

# 华泰柏瑞质量精选混合型证券投资基金 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 28 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 3 月 31 日（基金合同生效日）起至 2021 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
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.....	16
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>17</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
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.....	17
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.....	17
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>18</b>
6.1 资产负债表.....	18
6.2 利润表.....	19
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20

6.4 报表附注.....	21
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>49</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	49
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	49
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.....	50
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	53
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.....	54
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.....	54
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.....	54
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.....	54
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	54
7.12 投资组合报告附注.....	54
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>56</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	56
8.3 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.....	56
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>58</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>59</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	59
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.....	59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	59
10.4 基金投资策略的改变.....	59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	59
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	59
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	59
10.8 其他重大事件.....	62
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>64</b>
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.....	64

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	64
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>65</b>
12.1 备查文件目录.....	65
12.2 存放地点.....	65
12.3 查阅方式.....	65

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞质量精选混合型证券投资基金	
基金简称	华泰柏瑞质量精选混合	
基金主代码	010415	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 3 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	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	439,483,211.76 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	华泰柏瑞质量精选混合 A	华泰柏瑞质量精选混合 C
下属分级基金的交易代码:	010415	010416
报告期末下属分级基金的份额总额	430,132,918.49 份	9,350,293.27 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过深入的公司基本面研究，精选具有可持续高质量成长且估值具有吸引力的公司进行价值投资，在控制组合风险的基础上，实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金将通过研究国内国际宏观经济趋势、货币政策、财政政策、企业盈利周期、估值水平等可能影响证券市场的重要因素，对各大类资产的风险收益特征进行深入分析，在严格控制组合风险的基础上，调整或确定各大类资产的配置比例，实现基金资产的长期、稳定和持续增值。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率*70%+恒生指数收益率(使用估值汇率折算)*20%+上证国债指数收益率*10%。
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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘万方	李申
	联系电话	021-38601777	021-60637102
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		400-888-0001	021-60637111
传真		021-38601799	021-60635778
注册地址		上海市浦东新区民生路 1199	北京市西城区金融大街 25 号

	弄上海证大五道口广场 1 号 17 层	
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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	200135	100033
法定代表人	贾波	田国立

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.huatai-pb.com">http://www.huatai-pb.com</a>
基金中期报告备置地点	上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

## 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 弄上海证大五道口广场 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

基金级别	华泰柏瑞质量精选混合 A	华泰柏瑞质量精选混合 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年3月31日 - 2021年6月30日)	报告期(2021年3月31日 - 2021年6月30日)
本期已实现收益	6,454,977.88	127,750.82
本期利润	57,156,235.24	1,229,291.38
加权平均基金份额本期利润	0.1329	0.1315
本期加权平均净值利润率	12.60%	12.47%
本期基金份额净值增长率	13.29%	13.15%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)	
期末可供分配利润	6,454,977.88	127,750.82
期末可供分配基金份额利润	0.0150	0.0137
期末基金资产净值	487,289,153.73	10,579,584.65
期末基金份额净值	1.1329	1.1315
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	13.29%	13.15%

注：1、所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。

#### 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

华泰柏瑞质量精选混合 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
过去一个月	0.81%	1.87%	-0.83%	0.64%	1.64%	1.23%
过去三个月	13.29%	1.47%	3.40%	0.73%	9.89%	0.74%
自基金合同生效起至今	13.29%	1.45%	2.69%	0.73%	10.60%	0.72%

