

华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金 2020 年年度报告

2020 年 12 月 31 日

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2021 年 3 月 31 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 3 月 30 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。

本年度报告财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 2020 年 12 月 31 日止。

华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金于 2020 年 8 月 20 日根据收费方式分不同，新增 C 类份额，C 类相关指标从 2020 年 8 月 20 日开始计算。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	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、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	10
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	15
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.....	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	17
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	18
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	19
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	19
4.9 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.....	19
§5 托管人报告	20
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	20
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.....	20
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	20
§6 审计报告	21
6.1 审计报告基本信息.....	21
6.2 审计报告的基本内容.....	21
§7 年度财务报表	24
7.1 资产负债表.....	24
7.2 利润表.....	25
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	26
7.4 报表附注.....	27
§8 投资组合报告	59
8.1 期末基金资产组合情况.....	59
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	59
8.3 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.....	60
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	64
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	70
8.6 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.....	70
8.7 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.....	70

8.8 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	70
8.9 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	70
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	71
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	71
8.12 投资组合报告附注	71
§ 9 基金份额持有人信息	73
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	73
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	73
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	73
§ 10 开放式基金份额变动	75
§ 11 重大事件揭示	76
11.1 基金份额持有人大会决议	76
11.2 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	76
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	76
11.4 基金投资策略的改变	76
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	76
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	76
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	76
11.8 其他重大事件	79
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	83
12.1 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	83
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	83
§ 13 备查文件目录	84
13.1 备查文件目录	84
13.2 存放地点	84
13.3 查阅方式	84

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金	
基金简称	华泰柏瑞创新升级混合	
基金主代码	000566	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014 年 5 月 6 日	
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,069,256,166.56 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	华泰柏瑞创新升级混合 A	华泰柏瑞创新升级混合 C
下属分级基金的交易代码:	000566	010028
报告期末下属分级基金的份额总额	1,067,262,094.56 份	1,994,072.00 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制风险的前提下，本基金追求基金资产的长期增值，力争在中长期为投资者创造高于业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将采取积极、主动的资产配置策略，精选与经济结构调整与转型主题直接相关，具备长期盈利能力提升的上市公司，力求实现基金资产的长期增值。
业绩比较基准	中证 TMT 产业主题指数收益率×20%+中证新兴产业指数收益率×40%+中债总指数（全价）收益率×40%
风险收益特征	本基金属于混合型基金，其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华泰柏瑞基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈晖	许俊
	联系电话	021-38601777	010-66594319
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-888-0001	95566
传真		021-38601799	010-66594942
注册地址		上海市浦东新区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		上海市浦东新区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		200135	100818

法定代表人	贾波	刘连舸
-------	----	-----

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
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 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2020 年		2019 年		2018 年	
	华泰柏瑞创新升级 混合 A	华泰柏瑞创新 升级混合 C	华泰柏瑞创新升级 混合 A	华 泰 柏 瑞 创 新 升 级 混 合 C	华泰柏瑞创新升 级混合 A	华 泰 柏 瑞 创 新 升 级 混 合 C
本期已 实现收 益	861,985,483.62	81,102.26	203,886,688.27	-	-50,566,255.80	-
本期利 润	1,298,509,557.36	363,278.71	347,807,882.14	-	-81,503,596.05	-
加权平 均基金 份额本 期利润	1.4132	0.6783	0.7452	-	-0.3377	-
本期加 权平均 净值利 润率	48.66%	20.29%	32.55%	-	-15.73%	-
本期基 金份额 净值增 长率	61.82%	9.27%	38.69%	-	-12.82%	-
3.1.2 期末数 据和指 标	2020 年末		2019 年末		2018 年末	
期末可 供分配 利润	1,860,469,283.92	4,859,610.56	649,713,122.81	-	316,394,485.19	-
期末可 供分配	1.7432	2.4370	0.8193	-	0.7731	-

基金份 额利润						
期末基 金资产 净值	3,835,700,327.18	7,148,551.28	1,760,876,186.77	-	773,358,922.88	-
期末基 金份额 净值	3.594	3.585	2.221	-	1.890	-
3.1.3 累计期 末指标	2020 年末		2019 年末		2018 年末	
基金份 额累计 净值增 长率	388.93%	9.27%	202.15%	-	117.86%	-

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

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

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

4、C 级指标的计算期间为 2020 年 8 月 20 日至 2020 年 12 月 31 日。

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

华泰柏瑞创新升级混合 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	12.59%	1.17%	6.05%	0.74%	6.54%	0.43%
过去六个月	25.36%	1.50%	8.86%	0.94%	16.50%	0.56%
过去一年	61.82%	1.61%	20.95%	1.07%	40.87%	0.54%
过去三年	95.65%	1.39%	22.61%	0.99%	73.04%	0.40%
过去五年	129.12%	1.41%	7.96%	0.94%	121.16%	0.47%
自基金合同 生效日起至 今	388.93%	1.63%	71.77%	1.07%	317.16%	0.56%

华泰柏瑞创新升级混合 C

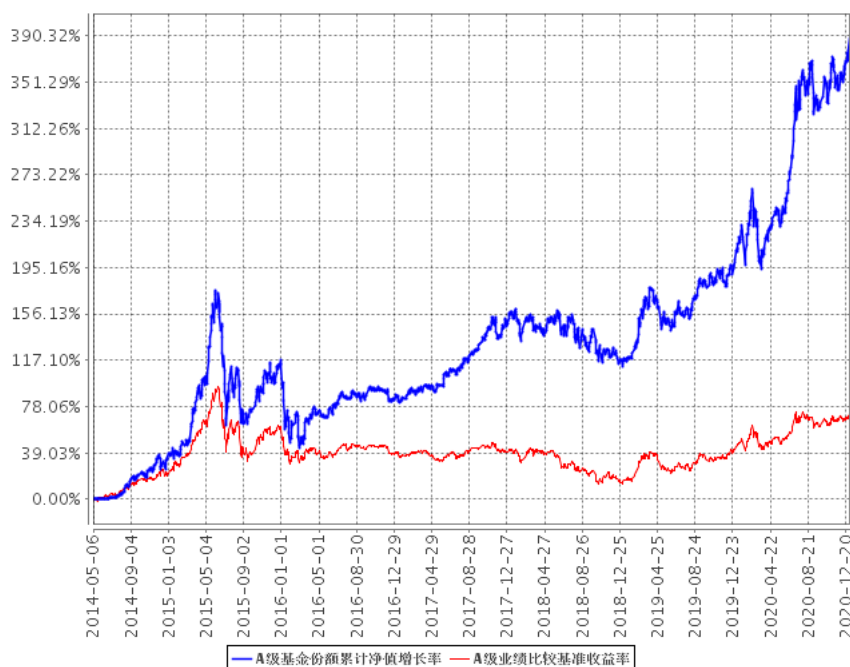
阶段	份额净值增 长率①	份额净值 增长率标 准差	业绩比较 基准收益	业绩比较基 准收益 率标准差	①-③	②-④
----	--------------	--------------------	--------------	----------------------	-----	-----

		准差②	率③	④		
过去三个月	12.38%	1.17%	6.05%	0.74%	6.33%	0.43%
自基金合同生效日起至 今	9.27%	1.28%	1.99%	0.74%	7.28%	0.54%

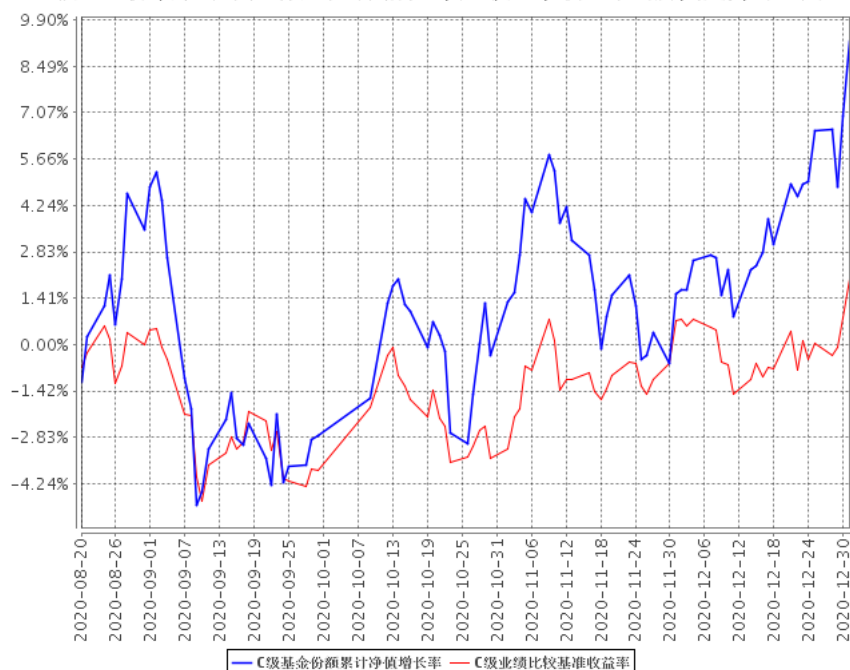
注：本基金于 2020 年 8 月 20 日新增 C 级份额。C 级指标的计算期间为 2020 年 8 月 20 日至 2020 年 12 月 31 日。

