

华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资
基金
2025 年中期报告

2025 年 6 月 30 日

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2025 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 8 月 29 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，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2025 年 1 月 1 日起至 2025 年 6 月 30 日止。

华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金于 2018 年 6 月 19 日根据收费方式分不同，新增 C 类份额，C 类相关指标从 2018 年 6 月 19 日开始计算。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	45
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	56
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	57
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	57

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	58
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	58
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	58
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	58
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	58
7.12 投资组合报告附注	58
§ 8 基金份额持有人信息	59
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	59
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	59
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	59
§ 9 开放式基金份额变动	60
§ 10 重大事件揭示	60
10.1 基金份额持有人大会决议	60
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	61
10.4 基金投资策略的改变	61
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	61
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	61
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	61
10.8 其他重大事件	64
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	65
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	65
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	65
§ 12 备查文件目录	65
12.1 备查文件目录	65
12.2 存放地点	65
12.3 查阅方式	65

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	华泰柏瑞量化智慧混合	
基金主代码	001244	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 6 月 3 日	
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	163,538,438.30 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华泰柏瑞量化智慧混合 A	华泰柏瑞量化智慧混合 C
下属分级基金的交易代码	001244	006104
报告期末下属分级基金的份额总额	137,863,024.80 份	25,675,413.50 份

2.2 基金产品说明

投资目标	利用定量投资模型，在有效控制风险的前提下，追求资产的长期增值，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	<p>本基金投资策略如下：</p> <p>1、股票投资策略</p> <p>本基金主要通过定量投资模型，选取并持有预期收益较好的股票构成投资组合，在有效控制风险的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。但在极端市场情况下，为保护投资者的本金安全，股票资产比例可降至 0%。</p> <p>2、固定收益资产投资策略</p> <p>本基金固定收益资产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。</p> <p>3、资产支持证券投资策略</p> <p>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>4、权证投资策略</p> <p>权证为本基金辅助性投资工具，其投资原则为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、其他金融衍生工具投资策略</p>

	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等相关金融衍生工具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、交易活跃的衍生品合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。若法律法规或监管机构以后允许基金投资如期权、互换等其他金融衍生品种，本基金将以风险管理和组合优化为目的，根据届时法律法规的相关规定参与投资。
业绩比较基准	95%*中证 500 指数收益率+5%*银行活期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华泰柏瑞基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	刘万方	郭明
	联系电话	021-38601777	(010) 66105799
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-0001	95588
传真		021-38601799	(010) 66105798
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 55 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 55 号
邮政编码		200135	100140
法定代表人		贾波	廖林

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据	报告期(2025 年 1 月 1 日-2025 年 6 月 30 日)	
和指标	华泰柏瑞量化智慧混合 A	华泰柏瑞量化智慧混合 C
本期已实现收益	15,264,763.38	2,323,055.00

本期利润	18,819,400.33	3,094,437.12
加权平均基金份额本期利润	0.1335	0.1521
本期加权平均净值利润率	8.73%	9.55%
本期基金份额净值增长率	9.03%	8.89%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	85,434,597.20	14,812,685.44
期末可供分配基金份额利润	0.6197	0.5769
期末基金资产净值	223,888,537.43	43,322,574.26
期末基金份额净值	1.6240	1.6873
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	89.13%	78.95%

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

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

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

4、本基金于 2018 年 6 月 19 日新增 C 类份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华泰柏瑞量化智慧混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

过去一个月	6.23%	0.69%	4.09%	0.75%	2.14%	-0.06%
过去三个月	3.79%	1.45%	0.97%	1.43%	2.82%	0.02%
过去六个月	9.03%	1.25%	3.21%	1.29%	5.82%	-0.04%
过去一年	22.55%	1.60%	18.83%	1.64%	3.72%	-0.04%
过去三年	6.01%	1.23%	-7.61%	1.29%	13.62%	-0.06%
自基金合同 生效起至今	89.13%	1.40%	-43.02%	1.51%	132.15%	-0.11%

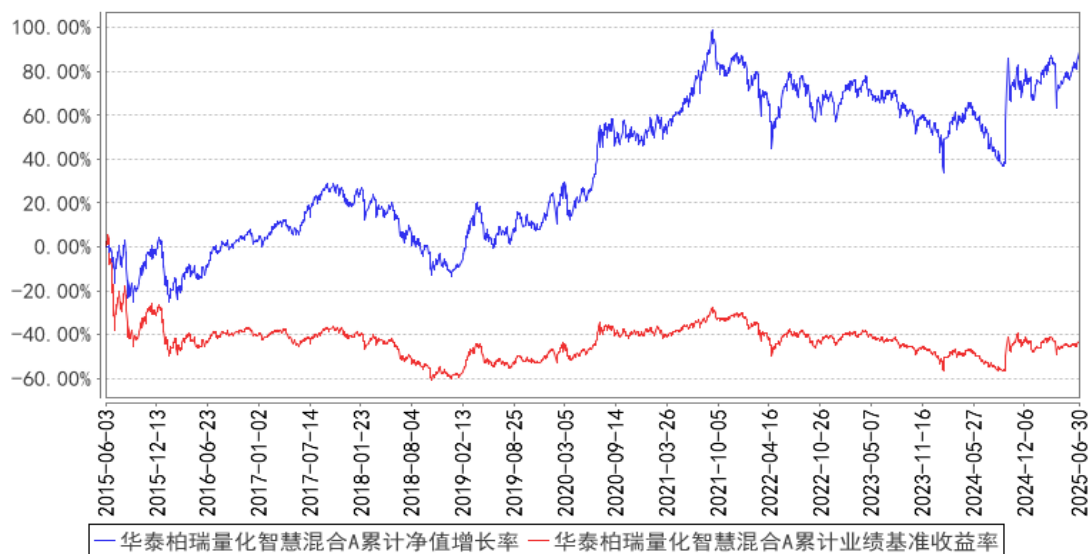
华泰柏瑞量化智慧混合 C

阶段	份额净值增 长率①	份额净值增 长率标准差 ②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①－③	②－④
过去一个月	6.20%	0.69%	4.09%	0.75%	2.11%	-0.06%
过去三个月	3.73%	1.45%	0.97%	1.43%	2.76%	0.02%
过去六个月	8.89%	1.25%	3.21%	1.29%	5.68%	-0.04%
过去一年	22.24%	1.60%	18.83%	1.64%	3.41%	-0.04%
过去三年	5.21%	1.23%	-7.61%	1.29%	12.82%	-0.06%
自基金合同 生效起至今	78.95%	1.29%	8.48%	1.34%	70.47%	-0.05%

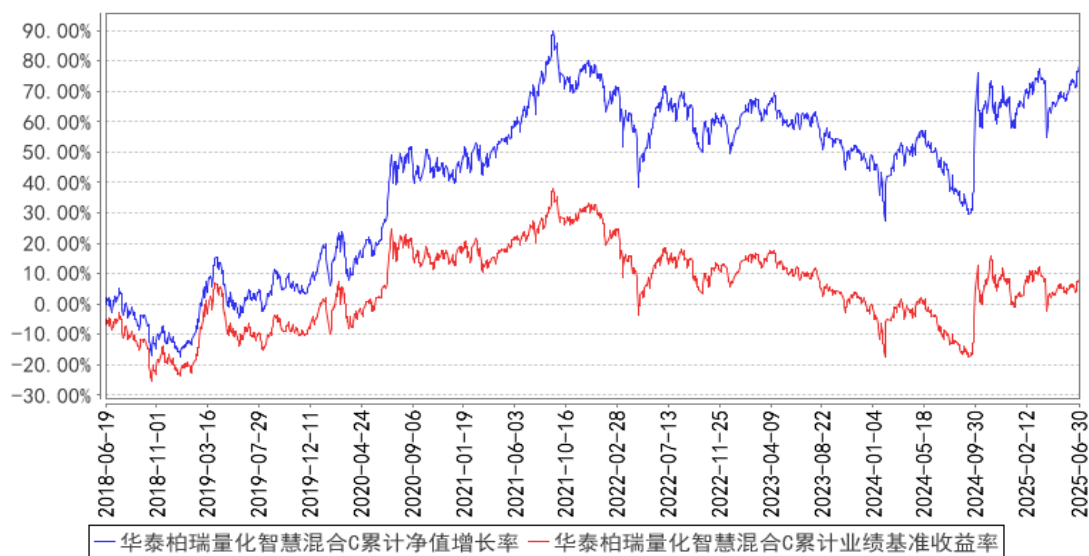
注：C 类份额业绩计算期间为 2018 年 6 月 19 日至 2025 年 6 月 30 日。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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



