

# 华泰柏瑞基本面智选混合型证券投资基金 2024 年年度报告

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

送出日期：2025 年 3 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 03 月 28 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。

本年度报告财务资料已经审计，德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 12 月 31 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 .....                         | 6         |
| 2.4 信息披露方式 .....                              | 7         |
| 2.5 其他相关资料 .....                              | 7         |
| <b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....         | <b>7</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 .....                         | 7         |
| 3.2 基金净值表现 .....                              | 9         |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况 .....                       | 11        |
| <b>§ 4 管理人报告</b> .....                        | <b>11</b> |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 .....                        | 11        |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....              | 13        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....                 | 13        |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....             | 14        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....             | 15        |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 .....                 | 15        |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....                | 16        |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....                 | 16        |
| 4.9 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 .....       | 17        |
| <b>§ 5 托管人报告</b> .....                        | <b>17</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....                  | 17        |
| 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 ..... | 17        |
| 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 .....       | 17        |
| <b>§ 6 审计报告</b> .....                         | <b>17</b> |
| 6.1 审计报告基本信息 .....                            | 17        |
| 6.2 审计报告的基本内容 .....                           | 17        |
| <b>§ 7 年度财务报表</b> .....                       | <b>19</b> |
| 7.1 资产负债表 .....                               | 19        |
| 7.2 利润表 .....                                 | 21        |
| 7.3 净资产变动表 .....                              | 22        |
| 7.4 报表附注 .....                                | 24        |
| <b>§ 8 投资组合报告</b> .....                       | <b>55</b> |
| 8.1 期末基金资产组合情况 .....                          | 55        |
| 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....                    | 55        |

|   |           |
|---|-----------|
| 8.3 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 .....     | 56        |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....                   | 58        |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....                  | 61        |
| 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....    | 61        |
| 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 ..... | 61        |
| 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 ..... | 61        |
| 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....    | 61        |
| 8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....                   | 61        |
| 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....             | 61        |
| 8.12 投资组合报告附注 .....                         | 61        |
| <b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>                  | <b>62</b> |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 62        |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 63        |
| 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....      | 63        |
| <b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>                 | <b>63</b> |
| <b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>                    | <b>64</b> |
| 11.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 64        |
| 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....      | 64        |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 64        |
| 11.4 基金投资策略的改变 .....                        | 64        |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 64        |
| 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....         | 65        |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                | 65        |
| 11.8 其他重大事件 .....                           | 70        |
| <b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>            | <b>72</b> |
| 12.1 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 .....    | 72        |
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                   | 72        |
| <b>§ 13 备查文件目录 .....</b>                    | <b>72</b> |
| 13.1 备查文件目录 .....                           | 72        |
| 13.2 存放地点 .....                             | 72        |
| 13.3 查阅方式 .....                             | 72        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                    |                |
|-----------------|--------------------|----------------|
| 基金名称            | 华泰柏瑞基本面智选混合型证券投资基金 |                |
| 基金简称            | 华泰柏瑞基本面智选          |                |
| 基金主代码           | 007306             |                |
| 基金运作方式          | 契约型开放式             |                |
| 基金合同生效日         | 2019年6月5日          |                |
| 基金管理人           | 华泰柏瑞基金管理有限公司       |                |
| 基金托管人           | 中国银行股份有限公司         |                |
| 报告期末基金份额总额      | 71,470,092.28份     |                |
| 基金合同存续期         | 不定期                |                |
| 下属分级基金的基金简称     | 华泰柏瑞基本面智选 A        | 华泰柏瑞基本面智选 C    |
| 下属分级基金的交易代码     | 007306             | 007307         |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 51,902,078.76份     | 19,568,013.52份 |

### 2.2 基金产品说明

|      |  |
|------|--|
| 投资目标 | 本基金通过基本面指标精选质地优良的公司，在严控组合风险及考虑流动性的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争基金资产的持续稳健增值。   |
| 投资策略 | <p>1、大类资产配置 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。</p> <p>2、股票投资策略 本基金选用长期有效且稳定的基本面选股指标对个股进行筛选，再进一步研究分析加以精选，以选择质地优良、盈利能力突出、增长稳定持续的个股构建投资组合，并合理控制组合的风险暴露，在控制风险的同时最大程度获得收益。</p> <p>3、债券投资策略 本基金债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。本基金管理人将基于对国内外宏观经济形势的深入分析、国内财政政策与货币市场政策等因素对债券的影响，进行合理的利率预期，判断市场的基本走势，制定久期控制下的资产类属配置策略。在债券投资组合构建和管理过程中，本基金管理人将具体采用期限结构配置、市场转换、信用利差和相对价值判断、信用风险评估、现金管理等管理手段进行个券选择。</p> <p>4、权证投资策略 权证为本基金辅助性投资工具，其投资原则为</p> |

|        |   |
|--------|---|
|        | <p>有利于基金资产增值，有利于加强基金风险控制。本基金在权证投资中将对权证标的证券的基本面进行研究，同时综合考虑权证定价模型、市场供求关系、交易制度设计等多种因素对权证进行定价。</p> <p>5、资产支持证券投资策略 在对市场利率环境深入研究的基础上，本基金投资于资产支持证券将采用久期配置策略与期限结构配置策略，结合定量分析和定性分析的方法，综合分析资产支持证券的利率风险、提前偿付风险、流动性风险、税收溢价等因素，选择具有较高投资价值的资产支持证券进行配置。</p> <p>6、股指期货投资策略 在法律法规允许的范围内，本基金可基于谨慎原则运用股指期货对基金投资组合进行管理，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险，提高投资效率。本基金主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。</p> <p>7、融资业务的投资策略 本基金参与融资业务，将综合考虑融资成本、保证金比例、冲抵保证金证券折算率、信用资质等条件，选择合适的交易对手方。同时，在保障基金投资组合充足流动性以及有效控制融资杠杆风险的前提下，确定融资比例。</p> |
| 业绩比较基准 | 中证 800 指数收益率*80%+中债综合指数收益率*20%  |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金，低于股票型基金。 本基金可能投资港股通标的股票，除需承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险，还需承担汇率风险以及香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。  |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目          |      | 基金管理人                             | 基金托管人                     |
|-------------|------|-----------------------------------|---------------------------|
| 名称          |      | 华泰柏瑞基金管理有限公司                      | 中国银行股份有限公司                |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 刘万方                               | 许俊                        |
|             | 联系电话 | 021-38601777                      | 010-66596688              |
|             | 电子邮箱 | cs4008880001@huatai-pb.com        | fxjd_hq@bank-of-china.com |
| 客户服务电话      |      | 400-888-0001                      | 95566                     |
| 传真          |      | 021-38601799                      | 010-66594942              |
| 注册地址        |      | 上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号 17 层 | 北京市西城区复兴门内大街 1 号          |
| 办公地址        |      | 上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号 17 层 | 北京市西城区复兴门内大街 1 号          |
| 邮政编码        |      | 200135                            | 100818                    |
| 法定代表人       |      | 贾波                                | 葛海蛟                       |

## 2.4 信息披露方式

|                     |  |
|---------------------|--|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 证券时报                                       |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | http://www.huatai-pb.com                   |
| 基金年度报告备置地点          | 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                                |
|--------|--------------------|-------------------------------------|
| 会计师事务所 | 德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙) | 上海市黄浦区延安东路 222 号 21 楼               |
| 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、基金净值表现及利润分配情况

### 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 | 2024 年        |               | 2023 年         |               | 2022 年        |               |
|---------------|---------------|---------------|----------------|---------------|---------------|---------------|
|               | 华泰柏瑞基本面智选 A   | 华泰柏瑞基本面智选 C   | 华泰柏瑞基本面智选 A    | 华泰柏瑞基本面智选 C   | 华泰柏瑞基本面智选 A   | 华泰柏瑞基本面智选 C   |
| 本期已实现收益       | 39,255,373.57 | 13,383,390.36 | 123,752,313.91 | 53,753,679.88 | 65,838,209.62 | 41,774,371.08 |
| 本期利润          | 21,959,609.79 | 7,710,607.34  | 126,683,378.95 | 66,302,170.54 | 55,302,699.46 | 60,858,168.73 |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.3566       | -0.3593       | -1.0496        | -1.1209       | -0.4506       | -0.8145       |
| 本期加权平均净值利润率   | -28.13%       | -28.78%       | -50.63%        | -50.70%       | -16.52%       | -30.24%       |
| 本期基金份额净值      | -19.89%       | -20.13%       | -37.88%        | -38.04%       | -16.33%       | -16.55%       |

| 增长率           |               |               |                |               |                |                |
|---------------|---------------|---------------|----------------|---------------|----------------|----------------|
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2024 年末       |               | 2023 年末        |               | 2022 年末        |                |
| 期末可供分配利润      | 29,921,281.29 | 11,543,221.25 | 478,946.62     | -311,400.71   | 158,051,257.83 | 146,067,280.87 |
| 期末可供分配基金份额利润  | -0.5765       | -0.5899       | 0.0070         | -0.0126       | 1.0126         | 0.9838         |
| 期末基金资产净值      | 65,562,585.79 | 24,259,918.27 | 108,142,883.33 | 38,396,363.96 | 396,189,811.21 | 371,970,913.42 |
| 期末基金份额净值      | 1.2632        | 1.2398        | 1.5768         | 1.5523        | 2.5384         | 2.5053         |
| 3.1.3 累计期末指标  | 2024 年末       |               | 2023 年末        |               | 2022 年末        |                |
| 基金份额累计净值增长率   | 26.32%        | 23.98%        | 57.68%         | 55.23%        | 153.84%        | 150.53%        |

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

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华泰柏瑞基本面智选 A

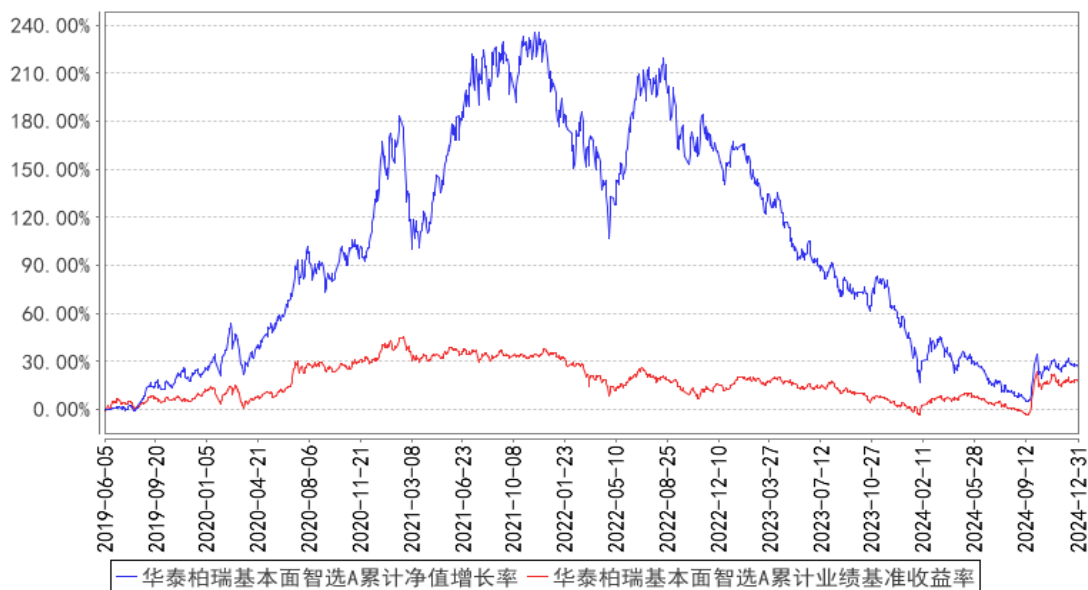
| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月      | -1.44%   | 1.59%       | -0.60%     | 1.42%         | -0.84% | 0.17% |
| 过去六个月      | 8.08%    | 1.63%       | 12.37%     | 1.37%         | -4.29% | 0.26% |
| 过去一年       | -19.89%  | 1.74%       | 11.72%     | 1.14%         | -      | 0.60% |
|            |          |             |            |               | 31.61% |       |
| 过去三年       | -58.37%  | 1.79%       | -13.77%    | 0.96%         | -      | 0.83% |
|            |          |             |            |               | 44.60% |       |
| 过去五年       | 1.19%    | 1.94%       | 5.31%      | 0.98%         | -4.12% | 0.96% |
| 自基金合同生效起至今 | 26.32%   | 1.87%       | 16.86%     | 0.96%         | 9.46%  | 0.91% |