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

A级基金份额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



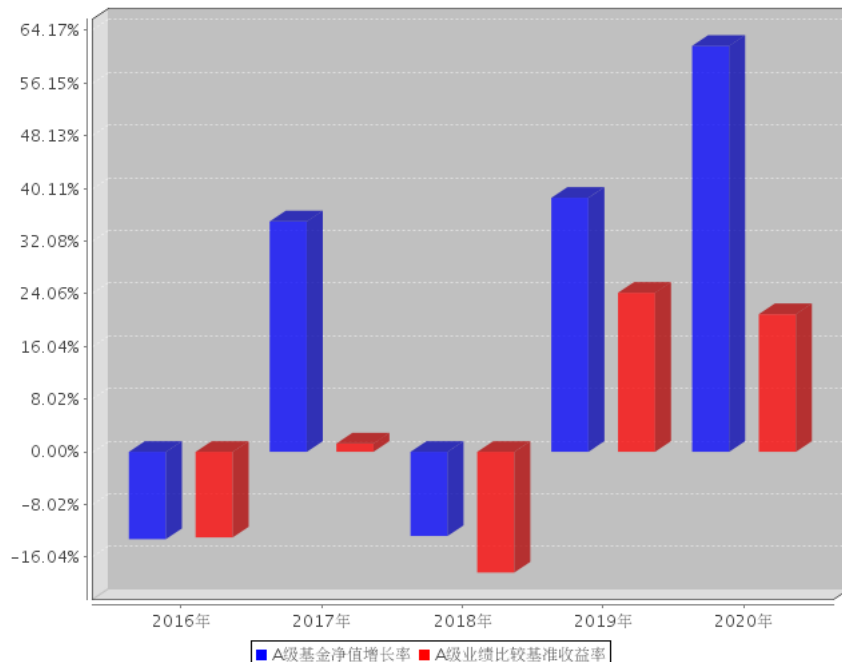
C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



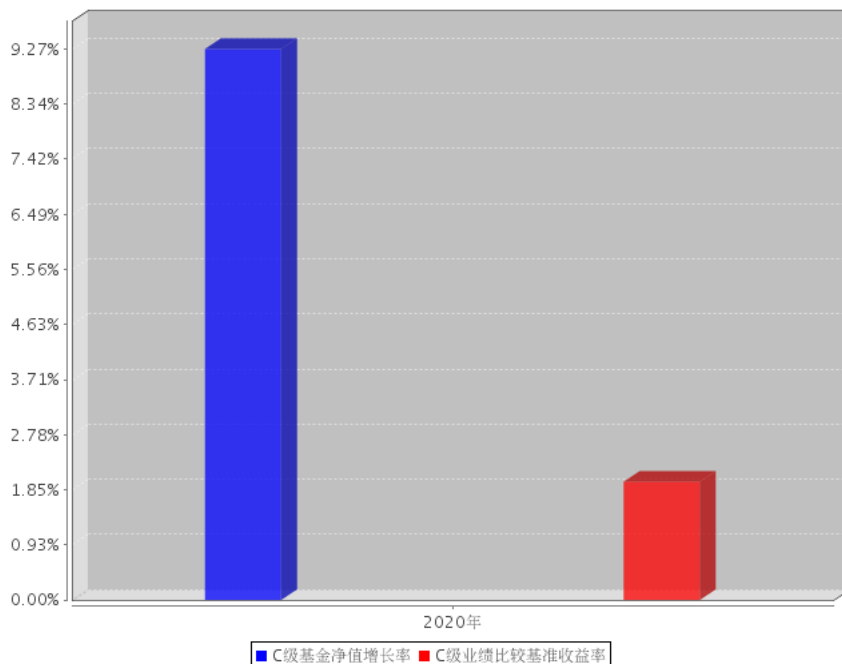
注：A 级图示日期为 2014 年 5 月 6 日至 2020 年 12 月 31 日。C 级图示日期为 2020 年 8 月 20 日至 2020 年 12 月 31 日。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

A 级过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



C 级过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：C 类份额 2020 年度的相关数据根据当年的实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

华泰柏瑞创新升级混合 A					
年度	每 10 份基金	现金形式发放总额	再投资形式发放	年度利润分配合	备注

	份额分红数		总额	计	
2020	-	-	-	-	
2019	3.8290	257,846,860.63	37,925,271.06	295,772,131.69	
2018	3.2300	26,527,663.79	29,047,551.89	55,575,215.68	
合计	7.0590	284,374,524.42	66,972,822.95	351,347,347.37	

注：本基金于 2020 年 8 月 20 日新增 C 类份额。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司。华泰柏瑞基金管理有限公司是经中国证监会批准，于 2004 年 11 月 18 日成立的合资基金管理公司，注册资本为 2 亿元人民币。目前的股东构成为华泰证券股份有限公司、柏瑞投资有限责任公司（原 AIGGIC）和苏州新区高新技术产业股份有限公司，出资比例分别为 49%、49%和 2%。目前公司旗下管理华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金、华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金、上证红利交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金、华泰柏瑞货币市场证券投资基金、华泰柏瑞行业领先混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化先行混合型证券投资基金、华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金、上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金、华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金、华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金、华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金、华泰柏瑞丰汇债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金、华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金、华泰柏瑞交易型货币市场基金、华泰柏瑞激励动力灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化对冲稳健收益定期开放混合型发起式证券投资基金、华泰柏瑞天添宝货币市场基金、华泰柏瑞多策略灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞新经济沪港深灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞享利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化创优灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞生物医药灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞富利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞港股通量化灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞战略新兴产业混合型证券投资基金、华泰柏瑞新金融地产灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国

际通交易型开放式指数基金、华泰柏瑞医疗健康混合型证券投资基金、华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通指数基金联接基金、华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞量化明选混合型证券投资基金、华泰柏瑞基本面智选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞锦泰一年定期开放债券型证券投资基金、华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞益通三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、华泰柏瑞研究精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞景气回报一年持有期混合型证券投资基金、华泰柏瑞锦兴 39 个月定期开放债券型证券投资基金、华泰柏瑞锦瑞债券型证券投资基金、华泰柏瑞益商一年定期开放债券型发起式证券投资基金、华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞质量成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞行业精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞鸿利中短债债券型证券投资基金、华泰柏瑞景气优选混合型证券投资基金、华泰柏瑞品质优选混合型证券投资基金、华泰柏瑞景利混合型证券投资基金、华泰柏瑞优势领航混合型证券投资基金、华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞锦乾债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化创盈混合型证券投资基金、华泰柏瑞成长智选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞量化创享混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金。截至 2020 年 12 月 31 日，公司基金管理规模为 1622.89 亿元。

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		
张慧	投资研究部总监、本基金的基金经理	2014 年 5 月 6 日	-	13 年	经济学硕士，13 年证券从业经历。2007 年 7 月至 2010 年 6 月任国泰君安证券股份有限公司研究员。2010 年 6 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任研究员、高级研究员、基金经理助理，2013 年 9 月至 2018 年 5 月任华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金的基金经理，2014 年 5 月起任华泰柏瑞创新升级混

					<p>合型证券投资基金的基金经理。2015年2月起任华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018年1月起任投资部副总监。2018年1月至2020年8月任华泰柏瑞战略新兴产业混合型证券投资基金的基金经理。2019年3月起任投资研究部副总监。2019年11月起任华泰柏瑞研究精选混合型证券投资基金的基金经理。2019年12月起任华泰柏瑞景气回报一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。2020年1月起任投资研究部总监。2020年6月起任华泰柏瑞景气优选混合型证券投资基金的基金经理。</p>
杜聪	本基金的基金经理助理	2020年5月20日	2020年8月26日	6年	<p>复旦大学金融学硕士，曾任大成基金管理有限公司研究员。2016年7月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任投资研究部研究员、高级研究员、高级研究员兼基金经理助理。2020年8月起任华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金的基金经理。</p>

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：无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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，建立了科学完善的公平交易管理制度，从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能发生的利益输送。投资部和研究部通过规范的决策流程公平对待不同投资组合。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，对于场内交易的非组合指令启用投资管理系统中的公平交易模块；对于场外交易按照时间优先价格优先的原则公平对待不同帐户。风险管理部对报告期内的交易进行日常监控和分析评估，同时对投资组合的交易价差在不同时间窗（如日内、3日、5日）下进行分析，综合判断各基金之间是否存在不公平交易或利益输送的可能，确保公平交易的实施。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司将投资管理职能和交易执行职能完全隔离，实行集中交易制度，由交易部为公募基金、专户理财和海外投资等业务统一交易服务，为公平交易的实施提供了较好的保障。

目前公司公募基金经理有兼任私募资产管理计划投资经理的情况，兼任业务遵照相关法律法规要求进行，同时遵守公司公平交易制度。公司机构设置合理，公平交易的相关管理制度健全，投资决策流程完善，各项制度执行情况良好。交易价差分析表明公司旗下各基金均得到了公平对待，不存在非公平交易和利益输送的行为。经过对不同基金之间交易相同证券时的同向交易价差进行分析发现，报告期内基金之间的买卖交易价差总体上处于正常的合理水平。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金管理人根据《异常交易监控与管理办法》对投资交易过程中可能发生的异常交易行为进行监督和管理。投资部负责对异常交易行为进行事前识别和检查，交易部负责对异常交易行为

的事中监督和控制，风险管理部及异常交易评估小组负责异常交易行为的事后审查和评估。本报告期内，该制度执行情况良好，无论在二级市场还是在大宗交易或者一级市场申购等交易中，均没有发现影响证券价格或者严重误导其他投资者等异常交易行为。

本报告期内，本基金与公司所管理的其他投资组合参与交易所公开竞价单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的同日反向交易共 2 次，投资决策根据自下而上基本面研究成果做出，与其他组合发生反向交易，不存在利益输送行为。

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

2020 年 1 季度 A 股呈现宽幅震荡的走势，指数整体先涨后跌，3 月上旬开始出现一定程度上的回落。1 季度上证综指下跌 9.83%，沪深 300 下跌 10.02%，中证 500 下跌 4.29%，创业板指上涨 4.1%。2 季度市场基本呈现匀速上涨态势，结构性机会较多。上证指数上涨幅度较低，创业板表现相对较好。其中，沪深 300 上涨 12.96%，创业板指上涨 30.25%，中证 500 上涨 16.32%。风格上来说，消费行业整体在 2 季度的表现较为优秀，成长个股分化和波动较大。

