

华泰柏瑞景气回报一年持有期混合型证券投资基金

2024年第4季度报告

2024年12月31日

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2025年1月22日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 01 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 10 月 01 日起至 2024 年 12 月 31 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华泰柏瑞景气回报一年持有期混合	
基金主代码	008373	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 12 月 18 日	
报告期末基金份额总额	109,103,028.37 份	
投资目标	在控制风险的前提下，力争控制基金的回撤水平，追求资产净值的长期稳健增值，为投资人提供超越业绩比较基准的投资回报。	
投资策略	本基金将通过研究宏观经济、国家政策等可能影响证券市场的重要因素，对股票、债券和货币资产的风险收益特征进行深入分析，合理预测各类资产的价格变动趋势，确定不同资产类别的投资比例。在此基础上，积极跟踪由于市场短期波动引起的各类资产的价格偏差和风险收益特征的相对变化，动态调整各大类资产之间的投资比例，在保持总体风险水平相对平稳的基础上，获取相对较高的基金投资收益。	
业绩比较基准	中证 800 指数收益率*80%+上证国债指数收益率*10%+银行活期存款利率(税后)*10%	
风险收益特征	本基金为混合型基金，在通常情况下其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。	
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	华泰柏瑞景气回报一年持有	华泰柏瑞景气回报一年持有

	期混合 A	期混合 C
下属分级基金的交易代码	008373	008374
报告期末下属分级基金的份额总额	105,124,016.37 份	3,979,012.00 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2024 年 10 月 1 日-2024 年 12 月 31 日）	
	华泰柏瑞景气回报一年持有期混合 A	华泰柏瑞景气回报一年持有期混合 C
1. 本期已实现收益	4,625,582.56	169,904.60
2. 本期利润	-5,102,001.79	-185,758.27
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0476	-0.0458
4. 期末基金资产净值	148,241,476.48	5,540,982.14
5. 期末基金份额净值	1.4102	1.3926

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华泰柏瑞景气回报一年持有期混合 A

阶段	净值增长率①	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
过去三个月	-3.21%	1.56%	-0.88%	1.43%	-2.33%	0.13%
过去六个月	3.39%	1.55%	12.00%	1.38%	-8.61%	0.17%
过去一年	5.93%	1.35%	10.98%	1.14%	-5.05%	0.21%
过去三年	-25.56%	1.28%	-15.02%	0.96%	-10.54%	0.32%
过去五年	40.42%	1.45%	3.00%	0.98%	37.42%	0.47%
自基金合同	41.02%	1.45%	4.01%	0.98%	37.01%	0.47%

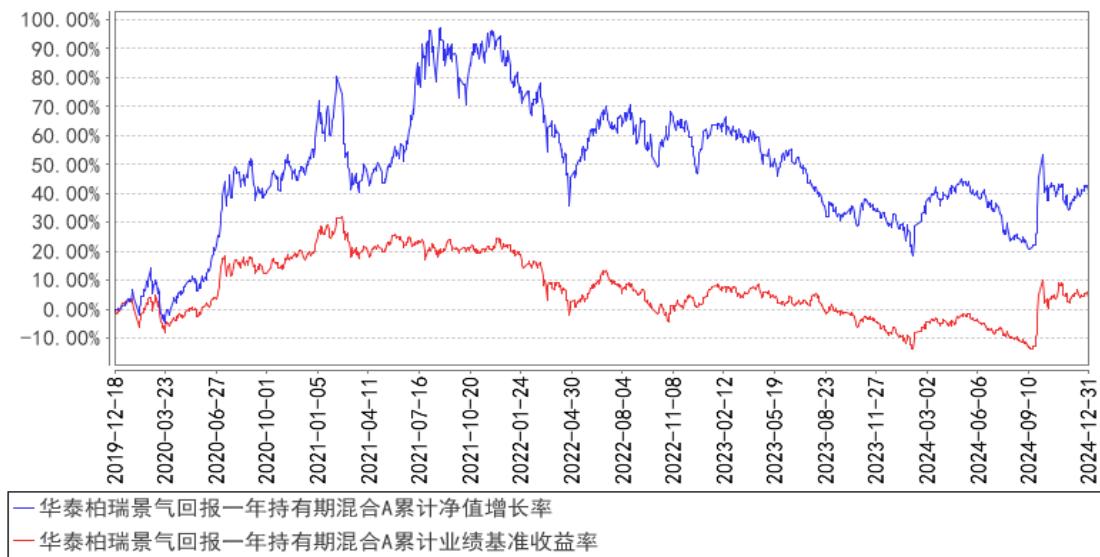
生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

