

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  
2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 08 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

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

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>7</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	11
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	12
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>12</b>
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>37</b>
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
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	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	50

7.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	50
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	50
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	50
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	50
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50
7.12	市场中性策略执行情况	50
7.13	投资组合报告附注	51
<b>§ 8</b>	<b>基金份额持有人信息</b>	<b>52</b>
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	52
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	52
8.4	发起式基金发起资金持有份额情况	52
<b>§ 9</b>	<b>开放式基金份额变动</b>	<b>52</b>
<b>§ 10</b>	<b>重大事件揭示</b>	<b>53</b>
10.1	基金份额持有人大会决议	53
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	53
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	53
10.4	基金投资策略的改变	53
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	53
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	53
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	53
10.8	其他重大事件	58
<b>§ 11</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息</b>	<b>59</b>
11.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	59
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	59
<b>§ 12</b>	<b>备查文件目录</b>	<b>60</b>
12.1	备查文件目录	60
12.2	存放地点	60
12.3	查阅方式	60

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金
基金简称	华泰柏瑞量化绝对收益混合
基金主代码	001073
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 6 月 29 日
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	51,807,001.48 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	利用定量投资模型，灵活应用多种策略对冲投资组合的市场风险，谋求投资组合资产的长期增值。
投资策略	在力求有效控制投资风险的前提下，通过全市场选股构建预期收益高于市场回报的投资组合，同时利用股指期货等多种策略对冲投资组合的市场风险，以求获得不依赖市场整体走向的比较稳定的长期资产增值。
业绩比较基准	三个月银行定期存款税后收益率
风险收益特征	本基金为特殊的混合型基金，通过采用量化对冲策略剥离市场系统性风险，因此相对股票型基金和一般的混合型基金，其预期风险较小。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

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

### 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

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

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-1,350,274.90
本期利润	-1,189,902.95
加权平均基金份额本期利润	-0.0320
本期加权平均净值利润率	-3.24%
本期基金份额净值增长率	-3.29%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-1,303,661.02
期末可供分配基金份额利润	-0.0252
期末基金资产净值	50,503,340.46
期末基金份额净值	0.9748
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	19.35%

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

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.70%	0.24%	0.09%	0.00%	-0.79%	0.24%
过去三个月	-1.87%	0.25%	0.28%	0.00%	-2.15%	0.25%
过去六个月	-3.29%	0.29%	0.56%	0.00%	-3.85%	0.29%
过去一年	-4.89%	0.24%	1.12%	0.00%	-6.01%	0.24%
过去三年	-1.72%	0.27%	3.35%	0.00%	-5.07%	0.27%

自基金合同生效起至今	19.35%	0.26%	10.17%	0.00%	9.18%	0.26%
------------	--------	-------	--------	-------	-------	-------

### 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

华泰柏瑞量化绝对收益混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：图示日期为 2015 年 6 月 29 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	2015 年 6 月 29 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

					<p>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。</p>
盛豪	量化与海外投资部总监、本基金的基金经理	2021 年 9 月 17 日	-	16 年	<p>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</p>

				<p>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。</p>
--	--	--	--	---

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

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

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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《证券投资基金管理人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

A 股市场在上半年整体波动加大。市场在年初先是经历了由小微盘带来的较大幅度波动，随之在宏观数据和放松政策支撑下逐步上行，但至年中又在企业盈利预期下修后开始回落。本报告期在增量资金偏好下，大盘风格、红利风格及龙头股具有显著的超额收益，大盘价值和小盘成长的风格收益裂口急剧扩大。本报告期，上证 50 和沪深 300 分别上涨 2.95% 和 0.89%，而中证 2000、中证 1000、科创 50 则分别下跌 23.28%、16.84% 和 16.42%。行业之间涨跌分化较大，上涨行业数量较少，银行、煤炭、公用事业上涨 10% 以上，综合、计算机、商贸零售、社会服务、传媒、医药、地产下跌 20% 以上。经历了年初的尾部风险集中释放，1、2 月份股指期货市场基差波动巨大，基差经历了非理性的大幅贴水之后，在 3 月后情绪回暖后贴水迅速收窄，重归理性区间。

本报告期内，本基金继续采用完全对冲策略。多头端通过量化选股模型构建跟踪中证 500 指数的增强股票组合，同时利用中证 500 股指期货合约（IC）进行对冲，以获得绝对收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.9748 元，本报告期基金份额净值增长率为-3.29%，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

展望未来几个季度，从投资逻辑角度，国九条推出后，市场炒小炒烂的心态受到压制，投资人势必更加关注公司盈利、公司质地等基本面的信息，市场主流认知将与基本面量化的投资逻辑趋向一致，在投资环境上有利于基本面量化。从投资分散化的角度上，资金抱团权重股的概率非常小，分散化投资且覆盖度广的量化选股更有选股优势。从风格回归的角度来看，估值因子近几年来长期受到压制，近两年开始有好的表现，预计这一好转进程仍将持续；成长因子一直表现稳健上升，在三季度的中报披露季预期成长因子将走强，未来均衡配置风格还将持续取得更稳定的收益。

量化策略方面，基于当前市场环境的变化，我们将采用以基本面为主的量化选股模型。从基本面因子表现来看，华泰柏瑞量化团队的质量因子近期表现较好，我们预期其趋势仍将延续，而我们的成长因子预期会继续表现良好；政策面和“退市风波”的扰动减弱后，市场主线正逐渐回归到股票的基本面上；同时，小微盘拥挤的风险得到释放之后，大小市值、各行业股票均有机会，量化投资全市场选股的优势将得以更好体现。

在组合管理方面，本基金还是坚持利用完全对冲的量化策略，在坚持控制投资风险的前提下，力求继续获得稳定的绝对收益。

#### 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，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 25%。本报告期内，本基金未进行利润分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

截止本报告期末，因赎回等原因，本基金自 2023 年 6 月 12 日至 2024 年 6 月 20 日存在连续

60 个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形，但无基金份额持有人数量低于 200 人的情形。

已于 2023 年 9 月 6 日将《华泰柏瑞基金管理有限公司关于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基金资产净值低于五千万元情况的报告》上报上海证监局。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

