

华泰柏瑞港股通量化灵活配置混合型证券 投资基金 2026 年中期报告

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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 29 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

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

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	7
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
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	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	45
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	45
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	45
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	45

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	45
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	45
7.12 投资组合报告附注	46
§ 8 基金份额持有人信息	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	46
8.2 盈利投资者数量占比	47
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	47
8.4 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	47
§ 9 开放式基金份额变动	47
§ 10 重大事件揭示	48
10.1 基金份额持有人大会决议	48
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	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	48
10.4 基金投资策略的改变	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	49
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	49
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	49
10.8 其他重大事件	52
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	53
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	53
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	53
§ 12 备查文件目录	53
12.1 备查文件目录	53
12.2 存放地点	54
12.3 查阅方式	54

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞港股通量化灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	华泰柏瑞港股通量化混合	
基金主代码	005269	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 12 月 20 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	152,948,023.37 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	华泰柏瑞港股通量化混合 A	华泰柏瑞港股通量化混合 C
下属分级基金的交 易代码	005269	021710
报告期末下属分级 基金的份额总额	124,166,506.56 份	28,781,516.81 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金利用定量投资模型，通过对企业的基本面、经营状况进行深入研究，选择出基本面良好、成长性良好的公司进行投资，在严格控制投资组合风险的前提下，力求超越业绩比较基准的投资回报，争取实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	1、资产配置策略 本基金为灵活配置混合型基金，基金管理人将跟踪宏观经济变量和国家财政、税收和货币政策等指标，判断经济周期的阶段和未来经济发展的趋势，研究预测宏观经济和国家政策等因素对证券市场的影响，分析比较股票、债券等市场和不同金融工具的风险收益特征，估计各子资产类的相关性矩阵，并在此基础上确定基金资产在各类别资产间的分配比例。 2、股票投资策略 本基金主要利用定量投资模型，通过主动管理，使用量化方法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。本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%，投资于港股通标的股票的比例不低于非现金基金资产的 80%；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%。 本基金主要通过多因子 alpha 模型，从多个角度对影响公司股价的因素进行评估，选取并持有预期收益率较好的股票构成投资组合。 本基金仅通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场，不使用合格境内机构投资者（QDII）境外投资额度进行境外投资。 本基金采用量化模型精选个股策略，重点投资于估值合

	理、具备核心竞争力的港股通股票，主要关注公司的基本面，且以大市值个股为主，精选低估值的优秀企业、有特色或独特定价权的稀缺性标的进行投资。 3、债券组合投资策略 本基金债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。本基金管理人将基于对国内外宏观经济形势的深入分析、国内财政政策与货币市场政策等因素对债券的影响，进行合理的利率预期，判断市场的基本走势，制定久期控制下的资产类属配置策略。在债券投资组合构建和管理过程中，本基金管理人将具体采用期限结构配置、市场转换、信用利差和相对价值判断、信用风险评估、现金管理等管理手段进行个券选择。 4、权证投资策略 权证为本基金辅助性投资工具，其投资原则为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。 5、资产支持证券投资策略 在对市场利率环境深入研究的基础上，本基金投资于资产支持证券将采用久期配置策略与期限结构配置策略，结合定量分析和定性分析的方法，综合分析资产支持证券的利率风险、提前偿付风险、流动性风险、税收溢价等因素，选择具有较高投资价值的资产支持证券进行配置。 6、其他金融衍生工具投资策略 在法律法规允许的范围内，本基金可基于谨慎原则运用股指期货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。本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。 7、融资业务的投资策略 本基金参与融资业务，将综合考虑融资成本、保证金比例、冲抵保证金证券折算率、信用资质等条件，选择合适的交易对手方。同时，在保障基金投资组合充足流动性以及有效控制融资杠杆风险的前提下，确定融资比例。
业绩比较基准	恒生指数收益率*90%+银行活期存款利率（税后）*10%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金，低于股票型基金。本基金主要投资港股通标的股票，除需承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险，还需承担汇率风险以及香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华泰柏瑞基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	康珂	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 号楼 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 号楼 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	上海证券报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.huatai-pb.com
基金中期报告置备地点	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 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)	
	华泰柏瑞港股通量化混合 A	华泰柏瑞港股通量化混合 C
本期已实现收益	3,515,127.23	757,354.87
本期利润	-31,799,107.85	-6,428,347.66
加权平均基金份 额本期利润	-0.2187	-0.1785
本期加权平均净 值利润率	-15.57%	-12.90%
本期基金份额净	-16.91%	-17.10%

值增长率		
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	24,021,469.30	4,880,547.82
期末可供分配基金份额利润	0.1935	0.1696
期末基金资产净值	148,187,975.86	33,662,064.63
期末基金份额净值	1.1935	1.1696
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	19.35%	13.87%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华泰柏瑞港股通量化混合 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
过去三个月	-10.31%	1.13%	-6.91%	1.05%	-3.40%	0.08%
过去六个月	-16.91%	1.20%	-9.62%	1.13%	-7.29%	0.07%
过去一年	-8.04%	1.13%	-4.29%	1.04%	-3.75%	0.09%
过去三年	22.67%	1.30%	19.61%	1.28%	3.06%	0.02%
过去五年	8.45%	1.17%	-17.56%	1.39%	26.01%	-0.22%
过去七年	31.11%	1.18%	-16.44%	1.33%	47.55%	-0.15%
自基金合同	19.35%	1.13%	-18.04%	1.29%	37.39%	-0.16%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

