

华泰柏瑞沪深 300 指数增强型证券投资基金
(原华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型
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。

华泰柏瑞沪深 300 指数增强型证券投资基金由华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金变更而来。本基金管理人于 2026 年 4 月 30 日至 2026 年 6 月 1 日以通讯方式召开了本基金的基金份额持有人大会，于 2026 年 6 月 2 日审议并通过了《关于华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金转型为华泰柏瑞沪深 300 指数增强型证券投资基金有关事项的议案》。自 2026 年 6 月 12 日起，《华泰柏瑞沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》《华泰柏瑞沪深 300 指数增强型证券投资基金托管协议》《华泰柏瑞沪深 300 指数增强型证券投资基金招募说明书》等法律文件生效。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告中，转型前报告期自 2026 年 4 月 1 日起至 2026 年 6 月 11 日止，转型后报告期自 2026 年 6 月 12 日起至 2026 年 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况（转型后）

基金简称	华泰柏瑞沪深 300 指数增强
基金主代码	001074
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2026 年 6 月 12 日
报告期末基金份额总额	230,365,128.55 份
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	1、股票投资策略：本基金为增强型指数基金，主要利用量化投资模型，在保持对基准指数紧密跟踪的前提下力争实现对基准指数长期超越。本基金力争使基金

	净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 8%；2、存托凭证投资策略；3、债券投资策略；4、资产支持证券投资策略；5、衍生品投资策略；6、融资及转融通证券出借业务的投资策略	
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*95%+活期存款基准利率*5%	
风险收益特征	本基金是一只股票指数增强型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。 本基金还可以根据法律法规规定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。	
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	华泰柏瑞沪深 300 指数增强 A	华泰柏瑞沪深 300 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	001074	006531
报告期末下属分级基金的份额总额	173,663,871.24 份	56,701,257.31 份

2.1 基金基本情况（转型前）

基金简称	华泰柏瑞量化驱动混合	
基金主代码	001074	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 3 月 24 日	
报告期末基金份额总额	230,364,237.92 份	
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	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%。	
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：95%*沪深 300 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。	
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	华泰柏瑞量化驱动混合 A	华泰柏瑞量化驱动混合 C
下属分级基金的交易代码	001074	006531
报告期末下属分级基金的份额总额	177,075,593.27 份	53,288,644.65 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标（转型后）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2026 年 6 月 12 日-2026 年 6 月 30 日）	
	华泰柏瑞沪深 300 指数增强 A	华泰柏瑞沪深 300 指数增强 C
1. 本期已实现收益	4,547,295.25	1,405,721.57
2. 本期利润	23,152,347.62	7,023,596.43
3. 加权平均基金份额本期利润	0.1320	0.1281
4. 期末基金资产净值	347,560,982.00	112,131,107.75
5. 期末基金份额净值	2.0013	1.9776

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、本基金转型后基金合同于 2026 年 6 月 12 日起生效。

3.1 主要财务指标（转型前）

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 11 日）	
	华泰柏瑞量化驱动混合 A	华泰柏瑞量化驱动混合 C
1. 本期已实现收益	18,847,243.06	5,016,026.55
2. 本期利润	27,146,337.35	5,479,611.82
3. 加权平均基金份额本期利润	0.1424	0.1149
4. 期末基金资产净值	331,187,672.52	98,493,116.21
5. 期末基金份额净值	1.8703	1.8483

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（转型后）

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

华泰柏瑞沪深 300 指数增强 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	①—③	②—④
----	--------	---------------	----------------	----------------	-----	-----