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



注：A类图示日期为2015年6月3日至2025年6月30日。C类图示日期为2018年6月19日至2025年6月30日。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司。华泰柏瑞基金管理有限公司是经中国证监会批准，于2004年11月18日成立的合资基金管理公司，注册资本为2亿元人民币。目前的股东构成

为华泰证券股份有限公司、柏瑞投资有限责任公司（原 AIGGIC）和苏州新区高新技术产业股份有限公司，出资比例分别为 49%、49%和 2%。截至 2025 年 6 月 30 日，公司旗下管理 179 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		
笪篁	量化与海外投资部总监助理、本基金的基金经理	2021 年 9 月 17 日	-	11 年	美国明尼苏达大学双城分校金融数学硕士，曾任中国金融期货交易所债券事业部助理经理。2016 年 6 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任量化与海外投资部助理研究员、研究员、高级研究员。现任量化与海外投资部总监助理兼基金经理。2020 年 5 月起任华泰柏瑞量化创优灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 11 月起任华泰柏瑞量化创盈混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月起任华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞量化对冲稳健收益定期开放混合型发起式证券投资基金的基金经理。2022 年 11 月起任华泰柏瑞中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 9 月起任华泰柏瑞中证 1000 指数增强型证券投资基金的基金经理。2025 年 4 月起任华泰柏瑞中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及其他相关法律、法规的规定以及本基金的《基金合同》的约定，在严格控制风险的基础上，忠实履行基金管理职责，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金投资管理符合有关法律、法规的规定及基金合同的约定，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

首先投资部和研究部通过规范的决策流程来确保公平对待不同投资组合。其次交易部对投资指令的合规性、有效性及合理性进行独立审核，在交易过程中启用投资交易系统内的公平交易模块，确保公平交易的实施。同时，风险管理部对报告期内的交易进行日常监控和分析评估。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 2 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

2025 年上半年，A 股走势震荡上行，虽然经历短暂关税战冲击，整体反弹趋势延续。年初随着 Deepseek 的出现大超市场预期，国内 AI 产业链的叙事发生重大变化，带动 A 股在春节后企稳反弹。四月初关税冲击远超市场预期，前期业绩预期较好的出口产业链短期调整剧烈。五到六月，股市活跃度维持在高位，主题行情持续到季末，市场主要宽基指数创出年内新高。上半年，A 股市场半导体、计算机等 AI 产业链和银行板块表现较好，同时军工和创新药板块表现活跃，而周期和消费相关行业表现相对稳健。

本报告期，代表大市值公司的上证 50、沪深 300 分别上涨 1.01% 和 0.03%；代表高股息类上市公司的中证红利全收益指数下跌 0.13%；代表小市值公司的中证 1000 和中证 2000 指数同期涨幅分别为 6.69% 和 15.24%。横向比较来看，股价弹性较大的中小市值公司，在上半年跑赢大市值和高股息类上市公司。

本报告期内，我们坚持基本面多因子的量化选股策略，结合对市场的研判，采取比较稳健的投资策略。由于我们采用相对严谨的风控措施，在风格和主题上的暴露相对较小，同时保持较高仓位运作，因而无论在科技主题轮动行情中，还是关税冲击的短期波动行情中，超额收益受到的影响相对较小，超额收益波动较小。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末华泰柏瑞量化智慧混合 A 的基金份额净值为 1.6240 元，本报告期基金份额净值增长率为 9.03%，同期业绩比较基准收益率为 3.21%，截至本报告期末华泰柏瑞量化智慧混合 C 的基金份额净值为 1.6873 元，本报告期基金份额净值增长率为 8.89%，同期业绩比较基准收益率为 3.21%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来几个季度，一系列增量政策的落地仍然值得期待，基本面的改善逐步显现。2025 年上半年，得益于前期财政和货币政策的发力，国内经济韧性进一步加强。我们预计央行将继续实行较为宽松的货币政策，政府和企业的融资成本有望进一步降低。同时我们预期财政发力，将继续引导新增资金向科技和扩内需等方向。海外，短期美国的关税政策给全球经济发展带来不确定性，但中长期我们坚定看好中国产业链的创新能力和国际竞争力。年初以来，一系列突破性的自主创新科技成果，以及国内经济在本次关税冲击中所展现的强大韧性，增强了市场对于中国经济的信心。在整体估值仍有吸引力的情况下，股票市场后续有望进入更加理性的上升区间。

量化策略方面，关税战的冲击预计将告一段落，随着财报期临近，我们预计市场将更加关注基本面的边际变化。从因子表现来看，华泰柏瑞量化团队的成长类因子和价值类因子近期表现较好，我们预期其趋势仍将延续。同时，我们认为在后市当中，大小市值、各行业股票均有机会，量化投资全市场选股的优势将得以更好体现。

如上所述，我们认为，当前 A 股市场整体估值仍有吸引力，对于专注于捕捉基本面变化逻辑的量化投资，超额收益将得到进一步提高，是很不错的配置风格均衡的基本面量化基金的机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人——华泰柏瑞基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对华泰柏瑞基金管理有限公司编制和披露的本基金 2025 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	18,878,984.37	20,926,930.36
结算备付金		3,819,969.25	4,895,743.05
存出保证金		440,616.38	997,926.32
交易性金融资产	6.4.7.2	249,113,650.27	218,382,123.14
其中：股票投资		242,041,306.71	218,382,123.14
基金投资		-	-
债券投资		7,072,343.56	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-

其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	1,473,038.40
应收股利		-	-
应收申购款		269,042.43	91,218.63
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		272,522,262.70	246,766,979.90
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		3,671,261.55	-
应付赎回款		1,118,062.94	4,898,060.84
应付管理人报酬		256,316.82	259,167.24
应付托管费		42,719.48	43,194.53
应付销售服务费		8,898.45	7,733.45
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	213,891.77	232,962.17
负债合计		5,311,151.01	5,441,118.23
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	163,538,438.30	161,329,422.71
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	103,672,673.39	79,996,438.96
净资产合计		267,211,111.69	241,325,861.67
负债和净资产总计		272,522,262.70	246,766,979.90

注： 报告截止日 2025 年 6 月 30 日，基金份额总额 163,538,438.30 份，其中下属 A 类基金份额净值 1.6240 元，基金份额总额 137,863,024.80 份；下属 C 类基金份额净值 1.6873 元，基金份额总额 25,675,413.50 份。

6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		23,760,335.19	2,217,366.35
1. 利息收入		65,651.37	114,028.64
其中：存款利息收入	6.4.7.13	65,651.37	114,028.64
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）		19,338,382.19	-11,422,976.06
其中：股票投资收益	6.4.7.14	16,936,241.40	-16,294,837.70
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	26,733.15	-
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-297,712.48	611,277.32
股利收益	6.4.7.19	2,673,120.12	4,260,584.32
以摊余成本计量的 金融资产终止确认产生的 收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	4,326,019.07	13,495,892.50
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	30,282.56	30,421.27
减：二、营业总支出		1,846,497.74	2,160,444.75
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,474,194.91	1,693,972.69
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	245,699.20	282,328.72
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	39,906.97	83,875.71
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		645.34	2,357.50

8. 其他费用	6.4.7.23	86,051.32	97,910.13
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		21,913,837.45	56,921.60
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		21,913,837.45	56,921.60
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		21,913,837.45	56,921.60

6.3 净资产变动表

会计主体：华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	161,329,422.71	-	79,996,438.96	241,325,861.67
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	161,329,422.71	-	79,996,438.96	241,325,861.67
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	2,209,015.59	-	23,676,234.43	25,885,250.02
（一）、综合收益总额	-	-	21,913,837.45	21,913,837.45
（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）	2,209,015.59	-	1,762,396.98	3,971,412.57
其中：1. 基金申购款	30,586,873.67	-	17,715,160.97	48,302,034.64
2. 基金赎回款	-28,377,858.08	-	-15,952,763.99	-44,330,622.07
（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	163,538,438.30	-	103,672,673.39	267,211,111.69
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	184,882,780.52	-	65,476,630.86	250,359,411.38
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	184,882,780.52	-	65,476,630.86	250,359,411.38
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	27,311,975.88	-	6,532,445.67	33,844,421.55
（一）、综合收益总额	-	-	56,921.60	56,921.60
（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）	27,311,975.88	-	6,475,524.07	33,787,499.95
其中：1. 基金申购款	70,177,850.57	-	22,756,783.62	92,934,634.19
2. 基金赎回款	-42,865,874.69	-	-16,281,259.55	-59,147,134.24
（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	212,194,756.40	-	72,009,076.53	284,203,832.93
-----------	----------------	---	---------------	----------------