3 季度市场整体上涨，7 月上旬市场经历快牛行情，三大指数迅速创出新高，成交额连续 17 个交易日破万亿，市场交投情绪高涨；月中中美摩擦波澜再起，叠加解禁和前期涨幅压力市场开始高位盘整，波动加剧，进入 8 月以来，外部摩擦和海外疫情恶化扰动仍存，内部受宏观流动性趋紧、中报披露、创业板注册制落地、监管层窗口指导低价股炒作等事件影响，市场情绪逐渐降温，观望情绪渐浓，A 股维持震荡调整态势，个股分化，价值表现整体优于成长。

4 季度市场出现反弹，国庆假期消费数据显示国内餐饮、旅游等服务业恢复势头较好，带动市场短期上行，但美国大选临近、海外疫情再度蔓延、欧洲重启封城，拖累全球经济复苏前景不甚明朗，市场谨慎情绪升温，股指震荡回落。进入 11 月后，随着海外美国大选落地、疫苗研发进展顺利并开始接种，国内十四五规划将出、RCEP 与中欧投资协定正式签署等利好持续释放，市场风险偏好提振并进一步强化全球经济复苏预期，市场开启跨年行情，各板块轮番表现，股指重拾升势，并相继突破前期高点。

受疫情影响和货币宽松，上半年市场风格偏向于科技成长以及医药、消费等部分必须消费品，对于金融、周期以及受疫情影响较大的线下领域表现较差。进入 3 季度，国内经济明显恢复，货币政策开始回归常态化，并提前考虑政策工具的适时退出，利率中枢较二季度明显抬升。低估值顺周期板块开始表现，上半年表现较好的医药、必选消费等疫情受益板块出现分化调整。4 季度经济复苏的内生动能持续强化，供给端也保持旺盛。12 月中央经济工作会议明确政策“不急转

弯”，市场在盈利恢复和流动性边际收紧预期之间赛跑，个股分化明显，中小市值公司出现明显调整，新能源和白酒表现突出。

本基金在报告期内保持行业及个股景气度选股的思路，上半年医药、科技、消费等高景气行业的配置比例相对较多，医药主要配置创新药、疫苗、原料药等子领域，消费主要配置食品饮料、免税、职业教育等，成长主要为光通信、苹果链和新能源汽车等。进入下半年，增持了与经济有关联的行业配置，主要是增配了工程机械、家电、保险。成长和消费方面，选择了 3、4 季度景气度上行且 21 年景气度清晰的方向。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金 A 级份额净值为 3.594 元，增长率为 61.82%，同期本基金的业绩比较基准增长率为 20.95%；本基金 C 级份额净值为 3.585 元，增长率为 9.27%，同期本基金的业绩比较基准增长率为 1.99%。

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 2021 年，我们将经历信用边际变紧和业绩持续成长的投资环境，市场可能较难复制 2020 年的收益情况，估值高企和交易拥挤使得波动率较以往可能加大。所幸的是，我们看到很多领域的产业周期正处于景气上行阶段，并不依赖对总量经济的增长有过强的假设。政治局会议给出“不急转弯”的政策指引，使得政策环境不会出现类似 18 年那样的剧烈变化，因此结构性机会依然可为，但持续性相较过去两年可能会有所下降。

经济增长方面，由于去年 1 季度疫情影响，上市公司盈利基数较低，1 季度全 A 盈利增速还会有一定程度的加速。2 季度开始，由于基数抬升，全 A 盈利增速可能逐季度回落，预计市场分化将进一步加大。

在当前估值环境下，我们对国内外流动性环境的变化对投资可能带来的风险会保持持续关注。我们看到，在国内流动性环境边际收紧之后，个股的分化愈发剧烈。相较于国内流动性的变化，更值得关注的是全球贴现率的上行以及全球“疫情拐点”之后政策收缩预期对市场和风格的影响。

如果我们将全球资产贴现率的上行分为预期阶段、经济恢复推升阶段和政策收紧推升阶段这三个阶段，那么当前可能还处于预期阶段。今年最大的宏观变化来自海外经济有望重复 20 年 2、3 季度中国经济曾经历的过程。从一个较长时间维度来看，贴现率的上行过程是方向确定但节奏不确定。当进入第二阶段之后，市场的波动和投资风格均可能发生较大的变化，我们将审慎应对。

操作上，我们以景气资产+长赛道核心资产为现阶段主要配置，注重业绩的成长性和确定性。其中，底仓结构为长赛道核心资产和金融，消费部分主要持有白酒，医药部分主要以 CXO 和服务型公司为主，金融主要持有银行。景气资产中，成长方向看好新能源汽车，周期方向以化工等海

外复苏受益资产为主。我们将保持对持仓个股业绩趋势的持续跟踪，并根据海外复苏情况对组合结构做进一步的优化调整。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2020 年度，本基金管理人在为基金份额持有人谋求最大利益的同时，始终将合规运作、防范风险工作放在各项工作的首位。依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。公司监察部门按照规定的权限和程序，通过实时监控、现场检查、重点抽查和人员询问等方法，独立地开展基金运作和公司管理的合规性稽核，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向董事长和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

(1) 全面开展基金运作合规监察工作，确保基金投资的独立性、公平性及合法合规

主要措施有：严格执行集中交易制度，各基金相互独立，交易指令由中央交易室统一执行完成；对基金投资交易系统进行事先合规性设置，并由风险控制部门进行实时监控，杜绝出现违规行为；严格检查基金的投资决策、研究支持、交易过程是否符合规定的程序；通过以上措施，保证了投资运作遵循投资决策程序与业务流程，保证了基金投资组合符合相关法规及基金合同规定，确保了基金投资行为的独立、公平及合法合规。

(2) 开展定期和专项监察稽核工作，确保各项业务活动的合法合规

本年度公司监察稽核部门开展了对公司基金投资、研究、销售、后台运营、反洗钱等方面的专项监察稽核活动。对稽核中发现问题及时发出合规提示函，要求相关部门限期整改，并对改进情况安排后续跟踪检查，确保各项业务开展合法合规。

(3) 促进公司各项内部管理制度的完善

按照相关法规、证监会等监管机关的相关规定和公司业务的发展的要求，公司法律监察部门及时要求各部门制订或修改相应制度，促进公司各项内部管理制度的进一步完善。

(4) 通过各种合规培训提高员工合规意识

本年度公司监察稽核部门通过对公司所有新入职员工进行入职前合规培训、对全体人员开展行为规范培训、对基金投资管理人员进行专项合规培训、对员工进行反洗钱培训等，有效提高了公司员工的合规意识。

通过以上工作的开展，在本报告期内本基金运作过程中未发生违规情形，基金运作整体合法合规。在今后的工作中，本基金管理人承诺将一如既往的本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，为基金持有

人谋求最大利益。

4.7 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、金融工程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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定，在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至多 12 次；每次基金收益分配比例不得低于收益分配基准日可供分配利润的 25%；基金的收益分配比例以收益分配基准日可供分配利润为基准计算，收益分配基准日可供分配利润以收益分配基准日资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数为准。基金合同生效不满 3 个月，收益可不分配。本基金本报告期内未进行利润分配。

4.9 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

注：无。

§ 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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《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有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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，本托管人根据《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，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本基金本报告期内未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2021)第 22576 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金(以下简称“华泰柏瑞创新升级混合基金”)的财务报表,包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表,2020 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了华泰柏瑞创新升级混合基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于华泰柏瑞创新升级混合基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>华泰柏瑞创新升级混合基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估华泰柏瑞创新升级</p>

	<p>混合基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算华泰柏瑞创新升级混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督华泰柏瑞创新升级混合基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对华泰柏瑞创新升级混合</p>

	<p>基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致华泰柏瑞创新升级混合基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	张炯 朱宏宇
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2021 年 3 月 29 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金

报告截止日：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	192,377,474.50	206,387,474.61
结算备付金		8,610,501.53	9,180,324.00
存出保证金		840,761.90	860,366.47
交易性金融资产	7.4.7.2	3,651,433,174.86	1,563,677,952.56
其中：股票投资		3,540,635,174.86	1,563,677,952.56
基金投资		-	-
债券投资		110,798,000.00	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		25,321,306.13	21,090,148.80
应收利息	7.4.7.5	4,206,001.12	50,051.70
应收股利		-	-
应收申购款		8,014,236.08	1,868,269.27
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		3,890,803,456.12	1,803,114,587.41
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		30,141,920.49	32,285,566.39
应付赎回款		5,198,847.20	4,133,171.05
应付管理人报酬		4,467,969.08	2,401,372.28
应付托管费		744,661.51	400,228.73
应付销售服务费		2,077.51	-
应付交易费用	7.4.7.7	7,170,828.68	2,832,120.85
应交税费		-	-
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	228,273.19	185,941.34
负债合计		47,954,577.66	42,238,400.64
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	1,069,256,166.56	793,003,758.59
未分配利润	7.4.7.10	2,773,592,711.90	967,872,428.18
所有者权益合计		3,842,848,878.46	1,760,876,186.77
负债和所有者权益总计		3,890,803,456.12	1,803,114,587.41

注：报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额总额 1,069,256,166.56 份，其中 A 类基金份额净值 3.594 元，A 类基金份额 1,067,262,094.56 份；C 类基金份额净值 3.585 元，C 类基金份额 1,994,072.00 份。

7.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
一、收入		1,384,347,556.99	381,969,727.82
1.利息收入		1,590,542.54	1,033,217.52
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,527,640.77	1,014,516.66
债券利息收入		62,901.77	1.34
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	18,699.52
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		941,230,005.96	234,903,549.02
其中：股票投资收益	7.4.7.12	926,764,112.96	226,166,552.40
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	607,522.85	371.88
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	13,858,370.15	8,736,624.74
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	436,806,250.19	143,921,193.87
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	4,720,758.30	2,111,767.41