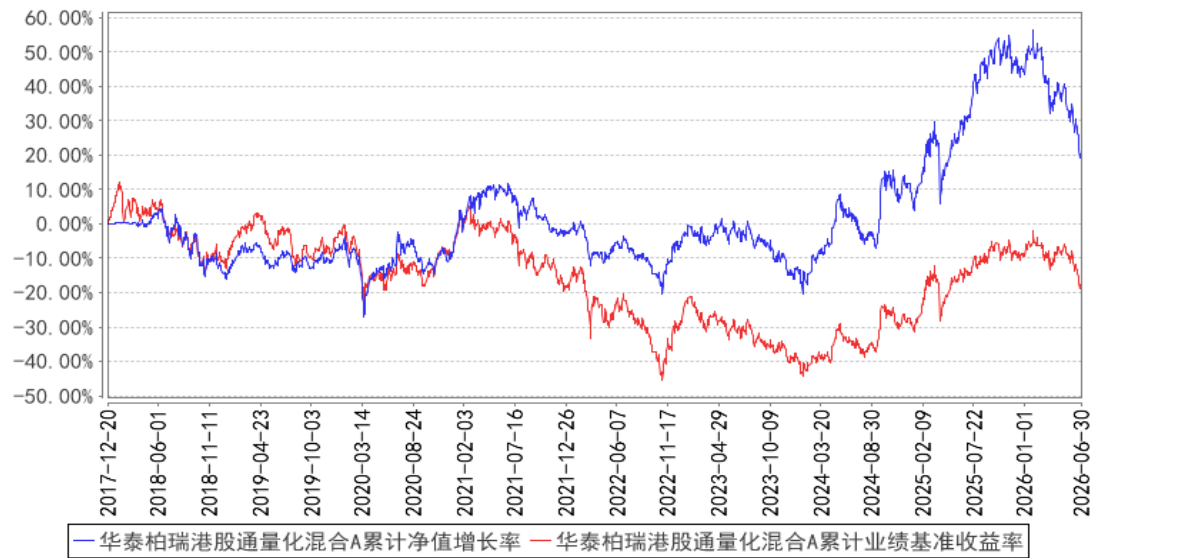
华泰柏瑞港股通量化混合 C

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
过去三个月	-10.42%	1.13%	-6.91%	1.05%	-3.51%	0.08%
过去六个月	-17.10%	1.20%	-9.62%	1.13%	-7.48%	0.07%
过去一年	-8.49%	1.13%	-4.29%	1.04%	-4.20%	0.09%
自基金合同生效起至今	13.87%	1.36%	25.30%	1.28%	-11.43%	0.08%

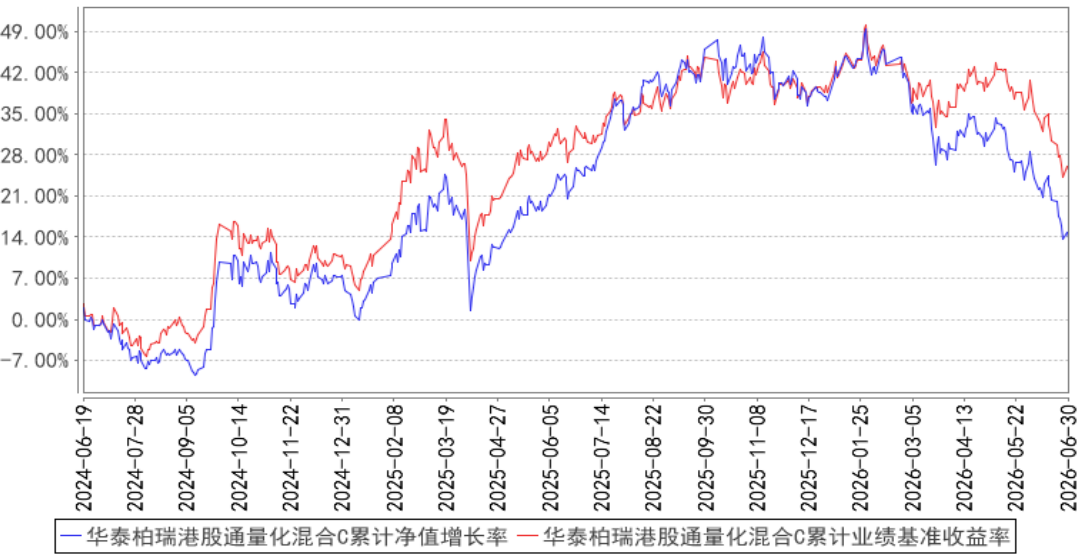
注：C 类份额业绩计算期间为 2024 年 6 月 19 日至 2026 年 6 月 30 日。

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

华泰柏瑞港股通量化混合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



华泰柏瑞港股通量化混合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 2017 年 12 月 20 日至 2026 年 6 月 30 日。C 类图示日期为 2024 年 6 月 19 日至 2026 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、Heron View Partners LLC 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 2026 年 6 月 30 日，公司旗下管理 201 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		
凌若冰	本基金的基金经理	2021 年 9 月 17 日	—	13 年	芝加哥大学金融数学硕士。2012 年 10 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任产品开发专员、高级产品经理、研究员、高级研究员、专户投资经理。2021 年 9 月至 2023 年 8 月任华泰柏瑞量化明选混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月起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。2023 年 9 月