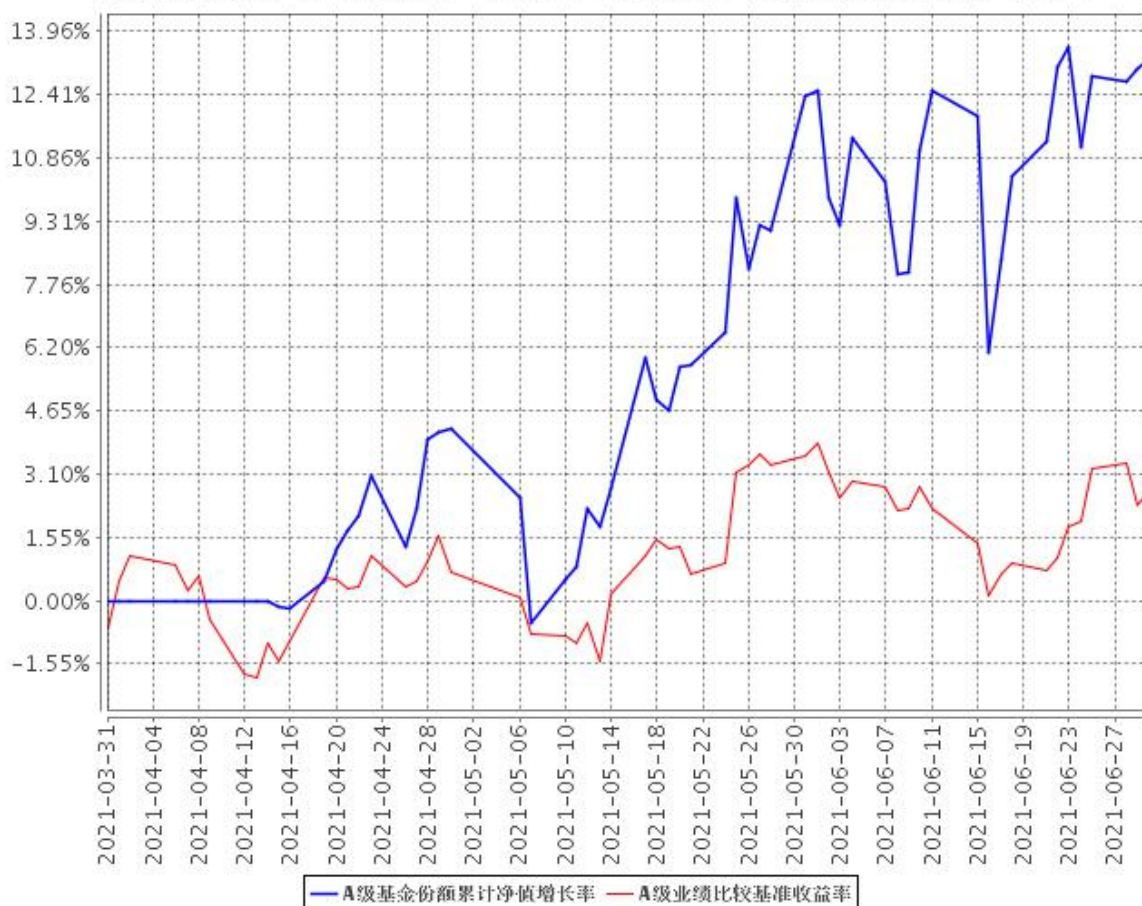
华泰柏瑞质量精选混合 C



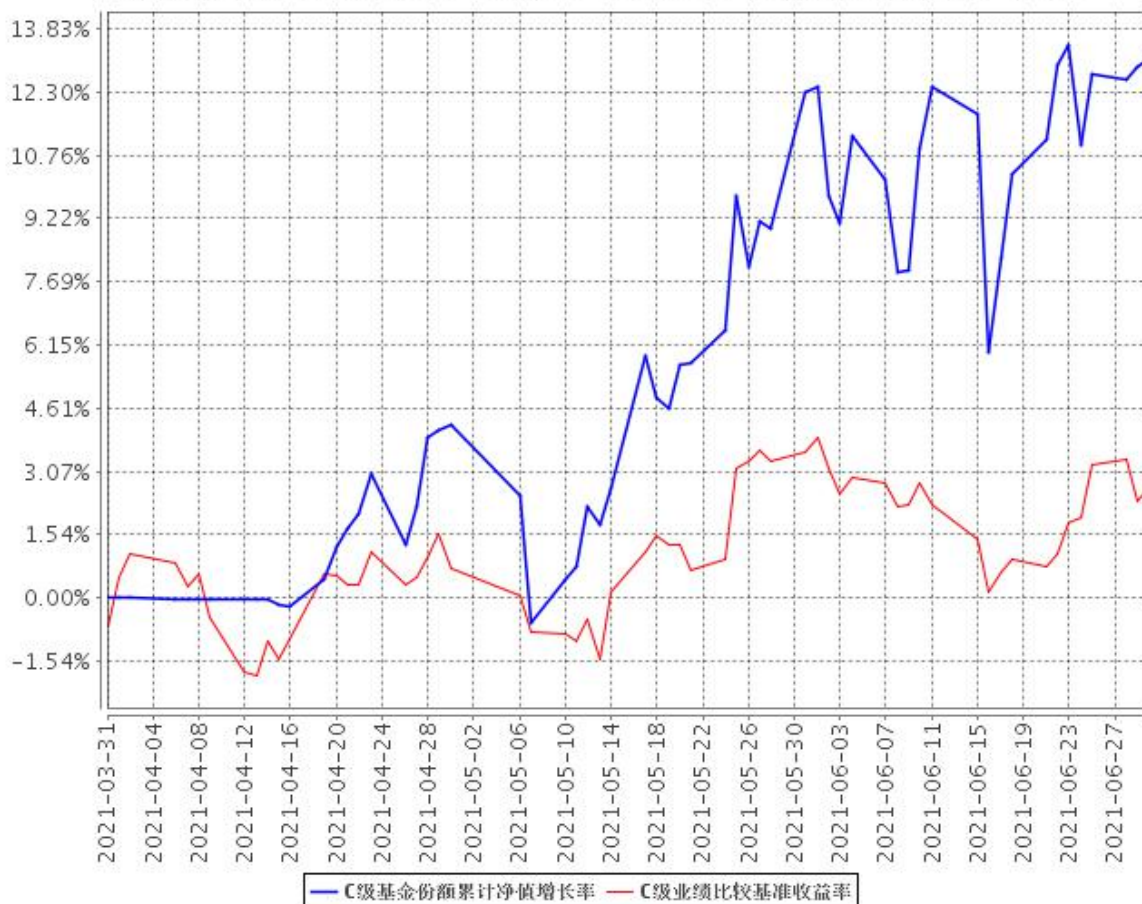
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.77%	1.87%	-0.83%	0.64%	1.60%	1.23%
过去三个月	13.15%	1.47%	3.40%	0.73%	9.75%	0.74%
自基金合同生效起至今	13.15%	1.45%	2.69%	0.73%	10.46%	0.72%