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2015]第 439 号《关于准予华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准，由华泰柏瑞基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 906,808,361.90 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第 664 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 6 月 3 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 906,942,174.07 份基金份额，其中认购资金利息折合 133,812.17 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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于 2018 年 6 月 15 日发布的《华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金增加 C 类份额并修改基金合同的公告》，经与基金托管人协商一致并报中国证监会备案，本基金自 2018 年 6 月 19 日起增加 C 类基金份额。根据修改后的《华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金基金合同》，本基金根据申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者申购基金份额时收取申购费用而不计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资者申购基金份额时不收取申购费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码，分别计算基金份额净值并分别公告。投资者可自行选择申购的基金份额类别，但不同基金份额类别之间不得互相转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行

的股票(包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票)、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。本基金的投资组合比例为：股票资产及存托凭证的投资比例占基金资产的 0%-95%；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：95% X 中证 500 指数收益率+5% X 银行活期存款利率(税后)。

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 8 月 29 日批准报出。

6.4.2 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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2025 年 6 月 30 日的财务状况以及 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通

知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
活期存款	18,878,984.37
等于：本金	18,876,559.25
加：应计利息	2,425.12
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	18,878,984.37

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	214,235,500.01	-	242,041,306.71	27,805,806.70
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	74,143.56	7,072,343.56	5,812.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	74,143.56	7,072,343.56	5,812.00
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	221,227,888.01	74,143.56	249,113,650.27	27,811,618.70

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	3,386,498.18	-	-	
其中：股指期货投资	3,386,498.18	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	3,386,498.18	-	-	

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2507	中证 500 股指期货 2507	3.00	3,520,440.00	133,941.82
合计				133,941.82
减：可抵销期货暂收款				133,941.82
净额				0.00

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

注：无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具。

6.4.7.8 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	392.02
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	136,636.29
其中：交易所市场	136,636.29
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	76,863.46
合计	213,891.77

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

华泰柏瑞量化智慧混合 A

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	144,135,479.13	144,135,479.13
本期申购	11,541,651.16	11,541,651.16
本期赎回（以“-”号填列）	-17,814,105.49	-17,814,105.49
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	137,863,024.80	137,863,024.80

华泰柏瑞量化智慧混合 C

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	17,193,943.58	17,193,943.58
本期申购	19,045,222.51	19,045,222.51
本期赎回（以“-”号填列）	-10,563,752.59	-10,563,752.59
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	25,675,413.50	25,675,413.50

注：申购（含红利再投）含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期末无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

华泰柏瑞量化智慧混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	73,698,631.23	-3,149,603.95	70,549,027.28
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	73,698,631.23	-3,149,603.95	70,549,027.28
本期利润	15,264,763.38	3,554,636.95	18,819,400.33
本期基金份额交易产生的变动数	-3,528,797.41	185,882.43	-3,342,914.98

其中：基金申购款	6,586,431.20	-403,815.27	6,182,615.93
基金赎回款	-10,115,228.61	589,697.70	-9,525,530.91
本期已分配利润	-	-	-
本期末	85,434,597.20	590,915.43	86,025,512.63

华泰柏瑞量化智慧混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	8,015,946.29	1,431,465.39	9,447,411.68
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	8,015,946.29	1,431,465.39	9,447,411.68
本期利润	2,323,055.00	771,382.12	3,094,437.12
本期基金份额交易产生的变动数	4,473,684.15	631,627.81	5,105,311.96
其中：基金申购款	9,930,252.88	1,602,292.16	11,532,545.04
基金赎回款	-5,456,568.73	-970,664.35	-6,427,233.08
本期已分配利润	-	-	-
本期末	14,812,685.44	2,834,475.32	17,647,160.76

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	40,689.82
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	24,855.14
其他	106.41
合计	65,651.37

注：其他为结算保证金利息收入、直销申购款利息收入和期货备付金利息收入。

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	16,936,241.40
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	16,936,241.40

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	207,099,105.18
减：卖出股票成本总额	189,825,075.33
减：交易费用	337,788.45
买卖股票差价收入	16,936,241.40

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益——证券出借差价收入。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	26,733.15
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	—
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	26,733.15

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——买卖债券差价收入。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——申购差价收入。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	-297,712.48

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	2,673,120.12
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,673,120.12

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	3,936,474.58
股票投资	3,930,662.58

债券投资	5,812.00
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	389,544.49
权证投资	-
期货投资	389,544.49
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	4,326,019.07

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	29,428.92
基金转换费收入	853.64
合计	30,282.56

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

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

6.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	17,356.09
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行间账户服务费	7,500.00
银行划款手续费	1,588.08
存托服务费	99.78
合计	86,051.32

6.4.7.24 分部报告

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

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例（%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例（%）
华泰证券	-	-	59,644,240.07	12.75

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
-	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
华泰证券	56,105.52	12.74	56,105.52	28.52

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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,474,194.91	1,693,972.69
其中：应支付销售机构的客户维护费	462,682.59	492,243.99
应支付基金管理人的净管理费	1,011,512.32	1,201,728.70

注：支付基金管理人华泰柏瑞基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20%的年费率计提，逐

日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	245,699.20	282,328.72

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰柏瑞量化智慧混合 A	华泰柏瑞量化智慧混合 C	合计
中国工商银行股份有限公司	—	122.61	122.61
华泰证券股份有限公司	—	25.08	25.08
华泰柏瑞基金管理有限公司	—	5,931.05	5,931.05
合计	—	6,078.74	6,078.74
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰柏瑞量化智慧混合 A	华泰柏瑞量化智慧混合 C	合计
中国工商银行股份有限公司	—	28.30	28.30
华泰证券股份有限公司	—	11.08	11.08
华泰柏瑞基金管理有限公司	—	44,566.59	44,566.59
合计	—	44,605.97	44,605.97

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 类基金份额前一日的基金资产净值

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	华泰柏瑞量化智慧混合 A	华泰柏瑞量化智慧混合 C
基金合同生效日（2015 年 6 月 3 日）持有的基金份额	—	—
报告期初持有的基金份额	3,820,001.53	—
报告期间申购/买入总份额	0.00	—
报告期间因拆分变动份额	0.00	—
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	—
报告期末持有的基金份额	3,820,001.53	—
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.3358%	—

项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	华泰柏瑞量化智慧混合 A	华泰柏瑞量化智慧混合 C
基金合同生效日（2015 年 6 月 3 日）持有的基金份额	—	—
报告期初持有的基金份额	3,820,001.53	—
报告期间申购/买入总份额	0.00	—
报告期间因拆分变动份额	0.00	—
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	—
报告期末持有的基金份额	3,820,001.53	—
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.8002%	—

- 注：1. 期间买入/申购总份额含转换入份额，期间卖出/赎回总份额含转换出份额。
2. 基金管理人投资本基金适用的认(申)购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本报告期末及上年度末，除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	18,878,984.37	40,689.82	27,608,234.40	40,572.01

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
华泰联合证券有限责任公司	301458	钧崴电子	网下申购	7,005	72,852.00
华泰联合证券有限责任公司	688757	胜科纳米	网下申购	5,357	48,641.56
华泰联合证券有	603014	威高血净	网下申购	1,305	34,582.50

限责任公司					
上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
华泰联合证券有 限责任公司	688709	成都华微	网下申购	4,527	71,028.63
华泰联合证券有 限责任公司	301392	汇成真空	网下申购	2,189	26,705.80
华泰联合证券有 限责任公司	603341	龙旗科技	网下申购	1,506	39,156.00
华泰联合证券有 限责任公司	603312	西典新能	网下申购	907	26,321.14
华泰联合证券有 限责任公司	301587	中瑞股份	网下申购	3,056	66,406.88

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2025 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券 代码	证 券 名 称	成功 认购 日	受限 期	流通 受限 类型	认购 价格	期末 估值 单价	数量 （单 位： 股）	期末 成本总额	期末估值 总额	备注
001335	信凯科技	2025 年4月 2日	6个月	新股 锁定 期内	12.80	28.05	80	1,024.00	2,244.00	-
001356	富岭股份	2025 年1月 16日	6个月	新股 锁定 期内	5.30	14.44	648	3,434.40	9,357.12	-
001382	新亚电缆	2025 年3月 13日	6个月	新股 锁定 期内	7.40	20.21	366	2,708.40	7,396.86	-
001388	信	2025	1个月	新股	16.42	16.42	843	13,842.06	13,842.06	-