					起任华泰柏瑞量化创享混合型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遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及本基金的基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定，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 11 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 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

2026 年上半年，港股市场振幅放大。首先是地缘政治因素对市场情绪的影响。二月起，中东局势持续升温，投资者风险偏好逐步回落；月底美以与伊朗冲突最终爆发，避险情绪迅速主导全球市场。四月初，随着中东地缘局势出现边际缓和，全球市场避险情绪逐步消退，港股连同全球主要股票市场迎来反弹。尔后，通胀数据和新任美联储主席的政策倾向使得加息预期升温。除 AI 产业链相关的板块外，其他多数行业板块承压回调。在这一过程中，资金加速向 AI 产业链集中，

交易愈演愈烈，强化了市场的结构性分化。行业层面，原油供给与运输受中东局势影响，油价和运价先涨后跌，传导至相关能源及油运板块。同时，半导体、电子元器件等 AI 产业链板块涨幅居前，而传媒、软件、消费等板块则表现落后。

组合构建方面，我们始终坚持一贯的量化选股策略，严格控制行业和个股的暴露，保持组合的分散性。随着 AI 行情加剧，市场定价逻辑短期脱离基本面，叠加港币相对人民币持续贬值，组合的超额收益有所回撤。

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港股通量化混合 A 的基金份额净值为 1.1935 元，本报告期基金份额净值增长率为-16.91%，同期业绩比较基准收益率为-9.62%，截至本报告期末华泰柏瑞港股通量化混合 C 的基金份额净值为 1.1696 元，本报告期基金份额净值增长率为-17.10%，同期业绩比较基准收益率为-9.62%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

往后看，我们倾向于认为极致的 AI 行情难以持续强化，AI 板块的交易拥挤度相比此前已大幅缓和，市场已开始逐步回归均衡；其次，随着季报披露的临近，业绩验证将促使资金从主题炒作回归基本面定价。此前估值受到压制的非 AI 板块，若具备业绩支撑，也有望迎来估值修复。因此，我们预期市场的结构分化将转向收敛。从策略角度看，如果市场能够如我们所预期的那样，从 AI 板块的高度拥挤进入一个相对均衡的结构，我们的量化模型将更好地发挥其选股效果。

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的真实、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 2026 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：华泰柏瑞港股通量化灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	15,695,207.44	26,569,682.02
结算备付金		1,799,456.94	24,016,202.12
存出保证金		17,458.93	31,564.54
交易性金融资产	6.4.7.2	166,818,112.23	276,639,544.73
其中：股票投资		166,818,112.23	276,639,544.73
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	2,999,375.34

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		-	780.82
应收股利		1,498,897.03	346,404.32
应收申购款		125,632.63	66,072.95
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		185,954,765.20	330,669,626.84
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 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		37.17	21,190,573.81
应付赎回款		3,706,345.24	8,614,608.20
应付管理人报酬		193,225.66	297,770.60
应付托管费		32,204.28	49,628.45
应付销售服务费		15,161.97	31,057.69
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	0.06
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	157,750.39	280,414.05
负债合计		4,104,724.71	30,464,052.86
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	152,948,023.37	209,858,513.32
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	28,902,017.12	90,347,060.66
净资产合计		181,850,040.49	300,205,573.98
负债和净资产总计		185,954,765.20	330,669,626.84

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 152,948,023.37 份，其中下属 A 类基金份额净值 1.1935 元，基金份额总额 124,166,506.56 份；下属 C 类基金份额净值 1.1696 元，基金份额总额 28,781,516.81 份。

6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞港股通量化灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-36,234,170.23	27,544,414.93
1. 利息收入		43,108.76	32,774.66
其中：存款利息收入	6.4.7.13	42,308.93	32,104.11
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		799.83	670.55
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以 “-”填列）		6,037,024.03	7,165,402.32
其中：股票投资收益	6.4.7.14	2,992,560.83	3,658,999.37
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投 资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	3,044,463.20	3,506,402.95
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	-42,499,937.61	20,176,975.52
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	185,634.59	169,262.43
减：二、营业总支出		1,993,285.28	1,428,313.93
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,524,416.81	1,051,448.74
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	254,069.48	175,241.49
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	125,449.78	114,443.46
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		0. 04	-
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	89, 349. 17	87, 180. 24
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-38, 227, 455. 51	26, 116, 101. 00
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-38, 227, 455. 51	26, 116, 101. 00
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-38, 227, 455. 51	26, 116, 101. 00

6.3 净资产变动表

会计主体：华泰柏瑞港股通量化灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 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	209, 858, 513. 32	-	90, 347, 060. 66	300, 205, 573. 98
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	209, 858, 513. 32	-	90, 347, 060. 66	300, 205, 573. 98
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-56, 910, 489. 95	-	-61, 445, 043. 54	-118, 355, 533. 49
（一）、综合收益总额	-	-	-38, 227, 455. 51	-38, 227, 455. 51
（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）	-56, 910, 489. 95	-	-23, 217, 588. 03	-80, 128, 077. 98
其中：1. 基金申购款	60, 772, 180. 37	-	24, 366, 580. 82	85, 138, 761. 19
2. 基金赎	-	-	-47, 584, 168. 85	-165, 266, 839. 17

