

华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券  
投资基金  
2026 年第 2 季度报告

2026 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：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2026 年 7 月 21 日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 7 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。

投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 4 月 1 日起至 2026 年 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

|            |                                                                                                                                                                                                                                          |
|------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 华泰柏瑞量化阿尔法                                                                                                                                                                                                                                |
| 基金主代码      | 005055                                                                                                                                                                                                                                   |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                                                                                                                                                                                                                                   |
| 基金合同生效日    | 2017 年 9 月 26 日                                                                                                                                                                                                                          |
| 报告期末基金份额总额 | 601,160,555.80 份                                                                                                                                                                                                                         |
| 投资目标       | 利用定量投资模型，在严格控制风险的前提下，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       | （一）资产配置策略<br>（二）股票投资策略<br>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%。<br>（三）存托凭证投资策略<br>（四）债券组合投资策略<br>（五）权证投资策略<br>（六）资产支持证券投资策略<br>（七）国债期货投资策略<br>（八）股指期货投资策略<br>（九）融资业务的投资策略 |
| 业绩比较基准     | 中证 800 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%                                                                                                                                                                                                         |
| 风险收益特征     | 本基金为混合型基金，其预期风险与预期收益高于债券                                                                                                                                                                                                                 |

|                 |                     |                  |
|-----------------|---------------------|------------------|
|                 | 型基金与货币市场基金，低于股票型基金。 |                  |
| 基金管理人           | 华泰柏瑞基金管理有限公司        |                  |
| 基金托管人           | 中国银行股份有限公司          |                  |
| 下属分级基金的基金简称     | 华泰柏瑞量化阿尔法 A         | 华泰柏瑞量化阿尔法 C      |
| 下属分级基金的交易代码     | 005055              | 006532           |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 303,366,861.36 份    | 297,793,694.44 份 |

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标          | 报告期（2026 年 4 月 1 日-2026 年 6 月 30 日） |                 |
|-----------------|-------------------------------------|-----------------|
|                 | 华泰柏瑞量化阿尔法 A                         | 华泰柏瑞量化阿尔法 C     |
| 1. 本期已实现收益      | -3,710,057.90                       | 4,473,270.62    |
| 2. 本期利润         | -80,353,032.92                      | -132,801,357.02 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.2555                             | -0.2703         |
| 4. 期末基金资产净值     | 496,515,130.02                      | 484,768,247.90  |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.6367                              | 1.6279          |

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华泰柏瑞量化阿尔法 A

| 阶段    | 净值增长率①  | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③     | ②—④   |
|-------|---------|-----------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去三个月 | -13.78% | 1.62%     | 13.02%     | 1.27%         | -26.80% | 0.35% |
| 过去六个月 | -7.45%  | 1.66%     | 10.59%     | 1.18%         | -18.04% | 0.48% |
| 过去一年  | 11.75%  | 1.37%     | 31.40%     | 1.04%         | -19.65% | 0.33% |
| 过去三年  | 19.65%  | 1.23%     | 33.43%     | 1.12%         | -13.78% | 0.11% |
| 过去五年  | 6.83%   | 1.16%     | 3.99%      | 1.09%         | 2.84%   | 0.07% |
| 过去七年  | 69.01%  | 1.17%     | 40.39%     | 1.12%         | 28.62%  | 0.05% |