	通电子	年6月24日	内(含)	未上市						
001388	信通电子	2025年6月24日	6个月以上	新股锁定期内	16.42	16.42	94	1,543.48	1,543.48	-
001390	古麒绒材	2025年5月21日	6个月	新股锁定期内	12.08	18.12	178	2,150.24	3,225.36	-
001395	亚联机械	2025年1月20日	6个月	新股锁定期内	19.08	47.25	80	1,526.40	3,780.00	-
301173	毓恬冠佳	2025年2月24日	6个月	新股锁定期内	28.33	44.98	173	4,901.09	7,781.54	-
301275	汉朔科技	2025年3月4日	6个月	新股锁定期内	27.50	56.19	232	6,380.00	13,036.08	-
301458	钧崴电子	2025年1月2日	6个月	新股锁定期内	10.40	34.11	701	7,290.40	23,911.11	-
301479	弘景光电	2025年3月6日	6个月	新股锁定期内	41.90	77.87	182	5,447.00	14,172.34	-
301501	恒鑫生活	2025年3月11日	6个月	新股锁定期内	39.92	45.22	226	6,227.52	10,219.72	-
301535	浙江华远	2025年3月18日	6个月	新股锁定期内	4.92	18.99	734	3,611.28	13,938.66	-
301560	众捷汽车	2025年4月17日	6个月	新股锁定期内	16.50	27.45	190	3,135.00	5,215.50	-
301590	优	2025	6个月	新股	89.60	139.48	59	5,286.40	8,229.32	-

	优绿能	年5月28日		锁定期内						
301595	太力科技	2025年5月12日	6个月	新股锁定期内	17.05	29.10	196	3,341.80	5,703.60	-
301601	惠通科技	2025年1月8日	6个月	新股锁定期内	11.80	33.85	342	4,035.60	11,576.70	-
301602	超研股份	2025年1月15日	6个月	新股锁定期内	6.70	24.80	658	4,408.60	16,318.40	-
301636	泽润新能	2025年4月30日	6个月	新股锁定期内	33.06	47.46	128	4,231.68	6,074.88	-
301658	首航新能	2025年3月26日	6个月	新股锁定期内	11.80	22.98	437	5,156.60	10,042.26	-
301662	宏工科技	2025年4月10日	6个月	新股锁定期内	26.60	82.50	143	3,803.80	11,797.50	-
301665	泰禾股份	2025年4月2日	6个月	新股锁定期内	10.27	22.39	393	4,036.11	8,799.27	-
301678	新恒汇	2025年6月13日	6个月	新股锁定期内	12.80	44.54	378	4,838.40	16,836.12	-
603014	威高血净	2025年5月12日	6个月	新股锁定期内	26.50	32.68	131	3,471.50	4,281.08	-
603072	天和磁材	2024年12月24日	6个月以上	新股锁定期内	12.30	54.45	216	2,656.80	11,761.20	-
603120	肯特	2025年4月	6个月	新股锁定	15.00	33.43	65	975.00	2,172.95	-

	催化	9 日		期内						
603124	江南新材	2025 年 3 月 12 日	6 个月	新股 锁定 期内	10.54	46.31	88	927.52	4,075.28	-
603202	天有为	2025 年 4 月 16 日	6 个月	新股 锁定 期内	93.50	90.66	39	3,646.50	3,535.74	-
603210	泰鸿万立	2025 年 4 月 1 日	6 个月	新股 锁定 期内	8.60	15.61	286	2,459.60	4,464.46	-
603257	中国瑞林	2025 年 3 月 28 日	6 个月	新股 锁定 期内	20.52	37.47	78	1,600.56	2,922.66	-
603271	永杰新材	2025 年 3 月 4 日	6 个月	新股 锁定 期内	20.60	35.08	114	2,348.40	3,999.12	-
603382	海阳科技	2025 年 6 月 5 日	6 个月	新股 锁定 期内	11.50	22.39	105	1,207.50	2,350.95	-
603400	华之杰	2025 年 6 月 12 日	6 个月	新股 锁定 期内	19.88	43.81	57	1,133.16	2,497.17	-
603409	汇通控股	2025 年 2 月 25 日	6 个月	新股 锁定 期内	24.18	33.32	95	2,297.10	3,165.40	-
688411	海博思创	2025 年 1 月 20 日	6 个月	新股 锁定 期内	19.38	83.49	473	9,166.74	39,490.77	-
688545	兴福电子	2025 年 1 月 15 日	6 个月	新股 锁定 期内	11.68	26.95	746	8,713.28	20,104.70	-
688583	思看科技	2025 年 1 月 8 日	6 个月	新股 锁定 期内	33.46	79.68	227	5,855.50	18,087.36	-

688755	汉邦科技	2025年5月9日	6个月	新股锁定期内	22.77	39.33	203	4,622.31	7,983.99	-
688757	胜科纳米	2025年3月18日	6个月	新股锁定期内	9.08	25.94	536	4,866.88	13,903.84	-
688758	赛分科技	2025年1月2日	6个月	新股锁定期内	4.32	16.97	777	3,356.64	13,185.69	-
688775	影石创新	2025年6月4日	6个月	新股锁定期内	47.27	124.16	207	9,784.89	25,701.12	-

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

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

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

4、基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后6个月内不得转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未参与转融通证券出借业务。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，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 2025 年 6 月 30 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券（2024 年 12 月 31 日：本基金无债券投资）。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

于 2025 年 06 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（净资产）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2025 年 06 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合法律法规的相关要求。

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

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，

以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	18,878,984.37	-	-	-	-	-	18,878,984.37
结算备付金	3,819,969.25	-	-	-	-	-	3,819,969.25
存出保证金	18,163.58	-	-	-	-	422,452.80	440,616.38
交易性金融资产	5,063,528.77	-	2,008,814.79	-	-	242,041,306.71	249,113,650.27
应收申购款	-	-	-	-	-	269,042.43	269,042.43
资产总计	27,780,645.97	-	2,008,814.79	-	-	242,732,801.94	272,522,262.70
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,118,062.94	1,118,062.94
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	256,316.82	256,316.82
应付托管费	-	-	-	-	-	42,719.48	42,719.48
应付清算款	-	-	-	-	-	3,671,261.55	3,671,261.55

应付销售服务费	-	-	-	-	-	8,898.45	8,898.45
其他负债	-	-	-	-	-	213,891.77	213,891.77
负债总计	-	-	-	-	-	5,311,151.01	5,311,151.01
利率敏感度缺口	27,780,645.97	-	-2,008,814.79	-	-	237,421,650.93	267,211,111.69
上年度末 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
资产							
货币资金	20,926,930.36	-	-	-	-	-	20,926,930.36
结算备付金	4,895,743.05	-	-	-	-	-	4,895,743.05
存出保证金	997,926.32	-	-	-	-	-	997,926.32
交易性金融资产	-	-	-	-	-	218,382,123.14	218,382,123.14
应收申购款	-	-	-	-	-	91,218.63	91,218.63
应收清算款	-	-	-	-	-	1,473,038.40	1,473,038.40
资产总计	26,820,599.73	-	-	-	-	219,946,380.17	246,766,979.90
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	4,898,060.84	4,898,060.84
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	259,167.24	259,167.24
应付托管费	-	-	-	-	-	43,194.53	43,194.53
应付销售服务费	-	-	-	-	-	7,733.45	7,733.45
其他负债	-	-	-	-	-	232,962.17	232,962.17
负债总计	-	-	-	-	-	5,441,118.23	5,441,118.23
利率敏感度缺口	26,820,599.73	-	-	-	-	214,505,261.94	241,325,861.67

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2025 年 06 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 2.65%(2024 年 12 月 31 日：无)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2024 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	242,041,306.71	90.58	218,382,123.14	90.49
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	242,041,306.71	90.58	218,382,123.14	90.49

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资(附注 6.4.7.3)。在当日无负债结算制度下，期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

6.4.13.4.3.2 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（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月

			31 日)
	业绩比较基准上升 5%	11, 533, 882. 08	10, 435, 096. 13
	业绩比较基准下降 5%	-11, 533, 882. 08	-10, 435, 096. 13