回款	117,682,670.32			
(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	152,948,023.37	-	28,902,017.12	181,850,040.49
项目	上年度可比期间 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	101,138,457.70	-	12,016,248.66	113,154,706.36
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	101,138,457.70	-	12,016,248.66	113,154,706.36
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	86,595,493.58	-	42,869,736.39	129,465,229.97
(一)、综合收益总额	-	-	26,116,101.00	26,116,101.00
(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)	86,595,493.58	-	16,753,635.39	103,349,128.97
其中：1. 基金申购款	130,307,180.08	-	25,769,665.90	156,076,845.98
2. 基金赎回款	-43,711,686.50	-	-9,016,030.51	-52,727,717.01
(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	187,733,951.28	-	54,885,985.05	242,619,936.33

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：

崔春

房伟力

赵景云

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

华泰柏瑞港股通量化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”)证监许可[2017]1625 号《关于准予华泰柏瑞中证申万医药生物交易型开放式指数证券投资基金变更注册的批复》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《华泰柏瑞港股通量化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 227,124,649.80 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(2017)第 1039 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞港股通量化灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 12 月 20 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 227,365,450.95 份基金份额,其中认购资金利息折合 240,801.15 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。

根据基金管理人于 2024 年 6 月 19 日发布的《华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞港股通量化灵活配置混合型证券投资基金增加 C 类基金份额并修改基金合同和托管协议的公告》的规定,自 2024 年 6 月 19 日起对本基金增加 C 类基金份额,原基金份额全部自动划归为 A 类基金份额,并修订相关法律文件。根据更新的《华泰柏瑞港股通量化灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《华泰柏瑞港股通量化灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的规定,本基金根据申购费用、赎回费用、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人申购时收取申购费用、赎回时收取赎回费用的基金份额,称为 A 类基金份额;在投资人申购时不收取申购费用,赎回时收取赎回费用,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 类基金份额分设不同的基金代码。由于基金费用的不同,本基金 A 类基

金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值并单独公告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞港股通量化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(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、存托凭证、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许投资的香港联合交易所上市的股票(以下简称“港股通标的股票”)、债券(国债、金融债、企业债、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、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金持有的股票资产及存托凭证占基金资产的比例为 0-95%；投资于港股通标的股票的比例不低于非现金基金资产的 80%；其中，基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者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：恒生指数收益率 $\times$ 90%+银行活期存款利率(税后) $\times$ 10%。

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 2026 年 8 月 28 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 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 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 2026 年 06 月 30 日的财务状况以及 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净资产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[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[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2021]33 号《关于北京证券交易所税收政策适用问题的公告》、财税[2024]8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[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》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财税[2025]4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》、财政部、税务总局公告 2026 年第 12 号《关于明确增值税应税交易销售额计算口径的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税交易，以资管产品管理人为增值税纳税人，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税。对公募证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入以及金融同业往来利息收入免征增值税。

(2) 对证券投资基金取得的自 2025 年 8 月 8 日之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复缴纳增值税；取得的在 2025 年 8 月 8 日之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

(3) 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。

(4) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%

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

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

(5)对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税；自 2023 年 8 月 28 日起，出让方减按 0.05%的税率缴纳证券(股票)交易印花税。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(6)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 2026 年 6 月 30 日
活期存款	15,695,207.44
等于：本金	15,693,561.82
加：应计利息	1,645.62
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	15,695,207.44

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		181,291,963.11	-	166,818,112.23	-14,473,850.88
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		181,291,963.11	-	166,818,112.23	-14,473,850.88

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

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末未持有期货合约。

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 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	6,026.02
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	74,860.91
其中：交易所市场	74,860.91
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	76,863.46
合计	157,750.39

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

华泰柏瑞港股通量化混合 A

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	161,216,267.81	161,216,267.81
本期申购	43,842,345.18	43,842,345.18
本期赎回（以“-”号填列）	-80,892,106.43	-80,892,106.43
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	124,166,506.56	124,166,506.56

华泰柏瑞港股通量化混合 C

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	48,642,245.51	48,642,245.51
本期申购	16,929,835.19	16,929,835.19
本期赎回（以“-”号填列）	-36,790,563.89	-36,790,563.89
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	28,781,516.81	28,781,516.81

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

华泰柏瑞港股通量化混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	40,545,895.90	29,813,500.12	70,359,396.02
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	40,545,895.90	29,813,500.12	70,359,396.02
本期利润	3,515,127.23	-35,314,235.08	-31,799,107.85
本期基金份额交易产生的变动数	-9,666,838.57	-4,871,980.30	-14,538,818.87
其中：基金申购款	11,857,883.46	5,242,189.39	17,100,072.85
基金赎回款	-21,524,722.03	-10,114,169.69	-31,638,891.72
本期已分配利润	-	-	-
本期末	34,394,184.56	-10,372,715.26	24,021,469.30

华泰柏瑞港股通量化混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	11,652,861.51	8,334,803.13	19,987,664.64
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	11,652,861.51	8,334,803.13	19,987,664.64
本期利润	757,354.87	-7,185,702.53	-6,428,347.66
本期基金份额交易产生的变动数	-4,893,349.32	-3,785,419.84	-8,678,769.16
其中：基金申购款	4,250,754.55	3,015,753.42	7,266,507.97
基金赎回款	-9,144,103.87	-6,801,173.26	-15,945,277.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,516,867.06	-2,636,319.24	4,880,547.82