华泰柏瑞景气回报一年持有期混合 C

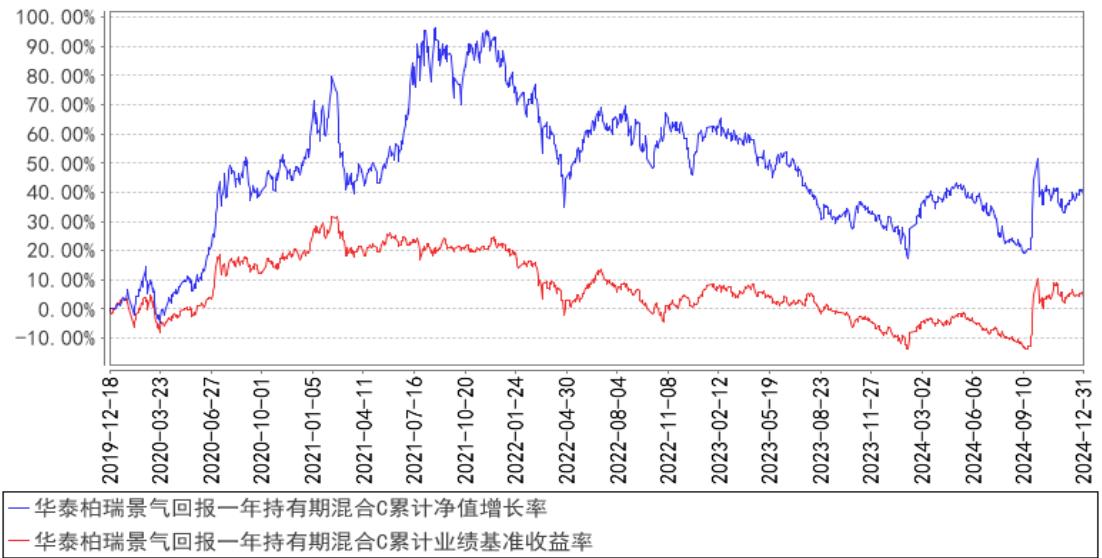
阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	-3.26%	1.56%	-0.88%	1.43%	-2.38%	0.13%
过去六个月	3.26%	1.55%	12.00%	1.38%	-8.74%	0.17%
过去一年	5.66%	1.35%	10.98%	1.14%	-5.32%	0.21%
过去三年	-26.11%	1.28%	-15.02%	0.96%	-11.09%	0.32%
过去五年	38.68%	1.45%	3.00%	0.98%	35.68%	0.47%
自基金合同 生效起至今	39.26%	1.45%	4.01%	0.98%	35.25%	0.47%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

华泰柏瑞景气回报一年持有期混合 A 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



华泰柏瑞景气回报一年持有期混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：A类图示日期为 2019 年 12 月 18 日至 2024 年 12 月 31 日。C类图示日期为 2019 年 12 月 18 日至 2024 年 12 月 31 日。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
吴邦栋	投资二部副总监、本基金的基金经理	2023 年 6 月 9 日	-	14 年	上海财经大学金融学硕士。曾任长江证券股份有限公司研究员、农银汇理基金管理有限公司研究员。2015 年 6 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，任高级研究员兼基金经理助理。2018 年 3 月起任华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 4 月至 2018 年 11 月任华泰柏瑞爱利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 4 月至 2020 年 8 月任华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 4 月至 2020 年 12 月任华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 2 月至 2022 年 1 月任华泰柏瑞锦瑞债券型证券投资基金的基金经理。2020 年 3 月起任华泰柏瑞战略新兴产业混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 6 月至 2023 年 11 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。2020 年 9 月至 2023 年 9 月任华泰柏瑞景利混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月起任华泰柏瑞景气成长混合型证券投资基金的基金经理。2022 年 9 月至 2023 年 10 月任华泰柏瑞景气驱动混合型证券投资基金的基金经理。2023 年 6 月起任华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金、华泰柏瑞研究精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞景气回报一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--

