

# 华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金

## 2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1. 1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 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>	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	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	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>	6
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>	7
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遵规守信情况的说明	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	8
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	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	10
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	10
<b>§ 5 托管人报告</b>	10
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	10
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	10
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	10
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	11
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	12
6.3 净资产变动表	13
6.4 报表附注	15
<b>§ 7 投资组合报告</b>	37
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	37
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	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	43
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	43
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	43
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	43

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 .....	43
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	43
7.12 投资组合报告附注 .....	44
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>45</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	45
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	45
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 .....	45
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>45</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>45</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	45
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 .....	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	46
10.4 基金投资策略的改变 .....	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	46
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 .....	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	46
10.8 其他重大事件 .....	51
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>51</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 .....	51
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	51
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>52</b>
12.1 备查文件目录 .....	52
12.2 存放地点 .....	52
12.3 查阅方式 .....	52

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	华泰柏瑞消费成长混合
基金主代码	001069
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 5 月 20 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	105,334,225.66 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过深入研究，本基金投资于消费相关行业优质成长性公司，在有效控制风险的前提下，力争为投资者创造高于业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金采用“自上而下”和“自下而上”相结合方法来构建投资组合。通过定量和定性分析，对宏观经济、市场环境、行业估值等因素做深入系统研究，分析比较股票和债券预期收益率变化，优化股票和债券的投资比例从而确定大类资产配置。
业绩比较基准	申银万国消费品指数*80%+中证全债指数*20%
风险收益特征	本基金属于混合型基金，其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	华泰柏瑞基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘万方
	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	<a href="http://www.huatai-pb.com">http://www.huatai-pb.com</a>
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	-2,402,526.60
本期利润	7,981,399.08
加权平均基金份额本期利润	0.0742
本期加权平均净值利润率	5.08%
本期基金份额净值增长率	5.11%
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	52,779,524.60
期末可供分配基金份额利润	0.5011
期末基金资产净值	158,113,750.26
期末基金份额净值	1.501
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	50.10%

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

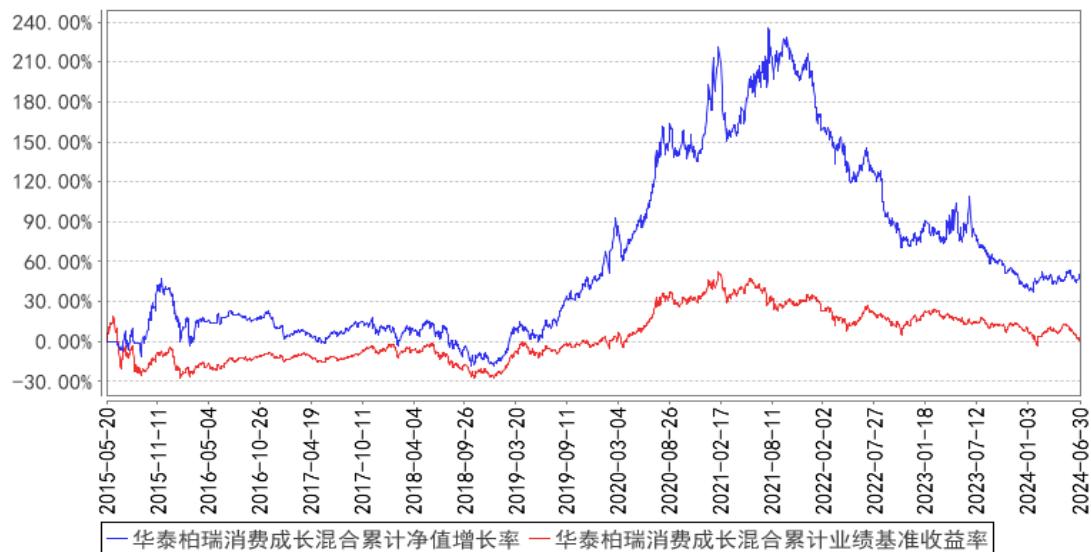
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-0.27%	0.79%	-6.66%	0.52%	6.39%	0.27%
过去三个月	4.45%	0.79%	-6.84%	0.72%	11.29%	0.07%
过去六个月	5.11%	0.88%	-8.72%	0.90%	13.83%	-0.02%

过去一年	-18.60%	0.87%	-11.63%	0.79%	-6.97%	0.08%
过去三年	-50.71%	1.56%	-29.15%	0.93%	-21.56%	0.63%
自基金合同生效起至今	50.10%	1.65%	0.90%	1.20%	49.20%	0.45%

### 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

华泰柏瑞消费成长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 5 月 20 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		
钱建江	本基金的基金经理	2022 年 11 月 16	-	8 年	华中科技大学系统工程专业硕士。曾任国元证券研究中心机械行业研究员、太平洋