### 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：1、图示日期为 2021 年 3 月 31 日至 2021 年 6 月 30 日。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期，截至报告期末本基金的各项投资比例未达到基金合同投资范围中规定的比例。

3、自基金合同生效起至本报告期末不满一年。

## § 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、华泰柏瑞质量领先混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证稀土产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞品质成长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联接基金、华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证物联网主题交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞质量精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞港股通时代机遇混合型证券投资基金、华泰柏瑞行业严选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证企业核心竞争力 50 交易型开放式指数证券投资基金。截至 2021 年 6 月 30 日，公司基金管理规模为 2174.24 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		
李晓西	副总经理、本基金的基金经理	2021 年 3 月 31 日	-	22 年	副总经理，美国杜克大学工商管理硕士。曾任中银信托投资公司外汇交易结算员，银建实业股份有限

					<p>公司证券投资经理，汉唐证券有限责任公司高级经理，美国信安环球股票有限公司董事总经理兼基金经理。2018 年 7 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，2018 年 8 月起任公司副总经理。2020 年 2 月起任华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金、华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 3 月起任华泰柏瑞质量成长混合型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2021 年 1 月起任华泰柏瑞质量领先混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月起任华泰柏瑞质量精选混合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。任职日期和离职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

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。

#### 4.3.2 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。

本报告期本基金与公司所管理的其他投资组合没有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。

#### 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

回顾上半年 A 股市场，一季度市场波动较大，二季度平稳向上。春节前，A 股市场延续了去年以来的结构性行情，医药和大消费包括食品饮料、休闲服务等行业涨幅大幅居前。港股通在春节前也持续有南向资金流入，港股恒生指数在春节期间突破 30000 点，并创出 2019 年以来的新高，其中港股科技、消费和医药等行业涨幅较大。春节后，A 股和港股市场投资风格发生了较大变化，自 2019 年以来涨幅居前的行业包括食品饮料、电气设备、医药服务等纷纷回调，其中不少前期强势个股在短时间跌幅达到 25%-40%，而之前涨幅较小、估值较低的行业如银行、钢铁、采掘等则相对表现较强。3 月中下旬，前期大幅下跌的行业如休闲服务、食品饮料、医药板块出现小幅反弹。4 月市场核心资产大幅反弹，创业板指涨幅显著领先，医药领涨；5 月市场普涨走势，核心资产、中小市值均大幅上涨，国防军工、食品饮料领涨；6 月指数呈现震荡走势，创业板大幅上涨 5.1%，其中 TMT 板块领涨。上半年整体来看，涨幅居前的板块为钢铁、采掘、电气设备，而农林牧渔、家用电器、非银金融等行业跌幅居前。

##### 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质量精选混合 A 基金份额净值为 1.1329 元，本报告期基金份额净值增长率为 13.29%；截至本报告期末华泰柏瑞质量精选混合 C 基金份额净值为 1.1315 元，本报告期基金份额净值增长率为 13.15%；同期业绩比较基准收益率为 2.69%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，随着新冠疫苗的普遍接种，国内经济进入正常化阶段，经济环比高增可能逐渐放缓并往中长期中枢回归，政策也进入常态化回归过程。上半年，财政支出明显后置，预计财政发力的主要时段大概率落在今年三季度和四季度前半段，对下半年经济形成支撑作用；房地产在严监管的政策条件下，销售前高后低，竣工端有望维持高增长，在按揭利率没有显著变化的背景下未来可能还将保持平稳；上半年我国出口总体保持稳定增长。下半年在海外发达国家新冠疫苗接种进一步增加、新兴国家疫情逐步得到缓解的背景下，国外各行业产能可能逐步恢复，我国出口下半年增速则可能相应回落；国内消费行业上半年恢复较慢，特别是服务类消费仍未恢复到疫情前的水平，下半年仍有恢复的空间。与此同时，美国市场随着新冠疫苗接种率的提升，经济受疫情的负面影响可能进一步缓解，在经济稳步复苏和通胀预期下，美国联邦救助将逐渐退出，加息预期或往前移。

未来一段时间，我们重点关注的事件包括：国内经济数据的变化，财政和货币政策的走向，中美通胀数据、美联储货币政策的走向以及美国是否提高企业所得税、“Delta”新冠变异病毒的进展等。此外，我们还将继续关注我国在教育、房地产、反垄断、保障民生、消费、环保等领域政策的发展。预计碳达峰和碳中和还将会是资本市场的重要投资主线之一。

本基金将继续坚持以深入的基本面研究为核心，自下而上精选个股构建投资组合。在行业方面，根据国内外行业发展趋势、竞争格局、行业景气度，主要选择景气度和盈利相对稳定或者上升、符合社会和经济发展趋势、成长空间大的行业。自下而上精选优秀个股，力争实现投资业绩的可复制性和可持续性。