4.1.1 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

报告期内本基金的运作符合相关法律、法规以及基金合同的约定，不存在损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

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 24 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

经历 9 月底的反弹后，四季度行情整体震荡，但市场交投活跃，各类主题机会涌现。期间，10 月中上旬在前期的快速大涨后，市场一度回调。而行至 10 月下旬，一方面政策持续密集加

码，包括推动房地产市场止跌回稳的“442”增量政策组合拳落地，证券、基金、保险公司互换便利（SFISF）操作正式启动等，提振市场信心，另一方面 9 月多数经济指标呈现改善信号，带动经济预期改善，市场再度迎来上涨。直至 11 月中旬，人大常委会的政策宽松兑现叠加特朗普上任引发对关税的担忧，市场再次回调。直至 11 月底开始，随着特朗普交易降温，同时 12 月国内重要会议窗口临近，市场风险偏好迎来改善。而到了 12 月下旬，随着政治局会议、经济工作会议陆续召开，叠加宏观数据指向基本面的内生动能仍有一定偏弱，市场也整体震荡波动。整个四季度，沪深 300 跌 2.06%，中证 500 跌 0.30%，创业板指跌 1.54%。风格上，成长、小盘风格一度占优。而近期随着风险偏好回落，又转向大盘、红利风格。

宏观经济方面，随着政策落地生效，四季度经济基本面进一步边际改善。具体来看，7-9 月，我国制造业 PMI 录得 50.1%、50.3%、50.1%，持续处于扩张区间。12 月制造业 PMI 虽环比回落，但主要是生产和配送时间的拖累，需求仍在向上。剔除季节性影响后，PMI 数据整体延续企稳，但另一方面我们也需要看到其中的结构分化和政策拉动特征依旧明显，内生动能弹性仍有一定偏弱。生产端，11 月规模以上工业增加值同比 5.4%，前值 5.3%，高于市场预期的 5.2%。其中制造业增速同比为 6.0%，是过去六个月以来最快。消费端，10 月需求提前释放后，11 月商品需求较快回落。11 月社会消费品零售总额同比 3.0%，前值 4.8%，低于市场预期的 5.3%。投资端，11 月固定资产投资当月同比 2.4%，前值 3.4%。整体来看，固定资产投资变化不大，环比季调 0.1%，略高于前值的-0.16%，去年基数抬高的背景下同比低于前值确实算不上减速，但也没有加速特征。出口端，11 月出口当月同比 6.7%，前期积压订单释放完毕后，本期增速回落符合预期，维持 7% 左右的增长也足见韧性。物价方面，11 月通胀结构性修复，回升动能仍需政策支撑。其中 11 月 CPI 同比为 0.2%，略低于前值的 0.3%；PPI 同比-2.5%，略高于前值的-2.9%。社融方面，11 月社融增加 2.3 万亿元，同比少增 1197 亿元，低于市场平均预期。各分项中，实体信贷同比少增，企业债与政府债同比多增，其余变化不大。社融存量增速为 7.8%，与上月持平。

政策层面，9 月底以来国内各项宽松举措密集落地，近期政治局会议、中央经济工作会议更加积极有为的宏观政策定调、聚焦需求侧发力和供需平衡的工作思路，以及对于楼市股市更加明确的支持态度，进一步对中长期基本面的改善和市场信心的回暖形成持续的支撑。其中，对于当前经济，决策层明确“正视困难，坚定信心”，并针对性提出五个“必须统筹好”作为工作总纲，直切当前经济面临的关键问题。宏观政策方面，财政政策“更加积极”+货币政策“适度宽松”的组合，意味着明年政策逆周期刺激将更加“积极有为”。1) 财政政策方面，会议明确“实施更加积极的财政政策”，在此前“积极”基调的基础上额外增加“更加”二字强调，意味