	助理	日			证券研究院机械行业研究员。2021 年 6 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司。2022 年 6 月起任基金经理助理。
李晓西	副 总 经理、本基 金的基金 经理	2020 年 2 月 18 日	-	24 年	副总经理，美国杜克大学工商管理硕士。曾任中银信托投资公司外汇交易结算员，银建实业股份有限公司证券投资经理，汉唐证券有限责任公司高级经理，美国信安环球股票有限公司董事总经理兼基金经理。2018 年 7 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，2018 年 8 月起任公司副总经理，现任公司副总经理兼投资一部总监。2020 年 2 月至 2022 年 7 月任华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 2 月起任华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 3 月起任华泰柏瑞质量成长混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 1 月至 2022 年 9 月任华泰柏瑞质量领先混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月至 2024 年 2 月任华泰柏瑞质量精选混合型证券投资基金的基金经理。

注：证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。任职日期和离任日期指基金管理公司作出决定之日。李晓西 2024 年 7 月 11 日离任本基金基金经理。钱建江 2024 年 7 月 11 日离任本基金基金经理助理。

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

首先投资部和研究部通过规范的决策流程来确保公平对待不同投资组合。其次交易部对投资

指令的合规性、有效性及合理性进行独立审核，在交易过程中启用投资交易系统中的公平交易模块，确保公平交易的实施。同时，风险管理部对报告期内的交易进行日常监控和分析评估。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共有 3 次，都为指数投资组合因跟踪指数需要而发生的反向交易。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024 年上半年，股票市场有一定的波动和回落，行业和板块之间轮动较快。投资风格方面，上半年低波动和低估值高股息的股票总体表现较好，大幅跑赢高波动和高估值低股息的股票，大市值股票总体大幅跑赢小市值股票和微盘股，价值股总体跑赢成长股。行业方面，银行、公用事业、家电、交运、石油石化、通信、煤炭等行业上半年表现居前，超额收益明显；计算机、社服、轻工制造、传媒、商贸零售、医药生物等行业同期表现落后。

目前我国房地产行业还处于调整和改善之中，地产开发投资和销售数据有待进一步观察，宏观经济总体体现出了较好的韧性，处于复苏趋势之中。上半年市场投资者的整体风险偏好有所下降，经营业绩良好且现金流稳定的优质公司更受到市场的青睐。在此背景下，本基金更关注和布局业绩确定性强、现金流或分红稳定的公司，同时挖掘在本轮经济复苏以及经济转型过程中有望受益的高质量成长企业。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.501 元，本报告期基金份额净值增长率为 5.11%，业绩比较基准收益率为-8.72%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前我国经济正处于迈向高质量发展的重要转型期，一方面房地产及相关行业处于深度调整期，导致内需有所承压，而另一方面，以新能源汽车、光伏、半导体为代表的新兴技术产业快速进步和发展，产业竞争力持续提升。站在当前时点展望，我们认为经济的内生动能正在持续积累，随着国内政策空间逐步释放，经济基本面有望持续向上。

目前 A 股整体估值处于较低位置，具有较高的吸引力。在配置方面，主要看好以下几个方向：

1) 继续关注业绩确定性强、现金流或分红稳定的公司，在长期收益率下行背景下，这类公司估值

提升是大概率事件；2) 我们认为出海是我国制造业走到当前阶段的选择，凭借国内生产要素完备优势，我国制造业极具竞争优势，拓展海外市场可能大有可为；3) 关注人工智能等新技术迭代和落地，特别是革命性产品的推出往往能够带来丰厚的投资回报。本基金将从以上领域努力挑出优秀投资标的，力争实现业绩的可持续增长。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未进行利润分配。

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

无。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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

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

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	27,944,139.37	25,313,645.21
结算备付金		512,812.03	432,754.17
存出保证金		102,451.48	126,419.87
交易性金融资产	6.4.7.2	133,965,870.88	130,239,094.91
其中：股票投资		133,965,870.88	130,239,094.91
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		236,347.29	3,923,830.88
应收股利		—	—
应收申购款		23,922.97	49,374.46
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.8	—	—
资产总计		162,785,544.02	160,085,119.50
<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		3,942,199.64	866,222.35
应付赎回款		160,586.59	159,370.80

应付管理人报酬		153,435.03	163,546.00
应付托管费		25,572.51	27,257.68
应付销售服务费		-	-
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	389,999.99	433,519.45
负债合计		4,671,793.76	1,649,916.28
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	105,334,225.66	110,950,071.61
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	52,779,524.60	47,485,131.61
净资产合计		158,113,750.26	158,435,203.22
负债和净资产总计		162,785,544.02	160,085,119.50