华泰柏瑞基本面智选 C

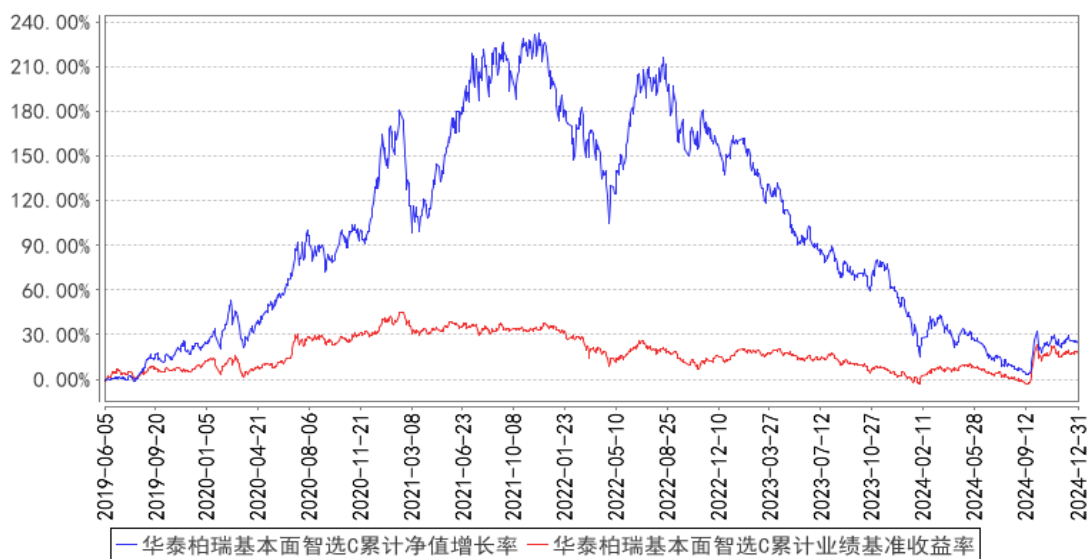
| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月      | -1.55%   | 1.59%       | -0.60%     | 1.42%         | -0.95% | 0.17% |
| 过去六个月      | 7.88%    | 1.63%       | 12.37%     | 1.37%         | -4.49% | 0.26% |
| 过去一年       | -20.13%  | 1.74%       | 11.72%     | 1.14%         | -      | 0.60% |
|            |          |             |            |               | 31.85% |       |
| 过去三年       | -58.70%  | 1.79%       | -13.77%    | 0.96%         | -      | 0.83% |
|            |          |             |            |               | 44.93% |       |
| 过去五年       | -0.13%   | 1.94%       | 5.31%      | 0.98%         | -5.44% | 0.96% |
| 自基金合同生效起至今 | 23.98%   | 1.86%       | 16.86%     | 0.96%         | 7.12%  | 0.90% |

### 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

华泰柏瑞基本面智选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



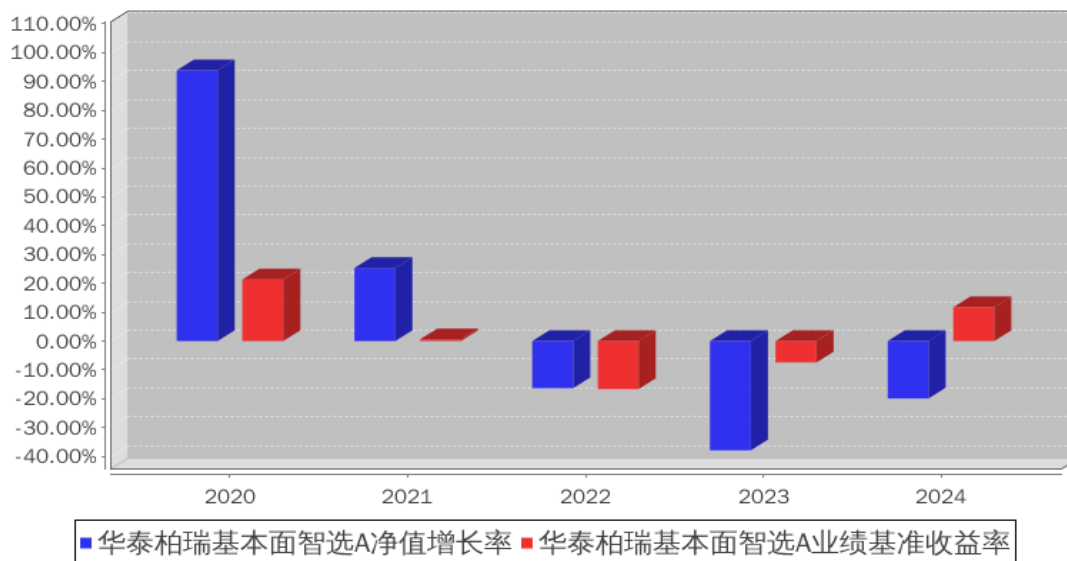
华泰柏瑞基本面智选C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



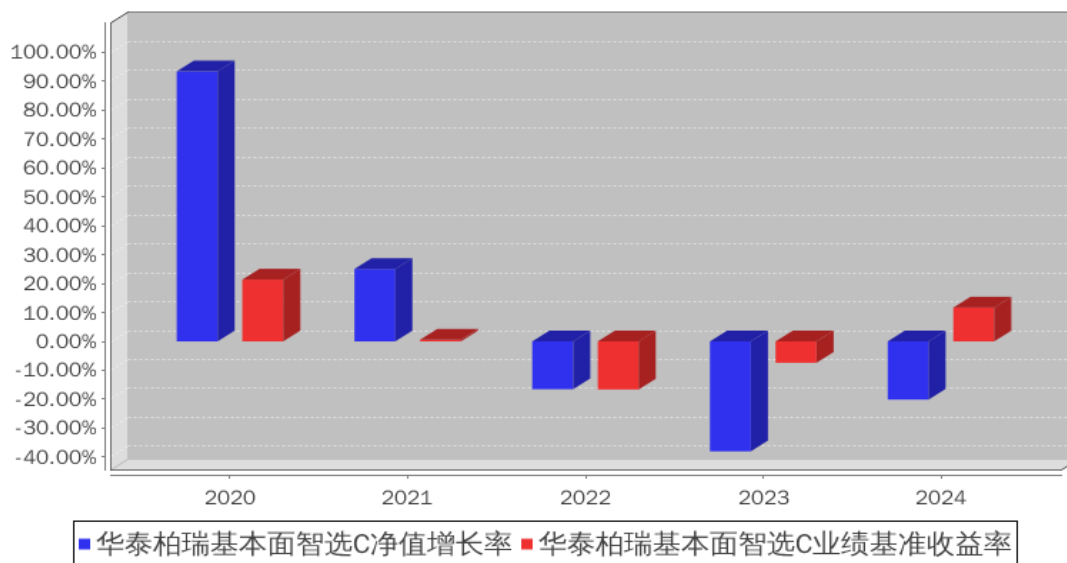
注：A类图示日期为2019年6月5日至2024年12月31日。C类图示日期为2019年6月5日至2024年12月31日。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华泰柏瑞基本面智选A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



华泰柏瑞基本面智选C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金过去三年未实施过利润分配。

## § 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 12 月 31 日，公司旗下管理 165 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           |        |   |
| 牛勇  | 本基金的基金经理   | 2019 年 6 月 5 日  | 2024 年 8 月 2 日 | 16 年   | 经济学硕士，FRM。曾在泰康人寿保险股份有限公司从事研究工作。2008 年 5 月加入华安基金管理有限公司任高级金融工程师，2010 年 9 月起担任基金经理，2016 年 6 月起任华安基金指数与量化投资事业部助理总监。2018 年 1 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司。2018 年 5 月至 2024 年 8 月任华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 6 月至 2024 年 8 月任华泰柏瑞基本面智选混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 11 月至 2024 年 8 月任华泰柏瑞成长智选混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 7 月至 2024 年 8 月任华泰柏瑞远见智选混合型证券投资基金的基金经理。2022 年 2 月至 2024 年 8 月任华泰柏瑞聚优智选一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。2022 年 8 月至 2024 年 8 月任华泰柏瑞低碳经济智选混合型证券投资基金的基金经理。 |
| 谭笑  | 本基金的基金经理   | 2024 年 8 月 2 日  | -              | 10 年   | 山东大学金融学硕士。2014 年 7 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任研究部助理研究员、研究员、高级研究员、部门副总监兼基金经理助理。2023 年 8 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。2024 年 8 月起任华泰柏瑞基本面智选混合型证券投资基金的基金经理。  |
| 刘腾飞 | 本基金的基金经理助理 | 2024 年 8 月 2 日  | -              | 6 年    | 上海交通大学企业管理专业硕士。曾任华泰保兴基金管理有限公司研究员。2022 年 10 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，现任基金经理助理。  |

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

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

注：1、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。

2、本报告期内兼任投资人员有产品离任情况，牛勇离任产品情况：

①产品类型：公募，离任数量：6 只，离任时间：2024-08-02；

②产品类型：私募资产管理计划，离任数量：0 只；离任时间：无。

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

兼任基金经理所管理的私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩不直接与兼任基金经理薪酬激励挂钩，公司会根据实际情况对兼任基金经理的公募产品及所管理的私募资产管理计划分别进行考核，并依据考核结果对薪酬激励进行评定和调整。

#### 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 公平交易制度和控制方法

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，建立了科学完善的公平交易管理制度，从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能发生的利益输送。投资部和研究部通过规范的决策流程公平对待不同投资组合。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，对于场内交易的非组合指令启用投资管理系统中的公平交易模块；对于场外交易按照时间优先价格优先的原则公平对待不同帐户。风险管理部对报告期内的交易进行日常监控和分析评估，同时对投资组合的交易价差在不同时间窗（如日内、3 日、5 日）下进行分析，综合判断各基金之间是否存在不公平交易或利益输送的可能，确保公平交易的实施。

##### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司将投资管理职能和交易执行职能完全隔离，实行集中交易制度，由交易部为公募基金、专户理财和海外投资等业务统一交易服务，为公平交易的实施提供了较好的保障。

目前公司公募基金经理有兼任私募资产管理计划投资经理的情况，兼任业务遵照相关法律法规

规要求进行，同时遵守公司公平交易制度。公司机构设置合理，公平交易的相关管理制度健全，投资决策流程完善，各项制度执行情况良好。交易价差分析表明公司旗下各基金均得到了公平对待，不存在非公平交易和利益输送的行为。经过对不同基金之间交易相同证券时的同向交易价差进行分析发现，报告期内基金之间的买卖交易价差总体上处于正常的合理水平。

#### 4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本报告期内，本产品基金经理同时兼任私募资产管理计划投资经理工作。

公司依据《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》针对同一基金经理管理的多个投资组合投资交易行为加强管理、监控和分析，防范不公平交易。包括：原则上采取“多基金指令”下达投资指令，以实现“同时同价”，因产品策略、头寸变化等原因导致无法“同时同价”的，公司每日分析交易流水，并定期通过公平交易系统进行价差监控管理，以加强事后分析。兼任的不同组合间原则上不得进行同日反向交易，遇到特殊情况需要提出申请。风险管理部每日对兼任组合间多个时间窗口下同向及反向交易价差进行监控，强化控制和监测。风险管理部定期对不同投资组合的公平交易情况进行监控和分析，相关投资组合经理对异常交易情况进行说明，风险管理部进行严格复核与独立评估，并结合成交顺序、价格偏差、产品规模、成交量等因素对是否存在不公平对待的情形进行分析，合规法律部对兼任公平交易制度以及其它交易相关规定的贯彻情况进行不定期监察稽核。

本报告期内，未发现本产品基金经理所管理的各个投资组合间存在不公平交易的情况。

#### 4.3.3 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 29 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 年全年上证指数上涨 12.67%，深证成指上涨 9.34%，创业板指数上涨 13.23%，三季度随着重磅政策的出台，A 股整体拉升明显，并且随着指数反弹和交易量的放大，成交活跃度大幅提升，板块轮动速度较快。