列)			
减：二、费用		85,474,720.92	34,161,845.68
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	39,707,691.49	15,941,187.09
2. 托管费	7.4.10.2.2	6,617,948.45	2,656,864.61
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	5,152.27	-
4. 交易费用	7.4.7.19	38,854,879.53	15,327,427.55
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		1.53	-
7. 其他费用	7.4.7.20	289,047.65	236,366.43
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,298,872,836.07	347,807,882.14
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,298,872,836.07	347,807,882.14

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	793,003,758.59	967,872,428.18	1,760,876,186.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,298,872,836.07	1,298,872,836.07
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	276,252,407.97	506,847,447.65	783,099,855.62
其中：1. 基金申购款	1,008,036,136.03	1,824,232,086.09	2,832,268,222.12
2. 基金赎回款	-731,783,728.06	-1,317,384,638.44	-2,049,168,366.50
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基	1,069,256,166.56	2,773,592,711.90	3,842,848,878.46

项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
	金净值)		
一、期初所有者权益（基金净值）	409,266,487.39	364,092,435.49	773,358,922.88
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	347,807,882.14	347,807,882.14
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	383,737,271.20	551,744,242.24	935,481,513.44
其中：1. 基金申购款	729,508,772.75	995,852,231.34	1,725,361,004.09
2. 基金赎回款	-345,771,501.55	-444,107,989.10	-789,879,490.65
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-295,772,131.69	-295,772,131.69
五、期末所有者权益（基金净值）	793,003,758.59	967,872,428.18	1,760,876,186.77

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

 韩勇 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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞创新升级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[2014]88号《关于核准华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金募集的批复》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《华泰柏瑞创新升级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267,666,871.23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(2014)第224号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金基金合同》于2014年5月6日正式生效,

基金合同生效日的基金份额总额为 267,739,518.28 份基金份额，其中认购资金利息折合 72,647.05 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，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金增加 C 类份额并修改基金合同和托管协议的公告》，本基金自 2020 年 8 月 20 日起增加收取销售服务费的 C 类份额，并对本基金的基金合同、托管协议作相应修改。在本基金增加收取销售服务费的 C 类份额后，原有的基金份额全部自动划归为本基金 A 类份额。对投资者申购时收取申购费用，赎回时收取赎回费用，且不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；对投资者申购时不收取申购费用，但在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基金份额，称为 C 类基金份额。本基金增加 C 类基金份额后，将分别设置对应的基金代码并分别计算基金份额净值。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞创新升级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，包括国内依法发行上市的股票、存托凭证、债券、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（须符合中国证监会相关规定）。本基金持有的股票及存托凭证占基金资产的比例为 30%-95%，其中投资于创新升级主题相关的上市公司股票不低于非现金基金资产的 80%；债券、权证、货币市场工具以及证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为 5%-70%，其中，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金后，本基金保持不低于基金资产净值 5%的现金（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 1 年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为中证 TMT 产业主题指数收益率×20%+中证新兴产业指数收益率×40%+中债总指数（全价）收益率×40%。

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 2021 年 3 月 29 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华泰柏瑞创新升级混合型证券

投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年度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 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息

支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则

按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分(包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等)为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分相抵未实现部分后的余额)。经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估

值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税

试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

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

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
活期存款	192,377,474.50	206,387,474.61
定期存款	-	-
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	-	-
合计：	192,377,474.50	206,387,474.61

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	2,965,972,303.18	3,540,635,174.86	574,662,871.68	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	1,000.00	1,000.00	
	银行间市场	110,759,800.00	110,797,000.00	37,200.00
	合计	110,760,800.00	110,798,000.00	37,200.00
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	3,076,733,103.18	3,651,433,174.86	574,700,071.68	
项目	上年度末 2019 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	1,425,784,131.07	1,563,677,952.56	137,893,821.49	
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	1,425,784,131.07	1,563,677,952.56	137,893,821.49

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：截至本报告期末及上年度末，本基金未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
应收活期存款利息	40,309.32	45,057.89
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	4,277.95	4,567.89
应收债券利息	4,160,997.61	-
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	416.24	425.92
合计	4,206,001.12	50,051.70

7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
交易所市场应付交易费用	7,170,103.68	2,832,120.85
银行间市场应付交易费用	725.00	-

合计	7,170,828.68	2,832,120.85
----	--------------	--------------

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	8,273.19	5,941.34
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	220,000.00	180,000.00
合计	228,273.19	185,941.34

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

华泰柏瑞创新升级混合 A		
项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	793,003,758.59	793,003,758.59
本期申购	1,005,481,940.33	1,005,481,940.33
本期赎回（以“-”号填列）	-731,223,604.36	-731,223,604.36
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,067,262,094.56	1,067,262,094.56

金额单位：人民币元

华泰柏瑞创新升级混合 C		
项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	2,554,195.70	2,554,195.70
本期赎回（以“-”号填列）	-560,123.70	-560,123.70
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-

本期末	1,994,072.00	1,994,072.00
-----	--------------	--------------

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

华泰柏瑞创新升级混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	649,713,122.81	318,159,305.37	967,872,428.18
本期利润	861,985,483.62	436,524,073.74	1,298,509,557.36
本期基金份额交易产生的变动数	348,770,677.49	153,285,569.59	502,056,247.08
其中：基金申购款	1,227,963,274.54	590,174,562.15	1,818,137,836.69
基金赎回款	-879,192,597.05	-436,888,992.56	-1,316,081,589.61
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,860,469,283.92	907,968,948.70	2,768,438,232.62

单位：人民币元

华泰柏瑞创新升级混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	81,102.26	282,176.45	363,278.71
本期基金份额交易产生的变动数	4,778,508.30	12,692.27	4,791,200.57
其中：基金申购款	6,098,524.24	-4,274.84	6,094,249.40
基金赎回款	-1,320,015.94	16,967.11	-1,303,048.83
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,859,610.56	294,868.72	5,154,479.28

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
活期存款利息收入	1,365,842.07	922,011.21
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	148,993.94	74,666.09
其他	12,804.76	17,839.36
合计	1,527,640.77	1,014,516.66

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020 年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019 年12月31日
卖出股票成交总额	12,627,180,173.79	4,873,162,337.92
减：卖出股票成本总额	11,700,416,060.83	4,646,995,785.52
买卖股票差价收入	926,764,112.96	226,166,552.40

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020 年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	607,522.85	371.88
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	607,522.85	371.88

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020 年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	2,228,259.61	4,073.22
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,620,300.00	3,700.00
减：应收利息总额	436.76	1.34
买卖债券差价收入	607,522.85	371.88

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间无债券赎回差价收入。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间无债券申购差价收入。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间未投资资产支持证券。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期及上年度可比期间未投资贵金属。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间未投资贵金属。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间未投资贵金属。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间未投资贵金属。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
股票投资产生的股利收益	13,858,370.15	8,736,624.74
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	13,858,370.15	8,736,624.74

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020 年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31日
1. 交易性金融资产	436,806,250.19	143,921,193.87
——股票投资	436,769,050.19	143,921,193.87
——债券投资	37,200.00	-
——资产支持证券投资	-	-
——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	436,806,250.19	143,921,193.87

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12 月31日
基金赎回费收入	4,613,413.26	2,086,808.15
转换费收入	107,345.04	24,959.26
合计	4,720,758.30	2,111,767.41

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。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12 月31日
交易所市场交易费用	38,854,154.53	15,327,427.55
银行间市场交易费用	725.00	-
交易基金产生的费用	-	-

其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	38,854,879.53	15,327,427.55

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020 年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31日
审计费用	100,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行划款手续费	51,047.65	38,366.43
银行间账户服务费	18,000.00	18,000.00
合计	289,047.65	236,366.43

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

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
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金销售机构
华泰证券股份有限公司（“华泰证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
华泰联合证券有限责任公司（“华泰联合证券”）	基金管理人的股东华泰证券的控股子公司
PineBridge Investment LLC	基金管理人的股东
苏州新区高新技术产业股份有限公司	基金管理人的股东
柏瑞爱建资产管理（上海）有限公司	基金管理人的控股子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31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
华泰证券股份有 限公司	-	-	97,142,839.91	0.95%

7.4.10.1.2 权证交易

注：本报告期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31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
华泰证券股份有 限公司	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31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
华泰证券股份有 限公司	88,526.56	0.93%	-	-

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. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	39,707,691.49	15,941,187.09
其中：支付销售机构的客户维护费	2,626,863.84	1,469,713.55

注：支付基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5%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×1.5% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	6,617,948.45	2,656,864.61

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%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×0.25% / 当年天数。

7.4.10.2.3 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		
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰柏瑞创新升级混合 A	华泰柏瑞创新升级混合 C	合计
华泰柏瑞基金管理有限公司	0.00	5.51	5.51
合计	0.00	5.51	5.51
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		

	华泰柏瑞创新升级 混合 A	华泰柏瑞创新升级 混合 C	合计
华泰柏瑞基金管理有限 公司	-	-	-
合计	-	-	-

注：自 2020 年 8 月 19 日起，支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.80% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给华泰柏瑞基金，再由华泰柏瑞基金计算并支付给各基金销售机构。A 类基金份额不收取销售服务费。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 C 类基金份额的基金资产净值 X 0.80% / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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：无。

7.4.10.4.2 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：无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 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，基金管理人未投资本基金。

7.4.10.5.2 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。

7.4.10.6 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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	192,377,474.50	1,365,842.07	206,387,474.61	922,011.21

限公司				
-----	--	--	--	--

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2020年1月1日至2020年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：份）	总金额
华泰联合证券	300919	中伟股份	网下申购	6,093	149,887.80
华泰联合证券	300907	康平科技	网下申购	4,724	67,553.20
上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：份）	总金额
华泰联合证券	-	-	-	-	-

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

注：本基金本报告期及上年度可比期间无其他需要说明的关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2020年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300860	锋尚文化	2020年8月6日	2021年2月24日	新股锁定期内	138.02	126.67	381	52,585.62	48,261.27	-
300861	美畅股份	2020年8月6日	2021年2月24日	新股锁定期内	43.76	51.10	895	39,165.20	45,734.50	-
300867	圣元	2020年	2021	新股锁	19.34	31.97	1,498	28,971.32	47,891.06	-