具体而言，本基金将继续关注在经济增速放缓以及经济转型过程中的高质量成长企业，包括医药、消费和消费升级、新能源（含电动车和光伏产业链等）、行业集中度持续提升并且行业盈利能力提升的行业里的龙头企业（含化工、检测、机械设备、建材、高端制造等），以及部分 TMT 企业（含电子、计算机、数据中心等）。在医药行业，医疗服务外包领域上市公司的业绩增速在接下来几年预计还将保持稳定的增长。新能源行业含电动车等是我国、美国和欧洲都在积极推动的行业，不断有政策催化，电动车渗透率在各主要国家政策的推动下将快速提升，预计接下来 5-10 年还将保持高增速，我国一定会涌现出大量业绩优秀的新能源产业链上市公司。新能源光伏行业景气度预计今年上半年已经过了低点，下半年和明年将处于景气度逐步上升阶段。电子和计算机行业有很多公司从事的研发是属于“卡脖子”工程的项目，这些公司的产品未来在我国有很大的需求和应用场景，相信也会反应到上市公司业绩上。疫情的变化也凸显供应链和制造业的重要性，我国近期政策层面也反应了这一点，制造业包括高端制造行业等也会不断有优秀的公司脱颖而出。

此外，近年来在消费领域我国很多本土品牌陆续成长起来，例如体育服饰领域诞生了不少优秀的公司。本基金将会继续积极关注各个行业的动态变化，精选高质量的标的，进行布局。

波动是股票市场固有的特点，但优秀的公司终将在波动和长期竞争中胜出。我们将扎根于寻找有长期业绩增长的高质量公司，寻找各行各业中可以跑出长期优势的公司，避免参与短期炒作，坚守长期价值投资理念。本基金管理人相信，市场每天都在变化，但坚守理性和系统化的投资理念，扎根于长期基本面投资是实现长期可持续和可复制投资业绩的基础。2020 年一季度以及今年一季度的市场大幅波动进一步说明高质量成长（注：不是简单高成长）公司在 A 股市场有着强大的生命力。本管理人深信基于高质量成长的投资理念在 A 股市场是应该能够产生较好长期超额回报的。

#### **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**

注：本报告期内基金未实施收益分配。

#### **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**

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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

### 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

本托管人复核审查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。

## § 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：华泰柏瑞质量精选混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日
<b>资产：</b>		
银行存款	6.4.7.1	102,435,934.67
结算备付金		2,834,826.67
存出保证金		168,607.26
交易性金融资产	6.4.7.2	396,418,094.74
其中：股票投资		376,514,094.74
基金投资		-
债券投资		19,904,000.00
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
应收证券清算款		17,766,495.48
应收利息	6.4.7.5	83,917.58
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		519,707,876.40
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 6 月 30 日</b>
<b>负 债：</b>		
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		-
应付证券清算款		19,624,826.30
应付赎回款		-
应付管理人报酬		602,584.60
应付托管费		100,430.77
应付销售服务费		4,269.14
应付交易费用	6.4.7.7	1,457,027.05
应交税费		-

应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	50,000.16
负债合计		21,839,138.02
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	6.4.7.9	439,483,211.76
未分配利润	6.4.7.10	58,385,526.62
所有者权益合计		497,868,738.38
负债和所有者权益总计		519,707,876.40

注：1. 报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额总额 439,483,211.76 份，其中华泰柏瑞质量精选混合 A 基金份额净值 1.1329 元，份额总额 430,132,918.49 份；华泰柏瑞质量精选混合 C 基金份额净值 1.1315 元，份额总额 9,350,293.27 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2021 年 3 月 31 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日止期间。

## 6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞质量精选混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 3 月 31 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021 年 3 月 31 日(基 金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		62,759,539.04
1.利息收入		586,301.91
其中：存款利息收入	6.4.7.11	83,703.57
债券利息收入		73,652.74
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		428,945.60
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		10,370,439.21
其中：股票投资收益	6.4.7.12	9,753,584.03
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	616,855.18
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	51,802,797.92

4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-
<b>减：二、费用</b>		4,374,012.42
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,734,062.56
2. 托管费	6.4.10.2.2	289,010.45
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	12,290.17
4. 交易费用	6.4.7.19	2,280,386.24
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	6.4.7.20	58,263.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		58,385,526.62
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		58,385,526.62

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华泰柏瑞质量精选混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 3 月 31 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 3 月 31 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 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）	439,483,211.76	-	439,483,211.76
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	58,385,526.62	58,385,526.62
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）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-

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（基金净值）	439,483,211.76	58,385,526.62	497,868,738.38

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：

          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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞质量精选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[2020]2462号《关于准予华泰柏瑞质量精选混合型证券投资基金注册的批复》核准,由华泰柏瑞基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞质量精选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439,322,195.11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0319号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞质量精选混合型证券投资基金基金合同》于2021年3月31日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为439,483,211.76份基金份额,其中认购资金利息折合161,016.65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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《华泰柏瑞质量精选混合型证券投资基金招募说明书》,本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用的基金份额,称为A类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额,称为C类基金份额。本基金A类、C类基金份额分别设置代码。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《华泰柏瑞质量精选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(包含中小板、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”）、债券（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）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、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。本基金股票资产的投资比例占基金资产的 60%-95%；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%。本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率×70%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×20%+上证国债指数收益率×10%。