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	39,331.33
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	2,798.80
其他	178.80
合计	42,308.93

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 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	2,992,560.83
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	2,992,560.83

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
----	----

	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	199,895,016.41
减：卖出股票成本总额	196,384,134.97
减：交易费用	518,320.61
买卖股票差价收入	2,992,560.83

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

注：本基金本报告期内无债券投资收益。

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

注：本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	3,044,463.20
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	3,044,463.20

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-42,499,937.61
股票投资	-42,499,937.61
债券投资	—
资产支持证券投资	—
基金投资	—
贵金属投资	—
其他	—
2. 衍生工具	—
权证投资	—
3. 其他	—
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	—
合计	-42,499,937.61

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	185,634.59
合计	185,634.59

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 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	-
证券组合费	9,314.07
银行划款手续费	3,171.64
合计	89,349.17

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、关联关系

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

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

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股票交易。

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

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支付关联方佣金。

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,524,416.81	1,051,448.74
其中：应支付销售机构的客户维护费	393,746.04	194,861.50
应支付基金管理人的净管理费	1,130,670.77	856,587.24

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：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 × 1.20%/ 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	254,069.48	175,241.49

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：

日托管费=前一日基金资产净值 × 0.20%/ 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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰柏瑞港股通量化混 合 A	华泰柏瑞港股通量化混 合 C	合计
中国工商银行股份有限公司	-	523.41	523.41
华泰证券股份有限公司	-	0.45	0.45
华泰柏瑞基金管理有限公司	-	53,858.29	53,858.29
合计	-	54,382.15	54,382.15
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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		
	华泰柏瑞港股通量化混 合 A	华泰柏瑞港股通量化混 合 C	合计
华泰柏瑞基金管理有限公司	-	71,271.01	71,271.01
合计	-	71,271.01	71,271.01

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 0.5%的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	华泰柏瑞港股通量化混合 A	华泰柏瑞港股通量化混合 C
基金合同生效日（2017 年 12 月 20 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	23,986,614.63	-
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	10,273,896.08	-
报告期末持有的基金份额	13,712,718.55	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	8.9656%	-
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	华泰柏瑞港股通量化混合 A	华泰柏瑞港股通量化混合 C
基金合同生效日（2017 年 12 月 20 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	15,018,629.43	-
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	4,744,733.35	-
报告期末持有的基金份额	10,273,896.08	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	5.4726%	-

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	15,695,207.44	39,331.33	22,429,748.81	26,164.78

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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

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（2026 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

注：本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

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和债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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

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

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 2026 年 06 月 30 日，本基金无债券投资(2025 年 12 月 31 日：同)。

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 2026 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“期末本基金持有的流通受限证券”。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%。于本报告期末，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 2026 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	15,695,207.44	-	-	-	-	-	15,695,207.44
结算备付金	1,799,456.94	-	-	-	-	-	1,799,456.94
存出保证金	17,458.93	-	-	-	-	-	17,458.93
交易性金融资产	-	-	-	-	-	166,818,112.23	166,818,112.23
应收股利	-	-	-	-	-	1,498,897.03	1,498,897.03
应收申购款	-	-	-	-	-	125,632.63	125,632.63
资产总计	17,512,123.31	-	-	-	-	168,442,641.89	185,954,765.20
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	3,706,345.24	3,706,345.24
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	193,225.66	193,225.66
应付托管费	-	-	-	-	-	32,204.28	32,204.28

应付清算款	-	-	-	-	-	37.17	37.17
应付销售服务费	-	-	-	-	-	15,161.97	15,161.97
其他负债	-	-	-	-	-	157,750.39	157,750.39
负债总计	-	-	-	-	-	4,104,724.71	4,104,724.71
利率敏感度缺口	17,512,123.31	-	-	-	-	164,337,917.18	181,850,040.49
上年度末 2025 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	26,569,682.02	-	-	-	-	-	26,569,682.02
结算备付金	24,016,202.12	-	-	-	-	-	24,016,202.12
存出保证金	31,564.54	-	-	-	-	-	31,564.54
交易性金融资产	-	-	-	-	-	276,639,544.73	276,639,544.73
买入返售金融资产	2,999,375.34	-	-	-	-	-	2,999,375.34
应收股利	-	-	-	-	-	346,404.32	346,404.32
应收申购款	-	-	-	-	-	66,072.95	66,072.95
应收清算款	-	-	-	-	-	780.82	780.82
资产总计	53,616,824.02	-	-	-	-	277,052,802.82	330,669,626.84
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	8,614,608.20	8,614,608.20
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	297,770.60	297,770.60
应付托管费	-	-	-	-	-	49,628.45	49,628.45
应付清算款	-	-	-	-	-	21,190,573.81	21,190,573.81
应付销售服务费	-	-	-	-	-	31,057.69	31,057.69
应交税费	-	-	-	-	-	0.06	0.06
其他负债	-	-	-	-	-	280,414.05	280,414.05
负债总计	-	-	-	-	-	30,464,052.86	30,464,052.86
利率敏感度缺口	53,616,824.02	-	-	-	-	246,588,749.96	300,205,573.98