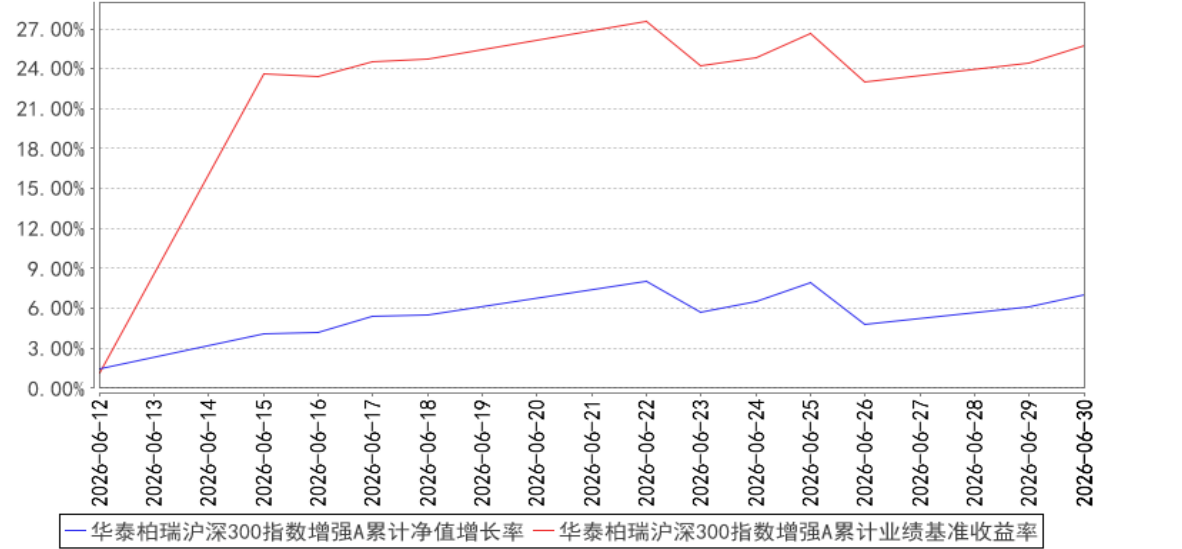
				准差④		
自基金合同 生效起至今	7.00%	1.65%	5.17%	1.65%	1.83%	0.00%

华泰柏瑞沪深 300 指数增强 C

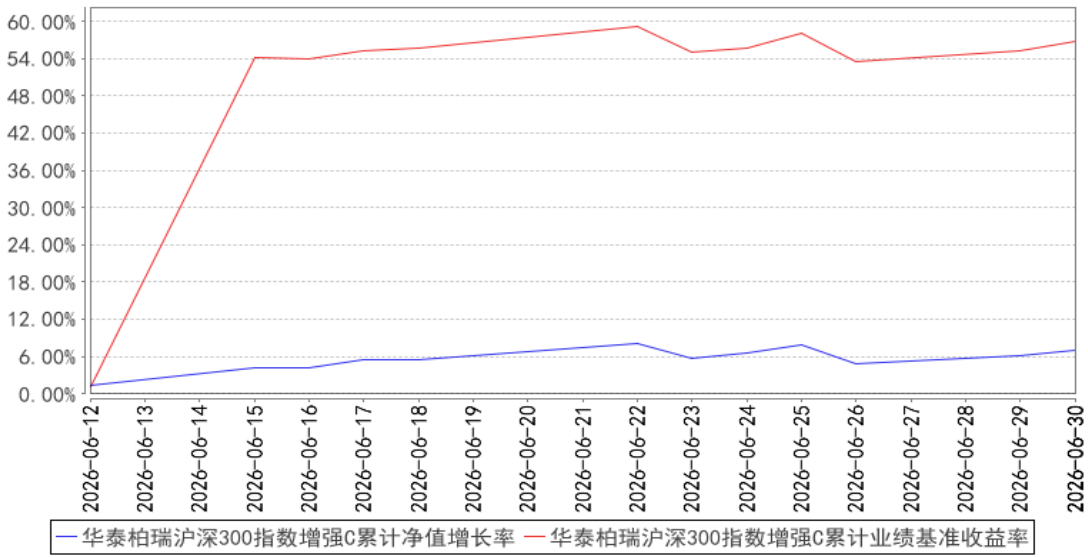
阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①－③	②－④
自基金合同 生效起至今	7.00%	1.65%	5.17%	1.65%	1.83%	0.00%

3.2.2 自基金转型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

华泰柏瑞沪深300指数增强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



华泰柏瑞沪深300指数增强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：1、A类图示日期为2026年6月12日（基金转型日）至2026年6月30日。C类图示日期为2026年6月12日（基金转型日）至2026年6月30日。

- 2、本基金于2026年6月12日正式转型为华泰柏瑞沪深300指数增强型证券投资基金。
- 3、自2026年6月12日起，本基金的业绩比较基准由“95%*沪深300指数收益率+5%*银行活期存款利率（税后）”变更为“沪深300指数收益率*95%+活期存款基准利率*5%”。