6. 4. 14 公允价值

6. 4. 14. 1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定： 第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。 第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。 第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6. 4. 14. 2 持续的以公允价值计量的金融工具

6. 4. 14. 2. 1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	241, 632, 581. 35	217, 785, 875. 87
第二层次	7, 087, 729. 10	26, 481. 90
第三层次	393, 339. 82	569, 765. 37
合计	249, 113, 650. 27	218, 382, 123. 14

6. 4. 14. 2. 2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。
--

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2025 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2024 年 12 月 31 日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	242,041,306.71	88.82
	其中：股票	242,041,306.71	88.82
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	7,072,343.56	2.60
	其中：债券	7,072,343.56	2.60
	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	22,698,953.62	8.33
8	其他各项资产	709,658.81	0.26
9	合计	272,522,262.70	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	429,042.00	0.16
B	采矿业	14,627,501.00	5.47
C	制造业	142,900,612.90	53.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,052,411.20	3.01
E	建筑业	1,442,503.00	0.54
F	批发和零售业	2,153,883.00	0.81

G	交通运输、仓储和邮政业	5,643,380.00	2.11
H	住宿和餐饮业	842,148.00	0.32
I	信息传输、软件和信息技术服务业	27,389,437.97	10.25
J	金融业	25,701,640.90	9.62
K	房地产业	1,490,514.00	0.56
L	租赁和商务服务业	4,161,844.00	1.56
M	科学研究和技术服务业	5,767,058.74	2.16
N	水利、环境和公共设施管理业	725,448.00	0.27
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	540,278.00	0.20
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	173,604.00	0.06
S	综合	-	-
	合计	242,041,306.71	90.58

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002517	恺英网络	142,300	2,747,813.00	1.03
2	603444	吉比特	9,100	2,747,745.00	1.03
3	300454	深信服	28,100	2,646,458.00	0.99
4	300476	胜宏科技	18,800	2,526,344.00	0.95
5	603259	药明康德	32,500	2,260,375.00	0.85
6	300502	新易盛	17,500	2,222,850.00	0.83
7	600066	宇通客车	84,100	2,090,726.00	0.78
8	600988	赤峰黄金	80,800	2,010,304.00	0.75
9	300207	欣旺达	98,100	1,967,886.00	0.74
10	603893	瑞芯微	12,800	1,943,808.00	0.73
11	600578	京能电力	420,100	1,886,249.00	0.71
12	600109	国金证券	213,000	1,868,010.00	0.70
13	688183	生益电子	35,400	1,812,480.00	0.68
14	000932	华菱钢铁	410,866	1,807,810.40	0.68
15	601881	中国银河	104,900	1,799,035.00	0.67
16	300558	贝达药业	29,700	1,721,115.00	0.64
17	688258	卓易信息	35,430	1,715,874.90	0.64
18	600489	中金黄金	115,800	1,694,154.00	0.63
19	300866	安克创新	14,910	1,693,776.00	0.63
20	600143	金发科技	164,100	1,691,871.00	0.63
21	688048	长光华芯	28,771	1,661,237.54	0.62

22	000728	国元证券	192,200	1,516,458.00	0.57
23	601138	工业富联	70,200	1,500,876.00	0.56
24	002985	北摩高科	49,300	1,491,325.00	0.56
25	300573	兴齐眼药	28,480	1,474,979.20	0.55
26	300496	中科创达	25,700	1,470,554.00	0.55
27	002532	天山铝业	174,800	1,452,588.00	0.54
28	002926	华西证券	161,800	1,446,492.00	0.54
29	688131	皓元医药	28,870	1,395,864.50	0.52
30	000783	长江证券	197,700	1,370,061.00	0.51
31	000951	中国重汽	76,900	1,351,902.00	0.51
32	601991	大唐发电	425,900	1,350,103.00	0.51
33	300604	长川科技	29,800	1,338,318.00	0.50
34	601336	新华保险	22,700	1,327,950.00	0.50
35	600030	中信证券	48,070	1,327,693.40	0.50
36	601126	四方股份	81,500	1,326,005.00	0.50
37	689009	九号公司	22,330	1,321,266.10	0.49
38	603129	春风动力	6,100	1,320,650.00	0.49
39	603678	火炬电子	34,700	1,319,641.00	0.49
40	688196	卓越新能	27,390	1,316,637.30	0.49
41	601717	中创智领	79,200	1,316,304.00	0.49
42	688198	佰仁医疗	12,700	1,304,163.00	0.49
43	002001	新 和 成	61,300	1,303,851.00	0.49
44	688088	虹软科技	26,980	1,301,785.00	0.49
45	600316	洪都航空	33,900	1,278,030.00	0.48
46	002138	顺络电子	45,400	1,276,648.00	0.48
47	600901	江苏金租	209,540	1,269,812.40	0.48
48	600873	梅花生物	117,900	1,260,351.00	0.47
49	000933	神火股份	74,900	1,246,336.00	0.47
50	603565	中谷物流	130,400	1,245,320.00	0.47
51	600299	安迪苏	128,000	1,235,200.00	0.46
52	000935	四川双马	66,500	1,211,630.00	0.45
53	300803	指南针	15,020	1,211,513.20	0.45
54	603267	鸿远电子	23,800	1,196,426.00	0.45
55	688690	纳微科技	52,200	1,191,726.00	0.45
56	688578	艾力斯	12,807	1,191,563.28	0.45
57	688543	国科军工	19,640	1,182,131.60	0.44
58	600276	恒瑞医药	22,700	1,178,130.00	0.44
59	000553	安道麦 A	162,500	1,173,250.00	0.44
60	688591	泰凌微	24,280	1,163,012.00	0.44
61	301080	百普赛斯	16,200	1,158,786.00	0.43
62	603979	金诚信	24,900	1,156,356.00	0.43
63	600301	华锡有色	57,500	1,148,275.00	0.43
64	600267	海正药业	123,700	1,144,225.00	0.43

65	002139	拓邦股份	82,600	1,140,706.00	0.43
66	688278	特宝生物	15,772	1,137,318.92	0.43
67	601857	中国石油	133,000	1,137,150.00	0.43
68	688141	杰华特	34,730	1,131,503.40	0.42
69	601168	西部矿业	67,200	1,117,536.00	0.42
70	688608	恒玄科技	3,200	1,113,536.00	0.42
71	600483	福能股份	115,330	1,111,781.20	0.42
72	688100	威胜信息	29,942	1,109,351.10	0.42
73	601555	东吴证券	126,100	1,103,375.00	0.41
74	600583	海油工程	199,900	1,091,454.00	0.41
75	603698	航天工程	61,500	1,083,630.00	0.41
76	688297	中无人机	20,175	1,077,345.00	0.40
77	603766	隆鑫通用	84,400	1,076,944.00	0.40
78	605020	永和股份	46,400	1,069,056.00	0.40
79	002468	申通快递	100,000	1,069,000.00	0.40
80	000776	广发证券	63,500	1,067,435.00	0.40
81	601233	桐昆股份	100,100	1,061,060.00	0.40
82	002958	青农商行	289,200	1,044,012.00	0.39
83	001872	招商港口	52,500	1,042,650.00	0.39
84	300395	菲利华	20,100	1,027,110.00	0.38
85	600153	建发股份	98,500	1,021,445.00	0.38
86	688286	敏芯股份	14,260	1,008,039.40	0.38
87	688188	柏楚电子	7,607	1,001,537.62	0.37
88	002690	美亚光电	58,200	981,834.00	0.37
89	688041	海光信息	6,900	974,901.00	0.36
90	688252	天德钰	39,800	970,324.00	0.36
91	000733	振华科技	19,300	965,965.00	0.36
92	300770	新媒股份	24,000	959,760.00	0.36
93	002315	焦点科技	21,000	959,490.00	0.36
94	603799	华友钴业	25,900	958,818.00	0.36
95	002597	金禾实业	40,700	958,485.00	0.36
96	688458	美芯晟	20,000	943,200.00	0.35
97	600167	联美控股	166,700	936,854.00	0.35
98	000050	深天马 A	109,400	932,088.00	0.35
99	600482	中国动力	40,400	932,028.00	0.35
100	001914	招商积余	74,700	924,039.00	0.35
101	301327	华宝新能	17,812	914,824.32	0.34
102	002487	大金重工	27,800	914,620.00	0.34
103	600968	海油发展	222,500	907,800.00	0.34
104	601225	陕西煤业	47,100	906,204.00	0.34
105	300101	振芯科技	40,000	905,200.00	0.34
106	002080	中材科技	45,900	895,050.00	0.33
107	300726	宏达电子	25,000	893,750.00	0.33