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

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金

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
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	15,116,082.85	11,510,727.69
结算备付金		7,830,536.55	3,788,758.42
存出保证金		1,304,945.91	2,358,860.60
交易性金融资产	6.4.7.2	11,635,621.56	19,496,557.00
其中：股票投资		11,635,621.56	19,496,557.00
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	15,005,708.22	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		50,892,895.09	37,154,903.71
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年6月30日</b>	<b>上年度末 2023年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		39,338.94	37,784.70
应付托管费		6,556.49	6,297.47
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	10,935.99
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	343,659.20	304,191.26
负债合计		389,554.63	359,209.42
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	51,807,001.48	36,503,853.02
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-1,303,661.02	291,841.27
净资产合计		50,503,340.46	36,795,694.29
负债和净资产总计		50,892,895.09	37,154,903.71

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.9748 元，基金份额总额 51,807,001.48 份。

## 6.2 利润表

会计主体：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

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
<b>一、营业总收入</b>		-866,983.01	4,505,725.32
1. 利息收入		96,273.44	81,768.65
其中：存款利息收入	6.4.7.13	89,257.54	81,768.65
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		7,015.90	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-1,123,688.03	-1,720,633.70
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-2,563,484.87	-2,895,393.90
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	9,243.87
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	1,243,754.75	553,167.13
股利收益	6.4.7.19	196,042.09	612,349.20
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	160,371.95	6,121,824.77
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	59.63	22,765.60
<b>减：二、营业总支出</b>		322,919.94	1,093,317.98
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	219,251.34	852,391.24
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	36,541.88	142,065.27
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-

其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		8,065.68	2,063.00
8. 其他费用	6.4.7.23	59,061.04	96,798.47
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,189,902.95	3,412,407.34
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,189,902.95	3,412,407.34
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-1,189,902.95	3,412,407.34

### 6.3 净资产变动表

会计主体：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

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	36,503,853.02	-	291,841.27	36,795,694.29
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	36,503,853.02	-	291,841.27	36,795,694.29
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	15,303,148.46	-	-1,595,502.29	13,707,646.17
（一）、综合收益总额	-	-	-1,189,902.95	-1,189,902.95
（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）	15,303,148.46	-	-405,599.34	14,897,549.12
其中：1. 基金申购款	15,728,600.56	-	-415,043.54	15,313,557.02
2. 基金赎回	-425,452.10	-	9,444.20	-416,007.90

回款				
(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	51,807,001.48	-	-1,303,661.02	50,503,340.46
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	127,469,518.12	-	6,147,306.47	133,616,824.59
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	127,469,518.12	-	6,147,306.47	133,616,824.59
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-86,350,956.18	-	-5,122,506.65	-91,473,462.83
(一)、综合收益总额	-	-	3,412,407.34	3,412,407.34
(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)	-86,350,956.18	-	-2,835,387.23	-89,186,343.41
其中：1. 基金申购款	520,281.29	-	9,176.11	529,457.40
2. 基金赎回款	-86,871,237.47	-	-2,844,563.34	-89,715,800.81
(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)	-	-	-5,699,526.76	-5,699,526.76

（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	41,118,561.94	-	1,024,799.82	42,143,361.76

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金(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[2015]42号《关于准予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《华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式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 496,894,780.21 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(2015)第 801 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《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基金合同》于 2015 年 6 月 29 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 496,952,339.78 份基金份额,其中认购资金利息折合 57,559.57 份基金份额。本基金的基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金为发起式基金。发起资金认购部分为 10,002,400.00 份基金份额,发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

根据《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基金合同》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招募说明书》的有关规定,本基金每三个月开放一次,每次开放期不超过 5 个工作日,每个开放期所在月份为基金合同生效日所在月份后续每三个日历月中最后一个日历月,每个开放期的首日为当月沪深 300 股指期货交割日前五个工作日的第一个工作日。本基金的首个封闭期为自基金合同生效日起至第一个开放期的首日(不含该日)之间的期间,之后的封闭期为每相邻两个开放期之间的期间。本基金在封闭期内不办理申

购与赎回业务。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《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(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、股指期货、权证、债券(国债、金融债、企业/公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产和现金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。本基金的投资组合比例为：本基金权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的价值的比例范围为 80%-120%，其中，权益类空头头寸的价值是指融券卖出的股票及存托凭证市值、卖出股指期货的合约价值及卖出其他权益类衍生工具的合约价值的合计值；权益类多头头寸的价值是指买入持有的股票及存托凭证市值、买入股指期货的合约价值及买入其他权益类衍生工具的合约价值的合计值。开放期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；封闭期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%。开放期内，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制。本基金的业绩比较基准为：三个月银行定期存款税后收益率。

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

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式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[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	15,116,082.85
等于：本金	15,114,465.93
加：应计利息	1,616.92
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	15,116,082.85

### 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	12,368,842.87	-	11,635,621.56	-733,221.31
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	12,368,842.87	-	11,635,621.56	-733,221.31

### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	-11,439,904.35	-	-	
其中：股指期货投资	-11,439,904.35	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	-11,439,904.35	-	-	

#### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2407	中证500股指期货2407	-11.00	-10,818,720.00	621,184.35
合计				621,184.35
减：可抵销期货暂收款				621,184.35

净额					0.00
----	--	--	--	--	------

**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**

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	15,005,708.22	-
银行间市场	-	-
合计	15,005,708.22	-

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

注：本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

**6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明**

注：无。
------

**6.4.7.5 债权投资**

**6.4.7.5.1 债权投资情况**

注：本基金本报告期末未持有债权投资。

**6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况**

注：本基金本报告期末未持有债权投资。

**6.4.7.6 其他债权投资**

**6.4.7.6.1 其他债权投资情况**

注：本基金本报告期末未持有其他债权投资。

**6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况**

注：本基金本报告期末未持有其他债权投资。

**6.4.7.7 其他权益工具投资**

**6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况**

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具。

**6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况**

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具。

#### 6.4.7.8 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	293,933.16
其中：交易所市场	293,933.16
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	49,726.04
合计	343,659.20

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	36,503,853.02	36,503,853.02
本期申购	15,728,600.56	15,728,600.56
本期赎回（以“-”号填列）	-425,452.10	-425,452.10
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	51,807,001.48	51,807,001.48

注：1. 申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

2. 根据《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基金合同》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招募说明书》的有关规定，本基金每三个月开放一次，每次开放期不超过 5 个工作日，每个开放期所在月份为基金合同生效日所在月份后续每三个日历月中最后一个日历月，每个开放期的首日为当月沪深 300 股指期货交割日前五个工作日的第一个工作日。本基金的首个封闭期为自基金合同生效日起至第一个开放期的首日（不含该日）之间的期间，之后的封闭期为每相邻两个开放期之间的期间。本基金在封闭期内不办理申购与赎回业务。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期末无其他综合收益。

#### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,727,833.39	-2,435,992.12	291,841.27
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	2,727,833.39	-2,435,992.12	291,841.27
本期利润	-1,350,274.90	160,371.95	-1,189,902.95
本期基金份额交易产生的变动数	711,502.12	-1,117,101.46	-405,599.34
其中：基金申购款	725,816.35	-1,140,859.89	-415,043.54
基金赎回款	-14,314.23	23,758.43	9,444.20
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,089,060.61	-3,392,721.63	-1,303,661.02

#### 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	11,416.97
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	77,777.56
其他	63.01
合计	89,257.54

#### 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	-2,563,484.87
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	-2,563,484.87

##### 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	167,454,893.49
减：卖出股票成本总额	169,606,725.24
减：交易费用	411,653.12
买卖股票差价收入	-2,563,484.87

#### 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
	2024年1月1日至2024年6月30日
股指期货投资收益	1,243,754.75

**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	196,042.09
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	196,042.09

**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	-338,772.40
股票投资	-338,772.40
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	499,144.35
权证投资	-
期货投资	499,144.35
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	160,371.95

#### 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	12.09
基金转换费收入	47.54
合计	59.63

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	24,863.02
信息披露费	24,863.02
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	335.00
合计	59,061.04

#### 6.4.7.24 分部报告

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

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

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股票交易。

###### 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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均不存在向关联方支付佣金的情况。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	219,251.34	852,391.24
其中：应支付销售机构的客户维护 费	-	80,688.51

应支付基金管理人的净管理费	219,251.34	771,702.73
---------------	------------	------------

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	36,541.88	142,065.27

注：自 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 8 月 25 日，支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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

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建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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

#### 6.4.10.3 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	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
基金合同生效日（2015 年 6 月 29 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	18,752,966.66	18,752,966.66
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	18,752,966.66	18,752,966.66
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	36.1978%	45.6071%

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		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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	15,116,082.85	11,416.97	2,913,311.75	22,893.12

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

### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期					
2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
-	-	-	-	-	-
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	603291.SH	联合水务	网下申购	536	3,140.96
华泰联合证券	600925.SH	苏能股份	网下申购	8,960	55,372.80
华泰联合证券	601916.SH	浙商银行	网上配股	14,970	30,239.40
华泰联合证券	118031.SH	天 23 转债	网上配售	160	16,000.00

#### 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

注：本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300630	普利制药	2024 年 5 月 6 日	重大事项停牌	12.35	2024 年 07 月 08 日	9.88	1,200	17,380.00	14,820.00	-

注：本基金截至 2024 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

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

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

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

#### 6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国建设银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发

行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2024 年 6 月 30 日，本基金无债券投资(2023 年 12 月 31 日：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于约定开放日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于开放期内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约约定到期日均为一个月以内且不计息，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》且于基金开放期内按照《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。

于开放期内，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	15,116,082.85	-	-	-	-	-	15,116,082.85
结算备付金	7,830,536.55	-	-	-	-	-	7,830,536.55
存出保证金	1,304,945.91	-	-	-	-	-	1,304,945.91
交易性金融资产	-	-	-	-	-	11,635,621.56	11,635,621.56
买入返售金融资产	15,005,708.22	-	-	-	-	-	15,005,708.22
资产总计	39,257,273.53	-	-	-	-	11,635,621.56	50,892,895.09
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	39,338.94	39,338.94

应付托管费	-	-	-	-	-	6,556.49	6,556.49
其他负债	-	-	-	-	-	343,659.20	343,659.20
负债总计	-	-	-	-	-	389,554.63	389,554.63
利率敏感度缺口	39,257,273.53	-	-	-	-	-11,246,066.93	50,503,340.46
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	11,510,727.69	-	-	-	-	-	11,510,727.69
结算备付金	3,788,758.42	-	-	-	-	-	3,788,758.42
存出保证金	10,163.00	-	-	-	-	2,348,697.60	2,358,860.60
交易性金融资产	-	-	-	-	-	19,496,557.00	19,496,557.00
资产总计	15,309,649.11	-	-	-	-	21,845,254.60	37,154,903.71
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	37,784.70	37,784.70
应付托管费	-	-	-	-	-	6,297.47	6,297.47
应交税费	-	-	-	-	-	10,935.99	10,935.99
其他负债	-	-	-	-	-	304,191.26	304,191.26
负债总计	-	-	-	-	-	359,209.42	359,209.42
利率敏感度缺口	15,309,649.11	-	-	-	-	-21,486,045.18	36,795,694.29

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：同），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	11,635,621.56	23.04	19,496,557.00	52.99
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	11,635,621.56	23.04	19,496,557.00	52.99

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除三个月银行定期存款收益率(税后)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）
	三个月银行定期存款收益率(税后)上升5%	216,209.42	-23,179.32
	三个月银行定期存款收益率(税后)下降5%	-216,209.42	23,179.32

#### 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	11,620,801.56	19,472,687.00
第二层次	14,820.00	23,870.00
第三层次	-	-
合计	11,635,621.56	19,496,557.00

##### 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的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	11,635,621.56	22.86
	其中：股票	11,635,621.56	22.86
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	15,005,708.22	29.48
	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	22,946,619.40	45.09
8	其他各项资产	1,304,945.91	2.56
9	合计	50,892,895.09	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	75,467.00	0.15
B	采矿业	655,849.00	1.30
C	制造业	6,385,080.40	12.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	547,767.00	1.08
E	建筑业	234,000.00	0.46
F	批发和零售业	219,159.96	0.43
G	交通运输、仓储和邮政业	615,575.00	1.22
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,119,252.80	2.22
J	金融业	1,324,334.40	2.62
K	房地产业	112,851.00	0.22
L	租赁和商务服务业	180,383.00	0.36
M	科学研究和技术服务业	28,008.00	0.06
N	水利、环境和公共设施管理业	27,772.00	0.05
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	28,499.00	0.06
R	文化、体育和娱乐业	81,623.00	0.16
S	综合	-	-
	合计	11,635,621.56	23.04