	环保	8月12日	2021年3月3日	定期内							
300870	欧陆通	2020年8月13日	2021年2月24日	新股锁定期内	36.81	65.67	478	17,595.18	31,390.26	-	
300879	大叶股份	2020年8月25日	2021年3月1日	新股锁定期内	10.58	27.12	466	4,930.28	12,637.92	-	
300882	万胜智能	2020年8月27日	2021年3月10日	新股锁定期内	10.33	25.79	440	4,545.20	11,347.60	-	
300884	狄耐克	2020年11月5日	2021年5月12日	新股锁定期内	24.87	33.51	499	12,410.13	16,721.49	-	
300886	华业香料	2020年9月8日	2021年3月16日	新股锁定期内	18.59	45.67	147	2,732.73	6,713.49	-	
300889	爱克股份	2020年9月9日	2021年3月16日	新股锁定期内	27.97	30.12	479	13,397.63	14,427.48	-	
300890	翔丰华	2020年9月10日	2021年3月18日	新股锁定期内	14.69	48.85	286	4,201.34	13,971.10	-	
300891	惠云钛业	2020年9月10日	2021年3月17日	新股锁定期内	3.64	16.40	1,143	4,160.52	18,745.20	-	
300893	松原股份	2020年9月17日	2021年3月24日	新股锁定期内	13.47	35.08	276	3,717.72	9,682.08	-	
300895	铜牛信息	2020年9月17日	2021年3月24日	新股锁定期内	12.65	45.30	283	3,579.95	12,819.90	-	
300898	熊猫乳品	2020年10月9日	2021年4月16日	新股锁定期内	10.78	33.03	496	5,346.88	16,382.88	-	
300907	康平科技	2020年11月11日	2021年5月18日	新股锁定期内	14.30	26.85	473	6,763.90	12,700.05	-	
300908	仲景食品	2020年11月13日	2021年5月24日	新股锁定期内	39.74	60.44	285	11,325.90	17,225.40	-	
300910	瑞丰新材	2020年11月20日	2021年5月27日	新股锁定期内	30.26	47.87	474	14,343.24	22,690.38	-	

300911	亿田智能	2020年11月24日	2021年6月3日	新股锁定期内	24.35	33.06	309	7,524.15	10,215.54	-
300917	特发服务	2020年12月14日	2021年6月21日	新股锁定期内	18.78	31.94	281	5,277.18	8,975.14	-
300918	南山智尚	2020年12月15日	2021年6月22日	新股锁定期内	4.97	8.94	1,063	5,283.11	9,503.22	-
300919	中伟股份	2020年12月15日	2021年6月23日	新股锁定期内	24.60	61.51	610	15,006.00	37,521.10	-
300922	天秦装备	2020年12月18日	2021年6月25日	新股锁定期内	16.05	31.58	287	4,606.35	9,063.46	-
300925	法本信息	2020年12月21日	2021年6月30日	新股锁定期内	20.08	37.33	353	7,088.24	13,177.49	-
688095	福昕软件	2020年9月1日	2021年3月8日	新股锁定期内	238.53	228.79	1,981	472,527.93	453,232.99	-
688229	博睿数据	2020年8月7日	2021年2月18日	新股锁定期内	65.82	101.25	1,643	108,142.26	166,353.75	-
688550	瑞联新材	2020年8月24日	2021年3月2日	新股锁定期内	113.72	84.08	2,539	288,735.08	213,479.12	-
688569	铁科轨道	2020年8月21日	2021年3月1日	新股锁定期内	22.46	20.10	6,841	153,648.86	137,504.10	-
688679	通源环境	2020年12月16日	2021年6月25日	新股锁定期内	12.05	13.49	3,139	37,824.95	42,345.11	-
003030	祖名股份	2020年12月25日	2021年1月6日	新股未上市	15.18	15.18	480	7,286.40	7,286.40	-
003031	中瓷电子	2020年12月24日	2021年1月4日	新股未上市	15.27	15.27	387	5,909.49	5,909.49	-
300926	博俊科技	2020年12月29日	2021年1月7日	新股未上市	10.76	10.76	3,584	38,563.84	38,563.84	-
688617	惠泰医疗	2020年12月30日	2021年1月	新股未上市	74.46	74.46	1,673	124,571.58	124,571.58	-

		日	7 日							
605277	新亚电子	2020 年 12 月 25 日	2021 年 1 月 6 日	新股未上市	16.95	16.95	507	8,593.65	8,593.65	-

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113616	韦尔转债	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 22 日	配债未上市	100.00	100.00	10	1,000.00	1,000.00	-

注：1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

2、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

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

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌的股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末没有在银行间市场债券正回购交易中抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：本基金本报告期末没有在交易所市场债券正回购交易中抵押的债券。

7.4.12.4 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的出借业务。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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，为证券投资基金中的中高风险、中高收益品种。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。

7.4.13.2 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约责任，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中国银行，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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	1,000.00	0.00
未评级	110,797,000.00	0.00
合计	110,798,000.00	0.00

注：未评级的债券包括政策性金融债。债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

7.4.13.3 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 2020 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合同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(所有者权益)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。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

7.4.13.3.2 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。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

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 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 0.04%

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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金和债券投资等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 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							
银行存款	192,377,474.50	-	-	-	-	-	192,377,474.50
结算备付金	8,610,501.53	-	-	-	-	-	8,610,501.53
存出保证金	840,761.90	-	-	-	-	-	840,761.90
交易性金融 资产	-	-	110,797,000.00	-	1,000.00	3,540,635,174.86	3,651,433,174.86
应收证券清 算款	-	-	-	-	-	25,321,306.13	25,321,306.13
应收利息	-	-	-	-	-	4,206,001.12	4,206,001.12
应收申购款	-	-	-	-	-	8,014,236.08	8,014,236.08
资产总计	201,828,737.93	-	110,797,000.00	-	1,000.00	3,578,176,718.19	3,890,803,456.12
负债							
应付证券清 算款	-	-	-	-	-	30,141,920.49	30,141,920.49
应付赎回款	-	-	-	-	-	5,198,847.20	5,198,847.20
应付管理人 报酬	-	-	-	-	-	4,467,969.08	4,467,969.08
应付托管费	-	-	-	-	-	744,661.51	744,661.51
应付销售服 务费	-	-	-	-	-	2,077.51	2,077.51
应付交易费 用	-	-	-	-	-	7,170,828.68	7,170,828.68
其他负债	-	-	-	-	-	228,273.19	228,273.19
负债总计	-	-	-	-	-	47,954,577.66	47,954,577.66
利率敏感度 缺口	201,828,737.93	-	110,797,000.00	-	1,000.00	3,530,222,140.53	3,842,848,878.46
上年度末 2019 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							
银行存款	206,387,474.61	-	-	-	-	-	206,387,474.61
结算备付金	9,180,324.00	-	-	-	-	-	9,180,324.00
存出保证金	860,366.47	-	-	-	-	-	860,366.47

交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,563,677,952.56	1,563,677,952.56
应收证券清算款	-	-	-	-	-	21,090,148.80	21,090,148.80
应收利息	-	-	-	-	-	50,051.70	50,051.70
应收申购款	-	-	-	-	-	1,868,269.27	1,868,269.27
资产总计	216,428,165.08	-	-	-	-	1,586,686,422.33	1,803,114,587.41
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	32,285,566.39	32,285,566.39
应付赎回款	-	-	-	-	-	4,133,171.05	4,133,171.05
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,401,372.28	2,401,372.28
应付托管费	-	-	-	-	-	400,228.73	400,228.73
应付交易费用	-	-	-	-	-	2,832,120.85	2,832,120.85
其他负债	-	-	-	-	-	185,941.34	185,941.34
负债总计	-	-	-	-	-	42,238,400.64	42,238,400.64
利率敏感度缺口	216,428,165.08	-	-	-	-	1,544,448,021.69	1,760,876,186.77

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 2.88% (2019 年 12 月 31 日：无)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2019 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，将采取“自上而下”和“自下而上”相结合的方法，深入挖掘在中国经济结构调整和产业升级过程中出现的主题投资机会。持续跟踪国家政策、产业发展趋势、技术、工艺、商业模式的最新变化，对创新和转型升级主题相关行业的范围进行动态调整。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金持有的股票及存托凭证占基金资产的比例为 30%-95%，其中投资于创新升级主题相关的上市公司股票不低于非现金基金资产的 80%；债券、权证、货币市场工具以及证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为 5%-70%。其中，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金后，本基金保持不低于基金资产净值 5% 的现金(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 1 年以内的政府债券。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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日		上年度末 2019 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	3,540,635,174.86	92.14	1,563,677,952.56	88.80
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
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	3,540,635,174.86	92.14	1,563,677,952.56	88.80

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证 500 指数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（2020 年 12 月 31 日）	上年度末（2019 年 12 月 31 日）
	中证 500 指数上升 5%	156,703,239.49	66,938,707.36
	中证 500 指数下降 5%	-156,703,239.49	-66,938,707.36

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 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。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 3,538,989,536.82 元，属于第二层次的余额为 112,443,638.04 元，无属于第三层次的余额(2019 年 12 月 31 日：第一层次 1,502,779,301.02 元，第二层次 60,898,651.54 元，无第三层次)。

(ii) 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公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2020 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2019 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	3,540,635,174.86	91.00
	其中：股票	3,540,635,174.86	91.00
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	110,798,000.00	2.85
	其中：债券	110,798,000.00	2.85
	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	200,987,976.03	5.17
8	其他各项资产	38,382,305.23	0.99
9	合计	3,890,803,456.12	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	75,866.40	0.00
B	采矿业	512,703.09	0.01
C	制造业	2,587,233,352.74	67.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	102,972.72	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	410,274.31	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	61,761.00	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	44,071,365.69	1.15
J	金融业	149,678,747.66	3.89
K	房地产业	271,556.76	0.01
L	租赁和商务服务业	126,994,779.03	3.30
M	科学研究和技术服务业	94,891,931.47	2.47