108	601601	中国太保	23,800	892,738.00	0.33
109	000725	京东方 A	218,800	873,012.00	0.33
110	688522	纳睿雷达	16,940	867,666.80	0.32
111	688261	东微半导	20,835	859,443.75	0.32
112	688213	思特威	8,400	858,648.00	0.32
113	002705	新宝股份	58,300	857,010.00	0.32
114	603916	苏博特	94,200	853,452.00	0.32
115	688082	盛美上海	7,481	852,385.14	0.32
116	600258	首旅酒店	59,600	842,148.00	0.32
117	300677	英科医疗	35,500	840,640.00	0.31
118	001206	依依股份	40,000	840,000.00	0.31
119	600176	中国巨石	73,600	839,040.00	0.31
120	002594	比亚迪	2,500	829,775.00	0.31
121	601615	明阳智能	72,100	828,429.00	0.31
122	603171	税友股份	19,300	828,163.00	0.31
123	301029	怡合达	36,200	827,532.00	0.31
124	601001	晋控煤业	67,400	823,628.00	0.31
125	003031	中瓷电子	15,400	819,434.00	0.31
126	600428	中远海特	130,800	817,500.00	0.31
127	600487	亨通光电	52,840	808,452.00	0.30
128	688612	威迈斯	30,155	806,344.70	0.30
129	000893	亚钾国际	26,500	798,710.00	0.30
130	688035	德邦科技	19,540	793,714.80	0.30
131	600163	中闽能源	154,500	791,040.00	0.30
132	688281	华秦科技	13,020	787,840.20	0.29
133	002709	天赐材料	43,200	782,784.00	0.29
134	601919	中远海控	51,300	771,552.00	0.29
135	000651	格力电器	17,100	768,132.00	0.29
136	002648	卫星化学	44,300	767,719.00	0.29
137	002202	金风科技	74,700	765,675.00	0.29
138	688150	莱特光电	30,965	765,454.80	0.29
139	002410	广联达	57,000	764,370.00	0.29
140	688122	西部超导	14,620	758,485.60	0.28
141	603225	新凤鸣	71,100	757,215.00	0.28
142	300037	新宙邦	21,500	756,800.00	0.28
143	002371	北方华创	1,700	751,757.00	0.28
144	600352	浙江龙盛	72,600	737,616.00	0.28
145	002299	圣农发展	51,400	734,506.00	0.27
146	300274	阳光电源	10,800	731,916.00	0.27
147	000498	山东路桥	123,800	727,944.00	0.27
148	300888	稳健医疗	17,700	727,470.00	0.27
149	002011	盾安环境	61,000	707,600.00	0.26
150	600998	九州通	136,200	700,068.00	0.26

151	600861	北京人力	35,800	690,940.00	0.26
152	300662	科锐国际	23,100	686,301.00	0.26
153	000685	中山公用	77,900	683,962.00	0.26
154	688665	四方光电	15,214	680,370.08	0.25
155	688225	亚信安全	33,365	680,312.35	0.25
156	600563	法拉电子	6,100	665,449.00	0.25
157	688322	奥比中光	11,255	664,157.55	0.25
158	002736	国信证券	57,600	663,552.00	0.25
159	601577	长沙银行	66,400	660,016.00	0.25
160	600057	厦门象屿	93,400	656,602.00	0.25
161	300768	迪普科技	37,800	648,270.00	0.24
162	000975	山金国际	34,200	647,748.00	0.24
163	603529	爱玛科技	18,500	636,400.00	0.24
164	002895	川恒股份	28,200	636,192.00	0.24
165	601369	陕鼓动力	72,400	634,948.00	0.24
166	600741	华域汽车	35,900	633,635.00	0.24
167	000885	城发环境	47,400	631,368.00	0.24
168	300850	新强联	17,500	626,850.00	0.23
169	002947	恒铭达	18,500	614,015.00	0.23
170	600219	南山铝业	159,900	612,417.00	0.23
171	600062	华润双鹤	32,700	610,182.00	0.23
172	002993	奥海科技	14,700	609,609.00	0.23
173	300627	华测导航	17,380	608,300.00	0.23
174	688692	达梦数据	2,700	601,803.00	0.23
175	605376	博迁新材	15,700	601,781.00	0.23
176	600862	中航高科	22,800	594,624.00	0.22
177	688182	灿勤科技	21,440	590,886.40	0.22
178	601319	中国人保	67,400	587,054.00	0.22
179	002876	三利谱	23,300	586,927.00	0.22
180	002818	富森美	46,200	576,576.00	0.22
181	002244	滨江集团	58,100	566,475.00	0.21
182	601668	中国建筑	96,800	558,536.00	0.21
183	300750	宁德时代	2,200	554,884.00	0.21
184	688636	智明达	16,420	554,831.80	0.21
185	600926	杭州银行	32,800	551,696.00	0.21
186	603236	移远通信	6,400	549,120.00	0.21
187	601958	金钼股份	49,800	544,812.00	0.20
188	601318	中国平安	9,800	543,704.00	0.20
189	605098	行动教育	15,100	540,278.00	0.20
190	002461	珠江啤酒	47,400	535,146.00	0.20
191	688506	百利天恒	1,800	533,016.00	0.20
192	688039	当虹科技	16,200	531,684.00	0.20
193	600755	厦门国贸	87,600	529,980.00	0.20

194	300113	顺网科技	26,700	527,592.00	0.20
195	000598	兴蓉环境	72,800	524,888.00	0.20
196	002595	豪迈科技	8,800	521,136.00	0.20
197	000423	东阿阿胶	9,900	517,770.00	0.19
198	601766	中国中车	73,400	516,736.00	0.19
199	688668	鼎通科技	7,978	498,305.88	0.19
200	600704	物产中大	93,300	491,691.00	0.18
201	688256	寒武纪	800	481,200.00	0.18
202	600517	国网英大	93,600	477,360.00	0.18
203	605507	国邦医药	23,600	466,572.00	0.17
204	300017	网宿科技	43,400	465,248.00	0.17
205	603508	思维列控	17,500	463,400.00	0.17
206	600782	新钢股份	130,200	460,908.00	0.17
207	002353	杰瑞股份	13,100	458,500.00	0.17
208	600710	苏美达	47,700	458,397.00	0.17
209	300748	金力永磁	19,000	452,960.00	0.17
210	300475	香农芯创	12,600	448,938.00	0.17
211	002155	湖南黄金	24,960	445,536.00	0.17
212	300913	兆龙互连	9,480	443,853.60	0.17
213	300570	太辰光	4,600	443,348.00	0.17
214	603993	洛阳钼业	50,900	428,578.00	0.16
215	601339	百隆东方	90,700	428,104.00	0.16
216	600038	中直股份	10,700	415,267.00	0.16
217	300759	康龙化成	16,800	412,272.00	0.15
218	688095	福昕软件	6,070	412,213.70	0.15
219	300033	同花顺	1,500	409,515.00	0.15
220	688772	珠海冠宇	28,486	407,064.94	0.15
221	601211	国泰海通	21,200	406,192.00	0.15
222	301031	中熔电气	5,032	400,798.80	0.15
223	601128	常熟银行	53,570	394,810.90	0.15
224	600866	星湖科技	57,000	393,870.00	0.15
225	601665	齐鲁银行	62,300	393,736.00	0.15
226	000513	丽珠集团	10,900	392,836.00	0.15
227	601995	中金公司	11,100	392,496.00	0.15
228	688114	华大智造	6,050	392,221.50	0.15
229	600132	重庆啤酒	7,100	391,210.00	0.15
230	300724	捷佳伟创	7,200	390,960.00	0.15
231	601169	北京银行	57,200	390,676.00	0.15
232	603515	欧普照明	21,200	381,388.00	0.14
233	300073	当升科技	8,686	381,054.82	0.14
234	601298	青岛港	43,700	379,753.00	0.14
235	603039	ST 泛微	6,800	378,760.00	0.14
236	603612	索通发展	20,300	373,114.00	0.14