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.501 元，基金份额总额 105,334,225.66 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业收入</b>		9,183,312.67	11,053,670.68
1. 利息收入		45,006.46	48,657.35
其中：存款利息收入	6.4.7.13	45,006.46	48,657.35
债券利息收入		-	-
资产支持证券利 息收入		-	-
买入返售金融资 产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以 “-”填列）		-1,259,489.73	5,718,282.89
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-4,144,684.69	4,250,401.75
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
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	-	-
股利收益	6. 4. 7. 19	2, 885, 194. 96	1, 467, 881. 14
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	10, 383, 925. 68	5, 203, 915. 28
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	6. 4. 7. 21	13, 870. 26	82, 815. 16
<b>减: 二、营业总支出</b>		1, 201, 913. 59	2, 014, 043. 87
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	938, 552. 60	1, 635, 009. 94
其中: 暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	156, 425. 41	272, 501. 63
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. 其他费用	6. 4. 7. 23	106, 935. 58	106, 532. 30
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		7, 981, 399. 08	9, 039, 626. 81
<b>减: 所得税费用</b>		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		7, 981, 399. 08	9, 039, 626. 81
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		7, 981, 399. 08	9, 039, 626. 81

### 6.3 净资产变动表

会计主体: 华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金

本报告期: 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期			
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	110, 950, 071. 61	-	47, 485, 131. 61	158, 435, 203. 22

加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	110,950,071.61	-	47,485,131.61	158,435,203.22
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-5,615,845.95	-	5,294,392.99	-321,452.96
(一)、综合收益总额	-	-	7,981,399.08	7,981,399.08
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	-5,615,845.95	-	-2,687,006.09	-8,302,852.04
其中：1.基金申购款	3,283,132.12	-	1,522,138.79	4,805,270.91
2.基金赎回款	-8,898,978.07	-	-4,209,144.88	-13,108,122.95
(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	105,334,225.66	-	52,779,524.60	158,113,750.26
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	118,497,558.43	-	91,164,423.86	209,661,982.29
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	118,497,558.43	-	91,164,423.86	209,661,982.29

资产				
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	76,402.67	-	8,918,828.72	8,995,231.39
(一)、综合收益总额	-	-	9,039,626.81	9,039,626.81
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	76,402.67	-	-120,798.09	-44,395.42
其中：1. 基金申购款	15,330,187.01	-	13,121,691.47	28,451,878.48
2. 基金赎回款	-15,253,784.34	-	-13,242,489.56	-28,496,273.90
(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	118,573,961.10	-	100,083,252.58	218,657,213.68

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

华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2014]579号《关于核准华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》和证券基金机构监管部部函[2015]371号《关于华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金延期募集备案的回函》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《华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金基金合

同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,548,732,917.36 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 491 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 5 月 20 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,549,036,076.82 份基金份额，其中认购资金利息折合 303,159.46 份基金份额。本基金的基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、债券、债券回购、银行存款、货币市场工具、权证、资产支持证券、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）。本基金持有的股票资产及存托凭证占基金资产的 0%-95%，投资于消费相关行业的证券资产不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金后，本基金保持不低于基金资产净值 5%的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在 1 年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为申银万国消费品指数 x 80%+中证全债指数 x 20%。

本财务报表由本基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于 2024 年 08 月 31 日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2024 年 06 月 30 日的财务状况以及 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日止期间的经营成果和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	27,944,139.37
等于： 本金	27,941,745.33
加： 应计利息	2,394.04
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	27,944,139.37

### 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	125,650,710.97	-	133,965,870.88	8,315,159.91
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	125,650,710.97	-	133,965,870.88	8,315,159.91

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末未持有期货合约。

#### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

注：无。

### 6.4.7.5 债权投资

#### 6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有债权投资。

#### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末未持有债权投资。

## 6.4.7.6 其他债权投资

### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他债权投资。

### 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末未持有其他债权投资。

## 6.4.7.7 其他权益工具投资

### 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具。

### 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具。

## 6.4.7.8 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

## 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	32.56
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	302,945.95
其中：交易所市场	302,945.95
银行间市场	—
应付利息	—
预提费用	87,021.48
合计	389,999.99

## 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	110,950,071.61	110,950,071.61
本期申购	3,283,132.12	3,283,132.12
本期赎回(以“-”号填列)	-8,898,978.07	-8,898,978.07
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	105,334,225.66	105,334,225.66