N	水利、环境和公共设施管理业	90,236.17	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	143,166,167.25	3.73
Q	卫生和社会工作	392,953,134.30	10.23
R	文化、体育和娱乐业	120,326.27	0.00
S	综合	-	-
	合计	3,540,635,174.86	92.14

8.2.2 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股票。

8.3 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	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	177,879	355,402,242.00	9.25
2	000858	五粮液	983,084	286,913,065.40	7.47
3	300015	爱尔眼科	3,150,450	235,937,200.50	6.14
4	002050	三花智控	8,406,699	207,225,130.35	5.39
5	601100	恒立液压	1,809,236	204,443,668.00	5.32
6	000333	美的集团	1,939,595	190,933,731.80	4.97
7	002179	中航光电	2,091,060	163,709,087.40	4.26
8	600276	恒瑞医药	1,338,288	149,165,580.48	3.88
9	002607	中公教育	4,075,325	143,166,167.25	3.73
10	601888	中国中免	449,543	126,973,420.35	3.30
11	002460	赣锋锂业	1,181,976	119,615,971.20	3.11
12	002304	洋河股份	496,359	117,135,760.41	3.05
13	601318	中国平安	1,297,399	112,847,765.02	2.94
14	603267	鸿远电子	868,188	111,787,886.88	2.91
15	603338	浙江鼎力	982,096	99,378,294.24	2.59
16	603899	晨光文具	1,032,478	91,436,251.68	2.38
17	600763	通策医疗	288,345	79,733,159.40	2.07
18	300347	泰格医药	477,920	77,236,651.20	2.01
19	601799	星宇股份	379,100	76,009,550.00	1.98
20	603799	华友钴业	943,124	74,789,733.20	1.95
21	300750	宁德时代	207,851	72,978,564.61	1.90
22	300502	新易盛	1,314,910	72,951,206.80	1.90
23	603259	药明康德	472,645	63,674,734.40	1.66
24	002821	凯莱英	201,174	60,179,190.36	1.57

25	002025	航天电器	795,126	51,826,312.68	1.35
26	688111	金山办公	103,318	42,463,698.00	1.11
27	603288	海天味业	204,910	41,092,651.40	1.07
28	601601	中国太保	924,109	35,485,785.60	0.92
29	300394	天孚通信	590,952	31,515,470.16	0.82
30	601965	中国汽研	2,086,268	30,897,629.08	0.80
31	601012	隆基股份	10,102	931,404.40	0.02
32	600570	恒生电子	6,285	659,296.50	0.02
33	300601	康泰生物	3,700	645,650.00	0.02
34	300073	当升科技	7,948	515,427.80	0.01
35	688095	福昕软件	1,981	453,232.99	0.01
36	600036	招商银行	9,383	412,382.85	0.01
37	603939	益丰药房	4,549	410,274.31	0.01
38	300014	亿纬锂能	4,942	402,773.00	0.01
39	601088	中国神华	18,335	330,213.35	0.01
40	600600	青岛啤酒	3,138	311,917.20	0.01
41	000001	平安银行	15,042	290,912.28	0.01
42	000002	万 科 A	8,749	251,096.30	0.01
43	600305	恒顺醋业	11,254	249,163.56	0.01
44	601166	兴业银行	11,325	236,352.75	0.01
45	300059	东方财富	7,426	230,206.00	0.01
46	002938	鹏鼎控股	4,623	229,624.41	0.01
47	688558	国盛智科	8,488	226,544.72	0.01
48	601233	桐昆股份	10,845	223,298.55	0.01
49	603520	司太立	3,301	217,304.83	0.01
50	688550	瑞联新材	2,539	213,479.12	0.01
51	300124	汇川技术	2,210	206,193.00	0.01
52	000568	泸州老窖	858	194,045.28	0.01
53	603517	绝味食品	2,157	167,253.78	0.00
54	688229	博睿数据	1,643	166,353.75	0.00
55	300012	华测检测	6,047	165,506.39	0.00
56	601225	陕西煤业	17,700	165,318.00	0.00
57	300037	新宙邦	1,600	162,240.00	0.00
58	002597	金禾实业	4,667	151,350.81	0.00
59	000596	古井贡酒	530	144,160.00	0.00
60	688569	铁科轨道	6,841	137,504.10	0.00
61	600132	重庆啤酒	1,121	133,387.79	0.00
62	000786	北新建材	3,326	133,206.30	0.00
63	603688	石英股份	5,564	130,865.28	0.00

64	601689	拓普集团	3,377	129,778.11	0.00
65	688617	惠泰医疗	1,673	124,571.58	0.00
66	300595	欧普康视	1,213	99,368.96	0.00
67	603039	泛微网络	980	98,940.80	0.00
68	300759	康龙化成	800	96,320.00	0.00
69	600436	片仔癀	356	95,233.56	0.00
70	300207	欣旺达	3,100	95,201.00	0.00
71	603501	韦尔股份	402	92,902.20	0.00
72	000661	长春高新	206	92,475.46	0.00
73	002507	涪陵榨菜	2,169	91,748.70	0.00
74	000739	普洛药业	3,772	87,812.16	0.00
75	688008	澜起科技	1,050	87,024.00	0.00
76	600703	三安光电	3,100	83,731.00	0.00
77	600585	海螺水泥	1,531	79,030.22	0.00
78	002714	牧原股份	984	75,866.40	0.00
79	002078	太阳纸业	5,231	75,483.33	0.00
80	300413	芒果超媒	994	72,065.00	0.00
81	600030	中信证券	2,413	70,942.20	0.00
82	603658	安图生物	486	70,557.48	0.00
83	600885	宏发股份	1,276	69,184.72	0.00
84	600741	华域汽车	2,321	66,891.22	0.00
85	600886	国投电力	7,514	64,920.96	0.00
86	600031	三一重工	1,825	63,838.50	0.00
87	002705	新宝股份	1,500	63,375.00	0.00
88	002311	海大集团	947	62,028.50	0.00
89	002352	顺丰控股	700	61,761.00	0.00
90	002594	比亚迪	300	58,290.00	0.00
91	603127	昭衍新药	560	57,741.60	0.00
92	002648	卫星石化	2,206	57,620.72	0.00
93	600837	海通证券	4,260	54,783.60	0.00
94	300760	迈瑞医疗	126	53,676.00	0.00
95	600529	山东药玻	1,045	52,406.75	0.00
96	002384	东山精密	1,929	50,154.00	0.00
97	002142	宁波银行	1,404	49,617.36	0.00
98	600298	安琪酵母	971	49,588.97	0.00
99	600588	用友网络	1,120	49,134.40	0.00
100	300860	锋尚文化	381	48,261.27	0.00
101	600309	万华化学	530	48,251.20	0.00
102	300867	圣元环保	1,498	47,891.06	0.00

103	002410	广联达	588	46,299.12	0.00
104	603882	金域医学	360	46,123.20	0.00
105	300861	美畅股份	895	45,734.50	0.00
106	002791	坚朗五金	300	43,200.00	0.00
107	688679	通源环境	3,139	42,345.11	0.00
108	000902	新洋丰	2,612	41,792.00	0.00
109	600872	中炬高新	622	41,456.30	0.00
110	300496	中科创达	348	40,716.00	0.00
111	603605	珀莱雅	227	40,406.00	0.00
112	300926	博俊科技	3,584	38,563.84	0.00
113	600900	长江电力	1,986	38,051.76	0.00
114	300136	信维通信	1,048	37,602.24	0.00
115	300919	中伟股份	610	37,521.10	0.00
116	000625	长安汽车	1,686	36,889.68	0.00
117	300433	蓝思科技	1,200	36,732.00	0.00
118	002812	恩捷股份	253	35,870.34	0.00
119	002475	立讯精密	607	34,064.84	0.00
120	300253	卫宁健康	1,912	33,460.00	0.00
121	300870	欧陆通	478	31,390.26	0.00
122	002032	苏泊尔	385	30,026.15	0.00
123	002241	歌尔股份	796	29,706.72	0.00
124	000651	格力电器	441	27,315.54	0.00
125	600720	祁连山	1,984	26,942.72	0.00
126	600161	天坛生物	619	25,812.30	0.00
127	300725	药石科技	185	25,530.00	0.00
128	300910	瑞丰新材	474	22,690.38	0.00
129	003026	中晶科技	461	21,740.76	0.00
130	002027	分众传媒	2,164	21,358.68	0.00
131	300891	惠云钛业	1,143	18,745.20	0.00
132	003029	吉大正元	716	18,716.24	0.00
133	003028	振邦智能	432	18,010.08	0.00
134	300908	仲景食品	285	17,225.40	0.00
135	600547	山东黄金	727	17,171.74	0.00
136	300884	狄耐克	499	16,721.49	0.00
137	605179	一鸣食品	939	16,582.74	0.00
138	600104	上汽集团	675	16,497.00	0.00
139	300898	熊猫乳品	496	16,382.88	0.00
140	600845	宝信软件	225	15,520.50	0.00
141	605377	华旺科技	750	14,977.50	0.00