3.2 基金净值表现（转型前）

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

华泰柏瑞量化驱动混合 A

阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	7.66%	1.08%	5.82%	1.06%	1.84%	0.02%
过去六个月	5.78%	1.04%	1.93%	0.99%	3.85%	0.05%
过去一年	29.95%	0.97%	18.97%	0.92%	10.98%	0.05%
过去三年	40.19%	1.07%	21.95%	1.04%	18.24%	0.03%
过去五年	17.02%	1.04%	-8.75%	1.05%	25.77%	-0.01%
过去七年	79.39%	1.08%	22.96%	1.10%	56.43%	-0.02%
过去十年	127.97%	1.08%	48.12%	1.09%	79.85%	-0.01%

自基金合同 生效起至今	87.03%	1.28%	19.50%	1.27%	67.53%	0.01%
----------------	--------	-------	--------	-------	--------	-------

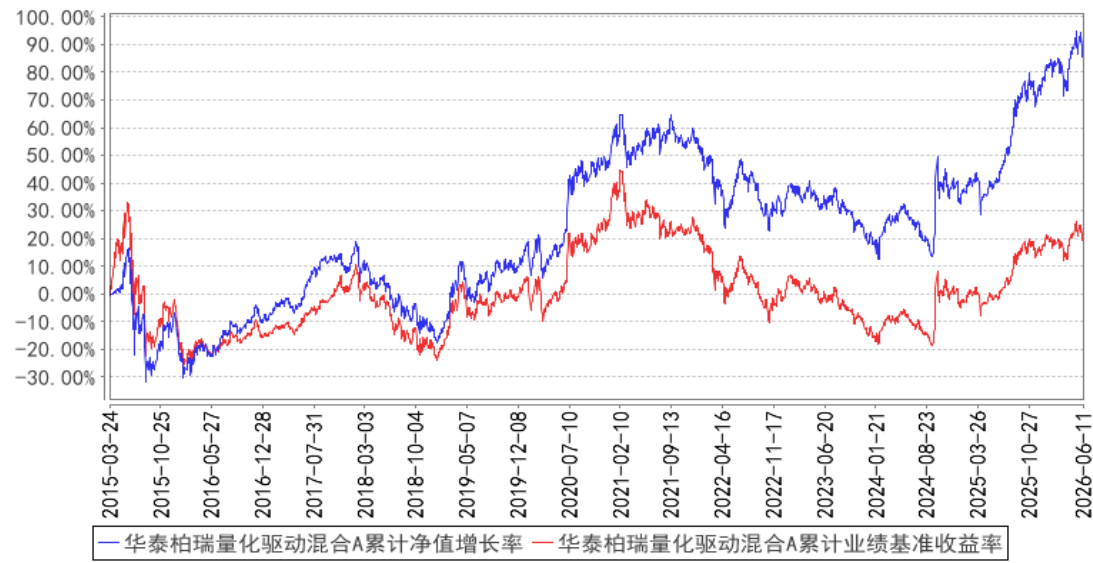
华泰柏瑞量化驱动混合 C

阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	7.61%	1.08%	5.82%	1.06%	1.79%	0.02%
过去六个月	5.68%	1.04%	1.93%	0.99%	3.75%	0.05%
过去一年	29.66%	0.97%	18.97%	0.92%	10.69%	0.05%
过去三年	39.15%	1.07%	21.95%	1.04%	17.20%	0.03%
过去五年	15.58%	1.04%	-8.75%	1.05%	24.33%	-0.01%
过去七年	76.42%	1.08%	22.96%	1.10%	53.46%	-0.02%
自基金合同 生效起至今	109.23%	1.12%	49.11%	1.14%	60.12%	-0.02%