本财务报表由本基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于 2021 年 8 月 28 日批准报出。

#### 6.4.2 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 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会公告[2010]5 号《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〉》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华泰柏瑞质量精选混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注 6.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年 3 月 31 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 3 月 31 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 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。本期财务报表的实际编制期间为 2021 年 3 月 31 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

### 6.4.4.3 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。

### 6.4.4.4 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。

#### 6.4.4.5 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。

#### 6.4.4.6 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。

#### 6.4.4.7 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。

#### 6.4.4.8 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)。

#### 6.4.4.9 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。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管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。

#### 6.4.4.11 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为正数，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，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，即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。

#### 6.4.4.12 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。

#### 6.4.4.13 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。

#### 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[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[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]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]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[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

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。

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。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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	102,435,934.67

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：	102,435,934.67

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	324,715,476.82	376,514,094.74	51,798,617.92	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	19,899,820.00	19,904,000.00	4,180.00
	合计	19,899,820.00	19,904,000.00	4,180.00
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	344,615,296.82	396,418,094.74	51,802,797.92	

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：截至本报告期末，本基金未持有衍生金融资产/负债。

#### 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：截至本报告期末，本基金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：截至本报告期末，本基金未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日

应收活期存款利息	6,838.61
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	1,275.70
应收债券利息	75,727.47
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	75.80
合计	83,917.58

#### 6.4.7.6 其他资产

注：截至本报告期末，本基金未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	1,456,827.05
银行间市场应付交易费用	200.00
合计	1,457,027.05

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	50,000.16
合计	50,000.16

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

华泰柏瑞质量精选混合 A
--------------

项目	本期 2021 年 3 月 31 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	430,132,918.49	430,132,918.49
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
- 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	430,132,918.49	430,132,918.49

金额单位：人民币元

华泰柏瑞质量精选混合 C		
项目	本期 2021 年 3 月 31 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	9,350,293.27	9,350,293.27
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
- 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	9,350,293.27	9,350,293.27

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

华泰柏瑞质量精选混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	6,454,977.88	50,701,257.36	57,156,235.24
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,454,977.88	50,701,257.36	57,156,235.24

单位：人民币元

华泰柏瑞质量精选混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	127,750.82	1,101,540.56	1,229,291.38
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	127,750.82	1,101,540.56	1,229,291.38

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年3月31日(基金合同生效日)至2021年6月30日
活期存款利息收入	69,387.29
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	13,989.83
其他	326.45
合计	83,703.57

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年3月31日(基金合同生效日)至2021年6月30日
卖出股票成交总额	672,164,785.36
减：卖出股票成本总额	662,411,201.33
买卖股票差价收入	9,753,584.03



### **6.4.7.13 债券投资收益**

#### **6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

注：本基金本报告期内无债券投资收益。

#### **6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

注：本基金本报告期内无债券投资收益——买卖债券差价收入。

#### **6.4.7.13.3 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。

#### **6.4.7.13.4 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。

#### **6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益**

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

### **6.4.7.14 贵金属投资收益**

#### **6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### **6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

#### **6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——赎回差价收入。

#### **6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——申购差价收入。

### **6.4.7.15 衍生工具收益**

#### **6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期内无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

#### **6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

注：本基金本报告期内无衍生工具收益——其他投资收益。

### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 3 月 31 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	616,855.18
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	616,855.18

### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 3 月 31 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	51,802,797.92
——股票投资	51,798,617.92
——债券投资	4,180.00
——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	51,802,797.92

### 6.4.7.18 其他收入

注：无。

### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 3 月 31 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	2,280,186.24
银行间市场交易费用	200.00

交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	2,280,386.24

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年3月31日(基金合同生效日)至2021 年6月30日
审计费用	19,999.88
信息披露费	30,000.28
证券出借违约金	-
银行划款手续费	7,562.84
其他费用	700.00
合计	58,263.00

#### 6.4.7.21 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，不需要进行分部报告的披露。

#### 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

截止资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截止本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

### 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、登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 6.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期内无应支付关联方的佣金。

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2021年3月31日(基金合同生效日)至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,734,062.56
其中：支付销售机构的客户维护费	802,214.66

注：支付基金管理人华泰柏瑞基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 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 × 1.50% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 3 月 31 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	289,010.45

注：支付基金托管人中国建设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 X 0.25% / 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		
	2021 年 3 月 31 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰柏瑞质量精选混合 A	华泰柏瑞质量精选混合 C	合计
华泰证券股份有限公司	0.00	1,745.50	1,745.50
华泰柏瑞基金管理有限公司	0.00	23.96	23.96
合计	0.00	1,769.46	1,769.46

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.5%的年费率计提，计算方法如下：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

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，由基金托管人于次月前 5 个工作日内从基金资产中一次性支取。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