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期末及上年度末未有其他综合收益。

#### 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	60,377,675.32	-12,892,543.71	47,485,131.61
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	60,377,675.32	-12,892,543.71	47,485,131.61
本期利润	-2,402,526.60	10,383,925.68	7,981,399.08
本期基金份额交易产生的变动数	-2,718,216.30	31,210.21	-2,687,006.09
其中：基金申购款	1,616,484.19	-94,345.40	1,522,138.79
基金赎回款	-4,334,700.49	125,555.61	-4,209,144.88
本期已分配利润	-	-	-
本期末	55,256,932.42	-2,477,407.82	52,779,524.60

#### 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	37,390.75
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	6,838.92
其他	776.79
合计	45,006.46

注：其他为结算保证金利息收入和直销申购款利息收入。

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-4,144,684.69
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	-4,144,684.69

#### 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	591,280,398.69
减：卖出股票成本总额	593,958,834.36
减：交易费用	1,466,249.02
买卖股票差价收入	-4,144,684.69

#### 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

注：本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

### 6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,885,194.96
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,885,194.96

### 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	10,383,925.68
股票投资	10,383,925.68
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	10,383,925.68

#### 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	10,581.33
基金转换费收入	3,288.93
合计	13,870.26

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

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

#### 6.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	27,349.14
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行间账户服务费	18,600.00
银行划款手续费	1,314.10
合计	106,935.58

#### 6.4.7.24 分部报告

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

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例（%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例（%）
华泰证券	17,772,030.28	1.51	-	-

#### 6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本期与上年度可比期间未发生与关联方进行的债券交易。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
华泰证券	8,886.65	0.81	8,886.65	2.93
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
-	-	-	-	-

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等（截至 2024 年 6 月 30 日）。

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	938,552.60	1,635,009.94
其中：应支付销售机构的客户维 护费	392,249.32	681,853.77
应支付基金管理人的净管理费	546,303.28	953,156.17

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：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 × 1.50%/ 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：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 × 1.20%/ 当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	156,425.41	272,501.63

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

注：本报告期及上年度可比期间，基金管理人未投资本基金。

##### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本报告期末及上年度末，除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	27,944,139.37	37,390.75	38,742,776.81	37,086.21

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

关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	本期	
				数量（单 位：股/ 张）	总金额
华泰联合证券有限责任公司	688709	成都华微	网下申购	2,960	46,442.40
华泰联合证券有限责任公司	603341	龙旗科技	网下申购	945	24,570.00
华泰联合证券有限责任公司	603312	西典新能	网下申购	583	16,918.66
上年度可比期间					
2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单 位：股/ 张）	总金额
华泰联合证券有限责任公司	301408	华人健康	网下申购	3,852	62,556.48
华泰联合证券有限责任公司	603291	联合水务	网下申购	536	3,140.96
华泰联合证券有限责任公司	600925	苏能股份	网下申购	8,960	55,372.80
华泰联合证券有限责任公司	603137	恒尚节能	网下申购	1,382	21,973.80
华泰联合证券有限责任公司	688478	晶升股份	网下申购	2,207	71,771.64
华泰联合证券有限责任公司	688472	阿特斯	网下申购	7,651	84,926.10
华泰联合证券有限责任公司	300804	广康生化	网下申购	1,641	69,660.45
华泰联合证券有限责任公司	688429	时创能源	网下申购	2,427	46,598.40

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

### 6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

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

#### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位： 股))	期末成本总额	期末估值总额	备注
601033	永兴股份	2024 年 1 月 11 日	6 个月	新股锁定期内	16.20	15.96	216	3,499.20	3,447.36	-
603082	北自科技	2024 年 1 月 23 日	6 个月	新股锁定期内	21.28	29.49	70	1,489.60	2,064.30	-
603285	键邦股份	2024 年 6 月 28 日	1 个月内 (含)	新股未上市	18.65	18.65	794	14,808.10	14,808.10	-
603312	西典新能	2024 年 1 月 4 日	6 个月	新股锁定期内	29.02	25.36	59	1,712.18	1,496.24	-
603325	博隆技术	2024 年 1 月 3 日	6 个月	新股锁定期内	72.46	68.06	25	1,811.50	1,701.50	-
603341	龙旗科技	2024 年 2 月 23 日	6 个月	新股锁定期内	26.00	37.49	95	2,470.00	3,561.55	-
603344	星德胜	2024 年 3 月 13 日	6 个月	新股锁定期内	19.18	22.66	92	1,764.56	2,084.72	-
603350	安乃达	2024 年 6 月 26 日	1 个月内 (含)	新股未上市	20.56	20.56	809	16,633.04	16,633.04	-
603375	盛	2024	6 个月	新股	38.18	38.90	43	1,641.74	1,672.70	-