2024 年全球资本市场在“动荡中寻平衡”的基调下展开。国内方面，政策层以“新质生产力”为重心推动产业升级，财政端发力基建，货币政策在四季度开始明显转向宽松，但地产链复苏相对乏力导致市场风险偏好波动较大。海外美债利率回落，这也为 A 股外资回流创造条件。然而，地缘政治冲突加剧（如俄乌战争、中东局势）等事件冲击对产业链构成一定阶段性扰动。

本基金在报告期内继续保持自下而上的选股思路，整体来说行业配置上较为均衡，同时挖掘供给端未来可能发生较大变化的一些方向并做中长期配置。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末华泰柏瑞基本面智选 A 的基金份额净值为 1.2632 元，本报告期基金份额净值增长率为-19.89%，同期业绩比较基准收益率为 11.72%，截至本报告期末华泰柏瑞基本面智选 C 的基金份额净值为 1.2398 元，本报告期基金份额净值增长率为-20.13%，同期业绩比较基准收益率为 11.72%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为，目前的政策方向对 A 股非常有利，且国内外的环境改善均值得期待，经济预期逐步回升。A 股经历了两年多的震荡调整，2024 年 9 月底的剧烈上涨本质上也是一种对过去超跌的修正，投资机会仍然明显，亟待我们去挖掘和发现，目前我们仍然保持对 A 股的乐观态度，在去年 9 月底的剧烈上涨之后，一石激起千层浪，A 股短期波动加剧，2024 年底到 2025 年初的行情分化也较为剧烈，科技股表现亮眼，暂时没有出现指数整体大幅上涨的行情，我们认为随着经济数据的企稳回升，2025 年 A 股整体有望呈现向上的趋势。

个股方面，我们依然倾向于自下而上选取具有景气方向的优秀公司，过去很长一段时间以来，有些声音对于未来前景是过度悲观的，在这样的整体环境下，仍然保持进取、不断增强自身竞争力的企业显得尤为珍贵，在悲观预期被修正时，保持进取的优秀公司的表现或更为突出，我们将持续挖掘可持续成长的优秀公司。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2024 年度，本基金管理人在为基金份额持有人谋求最大利益的同时，始终将合规运作、防范风险工作放在各项工作的首位。依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。公司合规法律部按照规定的权限和程序，通过实时监控、现场检查、重点抽查和人员询问等方法，独立地开展基金运作和公司管理的合规性稽核，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向董事会和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

(1) 全面开展基金运作合规监察工作，确保基金投资的独立性、公平性及合法合规

主要措施有：严格执行集中交易制度，各基金相互独立，交易指令由中央交易室统一执行完成；对基金投资交易系统事先进行合规性设置，并由风险控制部门进行实时监控，杜绝出现违规行为；严格检查基金的投资决策、研究支持、交易过程是否符合规定的程序；通过以上措施，保证了投资运作遵循投资决策程序与业务流程，保证了基金投资组合符合相关法规及基金合同规定，确保了基金投资行为的独立、公平及合法合规。

(2) 开展定期和专项监察稽核工作，确保各项业务活动的合法合规

本年度公司合规法律部开展了对公司基金投资、研究、销售、后台运营、反洗钱等方面的专项监察稽核活动。对稽核中发现问题及时发出合规提示函，要求相关部门限期整改，并对改进情况安排后续跟踪检查，确保各项业务开展合法合规。

(3) 促进公司各项内部管理制度的完善

按照相关法规、证监会等监管机关的相关规定和公司业务的发展的要求，公司合规法律部及时要求各部门制订或修改相应制度，促进公司各项内部管理制度的进一步完善。

(4) 通过各种合规培训提高员工合规意识

本年度公司合规法律部通过对公司所有新入职员工进行入职前合规培训、对全体人员开展行为规范培训、对基金投资管理人员进行专项合规培训、对员工进行反洗钱培训等，有效提高了公司员工的合规意识。

通过以上工作的开展，在本报告期内本基金运作过程中未发生违规情形，基金运作整体合法合规。在今后的工作中，本基金管理人承诺将一如既往的本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，为基金持有人谋求最大利益。

#### 4.7 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。

#### 4.8 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，基金收益分配后基金份额净值不能低于面值。本报告期内基金未实施收益分配。

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

无。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在华泰柏瑞基本面智选混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

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

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

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

### § 6 审计报告

#### 6.1 审计报告基本信息

|            |                       |
|------------|-----------------------|
| 财务报表是否经过审计 | 是                     |
| 审计意见类型     | 标准无保留意见               |
| 审计报告编号     | 德师报(审)字(25)第 P02926 号 |

#### 6.2 审计报告的基本内容

|         |  |
|---------|--|
| 审计报告标题  | 审计报告   |
| 审计报告收件人 | 华泰柏瑞基本面智选混合型证券投资基金全体持有人  |
| 审计意见    | 我们审计了华泰柏瑞基本面智选混合型证券投资基金的财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。<br>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了华泰柏瑞基本面智选混合型证券投资基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 |

|                 |   |
|-----------------|---|
|                 | 年度的经营成果和净资产变动情况。  |
| 形成审计意见的基础       | 我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于华泰柏瑞基本面智选混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。   |
| 强调事项            | -   |
| 其他事项            | -   |
| 其他信息            | <p>华泰柏瑞基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括华泰柏瑞基本面智选混合型证券投资基金年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p> |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | <p>基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估华泰柏瑞基本面智选混合型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算华泰柏瑞基本面智选混合型证券投资基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督华泰柏瑞基本面智选混合型证券投资基金的财务报告过程。</p>       |
| 注册会计师对财务报表审计的责任 | <p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错</p>                                   |

|           |  |
|-----------|--|
|           | <p>报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对华泰柏瑞基本面智选混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致华泰柏瑞基本面智选混合型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p> |
| 会计师事务所的名称 | 德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)   |
| 注册会计师的姓名  | 胡小骏 冯适   |
| 会计师事务所的地址 | 上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼   |
| 审计报告日期    | 2025 年 3 月 28 日  |

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞基本面智选混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产         | 附注号     | 本期末<br>2024 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|-------------------------|--------------------------|
| <b>资产：</b> |         |                         |                          |
| 货币资金       | 7.4.7.1 | 10,852,869.94           | 8,617,143.24             |
| 结算备付金      |         | 95,034.65               | 245,008.64               |
| 存出保证金      |         | 24,282.12               | 46,880.73                |
| 交易性金融资产    | 7.4.7.2 | 79,087,067.94           | 136,213,011.88           |

|               |            |                    |                    |
|---------------|------------|--------------------|--------------------|
| 其中：股票投资       |            | 79,087,067.94      | 136,213,011.88     |
| 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        | 7.4.7.3    | -                  | -                  |
| 买入返售金融资产      | 7.4.7.4    | -                  | -                  |
| 债权投资          | 7.4.7.5    | -                  | -                  |
| 其中：债券投资       |            | -                  | -                  |
| 资产支持证券投资      |            | -                  | -                  |
| 其他投资          |            | -                  | -                  |
| 其他债权投资        | 7.4.7.6    | -                  | -                  |
| 其他权益工具投资      | 7.4.7.7    | -                  | -                  |
| 应收清算款         |            | 181,557.51         | 2,311,085.07       |
| 应收股利          |            | -                  | -                  |
| 应收申购款         |            | 5,878.49           | 39,956.47          |
| 递延所得税资产       |            | -                  | -                  |
| 其他资产          | 7.4.7.8    | -                  | -                  |
| 资产总计          |            | 90,246,690.65      | 147,473,086.03     |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末</b>         | <b>上年度末</b>        |
|               |            | <b>2024年12月31日</b> | <b>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        | 7.4.7.3    | -                  | -                  |
| 卖出回购金融资产款     |            | -                  | -                  |
| 应付清算款         |            | 2.52               | 90,798.85          |
| 应付赎回款         |            | 170,972.87         | 147,954.01         |
| 应付管理人报酬       |            | 93,597.78          | 191,653.32         |
| 应付托管费         |            | 15,599.62          | 31,942.23          |
| 应付销售服务费       |            | 5,274.66           | 8,379.62           |
| 应付投资顾问费       |            | -                  | -                  |
| 应交税费          |            | 111.62             | 34.66              |
| 应付利润          |            | -                  | -                  |
| 递延所得税负债       |            | -                  | -                  |
| 其他负债          | 7.4.7.9    | 138,627.52         | 463,076.05         |
| 负债合计          |            | 424,186.59         | 933,838.74         |
| <b>净资产：</b>   |            |                    |                    |
| 实收基金          | 7.4.7.10   | 71,470,092.28      | 93,318,374.09      |
| 其他综合收益        | 7.4.7.11   | -                  | -                  |
| 未分配利润         | 7.4.7.12   | 18,352,411.78      | 53,220,873.20      |
| 净资产合计         |            | 89,822,504.06      | 146,539,247.29     |
| 负债和净资产总计      |            | 90,246,690.65      | 147,473,086.03     |

注：报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额总额 71,470,092.28 份，其中下属 A 类基金份额净值 1.2632 元，基金份额总额 51,902,078.76 份；下属 C 类基金份额净值 1.2398 元，基金份额总额 19,568,013.52 份。

## 7.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞基本面智选混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                     | 附注号      | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024<br>年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2023 年 1 月 1 日至 2023<br>年 12 月 31 日 |
|------------------------|----------|---|--|
| <b>一、营业总收入</b>         |          | -27,999,123.06                            | -185,882,270.99                                |
| 1. 利息收入                |          | 45,732.42                                 | 185,279.90                                     |
| 其中：存款利息收入              | 7.4.7.13 | 45,732.42                                 | 185,279.90                                     |
| 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）      |          | -51,031,579.38                            | -170,738,665.83                                |
| 其中：股票投资收益              | 7.4.7.14 | -53,064,442.54                            | -173,219,393.18                                |
| 基金投资收益                 |          | -   | -  |
| 债券投资收益                 | 7.4.7.15 | 413,295.50                                | 14,546.94                                      |
| 资产支持证券投资               | 7.4.7.16 | -   | -  |
| 收益                     |          |   |  |
| 贵金属投资收益                | 7.4.7.17 | -   | -  |
| 衍生工具收益                 | 7.4.7.18 | -   | -  |
| 股利收益                   | 7.4.7.19 | 1,619,567.66                              | 2,466,180.41                                   |
| 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） | 7.4.7.20 | 22,968,546.80                             | -15,479,555.70                                 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）     |          | -   | -  |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）     | 7.4.7.21 | 18,177.10                                 | 150,670.64                                     |
| <b>减：二、营业总支出</b>       |          | 1,671,094.07                              | 7,103,278.50                                   |

|                            |            |                |                 |
|----------------------------|------------|----------------|-----------------|
| 1. 管理人报酬                   | 7.4.10.2.1 | 1,261,646.43   | 5,609,648.05    |
| 其中：暂估管理人报酬                 |            | -              | -               |
| 2. 托管费                     | 7.4.10.2.2 | 210,274.33     | 934,941.41      |
| 3. 销售服务费                   | 7.4.10.2.3 | 67,094.18      | 338,611.37      |
| 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                  | 7.4.7.22   | -              | -               |
| 7. 税金及附加                   |            | 8.25           | -               |
| 8. 其他费用                    | 7.4.7.23   | 132,070.88     | 220,077.67      |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | -29,670,217.13 | -192,985,549.49 |
| 减：所得税费用                    |            | -              | -               |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | -29,670,217.13 | -192,985,549.49 |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>       |            | -              | -               |
| <b>六、综合收益总额</b>            |            | -29,670,217.13 | -192,985,549.49 |