着在今年年内财政政策已经加大发力的背景下，明年财政政策取向和力度会更加积极。手段上，包括提高赤字率、加大财政支出、增发超长期特别国债和专项债等，明年财政增量空间可期。

2) 货币政策方面，一是“保持流动性合理充裕”变为“保持流动性充裕”，二是明确提出明年要“适时降准降息”，意味着后续降准降息都有空间并且会逐步落地。稳增长的同时，也将对市场风险偏好形成支撑。更重要的，本次会议首次将“稳住楼市股市”列为经济工作的重点，提振股市已经成为本轮政策稳增长的重要抓手。此外，对于政策落地的节奏上，会议罕见明确“各项工作能早则早、抓紧抓实，保证足够力度”，对于及时应对外部冲击、形成良好预期也有重要意义。而海外方面，特朗普胜选且共和党同时成为参议院和众议院的多数党派，特朗普交易一度主导市场。另一方面，12 月美联储如期降息 25bp，但为后续降息节奏做了鹰派指引。尤其是近期宏观数据显示美国经济较有韧性，叠加美联储正在评估特朗普政策影响，令市场本已鹰于联储的降息预期再度收窄，期限溢价和通胀预期推动 10 年期美债收益率上涨。当前，市场降息预期保持在 2025 年降息 1-2 次的偏紧区间。

行业层面，随着 9 月底开始政策重磅加码，市场 beta 式上涨，TMT、先进制造等高弹性方向领涨。而行至 11 月中下旬市场回调，银行、红利、消费等板块表现靠前。而 11 月底开始，随着特朗普交易降温，同时 12 月国内重要会议窗口临近，市场风险偏好迎来改善，TMT、先进制造再度反弹，金融、消费方向也持续支撑。到了 12 月下旬，市场整体震荡回调，而红利方向却逆市上涨。

本基金在报告期内继续保持行业及个股景气度选股的思路，整体来说行业配置上较为均衡，成长股比例略为增加，主要以消费以及高端制造类的成长个股为主。

近期市场波动再度加大，一方面是化解前期预期兑现的压力，另一方面也是对特朗普上任在即、年报业绩预告披露窗口临近等不确定因素的提前演绎。但站在我们的角度，随着 9 月底以来政策加码带来市场逻辑反转，我们更关注的仍是这轮行情走多长。围绕着反转逻辑，资本市场和资产负债表以及中国经济要形成一种良性的正面循环，需要更长久的行情，而不是短期暴利。但是中国经济的持续好转不是一蹴而就的，因此本轮上涨或将由多个阶段性的“快涨、大波动”的震荡市构成，底部逐步抬升、拾级而上。面对阶段性的震荡波动，关键是把握好预期与现实的节奏，利用短期波动期布局。

结构上，短期维度，由于两会前基本面和政策尚待验证，市场整体仍处于预期驱动的阶段，或仍将呈现大盘红利+小盘主题的“哑铃型”风格。但需要注意的是，由于预期驱动的过程中也交织着现实的扰动，使得“哑铃”的两端在节奏上可能有些差异：从年初到春节前，退市新规生效、特朗普就任等潜在因素扰动，叠加险资等主要增量资金影响，“哑铃”可能更偏大盘、红利

一端。而 2 月（尤其是从春节后到两会期间），随着春节数据披露、地方两会陆续召开确认各地 GDP 目标和重点工作方向，资金面环境相对宽松、叠加对两会政策期待，“哑铃”将可能更偏成长、主题一端。

中长期维度，行情得以持续最终仍需要盈利支撑，届时市场审美或也将从估值驱动回归盈利驱动。本轮来看，3、4 月份或将是行情能否转向盈利驱动的重要观察窗口。一方面，来自中美贸易等外部的扰动逐步“靴子落地”，市场或将进一步聚焦内部景气修复的线索。更重要的是，2025 年 3 月初两会将进一步明确经济目标和包括赤字率在内的增量政策力度，为市场注入一剂“强心剂”。同时在经历逆周期政策发力 2 个季度后，2024 年年报和 2025 年一季报有望验证企业基本面的改善，进一步强化市场信心。此时可择机提升对内需顺周期和困境反转行业的关注。

