

华泰柏瑞恒利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：兴业银行股份有限公司

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。

基金托管人兴业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	5
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	10
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	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
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	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
§ 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	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50
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	50
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	50
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	50

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	50
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	51
7.12 投资组合报告附注	51
§ 8 基金份额持有人信息	52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	52
8.2 盈利投资者数量占比	52
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52
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	53
§ 9 开放式基金份额变动	53
§ 10 重大事件揭示	53
10.1 基金份额持有人大会决议	53
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	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	54
10.4 基金投资策略的改变	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	54
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	54
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	55
10.8 其他重大事件	56
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	57
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	57
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	58
§ 12 备查文件目录	58
12.1 备查文件目录	58
12.2 存放地点	58
12.3 查阅方式	58

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金	
基金简称	华泰柏瑞恒利混合	
基金主代码	012953	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 9 月 14 日	
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	23,895,402.23 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	华泰柏瑞恒利混合 A	华泰柏瑞恒利混合 C
下属分级基金的交 易代码	012953	012954
报告期末下属分级 基金的份额总额	13,173,396.62 份	10,722,005.61 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的前提下，通过积极灵活合理配置，追求超越业绩比较基准的投资回报力争金产持续稳健增值。
投资策略	1、大类资产配置本基金将通过研究宏观经济、国家政策等可能影响证券市场的重要因素，对股票、债券和货币资产的风险收益特征进行深入分析，合理预测各类资产的价格变动趋势，确定不同资产类别的投资比例。在此基础上，积极跟踪由于市场短期波动引起的各类资产的价格偏差和风险收益特征的相对变化，动态调整各大类资产之间的投资比例，在保持总体风险水平相对平稳的基础上，获取相对较高的基金投资益。2、债券组合投资策略；3、股票投资策略；4、存托凭证投资策略；5、资产支持证券投资策略；6、股指期货投资策略；7、融资业务的投资策略。
业绩比较基准	上证国债指数收益率×80%+沪深 300 指数收益率×15%+中证港股通综合指数（人民币）收益率×5%
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。 本基金可能投资港股通标的股票，除需承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险，还需承担汇率风险以及香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	华泰柏瑞基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	康珂	冯萌
	联系电话	021-38601777	021-52629999-213310
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	fengmeng@cib.com.cn
客户服务电话		400-888-0001	95561
传真		021-38601799	021-62159217
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	福建省福州市台江区江滨中大 道 398 号兴业银行大厦
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	上海市浦东新区银城路 167 号 4 楼
邮政编码		200135	200120
法定代表人		贾波	吕家进

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
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 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)	
	华泰柏瑞恒利混合 A	华泰柏瑞恒利混合 C
本期已实现收益	-982,934.25	-381,725.21
本期利润	-573,448.06	-142,172.63
加权平均基金份 额本期利润	-0.0195	-0.0105
本期加权平均净 值利润率	-1.60%	-0.87%
本期基金份额净 值增长率	-0.56%	-0.64%
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	2,342,742.77	1,785,782.58
期末可供分配基金份额利润	0.1778	0.1666
期末基金资产净值	15,516,139.39	12,507,788.19
期末基金份额净值	1.1778	1.1666
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	20.21%	19.06%

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

华泰柏瑞恒利混合 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	-3.01%	0.30%	2.10%	0.23%	-5.11%	0.07%
过去六个月	-0.56%	0.32%	1.74%	0.22%	-2.30%	0.10%
过去一年	0.52%	0.25%	4.39%	0.19%	-3.87%	0.06%
过去三年	10.52%	0.24%	16.02%	0.21%	-5.50%	0.03%
自基金合同生效起至今	20.21%	0.24%	17.06%	0.22%	3.15%	0.02%

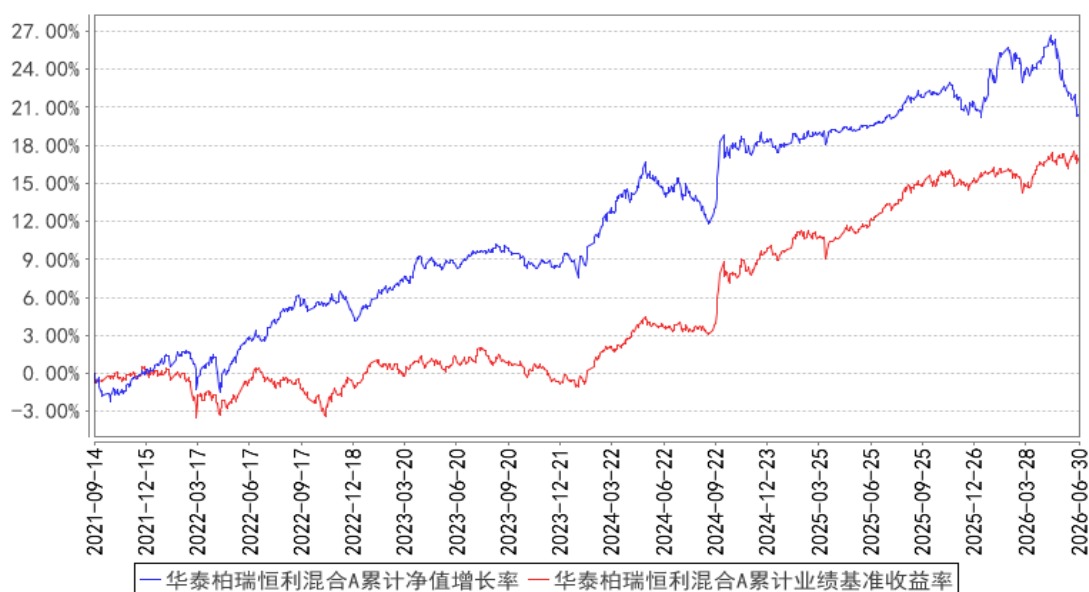
华泰柏瑞恒利混合 C

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	-3.05%	0.30%	2.10%	0.23%	-5.15%	0.07%