### 7.3 净资产变动表

会计主体：华泰柏瑞基本面智选混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                   | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 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            | 93,318,374.09                          | -      | 53,220,873.20  | 146,539,247.29 |
| 加：会计政策变更             | -                                      | -      | -              | -              |
| 前期差错更正               | -                                      | -      | -              | -              |
| 其他                   | -                                      | -      | -              | -              |
| 二、本期期初净资产            | 93,318,374.09                          | -      | 53,220,873.20  | 146,539,247.29 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | -21,848,281.81                         | -      | -34,868,461.42 | -56,716,743.23 |
| （一）、综合收益总额           | -                                      | -      | -29,670,217.13 | -29,670,217.13 |
| （二）、本期基金份额交易产生的      | -21,848,281.81                         | -      | -5,198,244.29  | -27,046,526.10 |

|  |                                  |        |                |                 |
|--|----------------------------------|--------|----------------|-----------------|
| 净资产变动数<br>(净资产减少以“-”号填列)                 |                                  |        |                |                 |
| 其中: 1. 基金申购款                             | 8,636,402.08                     | -      | 2,422,812.95   | 11,059,215.03   |
| 2. 基金赎回款                                 | -30,484,683.89                   | -      | -7,621,057.24  | -38,105,741.13  |
| (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                                | 71,470,092.28                    | -      | 18,352,411.78  | 89,822,504.06   |
| 项目                                       | 上年度可比期间<br>2023年1月1日至2023年12月31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                                | 304,553,041.80                   | -      | 463,607,682.83 | 768,160,724.63  |
| 加: 会计政策变更                                | -                                | -      | -              | -               |
| 前期差错更正                                   | -                                | -      | -              | -               |
| 其他                                       | -                                | -      | -              | -               |
| 二、本期期初净资产                                | 304,553,041.80                   | -      | 463,607,682.83 | 768,160,724.63  |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | -                                | -      | -              | -621,621,477.34 |
|  | 211,234,667.71                   |        | 410,386,809.63 |                 |
| (一)、综合收益总额                               | -                                | -      | -              | -192,985,549.49 |
|  |                                  |        | 192,985,549.49 |                 |
| (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)      | -                                | -      | -              | -428,635,927.85 |
|  | 211,234,667.71                   |        | 217,401,260.14 |                 |
| 其中: 1. 基金申购款                             | 18,511,217.69                    | -      | 23,568,830.86  | 42,080,048.55   |

|  |                |   |                |                 |
|--|----------------|---|----------------|-----------------|
| 2. 基金赎回款                                 | -              | - | -              | -470,715,976.40 |
|  | 229,745,885.40 |   | 240,970,091.00 |                 |
| (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                                | 93,318,374.09  | - | 53,220,873.20  | 146,539,247.29  |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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    |

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞基本面智选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[2019]373号《关于准予华泰柏瑞基本面智选混合型证券投资基金注册的批复》注册,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《华泰柏瑞基本面智选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 234,887,888.76 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(2019)第 0320 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞基本面智选混合型证券投资基金基金合同》于 2019 年 6 月 5 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 234,977,724.58 份基金份额,其中认购资金利息折合 89,835.82 份基金份额。本基金的基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《华泰柏瑞基本面智选混合型证券投资基金招募说明书》,本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用的基金份额,称为 A 类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费

用的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞基本面智选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(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许投资的香港联合交易所上市的股票(以下简称“港股通标的股票”)、存托凭证、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、货币市场工具、股指期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金将根据法律法规的规定参与融资业务。本基金持有的股票资产及存托凭证的投资比例占基金资产的 60-95%；港股通标的股票投资比例不超过股票资产的 50%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为中证 800 指数收益率×80%+中债综合指数收益率×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 2025 年 03 月 28 日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)、中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2024 年度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 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

##### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

##### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

##### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

##### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

##### 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

##### (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项

等。

### (3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；

或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资 and 衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，

申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 7.4.4.13 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) 本基金的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，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 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。

##### 7.4.5.2 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。

##### 7.4.5.3 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。

#### 7.4.6 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》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2021]33号《关于北京证券交易所税收政策适用问题的公告》、财税[2024]8号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、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。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额

的适用比例计算缴纳。

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目             | 本期末              | 上年度末             |
|----------------|------------------|------------------|
|                | 2024 年 12 月 31 日 | 2023 年 12 月 31 日 |
| 活期存款           | 10,852,869.94    | 8,617,143.24     |
| 等于：本金          | 10,851,756.72    | 8,615,663.32     |
| 加：应计利息         | 1,113.22         | 1,479.92         |
| 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             | 10,852,869.94    | 8,617,143.24     |

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末              |      |               |              |
|---------------|------------------|------|---------------|--------------|
|               | 2024 年 12 月 31 日 |      |               |              |
|               | 成本               | 应计利息 | 公允价值          | 公允价值变动       |
| 股票            | 73,892,230.23    | -    | 79,087,067.94 | 5,194,837.71 |
| 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            | 73,892,230.23    | -    | 79,087,067.94 | 5,194,837.71 |

| 项目            | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |      |                |                |
|---------------|--------------------------|------|----------------|----------------|
|               | 成本                       | 应计利息 | 公允价值           | 公允价值变动         |
| 股票            | 153,986,720.97           | -    | 136,213,011.88 | -17,773,709.09 |
| 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            | 153,986,720.97           | -    | 136,213,011.88 | -17,773,709.09 |

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

##### 7.4.7.3.2 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。

##### 7.4.7.3.3 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。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

##### 7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

注：无。

#### 7.4.7.5 债权投资

##### 7.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有债权投资。

##### 7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有债权投资。

#### 7.4.7.6 其他债权投资

##### 7.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他债权投资。

##### 7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他债权投资。

#### 7.4.7.7 其他权益工具投资

##### 7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他权益工具。

##### 7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他权益工具。

#### 7.4.7.8 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

#### 7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2024年12月31日 | 上年度末<br>2023年12月31日 |
|-------------|--------------------|---------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                  | -                   |
| 应付赎回费       | 16.87              | 13.71               |
| 应付证券出借违约金   | -                  | -                   |
| 应付交易费用      | 33,610.65          | 288,062.34          |
| 其中：交易所市场    | 33,610.65          | 288,062.34          |
| 银行间市场       | -                  | -                   |
| 应付利息        | -                  | -                   |
| 预提费用        | 105,000.00         | 175,000.00          |
| 合计          | 138,627.52         | 463,076.05          |

#### 7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

华泰柏瑞基本面智选 A

| 项目            | 本期<br>2024年1月1日至2024年12月31日 |                |
|---------------|-----------------------------|----------------|
|               | 基金份额（份）                     | 账面金额           |
| 上年度末          | 68,583,924.85               | 68,583,924.85  |
| 本期申购          | 2,530,715.00                | 2,530,715.00   |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -19,212,561.09              | -19,212,561.09 |
| 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           | 51,902,078.76 | 51,902,078.76 |

华泰柏瑞基本面智选 C

| 项目            | 本期<br>2024年1月1日至2024年12月31日 |                |
|---------------|-----------------------------|----------------|
|               | 基金份额（份）                     | 账面金额           |
| 上年度末          | 24,734,449.24               | 24,734,449.24  |
| 本期申购          | 6,105,687.08                | 6,105,687.08   |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -11,272,122.80              | -11,272,122.80 |
| 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           | 19,568,013.52               | 19,568,013.52  |

注：申购（含红利再投）含转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期末无其他综合收益。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

华泰柏瑞基本面智选 A

| 项目             | 已实现部分          | 未实现部分          | 未分配利润合计        |
|----------------|----------------|----------------|----------------|
| 上年度末           | 478,946.62     | 39,080,011.86  | 39,558,958.48  |
| 加：会计政策变更       | -              | -              | -              |
| 前期差错更正         | -              | -              | -              |
| 其他             | -              | -              | -              |
| 本期期初           | 478,946.62     | 39,080,011.86  | 39,558,958.48  |
| 本期利润           | -39,255,373.57 | 17,295,763.78  | -21,959,609.79 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 8,855,145.66   | -12,793,987.32 | -3,938,841.66  |
| 其中：基金申购款       | -1,119,299.90  | 1,897,124.67   | 777,824.77     |
| 基金赎回款          | 9,974,445.56   | -14,691,111.99 | -4,716,666.43  |
| 本期已分配利润        | -              | -              | -              |
| 本期末            | -29,921,281.29 | 43,581,788.32  | 13,660,507.03  |

华泰柏瑞基本面智选 C

| 项目       | 已实现部分          | 未实现部分         | 未分配利润合计       |
|----------|----------------|---------------|---------------|
| 上年度末     | -311,400.71    | 13,973,315.43 | 13,661,914.72 |
| 加：会计政策变更 | -              | -             | -             |
| 前期差错更正   | -              | -             | -             |
| 其他       | -              | -             | -             |
| 本期期初     | -311,400.71    | 13,973,315.43 | 13,661,914.72 |
| 本期利润     | -13,383,390.36 | 5,672,783.02  | -7,710,607.34 |

|                |                |               |               |
|----------------|----------------|---------------|---------------|
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 2,151,569.82   | -3,410,972.45 | -1,259,402.63 |
| 其中：基金申购款       | -3,188,679.25  | 4,833,667.43  | 1,644,988.18  |
| 基金赎回款          | 5,340,249.07   | -8,244,639.88 | -2,904,390.81 |
| 本期已分配利润        | -              | -             | -             |
| 本期末            | -11,543,221.25 | 16,235,126.00 | 4,691,904.75  |

#### 7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2024年1月1日至2024年12月31日 | 上年度可比期间<br>2023年1月1日至2023年12月31日 |
|-----------|-----------------------------|----------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 33,417.15                   | 101,384.43                       |
| 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 | 11,507.43                   | 77,743.51                        |
| 其他        | 807.84                      | 6,151.96                         |
| 合计        | 45,732.42                   | 185,279.90                       |

注：其他为结算保证金利息收入和直销申购款利息收入。

#### 7.4.7.14 股票投资收益

##### 7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                   | 本期<br>2024年1月1日至2024年12月31日 | 上年度可比期间<br>2023年1月1日至2023年12月31日 |
|----------------------|-----------------------------|----------------------------------|
| 股票投资收益——买卖<br>股票差价收入 | -53,064,442.54              | -173,219,393.18                  |
| 股票投资收益——赎回<br>差价收入   | -                           | -                                |
| 股票投资收益——申购<br>差价收入   | -                           | -                                |
| 股票投资收益——证券<br>出借差价收入 | -                           | -                                |
| 合计                   | -53,064,442.54              | -173,219,393.18                  |

##### 7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2024年1月1日至2024年12月 | 上年度可比期间<br>2023年1月1日至2023年 |
|----|--------------------------|----------------------------|
|----|--------------------------|----------------------------|

|            | 31 日           | 12 月 31 日        |
|------------|----------------|------------------|
| 卖出股票成交总额   | 543,812,606.94 | 3,581,637,290.14 |
| 减：卖出股票成本总额 | 595,579,634.01 | 3,743,982,216.45 |
| 减：交易费用     | 1,297,415.47   | 10,874,466.87    |
| 买卖股票差价收入   | -53,064,442.54 | -173,219,393.18  |

#### 7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无股票投资收益——证券出借差价收入。

#### 7.4.7.15 债券投资收益

##### 7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                           | 本期<br>2024年1月1日至2024年12月<br>31日 | 上年度可比期间<br>2023年1月1日至2023年12月<br>31日 |
|------------------------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 债券投资收益——利息收入                 | 2,300.65                        | 15,891.94                            |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 410,994.85                      | -1,345.00                            |
| 债券投资收益——赎回差价收入               | -                               | -                                    |
| 债券投资收益——申购差价收入               | -                               | -                                    |
| 合计                           | 413,295.50                      | 14,546.94                            |

##### 7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                     | 本期<br>2024年1月1日至2024年12月<br>31日 | 上年度可比期间<br>2023年1月1日至2023年12月<br>31日 |
|------------------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 2,691,453.28                    | 2,854,640.00                         |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 2,273,046.18                    | 2,801,345.00                         |
| 减：应计利息总额               | 7,213.57                        | 54,640.00                            |

|          |            |           |
|----------|------------|-----------|
| 减：交易费用   | 198.68     | -         |
| 买卖债券差价收入 | 410,994.85 | -1,345.00 |

#### 7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益——赎回差价收入。

#### 7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益——申购差价收入。

#### 7.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

##### 7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

##### 7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益——赎回差价收入。

##### 7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益——申购差价收入。

#### 7.4.7.17 贵金属投资收益

##### 7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

##### 7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

##### 7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益——赎回差价收入。

##### 7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益——申购差价收入。

#### 7.4.7.18 衍生工具收益

##### 7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

##### 7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——其他投资收益。

#### 7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2024年1月1日至2024年12月31日 | 上年度可比期间<br>2023年1月1日至2023年12月31日 |
|---------------|-----------------------------|----------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 1,619,567.66                | 2,466,180.41                     |
| 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            | 1,619,567.66                | 2,466,180.41                     |

#### 7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期<br>2024年1月1日至2024年12月31日 | 上年度可比期间<br>2023年1月1日至2023年12月31日 |
|------------------------|-----------------------------|----------------------------------|
| 1. 交易性金融资产             | 22,968,546.80               | -15,479,555.70                   |
| 股票投资                   | 22,968,546.80               | -15,482,220.70                   |
| 债券投资                   | -                           | 2,665.00                         |
| 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                     | 22,968,546.80               | -15,479,555.70                   |