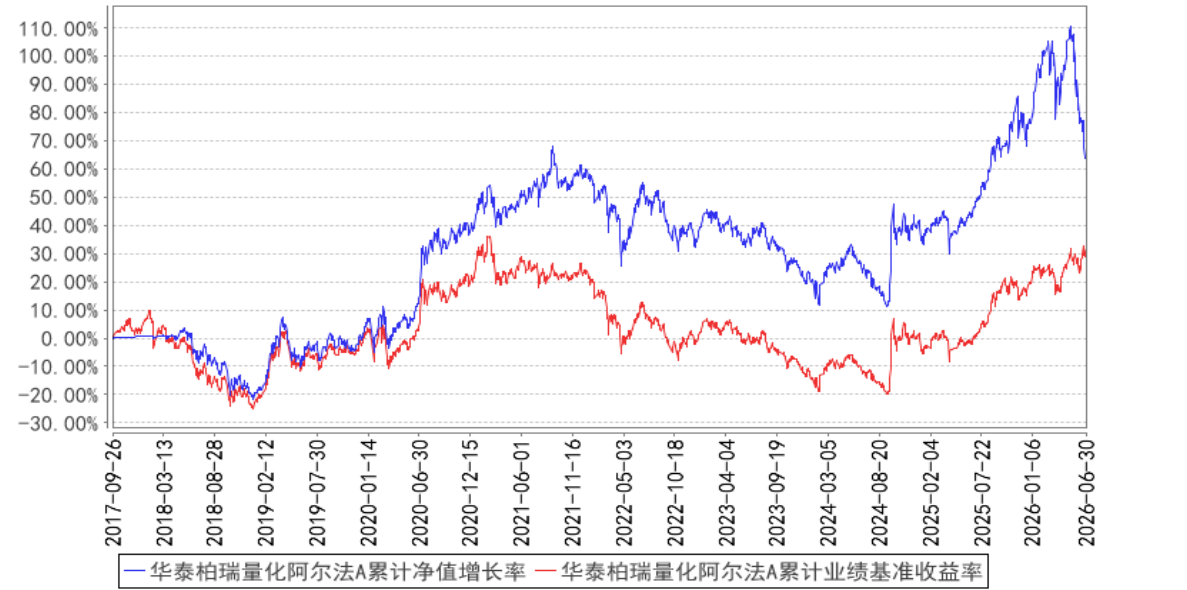
|                |        |       |        |       |        |       |
|----------------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 自基金合同<br>生效起至今 | 63.67% | 1.17% | 32.00% | 1.15% | 31.67% | 0.02% |
|----------------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|

华泰柏瑞量化阿尔法 C

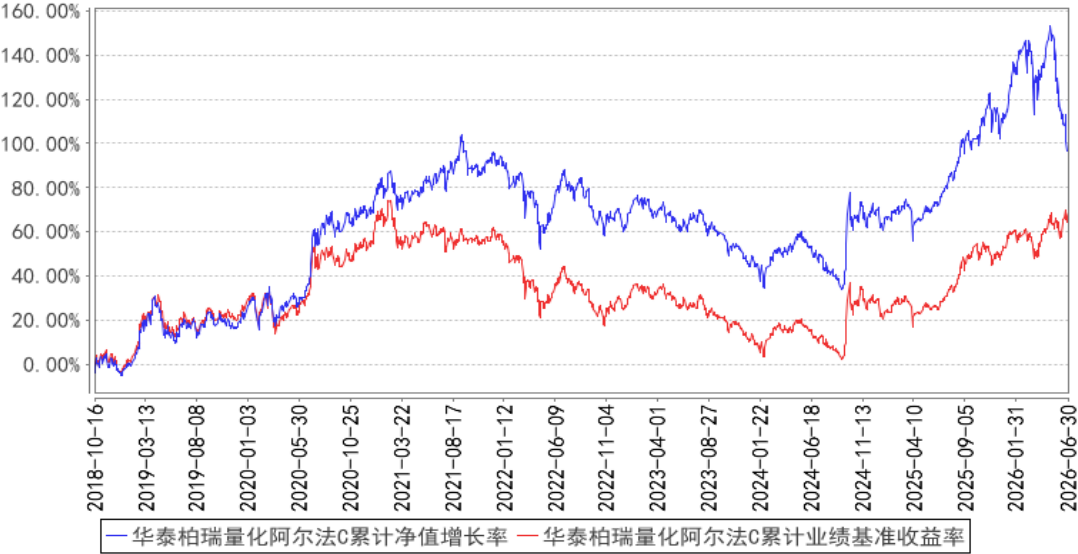
| 阶段             | 净值增长率①  | 净值增长率标准<br>差② | 业绩比较基准<br>收益率③ | 业绩比较基准<br>收益率标准差<br>④ | ①—③     | ②—④   |
|----------------|---------|---------------|----------------|-----------------------|---------|-------|
| 过去三个月          | -13.83% | 1.62%         | 13.02%         | 1.27%                 | -26.85% | 0.35% |
| 过去六个月          | -7.56%  | 1.66%         | 10.59%         | 1.18%                 | -18.15% | 0.48% |
| 过去一年           | 11.48%  | 1.37%         | 31.40%         | 1.04%                 | -19.92% | 0.33% |
| 过去三年           | 18.76%  | 1.23%         | 33.43%         | 1.12%                 | -14.67% | 0.11% |
| 过去五年           | 5.52%   | 1.16%         | 3.99%          | 1.09%                 | 1.53%   | 0.07% |
| 过去七年           | 66.26%  | 1.17%         | 40.39%         | 1.12%                 | 25.87%  | 0.05% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 96.32%  | 1.20%         | 68.81%         | 1.16%                 | 27.51%  | 0.04% |