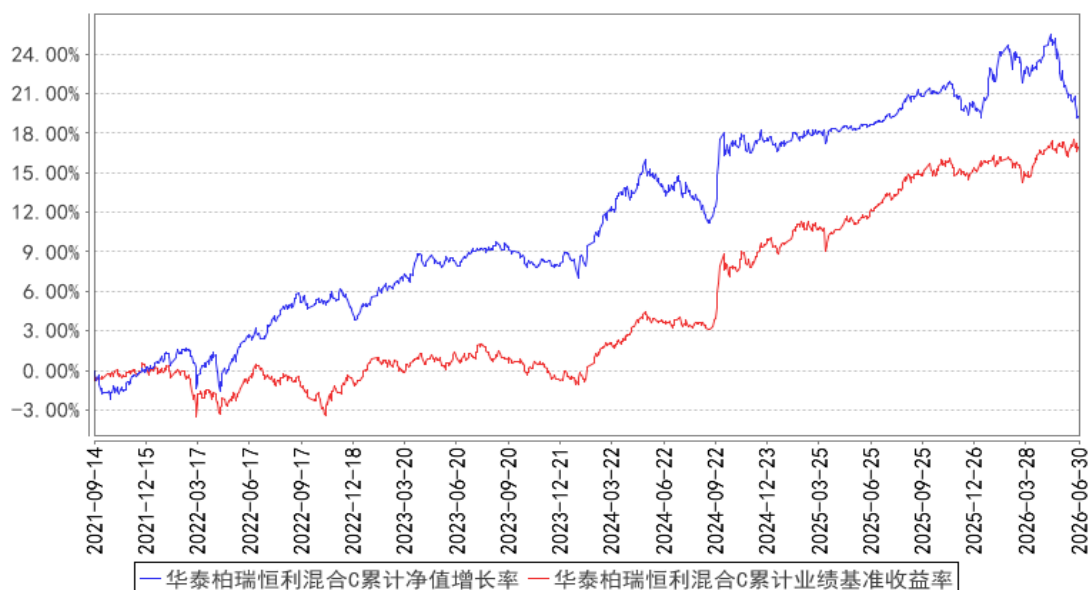
过去六个月	-0.64%	0.32%	1.74%	0.22%	-2.38%	0.10%
过去一年	0.33%	0.25%	4.39%	0.19%	-4.06%	0.06%
过去三年	9.87%	0.24%	16.02%	0.21%	-6.15%	0.03%
自基金合同 生效起至今	19.06%	0.24%	17.06%	0.22%	2.00%	0.02%

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

华泰柏瑞恒利混合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



华泰柏瑞恒利混合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2021年9月14日至2026年6月30日。C类图示日期为2021年9月14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		
李琛	本基金的基金经理助理	2026 年 2 月 26 日	-	10 年	资产评估硕士，曾任潍柴动力股份有限公司项目经理、中诚信国际信用评级有限责任公司企业评级部分析师、助理总监。2021 年 3 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，现任固定收益部基金经理助理。
何子建	固定收益部副总监、本基金的基金经理	2021 年 9 月 14 日	-	11 年	工商管理硕士，经济学学士。2014 年 5 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任固定收益部助理研究员、基金经理助理。2019 年 3 月起任华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金的基金经理。2020 年 1 月起任华泰柏瑞锦兴 39 个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2020 年 10 月起任华泰柏瑞锦泰一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2021 年 1 月至 2022 年 1 月任华泰柏瑞锦瑞债券型证券投资基金的基金经理。2021 年 1 月至 2023 年 9 月任华泰柏瑞景利混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月起任华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金的基金经理。2022 年 5 月至 2024 年 6 月任华泰柏瑞鸿裕 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金的基金经理。2022 年 9 月起任华泰柏瑞益兴三个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2023 年 3 月起任华泰柏瑞锦汇债券型证券投资基金的基金经理。2023 年 7 月起任华泰柏瑞益享债券型证券投资基金的基金经理。2024 年 7 月起任华泰柏瑞安诚 6 个月持

					有期债券型证券投资基金的基金经理。2025 年 3 月起任华泰柏瑞锦华债券型证券投资基金的基金经理。2025 年 9 月起任华泰柏瑞中证 AAA 科技创新公司债交易型开放式指数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	2025 年 11 月 26 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有限公司高级分析师。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。

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

权益方面，2026 年上半年，A 股市场整体呈震荡上行态势，指数重心稳步抬升，但板块间分化显著，市场结构轮动加快。年初，商业航天、有色金属、化工等板块领涨，市场风险偏好明显回升；此后受地缘冲突事件扰动，市场短期承压，但随着情绪修复，部分股指迅速反弹并创出阶段新高。进入二季度，伴随 AI 产业链一季报景气度验证，行情主线逐步向光通信、半导体等科技成长板块切换，算力、光模块等细分领域持续走强，推动创业板指与科创 50 大幅跑赢全市场。交易层面，市场日均成交额一度放大至历史新高，此后稳定维持在 3 万亿以上的较高水平，显示资金参与热情持续高涨，但板块间资金流向不平衡。AI 相关产业链持续获得增量资金青睐，而传统行业则面临明显资金流出，股价与流动性分化加剧，市场交易拥挤度亦呈结构性抬升。

本报告期，代表大盘价值风格的上证 50 小幅回调，下跌 1.38%；沪深 300 则在权重股支撑下上涨 7.55%。成长风格表现尤为突出，创业板指和科创 50 分别上涨 35.58% 和 64.25%，显著领跑全市场。中小市值方面，中证 1000 和中证 2000 分别录得 15.99% 和 9.10% 的涨幅，而万得微盘股指数则下跌 7.2%。市场整体呈现大中盘成长明显跑赢小盘与大盘价值、双创板块表现大幅优于全市场的格局。

本报告期内，我们坚持以技术面为主的短期多因子模型为主，结合对市场的研判，采取比较稳健的投资策略，股票仓位保持在较高水平。

债券方面，2026 年上半年，中国经济顶住外部压力运行在合理区间，呈现“总量稳、结构分化、名义改善”的特征。上半年 GDP 达 69.57 万亿元，同比增长 4.7%，恰好落在年初两会确定的“4.5%-5%”目标区间。其中一季度增长 5.0%，二季度增长 4.3%。GDP 平减指数结束此前连续 12 个

季度为负的局面，上半年名义增速高于实际增速 0.7 个百分点。PPI 在 3 月转正后持续上行，6 月同比达 4.1%，创 47 个月新高；CPI 温和上涨 1.0%，核心 CPI 上涨 1.2%，处于温和通胀区间。6 月制造业 PMI 为 50.3%，重回扩张区间，新出口订单指数 50.1%，时隔两年重返荣枯线以上。经济内部 K 型分化明显，生产端看，规模以上工业增加值增长 5.4%，装备制造业（+9.3%）和高技术制造业（+13.3%）表现亮眼，新动能对经济增长直接贡献超 40%。从需求端看，外需强劲，AI 相关产品出口量价齐升；内需偏弱，固定资产投资累计同比-5.7%，社会消费品零售总额接近 25 万亿元但增速放缓。建筑业增加值同比下降 4.0%，房地产业-0.2%，仍是主要拖累项。

上半年债市整体呈现“低波动、窄区间、震荡偏强”的特征，10 年期国债收益率在 1.70%-1.90% 区间运行，振幅不足 20BP。上半年资金面持续宽松成为最显著预期差，4-5 月 DR007 一度降至 1.34%，显著低于政策利率。6 月以来资金利率向政策利率回归，DR007 围绕政策利率运行。信用利差被压缩至历史低位。