### 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	600050	中国联通	71,000	333,700.00	0.66
2	300502	新易盛	2,300	242,765.00	0.48
3	000009	中国宝安	13,200	113,520.00	0.22
4	300763	锦浪科技	2,700	112,428.00	0.22
5	601800	中国交建	11,300	101,022.00	0.20
6	600559	老白干酒	5,300	96,354.00	0.19
7	601988	中国银行	20,000	92,400.00	0.18
8	600000	浦发银行	11,100	91,353.00	0.18
9	601608	中信重工	23,300	88,773.00	0.18
10	600547	山东黄金	3,200	87,616.00	0.17
11	600707	彩虹股份	12,800	87,168.00	0.17
12	601816	京沪高铁	15,300	82,161.00	0.16
13	000166	申万宏源	18,900	81,459.00	0.16
14	001286	陕西能源	7,000	80,710.00	0.16
15	601279	英利汽车	21,500	80,195.00	0.16
16	600582	天地科技	11,500	79,235.00	0.16
17	600517	国网英大	18,200	78,806.00	0.16
18	000563	陕国投 A	27,500	75,625.00	0.15
19	002498	汉缆股份	22,400	73,696.00	0.15
20	601766	中国中车	9,600	72,096.00	0.14
21	601958	金钼股份	6,900	71,829.00	0.14
22	001213	中铁特货	18,000	71,100.00	0.14
23	688578	艾力斯	1,100	70,114.00	0.14
24	002065	东华软件	15,500	70,060.00	0.14
25	601598	中国外运	12,400	69,812.00	0.14
26	603993	洛阳钼业	8,200	69,700.00	0.14
27	002204	大连重工	16,300	69,601.00	0.14
28	600497	驰宏锌锗	13,000	69,420.00	0.14
29	601989	中国重工	14,000	69,020.00	0.14
30	601216	君正集团	18,400	67,896.00	0.13
31	688568	中科星图	1,400	66,780.00	0.13
32	600598	北大荒	5,300	66,197.00	0.13
33	600018	上港集团	11,400	65,892.00	0.13
34	600776	东方通信	6,300	61,929.00	0.12
35	000883	湖北能源	10,200	61,302.00	0.12
36	601398	工商银行	10,600	60,420.00	0.12
37	300142	沃森生物	5,300	60,314.00	0.12

38	600906	财达证券	10,500	60,165.00	0.12
39	300134	大富科技	8,800	60,016.00	0.12
40	002945	华林证券	6,000	59,880.00	0.12
41	000559	万向钱潮	13,400	59,764.00	0.12
42	000039	中集集团	6,400	59,264.00	0.12
43	601991	大唐发电	19,500	58,695.00	0.12
44	601228	广州港	19,000	57,950.00	0.11
45	002185	华天科技	7,100	57,865.00	0.11
46	601326	秦港股份	18,100	57,377.00	0.11
47	601375	中原证券	16,700	56,947.00	0.11
48	000927	中国铁物	23,500	55,930.00	0.11
49	600019	宝钢股份	8,400	55,860.00	0.11
50	601990	南京证券	7,100	54,528.00	0.11
51	600874	创业环保	9,700	54,223.00	0.11
52	600877	电科芯片	5,000	53,600.00	0.11
53	600038	中直股份	1,300	53,443.00	0.11
54	603985	恒润股份	4,400	52,360.00	0.10
55	002421	达实智能	22,400	52,192.00	0.10
56	601128	常熟银行	6,840	51,778.80	0.10
57	300077	国民技术	5,900	51,507.00	0.10
58	002195	岩山科技	20,500	51,455.00	0.10
59	600812	华北制药	12,400	51,088.00	0.10
60	600312	平高电气	2,600	50,570.00	0.10
61	300618	寒锐钴业	1,900	50,255.00	0.10
62	688425	铁建重工	13,600	50,048.00	0.10
63	000878	云南铜业	4,000	49,840.00	0.10
64	000725	京东方 A	11,800	48,262.00	0.10
65	688278	特宝生物	900	48,195.00	0.10
66	600362	江西铜业	2,000	47,360.00	0.09
66	600489	中金黄金	3,200	47,360.00	0.09
67	605333	沪光股份	1,700	47,345.00	0.09
68	300832	新产业	700	47,208.00	0.09
69	002190	成飞集成	3,300	46,596.00	0.09
70	002601	龙佰集团	2,500	46,425.00	0.09
71	600126	杭钢股份	11,100	45,621.00	0.09
72	601567	三星医疗	1,300	45,500.00	0.09
73	600888	新疆众和	6,400	45,248.00	0.09
74	603013	亚普股份	3,300	44,451.00	0.09
75	000517	荣安地产	16,300	43,684.00	0.09
76	603466	风语筑	5,100	43,554.00	0.09
77	002078	太阳纸业	3,100	43,245.00	0.09
78	600848	上海临港	4,700	42,817.00	0.08
79	002226	江南化工	9,500	42,560.00	0.08

80	000557	西部创业	11,200	42,112.00	0.08
81	600008	首创环保	15,700	42,076.00	0.08
82	000935	四川双马	3,500	42,035.00	0.08
83	600926	杭州银行	3,200	41,760.00	0.08
84	300866	安克创新	580	41,301.80	0.08
85	000758	中色股份	8,100	41,148.00	0.08
86	002697	红旗连锁	8,800	40,744.00	0.08
87	600392	盛和资源	4,700	40,514.00	0.08
88	600618	氯碱化工	4,600	40,388.00	0.08
89	603806	福斯特	2,740	40,278.00	0.08
90	300379	东方通	4,900	39,592.00	0.08
91	300119	瑞普生物	2,900	39,498.00	0.08
92	002249	大洋电机	8,300	39,259.00	0.08
93	002287	奇正藏药	2,000	39,160.00	0.08
94	000598	兴蓉环境	5,200	39,104.00	0.08
95	002239	奥特佳	16,900	38,870.00	0.08
96	002245	蔚蓝锂芯	5,000	38,750.00	0.08
97	600335	国机汽车	6,700	38,659.00	0.08
98	600959	江苏有线	14,600	38,544.00	0.08
99	601519	大智慧	6,900	38,364.00	0.08
100	002326	永太科技	4,900	38,318.00	0.08
101	600704	物产中大	8,700	37,758.00	0.07
102	002467	二六三	11,200	37,408.00	0.07
103	600928	西安银行	11,400	37,278.00	0.07
104	601857	中国石油	3,600	37,152.00	0.07
105	000058	深赛格	6,900	37,053.00	0.07
106	600096	云天化	1,900	36,898.00	0.07
107	600662	外服控股	9,200	36,892.00	0.07
108	600282	南钢股份	7,400	36,852.00	0.07
109	300775	三角防务	1,200	36,720.00	0.07
110	300002	神州泰岳	4,500	36,540.00	0.07
111	300207	欣旺达	2,400	36,408.00	0.07
112	300821	东岳硅材	5,300	36,252.00	0.07
113	002265	建设工业	4,200	36,246.00	0.07
114	688128	中国电研	2,100	36,141.00	0.07
115	600055	万东医疗	2,900	35,815.00	0.07
116	300693	盛弘股份	1,700	35,598.00	0.07
117	600369	西南证券	9,900	35,442.00	0.07
118	000761	本钢板材	14,000	35,140.00	0.07
119	600320	振华重工	10,200	34,884.00	0.07
120	300677	英科医疗	1,300	34,853.00	0.07
121	600998	九州通	7,067	34,486.96	0.07
122	600667	太极实业	6,000	34,260.00	0.07