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

华泰柏瑞量化阿尔法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



华泰柏瑞量化阿尔法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 2017 年 9 月 26 日至 2026 年 6 月 30 日。C 类图示日期为 2018 年 10 月 16 日至 2026 年 6 月 30 日。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名  | 职务                   | 任本基金的基金经理期限     |      | 证券从业年限 | 说明                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
|-----|----------------------|-----------------|------|--------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |                      | 任职日期            | 离任日期 |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 孔令烨 | 量化与海外投资部副总监、本基金的基金经理 | 2025 年 9 月 10 日 | -    | 11 年   | 英国伦敦大学学院金融风险管理专业硕士。曾任德意志银行股份公司高级分析师。2017 年 5 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研究员、高级研究员、量化研究总监助理、量化研究副总监。现任量化与海外投资部副总监兼基金经理。2022 年 8 月至 2026 年 6 月任华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2024 年 1 月起任华泰柏瑞中证 2000 指数增强型证券投资基金的基金经理。2025 年 9 月起任华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2025 年 11 月起任华泰柏瑞上证科创板综合指数增强型证券投资基金的基金经理。2025 年 11 月起任华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金的基金经理。2026 年 4 月起任华泰柏瑞中证全指指数增强型证券投资基金的基金经理。2026 年 6 月起任华泰柏瑞沪 |

|    |                           |                 |   |      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
|----|---------------------------|-----------------|---|------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    |                           |                 |   |      | 深 300 指数增强型证券投资基金的基金经理。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 盛豪 | 总经理助理、量化与海外投资部总监、本基金的基金经理 | 2017 年 9 月 26 日 | - | 18 年 | <p>英国剑桥大学数学系硕士。2007 年 10 月至 2010 年 3 月任 Wilshire Associates 量化研究员，2010 年 11 月至 2012 年 8 月任 Goldenberg Hehmeyer Trading Company 交易员。2012 年 9 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任量化投资部研究员、基金经理助理。现任总经理助理兼量化与海外投资部总监。2015 年 10 月起任华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金。2015 年 10 月至 2024 年 9 月，任华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 12 月至 2018 年 11 月任华泰柏瑞行业竞争优势灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 3 月至 2018 年 10 月任华泰柏瑞盛利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 3 月至 2018 年 11 月任华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 3 月至 2018 年 3 月任华泰柏瑞嘉利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 4 月至 2018 年 4 月任华泰柏瑞泰利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 4 月至 2019 年 3 月任华泰柏瑞睿利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 6 月至 2020 年 6 月任华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 9 月起任华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 12 月至 2024 年 10 月任华泰柏瑞港股通量化灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 3 月至 2022 年 11 月任华泰柏瑞量化明选混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 12 月至 2023 年 9 月任华泰柏瑞量化创享混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月起任华泰柏瑞量化先行混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月至 2025 年 10 月任华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金的基金经理。2023 年 3</p> |

|  |  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                |
|--|--|--|--|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | 月至 2024 年 9 月，任华泰柏瑞上证 50 指数增强型证券投资基金的基金经理。2024 年 1 月起任华泰柏瑞中证 2000 指数增强型证券投资基金的基金经理。2025 年 1 月起任华泰柏瑞红利量化选股混合型证券投资基金的基金经理。2025 年 4 月起任华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金基金经理。2026 年 5 月起任华泰柏瑞嘉锐量化选股混合型证券投资基金的基金经理 |
|--|--|--|--|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

| 姓名 | 产品类型     | 产品数量（只） | 资产净值（元）           | 任职时间             |
|----|----------|---------|-------------------|------------------|
| 盛豪 | 公募基金     | 7       | 8,567,796,609.71  | 2015 年 10 月 13 日 |
|    | 私募资产管理计划 | 3       | 4,895,106,552.45  | 2024 年 11 月 8 日  |
|    | 其他组合     | -       | -                 | -                |
|    | 合计       | 10      | 13,462,903,162.16 | -                |