#### 7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2024年1月1日至2024年12月31日 | 上年度可比期间<br>2023年1月1日至2023年12月31日 |
|---------|-----------------------------|----------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 16,972.86                   | 126,473.45                       |
| 基金转换费收入 | 1,204.24                    | 24,197.19                        |
| 合计      | 18,177.10                   | 150,670.64                       |

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，A类基金份额不低于赎回费总额的25%归入基金资产，C类基金份额的赎回费全额归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出A类基金份

额赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产，转出 C 类基金份额赎回费全额归入基金资产。

#### 7.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期及上年度可比期间无信用减值损失。

#### 7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

| 项目       | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12<br>月 31 日 | 上年度可比期间<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31<br>日 |
|----------|---|--|
| 审计费用     | 25,000.00                                 | 55,000.00                                      |
| 信息披露费    | 80,000.00                                 | 120,000.00                                     |
| 证券出借违约金  | -   | -  |
| 证券组合费    | 904.53                                    | 7,549.40                                       |
| 银行间账户服务费 | 18,000.00                                 | 18,000.00                                      |
| 银行划款手续费  | 8,166.35                                  | 19,528.27                                      |
| 合计       | 132,070.88                                | 220,077.67                                     |

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 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。

##### 7.4.8.2 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。

#### 7.4.9 关联方关系

| 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       |
| PineBridge Investment LLC | 基金管理人的股东              |
| 苏州新区高新技术产业股份有限公司          | 基金管理人的股东              |
| 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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2024年1月1日至2024年12月31日 |                  | 上年度可比期间<br>2023年1月1日至2023年12月31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  | -                           | -                | 859,803,270.56                   | 12.72            |

#### 7.4.10.1.2 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。

#### 7.4.10.1.3 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。

#### 7.4.10.1.4 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。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2024年1月1日至2024年12月31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  | -                                | -              | -        | -                |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2023年1月1日至2023年12月31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  | 792,375.55                       | 12.84          | -        | -                |

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、根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自2024年7月1日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

## 7.4.10.2 关联方报酬

### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目               | 本期<br>2024年1月1日至2024年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2023年1月1日至2023<br>年12月31日 |
|------------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 1,261,646.43                    | 5,609,648.05                         |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 562,471.79                      | 1,792,116.38                         |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 699,174.64                      | 3,817,531.67                         |

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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.20\% / \text{当年天数}。$$

### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2024年1月1日至2024年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2023年1月1日至2023<br>年12月31日 |
|----------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 210,274.33                      | 934,941.41                           |

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

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

根据《华泰柏瑞基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，自 2023 年 8 月 26 日起，支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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

### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方 | 本期<br>2024年1月1日至2024年12月31日 |
|--------------|-----------------------------|
|              |                             |

| 名称                 | 当期发生的基金应支付的销售服务费                            |             |            |
|--------------------|---|-------------|------------|
|                    | 华泰柏瑞基本面智选 A                                 | 华泰柏瑞基本面智选 C | 合计         |
| 中国银行股份有限公司         | 0.00  | 23,491.78   | 23,491.78  |
| 华泰证券股份有限公司         | 0.00  | 270.48      | 270.48     |
| 华泰柏瑞基金管理有限公司       | 0.00  | 6,498.61    | 6,498.61   |
| 合计                 | 0.00  | 30,260.87   | 30,260.87  |
| 获得销售服务费的各关联方<br>名称 | 上年度可比期间<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日 |             |            |
|                    | 当期发生的基金应支付的销售服务费                            |             |            |
|                    | 华泰柏瑞基本面智选 A                                 | 华泰柏瑞基本面智选 C | 合计         |
| 中国银行股份有限公司         | 0.00  | 46,969.08   | 46,969.08  |
| 华泰证券股份有限公司         | 0.00  | 648.80      | 648.80     |
| 华泰柏瑞基金管理有限公司       | 0.00  | 76,155.44   | 76,155.44  |
| 合计                 | 0.00  | 123,773.32  | 123,773.32 |

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.25% 的年费率计提，计算方法如下：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

C 类基金份额销售服务费每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人按照与基金管理人约定的时间从基金资产中一次性支取。

#### 7.4.10.3 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。

#### 7.4.10.4 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

##### 7.4.10.4.1 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。

**7.4.10.4.2 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。

**7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**

**7.4.10.5.1 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。

**7.4.10.5.2 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。

**7.4.10.6 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<br>2024年1月1日至2024年12月31日 |           | 上年度可比期间<br>2023年1月1日至2023年12月31日 |            |
|-------|-----------------------------|-----------|----------------------------------|------------|
|       | 期末余额                        | 当期利息收入    | 期末余额                             | 当期利息收入     |
| 中国银行  | 10,852,869.94               | 33,417.15 | 8,617,143.24                     | 101,384.43 |

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

**7.4.10.7 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<br>2024年1月1日至2024年12月31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<br>2023年1月1日至2023年12月31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                           | 301566 | 达利凯普 | 网下申购 | 5,409      | 48,140.10 |
| 华泰联合证券                           | 301413 | 安培龙  | 网下申购 | 1,603      | 53,299.75 |

**7.4.10.8 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。

#### 7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2024 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 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。

##### 7.4.12.2 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。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

###### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 7.4.12.4 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。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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

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

#### 7.4.13.2 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开立的托管账户或其他商业银行开立的存款账户，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 12 月 31 日，本基金无债券投资 (2023 年 12 月 31 日：同)。

#### 7.4.13.3 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 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。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 12 月 31 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。

#### 7.4.13.4 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。

### 7.4.13.4.1 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。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2024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                        | 10,852,869.94 | -     | -      | -    | -    | -              | 10,852,869.94  |
| 结算备付金                       | 95,034.65     | -     | -      | -    | -    | -              | 95,034.65      |
| 存出保证金                       | 24,282.12     | -     | -      | -    | -    | -              | 24,282.12      |
| 交易性金融资产                     | -             | -     | -      | -    | -    | 79,087,067.94  | 79,087,067.94  |
| 应收申购款                       | -             | -     | -      | -    | -    | 5,878.49       | 5,878.49       |
| 应收清算款                       | -             | -     | -      | -    | -    | 181,557.51     | 181,557.51     |
| 资产总计                        | 10,972,186.71 | -     | -      | -    | -    | 79,274,503.94  | 90,246,690.65  |
| <b>负债</b>                   |               |       |        |      |      |                |                |
| 应付赎回款                       | -             | -     | -      | -    | -    | 170,972.87     | 170,972.87     |
| 应付管理人报酬                     | -             | -     | -      | -    | -    | 93,597.78      | 93,597.78      |
| 应付托管费                       | -             | -     | -      | -    | -    | 15,599.62      | 15,599.62      |
| 应付清算款                       | -             | -     | -      | -    | -    | 2.52           | 2.52           |
| 应付销售服务费                     | -             | -     | -      | -    | -    | 5,274.66       | 5,274.66       |
| 应交税费                        | -             | -     | -      | -    | -    | 111.62         | 111.62         |
| 其他负债                        | -             | -     | -      | -    | -    | 138,627.52     | 138,627.52     |
| 负债总计                        | -             | -     | -      | -    | -    | 424,186.59     | 424,186.59     |
| 利率敏感度缺口                     | 10,972,186.71 | -     | -      | -    | -    | 78,850,317.35  | 89,822,504.06  |
| <b>上年度末<br/>2023年12月31日</b> |               |       |        |      |      |                |                |
| <b>资产</b>                   |               |       |        |      |      |                |                |
| 货币资金                        | 8,617,143.24  | -     | -      | -    | -    | -              | 8,617,143.24   |
| 结算备付金                       | 245,008.64    | -     | -      | -    | -    | -              | 245,008.64     |
| 存出保证金                       | 46,880.73     | -     | -      | -    | -    | -              | 46,880.73      |
| 交易性金融资产                     | -             | -     | -      | -    | -    | 136,213,011.88 | 136,213,011.88 |
| 应收申购款                       | -             | -     | -      | -    | -    | 39,956.47      | 39,956.47      |
| 应收清算款                       | -             | -     | -      | -    | -    | 2,311,085.07   | 2,311,085.07   |

|         |              |   |   |   |   |                |                |
|---------|--------------|---|---|---|---|----------------|----------------|
| 资产总计    | 8,909,032.61 | - | - | - | - | 138,564,053.42 | 147,473,086.03 |
| 负债      |              |   |   |   |   |                |                |
| 应付赎回款   |              | - | - | - | - | 147,954.01     | 147,954.01     |
| 应付管理人报酬 |              | - | - | - | - | 191,653.32     | 191,653.32     |
| 应付托管费   |              | - | - | - | - | 31,942.23      | 31,942.23      |
| 应付清算款   |              | - | - | - | - | 90,798.85      | 90,798.85      |
| 应付销售服务费 |              | - | - | - | - | 8,379.62       | 8,379.62       |
| 应交税费    |              | - | - | - | - | 34.66          | 34.66          |
| 其他负债    |              | - | - | - | - | 463,076.05     | 463,076.05     |
| 负债总计    |              | - | - | - | - | 933,838.74     | 933,838.74     |
| 利率敏感度缺口 | 8,909,032.61 | - | - | - | - | 137,630,214.68 | 146,539,247.29 |

注：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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2024 年 12 月 31 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)。

#### 7.4.13.4.2 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。本基金持有不以记账本位币人民币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

| 项目                 | 本期末<br>2024 年 12 月 31 日 |              |               |              |
|--------------------|-------------------------|--------------|---------------|--------------|
|                    | 美元<br>折合人民币             | 港币<br>折合人民币  | 其他币种<br>折合人民币 | 合计           |
| 以外币计价的资产           |                         |              |               |              |
| 交易性金融资产            | -                       | 2,858,417.39 | -             | 2,858,417.39 |
| 资产合计               | -                       | 2,858,417.39 | -             | 2,858,417.39 |
| 以外币计价的负债           |                         |              |               |              |
| 负债合计               | -                       | -            | -             | -            |
| 资产负债表外<br>外汇风险敞口净额 | -                       | 2,858,417.39 | -             | 2,858,417.39 |

| 项目                    | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |               |               |               |
|-----------------------|--------------------------|---------------|---------------|---------------|
|                       | 美元<br>折合人民<br>币          | 港币<br>折合人民币   | 其他币种<br>折合人民币 | 合计            |
| 以外币计价的<br>资产          |                          |               |               |               |
| 交易性金融资<br>产           | -                        | 37,556,163.02 | -             | 37,556,163.02 |
| 资产合计                  | -                        | 37,556,163.02 | -             | 37,556,163.02 |
| 以外币计价的<br>负债          |                          |               |               |               |
| 负债合计                  | -                        | -             | -             | -             |
| 资产负债表外<br>汇风险敞口净<br>额 | -                        | 37,556,163.02 | -             | 37,556,163.02 |

#### 7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

| 假设                 | 除汇率以外的其他市场变量保持不变   |                                 |                           |
|--------------------|--------------------|---------------------------------|---------------------------|
| 分析                 | 相关风险变量的变<br>动      | 对资产负债表日基金资产净值的<br>影响金额（单位：人民币元） |                           |
|                    |                    | 本期末（2024 年 12 月 31<br>日）        | 上年度末（2023 年 12 月<br>31 日） |
|                    | 所有外币相对人民<br>币升值 5% | 142,920.87                      | 1,877,808.15              |
| 所有外币相对人民<br>币贬值 5% | -142,920.87        | -1,877,808.15                   |                           |

#### 7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2024年12月31日 |                   | 上年度末<br>2023年12月31日 |                   |
|---------------|--------------------|-------------------|---------------------|-------------------|
|               | 公允价值               | 占基金资产净值<br>比例 (%) | 公允价值                | 占基金资产净值<br>比例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资  | 79,087,067.94      | 88.05             | 136,213,011.88      | 92.95             |
| 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            | 79,087,067.94      | 88.05             | 136,213,011.88      | 92.95             |

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除业绩比较基准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12月31日）            | 上年度末（2023年12月31日） |
|    | 业绩比较基准上升5%           | 5,167,795.51                | 9,277,626.93      |
|    | 业绩比较基准下降5%           | -5,167,795.51               | -9,277,626.93     |