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恒利混合 A 的基金份额净值为 1.1778 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.56%，同期业绩比较基准收益率为 1.74%，截至本报告期末华泰柏瑞恒利混合 C 的基金份额净值为 1.1666 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.64%，同期业绩比较基准收益率为 1.74%。

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 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或出现分化。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可能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，力争为模型提供一定支撑。

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。

展望三季度，债券市场大概率延续震荡格局，整体仍处于偏多环境，但需警惕阶段性扰动。内需偏弱格局短期难改，终端需求偏温和，CPI 同比或维持震荡，基本面尚不构成利率上行风险。央行维持“适度宽松”基调，流动性平稳诉求强，资金面预计均衡偏松。但三季度财政落地进度或加快，新型政策性金融工具可能投放，利率债供给上行，对债市形成阶段性供给冲击。中短端信用利差已压缩至低位，外部评级调整或冲击弱资质信用债，信用下沉性价比不足。历史经验看，三季度市场普遍存在调整预期，叠加绝对收益账户止盈需求，利率可能出现阶段性起伏。

策略上，从“趋势做多”转向“区间震荡中的结构性机会挖掘”，密切跟踪三个信号——一是 7 月政治局会议对政策的定调；二是三季度社融增速是否持续超预期回升；三是美联储政策路径变化对人民币汇率和资金面的冲击。在利率低位震荡的环境中，维持灵活的久期与适中的杠杆水平，有效规避信用风险，同时增加交易频率。

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

1、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利按照除权除息日的基金份额净值自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

2、基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

3、本基金各基金份额类别在费用收取上不同，其对应的可分配收益可能有所不同；本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

4、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

截止本报告期末，因赎回等原因，本基金自 2026-1-9 至 2026-2-11 存在连续 20 个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形，但无基金份额持有人数量低于 200 人的情形。

§ 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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据自身能够获取的数据和信息，依据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

本基金本报告期内未做利润分配。

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

本托管人根据自身能够获取的数据和信息，认真复核了本中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 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：华泰柏瑞恒利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	2,189,503.67	860,934.01
结算备付金		26,119.09	88,669.00
存出保证金		19,824.59	39,246.03
交易性金融资产	6.4.7.2	25,399,742.06	75,325,993.16
其中：股票投资		4,715,698.12	8,185,852.20
基金投资		-	-
债券投资		20,684,043.94	67,140,140.96
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	-	-1,560.00
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		484,781.89	6,501,950.00
应收股利		-	-
应收申购款		54,320.93	17,045.39
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		28,174,292.23	82,832,277.59
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		-	-
应付赎回款		53,801.47	925,878.95
应付管理人报酬		20,381.06	59,301.03
应付托管费		3,396.85	9,883.53
应付销售服务费		2,362.96	4,115.48
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	228.48
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	70,422.31	192,031.96
负债合计		150,364.65	1,191,439.43
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	23,895,402.23	69,067,232.01
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	4,128,525.35	12,573,606.15
净资产合计		28,023,927.58	81,640,838.16
负债和净资产总计		28,174,292.23	82,832,277.59

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 23,895,402.23 份，其中下属 A 类基金份额净值 1.1778 元，基金份额总额 13,173,396.62 份；下属 C 类基金份额净值 1.1666 元，基金份额总

额 10,722,005.61 份。

6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞恒利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		-401,938.41	5,388,705.90
1. 利息收入		12,694.68	10,946.53
其中：存款利息收入	6.4.7.13	10,754.68	10,946.53
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		1,940.00	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以 “-” 填列）		-1,157,118.31	8,416,875.85
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-154,154.89	2,115,468.22
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-1,057,934.53	6,059,894.67
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	54,971.11	241,512.96
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	649,038.77	-3,060,348.22
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	93,446.45	21,231.74
减：二、营业总支出		313,682.28	1,826,165.36
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	156,693.01	1,039,745.29
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	26,115.51	173,290.93
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	16,129.45	55,595.11

4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		36,812.63	436,278.55
其中：卖出回购金融资产支出		36,812.63	436,278.55
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		0.09	391.39
8. 其他费用	6.4.7.23	77,931.59	120,864.09
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-715,620.69	3,562,540.54
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-715,620.69	3,562,540.54
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-715,620.69	3,562,540.54

6.3 净资产变动表

会计主体：华泰柏瑞恒利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	69,067,232.01	-	12,573,606.15	81,640,838.16
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	69,067,232.01	-	12,573,606.15	81,640,838.16
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-45,171,829.78	-	-8,445,080.80	-53,616,910.58
（一）、综合收益总额	-	-	-715,620.69	-715,620.69
（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）	-45,171,829.78	-	-7,729,460.11	-52,901,289.89
其中：1. 基金申	30,060,590.89	-	6,665,793.71	36,726,384.60

购款				
2. 基金赎回款	-75,232,420.67	-	-14,395,253.82	-89,627,674.49
(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	23,895,402.23	-	4,128,525.35	28,023,927.58
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	321,324,089.00	-	50,830,374.98	372,154,463.98
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	321,324,089.00	-	50,830,374.98	372,154,463.98
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-72,897,440.10	-	-8,537,383.28	-81,434,823.38
(一)、综合收益总额	-	-	3,562,540.54	3,562,540.54
(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）	-72,897,440.10	-	-12,099,923.82	-84,997,363.92
其中：1. 基金申购款	30,177,555.49	-	4,765,034.11	34,942,589.60
2. 基金赎回款	-103,074,995.59	-	-16,864,957.93	-119,939,953.52
(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	248,426,648.90	-	42,292,991.70	290,719,640.60

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

华泰柏瑞恒利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[2021]2247 号《关于准予华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金注册的批复》注册，由华泰柏瑞基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞恒利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 240,004,598.81 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(2021)第 0910 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金基金合同》于 2021 年 9 月 14 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 240,023,948.90 份基金份额，其中认购资金利息折合 19,350.09 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，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金基金合同》和《华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金根据认购费、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。在投资者认购、申购基金份额时收取认购、申购费用而不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资者认购、申购基金份额时不收取认购、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，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞恒利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，包括国内依法发行或上市的股票（包含创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许投资的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、存托凭证、债券（包含国债、地方政府债、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）、可交换债券、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、同业存单、货币市场工具、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）。本基金还可以根据相关法律法规的规定参与融资业务。本基金股票资产及存托凭证的投资比例占基金资产的 0%-30%；投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金投资同业存单的比例不高于基金资产的 20%。本基金的业绩比较基准为上证国债指数收益率 $\times$ 80%+沪深 300 指数收益率 $\times$ 15%+中证港股通综合指数（人民币）收益率 $\times$ 5%。