123	001236	弘业期货	4,800	34,128.00	0.07
124	601236	红塔证券	5,300	34,026.00	0.07
125	688798	艾为电子	600	33,972.00	0.07
126	601399	国机重装	13,100	33,798.00	0.07
127	002705	新宝股份	2,400	33,768.00	0.07
128	600183	生益科技	1,600	33,696.00	0.07
129	000597	东北制药	8,700	33,669.00	0.07
130	300122	智飞生物	1,200	33,636.00	0.07
131	300432	富临精工	5,200	33,488.00	0.07
132	002152	广电运通	3,200	33,472.00	0.07
133	600871	石化油服	19,200	33,408.00	0.07
134	601615	明阳智能	3,500	33,040.00	0.07
135	000157	中联重科	4,300	33,024.00	0.07
136	600989	宝丰能源	1,900	32,927.00	0.07
137	601636	旗滨集团	5,100	32,895.00	0.07
138	601600	中国铝业	4,300	32,809.00	0.06
139	600787	中储股份	6,800	32,708.00	0.06
140	300724	捷佳伟创	600	32,406.00	0.06
141	600027	华电国际	4,600	31,924.00	0.06
142	600929	雪天盐业	6,000	31,800.00	0.06
143	601696	中银证券	3,500	31,780.00	0.06
144	300017	网宿科技	4,000	31,600.00	0.06
145	300327	中颖电子	1,600	31,488.00	0.06
146	600361	创新新材	7,800	31,434.00	0.06
147	600273	嘉化能源	4,400	31,416.00	0.06
148	300233	金城医药	2,100	31,332.00	0.06
149	601717	郑煤机	2,100	31,080.00	0.06
150	000960	锡业股份	2,000	30,980.00	0.06
151	601058	赛轮轮胎	2,200	30,800.00	0.06
152	601611	中国核建	3,800	30,742.00	0.06
153	002850	科达利	400	30,552.00	0.06
154	300741	华宝股份	2,000	30,480.00	0.06
155	002683	广东宏大	1,500	30,195.00	0.06
156	600219	南山铝业	7,900	30,099.00	0.06
157	300170	汉得信息	4,900	30,086.00	0.06
158	600717	天津港	7,000	29,890.00	0.06
159	000848	承德露露	3,800	29,868.00	0.06
160	600699	均胜电子	2,000	29,640.00	0.06
161	002128	电投能源	1,400	29,540.00	0.06
162	600577	精达股份	7,400	29,378.00	0.06
163	601728	中国电信	4,600	28,290.00	0.06
164	688234	天岳先进	600	28,152.00	0.06
165	600968	海油发展	6,800	28,016.00	0.06

166	300676	华大基因	800	28,008.00	0.06
167	600177	雅戈尔	3,900	27,768.00	0.05
168	300113	顺网科技	2,700	27,648.00	0.05
169	603160	汇顶科技	400	27,500.00	0.05
170	600391	航发科技	1,800	27,450.00	0.05
171	600839	四川长虹	6,100	27,389.00	0.05
172	000729	燕京啤酒	3,100	27,373.00	0.05
173	601369	陕鼓动力	3,400	27,268.00	0.05
174	300352	北信源	7,100	27,264.00	0.05
175	600420	国药现代	2,500	26,700.00	0.05
176	600332	白云山	900	26,397.00	0.05
177	600185	格力地产	6,200	26,350.00	0.05
178	600864	哈投股份	5,500	26,125.00	0.05
179	600623	华谊集团	4,500	26,010.00	0.05
180	002465	海格通信	2,500	25,900.00	0.05
181	002292	奥飞娱乐	4,300	25,714.00	0.05
182	002267	陕天然气	3,400	25,704.00	0.05
183	002724	海洋王	5,700	25,365.00	0.05
184	600482	中国动力	1,300	25,324.00	0.05
185	600366	宁波韵升	4,800	25,056.00	0.05
186	601908	京运通	9,900	25,047.00	0.05
187	601333	广深铁路	7,600	24,624.00	0.05
188	600988	赤峰黄金	1,500	24,510.00	0.05
189	002625	光启技术	1,400	24,290.00	0.05
190	002268	电科网安	1,700	24,191.00	0.05
191	002434	万里扬	4,900	24,010.00	0.05
192	002064	华峰化学	3,300	23,661.00	0.05
193	300296	利亚德	5,100	22,950.00	0.05
194	002516	旷达科技	6,300	22,932.00	0.05
195	000425	徐工机械	3,200	22,880.00	0.05
196	000688	国城矿业	2,400	22,848.00	0.05
197	000061	农产品	4,700	22,842.00	0.05
198	603858	步长制药	1,500	22,725.00	0.04
199	300166	东方国信	3,700	22,644.00	0.04
200	688777	中控技术	600	22,620.00	0.04
201	000650	仁和药业	3,700	21,830.00	0.04
202	688739	成大生物	900	21,816.00	0.04
203	600248	陕建股份	6,000	21,780.00	0.04
204	600552	凯盛科技	2,300	21,689.00	0.04
205	000966	长源电力	4,900	21,609.00	0.04
206	605499	东鹏饮料	100	21,575.00	0.04
207	000727	冠捷科技	10,400	21,424.00	0.04
208	600845	宝信软件	660	21,073.80	0.04