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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<br>2024 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|---------------|-------------------------|--------------------------|
| 第一层次          | 79,087,067.94           | 136,079,958.13           |
| 第二层次          | -                       | -                        |
| 第三层次          | -                       | 133,053.75               |
| 合计            | 79,087,067.94           | 136,213,011.88           |

7.4.14.2.2 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。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日 |            |            |
|----------------|--|------------|------------|
|                | 交易性金融资产                                |            | 合计         |
|                | 债券投资                                   | 股票投资       |            |
| 期初余额           | -                                      | 133,053.75 | 133,053.75 |
| 当期购买           | -                                      | -          | -          |
| 当期出售/结算        | -                                      | -          | -          |
| 转入第三层次         | -                                      | 23,746.81  | 23,746.81  |
| 转出第三层次         | -                                      | 169,906.47 | 169,906.47 |
| 当期利得或损失总额      | -                                      | 13,105.91  | 13,105.91  |
| 其中：计入损益的利得或损失  | -                                      | 13,105.91  | 13,105.91  |
| 计入其他综合收益的利得或损失 | -                                      | -          | -          |

|  |                                  |            |            |
|--|----------------------------------|------------|------------|
| 期末余额                                       | -                                | -          | -          |
| 期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益 | -                                | -          | -          |
| 项目   | 上年度可比期间<br>2023年1月1日至2023年12月31日 |            |            |
|  | 交易性金融资产                          |            | 合计         |
|  | 债券投资                             | 股票投资       |            |
| 期初余额                                       | -                                | -          | -          |
| 当期购买                                       | -                                | -          | -          |
| 当期出售/结算                                    | -                                | -          | -          |
| 转入第三层次                                     | -                                | 92,480.30  | 92,480.30  |
| 转出第三层次                                     | -                                | -          | -          |
| 当期利得或损失总额                                  | -                                | 40,573.45  | 40,573.45  |
| 其中：计入损益的利得或损失                              | -                                | 40,573.45  | 40,573.45  |
| 计入其他综合收益的利得或损失                             | -                                | -          | -          |
| 期末余额                                       | -                                | 133,053.75 | 133,053.75 |
| 期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益 | -                                | 40,573.45  | 40,573.45  |

注：于 2024 年度，本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资。

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

| 项目 | 本期末公允价值  | 采用的估值技术 | 不可观察输入值 |          |            |
|----|----------|---------|---------|----------|------------|
|    |          |         | 名称      | 范围/加权平均值 | 与公允价值之间的关系 |
| -  | -        | -       | -       | -        | -          |
| 项目 | 上年度末公允价值 | 采用的估值技术 | 不可观察输入值 |          |            |
|    |          |         | 名称      | 范围/加权平均值 | 与公允价值之间的关系 |

|                   |            |            |       |               |     |
|-------------------|------------|------------|-------|---------------|-----|
| 证券交易所上市但尚在限售期内的股票 | 133,053.75 | 平均价格亚式期权模型 | 预期波动率 | 0.2716~2.1752 | 负相关 |
|-------------------|------------|------------|-------|---------------|-----|

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2024 年 12 月 31 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)。

#### 7.4.14.4 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。

#### 7.4.15 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。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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              | 79,087,067.94 | 87.63         |
|    | 其中：股票             | 79,087,067.94 | 87.63         |
| 2  | 基金投资              | -             | -             |
| 3  | 固定收益投资            | -             | -             |
|    | 其中：债券             | -             | -             |
|    | 资产支持证券            | -             | -             |
| 4  | 贵金属投资             | -             | -             |
| 5  | 金融衍生品投资           | -             | -             |
| 6  | 买入返售金融资产          | -             | -             |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -             | -             |
| 7  | 银行存款和结算备付金合计      | 10,947,904.59 | 12.13         |
| 8  | 其他各项资产            | 211,718.12    | 0.23          |
| 9  | 合计                | 90,246,690.65 | 100.00        |

注：通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币 2,858,417.39 元，占基金资产净值的比例为 3.18%。

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 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         | 7,233,057.00  | 8.05         |
| B  | 采矿业              | 1,545,855.00  | 1.72         |
| C  | 制造业              | 49,746,822.55 | 55.38        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 5,005,994.00  | 5.57         |
| E  | 建筑业              | 757,706.00    | 0.84         |
| F  | 批发和零售业           | -             | -            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 6,829,206.00  | 7.60         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 2,332,016.00  | 2.60         |
| J  | 金融业              | -             | -            |
| K  | 房地产业             | 1,396,224.00  | 1.55         |
| 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    | 1,381,770.00  | 1.54         |
| 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               | 76,228,650.55 | 84.87        |

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别    | 公允价值（人民币）    | 占基金资产净值比例（%） |
|---------|--------------|--------------|
| 10 能源   | -            | -            |
| 15 原材料  | -            | -            |
| 20 工业   | -            | -            |
| 25 可选消费 | 766,761.12   | 0.85         |
| 30 主要消费 | -            | -            |
| 35 医药卫生 | -            | -            |
| 40 金融   | -            | -            |
| 45 信息技术 | -            | -            |
| 50 通信服务 | -            | -            |
| 55 公用事业 | 2,091,656.27 | 2.33         |
| 60 房地产  | -            | -            |
| 合计      | 2,858,417.39 | 3.18         |

注：以上分类采用中证行业分类标准。

### 8.3 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<br>(股) | 公允价值 (元)     | 占基金资产净值比例<br>(%) |
|----|--------|-------|-----------|--------------|------------------|
| 1  | 601985 | 中国核电  | 425,000   | 4,432,750.00 | 4.94             |
| 2  | 002215 | 诺普信   | 364,100   | 4,088,843.00 | 4.55             |
| 3  | 002475 | 立讯精密  | 88,300    | 3,599,108.00 | 4.01             |
| 4  | 300750 | 宁德时代  | 13,200    | 3,511,200.00 | 3.91             |
| 5  | 300699 | 光威复材  | 97,800    | 3,388,770.00 | 3.77             |
| 6  | 01816  | 中广核电力 | 792,530   | 2,091,656.27 | 2.33             |
| 6  | 003816 | 中国广核  | 138,800   | 573,244.00   | 0.64             |
| 7  | 002311 | 海大集团  | 53,000    | 2,599,650.00 | 2.89             |
| 8  | 600887 | 伊利股份  | 80,400    | 2,426,472.00 | 2.70             |
| 9  | 601118 | 海南橡胶  | 439,900   | 2,379,859.00 | 2.65             |
| 10 | 603150 | 万朗磁塑  | 88,500    | 2,346,135.00 | 2.61             |
| 11 | 000333 | 美的集团  | 31,100    | 2,339,342.00 | 2.60             |
| 12 | 002487 | 大金重工  | 104,200   | 2,135,058.00 | 2.38             |
| 13 | 603885 | 吉祥航空  | 149,000   | 2,041,300.00 | 2.27             |
| 14 | 601021 | 春秋航空  | 35,100    | 2,024,217.00 | 2.25             |
| 15 | 601111 | 中国国航  | 245,500   | 1,941,905.00 | 2.16             |
| 16 | 002714 | 牧原股份  | 47,700    | 1,833,588.00 | 2.04             |
| 17 | 000922 | 佳电股份  | 157,100   | 1,773,659.00 | 1.97             |
| 18 | 600489 | 中金黄金  | 128,500   | 1,545,855.00 | 1.72             |
| 19 | 600733 | 北汽蓝谷  | 187,400   | 1,499,200.00 | 1.67             |
| 20 | 688012 | 中微公司  | 7,802     | 1,475,826.32 | 1.64             |
| 21 | 002850 | 科达利   | 14,500    | 1,416,360.00 | 1.58             |
| 22 | 603606 | 东方电缆  | 26,900    | 1,413,595.00 | 1.57             |
| 23 | 601512 | 中新集团  | 181,800   | 1,396,224.00 | 1.55             |
| 24 | 600323 | 瀚蓝环境  | 58,500    | 1,381,770.00 | 1.54             |
| 25 | 601179 | 中国西电  | 178,500   | 1,354,815.00 | 1.51             |
| 26 | 002637 | 赞宇科技  | 133,900   | 1,318,915.00 | 1.47             |
| 27 | 603766 | 隆鑫通用  | 144,300   | 1,313,130.00 | 1.46             |
| 28 | 000977 | 浪潮信息  | 24,800    | 1,286,624.00 | 1.43             |
| 29 | 600522 | 中天科技  | 87,500    | 1,253,000.00 | 1.39             |
| 30 | 000400 | 许继电气  | 44,600    | 1,227,838.00 | 1.37             |
| 31 | 605296 | 神农集团  | 44,200    | 1,224,340.00 | 1.36             |
| 32 | 002840 | 华统股份  | 83,200    | 1,049,152.00 | 1.17             |
| 33 | 603477 | 巨星农牧  | 58,100    | 1,031,275.00 | 1.15             |
| 34 | 688166 | 博瑞医药  | 31,744    | 958,668.80   | 1.07             |
| 35 | 600118 | 中国卫星  | 35,100    | 958,230.00   | 1.07             |
| 36 | 600104 | 上汽集团  | 45,900    | 952,884.00   | 1.06             |
| 37 | 600419 | 天润乳业  | 99,800    | 929,138.00   | 1.03             |
| 38 | 300682 | 朗新集团  | 71,600    | 873,520.00   | 0.97             |
| 39 | 002928 | 华夏航空  | 105,900   | 821,784.00   | 0.91             |
| 40 | 09690  | 途虎-W  | 46,000    | 766,761.12   | 0.85             |
| 41 | 002458 | 益生股份  | 79,500    | 763,995.00   | 0.85             |

|    |        |      |        |            |      |
|----|--------|------|--------|------------|------|
| 42 | 601117 | 中国化学 | 91,400 | 757,706.00 | 0.84 |
| 43 | 600406 | 国电南瑞 | 26,500 | 668,330.00 | 0.74 |
| 44 | 688665 | 四方光电 | 20,277 | 660,827.43 | 0.74 |
| 45 | 605196 | 华通线缆 | 52,900 | 617,872.00 | 0.69 |
| 46 | 600312 | 平高电气 | 32,000 | 614,400.00 | 0.68 |
| 47 | 688036 | 传音控股 | 4,938  | 469,110.00 | 0.52 |
| 48 | 002025 | 航天电器 | 9,000  | 437,040.00 | 0.49 |
| 49 | 301592 | 六九一二 | 3,000  | 436,500.00 | 0.49 |
| 50 | 301213 | 观想科技 | 8,200  | 353,666.00 | 0.39 |
| 51 | 002765 | 蓝黛科技 | 38,600 | 331,960.00 | 0.37 |