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《华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金基金合同》约定的资产估值和会计核算方法及财务报表 6.4.4 所述的重要会计政策和会计估计编制。本基金管理人编制本财务报表是为了向基金份额持有人、中国证监会及其派出机构披露及报送。因此，本财务报表不适用于其他用途。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表按照 6.4.2 所述的编制基础编制。

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[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、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[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]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[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》、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》、中华人民共和国国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 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》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交易，资管产品管理人为纳税人。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，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交易，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。

自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，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 日前取得的基金、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基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，金融同业往来利息收入免征增值税。根据财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、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。

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

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

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

(4)基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

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	2,189,503.67
等于：本金	2,189,091.11
加：应计利息	412.56
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	2,189,503.67

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		5,603,111.04	-	4,715,698.12	-887,412.92
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	20,562,360.00	76,043.94	20,684,043.94	45,640.00
	合计	20,562,360.00	76,043.94	20,684,043.94	45,640.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		26,165,471.04	76,043.94	25,399,742.06	-841,772.92

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	2.52
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	15,871.82
其中：交易所市场	13,628.32
银行间市场	2,243.50
应付利息	-
预提费用	54,547.97
合计	70,422.31

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

华泰柏瑞恒利混合 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	53,321,717.93	53,321,717.93
本期申购	21,098,007.69	21,098,007.69
本期赎回（以“-”号填列）	-61,246,329.00	-61,246,329.00
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	13,173,396.62	13,173,396.62

华泰柏瑞恒利混合 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	15,745,514.08	15,745,514.08
本期申购	8,962,583.20	8,962,583.20
本期赎回（以“-”号填列）	-13,986,091.67	-13,986,091.67
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	10,722,005.61	10,722,005.61

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

华泰柏瑞恒利混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	11,681,813.97	-1,849,956.80	9,831,857.17
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	11,681,813.97	-1,849,956.80	9,831,857.17
本期利润	-982,934.25	409,486.19	-573,448.06
本期基金份额交易产生的变动数	-8,153,258.05	1,237,591.71	-6,915,666.34
其中：基金申购款	4,656,325.91	118,474.42	4,774,800.33
基金赎回款	-12,809,583.96	1,119,117.29	-11,690,466.67
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,545,621.67	-202,878.90	2,342,742.77

华泰柏瑞恒利混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,283,387.85	-541,638.87	2,741,748.98
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	3,283,387.85	-541,638.87	2,741,748.98
本期利润	-381,725.21	239,552.58	-142,172.63
本期基金份额交易产生的变动数	-952,304.72	138,510.95	-813,793.77
其中：基金申购款	1,861,027.28	29,966.10	1,890,993.38
基金赎回款	-2,813,332.00	108,544.85	-2,704,787.15
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,949,357.92	-163,575.34	1,785,782.58

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	10,583.38
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	123.78
其他	47.52
合计	10,754.68

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	-154,154.89
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	-154,154.89

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	44,683,496.86
减：卖出股票成本总额	44,774,316.39
减：交易费用	63,335.36
买卖股票差价收入	-154,154.89

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 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	464,230.47
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-1,522,165.00
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	-1,057,934.53

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	87,185,924.88
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	88,385,010.00
减：应计利息总额	320,954.88
减：交易费用	2,125.00
买卖债券差价收入	-1,522,165.00

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	54,971.11
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	54,971.11

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	649,038.77

股票投资	-835,751.23
债券投资	1,484,790.00
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动 产生的预估增值税	-
合计	649,038.77

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	93,253.44
基金转换费收入	193.01
合计	93,446.45

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 50%归入基金资产。C 类基金份额的赎回费全额归入基金资产。

2、本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的不低于赎回费的 50%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	14,876.39
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
银行间账户服务费	18,600.00
银行划款手续费	4,783.62
合计	77,931.59

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

根据《华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金基金合同》以及本基金管理人于 2026 年 8 月 14 日发布的《华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》，自 2026 年 8 月 14 日起，本基金进入基金财产清算程序。

截至财务报表批准日，本基金无其他需要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
兴业银行股份有限公司（“兴业银行”）	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

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 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	
	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	50,461,121.16	58.12	46,288,948.42	33.43

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：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	
	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 成交总额的比例 (%)
华泰证券	-	-	38,603.75	100.00

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 2026年1月1日至2026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	25,234.98	71.25	9,703.48	71.20
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 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	23,152.68	43.50	17,153.23	68.19

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》，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 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	156,693.01	1,039,745.29
其中：应支付销售机构的客户维护费	60,911.57	157,822.71
应支付基金管理人的净管理费	95,781.44	881,922.58

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 0.60%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×0.60%/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	26,115.51	173,290.93

注：支付基金托管人兴业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10%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×0.10%/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		
	华泰柏瑞恒利混合 A	华泰柏瑞恒利混合 C	合计
兴业银行股份有限公司	-	85.12	85.12
华泰证券股份有限公司	-	1.69	1.69
华泰柏瑞基金管理有限公司	-	0.61	0.61
合计	-	87.42	87.42
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		
	华泰柏瑞恒利混合 A	华泰柏瑞恒利混合 C	合计
兴业银行股份有限公司	-	2,273.46	2,273.46
华泰证券股份有限公司	-	429.76	429.76
华泰柏瑞基金管理有限公司	-	215.20	215.20
合计	-	2,918.42	2,918.42

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 0.2%的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

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

单位：人民币元

本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
兴业银行	10,788,143.01	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
兴业银行	-	-	-	-	48,000,000.00	3,051.40

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

注：本报告期及上年度可比期间，基金管理人未投资本基金。

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
	2,189,503.67	10,583.38	3,172,580.12	8,691.46

注：本基金的银行存款由基金托管人兴业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，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券(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	2,189,503.67	-	-	-	-	-	2,189,503.67
结算备付金	26,119.09	-	-	-	-	-	26,119.09
存出保证金	19,824.59	-	-	-	-	-	19,824.59
交易性金融资产	10,066,038.46	-	-	10,618,005.48	-	4,715,698.12	25,399,742.06
应收申购款	-	-	-	-	-	54,320.93	54,320.93
应收清算款	-	-	-	-	-	484,781.89	484,781.89
资产总计	12,301,485.81	-	-	10,618,005.48	-	5,254,800.94	28,174,292.23
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	53,801.47	53,801.47
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	20,381.06	20,381.06
应付托管费	-	-	-	-	-	3,396.85	3,396.85
应付销售服务费	-	-	-	-	-	2,362.96	2,362.96
其他负债	-	-	-	-	-	70,422.31	70,422.31
负债总计	-	-	-	-	-	150,364.65	150,364.65
利率敏感度缺口	12,301,485.81	-	-	10,618,005.48	-	5,104,436.29	28,023,927.58
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	860,934.01	-	-	-	-	-	860,934.01
结算备付金	88,669.00	-	-	-	-	-	88,669.00
存出保证金	39,246.03	-	-	-	-	-	39,246.03
交易性金融资产	-	-	30,236,355.72	-	36,903,785.24	28,185,852.20	75,325,993.16
买入返售金融资产	-1,560.00	-	-	-	-	-	-1,560.00
应收清算款	-	-	-	-	-	6,501,950.00	6,501,950.00