**6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明**

**6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

注：无。

**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：无。

**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：本报告期内，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：本报告期内，除基金管理人之外的其它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	
	2021年3月31日(基金合同生效日)至 2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	102,435,934.67	69,387.29

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，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**

金额单位：人民币元

本期					
2021年3月31日(基金合同生效日)至2021年6月30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
华泰联合证券有限责任公司	605499	东鹏饮料	网下申购	632	29,242.64

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

注：本基金本报告期内无其他关联交易事项。

#### 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（2021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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 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
301018	申菱环境	2021年6月28日	2021年7月7日	新股流通受限	8.29	8.29	7,811	64,753.19	64,753.19	-
301017	漱玉平民	2021年6月23日	2021年7月5日	新股流通受限	8.86	8.86	5,550	49,173.00	49,173.00	-
301020	密封科技	2021年6月28日	2021年7月6日	新股流通受限	10.64	10.64	4,210	44,794.40	44,794.40	-
301021	英诺激光	2021年6月28日	2021年7月6日	新股流通受限	9.46	9.46	2,899	27,424.54	27,424.54	-
605287	德才股份	2021年6月28日	2021年7月6日	新股流通受限	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
605162	新中港	2021年6月29日	2021年7月7日	新股流通受限	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
688425	铁建重工	2021年6月11日	2021年12月22日	新股流通受限	2.87	4.75	50,248	144,211.76	238,678.00	-
301009	可靠股份	2021年6月8日	2021年12月17日	新股流通受限	12.54	27.89	801	10,044.54	22,339.89	-
301015	百洋医药	2021年6月22日	2021年12月30日	新股流通受限	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-

300614	百川畅银	2021 年 5 月 18 日	2021 年 11 月 25 日	新股流通受限	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
301013	利和兴	2021 年 6 月 21 日	2021 年 12 月 29 日	新股流通受限	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81	-
300997	欢乐家	2021 年 5 月 26 日	2021 年 12 月 2 日	新股流通受限	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
301002	崧盛股份	2021 年 5 月 27 日	2021 年 12 月 7 日	新股流通受限	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
300991	创益通	2021 年 5 月 12 日	2021 年 11 月 22 日	新股流通受限	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
301011	华立科技	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 17 日	新股流通受限	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
300995	奇德新材	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 26 日	新股流通受限	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
301007	德迈仕	2021 年 6 月 4 日	2021 年 12 月 16 日	新股流通受限	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
300998	宁波方正	2021 年 5 月 25 日	2021 年 12 月 2 日	新股流通受限	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
300992	泰福泵业	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 25 日	新股流通受限	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-

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，锁定期限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。

#### **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：本基金本报告期内无银行间市场债券正回购。

##### **6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

注：本基金本报告期内无交易所市场债券正回购。

#### **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，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。

#### **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建设银行，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。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021 年 6 月 30 日
A-1	0.00
A-1 以下	0.00
未评级	19,904,000.00
合计	19,904,000.00

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。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：无。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

#### 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。

于 2021 年 6 月 30 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。

#### **6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析**

注：无。

#### **6.4.13.3.2 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，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 6.4.12。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 2021 年 6 月 30 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 0.11%。

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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021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							
银行存款	102,435,934.67	-	-	-	-	-	-102,435,934.67

结算备付金	2,834,826.67	-	-	-	-	2,834,826.67
存出保证金	168,607.26	-	-	-	-	168,607.26
交易性金融资产	19,904,000.00	-	-	-	-376,514,094.74	396,418,094.74
应收证券清算款	-	-	-	-	17,766,495.48	17,766,495.48
应收利息	-	-	-	-	83,917.58	83,917.58
资产总计	125,343,368.60	-	-	-	-394,364,507.80	519,707,876.40
负债						
应付证券清算款	-	-	-	-	19,624,826.30	19,624,826.30
应付管理人报酬	-	-	-	-	602,584.60	602,584.60
应付托管费	-	-	-	-	100,430.77	100,430.77
应付销售服务费	-	-	-	-	4,269.14	4,269.14
应付交易费用	-	-	-	-	1,457,027.05	1,457,027.05
其他负债	-	-	-	-	50,000.16	50,000.16
负债总计	-	-	-	-	21,839,138.02	21,839,138.02
利率敏感度缺口	125,343,368.60	-	-	-	-372,525,369.78	497,868,738.38

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2021 年 6 月 30 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 4.00%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。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。本基金投资组合中股票及存托凭证投资比例为基金净资产的 60%-95%；投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%。每个交易日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金后，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%。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 2021 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	376,514,094.74	75.63
交易性金融资产-基金投资	-	-
交易性金融资产-债券投资	19,904,000.00	4.00
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	396,418,094.74	79.62

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2021 年 6 月）

		30 日 )	
	业绩比较基准上升 5%	36,723,650.19	
	业绩比较基准下降 5%	-36,723,650.19	

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

注：无。



## § 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	376,514,094.74	72.45
	其中：股票	376,514,094.74	72.45
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	19,904,000.00	3.83
	其中：债券	19,904,000.00	3.83
	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	105,270,761.34	20.26
8	其他各项资产	18,019,020.32	3.47
9	合计	519,707,876.40	100.00