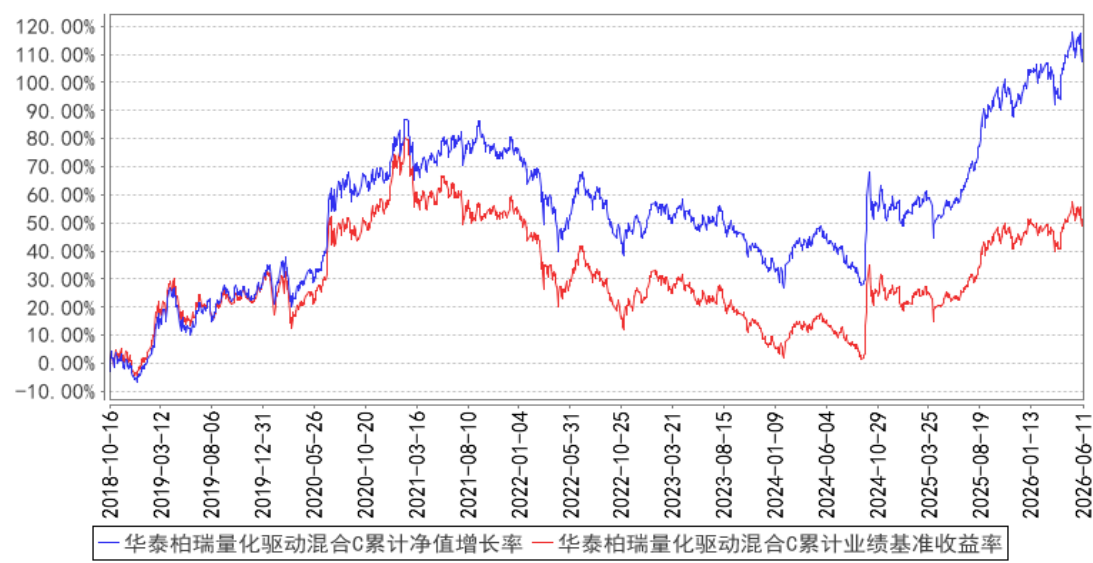
注：注：过去三个月为 2026 年 4 月 1 日至 2026 年 6 月 11 日，过去六个月为 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 11 日，过去一年为 2025 年 7 月 1 日至 2026 年 6 月 11 日，过去三年为 2023 年 7 月 1 日至 2026 年 6 月 11 日，过去五年为 2021 年 7 月 1 日至 2026 年 6 月 11 日，过去七年为 2019 年 7 月 1 日至 2026 年 6 月 11 日，过去十年为 2016 年 7 月 1 日至 2026 年 6 月 11 日，自基金合同生效起至今为 2015 年 3 月 24 日至 2026 年 6 月 11 日。

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

华泰柏瑞量化驱动混合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



华泰柏瑞量化驱动混合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3月24日至2026年6月11日。C类图示日期为2018年10月16日至2026年6月11日。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型后）

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		
和磊	本基金的基金经理	2026年06月12日	-	19年	硕士毕业于上海财经大学数量经济学专业。2007年4月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任高级交易员、量化投资

					部研究员、投资经理。2025 年 11 月起任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、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。2025 年 11 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。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。
孔令烨	量化与海外投资部副总监、本基金的基金经理	2026 年 06 月 12 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。

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（转型后）

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。

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型前）

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		
和磊	本基金的基金经理	2025 年 11 月 18 日	2026 年 06 月 11 日	19 年	硕士毕业于上海财经大学数量经济学专业。2007 年 4 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任高级交易员、量化投资部研究员、投资经理。2025 年 11 月起任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、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、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。
孔令烨	量化与海外投资部副总监、本基金的基金经理	2022 年 08 月 05 日	2026 年 06 月 11 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 月起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。

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（转型前）

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

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 股先升后落，上证指数跨越 4200 点关口，主要指数均创出多年新高。季初，美伊战事边际缓和，对全球能源体系威胁边际下降，市场风险偏好逐渐好转，结束三月初以来跌势。进入财报季，市场对业绩较好的上市公司正反馈明显上升，市场进入普涨行情。五月中旬之后，市场进入结构性分化行情。海外人工智能相关资本开支增加，半导体硬件产业链提价预期上升，相关板块连创新高，结构化行情持续到季末。整体看，以涨价逻辑为主线的 AI 相关硬件，以及产业链上游的新材料和有色等表现较为活跃，而金融和消费相关行业表现相对稳健。