237	002230	科大讯飞	7,700	368,676.00	0.14
238	600582	天地科技	59,800	358,202.00	0.13
239	002405	四维图新	40,200	343,308.00	0.13
240	688362	甬矽电子	11,485	342,023.30	0.13
241	688593	新相微	20,400	333,132.00	0.12
242	000708	中信特钢	28,200	331,632.00	0.12
243	603605	珀莱雅	4,000	331,160.00	0.12
244	600801	华新水泥	27,800	329,152.00	0.12
245	603197	保隆科技	8,300	324,281.00	0.12
246	601311	骆驼股份	35,300	318,759.00	0.12
247	002948	青岛银行	62,900	313,242.00	0.12
248	600909	华安证券	53,300	310,739.00	0.12
249	600000	浦发银行	22,200	308,136.00	0.12
250	001301	尚太科技	6,300	307,188.00	0.11
251	600728	佳都科技	55,100	300,295.00	0.11
252	300618	寒锐钴业	8,300	296,476.00	0.11
253	600699	均胜电子	16,500	287,760.00	0.11
254	300373	扬杰科技	5,500	285,450.00	0.11
255	300919	中伟股份	8,600	282,768.00	0.11
256	601818	光大银行	68,000	282,200.00	0.11
257	603699	纽威股份	9,000	280,530.00	0.10
258	002683	广东宏大	8,200	278,308.00	0.10
259	601009	南京银行	23,800	276,556.00	0.10
260	601899	紫金矿业	14,100	274,950.00	0.10
261	688012	中微公司	1,500	273,450.00	0.10
262	000988	华工科技	5,800	272,658.00	0.10
263	300761	立华股份	14,400	270,576.00	0.10
264	301367	瑞迈特	3,200	269,120.00	0.10
265	002444	巨星科技	10,500	267,855.00	0.10
266	000729	燕京啤酒	20,000	258,600.00	0.10
267	300236	上海新阳	6,500	252,200.00	0.09
268	603650	彤程新材	7,600	244,340.00	0.09
269	603296	华勤技术	2,900	233,972.00	0.09
270	300014	亿纬锂能	5,000	229,050.00	0.09
271	688526	科前生物	14,400	224,352.00	0.08
272	000528	柳工	23,300	223,913.00	0.08
273	002608	江苏国信	30,000	219,900.00	0.08
274	600900	长江电力	7,200	217,008.00	0.08
275	688112	鼎阳科技	5,849	216,237.53	0.08
276	601377	兴业证券	34,600	214,174.00	0.08
277	000960	锡业股份	13,800	211,140.00	0.08
278	600817	宇通重工	17,800	210,752.00	0.08
279	002293	罗莱生活	24,000	209,760.00	0.08

280	600685	中船防务	7,700	209,363.00	0.08
281	603218	日月股份	16,200	205,578.00	0.08
282	688425	铁建重工	49,800	203,184.00	0.08
283	000089	深圳机场	29,400	202,860.00	0.08
284	300725	药石科技	5,100	197,370.00	0.07
285	300298	三诺生物	8,300	187,497.00	0.07
286	600098	广州发展	29,600	185,000.00	0.07
287	688105	诺唯赞	7,908	178,958.04	0.07
288	002500	山西证券	30,400	177,536.00	0.07
289	600312	平高电气	11,500	176,985.00	0.07
290	600273	嘉化能源	20,900	176,814.00	0.07
291	601799	星宇股份	1,400	175,000.00	0.07
292	603730	岱美股份	30,520	173,658.80	0.06
293	601900	南方传媒	11,100	173,604.00	0.06
294	002701	奥瑞金	28,400	168,980.00	0.06
295	600875	东方电气	10,000	167,400.00	0.06
296	603477	巨星农牧	7,700	158,466.00	0.06
297	300470	中密控股	4,300	158,111.00	0.06
298	688563	航材股份	2,665	150,918.95	0.06
299	002821	凯莱英	1,700	150,025.00	0.06
300	600460	士兰微	6,000	148,920.00	0.06
301	688582	芯动联科	2,200	147,840.00	0.06
302	601528	瑞丰银行	25,400	147,066.00	0.06
303	601328	交通银行	18,200	145,600.00	0.05
304	688351	微电生理	7,250	142,825.00	0.05
305	002284	亚太股份	12,500	138,125.00	0.05
306	300602	飞荣达	6,500	137,865.00	0.05
307	688293	奥浦迈	3,000	135,030.00	0.05
308	601208	东材科技	13,900	131,772.00	0.05
309	300166	东方国信	11,700	127,530.00	0.05
310	000537	中绿电	15,100	126,236.00	0.05
311	002056	横店东磁	8,900	125,935.00	0.05
312	603659	璞泰来	6,600	123,948.00	0.05
313	603309	维力医疗	9,300	118,296.00	0.04
314	000636	风华高科	8,600	118,164.00	0.04
315	000877	天山股份	23,200	107,648.00	0.04
316	002081	金螳螂	31,100	106,673.00	0.04
317	003022	联泓新科	6,700	106,061.00	0.04
318	603379	三美股份	2,200	105,864.00	0.04
319	000039	中集集团	13,000	102,180.00	0.04
320	002913	奥士康	3,300	97,053.00	0.04
321	603899	晨光股份	3,300	95,667.00	0.04
322	600958	东方证券	9,800	94,864.00	0.04

323	601827	三峰环境	11,200	94,080.00	0.04
324	688097	博众精工	3,300	92,103.00	0.03
325	000709	河钢股份	41,600	89,856.00	0.03
326	301339	通行宝	5,100	87,363.00	0.03
327	000001	平安银行	7,000	84,490.00	0.03
328	002807	江阴银行	16,600	78,850.00	0.03
329	000825	太钢不锈	21,000	75,390.00	0.03
330	002100	天康生物	12,100	74,899.00	0.03
331	600690	海尔智家	2,900	71,862.00	0.03
332	603596	伯特利	1,300	68,497.00	0.03
333	002318	久立特材	2,900	67,831.00	0.03
334	600584	长电科技	2,000	67,380.00	0.03
335	300772	运达股份	5,148	66,306.24	0.02
336	601997	贵阳银行	10,600	66,144.00	0.02
337	002340	格林美	10,000	63,500.00	0.02
338	002120	韵达股份	9,400	62,980.00	0.02
339	300285	国瓷材料	3,500	60,725.00	0.02
340	603005	晶方科技	2,100	59,619.00	0.02
341	002275	桂林三金	3,900	55,809.00	0.02
342	600177	雅戈尔	7,500	54,750.00	0.02
343	000723	美锦能源	12,000	51,840.00	0.02
344	601598	中国外运	10,500	51,765.00	0.02
345	603816	顾家家居	2,000	51,040.00	0.02
346	688017	绿的谐波	400	49,956.00	0.02
347	603071	物产环能	3,900	49,647.00	0.02
348	600502	安徽建工	10,500	49,350.00	0.02
349	605117	德业股份	800	42,128.00	0.02
350	300369	绿盟科技	5,200	40,404.00	0.02
351	688411	海博思创	473	39,490.77	0.01
352	688570	天玛智控	1,900	38,912.00	0.01
353	688049	炬芯科技	600	36,300.00	0.01
354	600688	上海石化	12,600	35,910.00	0.01
355	600959	江苏有线	10,200	35,088.00	0.01
356	600155	华创云信	5,000	34,800.00	0.01
357	688366	昊海生科	510	26,132.40	0.01
358	688775	影石创新	207	25,701.12	0.01
359	000987	越秀资本	3,500	24,010.00	0.01
360	301458	钧崴电子	701	23,911.11	0.01
361	688696	极米科技	200	22,872.00	0.01
362	002180	纳思达	900	20,646.00	0.01
363	688545	兴福电子	746	20,104.70	0.01
364	688583	思看科技	227	18,087.36	0.01
365	600535	天士力	1,100	17,215.00	0.01