						00	
应收申购款	-	-	-	-	-	17,045.39	17,045.39
资产总计	987,289.04	-	30,236,355.72	-	36,903,785.24	14,704,847.59	82,832,277.59
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	925,878.95	925,878.95
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	59,301.03	59,301.03
应付托管费	-	-	-	-	-	9,883.53	9,883.53
应付销售服务费	-	-	-	-	-	4,115.48	4,115.48
应交税费	-	-	-	-	-	228.48	228.48
其他负债	-	-	-	-	-	192,031.96	192,031.96
负债总计	-	-	-	-	-	1,191,439.43	1,191,439.43
利率敏感度缺口	987,289.04	-	30,236,355.72	-	36,903,785.24	13,513,408.16	81,640,838.16

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

假设	除市场利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）
	市场利率下降 25 个基点	100,096.42	2,127,973.24
	市场利率上升 25 个基点	-98,899.53	-1,992,293.28

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 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	4,715,698.12	16.83	8,185,852.20	10.03
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	4,715,698.12	16.83	8,185,852.20	10.03

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：于 2026 年 06 月 30 日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为 16.83%(2025 年 12 月 31 日：10.03%)，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响(2025 年 12 月 31 日：同)。

6.4.14 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	4,715,698.12	8,185,852.20
第二层次	20,684,043.94	67,140,140.96
第三层次	—	—
合计	25,399,742.06	75,325,993.16

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	4,715,698.12	16.74
	其中：股票	4,715,698.12	16.74
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	20,684,043.94	73.41
	其中：债券	20,684,043.94	73.41
	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	2,215,622.76	7.86
8	其他各项资产	558,927.41	1.98
9	合计	28,174,292.23	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	28,219.00	0.10
B	采矿业	460,236.40	1.64
C	制造业	2,476,590.50	8.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	26,011.00	0.09
E	建筑业	114,669.00	0.41
F	批发和零售业	112,669.00	0.40
G	交通运输、仓储和邮政业	257,825.00	0.92
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	114,983.00	0.41
J	金融业	522,164.00	1.86
K	房地产业	75,812.00	0.27
L	租赁和商务服务业	83,122.00	0.30
M	科学研究和技术服务业	223,822.22	0.80
N	水利、环境和公共设施管理业	127,345.00	0.45
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	18,657.00	0.07
Q	卫生和社会工作	18,867.00	0.07
R	文化、体育和娱乐业	54,706.00	0.20
S	综合	-	-
	合计	4,715,698.12	16.83

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	601988	中国银行	8,600	49,192.00	0.18
2	600919	江苏银行	4,100	44,198.00	0.16
3	601939	建设银行	4,400	42,372.00	0.15
4	600971	恒源煤电	6,100	42,090.00	0.15
5	000408	藏格矿业	600	41,592.00	0.15
6	601225	陕西煤业	2,000	40,700.00	0.15
7	600123	兰花科创	7,600	40,584.00	0.14
8	601699	潞安环能	2,800	39,984.00	0.14
9	601088	中国神华	1,000	39,040.00	0.14
10	600938	中国海油	1,400	38,010.00	0.14
11	601398	工商银行	5,200	36,764.00	0.13
12	601328	交通银行	5,500	35,365.00	0.13
13	600177	雅戈尔	4,600	34,638.00	0.12
14	600901	江苏金租	5,900	33,925.00	0.12
15	601919	中远海控	2,400	31,824.00	0.11
16	600546	山煤国际	2,800	30,604.00	0.11
17	601009	南京银行	3,000	29,670.00	0.11
18	600015	华夏银行	4,500	28,755.00	0.10
19	601997	贵阳银行	5,400	27,702.00	0.10
20	000933	神火股份	1,300	27,560.00	0.10
21	601168	西部矿业	1,000	27,140.00	0.10
22	000983	山西焦煤	4,600	26,680.00	0.10
23	600755	厦门国贸	4,900	26,558.00	0.09
24	601963	重庆银行	2,500	25,200.00	0.09
25	301336	趣睡科技	630	25,168.50	0.09
26	600348	华阳股份	3,200	24,480.00	0.09
27	601998	中信银行	3,500	24,255.00	0.09
28	601000	唐山港	5,800	24,070.00	0.09
29	002154	报喜鸟	6,700	23,852.00	0.09
30	688670	金迪克	1,400	23,716.00	0.08
31	301390	经纬股份	700	22,582.00	0.08
32	600012	皖通高速	1,400	22,064.00	0.08
33	688426	康为世纪	1,200	22,008.00	0.08
34	688393	安必平	1,200	21,336.00	0.08
35	002857	三晖电气	1,200	21,084.00	0.08
36	688420	美腾科技	1,000	21,070.00	0.08
37	600398	海澜之家	4,000	20,920.00	0.07
38	301258	富士莱	900	20,493.00	0.07
39	601187	厦门银行	3,000	20,490.00	0.07
40	301159	三维天地	700	20,370.00	0.07
41	601825	沪农商行	2,700	20,223.00	0.07
42	300928	华安鑫创	700	20,216.00	0.07
43	688329	艾隆科技	1,000	20,210.00	0.07