本报告期，代表大市值公司的沪深 300 上涨 11.9%；代表中小市值公司的中证 500、中证 1000 同期涨幅分别为 18.56%、15.62%；代表高股息类上市公司的中证红利全收益指数下跌 10.74%。横向比较来看，股价弹性较大的中小市值公司，在本季度跑赢资源品占比较高的高股息类上市公司和大市值类上市公司。

本报告期内，我们坚持多因子模型的量化选股策略，结合对市场的研判，采取比较稳健的投资策略。

展望未来几个季度，A 股市场面临的国内外环境相对友好。2026 年以来，尽管美伊冲突威胁全球能源供应链，得益于能源安全体系构建，以及新能源转型的成果，国内经济韧性再一次得到验证。我们预计今后一段时间，能源安全将位于更加突出的位置，新能源转型升级也将更加深入推进。同时我们预期财政发力，消费补贴等扩内需政策将延续，并加强对人工智能等产业方向的引导。海外，美国的对外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。2026 年是“十五五”规划开局之年，从能源到 AI 基础设施等领域的投资预计将靠前发力，也将进一步增强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，在经历年初以来风险偏好的波动，以及大资金深度参与稳定市场预期之后，未来股票市场的不确定性在下降。随着半年度财报季临近，我们预计投资人将更加关注上市公司业绩展望的边际变化。从因子表现来看，华泰柏瑞量化团队的成长和量价类因子近期表现较好，我们认为其趋势仍将延续。价值和质量类因子表现相对稳健，预计后续将有更好的表现。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 股市场整体估值合理，对于专注于捕捉边际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多因子量化基金的机会。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金由华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金转型为华泰柏瑞沪深 300 指数增强型证券投资基金，转型前（报告期：2026 年 4 月 1 日至 2026 年 6 月 11 日），截至报告期末华泰柏瑞量化驱动混合 A 的基金份额净值为 1.8703 元，报告期期间基金份额净值增长率为 7.66%，同期业绩比较基准收益率为 5.82%，华泰柏瑞量化驱动混合 C 的基金份额净值为 1.8483 元，报告期期间基金份额净值增长率为 7.61%，同期业绩比较基准收益率为 5.82%。转型后（报告期：2026 年 6 月 12 日至 2026 年 6 月 31 日），截至报告期末华泰柏瑞沪深 300 指数增强 A 的基金份额净值为 2.0013 元，报告期期间基金份额净值增长率为 7.00%，同期业绩比较基准收益率为 5.17%，华泰柏瑞沪深 300 指数增强 C 的基金份额净值为 1.9776 元，报告期期间基金份额净值增长率为 7.00%，同期业绩比较基准收益率为 5.17%。

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（转型后）

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	419,696,248.63	91.01
	其中：股票	419,696,248.63	91.01
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	39,180,165.23	8.50

8	其他资产	2,288,475.99	0.50
9	合计	461,164,889.85	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	—	—
B	采矿业	20,422,498.82	4.44
C	制造业	260,698,994.16	56.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,477,034.00	2.06
E	建筑业	5,600,890.00	1.22
F	批发和零售业	7,153,037.00	1.56
G	交通运输、仓储和邮政业	13,461,019.46	2.93
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	20,271,891.15	4.41
J	金融业	77,650,188.04	16.89
K	房地产业	331,045.00	0.07
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	4,629,651.00	1.01
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	419,696,248.63	91.30

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	300308	中际旭创	12,900	16,383,000.00	3.56
2	300750	宁德时代	39,400	15,484,594.00	3.37
3	300502	新易盛	18,228	11,064,396.00	2.41
4	603986	兆易创新	10,600	8,639,000.00	1.88
5	000776	广发证券	304,600	7,127,640.00	1.55
6	002916	深南电路	14,000	6,410,600.00	1.39

7	688012	中微公司	13,223	6,194,975.50	1.35
8	601899	紫金矿业	245,400	6,169,356.00	1.34
9	300394	天孚通信	18,780	5,684,330.40	1.24
10	688396	华润微	57,600	5,618,880.00	1.22

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
IF2607	沪深 300 股指期货 2607	6	8,859,600.00	152,856.00	-
公允价值变动总额合计（元）					152,856.00
股指期货投资本期收益（元）					141,748.53
股指期货投资本期公允价值变动（元）					707,196.00

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。本报告期间基金遇到大额申赎时，我们有使用股指期货套保保持仓位。