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 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  | 601689 | 拓普集团 | 9,437,211.57 | 6.44            |
| 2  | 601666 | 平煤股份 | 8,966,479.83 | 6.12            |
| 3  | 300354 | 东华测试 | 8,605,998.74 | 5.87            |
| 4  | 03347  | 泰格医药 | 6,192,349.96 | 4.23            |
| 4  | 300347 | 泰格医药 | 2,409,865.48 | 1.64            |
| 5  | 600188 | 兖矿能源 | 8,560,068.50 | 5.84            |
| 6  | 600200 | 江苏吴中 | 8,405,909.00 | 5.74            |
| 7  | 002517 | 恺英网络 | 7,635,112.00 | 5.21            |
| 8  | 600546 | 山煤国际 | 7,116,521.00 | 4.86            |
| 9  | 600733 | 北汽蓝谷 | 6,135,398.00 | 4.19            |
| 10 | 002475 | 立讯精密 | 5,912,911.26 | 4.04            |
| 11 | 002487 | 大金重工 | 5,847,257.49 | 3.99            |
| 12 | 688017 | 绿的谐波 | 5,792,001.55 | 3.95            |
| 13 | 300033 | 同花顺  | 5,789,546.15 | 3.95            |
| 14 | 000975 | 山金国际 | 5,783,268.00 | 3.95            |
| 15 | 688110 | 东芯股份 | 5,772,221.11 | 3.94            |
| 16 | 688256 | 寒武纪  | 5,479,020.78 | 3.74            |
| 17 | 688697 | 纽威数控 | 5,440,602.16 | 3.71            |
| 18 | 002558 | 巨人网络 | 5,255,176.00 | 3.59            |
| 19 | 603596 | 伯特利  | 5,065,338.00 | 3.46            |
| 20 | 688687 | 凯因科技 | 4,996,930.10 | 3.41            |
| 21 | 000425 | 徐工机械 | 4,944,798.00 | 3.37            |
| 22 | 002050 | 三花智控 | 4,813,995.19 | 3.29            |
| 23 | 601699 | 潞安环能 | 4,659,676.00 | 3.18            |
| 24 | 601985 | 中国核电 | 4,625,094.00 | 3.16            |
| 25 | 002215 | 诺普信  | 4,595,617.00 | 3.14            |
| 26 | 002850 | 科达利  | 4,501,489.00 | 3.07            |
| 27 | 600480 | 凌云股份 | 4,500,680.00 | 3.07            |

|    |        |       |              |      |
|----|--------|-------|--------------|------|
| 28 | 300315 | 掌趣科技  | 4,375,149.09 | 2.99 |
| 29 | 601021 | 春秋航空  | 4,337,840.00 | 2.96 |
| 30 | 02367  | 巨子生物  | 4,177,751.94 | 2.85 |
| 31 | 601989 | 中国重工  | 4,116,733.00 | 2.81 |
| 32 | 601899 | 紫金矿业  | 3,982,960.00 | 2.72 |
| 33 | 002897 | 意华股份  | 3,839,983.00 | 2.62 |
| 34 | 000568 | 泸州老窖  | 3,809,775.00 | 2.60 |
| 35 | 01818  | 招金矿业  | 3,756,902.78 | 2.56 |
| 36 | 03800  | 协鑫科技  | 3,700,851.72 | 2.53 |
| 37 | 600916 | 中国黄金  | 3,553,467.45 | 2.42 |
| 38 | 600176 | 中国巨石  | 3,542,782.00 | 2.42 |
| 39 | 01816  | 中广核电力 | 2,951,772.31 | 2.01 |
| 39 | 003816 | 中国广核  | 569,315.00   | 0.39 |
| 40 | 688720 | 艾森股份  | 3,449,959.33 | 2.35 |
| 41 | 600702 | 舍得酒业  | 3,362,700.00 | 2.29 |
| 42 | 300699 | 光威复材  | 3,273,922.00 | 2.23 |
| 43 | 600489 | 中金黄金  | 3,249,034.00 | 2.22 |
| 44 | 300494 | 盛天网络  | 3,236,475.60 | 2.21 |
| 45 | 601118 | 海南橡胶  | 3,102,571.00 | 2.12 |
| 46 | 01024  | 快手-W  | 3,052,150.00 | 2.08 |
| 47 | 002605 | 姚记科技  | 3,020,719.00 | 2.06 |
| 48 | 603728 | 鸣志电器  | 2,997,403.00 | 2.05 |
| 49 | 002241 | 歌尔股份  | 2,964,230.00 | 2.02 |
| 50 | 300750 | 宁德时代  | 2,953,192.00 | 2.02 |

注：不考虑相关交易费用。

#### 8.4.2 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  | 600200 | 江苏吴中    | 12,061,251.00 | 8.23           |
| 2  | 03759  | 康龙化成    | 9,950,145.37  | 6.79           |
| 2  | 300759 | 康龙化成    | 505,898.00    | 0.35           |
| 3  | 000625 | 长安汽车    | 10,163,618.86 | 6.94           |
| 4  | 01548  | 金斯瑞生物科技 | 9,190,968.34  | 6.27           |
| 5  | 603596 | 伯特利     | 9,145,593.00  | 6.24           |
| 6  | 600188 | 兖矿能源    | 9,114,510.00  | 6.22           |
| 7  | 03347  | 泰格医药    | 6,592,821.42  | 4.50           |
| 7  | 300347 | 泰格医药    | 2,462,488.00  | 1.68           |
| 8  | 601689 | 拓普集团    | 9,039,993.50  | 6.17           |
| 9  | 601666 | 平煤股份    | 8,505,453.40  | 5.80           |
| 10 | 300354 | 东华测试    | 8,110,080.46  | 5.53           |
| 11 | 002919 | 名臣健康    | 7,797,988.38  | 5.32           |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 12 | 002517 | 恺英网络 | 7,747,090.77 | 5.29 |
| 13 | 300896 | 爱美客  | 7,494,107.20 | 5.11 |
| 14 | 000568 | 泸州老窖 | 6,963,405.00 | 4.75 |
| 15 | 300474 | 景嘉微  | 6,908,121.28 | 4.71 |
| 16 | 600546 | 山煤国际 | 6,317,138.00 | 4.31 |
| 17 | 02367  | 巨子生物 | 6,005,193.53 | 4.10 |
| 18 | 002475 | 立讯精密 | 5,766,884.00 | 3.94 |
| 19 | 688256 | 寒武纪  | 5,761,088.30 | 3.93 |
| 20 | 301045 | 天禄科技 | 5,743,859.32 | 3.92 |
| 21 | 600418 | 江淮汽车 | 5,713,636.50 | 3.90 |
| 22 | 688697 | 纽威数控 | 5,612,948.13 | 3.83 |
| 23 | 688121 | 卓然股份 | 5,566,621.85 | 3.80 |
| 24 | 000975 | 山金国际 | 5,400,258.00 | 3.69 |
| 25 | 002846 | 英联股份 | 5,381,745.00 | 3.67 |
| 26 | 600702 | 舍得酒业 | 5,177,384.00 | 3.53 |
| 27 | 002558 | 巨人网络 | 5,157,028.00 | 3.52 |
| 28 | 688127 | 蓝特光学 | 5,066,220.88 | 3.46 |
| 29 | 300031 | 宝通科技 | 5,046,620.38 | 3.44 |
| 30 | 688110 | 东芯股份 | 4,972,567.59 | 3.39 |
| 31 | 300033 | 同花顺  | 4,971,689.00 | 3.39 |
| 32 | 688017 | 绿的谐波 | 4,883,501.18 | 3.33 |
| 33 | 600480 | 凌云股份 | 4,802,440.00 | 3.28 |
| 34 | 02269  | 药明生物 | 4,744,815.88 | 3.24 |
| 35 | 002821 | 凯莱英  | 4,537,343.00 | 3.10 |
| 36 | 600733 | 北汽蓝谷 | 4,489,813.89 | 3.06 |
| 37 | 300315 | 掌趣科技 | 4,368,015.00 | 2.98 |
| 38 | 688687 | 凯因科技 | 4,344,934.54 | 2.97 |
| 39 | 000425 | 徐工机械 | 4,283,969.00 | 2.92 |
| 40 | 002050 | 三花智控 | 4,262,527.00 | 2.91 |
| 41 | 01818  | 招金矿业 | 4,166,361.97 | 2.84 |
| 42 | 002241 | 歌尔股份 | 4,111,414.00 | 2.81 |
| 43 | 002897 | 意华股份 | 3,980,168.00 | 2.72 |
| 44 | 600176 | 中国巨石 | 3,979,602.00 | 2.72 |
| 45 | 601989 | 中国重工 | 3,896,762.00 | 2.66 |
| 46 | 688111 | 金山办公 | 3,827,546.73 | 2.61 |
| 47 | 601699 | 潞安环能 | 3,776,680.00 | 2.58 |
| 48 | 300494 | 盛天网络 | 3,768,692.20 | 2.57 |
| 49 | 601899 | 紫金矿业 | 3,764,060.00 | 2.57 |
| 50 | 600916 | 中国黄金 | 3,630,378.00 | 2.48 |
| 51 | 688332 | 中科蓝讯 | 3,426,606.13 | 2.34 |
| 52 | 688698 | 伟创电气 | 3,383,580.91 | 2.31 |
| 53 | 01024  | 快手-W | 3,318,943.60 | 2.26 |
| 54 | 300406 | 九强生物 | 3,298,044.00 | 2.25 |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 55 | 300748 | 金力永磁 | 3,252,044.40 | 2.22 |
| 56 | 688313 | 仕佳光子 | 3,244,898.98 | 2.21 |
| 57 | 03800  | 协鑫科技 | 3,149,081.50 | 2.15 |
| 58 | 002487 | 大金重工 | 3,099,389.00 | 2.12 |
| 59 | 002605 | 姚记科技 | 3,012,489.04 | 2.06 |

注：不考虑相关交易费用。

#### 8.4.3 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 | 515,485,143.27 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 543,812,606.94 |

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。

#### 8.5 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。

#### 8.6 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。

#### 8.7 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。

#### 8.8 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。

#### 8.9 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。

#### 8.10 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。

#### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 8.11.1 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。

##### 8.11.2 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。

#### 8.12 投资组合报告附注

##### 8.12.1 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，海南橡胶（601118）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。

### 8.12.2 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。

### 8.12.3 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 | 24,282.12  |
| 2  | 应收清算款 | 181,557.51 |
| 3  | 应收股利  | -          |
| 4  | 应收利息  | -          |
| 5  | 应收申购款 | 5,878.49   |
| 6  | 其他应收款 | -          |
| 7  | 待摊费用  | -          |
| 8  | 其他    | -          |
| 9  | 合计    | 211,718.12 |

### 8.12.4 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。

### 8.12.5 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。

### 8.12.6 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别 | 持有人户数<br>(户) | 户均持有的基<br>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<br>额比例<br>(%) | 持有份额          | 占总份<br>额比例<br>(%) |
| 华泰柏瑞 | 4,442        | 11,684.39     | 0.00  | 0.00              | 51,902,078.76 | 100.00            |

|             |        |          |      |      |               |        |
|-------------|--------|----------|------|------|---------------|--------|
| 基本面智选 A     |        |          |      |      |               |        |
| 华泰柏瑞基本面智选 C | 7,717  | 2,535.70 | 0.00 | 0.00 | 19,568,013.52 | 100.00 |
| 合计          | 11,723 | 6,096.57 | 0.00 | 0.00 | 71,470,092.28 | 100.00 |

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 份额级别        | 持有份额总数（份）    | 占基金总份额比例（%） |
|------------------|-------------|--------------|-------------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 华泰柏瑞基本面智选 A | 47,051.90    | 0.0907      |
|                  | 华泰柏瑞基本面智选 C | 1,482,708.82 | 7.5772      |
|                  | 合计          | 1,529,760.72 | 2.1404      |

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目                           | 份额级别        | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|------------------------------|-------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金 | 华泰柏瑞基本面智选 A | 0                 |
|                              | 华泰柏瑞基本面智选 C | >100              |
|                              | 合计          | >100              |
| 本基金基金经理持有本开放式基金              | 华泰柏瑞基本面智选 A | 0                 |
|                              | 华泰柏瑞基本面智选 C | 0~10              |
|                              | 合计          | 0~10              |

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                       | 华泰柏瑞基本面智选 A    | 华泰柏瑞基本面智选 C   |
|--------------------------|----------------|---------------|
| 基金合同生效日（2019年6月5日）基金份额总额 | 158,199,210.25 | 76,778,514.33 |
| 本报告期初基金份额总额              | 68,583,924.85  | 24,734,449.24 |
| 本报告期基金总申购份额              | 2,530,715.00   | 6,105,687.08  |
| 减：本报告期基金总赎回份额            | 19,212,561.09  | 11,272,122.80 |
| 本报告期基金拆分                 | -              | -             |

|             |               |               |
|-------------|---------------|---------------|
| 变动份额        |               |               |
| 本报告期末基金份额总额 | 51,902,078.76 | 19,568,013.52 |

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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。

2024 年 7 月 2 日，经公司董事会审议通过，柳军先生、王文慧女士任公司副总经理。

2024 年 7 月 12 日，经公司董事会审议通过，李晓西先生不再担任公司副总经理。

2024 年 7 月 2 日，柳军先生任公司副总经理，根据法规要求，不再担任职工监事。

2024 年 7 月 11 日，公司全体员工投票推选赵景云女士担任公司职工监事。

2024 年 8 月 16 日，公司股东会书面决定卢龙威先生担任公司监事，卞时珍女士不再担任公司监事。

上述人事变动已按相关规定备案、报告。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

本报告期内，经中国银行股份有限公司研究决定，郭德秋先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 11.3 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。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金提供审计服务的机构由普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)变更为德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)。本基金本年度支付给审计机构德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)的报酬为 25,000.00 元人民币，其已提供审计服务的连续年限为 1

年。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 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。