### 7.2 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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	259,283,958.43	52.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00
E	建筑业	11,014.44	0.00
F	批发和零售业	67,112.46	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,839,822.10	2.78
J	金融业	34,721.10	0.01
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	70,834,750.80	14.23

N	水利、环境和公共设施管理业	13,285.02	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	32,416,410.00	6.51
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	376,514,094.74	75.63

## 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	占基金资产净值比例（%）
1	300760	迈瑞医疗	88,215	42,347,610.75	8.51
2	300750	宁德时代	76,187	40,744,807.60	8.18
3	603259	药明康德	250,320	39,197,608.80	7.87
4	300014	亿纬锂能	358,297	37,237,807.21	7.48
5	300450	先导智能	592,320	35,622,124.80	7.15
6	002709	天赐材料	333,896	35,586,635.68	7.15
7	300347	泰格医药	167,700	32,416,410.00	6.51
8	300759	康龙化成	145,800	31,637,142.00	6.35
9	002821	凯莱英	69,600	25,932,960.00	5.21
10	000858	五粮液	41,800	12,451,802.00	2.50
11	600570	恒生电子	111,718	10,417,703.50	2.09
12	601012	隆基股份	116,900	10,385,396.00	2.09
13	603737	三棵树	54,120	9,525,120.00	1.91
14	601636	旗滨集团	267,700	4,968,512.00	1.00
15	688111	金山办公	8,169	3,225,121.20	0.65
16	603986	兆易创新	14,600	2,743,340.00	0.55
17	300763	锦浪科技	3,102	560,221.20	0.11
18	002812	恩捷股份	2,000	468,200.00	0.09
19	688425	铁建重工	50,248	238,678.00	0.05
20	600845	宝信软件	3,630	184,767.00	0.04
21	605499	东鹏饮料	632	158,505.60	0.03
22	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.01
23	600196	复星医药	700	50,491.00	0.01

24	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.01
25	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.01
26	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.01
27	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.01
28	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
29	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00
30	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
31	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
32	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
33	301013	利和兴	471	12,768.81	0.00
34	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
35	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
36	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
37	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
38	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
39	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
40	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
41	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
42	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
43	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
44	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
45	300992	泰福泵业	200	4,064.00	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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	300347	泰格医药	60,313,749.24	12.11
2	603259	药明康德	59,516,424.95	11.95
3	300760	迈瑞医疗	57,983,032.97	11.65
4	002821	凯莱英	49,941,545.00	10.03
5	600570	恒生电子	45,402,214.58	9.12
6	300450	先导智能	44,803,484.44	9.00
7	300012	华测检测	43,662,918.84	8.77
8	002709	天赐材料	40,966,114.81	8.23
9	300759	康龙化成	40,545,550.00	8.14

10	300750	宁德时代	39,165,254.72	7.87
11	603456	九洲药业	38,530,883.86	7.74
12	300014	亿纬锂能	38,229,792.75	7.68
13	600196	复星医药	37,337,505.46	7.50
14	688363	华熙生物	33,674,922.75	6.76
15	688366	昊海生科	30,840,259.04	6.19
16	000568	泸州老窖	27,718,769.80	5.57
17	600623	华谊集团	27,633,245.44	5.55
18	600845	宝信软件	25,236,324.18	5.07
19	300957	贝泰妮	23,926,913.00	4.81
20	603127	昭衍新药	22,947,399.00	4.61
21	601012	隆基股份	22,813,785.00	4.58
22	000799	酒鬼酒	22,243,019.75	4.47
23	002541	鸿路钢构	17,836,995.00	3.58
24	000858	五粮液	15,915,287.37	3.20
25	300363	博腾股份	15,094,095.00	3.03
26	300144	宋城演艺	11,356,892.00	2.28
27	000513	丽珠集团	11,278,521.70	2.27
28	300725	药石科技	11,167,843.80	2.24
29	603737	三棵树	10,103,774.60	2.03

注：本项买入金额均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑其他交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	300012	华测检测	42,598,266.23	8.56
2	300347	泰格医药	38,770,256.14	7.79
3	603456	九洲药业	37,704,964.43	7.57
4	600196	复星医药	34,238,497.85	6.88
5	688363	华熙生物	33,589,110.11	6.75
6	600570	恒生电子	33,503,445.35	6.73
7	688366	昊海生科	32,681,634.97	6.56
8	600623	华谊集团	27,647,947.22	5.55
9	002821	凯莱英	27,113,819.05	5.45
10	600845	宝信软件	26,234,481.30	5.27
11	000568	泸州老窖	25,935,319.00	5.21

12	300957	贝泰妮	25,051,923.10	5.03
13	300759	康龙化成	22,732,163.00	4.57
14	603127	昭衍新药	22,485,029.05	4.52
15	603259	药明康德	21,681,003.00	4.35
16	000799	酒鬼酒	20,311,104.79	4.08
17	300760	迈瑞医疗	18,156,999.37	3.65
18	002541	鸿路钢构	17,923,993.22	3.60
19	002709	天赐材料	17,128,169.50	3.44
20	300363	博腾股份	14,176,650.00	2.85
21	300750	宁德时代	13,512,831.00	2.71
22	601012	隆基股份	11,624,778.02	2.33
23	300144	宋城演艺	11,185,918.42	2.25
24	300725	药石科技	11,181,612.00	2.25
25	000513	丽珠集团	10,711,900.18	2.15
26	300014	亿纬锂能	10,292,712.00	2.07