209	000988	华工科技	700	20,951.00	0.04
210	601009	南京银行	2,000	20,780.00	0.04
211	600905	三峡能源	4,700	20,492.00	0.04
212	600125	铁龙物流	3,400	20,298.00	0.04
213	603026	胜华新材	600	20,280.00	0.04
214	002410	广联达	2,100	20,118.00	0.04
215	603027	千禾味业	1,500	19,950.00	0.04
216	000818	航锦科技	900	19,872.00	0.04
217	003009	中天火箭	500	19,340.00	0.04
218	601006	大秦铁路	2,700	19,332.00	0.04
219	601198	东兴证券	2,400	19,104.00	0.04
220	300446	航天智造	1,600	19,040.00	0.04
221	600566	济川药业	600	19,026.00	0.04
222	000800	一汽解放	2,400	18,792.00	0.04
223	000813	德展健康	9,000	18,720.00	0.04
224	002681	奋达科技	5,100	18,615.00	0.04
225	300015	爱尔眼科	1,800	18,576.00	0.04
226	002291	遥望科技	4,300	18,490.00	0.04
227	300080	易成新能	6,400	18,432.00	0.04
228	688036	传音控股	240	18,369.60	0.04
229	600011	华能国际	1,900	18,278.00	0.04
230	603799	华友钴业	800	17,704.00	0.04
231	600651	飞乐音响	6,300	17,388.00	0.03
232	601015	陕西黑猫	6,200	17,360.00	0.03
233	300303	聚飞光电	3,500	17,010.00	0.03
234	000958	电投产融	4,600	16,836.00	0.03
235	002768	国恩股份	900	16,830.00	0.03
236	002183	怡亚通	5,900	16,756.00	0.03
237	601568	北元集团	4,500	16,695.00	0.03
238	688017	绿的谐波	200	16,420.00	0.03
239	300999	金龙鱼	600	16,410.00	0.03
240	002274	华昌化工	2,200	16,324.00	0.03
241	300409	道氏技术	1,900	16,264.00	0.03
242	601016	节能风电	5,400	16,146.00	0.03
243	002939	长城证券	2,400	16,080.00	0.03
244	600120	浙江东方	4,800	16,032.00	0.03
245	002320	海峡股份	3,100	15,996.00	0.03
246	000651	格力电器	400	15,688.00	0.03
247	300919	中伟股份	500	15,495.00	0.03
248	603195	公牛集团	200	15,424.00	0.03
249	002472	双环传动	700	15,414.00	0.03
250	600916	中国黄金	1,600	15,392.00	0.03
251	601139	深圳燃气	2,300	15,364.00	0.03

252	600737	中粮糖业	1,600	15,344.00	0.03
253	600757	长江传媒	1,900	15,314.00	0.03
254	300183	东软载波	1,300	15,054.00	0.03
255	002032	苏泊尔	300	15,030.00	0.03
256	000990	诚志股份	2,000	14,880.00	0.03
257	300630	普利制药	1,200	14,820.00	0.03
258	300382	斯莱克	2,500	14,775.00	0.03
259	601966	玲珑轮胎	800	14,696.00	0.03
260	002340	格林美	2,300	14,651.00	0.03
261	600176	中国巨石	1,300	14,365.00	0.03
262	002549	凯美特气	2,800	14,308.00	0.03
263	300253	卫宁健康	2,400	14,160.00	0.03
264	000963	华东医药	500	13,905.00	0.03
265	301071	力量钻石	500	13,855.00	0.03
266	600556	天下秀	3,800	13,832.00	0.03
267	002174	游族网络	1,800	13,662.00	0.03
268	600188	兖矿能源	600	13,638.00	0.03
269	600601	XR*ST 方	4,500	13,500.00	0.03
270	002537	海联金汇	2,600	13,442.00	0.03
271	002585	双星新材	2,700	13,392.00	0.03
272	002739	万达电影	1,100	13,299.00	0.03
273	000552	甘肃能化	3,800	13,186.00	0.03
274	600771	广誉远	700	13,181.00	0.03
275	002867	周大生	1,000	13,060.00	0.03
276	000338	潍柴动力	800	12,992.00	0.03
277	688172	燕东微	800	12,944.00	0.03
278	600886	国投电力	700	12,768.00	0.03
279	601668	中国建筑	2,400	12,744.00	0.03
280	688177	百奥泰	600	12,672.00	0.03
281	002191	劲嘉股份	3,500	12,635.00	0.03
282	600037	歌华有线	2,100	12,558.00	0.02
283	601212	白银有色	4,500	12,510.00	0.02
284	002517	恺英网络	1,300	12,415.00	0.02
285	002488	金固股份	2,800	12,292.00	0.02
286	000657	中钨高新	1,300	11,882.00	0.02
287	601319	中国人保	2,300	11,845.00	0.02
288	601068	中铝国际	2,800	11,788.00	0.02
289	002838	道恩股份	1,300	11,778.00	0.02
290	002468	申通快递	1,400	11,760.00	0.02
291	002866	传艺科技	900	11,583.00	0.02
292	000567	海德股份	2,060	11,556.60	0.02
293	601969	海南矿业	1,800	11,412.00	0.02
294	002043	兔宝宝	1,100	11,407.00	0.02

295	300088	长信科技	2,400	11,280.00	0.02
296	601231	环旭电子	700	11,235.00	0.02
297	000301	东方盛虹	1,400	11,158.00	0.02
298	000825	太钢不锈	3,300	11,154.00	0.02
299	600999	招商证券	800	11,128.00	0.02
300	300456	赛微电子	700	11,109.00	0.02
301	300158	振东制药	2,900	11,078.00	0.02
302	600032	浙江新能	1,500	10,920.00	0.02
303	601229	上海银行	1,500	10,890.00	0.02
304	600850	电科数字	600	10,860.00	0.02
304	601881	中国银河	1,000	10,860.00	0.02
305	600075	新疆天业	3,100	10,695.00	0.02
306	601390	中国中铁	1,600	10,432.00	0.02
307	002108	沧州明珠	3,400	10,404.00	0.02
308	000821	京山轻机	900	10,197.00	0.02
309	600535	天士力	800	10,064.00	0.02
310	601555	东吴证券	1,700	10,030.00	0.02
311	002176	江特电机	1,200	9,780.00	0.02
312	600575	淮河能源	2,500	9,725.00	0.02
313	688779	长远锂科	2,100	9,723.00	0.02
314	600645	中源协和	600	9,660.00	0.02
315	002446	盛路通信	1,700	9,605.00	0.02
316	000050	深天马 A	1,300	9,464.00	0.02
317	601949	中国出版	1,600	9,456.00	0.02
318	603556	海兴电力	200	9,366.00	0.02
319	300087	荃银高科	1,500	9,270.00	0.02
320	601360	三六零	1,200	9,216.00	0.02
321	002266	浙富控股	3,300	9,207.00	0.02
322	000795	英洛华	1,600	8,864.00	0.02
323	000156	华数传媒	1,400	8,792.00	0.02
324	002126	银轮股份	500	8,705.00	0.02
325	600478	科力远	2,300	8,671.00	0.02
326	002773	康弘药业	400	8,660.00	0.02
327	002460	赣锋锂业	300	8,595.00	0.02
328	600167	联美控股	1,600	8,336.00	0.02
329	601106	中国一重	3,600	8,316.00	0.02
330	603300	华铁应急	1,500	8,190.00	0.02
331	002091	江苏国泰	1,200	8,172.00	0.02
332	002990	盛视科技	400	8,052.00	0.02
333	000967	盈峰环境	1,900	8,037.00	0.02
334	600720	祁连山	900	8,010.00	0.02
335	002581	未名医药	800	7,720.00	0.02
336	600276	恒瑞医药	200	7,692.00	0.02