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内本基金的运作符合相关法律、法规以及基金合同的约定、勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，不存在损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求，通过科学完善的制度及流程，从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能的利益输送。首先投资部和研究部通过规范的决策流程来确保公平对待不同投资组合。其次交易部对投资指令的合规性、有效性及合理性进行独立审核，在交易过程中启用投资交易系统内的公平交易模块，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 4 次，是指数或量化投资组合因投资

策略需要而发生的反向交易。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2026 年二季度，A 股市场从国际地缘冲突的冲击中快速修复，板块分化明显，成交量快速放大新高后维持在 3 万亿以上，交易结构拥挤度持续提高。行情主要集中在科技板块，光通信、半导体等 AI 产业链中上游在一季报验证了景气度高增之后持续上涨，与之相对的传统行业板块资金流出明显，股价与流动性分化显著。

本报告期，传统行业占比较高的上证 50、沪深 300 分别上涨 5.78%和 11.90%；代表成长类上市公司的创业板指和科创 50 分别上涨 36.35%和 75.74%；中小市值指数中证 1000 和中证 2000 同期涨幅分别为 15.62%和 7.78%。万得微盘股指数-13.8%。横向比较来看，大中盘成长总体跑赢小微盘和大盘价值，双创表现大幅好于全市场。

本报告期内，我们坚持多因子模型的量化选股策略，结合市场历史表现和量化模型回测结果，本基金股票持仓相对业绩基准有一些小市值股票的暴露。

展望 2026 年三季度，我们认为短期市场乐观情绪和预期可能随着中报验证逐步修正，板块间的明显分化或有一定程度修复，由乐观情绪驱动的跟风资金与被市场分化挤压的调仓资金可能面临波动率扩大，前期持续上涨的高拥挤度板块可能出现分化。随着改革政策变得更加积极，新兴产业稳步发展，在股票市场整体估值处在合理区间的前提下，市场中长期表现可期。从行情发展的历史经验总结来看，在流动性保持充裕的前提下，市场风格有可能从估值提升逐渐偏向盈利增长驱动，业绩兑现不达预期的板块可能出现一定波动，板块间分化可能较为显著。

虽然国际贸易冲突、地缘冲突等风险因素可能将长期存在，但我们坚定看好中国产业链的创新能力和国际竞争力，相信新质生产力的长期优势。在不出现极端情况的前提下，我们对未来几个季度的 A 股股票市场持谨慎乐观的态度，对于股票市场的中长期表现更为乐观。

量化策略方面，当前市场呈现风格轮动加快、板块分化加剧的特征。在此环境下，兼具主题热度与基本面优秀的股票或更容易受到资金的青睐，技术面因子亦可借助捕捉资金流向特征，力争获取超额收益。与此同时，基本面因子持续筛选出估值合理、业绩优异且具备良好成长性的标的，力争为模型提供较强的支撑。

如上所述，我们认为，当前 A 股市场整体估值合理，具备长期配置价值。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末华泰柏瑞量化阿尔法 A 的基金份额净值为 1.6367 元，本报告期基金份额净值增长率为-13.78%，同期业绩比较基准收益率为 13.02%，截至本报告期末华泰柏瑞量化阿尔法 C

的基金份额净值为 1.6279 元，本报告期基金份额净值增长率为-13.83%，同期业绩比较基准收益率为 13.02%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额（元）          | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 894,471,449.66 | 89.86        |
|    | 其中：股票             | 894,471,449.66 | 89.86        |
| 2  | 基金投资              | —              | —            |
| 3  | 固定收益投资            | —              | —            |
|    | 其中：债券             | —              | —            |
|    | 资产支持证券            | —              | —            |
| 4  | 贵金属投资             | —              | —            |
| 5  | 金融衍生品投资           | —              | —            |
| 6  | 买入返售金融资产          | —              | —            |
|    | 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      | 95,661,342.90  | 9.61         |
| 8  | 其他资产              | 5,259,161.58   | 0.53         |
| 9  | 合计                | 995,391,954.14 | 100.00       |

#### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）        | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|----------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | 8,976,127.00   | 0.91         |
| B  | 采矿业              | 36,149.82      | 0.00         |
| C  | 制造业              | 626,013,868.33 | 63.80        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 3,202,510.00   | 0.33         |
| E  | 建筑业              | 29,556,590.00  | 3.01         |
| F  | 批发和零售业           | 52,003,278.00  | 5.30         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 12,742,989.46  | 1.30         |
| H  | 住宿和餐饮业           | —              | —            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 38,668,031.60  | 3.94         |

|   |               |                |       |
|---|---------------|----------------|-------|
| J | 金融业           | —              | —     |
| K | 房地产业          | 23,231,867.00  | 2.37  |
| L | 租赁和商务服务业      | 9,906,603.00   | 1.01  |
| M | 科学研究和技术服务业    | 44,689,782.45  | 4.55  |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 27,088,494.00  | 2.76  |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | —              | —     |
| P | 教育            | 7,333,260.00   | 0.75  |
| Q | 卫生和社会工作       | 3,473,845.00   | 0.35  |
| R | 文化、体育和娱乐业     | 7,548,054.00   | 0.77  |
| S | 综合            | —              | —     |
|   | 合计            | 894,471,449.66 | 91.15 |

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

### 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股）     | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|-----------|--------------|--------------|
| 1  | 688329 | 艾隆科技 | 386,230   | 7,805,708.30 | 0.80         |
| 2  | 301098 | 金埔园林 | 938,400   | 7,694,880.00 | 0.78         |
| 3  | 001373 | 翔腾新材 | 237,100   | 7,148,565.00 | 0.73         |
| 4  | 300610 | 晨化股份 | 730,597   | 7,123,320.75 | 0.73         |
| 5  | 301336 | 趣睡科技 | 177,380   | 7,086,331.00 | 0.72         |
| 6  | 301036 | 双乐股份 | 316,400   | 6,938,652.00 | 0.71         |
| 7  | 600768 | 宁波富邦 | 454,000   | 6,800,920.00 | 0.69         |
| 8  | 002687 | 乔治白  | 1,293,700 | 6,778,988.00 | 0.69         |
| 9  | 301390 | 经纬股份 | 208,600   | 6,729,436.00 | 0.69         |
| 10 | 300823 | 建科智能 | 460,600   | 6,715,548.00 | 0.68         |

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

| 代码                | 名称                | 持仓量（买/卖） | 合约市值(元)       | 公允价值变动（元）  | 风险说明         |
|-------------------|-------------------|----------|---------------|------------|--------------|
| IC2607            | 中证 500 股指期货 2607  | 7        | 12,499,480.00 | 810,440.00 | -            |
| IF2607            | 沪深 300 股指期货 2607  | 5        | 7,383,000.00  | 135,960.00 | -            |
| IM2607            | 中证 1000 股指期货 2607 | 4        | 6,951,680.00  | 202,640.00 | -            |
| 公允价值变动总额合计（元）     |                   |          |               |            | 1,149,040.00 |
| 股指期货投资本期收益（元）     |                   |          |               |            | 4,442,936.13 |
| 股指期货投资本期公允价值变动（元） |                   |          |               |            | 7,582,170.00 |

### 5.9.2 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。本报告期间因申赎、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。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

## 5.11 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，艾隆科技（688329）在报告编制日前一年内曾受到上海证券交易所的处罚。

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

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

### 5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同约定备选股票库之外的情形。

### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）        |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | 4,605,816.34 |
| 2  | 应收证券清算款 | 165,989.99   |
| 3  | 应收股利    | —            |
| 4  | 应收利息    | —            |
| 5  | 应收申购款   | 487,355.25   |
| 6  | 其他应收款   | —            |
| 7  | 其他      | —            |
| 8  | 合计      | 5,259,161.58 |

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 华泰柏瑞量化阿尔法 A | 华泰柏瑞量化阿尔法 C |
|----|-------------|-------------|
|----|-------------|-------------|

|                           |                |                |
|---------------------------|----------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 325,312,351.78 | 416,007,619.86 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 28,282,907.85  | 375,758,198.45 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额            | 50,228,398.27  | 493,972,123.87 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -              | -              |
| 报告期期末基金份额总额               | 303,366,861.36 | 297,793,694.44 |

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：本报告期内，基金管理人未持有本基金份额。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期内，管理人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本报告期内未有单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

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

### 9.2 存放地点

上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

托管人住所

### 9.3 查阅方式

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

021-3878 4638 公司网址：[www.huatai-pb.com](http://www.huatai-pb.com)

华泰柏瑞基金管理有限公司

2026 年 7 月 21 日