	景微	年1月17日		锁定期内						
603381	永臻股份	2024年6月19日	6个月	新股锁定期内	23.35	25.13	68	1,587.80	1,708.84	-
688530	欧莱新材	2024年4月29日	6个月	新股锁定期内	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-
688584	上海合晶	2024年2月1日	6个月	新股锁定期内	22.66	15.89	237	5,370.42	3,765.93	-
688691	灿芯股份	2024年4月2日	6个月	新股锁定期内	19.86	42.51	181	3,594.66	7,694.31	-
688692	达梦数据	2024年6月4日	6个月	新股锁定期内	86.96	174.93	56	4,869.76	9,796.08	-
688695	中创股份	2024年3月6日	6个月	新股锁定期内	22.43	31.55	174	3,902.82	5,489.70	-
688709	成都华微	2024年1月31日	6个月	新股锁定期内	15.69	18.79	296	4,644.24	5,561.84	-

注：1、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股中需要限售的部分或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

2、基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

3、基金作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

4、基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后 6 个月内不得转让。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本期末未持有暂时停牌的流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末无从事债券银行间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的有效性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主要环节，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可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

于 2024 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合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管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金管理规定》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、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

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

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

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年6月30 日	1个月以内	1-3个 月	3个月-1 年	1-5 年	5年以 上	不计息	合计
<b>资产</b>							
货币资金	27,944,139.37	-	-	-	-	-	27,944,139.37
结算备付金	512,812.03	-	-	-	-	-	512,812.03
存出保证金	102,451.48	-	-	-	-	-	102,451.48
交易性金融资产	-	-	-	-	-133,965,870.88	133,965,870.88	
应收申购款	-	-	-	-	-	23,922.97	23,922.97
应收清算款	-	-	-	-	-	236,347.29	236,347.29
<b>资产总计</b>	<b>28,559,402.88</b>	-	-	-	-134,226,141.14	<b>162,785,544.02</b>	
<b>负债</b>							
应付赎回款	-	-	-	-	-	160,586.59	160,586.59
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	153,435.03	153,435.03
应付托管费	-	-	-	-	-	25,572.51	25,572.51
应付清算款	-	-	-	-	-	3,942,199.64	3,942,199.64
其他负债	-	-	-	-	-	389,999.99	389,999.99
<b>负债总计</b>	<b>28,559,402.88</b>	-	-	-	-	<b>4,671,793.76</b>	<b>4,671,793.76</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>28,559,402.88</b>	-	-	-	-	<b>-129,554,347.38</b>	<b>158,113,750.26</b>
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
<b>资产</b>							
货币资金	25,313,645.21	-	-	-	-	-	25,313,645.21
结算备付金	432,754.17	-	-	-	-	-	432,754.17
存出保证金	126,419.87	-	-	-	-	-	126,419.87
交易性金融资产	-	-	-	-	-130,239,094.91	130,239,094.91	
应收申购款	-	-	-	-	-	49,374.46	49,374.46
应收清算款	-	-	-	-	-	3,923,830.88	3,923,830.88
<b>资产总计</b>	<b>25,872,819.25</b>	-	-	-	-134,212,300.25	<b>160,085,119.50</b>	
<b>负债</b>							
应付赎回款	-	-	-	-	-	159,370.80	159,370.80
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	163,546.00	163,546.00
应付托管费	-	-	-	-	-	27,257.68	27,257.68
应付清算款	-	-	-	-	-	866,222.35	866,222.35
其他负债	-	-	-	-	-	433,519.45	433,519.45
<b>负债总计</b>	<b>25,872,819.25</b>	-	-	-	-	<b>1,649,916.28</b>	<b>1,649,916.28</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>25,872,819.25</b>	-	-	-	-	<b>-132,562,383.97</b>	<b>158,435,203.22</b>

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	133,965,870.88	84.73	130,239,094.91	82.20
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	133,965,870.88	84.73	130,239,094.91	82.20

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2024 年 6 月 30 日）
	沪深 300 指数上升 5%	5,375,771.95
	沪深 300 指数下降 5%	-5,375,771.95

#### 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	133,878,846.27	129,847,380.81
第二层次	31,441.14	-
第三层次	55,583.47	391,714.10
合计	133,965,870.88	130,239,094.91

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

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

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

### § 7 投资组合报告

#### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	133,965,870.88	82.30
	其中：股票	133,965,870.88	82.30
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	28,456,951.40	17.48
8	其他各项资产	362,721.74	0.22
9	合计	162,785,544.02	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	-	-
B	采矿业	15,050,384.00	9.52
C	制造业	650,328.13	0.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	15,245,031.00	9.64
E	建筑业	10,498,463.00	6.64
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,585,235.09	8.59
J	金融业	78,932,982.30	49.92
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	3,447.36	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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	133,965,870.88	84.73