44	300949	奥雅股份	1,000	20,170.00	0.07
45	300694	蠡湖股份	2,100	20,160.00	0.07
46	301198	喜悦智行	1,500	20,100.00	0.07
47	300851	交大思诺	900	20,025.00	0.07
48	301052	果麦文化	900	19,998.00	0.07
49	001278	一彬科技	1,300	19,994.00	0.07
50	300844	山水比德	900	19,989.00	0.07
51	003011	海象新材	1,100	19,987.00	0.07
52	301163	宏德股份	900	19,962.00	0.07
53	002910	庄园牧场	1,800	19,944.00	0.07
53	300906	日月明	800	19,944.00	0.07
54	300898	熊猫乳品	1,100	19,932.00	0.07
55	002084	海鸥住工	5,700	19,836.00	0.07
56	001336	楚环科技	900	19,818.00	0.07
57	301331	恩威医药	900	19,800.00	0.07
58	300517	海波重科	2,100	19,782.00	0.07
59	301272	英华特	600	19,764.00	0.07
60	301036	双乐股份	900	19,737.00	0.07
61	603172	万丰股份	1,200	19,716.00	0.07
62	002760	凤形股份	1,200	19,704.00	0.07
63	301113	雅艺科技	1,320	19,681.20	0.07
64	301098	金埔园林	2,400	19,680.00	0.07
65	300865	大宏立	900	19,665.00	0.07
66	301049	超越科技	1,100	19,646.00	0.07
67	002319	乐通股份	1,900	19,608.00	0.07
68	301355	南王科技	2,000	19,560.00	0.07
69	300549	优德精密	1,500	19,530.00	0.07
70	301001	凯淳股份	900	19,503.00	0.07
71	300417	南华仪器	1,900	19,494.00	0.07
72	600768	宁波富邦	1,300	19,474.00	0.07
73	301314	科瑞思	400	19,464.00	0.07
74	002968	新大正	2,300	19,458.00	0.07
75	003023	彩虹集团	1,000	19,440.00	0.07
76	002780	三夫户外	1,600	19,424.00	0.07
77	301229	纽泰格	1,600	19,392.00	0.07
78	300899	上海凯鑫	700	19,383.00	0.07
79	688021	奥福科技	1,000	19,360.00	0.07
80	002820	桂发祥	2,300	19,320.00	0.07
80	301505	苏州规划	1,200	19,320.00	0.07
81	301515	港通医疗	1,100	19,283.00	0.07
82	300564	筑博设计	1,600	19,216.00	0.07
83	301037	保立佳	1,600	19,200.00	0.07
84	605567	春雪食品	2,400	19,176.00	0.07

85	001387	雪祺电气	1,500	19,155.00	0.07
86	300640	德艺文创	3,400	19,142.00	0.07
87	600502	安徽建工	4,400	19,140.00	0.07
88	300947	德必集团	1,500	19,125.00	0.07
89	000429	粤高速 A	1,400	19,110.00	0.07
89	300713	英可瑞	1,500	19,110.00	0.07
90	300778	新城市	2,000	19,100.00	0.07
91	605001	威奥股份	3,500	19,075.00	0.07
92	300126	锐奇股份	3,300	19,074.00	0.07
93	300615	欣天科技	1,900	19,057.00	0.07
94	301359	东南电子	1,200	19,056.00	0.07
95	300621	维业股份	3,000	19,050.00	0.07
96	000633	合金投资	4,000	19,040.00	0.07
97	603188	亚邦股份	4,800	19,008.00	0.07
98	300823	建科智能	1,300	18,954.00	0.07
99	002802	洪汇新材	1,800	18,936.00	0.07
100	002492	恒基达鑫	3,500	18,935.00	0.07
101	603810	丰山集团	1,700	18,921.00	0.07
102	301372	科净源	600	18,906.00	0.07
103	003003	天元股份	1,900	18,905.00	0.07
104	002813	路畅科技	1,000	18,900.00	0.07
104	301192	泰祥股份	1,000	18,900.00	0.07
104	600883	博闻科技	2,700	18,900.00	0.07
105	002524	光正眼科	5,700	18,867.00	0.07
106	600148	长春一东	1,300	18,863.00	0.07
107	603329	上海雅仕	2,100	18,858.00	0.07
108	000702	正虹科技	3,800	18,848.00	0.07
109	301006	迈拓股份	1,500	18,825.00	0.07
110	301126	达嘉维康	2,200	18,810.00	0.07
110	600561	江西长运	3,800	18,810.00	0.07
111	301429	森泰股份	1,200	18,804.00	0.07
112	002949	华阳国际	1,900	18,791.00	0.07
112	301009	可靠股份	2,300	18,791.00	0.07
113	300892	品渥食品	1,000	18,780.00	0.07
114	002105	信隆健康	3,800	18,772.00	0.07
114	002909	集泰股份	3,800	18,772.00	0.07
115	002652	扬子新材	4,400	18,744.00	0.07
116	000605	渤海股份	3,500	18,725.00	0.07
117	301156	美农生物	1,720	18,696.40	0.07
118	603536	惠发食品	2,400	18,696.00	0.07
119	300838	浙江力诺	1,400	18,690.00	0.07
120	603151	邦基科技	1,700	18,683.00	0.07
121	603506	南都物业	2,000	18,680.00	0.07

122	603041	美思德	1,800	18,666.00	0.07
123	600661	昂立教育	2,700	18,657.00	0.07
124	002494	华斯股份	4,200	18,648.00	0.07
124	300405	科隆股份	3,600	18,648.00	0.07
125	002188	中天服务	3,800	18,620.00	0.07
125	002790	瑞尔特	3,500	18,620.00	0.07
126	600257	大湖股份	4,300	18,619.00	0.07
127	300030	阳普医疗	3,200	18,592.00	0.07
128	300371	汇中股份	1,900	18,582.00	0.07
129	300612	宣亚国际	1,700	18,581.00	0.07
130	603900	莱绅通灵	3,300	18,579.00	0.07
131	002159	三特索道	1,500	18,555.00	0.07
132	002671	龙泉股份	5,000	18,550.00	0.07
133	301298	东利机械	1,600	18,512.00	0.07
134	000619	海螺新材	4,200	18,480.00	0.07
134	002836	新宏泽	2,000	18,480.00	0.07
135	603839	安正时尚	3,200	18,464.00	0.07
136	300240	飞力达	3,700	18,463.00	0.07
137	300987	川网传媒	1,500	18,450.00	0.07
138	603982	泉峰汽车	3,300	18,447.00	0.07
139	301519	舜禹股份	1,700	18,445.00	0.07
140	300254	仟源医药	2,300	18,423.00	0.07
141	300597	吉大通信	2,600	18,408.00	0.07
142	000548	湖南投资	4,500	18,405.00	0.07
143	300614	百川畅银	1,900	18,392.00	0.07
144	301011	华立科技	1,300	18,382.00	0.07
145	603022	新通联	2,300	18,377.00	0.07
146	600202	哈空调	4,100	18,368.00	0.07
147	600159	大龙地产	8,300	18,343.00	0.07
148	301539	宏鑫科技	1,400	18,340.00	0.07
149	605122	四方新材	1,700	18,326.00	0.07
150	688528	秦川物联	2,000	18,280.00	0.07
151	603768	常青股份	2,000	18,260.00	0.07
152	300635	中达安	1,500	18,255.00	0.07
153	603356	华菱精工	1,100	18,172.00	0.06
154	001373	翔腾新材	600	18,090.00	0.06
155	000590	古汉医药	2,200	17,974.00	0.06
156	688288	鸿泉技术	1,000	17,770.00	0.06
157	601077	渝农商行	2,900	17,719.00	0.06
158	601838	成都银行	1,000	17,700.00	0.06
159	300483	首华燃气	1,000	17,580.00	0.06
160	601872	招商轮船	1,000	17,570.00	0.06
161	001255	博菲电气	700	17,563.00	0.06