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 2026 年 06 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2025 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2025 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。本基金持有不以记账本位币人民币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	166,818,112.23	-	166,818,112.23
资产合计	-	166,818,112.23	-	166,818,112.23
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 外汇风险敞口净额	-	166,818,112.23	-	166,818,112.23
项目	上年度末 2025 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	276,639,544.73	-	276,639,544.73
资产合计	-	276,639,544.73	-	276,639,544.73
以外币计价的负债				

负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 汇风险敞口净 额	-	276,639,544.73	-	276,639,544.73

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	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（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	所有外币相对人民币升值 5%	8,340,905.61	13,831,977.24
	所有外币相对人民币贬值 5%	-8,340,905.61	-13,831,977.24

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 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 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	166,818,112.23	91.73	276,639,544.73	92.15
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	-	-	-	-
一权证投资				
其他	-	-	-	-
合计	166,818,112.23	91.73	276,639,544.73	92.15

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（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	8,373,947.57	13,844,135.45
	业绩比较基准下降 5%	-8,373,947.57	-13,844,135.45

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	166,818,112.23	276,639,544.73
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	166,818,112.23	276,639,544.73

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 2026 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(2025 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	166,818,112.23	89.71
	其中:股票	166,818,112.23	89.71
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	17,494,664.38	9.41
8	其他各项资产	1,641,988.59	0.88
9	合计	185,954,765.20	100.00

注:通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币 166,818,112.23 元,占基金资产净值的比例为 91.73%。

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

注：本基金本报告期末未持有境内股票。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
10 能源	5,548,974.87	3.05
15 原材料	11,804,619.40	6.49
20 工业	24,696,293.37	13.58
25 可选消费	21,971,853.53	12.08
30 主要消费	9,606,432.26	5.28
35 医药卫生	14,801,835.18	8.14
40 金融	49,539,647.92	27.24
45 信息技术	12,768,796.74	7.02
50 通信服务	9,556,551.42	5.26
55 公用事业	2,181,380.69	1.20
60 房地产	4,341,726.85	2.39
合计	166,818,112.23	91.73

注：以上分类采用中证行业分类标准。

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	00700	腾讯控股	25,600	9,556,551.42	5.26
2	09988	阿里巴巴-W	113,600	9,161,256.95	5.04
3	00939	建设银行	889,000	6,231,177.47	3.43
4	00288	万洲国际	567,500	4,086,158.62	2.25
5	00992	联想集团	204,000	4,078,780.28	2.24
6	03618	重庆农村商业银行	799,000	4,011,154.98	2.21
7	02888	渣打集团	20,750	3,813,542.49	2.10
8	00981	中芯国际	48,500	3,765,945.95	2.07
9	02318	中国平安	81,000	3,591,497.68	1.97
10	02618	京东物流	348,600	3,557,624.23	1.96
11	03323	中国建材	740,000	3,432,162.18	1.89
12	01288	农业银行	736,000	3,413,609.95	1.88
13	01579	颐海国际	299,000	3,305,935.81	1.82
14	00175	吉利汽车	223,000	3,265,556.92	1.80
15	01339	中国人民保险集团	773,000	3,148,815.11	1.73
16	01776	广发证券	212,800	3,140,218.21	1.73
17	01308	海丰国际	109,000	2,970,805.79	1.63

18	02600	中国铝业	452,000	2,928,681.12	1.61
19	03306	江南布衣	193,000	2,886,591.18	1.59
20	00857	中国石油股份	386,000	2,843,007.34	1.56
21	02208	金风科技	298,400	2,726,524.37	1.50
22	01336	新华保险	65,200	2,606,087.75	1.43
23	01988	民生银行	933,000	2,544,521.45	1.40
24	03968	招商银行	65,000	2,535,992.29	1.39
25	02338	潍柴动力	85,000	2,517,492.18	1.38
26	00666	瑞浦兰钧	205,200	2,406,057.21	1.32
27	00874	白云山	192,000	2,369,682.34	1.30
28	00386	中国石油化工股份	682,000	2,369,404.40	1.30
29	01530	三生制药	155,500	2,281,155.38	1.25
30	03320	华润医药	603,500	2,222,480.48	1.22
31	02899	紫金矿业	91,000	2,165,642.57	1.19
32	00293	国泰航空	187,000	2,108,196.67	1.16
33	02601	中国太保	88,000	2,054,502.91	1.13
34	06098	碧桂园服务	483,000	2,038,816.90	1.12
35	06030	中信证券	84,500	2,000,678.87	1.10
36	02331	李宁	153,500	1,962,506.10	1.08
37	01972	太古地产	104,800	1,869,633.78	1.03
38	09863	零跑汽车	61,700	1,847,767.17	1.02
39	01919	中远海控	160,000	1,807,973.68	0.99
40	02388	中银香港	49,000	1,803,648.30	0.99
41	02319	蒙牛乳业	123,000	1,718,921.25	0.95
42	00268	金蝶国际	334,000	1,717,366.54	0.94
43	03896	金山云	426,000	1,716,810.67	0.94
44	06181	老铺黄金	5,500	1,654,761.46	0.91
45	03931	中创新航	79,400	1,616,489.67	0.89
46	01801	信达生物	22,500	1,555,573.05	0.86
47	02607	上海医药	156,900	1,553,540.64	0.85
48	03988	中国银行	355,000	1,538,592.90	0.85
49	09995	荣昌生物	20,500	1,322,931.93	0.73
50	03993	洛阳钼业	99,000	1,305,274.31	0.72
51	00270	粤海投资	190,000	1,280,590.12	0.70
52	02328	中国财险	96,000	1,194,013.06	0.66
53	02359	药明康德	8,500	1,134,717.15	0.62
54	00576	浙江沪杭甬	214,000	1,102,207.32	0.61
55	00358	江西铜业股份	41,000	1,101,078.21	0.61
56	02382	舜宇光学科技	19,900	1,054,332.85	0.58
57	02016	浙商银行	571,000	1,051,397.15	0.58
58	06160	百济神州	7,100	1,050,806.53	0.58
59	02269	药明生物	31,500	946,632.65	0.52
60	01157	中联重科	149,600	896,552.05	0.49