### 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	003816	中国广核	1,671,100	7,737,193.00	4.89
2	601328	交通银行	1,024,300	7,651,521.00	4.84
3	601658	邮储银行	1,490,900	7,558,863.00	4.78
4	601985	中国核电	704,300	7,507,838.00	4.75
5	601288	农业银行	1,706,700	7,441,212.00	4.71
6	601825	沪农商行	1,077,100	7,238,112.00	4.58
7	601728	中国电信	1,168,700	7,187,505.00	4.55
8	002966	苏州银行	928,900	6,966,750.00	4.41
9	600919	江苏银行	900,000	6,687,000.00	4.23
10	600941	中国移动	59,300	6,374,750.00	4.03
11	601398	工商银行	1,073,600	6,119,520.00	3.87
12	600000	浦发银行	721,100	5,934,653.00	3.75
13	601229	上海银行	805,500	5,847,930.00	3.70

14	601128	常熟银行	766,390	5,801,572.30	3.67
15	600938	中国海油	171,800	5,669,400.00	3.59
16	601857	中国石油	535,000	5,521,200.00	3.49
17	601009	南京银行	444,300	4,616,277.00	2.92
18	601668	中国建筑	820,500	4,356,855.00	2.76
19	601186	中国铁建	359,600	3,081,772.00	1.95
20	601390	中国中铁	469,300	3,059,836.00	1.94
21	601988	中国银行	499,400	2,307,228.00	1.46
22	601225	陕西煤业	73,600	1,896,672.00	1.20
23	601169	北京银行	305,100	1,781,784.00	1.13
24	600926	杭州银行	125,200	1,633,860.00	1.03
25	601998	中信银行	201,000	1,346,700.00	0.85
26	600489	中金黄金	77,300	1,144,040.00	0.72
27	600028	中国石化	129,600	819,072.00	0.52
28	600519	贵州茅台	400	586,956.00	0.37
29	603350	安乃达	809	16,633.04	0.01
30	603285	键邦股份	794	14,808.10	0.01
31	688692	达梦数据	56	9,796.08	0.01
32	688691	灿芯股份	181	7,694.31	0.00
33	688709	成都华微	296	5,561.84	0.00
34	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
35	688695	中创股份	174	5,489.70	0.00
36	688584	上海合晶	237	3,765.93	0.00
37	603341	龙旗科技	95	3,561.55	0.00
38	601033	永兴股份	216	3,447.36	0.00
39	300122	智飞生物	99	2,774.97	0.00
40	603344	星德胜	92	2,084.72	0.00
41	603082	北自科技	70	2,064.30	0.00
42	603381	永臻股份	68	1,708.84	0.00
43	603325	博隆技术	25	1,701.50	0.00
44	603375	盛景微	43	1,672.70	0.00
45	603312	西典新能	59	1,496.24	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	601998	中信银行	19,583,950.00	12.36
2	601857	中国石油	18,035,258.50	11.38
3	002966	苏州银行	16,325,269.50	10.30
4	601390	中国中铁	16,235,424.82	10.25
5	600941	中国移动	15,743,129.00	9.94
6	601186	中国铁建	14,474,755.49	9.14

7	600926	杭州银行	13,917,791.00	8.78
8	600938	中国海油	13,528,491.00	8.54
9	600919	江苏银行	12,674,918.00	8.00
10	600418	江淮汽车	12,646,541.00	7.98
11	601881	中国银河	12,547,874.56	7.92
12	601668	中国建筑	12,118,604.20	7.65
13	002594	比亚迪	11,593,334.00	7.32
14	002517	恺英网络	11,473,149.00	7.24
15	002624	完美世界	10,716,376.13	6.76
16	601988	中国银行	10,614,893.00	6.70
17	002558	巨人网络	10,602,330.00	6.69
18	600546	山煤国际	10,581,080.00	6.68
19	601800	中国交建	10,121,171.22	6.39
20	300533	冰川网络	9,952,185.00	6.28
21	601825	沪农商行	9,875,079.00	6.23
22	601728	中国电信	9,744,864.00	6.15
23	600036	招商银行	9,321,980.00	5.88
24	600028	中国石化	9,027,895.00	5.70
25	601328	交通银行	8,648,155.00	5.46
26	601658	邮储银行	8,532,064.00	5.39
27	600985	淮北矿业	8,506,936.18	5.37
28	601898	中煤能源	8,328,356.00	5.26
29	002605	姚记科技	8,227,968.00	5.19
30	601009	南京银行	8,179,978.00	5.16
31	601398	工商银行	8,177,112.00	5.16
32	601985	中国核电	7,378,077.00	4.66
33	600325	华发股份	7,369,342.00	4.65
34	300474	景嘉微	7,326,076.50	4.62
35	600901	江苏租赁	7,304,751.60	4.61
36	601318	中国平安	7,253,338.00	4.58
37	601336	新华保险	7,210,887.00	4.55
38	601628	中国人寿	7,209,624.00	4.55
39	601689	拓普集团	7,099,636.00	4.48
40	003816	中国广核	6,983,304.00	4.41
41	601229	上海银行	6,857,691.00	4.33
42	688041	海光信息	6,687,679.14	4.22
43	601128	常熟银行	6,626,029.00	4.18
44	600000	浦发银行	6,399,811.00	4.04
45	000983	山西焦煤	6,353,686.60	4.01
46	300750	宁德时代	6,273,943.60	3.96
47	600188	兖矿能源	6,138,431.50	3.87
48	603000	人民网	6,127,953.88	3.87
49	000625	长安汽车	6,041,039.71	3.81