337	600141	兴发集团	400	7,632.00	0.02
338	601877	正泰电器	400	7,624.00	0.02
339	600529	山东药玻	300	7,602.00	0.02
340	600596	新安股份	1,000	7,600.00	0.02
341	000750	国海证券	2,600	7,566.00	0.01
342	002151	北斗星通	300	7,254.00	0.01
343	002626	金达威	500	7,225.00	0.01
344	600642	申能股份	800	7,064.00	0.01
345	002252	上海莱士	900	7,038.00	0.01
346	688006	杭可科技	400	6,980.00	0.01
347	600416	湘电股份	700	6,958.00	0.01
348	600549	厦门钨业	400	6,900.00	0.01
349	600072	中船科技	500	6,760.00	0.01
350	001308	康冠科技	300	6,750.00	0.01
351	601328	交通银行	900	6,723.00	0.01
352	600118	中国卫星	300	6,669.00	0.01
353	600196	复星医药	300	6,642.00	0.01
354	600498	烽火通信	400	6,360.00	0.01
355	002891	中宠股份	300	6,261.00	0.01
356	600295	鄂尔多斯	600	5,952.00	0.01
357	002926	华西证券	900	5,931.00	0.01
358	600062	华润双鹤	300	5,874.00	0.01
359	601069	西部黄金	500	5,815.00	0.01
360	002617	露笑科技	1,200	5,760.00	0.01
361	002237	恒邦股份	500	5,755.00	0.01
362	601666	平煤股份	500	5,600.00	0.01
363	000930	中粮科技	1,100	5,533.00	0.01
364	600763	通策医疗	100	5,405.00	0.01
365	600595	中孚实业	2,100	5,229.00	0.01
366	603866	桃李面包	1,000	5,070.00	0.01
367	601377	兴业证券	1,000	5,060.00	0.01
368	300765	新诺威	200	5,046.00	0.01
369	300039	上海凯宝	900	4,815.00	0.01
370	600660	福耀玻璃	100	4,790.00	0.01
371	300143	盈康生命	600	4,518.00	0.01
372	601669	中国电建	800	4,472.00	0.01
373	600206	有研新材	500	4,450.00	0.01
374	002038	双鹭药业	600	4,422.00	0.01
375	603888	新华网	200	4,302.00	0.01
376	002573	清新环境	1,100	4,257.00	0.01
377	600739	辽宁成大	500	4,185.00	0.01
378	300257	开山股份	400	4,040.00	0.01
379	600760	中航沈飞	100	4,010.00	0.01

380	002649	博彦科技	500	3,980.00	0.01
381	603379	三美股份	100	3,914.00	0.01
382	000950	重药控股	800	3,896.00	0.01
383	603071	物产环能	300	3,759.00	0.01
384	601101	昊华能源	400	3,676.00	0.01
385	002911	佛燃能源	400	3,656.00	0.01
386	600315	上海家化	200	3,556.00	0.01
387	300601	康泰生物	200	3,122.00	0.01
388	002958	青农商行	1,100	2,948.00	0.01
389	600161	天坛生物	120	2,928.00	0.01
390	300058	蓝色光标	500	2,720.00	0.01
391	300596	利安隆	100	2,713.00	0.01
392	000025	特力 A	200	2,688.00	0.01
393	600098	广州发展	400	2,560.00	0.01
394	600986	浙文互联	600	2,520.00	0.00
395	003040	楚天龙	200	2,460.00	0.00
396	603939	益丰药房	100	2,455.00	0.00
397	600872	中炬高新	100	2,269.00	0.00
398	600761	安徽合力	100	2,164.00	0.00
399	603000	人民网	100	1,999.00	0.00
400	300861	美畅股份	100	1,935.00	0.00
401	002493	荣盛石化	200	1,932.00	0.00
402	002004	华邦健康	500	1,900.00	0.00
403	000828	东莞控股	200	1,802.00	0.00
404	002651	利君股份	300	1,647.00	0.00
405	600808	马钢股份	800	1,616.00	0.00
406	002120	韵达股份	200	1,548.00	0.00
407	000582	北部湾港	200	1,488.00	0.00
408	301316	慧博云通	100	1,468.00	0.00
409	002500	山西证券	300	1,410.00	0.00
410	603118	共进股份	200	1,340.00	0.00
411	000100	TCL 科技	300	1,296.00	0.00
412	000683	远兴能源	100	691.00	0.00
413	300459	汤姆猫	200	678.00	0.00
414	000728	国元证券	100	606.00	0.00
415	600797	浙大网新	100	463.00	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	300475	香农芯创	846,741.00	2.30
2	301236	软通动力	681,273.00	1.85

3	600050	中国联通	633,991.00	1.72
4	600873	梅花生物	587,498.00	1.60
5	600497	驰宏锌锗	584,369.00	1.59
6	600418	江淮汽车	574,796.00	1.56
7	603392	万泰生物	563,750.00	1.53
8	300212	易华录	557,133.00	1.51
9	000009	中国宝安	543,121.00	1.48
10	002498	汉缆股份	525,600.00	1.43
11	300782	卓胜微	524,181.00	1.42
12	300438	鹏辉能源	513,770.00	1.40
13	601988	中国银行	495,299.00	1.35
14	002174	游族网络	493,443.00	1.34
15	600988	赤峰黄金	488,939.00	1.33
16	300759	康龙化成	488,619.00	1.33
17	002192	融捷股份	474,500.00	1.29
18	300763	锦浪科技	461,732.00	1.25
19	603993	洛阳钼业	457,024.00	1.24
20	300122	智飞生物	448,307.00	1.22