162	301105	鸿铭股份	400	17,192.00	0.06
163	002563	森马服饰	3,400	17,136.00	0.06
164	002756	永兴材料	300	16,992.00	0.06
165	300438	鹏辉能源	200	16,570.00	0.06
166	601666	平煤股份	2,200	15,730.00	0.06
167	601857	中国石油	1,800	15,624.00	0.06
168	600741	华域汽车	1,000	15,520.00	0.06
169	301365	矩阵股份	400	15,164.00	0.05
170	000651	格力电器	400	15,000.00	0.05
171	600256	广汇能源	3,000	14,820.00	0.05
172	600999	招商证券	700	14,770.00	0.05
173	603565	中谷物流	1,500	14,715.00	0.05
174	688202	美迪西	182	14,689.22	0.05
175	300661	圣邦股份	100	14,348.00	0.05
176	600997	开滦股份	3,000	14,250.00	0.05
177	601658	邮储银行	2,800	13,804.00	0.05
178	601098	中南传媒	1,400	13,776.00	0.05
179	300953	震裕科技	100	13,370.00	0.05
180	300769	德方纳米	200	13,300.00	0.05
181	001339	智微智能	130	13,296.40	0.05
182	002379	宏桥控股	900	13,293.00	0.05
183	600282	南钢股份	2,800	12,852.00	0.05
184	688097	博众精工	200	12,610.00	0.04
185	688026	洁特生物	800	12,568.00	0.04
186	688638	誉辰智能	400	12,468.00	0.04
187	600188	兖矿能源	700	12,439.00	0.04
188	601898	中煤能源	1,000	12,180.00	0.04
189	601019	山东出版	1,900	12,160.00	0.04
190	301095	广立微	100	11,805.00	0.04
191	600039	四川路桥	1,500	11,730.00	0.04
192	000895	双汇发展	500	11,200.00	0.04
193	601598	中国外运	2,200	10,912.00	0.04
194	300961	深水海纳	800	10,280.00	0.04
195	300960	通业科技	600	9,330.00	0.03
196	603700	宁水集团	800	9,288.00	0.03
197	688051	佳华科技	400	9,192.00	0.03
198	300763	锦浪科技	100	9,035.00	0.03
199	600026	中远海能	500	8,970.00	0.03
200	002737	葵花药业	800	8,968.00	0.03
201	600757	长江传媒	1,200	8,772.00	0.03
202	300556	丝路视觉	500	8,685.00	0.03
203	601916	浙商银行	3,300	8,679.00	0.03
204	002942	新农股份	600	8,598.00	0.03

205	000985	大庆华科	600	8,538.00	0.03
206	603183	建研院	2,400	8,520.00	0.03
207	003042	中农联合	700	8,505.00	0.03
208	600018	上港集团	1,800	8,496.00	0.03
209	603908	牧高笛	500	8,440.00	0.03
210	300800	力合科技	900	8,325.00	0.03
211	300220	金运激光	800	8,312.00	0.03
212	601006	大秦铁路	1,800	8,298.00	0.03
213	300642	透景生命	700	8,260.00	0.03
214	301010	晶雪节能	500	8,145.00	0.03
215	600774	汉商集团	1,300	8,138.00	0.03
216	688118	普元信息	400	8,048.00	0.03
217	300112	万讯自控	1,300	8,047.00	0.03
218	603345	安井食品	100	8,019.00	0.03
219	600099	林海股份	1,000	7,980.00	0.03
220	300886	华业香料	400	7,960.00	0.03
220	600269	赣粤高速	2,000	7,960.00	0.03
221	600287	苏豪时尚	1,800	7,938.00	0.03
221	600533	栖霞建设	4,200	7,938.00	0.03
222	002799	环球印务	1,300	7,865.00	0.03
223	000757	浩物股份	2,300	7,843.00	0.03
224	300707	威唐工业	700	7,826.00	0.03
225	301601	惠通科技	500	7,810.00	0.03
226	300610	晨化股份	800	7,800.00	0.03
227	002862	实丰文化	600	7,698.00	0.03
228	603826	坤彩科技	300	7,668.00	0.03
229	002233	塔牌集团	1,100	7,667.00	0.03
230	002295	精艺股份	900	7,632.00	0.03
231	002947	恒铭达	100	7,605.00	0.03
232	600359	新农开发	1,400	7,560.00	0.03
233	301307	美利信	100	7,529.00	0.03
234	002591	恒大高新	1,200	7,344.00	0.03
235	601288	农业银行	1,200	7,284.00	0.03
236	600887	伊利股份	300	7,188.00	0.03
237	600273	嘉化能源	1,100	7,172.00	0.03
238	600064	南京高科	1,000	7,130.00	0.03
239	600036	招商银行	200	7,100.00	0.03
240	002432	九安医疗	100	7,068.00	0.03
241	600428	中远海特	900	7,029.00	0.03
242	600985	淮北矿业	500	7,025.00	0.03
243	000776	广发证券	300	7,020.00	0.03
244	601668	中国建筑	1,600	6,944.00	0.02
245	002497	雅化集团	300	6,111.00	0.02