操作方面，我们仍坚持精选细分景气行业，自下而上挖掘个股，加入一些现金流提前复苏，或财报增速超预期的个股。整体来说，在关注前面提到的宏观面几个因素的同时，综合考虑组合可能的盈利增长和估值的匹配程度，对结构进一步优化。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末华泰柏瑞景气回报一年持有期混合 A 的基金份额净值为 1.4102 元，本报告期基金份额净值增长率为-3.21%，同期业绩比较基准收益率为-0.88%，截至本报告期末华泰柏瑞景气回报一年持有期混合 C 的基金份额净值为 1.3926 元，本报告期基金份额净值增长率为-3.26%，同期业绩比较基准收益率为-0.88%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	127,858,967.57	82.59
	其中：股票	127,858,967.57	82.59
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	26,892,227.34	17.37
8	其他资产	67,158.89	0.04
9	合计	154,818,353.80	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	122,174.00	0.08
B	采矿业	13,489,617.00	8.77
C	制造业	96,673,560.21	62.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	316,185.00	0.21
E	建筑业	2,124,718.00	1.38
F	批发和零售业	3,505.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	2,319,087.60	1.51
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,796,571.98	3.12
J	金融业	5,856,620.00	3.81
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,155,793.78	1.40
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	1,135.00	0.00
S	综合	-	-
	合计	127,858,967.57	83.14

5.2.2 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。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	002463	沪电股份	121,200	4,805,580.00	3.12
2	300750	宁德时代	15,100	4,016,600.00	2.61

3	600066	宇通客车	129,700	3,421,486.00	2.22
4	688018	乐鑫科技	15,240	3,322,320.00	2.16
5	300433	蓝思科技	132,500	2,901,750.00	1.89
6	002475	立讯精密	68,480	2,791,244.80	1.82
7	601567	三星医疗	87,600	2,694,576.00	1.75
8	301004	嘉益股份	22,100	2,555,865.00	1.66
9	300866	安克创新	25,160	2,456,622.40	1.60
10	600660	福耀玻璃	39,300	2,452,320.00	1.59

5.4 报告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。

5.5 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债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本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，三星医疗（601567）在报告编制日前一年内曾受到上海证券交易所的处罚。

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

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

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	16,097.07
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	51,061.82
6	其他应收款	—
7	其他	—
8	合计	67,158.89

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告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。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华泰柏瑞景气回报一年持有期混合 A	华泰柏瑞景气回报一年持有期混合 C
报告期期初基金份额总额	108,230,741.80	4,402,903.56
报告期期间基金总申购份额	1,789,017.34	116,650.71
减：报告期期间基金总赎回份额	4,895,742.77	540,542.27
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	105,124,016.37	3,979,012.00

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：无。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：1. 本基金本报告期内提取业绩报酬人民币 18,154.60 元，业绩报酬的计算公式为：

$$R = (Nav1 - Nav0) / Nav0 * 365 / D * 100\%$$

1) 若 $R \leq 8\%$ ，则 $H=0$ ；

2) 若 $R > 8\%$ ，则

$$H = (R - 8\%) * 20\% * Nav0' * N * D / 365$$

其中：

R 为单笔份额的年化收益率；

$Nav1$ 为单笔基金份额赎回申请日或基金最后运作日的基金份额累计净值；

$Nav0$ 为单笔基金份额认/申购申请日的基金份额累计净值；募集期内认购的基金份额，以基金合同生效日为单笔基金份额业绩报酬计提起始日；存续期内申购的基金份额，以申购日为单笔基金份额业绩报酬计提起始日；

$Nav0'$ 为单笔基金份额业绩报酬计提起始日的基金份额净值；

D 为单笔基金份额认/申购申请确认日（含当日，募集期认购的为基金合同生效日，基金合同存续期申购的基金份额为单笔基金份额申购申请确认日）到单笔基金份额赎回申请确认日（不含）或基金最后运作日（含）的天数；

H 为单笔基金份额的业绩报酬；

N 为单笔基金份额的基金份额数量。

2. 本基金本报告期内未参与融资交易。

§9 备查文件目录

9.1 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

9.2 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

9.3 查阅方式

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

华泰柏瑞基金管理有限公司

2025 年 1 月 22 日