142	300889	爱克股份	479	14,427.48	0.00
143	300890	翔丰华	286	13,971.10	0.00
144	300925	法本信息	353	13,177.49	0.00
145	300895	铜牛信息	283	12,819.90	0.00
146	300907	康平科技	473	12,700.05	0.00
147	300879	大叶股份	466	12,637.92	0.00
148	600048	保利地产	726	11,485.32	0.00
149	300882	万胜智能	440	11,347.60	0.00
150	300567	精测电子	206	11,317.64	0.00
151	603659	璞泰来	100	11,239.00	0.00
152	300911	亿田智能	309	10,215.54	0.00
153	688029	南微医学	54	9,936.54	0.00
154	300893	松原股份	276	9,682.08	0.00
155	300918	南山智尚	1,063	9,503.22	0.00
156	300922	天秦装备	287	9,063.46	0.00
157	300917	特发服务	281	8,975.14	0.00
158	605277	新亚电子	507	8,593.65	0.00
159	003030	祖名股份	480	7,286.40	0.00
160	300886	华业香料	147	6,713.49	0.00
161	603369	今世缘	110	6,311.80	0.00
162	003031	中瓷电子	387	5,909.49	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	000333	美的集团	576,439,312.12	32.74
2	601318	中国平安	485,593,190.80	27.58
3	600276	恒瑞医药	456,985,362.43	25.95
4	300750	宁德时代	404,767,216.50	22.99
5	000858	五粮液	388,108,326.12	22.04
6	601888	中国中免	367,254,617.06	20.86
7	600519	贵州茅台	350,583,888.60	19.91
8	300015	爱尔眼科	305,972,226.43	17.38
9	601012	隆基股份	282,036,850.67	16.02
10	600570	恒生电子	259,264,343.86	14.72

11	300433	蓝思科技	247,590,183.10	14.06
12	600036	招商银行	238,821,098.99	13.56
13	002607	中公教育	220,139,271.04	12.50
14	002050	三花智控	210,399,313.26	11.95
15	300502	新易盛	208,761,286.75	11.86
16	603338	浙江鼎力	207,196,458.33	11.77
17	000001	平安银行	205,781,902.08	11.69
18	002821	凯莱英	195,215,944.07	11.09
19	300601	康泰生物	184,540,666.35	10.48
20	601088	中国神华	182,149,816.92	10.34
21	600436	片仔癀	179,663,605.89	10.20
22	601100	恒立液压	171,233,553.11	9.72
23	002241	歌尔股份	161,333,276.11	9.16
24	002624	完美世界	157,176,897.73	8.93
25	600585	海螺水泥	140,104,382.81	7.96
26	000739	普洛药业	137,926,538.37	7.83
27	600183	生益科技	133,417,281.14	7.58
28	002384	东山精密	133,182,522.28	7.56
29	601601	中国太保	132,387,328.97	7.52
30	002475	立讯精密	132,229,016.45	7.51
31	000002	万科A	131,664,758.70	7.48
32	600529	山东药玻	130,675,128.92	7.42
33	002179	中航光电	130,601,289.78	7.42
34	603939	益丰药房	124,085,985.55	7.05
35	600031	三一重工	122,525,482.62	6.96
36	002555	三七互娱	121,839,140.04	6.92
37	601628	中国人寿	121,328,897.34	6.89
38	002460	赣锋锂业	119,171,283.56	6.77
39	002311	海大集团	112,714,177.92	6.40
40	600521	华海药业	108,264,916.88	6.15
41	300144	宋城演艺	107,288,453.61	6.09
42	001914	招商积余	105,902,440.27	6.01
43	600872	中炬高新	105,788,884.75	6.01
44	300347	泰格医药	105,781,963.78	6.01
45	601336	新华保险	103,856,393.12	5.90
46	603799	华友钴业	102,477,061.79	5.82

47	300059	东方财富	102,381,548.44	5.81
48	000063	中兴通讯	102,164,183.41	5.80
49	601398	工商银行	101,773,725.23	5.78
50	002027	分众传媒	98,784,442.09	5.61
51	688008	澜起科技	97,806,311.97	5.55
52	603267	鸿远电子	95,063,526.86	5.40
53	603259	药明康德	93,080,783.69	5.29
54	300124	汇川技术	92,636,486.56	5.26
55	002304	洋河股份	92,266,155.57	5.24
56	002938	鹏鼎控股	88,646,583.14	5.03
57	002185	华天科技	87,938,840.11	4.99
58	300413	芒果超媒	87,869,992.85	4.99
59	601799	星宇股份	86,933,576.09	4.94
60	600305	恒顺醋业	81,462,077.99	4.63
61	603816	顾家家居	77,691,283.04	4.41
62	603658	安图生物	76,743,704.52	4.36
63	600885	宏发股份	76,689,696.42	4.36
64	688981	中芯国际	76,589,919.83	4.35
65	600763	通策医疗	75,187,369.71	4.27
66	300012	华测检测	73,510,589.98	4.17
67	600703	三安光电	71,951,342.67	4.09
68	603899	晨光文具	70,633,457.78	4.01
69	300122	智飞生物	70,606,506.70	4.01
70	688111	金山办公	66,152,023.65	3.76
71	603688	石英股份	65,366,327.55	3.71
72	002174	游族网络	64,570,814.19	3.67
73	603520	司太立	63,017,286.40	3.58
74	300529	健帆生物	62,353,104.91	3.54
75	300394	天孚通信	61,816,697.34	3.51
76	600741	华域汽车	61,543,541.94	3.50
77	600298	安琪酵母	59,066,104.09	3.35
78	300590	移为通信	58,082,991.90	3.30
79	002912	中新赛克	56,447,945.43	3.21
80	002043	兔宝宝	56,369,662.43	3.20
81	002714	牧原股份	56,019,689.72	3.18
82	601689	拓普集团	50,355,611.57	2.86

83	603882	金域医学	49,810,555.30	2.83
84	603369	今世缘	46,993,035.96	2.67
85	601965	中国汽研	46,440,129.70	2.64
86	603700	宁水集团	46,396,924.17	2.63
87	002352	顺丰控股	46,031,077.20	2.61
88	603806	福斯特	45,372,654.52	2.58
89	000725	京东方 A	44,535,282.80	2.53
90	002025	航天电器	44,304,283.02	2.52
91	000661	长春高新	43,240,973.75	2.46
92	600556	天下秀	42,283,725.82	2.40
93	603288	海天味业	40,957,441.53	2.33
94	000568	泸州老窖	37,531,805.74	2.13
95	300073	当升科技	35,589,518.87	2.02

注：不考虑相关交易费用。

8.4.2 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	601318	中国平安	466,809,723.05	26.51
2	300433	蓝思科技	448,254,723.24	25.46
3	000333	美的集团	438,652,061.87	24.91
4	300750	宁德时代	385,399,263.02	21.89
5	601888	中国中免	354,001,402.29	20.10
6	600036	招商银行	339,151,198.54	19.26
7	600276	恒瑞医药	321,206,789.72	18.24
8	601012	隆基股份	288,702,852.14	16.40
9	600570	恒生电子	278,837,367.16	15.84
10	300601	康泰生物	258,039,238.66	14.65
11	002384	东山精密	237,334,211.21	13.48
12	000001	平安银行	214,567,214.10	12.19
13	600519	贵州茅台	205,988,665.99	11.70
14	000002	万科 A	205,575,966.98	11.67
15	600436	片仔癀	204,732,588.49	11.63
16	600585	海螺水泥	185,156,309.37	10.52
17	600529	山东药玻	176,624,849.17	10.03
18	601088	中国神华	171,856,131.10	9.76
19	300059	东方财富	169,540,871.58	9.63

20	002241	歌尔股份	165,410,980.85	9.39
21	300502	新易盛	160,672,633.02	9.12
22	002624	完美世界	152,283,949.37	8.65
23	002475	立讯精密	150,941,008.72	8.57
24	000739	普洛药业	147,103,967.65	8.35
25	002607	中公教育	146,543,680.72	8.32
26	002821	凯莱英	143,954,583.95	8.18
27	000858	五粮液	137,842,777.00	7.83
28	603882	金域医学	136,202,573.99	7.73
29	002185	华天科技	134,745,187.45	7.65
30	002555	三七互娱	132,155,290.81	7.51
31	603338	浙江鼎力	126,215,184.94	7.17
32	601628	中国人寿	124,781,176.52	7.09
33	300015	爱尔眼科	122,689,318.87	6.97
34	600031	三一重工	120,337,490.27	6.83
35	300529	健帆生物	118,168,451.52	6.71
36	000661	长春高新	117,524,537.56	6.67
37	300144	宋城演艺	116,756,685.30	6.63
38	600183	生益科技	116,272,560.40	6.60
39	603986	兆易创新	116,216,640.97	6.60
40	603939	益丰药房	114,548,994.58	6.51
41	603799	华友钴业	112,146,329.96	6.37
42	601336	新华保险	110,183,263.37	6.26
43	600872	中炬高新	106,098,907.23	6.03
44	002027	分众传媒	103,830,979.23	5.90
45	001914	招商积余	102,626,858.95	5.83
46	002311	海大集团	101,810,856.97	5.78
47	688981	中芯国际	99,155,427.44	5.63
48	300124	汇川技术	97,976,853.27	5.56
49	601601	中国太保	97,315,217.45	5.53
50	000063	中兴通讯	96,888,908.39	5.50
51	601398	工商银行	94,802,578.43	5.38
52	002938	鹏鼎控股	93,954,260.49	5.34
53	688008	澜起科技	93,929,048.48	5.33
54	600521	华海药业	93,381,362.97	5.30
55	300394	天孚通信	91,613,412.22	5.20
56	600305	恒顺醋业	90,991,741.34	5.17
57	600298	安琪酵母	85,691,412.32	4.87