#### 11.6.2 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。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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 (%) |    |
| 国泰君安 | 1      | 176,988,524.06 | 16.71            | 128,341.20 | 14.86          | -  |
| 方正证券 | 3      | 156,587,196.48 | 14.78            | 148,112.57 | 17.15          | -  |
| 海通证券 | 2      | 121,447,613.40 | 11.47            | 114,424.61 | 13.25          | -  |
| 中金公司 | 2      | 119,679,738.48 | 11.30            | 84,008.37  | 9.73           | -  |
| 广发证券 | 4      | 102,664,058.67 | 9.69             | 69,404.77  | 8.04           | -  |
| 中信证券 | 5      | 78,656,702.92  | 7.43             | 69,730.48  | 8.07           | -  |
| 申万宏源 | 3      | 73,301,638.34  | 6.92             | 55,455.62  | 6.42           | -  |
| 国联证券 | 2      | 42,057,425.18  | 3.97             | 36,894.08  | 4.27           | -  |
| 华鑫证券 | 1      | 32,543,511.47  | 3.07             | 30,457.26  | 3.53           | -  |
| 国信证券 | 2      | 25,871,201.11  | 2.44             | 23,134.09  | 2.68           | -  |
| 兴业证券 | 3      | 21,255,956.28  | 2.01             | 10,628.58  | 1.23           | -  |
| 国海证券 | 1      | 19,480,511.56  | 1.84             | 15,960.87  | 1.85           | -  |
| 东方证券 | 3      | 19,124,421.03  | 1.81             | 15,228.82  | 1.76           | -  |

|          |   |                   |      |           |      |   |
|----------|---|-------------------|------|-----------|------|---|
| 东北证券     | 3 | 17,046,607.<br>20 | 1.61 | 16,125.19 | 1.87 | - |
| 国金证券     | 1 | 13,343,776.<br>56 | 1.26 | 10,358.84 | 1.20 | - |
| 华安证券     | 2 | 11,978,506.<br>41 | 1.13 | 11,329.97 | 1.31 | - |
| 财通证券     | 3 | 10,930,065.<br>74 | 1.03 | 10,337.77 | 1.20 | - |
| 中银国际     | 3 | 5,310,827.7<br>2  | 0.50 | 5,018.04  | 0.58 | - |
| 国元证券     | 1 | 3,653,723.9<br>5  | 0.34 | 3,455.87  | 0.40 | - |
| 万联证券     | 2 | 3,356,755.0<br>2  | 0.32 | 3,174.80  | 0.37 | - |
| 光大证券     | 2 | 2,800,497.3<br>8  | 0.26 | 1,400.26  | 0.16 | - |
| 华创证券     | 1 | 1,121,376.0<br>0  | 0.11 | 560.83    | 0.06 | - |
| 高盛（中国）证券 | 1 | -                 | -    | -         | -    | - |
| 渤海证券     | 1 | -                 | -    | -         | -    | - |
| 长城证券     | 1 | -                 | -    | -         | -    | - |
| 长江证券     | 4 | -                 | -    | -         | -    | - |
| 大同证券     | 2 | -                 | -    | -         | -    | - |
| 东方财富证券   | 2 | -                 | -    | -         | -    | - |
| 东吴证券     | 2 | -                 | -    | -         | -    | - |
| 东兴证券     | 2 | -                 | -    | -         | -    | - |
| 国都证券     | 1 | -                 | -    | -         | -    | - |
| 国投证券     | 3 | -                 | -    | -         | -    | - |
| 恒泰证券     | 1 | -                 | -    | -         | -    | - |
| 华福证券     | 2 | -                 | -    | -         | -    | - |
| 华龙证券     | 1 | -                 | -    | -         | -    | - |
| 国新证券     | 1 | -                 | -    | -         | -    | - |
| 华泰证券     | 4 | -                 | -    | -         | -    | - |
| 民生证券     | 1 | -                 | -    | -         | -    | - |
| 瑞银证券     | 2 | -                 | -    | -         | -    | - |
| 申港证券     | 2 | -                 | -    | -         | -    | - |
| 天风证券     | 2 | -                 | -    | -         | -    | - |
| 西部证券     | 1 | -                 | -    | -         | -    | - |
| 西南证券     | 1 | -                 | -    | -         | -    | - |
| 湘财证券     | 1 | -                 | -    | -         | -    | - |
| 诚通证券     | 2 | -                 | -    | -         | -    | - |
| 信达证券     | 2 | -                 | -    | -         | -    | - |

|            |   |   |   |   |   |   |
|------------|---|---|---|---|---|---|
| 银河证券       | 4 | - | - | - | - | - |
| 招商证券       | 1 | - | - | - | - | - |
| 浙商证券       | 2 | - | - | - | - | - |
| 中金财富<br>证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中泰证券       | 3 | - | - | - | - | - |
| 中信建投       | 3 | - | - | - | - | - |

注：1. 选择证券公司参与证券交易的标准

公司选择财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强的证券公司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综合考虑下列因素：

(1) 具有相应的业务经营资格；

(2) 具备研究实力，有固定的研究机构和充足的研究人员，或者获得过知名金融媒体奖项，能及时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，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告和特色研究服务等；

(3) 诚信记录良好，最近两年券商研究、交易业务无重大违法违规行为，未受监管机构重大处罚；

(4) 财务状况良好，信誉良好，内部管理规范、严格，风控合规管理人员充足，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

(5) 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；  
(6) 被动股票型基金选择的提供交易单元的券商需综合考虑上述(1)、(3)、(4)和(5)基本条件，在此基础上可以设置指标进行评价，对相关未公开数据、证券公司内部业务流程及其他适用并纳入评价标准的相关信息，公司相关部门发送《尽职调查函》至各证券公司详询。

根据上述条件标准，公司建立被动股票型基金和其他类型基金证券公司白名单。

证券公司白名单进行定期或不定期更新，每年更新不得少于一次。

2. 选择证券公司参与证券交易的程序

公司选择证券公司租用基金专用交易席位，应遵循以下程序：

(1) 公司投研部门根据拟合作的证券公司名单，负责安排与券商签订经公司合规法律部审核的《证券研究服务协议》，协议需约定双方的权利义务，明确服务内容、收取交易佣金的价格标准与计算方式。

(2) 基金事务部依据公司相关部门对券商的综合评价，根据基金运作需要，与券商签署《证券交易单元租用协议》。

(3)如因业务需要，公司需新增租用已合作券商的交易单元，基金事务部应提出申请，与券商签订《证券交易单元租用协议》。

公司选择代理证券买卖的证券经营机构的程序：

基金管理人根据业务需要与被选择的证券经营机构签订证券经纪服务协议。

3. 本部分的数据统计时间区间与本报告的报告期一致，统计范围仅包括本基金；本公司官网披露的本公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）的报告期为 2024 年 7 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日，统计范围为报告期间存续过的所有公募基金，包括报告期间成立、清算、转型的公募基金。

4. 本报告期内，无变更租用证券公司交易单元的情况。

### 11.7.2 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 (%) |
| 海通证券 | -            | -                | -      | -                  | -    | -                |
| 中金公司 | -            | -                | -      | -                  | -    | -                |
| 中信证券 | -            | -                | -      | -                  | -    | -                |
| 方正证券 | -            | -                | -      | -                  | -    | -                |
| 广发证券 | -            | -                | -      | -                  | -    | -                |
| 申万宏源 | -            | -                | -      | -                  | -    | -                |
| 国泰君安 | -            | -                | -      | -                  | -    | -                |
| 国联证券 | 515,024.84   | 10.36            | -      | -                  | -    | -                |
| 华鑫证券 | -            | -                | -      | -                  | -    | -                |
| 兴业证券 | 577,350.50   | 11.61            | -      | -                  | -    | -                |
| 国海证券 | 1,924,786.20 | 38.71            | -      | -                  | -    | -                |

|                      |                  |       |   |   |   |   |
|----------------------|------------------|-------|---|---|---|---|
| 国信证<br>券             | -                | -     | - | - | - | - |
| 东方证<br>券             | 1,533,406.<br>44 | 30.84 | - | - | - | - |
| 东北证<br>券             | -                | -     | - | - | - | - |
| 国金证<br>券             | 170,703.45       | 3.43  | - | - | - | - |
| 华安证<br>券             | -                | -     | - | - | - | - |
| 财通证<br>券             | -                | -     | - | - | - | - |
| 国元证<br>券             | -                | -     | - | - | - | - |
| 万联证<br>券             | -                | -     | - | - | - | - |
| 光大证<br>券             | -                | -     | - | - | - | - |
| 中银国<br>际             | -                | -     | - | - | - | - |
| 华创证<br>券             | 251,642.24       | 5.06  | - | - | - | - |
| 高盛<br>(中<br>国)证<br>券 | -                | -     | - | - | - | - |
| 渤海证<br>券             | -                | -     | - | - | - | - |
| 长城证<br>券             | -                | -     | - | - | - | - |
| 长江证<br>券             | -                | -     | - | - | - | - |
| 大同证<br>券             | -                | -     | - | - | - | - |
| 东方财<br>富证券           | -                | -     | - | - | - | - |
| 东吴证<br>券             | -                | -     | - | - | - | - |
| 东兴证<br>券             | -                | -     | - | - | - | - |
| 国都证<br>券             | -                | -     | - | - | - | - |
| 国投证<br>券             | -                | -     | - | - | - | - |

|            |   |   |   |   |   |   |
|------------|---|---|---|---|---|---|
| 恒泰证<br>券   | - | - | - | - | - | - |
| 华福证<br>券   | - | - | - | - | - | - |
| 华龙证<br>券   | - | - | - | - | - | - |
| 国新证<br>券   | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证<br>券   | - | - | - | - | - | - |
| 民生证<br>券   | - | - | - | - | - | - |
| 瑞银证<br>券   | - | - | - | - | - | - |
| 申港证<br>券   | - | - | - | - | - | - |
| 天风证<br>券   | - | - | - | - | - | - |
| 西部证<br>券   | - | - | - | - | - | - |
| 西南证<br>券   | - | - | - | - | - | - |
| 湘财证<br>券   | - | - | - | - | - | - |
| 诚通证<br>券   | - | - | - | - | - | - |
| 信达证<br>券   | - | - | - | - | - | - |
| 银河证<br>券   | - | - | - | - | - | - |
| 招商证<br>券   | - | - | - | - | - | - |
| 浙商证<br>券   | - | - | - | - | - | - |
| 中金财<br>富证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证<br>券   | - | - | - | - | - | - |
| 中信建<br>投   | - | - | - | - | - | - |

### 11.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项                           | 法定披露方式     | 法定披露日期           |
|----|--------------------------------|------------|------------------|
| 1  | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金的销售机构由北京中植 | 证监会规定报刊和网站 | 2024 年 12 月 19 日 |

|    |  |            |                  |
|----|--|------------|------------------|
|    | 基金销售有限公司变更为华源证券股份有限公司的公告                     |            |                  |
| 2  | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止乾道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 11 月 18 日 |
| 3  | 华泰柏瑞基金管理有限公司旗下部分基金改聘会计师事务所公告                 | 证监会规定报刊和网站 | 2024 年 11 月 02 日 |
| 4  | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金持有停牌证券估值调整的提示性公告           | 证监会规定报刊和网站 | 2024 年 09 月 27 日 |
| 5  | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于暂停海银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 09 月 19 日 |
| 6  | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止深圳前海财厚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 09 月 04 日 |
| 7  | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止中民财富基金销售（上海）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 08 月 16 日 |
| 8  | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞基本面智选混合型证券投资基金基金经理变更的公告    | 证监会规定报刊和网站 | 2024 年 08 月 03 日 |
| 9  | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于停牌股票估值调整情况的公告                  | 证监会规定报刊和网站 | 2024 年 07 月 24 日 |
| 10 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金参加招商证券股份有限公司费率优惠活动的公告      | 证监会规定报刊和网站 | 2024 年 07 月 19 日 |
| 11 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告                    | 证监会规定报刊和网站 | 2024 年 07 月 13 日 |
| 12 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止喜鹊财富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 07 月 06 日 |
| 13 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告                    | 证监会规定报刊和网站 | 2024 年 07 月 03 日 |
| 14 | 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 |
| 15 | 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 |
| 16 | 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 |
| 17 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于对                              | 证监会规定报刊和网站 | 2024 年 02 月 01 日 |

|    |  |            |                  |
|----|--|------------|------------------|
|    | 营业执照吊销客户采取限制交易措施的公告                        |            |                  |
| 18 | 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 |

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 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

### 13.2 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

### 13.3 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

2025 年 3 月 31 日