61	00388	香港交易所	2,800	882,794.22	0.49
62	02727	上海电气	300,000	880,709.70	0.48
63	00631	三一国际	152,000	876,610.14	0.48
64	02628	中国人寿	36,000	833,599.55	0.46
65	06818	中国光大银行	292,000	743,096.64	0.41
66	01138	中远海能	60,000	720,722.79	0.40
67	00998	中信银行	120,000	693,102.90	0.38
68	00590	六福集团	34,000	653,809.70	0.36
69	01299	友邦保险	10,400	645,402.13	0.35
70	03908	中金公司	31,600	576,369.78	0.32
71	00200	新濠国际发展	187,000	508,371.00	0.28
72	00135	昆仑能源	88,000	491,460.33	0.27
73	06881	中国银河	76,000	485,832.13	0.27
74	01378	中国宏桥	26,000	453,000.94	0.25
75	00522	ASMP	2,100	435,560.45	0.24
76	03750	宁德时代	700	426,805.47	0.23
77	09696	天齐锂业	12,000	418,780.07	0.23
78	00902	华能国际电力股份	86,000	409,330.24	0.23
79	00168	青岛啤酒股份	10,000	373,823.92	0.21
80	02883	中海油田服务	62,000	336,563.13	0.19
81	00014	希慎兴业	20,000	286,968.92	0.16
82	06618	京东健康	8,800	251,004.00	0.14
83	00016	新鸿基地产	1,500	146,307.25	0.08
84	01318	毛戈平	2,700	121,592.66	0.07
85	09969	诺诚健华	11,000	113,311.03	0.06
86	01052	越秀交通基建	26,000	81,522.10	0.04
87	01316	耐世特	8,000	26,473.40	0.01
88	03690	美团-W	80	4,759.65	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	00939	建设银行	3,900,918.49	1.30
1	601939	建设银行	3,457,301.00	1.15
2	03968	招商银行	3,809,064.94	1.27
2	600036	招商银行	3,056,010.00	1.02
3	01288	农业银行	3,129,669.43	1.04
3	601288	农业银行	2,997,656.00	1.00
4	00386	中国石油化工股份	3,948,117.10	1.32
4	600028	中国石化	1,212,919.00	0.40

5	00268	金蝶国际	4,413,468.57	1.47
6	02618	京东物流	4,183,469.17	1.39
7	02899	紫金矿业	2,820,278.99	0.94
7	601899	紫金矿业	1,129,682.00	0.38
8	01579	颐海国际	3,941,045.68	1.31
9	00700	腾讯控股	3,855,764.52	1.28
10	03306	江南布衣	3,643,987.32	1.21
11	00293	国泰航空	3,567,555.85	1.19
12	00992	联想集团	3,457,669.37	1.15
13	02888	渣打集团	3,349,374.63	1.12
14	00857	中国石油股份	1,758,849.48	0.59
14	601857	中国石油	1,490,316.00	0.50
15	03320	华润医药	3,111,187.05	1.04
16	06181	老铺黄金	3,085,812.11	1.03
17	02331	李宁	2,851,389.78	0.95
18	02318	中国平安	1,430,267.47	0.48
18	601318	中国平安	1,408,563.00	0.47
19	03896	金山云	2,760,451.93	0.92
20	09863	零跑汽车	2,531,984.82	0.84

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	03968	招商银行	6,163,597.50	2.05
1	600036	招商银行	3,047,984.00	1.02
2	00939	建设银行	4,793,383.38	1.60
2	601939	建设银行	3,343,781.00	1.11
3	01288	农业银行	4,210,523.76	1.40
3	601288	农业银行	3,020,332.00	1.01
4	00631	三一国际	5,876,733.75	1.96
5	00014	希慎兴业	5,790,955.38	1.93
6	09988	阿里巴巴-W	5,474,569.97	1.82
7	00590	六福集团	5,047,908.03	1.68
8	00902	华能国际电力股份	5,026,194.85	1.67
9	00551	裕元集团	4,882,562.96	1.63
10	00700	腾讯控股	4,423,466.66	1.47
11	00992	联想集团	4,040,184.27	1.35
12	00857	中国石油股份	2,579,843.11	0.86
12	601857	中国石油	1,440,747.00	0.48
13	00525	广深铁路股份	3,970,871.14	1.32
14	01033	中石化油服	3,636,195.48	1.21

15	02208	金风科技	3,572,833.08	1.19
16	02318	中国平安	2,000,982.67	0.67
16	601318	中国平安	1,433,910.00	0.48
17	01910	新秀丽	3,273,941.50	1.09
18	00358	江西铜业股份	3,216,176.25	1.07
19	01919	中远海控	3,169,883.65	1.06
20	00386	中国石油化工股份	1,963,270.95	0.65
20	600028	中国石化	1,202,095.00	0.40