58	300347	泰格医药	81,646,055.98	4.64
59	300413	芒果超媒	80,297,277.62	4.56
60	600383	金地集团	79,299,997.16	4.50
61	600703	三安光电	78,853,602.01	4.48
62	600720	祁连山	76,980,692.24	4.37
63	601166	兴业银行	76,912,259.26	4.37
64	002597	金禾实业	74,025,968.34	4.20
65	600885	宏发股份	73,947,679.77	4.20
66	603658	安图生物	71,939,741.34	4.09
67	603259	药明康德	70,966,734.66	4.03
68	300122	智飞生物	70,228,169.27	3.99
69	601100	恒立液压	69,515,410.54	3.95
70	002050	三花智控	68,767,951.21	3.91
71	300012	华测检测	67,770,509.44	3.85
72	603816	顾家家居	66,406,653.52	3.77
73	603688	石英股份	62,518,431.38	3.55
74	603520	司太立	61,343,668.70	3.48
75	600741	华域汽车	57,042,632.71	3.24
76	603899	晨光文具	55,757,794.41	3.17
77	601689	拓普集团	54,467,140.40	3.09
78	002714	牧原股份	53,467,125.69	3.04
79	300590	移为通信	52,746,024.74	3.00
80	002174	游族网络	51,703,066.06	2.94
81	002043	兔宝宝	51,278,941.84	2.91
82	600556	天下秀	49,159,031.28	2.79
83	603313	梦百合	47,892,367.53	2.72
84	300559	佳发教育	47,637,540.17	2.71
85	603806	福斯特	46,829,633.22	2.66
86	002912	中新赛克	45,578,933.29	2.59
87	603700	宁水集团	45,142,529.41	2.56
88	603369	今世缘	44,802,015.54	2.54
89	002352	顺丰控股	43,789,427.16	2.49
90	002078	太阳纸业	42,537,900.21	2.42
91	000725	京东方A	40,662,206.00	2.31
92	603060	国检集团	38,651,697.06	2.20
93	300073	当升科技	38,556,371.06	2.19
94	600887	伊利股份	36,999,111.62	2.10
95	000568	泸州老窖	36,711,329.85	2.08

注：不考虑相关交易费用。

8.4.3 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	13,247,501,845.74
卖出股票收入（成交）总额	12,627,180,173.79

注：不考虑相关交易费用。

8.5 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	110,797,000.00	2.88
	其中：政策性金融债	110,797,000.00	2.88
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）	1,000.00	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	110,798,000.00	2.88

8.6 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	140210	14 国开 10	900,000	90,747,000.00	2.36
2	160416	16 农发 16	200,000	20,050,000.00	0.52
3	113616	韦尔转债	10	1,000.00	0.00

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10.2 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

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

8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的。

8.12.3 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	840,761.90
2	应收证券清算款	25,321,306.13
3	应收股利	-
4	应收利息	4,206,001.12
5	应收申购款	8,014,236.08
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	38,382,305.23

8.12.4 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。

8.12.5 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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
华泰柏瑞创新升级混合 A	60,524	17,633.70	899,534,030.23	84.28%	167,728,064.33	15.72%
华泰柏瑞创新升级混合 C	644	3,096.39	1,458,151.06	73.12%	535,920.94	26.88%
合计	61,100	17,500.10	900,992,181.29	84.26%	168,263,985.27	15.74%

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）。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	华泰柏瑞创新升级混合 A	3,976,008.43	0.3725%
	华泰柏瑞创新升级混合 C	298.36	0.0150%
	合计	3,976,306.79	0.3719%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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、基金投资和研发部门负责人持	华泰柏瑞创新升级混合 A	>100

有本开放式基金	华泰柏瑞创新升级混 合 C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开 放式基金	华泰柏瑞创新升级混 合 A	>100
	华泰柏瑞创新升级混 合 C	0
	合计	>100

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华泰柏瑞创新升级 混合 A	华泰柏瑞创新升级 混合 C
基金合同生效日（2014 年 5 月 6 日）基金 份额总额	267,739,518.28	-
本报告期期初基金份额总额	793,003,758.59	-
本报告期基金总申购份额	1,005,481,940.33	2,554,195.70
减:本报告期基金总赎回份额	731,223,604.36	560,123.70
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以 “-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,067,262,094.56	1,994,072.00

注：A 类份额变动计算期间为 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日。C 类份额变动计算期间为 2020 年 8 月 20 日至 2020 年 12 月 31 日。

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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

2020 年 2 月 10 日，经公司董事会批准程安至先生不再担任公司副总经理。

2020 年 12 月 9 日，公司选举周俊梁先生担任公司监事，童辉先生不再担任公司监事。

2020 年 12 月 14 日，经公司董事会批准童辉先生担任公司首席信息官，房伟力先生不再担任公司首席信息官。

上述人事变动已按相关规定备案、报告。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

11.5 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。本报告期基金应支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)的报酬为 100,000.00 元人民币，该事务所已向本基金提供了 7 年的审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

2020 年 3 月，公司收到上海证监局对公司采取责令改正措施的决定。公司高度重视，立即制定并实施相关整改措施，落实整改要求。2020 年 4 月公司完成整改事项并及时向监管机构提交整改报告。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比	佣金	占当期佣金总量的比例	

			例			
中信证券	3	5,593,110,365.16	21.67%	5,120,757.29	21.54%	-
长江证券	4	3,669,425,337.18	14.22%	3,392,480.97	14.27%	-
申万宏源	2	2,495,556,591.49	9.67%	2,298,527.52	9.67%	-
申港证券	2	1,968,684,150.08	7.63%	1,807,728.07	7.60%	-
齐鲁证券	2	1,720,212,405.09	6.67%	1,602,034.89	6.74%	-
国泰君安	1	1,249,081,501.57	4.84%	1,163,271.90	4.89%	-
方正证券	3	1,203,327,752.91	4.66%	1,120,657.66	4.71%	-
兴业证券	3	1,111,870,875.83	4.31%	1,013,249.87	4.26%	-
安信证券	3	1,100,000,468.87	4.26%	1,021,729.13	4.30%	-
银河证券	1	1,084,688,233.45	4.20%	1,010,166.31	4.25%	-
光大证券	2	768,908,409.67	2.98%	702,190.44	2.95%	-
广发证券	2	722,246,973.55	2.80%	658,184.82	2.77%	-
国金证券	1	694,673,186.76	2.69%	646,948.00	2.72%	-
民生证券	1	519,485,973.20	2.01%	473,409.39	1.99%	-
瑞银证券	2	496,062,906.87	1.92%	455,483.03	1.92%	-
东方证券	3	358,418,277.23	1.39%	326,626.67	1.37%	-
西藏东方财富	2	340,609,933.33	1.32%	313,550.07	1.32%	-
华创证券	1	330,680,628.49	1.28%	301,349.60	1.27%	-
华鑫证券	1	187,984,468.18	0.73%	171,310.59	0.72%	-
万联证券	2	100,027,173.56	0.39%	91,155.05	0.38%	-
北京高华	1	93,818,128.46	0.36%	87,373.15	0.37%	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	3	-	-	-	-	-
中银国际	3	-	-	-	-	-
新时代证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	3	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-

华安证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	2	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
华龙证券	1	-	-	-	-	-

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信证券	356.71	0.02%	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	2,227,902.90	99.98%	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-

西藏东方财富	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
北京高华	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
华龙证券	-	-	-	-	-	-

11.8 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参加交通银行股份有限公司	证监会规定报刊和网站	2020年12月31日

	公司申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告		
2	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国工商银行费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2020 年 12 月 31 日
3	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止北京电盈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	2020 年 12 月 31 日
4	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金参加泉州银行股份有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2020 年 12 月 30 日
5	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金参加平安银行股份有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2020 年 12 月 24 日
6	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止泰诚财富基金销售（大连）有限公司和深圳盈信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	2020 年 12 月 18 日
7	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2020 年 12 月 16 日
8	华泰柏瑞基金管理有限公司关于首席信息官变更的公告	证监会规定报刊和网站	2020 年 12 月 15 日
9	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参与腾安基金销售（深圳）有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2020 年 12 月 9 日
10	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金投资范围增加存托凭证并相应修订基金合同及托管协议的公告	证监会规定报刊和网站	2020 年 11 月 20 日
11	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2020 年 11 月 13 日
12	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2020 年 11 月 5 日
13	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国	证监会规定报刊和网站	2020 年 10 月 10 日

	建设银行股份有限公司费率优惠活动的公告		
14	华泰柏瑞基金管理有限公司关于调整旗下基金参加招商银行股份有限公司旗下招赢通平台费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2020年9月30日
15	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金参加招商银行股份有限公司旗下招赢通平台费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2020年9月28日
16	华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金 C 类份额开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资等业务公告	证监会规定报刊和网站	2020年8月18日
17	关于华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金增加 C 类份额并修改基金合同和托管协议的公告	证监会规定报刊和网站	2020年8月18日
18	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金参加鼎信汇金（北京）投资管理有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2020年7月27日
19	华泰柏瑞基金管理有限公司关于提醒客户及时更新身份证件及非自然人客户及时登记受益所有人信息的公告	证监会规定报刊和网站	2020年7月13日
20	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金参加徽商银行股份有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2020年7月2日
21	华泰柏瑞基金管理有限公司关于包商银行股份有限公司转让相关业务的提示性公告	证监会规定报刊和网站	2020年5月26日
22	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金获配非公开发行股票的公告	证监会规定报刊和网站	2020年5月21日
23	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金参加鼎信汇金（北京）投资管理有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2020年4月21日
24	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金参加长江证券股份有限公司费率优	证监会规定报刊和网站	2020年4月15日

	惠活动的公告		
25	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国人寿保险股份有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2020年4月1日
26	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金参加和合期货有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2020年4月1日
27	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	2020年3月19日
28	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金参加中国国际期货有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2020年3月18日
29	华泰柏瑞基金管理有限公司关于调整旗下基金最低申购金额、最低赎回份额和最低持有份额的公告	证监会规定报刊和网站	2020年3月9日
30	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	2020年2月14日
31	华泰柏瑞基金管理有限公司关于调整旗下基金2020年春节假期申购赎回等交易业务及清算交收安排的提示性公告	证监会规定报刊和网站	2020年1月30日
32	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参加嘉实财富管理有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2020年1月9日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	20200101-20200213;	162,469,644.18	0.00	137,469,644.18	25,000,000.00	2.34%
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

本基金报告期内有单一机构持有基金份额超过 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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 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

13.2 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

13.3 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

2021 年 3 月 31 日