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，广发证券（000776）在报告编制日前一年内曾受到中国银行间市场交易商协会的处罚。

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	1,140,106.63
2	应收证券清算款	91,137.69
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	1,057,231.67
6	其他应收款	—
7	其他	—
8	合计	2,288,475.99

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。

§5 投资组合报告（转型前）

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	388,944,321.85	90.28
	其中：股票	388,944,321.85	90.28
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	39,488,684.25	9.17
8	其他资产	2,369,666.40	0.55
9	合计	430,802,672.50	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	—	—
B	采矿业	20,736,690.55	4.83
C	制造业	229,037,839.87	53.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,759,072.00	2.74
E	建筑业	6,234,937.00	1.45
F	批发和零售业	6,561,466.00	1.53
G	交通运输、仓储和邮政业	12,404,387.65	2.89
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,971,072.58	3.95
J	金融业	79,338,224.76	18.46
K	房地产业	368,225.00	0.09
L	租赁和商务服务业	775,336.00	0.18
M	科学研究和技术服务业	4,757,070.44	1.11
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—

Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	388,944,321.85	90.52

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	300308	中际旭创	14,100	15,848,400.00	3.69
2	300750	宁德时代	39,800	15,211,560.00	3.54
3	300502	新易盛	18,228	9,587,928.00	2.23
4	601899	紫金矿业	236,000	6,449,880.00	1.50
5	300394	天孚通信	14,700	6,060,810.00	1.41
6	000001	平安银行	522,320	5,902,216.00	1.37
7	000776	广发证券	306,700	5,873,305.00	1.37
8	601328	交通银行	823,600	5,740,492.00	1.34
9	600519	贵州茅台	4,475	5,723,525.00	1.33
10	603986	兆易创新	10,200	4,931,700.00	1.15

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
IF2606	沪深 300 股指期货 2606	10	14,032,200.00	-554,340.00	-
公允价值变动总额合计（元）					-554,340.00
股指期货投资本期收益（元）					-439.60
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-554,340.00

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

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。

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规定备选股票库之外的情形。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,760,857.52
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	572,270.44

6	其他应收款	-
7	待摊费用	36,538.44
8	其他	-
9	合计	2,369,666.40

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（转型后）

单位：份

项目	华泰柏瑞沪深 300 指数增强 A	华泰柏瑞沪深 300 指数增强 C
基金合同生效日(2026 年 6 月 12 日)基金份额总额	177,075,593.27	53,288,644.65
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	4,000,265.63	4,964,815.32
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	7,411,987.66	1,552,202.66
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	173,663,871.24	56,701,257.31

§6 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

项目	华泰柏瑞量化驱动混合 A	华泰柏瑞量化驱动混合 C
报告期期初基金份额总额	199,331,578.51	42,867,946.08
报告期期间基金总申购份额	3,539,108.13	15,140,426.47
减:报告期期间基金总赎回份额	25,795,093.37	4,719,727.90
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	177,075,593.27	53,288,644.65

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型后）

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。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型前）

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

本基金管理人于 2026 年 4 月 30 日至 2026 年 6 月 1 日以通讯方式召开了本基金的基金份额持有人大会，于 2026 年 6 月 2 日审议并通过了《关于华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金转型为华泰柏瑞沪深 300 指数增强型证券投资基金有关事项的议案》。自 2026 年 6 月 12 日起，本基金按调整后的条款执行，本基金管理人已将《华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金基金合同》《华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金托管协议》修订为《华泰柏瑞沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》《华泰柏瑞沪深 300 指数增强型证券投资基金托管协议》，并据此拟定了《华泰柏瑞沪深 300 指数增强型证券投资基金招募说明书》。详情可见本基金管理人网站（<https://www.huatai-pb.com/>）刊登的《华泰柏瑞基金管理有限公司关于以通讯方式召开华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》

《华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。

§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变更注册文件

- 2、本基金的《基金合同》
- 3、本基金的《招募说明书》
- 4、本基金的《托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、本基金的公告

9.2 存放地点

上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

托管人住所

9.3 查阅方式

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

021-3878 4638 公司网址：www.huatai-pb.com

华泰柏瑞基金管理有限公司

2026 年 7 月 21 日