50	600489	中金黄金	5,842,376.00	3.69
51	300580	贝斯特	5,142,279.00	3.25
52	000975	山金国际	4,732,447.00	2.99
53	600602	云赛智联	4,459,633.00	2.81
54	600633	浙数文化	4,435,524.00	2.80
55	300002	神州泰岳	4,223,717.00	2.67
56	000550	江铃汽车	4,210,153.00	2.66
57	600383	金地集团	4,197,816.00	2.65
58	301061	匠心家居	4,160,139.00	2.63
59	300226	上海钢联	4,099,748.61	2.59
60	002155	湖南黄金	3,960,019.86	2.50
61	600395	盘江股份	3,955,293.00	2.50
62	000568	泸州老窖	3,922,779.00	2.48
63	002368	太极股份	3,671,231.75	2.32
64	000032	深桑达 A	3,670,299.00	2.32
65	002156	通富微电	3,254,930.00	2.05
66	601595	上海电影	3,178,385.00	2.01

注：不考虑相关交易费用。

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

#### 7.4.2 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	601998	中信银行	19,559,352.00	12.35
2	601881	中国银河	17,415,640.05	10.99
3	600941	中国移动	14,140,256.00	8.92
4	601857	中国石油	13,167,571.00	8.31
5	601390	中国中铁	13,153,767.00	8.30
6	600926	杭州银行	13,069,304.90	8.25
7	600546	山煤国际	12,605,438.00	7.96
8	600418	江淮汽车	11,963,602.38	7.55
9	601186	中国铁建	11,855,148.00	7.48
10	002594	比亚迪	11,801,421.00	7.45
11	600985	淮北矿业	11,629,102.66	7.34
12	601800	中国交建	11,153,375.00	7.04
13	002558	巨人网络	11,025,549.00	6.96
14	002517	恺英网络	10,926,645.00	6.90
15	601898	中煤能源	10,317,663.00	6.51
16	002624	完美世界	10,289,781.00	6.49
17	000983	山西焦煤	10,273,848.00	6.48
18	002966	苏州银行	10,001,199.00	6.31

19	600519	贵州茅台	9,390,771.00	5.93
20	300533	冰川网络	9,388,016.50	5.93
21	300474	景嘉微	9,179,184.00	5.79
22	601988	中国银行	8,994,477.00	5.68
23	600036	招商银行	8,953,420.00	5.65
24	600938	中国海油	8,645,301.00	5.46
25	601728	中国电信	8,525,081.00	5.38
26	600028	中国石化	8,410,149.00	5.31
27	002605	姚记科技	8,085,398.80	5.10
28	601668	中国建筑	7,997,829.00	5.05
29	601825	沪农商行	7,774,419.00	4.91
30	601328	交通银行	7,439,742.83	4.70
31	601336	新华保险	7,224,716.63	4.56
32	600325	华发股份	7,122,841.00	4.50
33	601318	中国平安	7,062,813.00	4.46
34	600395	盘江股份	7,000,629.00	4.42
35	600901	江苏租赁	6,916,341.00	4.37
36	601628	中国人寿	6,875,800.00	4.34
37	601689	拓普集团	6,696,002.00	4.23
38	300750	宁德时代	6,574,890.60	4.15
39	300759	康龙化成	6,385,647.00	4.03
40	688041	海光信息	6,312,512.04	3.98
41	600919	江苏银行	6,272,785.00	3.96
42	002294	信立泰	6,219,984.00	3.93
43	000625	长安汽车	6,135,494.07	3.87
44	603198	迎驾贡酒	5,914,861.00	3.73
45	600188	兖矿能源	5,750,745.00	3.63
46	603000	人民网	5,707,360.68	3.60
47	600509	天富能源	5,625,648.00	3.55
48	600276	恒瑞医药	5,552,914.00	3.50
49	301045	天禄科技	5,367,227.00	3.39
50	601009	南京银行	5,296,179.00	3.34
51	000526	学大教育	5,188,200.00	3.27
52	688433	华曙高科	5,092,074.61	3.21
53	600489	中金黄金	5,017,372.90	3.17
54	600383	金地集团	4,776,505.00	3.01
55	601001	晋控煤业	4,602,425.00	2.90
56	301061	匠心家居	4,544,227.12	2.87
57	002155	湖南黄金	4,413,509.00	2.79
58	688234	天岳先进	4,373,142.59	2.76
59	600602	云赛智联	4,355,737.96	2.75
60	000975	山金国际	4,333,077.00	2.73
61	300580	贝斯特	4,274,852.00	2.70