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	129,062,640.08
卖出股票收入（成交）总额	199,895,016.41

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，建设银行在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行和国家金融监督管理总局的处罚。

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。

7.12.2 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。

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	17,458.93
2	应收清算款	-
3	应收股利	1,498,897.03
4	应收利息	-
5	应收申购款	125,632.63
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,641,988.59

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	户均持有的基	持有人结构
------	-----	--------	-------

	户数 (户)	金份额	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 港股通量 化混合 A	7,813	15,892.30	66,083,143.45	53.22	58,083,363.11	46.78
华泰柏瑞 港股通量 化混合 C	1,846	15,591.29	17,542,154.98	60.95	11,239,361.83	39.05
合计	9,579	15,967.01	83,625,298.43	54.68	69,322,724.94	45.32

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 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025 年 7 月 1 日-2026 年 6 月 30 日）
盈利投资者数量占比（%）	18.58

8.3 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	华泰柏瑞港股通量化混合 A	1,479,866.99	1.1918
	华泰柏瑞港股通量化混合 C	426.69	0.0015
	合计	1,480,293.68	0.9678

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	华泰柏瑞港股通量化混合 A	10~50
	华泰柏瑞港股通量化混合 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	华泰柏瑞港股通量化混合 A	10~50
	华泰柏瑞港股通量化混合 C	0
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华泰柏瑞港股通量化混合 A	华泰柏瑞港股通量化混合 C
----	---------------	---------------

基金合同生效日 (2017 年 12 月 20 日) 基金份额总额	227,365,450.95	—
本报告期期初基金份额总额	161,216,267.81	48,642,245.51
本报告期基金总申购份额	43,842,345.18	16,929,835.19
减: 本报告期基金总赎回份额	80,892,106.43	36,790,563.89
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	124,166,506.56	28,781,516.81

§ 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:

经公司股东书面决定, 谢仕荣先生于 2026 年 1 月 16 日起担任公司董事, 陈健先生担任公司监事, Kirk Chester SWEENEY 先生不再担任公司董事, 卢龙威先生不再担任公司监事。

经公司股东书面决定, 刘晓冰先生于 2026 年 3 月 21 日起担任公司董事, 徐珊女士担任公司监事, 陆春光先生不再担任公司董事, 刘晓冰先生不再担任公司监事。

经公司董事会审议通过, 董辰先生于 2026 年 3 月 25 日起担任公司副总经理。

上述人事变动已按相关规定备案、报告。

报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动:

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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

注：报告期内基金管理人未受监管部门稽查或处罚。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

管理人相关从业人员受调查或处罚等情况 1	内容
受到调查或处罚等措施的主体	高级管理人员 1
受到调查或处罚等措施的时间	2026 年 3 月 9 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证监会上海监管局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施
受到的具体措施类型	监管谈话
受到调查或处罚等措施的原因	人员管理
受到处罚的依据	《证券投资基金行业高级管理人员任职管理办法》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	未涉及
其他	—
管理人相关从业人员受调查或处罚等情况 2	内容
受到调查或处罚等措施的主体	高级管理人员 2
受到调查或处罚等措施的时间	2026 年 6 月 8 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证监会上海监管局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施
受到的具体措施类型	监管谈话
受到调查或处罚等措施的原因	人员管理
受到处罚的依据	《证券投资基金行业高级管理人员任职管理办法》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	未涉及
其他	—

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

注：报告期内基金托管人未受监管部门调查或处罚。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：报告期内基金托管人相关从业人员未受监管部门调查或处罚。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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 (%)	
长江证券	2	241,759,596.07	73.49	120,879.46	73.49	-
东方证券	2	44,713,497.75	13.59	22,356.73	13.59	-
东方财富证券	1	29,392,658.00	8.94	14,696.94	8.94	-
国投证券	1	11,290,454.23	3.43	5,645.35	3.43	-
国泰海通证券	3	1,801,450.44	0.55	900.73	0.55	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	6	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中金财富证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
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，本基金无变更租用证券公司交易单元的情况。

10.7.2 基金租用或者通过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(%)
长江证券	-	-	-	-	-	-

东方证券	-	-	-	-	-	-
东方财富 证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通 证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金财富 证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
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停牌股票估值调整情况的公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 06 月 25 日
2	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参与汇添富基金销售（上海）有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 06 月 25 日
3	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止浦领基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 06 月 12 日
4	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止中证金牛（北京）基金销售有限	证监会规定报刊和网站	2026 年 06 月 06 日

	公司办理旗下基金相关业务公告		
5	华泰柏瑞港股通量化灵活配置混合型证券投资基金限制大额申购（含定期定额投资）业务的公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 04 月 27 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	2026 年 03 月 27 日
7	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	2026 年 03 月 05 日
8	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	2026 年 02 月 27 日
9	华泰柏瑞港股通量化灵活配置混合型证券投资基金限制大额申购（含定期定额投资）业务的公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 02 月 10 日
10	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	2026 年 01 月 26 日
11	华泰柏瑞基金管理有限公司关于注销深圳分公司的公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 01 月 10 日
12	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参与易方达财富管理基金销售(广州)有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 01 月 09 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

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

2026 年 8 月 29 日