366	301678	新恒汇	378	16,836.12	0.01
367	301602	超研股份	658	16,318.40	0.01
368	001388	信通电子	937	15,385.54	0.01
369	301479	弘景光电	182	14,172.34	0.01
370	600999	招商证券	800	14,072.00	0.01
371	301535	浙江华远	734	13,938.66	0.01
372	688757	胜科纳米	536	13,903.84	0.01
373	688758	赛分科技	777	13,185.69	0.00
374	301275	汉朔科技	232	13,036.08	0.00
375	002777	久远银海	700	12,782.00	0.00
376	601918	新集能源	1,900	12,274.00	0.00
377	000690	宝新能源	2,600	11,830.00	0.00
378	301662	宏工科技	143	11,797.50	0.00
379	603072	天和磁材	216	11,761.20	0.00
380	301601	惠通科技	342	11,576.70	0.00
381	688475	萤石网络	360	11,347.20	0.00
382	301501	恒鑫生活	226	10,219.72	0.00
383	301658	首航新能	437	10,042.26	0.00
384	002738	中矿资源	300	9,648.00	0.00
385	001356	富岭股份	648	9,357.12	0.00
386	000563	陕国投 A	2,500	8,925.00	0.00
387	301665	泰禾股份	393	8,799.27	0.00
388	301328	维峰电子	200	8,430.00	0.00
389	301590	优优绿能	59	8,229.32	0.00
390	688755	汉邦科技	203	7,983.99	0.00
391	301173	毓恬冠佳	173	7,781.54	0.00
392	603456	九洲药业	500	7,605.00	0.00
393	600803	新奥股份	400	7,560.00	0.00
394	001382	新亚电缆	366	7,396.86	0.00
395	301636	泽润新能	128	6,074.88	0.00
396	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
397	301560	众捷汽车	190	5,215.50	0.00
398	002624	完美世界	300	4,551.00	0.00
399	603210	泰鸿万立	286	4,464.46	0.00
400	603014	威高血净	131	4,281.08	0.00
401	603124	江南新材	88	4,075.28	0.00
402	603271	永杰新材	114	3,999.12	0.00
403	001395	亚联机械	80	3,780.00	0.00
404	603202	天有为	39	3,535.74	0.00
405	600369	西南证券	800	3,480.00	0.00
406	001390	古麒绒材	178	3,225.36	0.00
407	603409	汇通控股	95	3,165.40	0.00
408	603257	中国瑞林	78	2,922.66	0.00

409	002221	东华能源	300	2,898.00	0.00
410	603400	华之杰	57	2,497.17	0.00
411	600188	兖矿能源	200	2,434.00	0.00
412	603382	海阳科技	105	2,350.95	0.00
413	001335	信凯科技	80	2,244.00	0.00
414	603120	肯特催化	65	2,172.95	0.00
415	300363	博腾股份	100	1,708.00	0.00
416	600906	财达证券	200	1,364.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300454	深信服	2,590,680.00	1.07
2	603259	药明康德	2,004,604.00	0.83
3	603444	吉比特	1,923,185.00	0.80
4	600109	国金证券	1,811,566.00	0.75
5	300033	同花顺	1,718,310.00	0.71
6	688258	卓易信息	1,687,006.98	0.70
7	600143	金发科技	1,657,660.00	0.69
8	688100	威胜信息	1,620,395.84	0.67
9	688048	长光华芯	1,611,970.87	0.67
10	300573	兴齐眼药	1,575,002.00	0.65
11	002926	华西证券	1,501,048.00	0.62
12	600060	海信视像	1,434,806.00	0.59
13	300496	中科创达	1,418,533.00	0.59
14	601298	青岛港	1,416,786.00	0.59
15	600422	昆药集团	1,389,130.00	0.58
16	002985	北摩高科	1,358,850.00	0.56
17	601126	四方股份	1,349,735.00	0.56
18	603267	鸿远电子	1,323,557.17	0.55
19	688198	佰仁医疗	1,314,015.55	0.54
20	000783	长江证券	1,311,380.00	0.54

注：不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600096	云天化	2,056,928.00	0.85
2	601211	国泰海通	1,979,462.00	0.82
3	688798	艾为电子	1,906,780.80	0.79
4	688200	华峰测控	1,897,107.80	0.79
5	603699	纽威股份	1,804,449.00	0.75
6	688208	道通科技	1,786,700.63	0.74

7	300866	安克创新	1,763,512.00	0.73
8	000830	鲁西化工	1,510,296.00	0.63
9	688120	华海清科	1,493,774.99	0.62
10	688095	福昕软件	1,469,296.44	0.61
11	688123	聚辰股份	1,460,959.74	0.61
12	688232	新点软件	1,457,641.69	0.60
13	605499	东鹏饮料	1,433,506.00	0.59
14	600060	海信视像	1,432,471.00	0.59
15	000528	柳工	1,404,676.00	0.58
16	002558	巨人网络	1,401,501.00	0.58
17	600487	亨通光电	1,399,412.00	0.58
18	000034	神州数码	1,362,247.00	0.56
19	000423	东阿阿胶	1,361,427.00	0.56
20	605333	沪光股份	1,324,383.00	0.55

注：不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	209,553,596.32
卖出股票收入（成交）总额	207,099,105.18

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	7,072,343.56	2.65
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	7,072,343.56	2.65

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	019749	24 国债 15	50,000	5,063,528.77	1.89
2	019766	25 国债 01	20,000	2,008,814.79	0.75

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

根据公募基金相关法规和本基金合同，我们可以使用股指期货进行加减仓位的投资操作。本报告期间因市场流动性或者股指期货贴水较大时，我们有使用股指期货套保调整或保持仓位。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情形。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	440,616.38
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	269,042.43
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	709,658.81

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人 户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
华泰柏瑞 量化智慧 混合 A	119,071	1,157.82	34,856,882.49	25.28	103,006,142.31	74.72
华泰柏瑞 量化智慧 混合 C	15,137	1,696.20	9,116,540.55	35.51	16,558,872.95	64.49
合计	133,857	1,221.74	43,973,423.04	26.89	119,565,015.26	73.11

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

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	华泰柏瑞量化智慧混合 A	202,218.35	0.1467
	华泰柏瑞量化智慧混合 C	0.61	0.0000
	合计	202,218.96	0.1237

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金	华泰柏瑞量化智慧混合 A	0

金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	华泰柏瑞量化智慧混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	华泰柏瑞量化智慧混合 A	10~50
	华泰柏瑞量化智慧混合 C	0
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华泰柏瑞量化智慧混合 A	华泰柏瑞量化智慧混合 C
基金合同生效日 (2015 年 6 月 3 日) 基金份额总额	906,942,174.07	—
本报告期期初基金份额总额	144,135,479.13	17,193,943.58
本报告期基金总申购份额	11,541,651.16	19,045,222.51
减：本报告期基金总赎回份额	17,814,105.49	10,563,752.59
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	137,863,024.80	25,675,413.50

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人重大人事变动：

经公司董事会审议通过，田汉卿女士于 2025 年 4 月 30 日起，不再担任公司副总经理。

经公司董事会审议通过，韩勇先生于 2025 年 5 月 9 日起不再担任公司总经理，董事长贾波先生代为履行总经理职责。

经公司股东会书面决定，韩勇先生于 2025 年 5 月 9 日起不再担任公司董事。

上述人事变动已按相关规定备案、报告。

基金托管人重大人事变动：

报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：报告期内基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：报告期内基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	
招商证券	2	88,304,599.68	21.27	44,161.30	21.27	-
东方证券	2	87,891,538.63	21.17	43,953.94	21.17	-
方正证券	2	82,118,740.05	19.78	41,067.29	19.78	-
长江证券	2	81,671,666.08	19.67	40,844.84	19.68	-
银河证券	2	61,128,962.54	14.73	30,569.27	14.73	-
国投证券	1	9,517,264.44	2.29	4,760.32	2.29	-
中金公司	2	4,474,275.00	1.08	2,238.10	1.08	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-

广发证券	6	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
国泰海通 证券	3	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
中金财富 证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

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、本报告期内，本基金退租湘财证券、兴业证券的交易单元。

4、国泰君安证券股份有限公司吸收合并海通证券股份有限公司。根据《国泰海通证券股份有限公司关于完成公司名称变更、注册资本变更、公司章程修订及相应市场主体变更登记的公告》，自 2025 年 4 月 3 日起，国泰君安证券股份有限公司中文名称变更为“国泰海通证券股份有限公司”。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
招商证券	4,996,506.00	71.46	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	1,995,882.00	28.54	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-

国都证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通 证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中金财富 证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金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	2025 年 06 月 04 日
2	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止民商基金销售(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	2025 年 05 月 24 日
3	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金参加中国邮政储蓄银行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	2025 年 05 月 14 日
4	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2025 年 05 月 14 日
5	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	2025 年 05 月 10 日
6	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	2025 年 05 月 01 日
7	华泰柏瑞基金管理有限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)	证监会规定报刊和网站	2025 年 3 月 31 日
8	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2025 年 03 月 19 日
9	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2025 年 01 月 03 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本报告期内未有单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

托管人住所

12.3 查阅方式

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

华泰柏瑞基金管理有限公司

2025 年 8 月 30 日