注：本项卖出金额均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑其他交易费用。

### 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	987,126,678.15
卖出股票收入（成交）总额	672,164,785.36

注：“买入股票成本”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	19,904,000.00	4.00
	其中：政策性金融债	19,904,000.00	4.00
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	19,904,000.00	4.00

## 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	2103673	21 进出 673	200,000	19,904,000.00	4.00

## 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。

## 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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 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。

### 7.10.2 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。

## 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 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。

### 7.11.3 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。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 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。

### 7.12.2 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	168,607.26
2	应收证券清算款	17,766,495.48
3	应收股利	-
4	应收利息	83,917.58
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,019,020.32

### 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。

## § 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
华泰柏瑞质量精选混合 A	5,869	73,288.96	494,304.48	0.11%	429,638,614.01	99.89%
华泰柏瑞质量精选混合 C	1,205	7,759.58	0.00	0.00%	9,350,293.27	100.00%
合计	7,039	62,435.46	494,304.48	0.11%	438,988,907.28	99.89%

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 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	华泰柏瑞质量精选混合 A	99,585.66	0.0232%
	华泰柏瑞质量精选混合 C	20,020.11	0.2141%
	合计	119,605.77	0.0272%

### 8.3 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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	华泰柏瑞质量精选混合 A	0
	华泰柏瑞质量精选混合 C	0



	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	华泰柏瑞质量精选混合 A	0
	华泰柏瑞质量精选混合 C	0
	合计	0

### § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华泰柏瑞质量精选混合 A	华泰柏瑞质量精选混合 C
基金合同生效日（2021 年 3 月 31 日）基金份额总额	430,132,918.49	9,350,293.27
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-	-
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	430,132,918.49	9,350,293.27

## § 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

2021 年 5 月 19 日，经公司董事会批准陈晖女士不再担任公司督察长，刘万方先生担任公司督察长并不再担任公司副总经理。

上述人事变动已按相关规定备案、公告。

本报告期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、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 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例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券	2	332,868,157.53	20.08%	305,556.72	20.97%	-
天风证券	2	302,147,143.56	18.23%	282,913.68	19.42%	-
中泰证券	2	291,636,435.34	17.59%	270,192.81	18.55%	-
粤开证券	1	178,941,489.59	10.80%	163,069.15	11.19%	-
国信证券	2	143,811,878.73	8.68%	105,169.95	7.22%	-
民生证券	3	101,485,887.85	6.12%	92,484.12	6.35%	-

信达证券	1	87,986,920.73	5.31%	62,585.25	4.30%	-
东吴证券	2	74,249,691.35	4.48%	69,148.70	4.75%	-
中信建投	3	63,852,029.37	3.85%	45,417.40	3.12%	-
西部证券	1	41,735,200.34	2.52%	30,518.92	2.09%	-
海通证券	2	31,822,345.32	1.92%	23,272.19	1.60%	-
宏信证券	2	6,977,493.94	0.42%	6,498.16	0.45%	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
西藏东方财富	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
野村东方国际证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	2	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	5	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-

注：1、选择代理证券买卖的证券经营机构的标准：公司应选择财务状况良好，经营行为规范，具备研究实力的证券公司及专业研究机构，向其或其合作券商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满足下列基本条件：1) 具有相应的业务经营资格；2) 诚信记录良好，最近两年无重大违法违规行，未受监管机构重大处罚；3) 资金雄厚，信誉良好。内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求；4) 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，并能为基金提供全面的信息；5) 具备研究实力，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时全面地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及周到的信息服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告。2、选择代理证券买卖的证券经营机构的程序 基金管理人根据以上标准进行考察后确定证券经营机构的选择。基金管理人与被选择的证券经营机构签订交易单元租用协

议和证券研究服务协议。

### 10.7.2 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
招商证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	200,000,000.00	19.42%	-	-
海通证券	-	-	830,000,000.00	80.58%	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
野村东方国际证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-

华泰证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-

### 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参加交通银行股份有限公司申购及定期定额投资一折费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2021年6月30日
2	华泰柏瑞质量精选混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资、费率优惠等业务公告	证监会规定报刊和网站	2021年6月26日
3	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	2021年6月22日
4	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参与珠海盈米基金销售有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2021年6月2日
5	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	2021年5月21日
6	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	2021年5月20日
7	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参加浙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	2021年4月30日
8	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止上海尚善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	2021年4月27日
9	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参与蚂蚁（杭州）基金销售有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2021年4月20日
10	华泰柏瑞质量精选混合型证券投资基金基金合同生效公告	证监会规定报刊和网站	2021年4月1日



## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本基金本报告期内未有单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：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

### 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](http://www.huatai-pb.com)

华泰柏瑞基金管理有限公司

2021 年 8 月 28 日