62	000568	泸州老窖	4,212,397.00	2.66
63	688001	华兴源创	4,097,807.84	2.59
64	600633	浙数文化	4,077,912.00	2.57
65	603297	永新光学	4,070,154.00	2.57
66	300002	神州泰岳	3,969,350.23	2.51
67	688333	铂力特	3,969,077.30	2.51
68	000550	江铃汽车	3,950,921.00	2.49
69	300226	上海钢联	3,665,004.80	2.31
70	688025	杰普特	3,600,857.74	2.27
71	000032	深桑达 A	3,174,446.00	2.00

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	587,301,684.65
卖出股票收入（成交）总额	591,280,398.69

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 7.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

##### 7.11.2 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，农业银行（601288）在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，邮储银行（601658）在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行的处罚。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，交通银行（601328）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。

### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情形。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	102,451.48
2	应收清算款	236,347.29
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	23,922.97
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	362,721.74

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比 例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
11,374	9,260.97	54.86	0.00	105,334,170.80	100.00

### 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	7,290.49	0.0069

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2015年5月20日)	1,549,036,076.82
基金份额总额	
本报告期期初基金份额总额	110,950,071.61
本报告期基金总申购份额	3,283,132.12
减：本报告期基金总赎回份额	8,898,978.07
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	105,334,225.66

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

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 (%)	
招商证券	4	334,450,592 .09	28.39	316,357.38	28.89	-
粤开证券	1	129,502,387 .87	10.99	121,201.67	11.07	-
方正证券	3	113,264,378 .55	9.61	106,004.38	9.68	-
华宝证券	2	75,544,861. 51	6.41	71,455.88	6.53	-
国投证券	3	71,522,459. 18	6.07	67,651.52	6.18	-
平安证券	2	67,439,487. 90	5.72	63,791.02	5.83	-
天风证券	2	60,147,502. 82	5.11	57,183.59	5.22	-
中泰证券	2	47,770,995. 32	4.05	45,186.08	4.13	-

中金财富证券	2	47,095,133.02	4.00	44,547.79	4.07	-
南京证券	2	43,276,850.90	3.67	40,935.14	3.74	-
国盛证券	2	39,071,105.86	3.32	28,752.72	2.63	-
民生证券	4	29,792,833.76	2.53	27,882.98	2.55	-
中航证券	1	26,083,613.76	2.21	24,671.57	2.25	-
江海证券	2	24,941,073.28	2.12	23,590.71	2.15	-
太平洋证券	2	23,211,410.06	1.97	21,956.47	2.01	-
华泰证券	5	17,772,030.28	1.51	8,886.65	0.81	-
金元证券	2	14,415,158.00	1.22	13,491.12	1.23	-
华西证券	1	9,893,695.90	0.84	9,358.47	0.85	-
中信建投	3	2,937,436.00	0.25	2,161.84	0.20	-
长江证券	2	2,455.00	0.00	2.32	0.00	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	4	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东方财富证券	2	-	-	-	-	-
东海证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	3	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
宏信证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
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、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、无变更租用证券公司交易单元的情况。

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
招商证券	-	-	-	-	-	-

粤开证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
中金财富证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
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	华泰柏瑞基金管理有限公司关于提醒投资者防范不法分子假冒公司名义从事非法活动的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 03 月 29 日
3	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 02 月 24 日
4	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止和合期货有限公司办理旗下基金相关业务公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 02 月 21 日
5	华泰柏瑞基金管理有限公司关于对营业执照吊销客户采取限制交易措施的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 02 月 01 日
6	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 02 月 01 日
7	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止北京中期时代基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 01 月 06 日
8	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 01 月 05 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

注：本基金本报告期内未有单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

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

### 12.2 存放地点

上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

托管人住所

### 12.3 查阅方式

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

华泰柏瑞基金管理有限公司

2024 年 8 月 31 日