246	002566	益盛药业	1,000	6,040.00	0.02
247	605180	华生科技	500	5,925.00	0.02
248	002738	中矿资源	100	5,899.00	0.02
249	300731	科创新源	100	5,836.00	0.02
250	301317	鑫磊股份	100	5,612.00	0.02
251	301193	家联科技	300	5,562.00	0.02
252	600886	国投电力	400	5,324.00	0.02
253	002809	红墙股份	700	5,208.00	0.02
254	601677	明泰铝业	300	4,980.00	0.02
255	002545	东方铁塔	300	4,866.00	0.02
256	300073	当升科技	100	4,804.00	0.02
257	601318	中国平安	100	4,774.00	0.02
258	600926	杭州银行	300	4,335.00	0.02
259	300432	富临精工	200	4,018.00	0.01
260	600641	先导基电	100	3,986.00	0.01
261	600299	安迪苏	500	3,925.00	0.01
262	301109	军信股份	300	3,738.00	0.01
263	300955	嘉亨家化	100	3,609.00	0.01
264	000426	兴业银锡	100	3,296.00	0.01
265	601101	昊华能源	300	3,168.00	0.01
266	600508	上海能源	420	3,095.40	0.01
267	600595	中孚实业	500	2,810.00	0.01
268	002250	联化科技	200	2,734.00	0.01
269	301371	敷尔佳	100	2,600.00	0.01
270	002531	天顺风能	300	2,529.00	0.01
271	002128	电投能源	100	2,312.00	0.01
272	002043	兔宝宝	200	2,216.00	0.01
273	000663	永安林业	400	2,040.00	0.01
274	002267	陕天然气	300	1,962.00	0.01
275	603619	中曼石油	100	1,871.00	0.01
276	002416	爱施德	200	1,792.00	0.01
277	600028	中国石化	400	1,784.00	0.01
278	002468	申通快递	100	1,456.00	0.01
279	601717	中创智领	100	1,391.00	0.00
280	600230	沧州大化	100	1,302.00	0.00
281	600295	鄂尔多斯	100	1,072.00	0.00
282	002382	蓝帆医疗	200	1,016.00	0.00
283	601229	上海银行	100	868.00	0.00
284	600020	中原高速	200	738.00	0.00
285	300305	裕兴股份	100	586.00	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	002072	凯瑞德	249,305.00	0.31
2	301505	苏州规划	242,931.00	0.30
3	002857	三晖电气	234,435.00	0.29
4	301118	恒光股份	226,934.39	0.28
5	300240	飞力达	224,358.00	0.27
6	605151	西上海	223,938.00	0.27
7	301105	鸿铭股份	208,625.00	0.26
8	300621	维业股份	203,699.00	0.25
9	002679	福建金森	198,733.00	0.24
10	002799	环球印务	195,410.00	0.24
11	300713	英可瑞	194,742.00	0.24
12	301125	腾亚精工	189,759.00	0.23
13	301578	辰奕智能	188,819.00	0.23
14	301390	经纬股份	188,213.00	0.23
15	688426	康为世纪	183,863.23	0.23
16	300514	友讯达	182,258.00	0.22
17	600128	苏豪弘业	179,083.00	0.22
18	002968	新大正	178,380.00	0.22
19	600159	大龙地产	177,820.00	0.22
20	300992	泰福泵业	176,270.00	0.22

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	002072	凯瑞德	254,342.00	0.31
2	301118	恒光股份	240,765.00	0.29
3	605151	西上海	227,830.00	0.28
4	601919	中远海控	218,751.00	0.27
5	301505	苏州规划	215,094.00	0.26
6	002857	三晖电气	206,558.00	0.25
7	301125	腾亚精工	201,226.00	0.25
8	601225	陕西煤业	198,660.00	0.24
9	301105	鸿铭股份	191,289.00	0.23
10	300240	飞力达	189,442.00	0.23
11	002679	福建金森	186,935.00	0.23
12	600295	鄂尔多斯	186,247.40	0.23
13	301578	辰奕智能	184,541.50	0.23
14	300992	泰福泵业	184,535.00	0.23
15	002799	环球印务	184,127.00	0.23
16	600919	江苏银行	180,139.00	0.22

17	300713	英可瑞	177,269.00	0.22
18	300621	维业股份	175,926.00	0.22
19	300907	康平科技	171,573.00	0.21
20	300514	友讯达	169,777.00	0.21

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	42,139,913.54
卖出股票收入（成交）总额	44,683,496.86

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,684,043.94	73.81
	其中：政策性金融债	20,684,043.94	73.81
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	20,684,043.94	73.81

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	占基金资产净值比例（%）
1	200210	20 国开 10	100,000	10,618,005.48	37.89
2	092303001	23 进出清发 01	100,000	10,066,038.46	35.92

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（601939）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；中国银行（601988）在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚；20 国开 10 的发行主体国家开发银行在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行的处罚；23 进出清发 01 的发行主体进出口银行在报告编制日前一年内曾受到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	19,824.59
2	应收清算款	484,781.89
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	54,320.93
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	558,927.41

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 恒利混合 A	928	14,195.47	957,165.45	7.27	12,216,231.17	92.73
华泰柏瑞 恒利混合 C	1,010	10,615.85	46,093.43	0.43	10,675,912.18	99.57
合计	1,893	12,623.03	1,003,258.88	4.20	22,892,143.35	95.80

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（%）	57.77

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	华泰柏瑞恒利混合 A	1,170,072.10	8.8821
	华泰柏瑞恒利混合 C	210,367.82	1.9620
	合计	1,380,439.92	5.7770

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	华泰柏瑞恒利混合 A	0
	华泰柏瑞恒利混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	华泰柏瑞恒利混合 A	>100
	华泰柏瑞恒利混合 C	10~50
	合计	>100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华泰柏瑞恒利混合 A	华泰柏瑞恒利混合 C
基金合同生效日（2021 年 9 月 14 日）基金份额总额	170,011,448.81	70,012,500.09
本报告期期初基金份额总额	53,321,717.93	15,745,514.08
本报告期基金总申购份额	21,098,007.69	8,962,583.20
减：本报告期基金总赎回份额	61,246,329.00	13,986,091.67
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	13,173,396.62	10,722,005.61

§ 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。

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，本基金托管人在开展基金托管业务过程中无受调查或处罚等情况。

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，本基金托管人相关从业人员在开展基金托管业务过程中无受调查或处罚等情况。

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 (%)	
华泰证券	2	50,461,121.16	58.12	25,234.98	71.25	—
国投证券	1	36,362,289.24	41.88	10,183.66	28.75	—
国信证券	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 (%)
华泰证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	9,000,000.00	100.00	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-

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部分基金调整业绩比较基准并修订基金合同等法律文件的公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 06 月 27 日
2	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
3	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	证监会规定报刊和网站	2026 年 06 月 25 日

	（上海）有限公司费率优惠活动的公告		
4	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
5	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 06 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	华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金恢复申购、转换转入、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 12 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比(%)
机构	1	20260101-20260108;	26,931,884.90	0.00	26,931,884.90	0.00	0.00
	2	20260212-20260617;	0.00	14,663,136.46	14,663,136.46	0.00	0.00
产品特有风险							
本基金报告期内有单一持有人持有基金份额超过 20%的情形。如果这些份额持有比例较大的投资者赎回，可能导致巨额赎回，从而引发流动性风险，可能对基金产生如下影响：（1）延期办							

理赎回申请或暂停赎回的风险。当发生巨额赎回时，投资者可能面临赎回申请延期办理、延缓支付或暂停赎回的风险。（2）基金净值大幅波动的风险。基金管理人为了应对大额赎回可能短时间内进行资产变现，这将对基金资产净值产生不利影响，同时可能发生大额赎回费用归入基金资产、基金份额净值保留位数四舍五入等问题，这些都可能会造成基金资产净值的较大波动。（3）基金投资目标偏离的风险。单一投资者大额赎回后可能导致基金规模缩小，基金将面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形，从而使得实现基金投资目标存在一定的不确定性。（4）基金合同提前终止的风险。如果投资者大额赎回可能导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。本基金管理人将密切关注申赎动向，审慎评估大额申赎对基金持有集中度的影响，同时将完善流动性风险管控机制，最大限度的保护基金份额持有人的合法权益。

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