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	300475	香农芯创	844,568.00	2.30
2	301236	软通动力	681,573.00	1.85
3	600873	梅花生物	613,462.00	1.67
4	603392	万泰生物	572,667.00	1.56
5	600418	江淮汽车	558,873.00	1.52
6	600497	驰宏锌锗	524,984.00	1.43
7	300212	易华录	520,249.00	1.41
8	300782	卓胜微	510,838.00	1.39
9	300438	鹏辉能源	507,139.00	1.38
10	600988	赤峰黄金	502,737.00	1.37
11	300759	康龙化成	486,891.00	1.32
12	002174	游族网络	463,700.00	1.26
13	002192	融捷股份	461,691.00	1.25
14	000988	华工科技	441,962.00	1.20
15	000032	深桑达 A	439,752.00	1.20
16	002498	汉缆股份	432,872.00	1.18
17	000683	远兴能源	430,566.00	1.17
18	600968	海油发展	428,682.00	1.17
19	002043	兔宝宝	424,902.00	1.15
20	601988	中国银行	419,720.00	1.14

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	162,084,562.20
卖出股票收入（成交）总额	167,454,893.49

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

多头端通过量化选股模型构建跟踪中证 500 指数的增强股票组合，同时利用中证 500 股指期货合约（IC）进行对冲，以获得绝对收益。

### 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 市场中性策略执行情况

截至本报告期末，本基金持有股票资产 11,635,621.56 元，占基金资产净值的比例为 23.04%；运用股指期货进行对冲的空头合约市值 10,818,720.00 元，占基金资产净值的比例为 21.42%，空头合约市值占股票资产的比例为 92.98%。本报告期内，本基金执行市场中性策略的投资收益为 -899,950.08 元，公允价值变动损益为 160,371.95 元。

### 7.13 投资组合报告附注

#### 7.13.1 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，中国银行（601988）在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。

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。

#### 7.13.2 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。

#### 7.13.3 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	1,304,945.91
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,304,945.91

#### 7.13.4 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。

#### 7.13.5 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。

#### 7.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
894	57,949.67	34,467,839.30	66.53	17,339,162.18	33.47

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	77,604.36	0.1498

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

### 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额 占基金总 份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占 基金总份额 比例(%)	发起份额承 诺持有期限
基金管理人固有资金	18,752,966.66	36.20	10,002,400.00	19.31	3年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	18,752,966.66	36.20	10,002,400.00	19.31	-

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2015 年 6 月 29 日) 基金份额总额	496,952,339.78
本报告期期初基金份额总额	36,503,853.02

本报告期基金总申购份额	15,728,600.56
减：本报告期基金总赎回份额	425,452.10
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	51,807,001.48

## § 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，陆桢女士不再担任公司独立董事。

上述人事变动已按相关规定备案、报告。

报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未改聘为其审计的会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：报告期内基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：报告期内基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	

			(%)		(%)	
方正证券	3	50,811,182.77	15.42	47,555.03	15.50	-
招商证券	4	42,219,473.19	12.81	39,934.18	13.02	-
粤开证券	1	37,566,464.20	11.40	35,158.78	11.46	-
国投证券	3	33,011,129.75	10.02	31,225.06	10.18	-
民生证券	4	26,280,239.80	7.97	24,596.44	8.02	-
天风证券	2	21,623,440.69	6.56	20,633.54	6.73	-
华宝证券	2	21,423,138.29	6.50	20,264.24	6.61	-
华西证券	1	16,501,477.02	5.01	15,609.23	5.09	-
中航证券	1	12,090,282.32	3.67	11,436.74	3.73	-
江海证券	2	10,544,441.50	3.20	9,973.90	3.25	-
中信建投	3	10,172,730.00	3.09	7,486.29	2.44	-
金元证券	2	9,140,548.00	2.77	8,554.62	2.79	-
国盛证券	2	7,932,213.00	2.41	5,837.48	1.90	-
东海证券	2	7,895,884.00	2.40	7,389.91	2.41	-
平安证券	2	5,283,768.64	1.60	4,997.74	1.63	-
中金财富证券	2	4,843,912.18	1.47	4,582.22	1.49	-
太平洋证券	2	4,455,390.25	1.35	4,214.32	1.37	-
南京证券	2	3,593,660.12	1.09	3,399.22	1.11	-
长江证券	2	2,605,355.00	0.79	2,464.32	0.80	-
中泰证券	2	1,544,724.97	0.47	1,461.15	0.48	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
财达证券	2	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东方财富证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-

东亚前海 证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	3	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
宏信证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	6	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
摩根大通 证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	2	-	-	-	-	-
世纪证券	2	-	-	-	-	-
首创证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
诚通证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	3	-	-	-	-	-
野村证券	1	-	-	-	-	-
银泰证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-

注：本报告期内：1、选择代理证券买卖的证券经营机构的标准：公司应选择财务状况良好，经营行为规范，具备研究实力的证券公司及专业研究机构，向其或其合作券商租用基金专用交易席位。公司选择的提供交易单元的券商应当满足下列基本条件：1) 具有相应的业务经营资格；2) 诚信记录良好，最近两年无重大违法违规行为，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(%)
方正证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	4,000,000.00	21.05	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	15,000,000.00	78.95	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中金财	-	-	-	-	-	-

富证券						
南京证 券	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-
爱建证 券	-	-	-	-	-	-
财达证 券	-	-	-	-	-	-
财通证 券	-	-	-	-	-	-
长城证 券	-	-	-	-	-	-
德邦证 券	-	-	-	-	-	-
东北证 券	-	-	-	-	-	-
东方财 富证券	-	-	-	-	-	-
东吴证 券	-	-	-	-	-	-
东亚前 海证券	-	-	-	-	-	-
东莞证 券	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
国元证 券	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
恒泰证 券	-	-	-	-	-	-
宏信证 券	-	-	-	-	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-
华福证 券	-	-	-	-	-	-
华金证 券	-	-	-	-	-	-
华泰证 券	-	-	-	-	-	-
开源证	-	-	-	-	-	-

券						
摩根大通证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
诚通证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
野村证券	-	-	-	-	-	-
银泰证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华泰柏瑞基金管理有限公司关于变更网上直销汇款交易业务的收款银行账户的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 06 月 25 日
2	华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金对冲策略执行情况公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 06 月 13 日
3	关于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第三十六个开放期开放申购赎回及转换业务的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 06 月 13 日
4	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
5	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对冲策略执行情况公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 03 月 07 日

6	关于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第三十五个开放期开放申购赎回及转换业务的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 03 月 02 日
7	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
8	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
9	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止北京中期时代基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 01 月 06 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20240101-20240630;	18,752,966.66	0.00	0.00	18,752,966.66	36.20
个人	1	20240101-20240620;	9,417,027.69	0.00	0.00	9,417,027.69	18.18

#### 产品特有风险

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

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

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

### 12.2 存放地点

上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

托管人住所

### 12.3 查阅方式

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

华泰柏瑞基金管理有限公司

2024 年 8 月 31 日