

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 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 1 月 1 日起至 2021 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
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
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	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.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
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.....	16
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.....	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19

6.4 报表附注.....	20
§7 投资组合报告.....	48
7.1 期末基金资产组合情况.....	48
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	48
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.....	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	57
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.....	57
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.....	57
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.....	57
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.....	57
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	57
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	58
7.12 市场中性策略执行情况.....	58
7.13 投资组合报告附注.....	58
§8 基金份额持有人信息.....	60
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	60
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	60
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.....	60
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	60
§9 开放式基金份额变动.....	61
§10 重大事件揭示.....	62
10.1 基金份额持有人大会决议.....	62
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.....	62
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	62
10.4 基金投资策略的改变.....	62
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	62
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.....	62
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	62
10.8 其他重大事件.....	66

§11 影响投资者决策的其他重要信息	69
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	69
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	69
§12 备查文件目录	70
12.1 备查文件目录.....	70
12.2 存放地点.....	70
12.3 查阅方式.....	70

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	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
基金简称	华泰柏瑞量化对冲混合
基金主代码	002804
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 5 月 26 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	172,791,267.40 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	利用定量投资模型，灵活应用多种策略对冲投资组合的市场风险，谋求投资组合资产的长期增值。
投资策略	在力求有效控制投资风险的前提下，通过全市场选股构建预期收益高于市场回报的投资组合，同时利用股指期货等多种策略对冲投资组合的市场风险，以求获得不依赖市场整体走向的比较稳定的长期资产增值。
业绩比较基准	1 年期银行定期存款收益率（税后）
风险收益特征	本基金为特殊的混合型基金，通过采用量化对冲策略剥离市场系统性风险，因此相对股票型基金和一般的混合型基金，其预期风险较小。

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	刘万方	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	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.huatai-pb.com
基金中期报告备置地点	上海市浦东新区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华泰柏瑞基金管理有限公司	上海市浦东新区民生路 1199 弄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

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年1月1日 - 2021年6月30日)
本期已实现收益	34,182,130.44
本期利润	6,912,728.59
加权平均基金份额本期利润	0.0199
本期加权平均净值利润率	1.65%
本期基金份额净值增长率	2.23%
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	26,163,481.85
期末可供分配基金份额利润	0.1514
期末基金资产净值	212,165,809.78
期末基金份额净值	1.2279
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	22.79%

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。

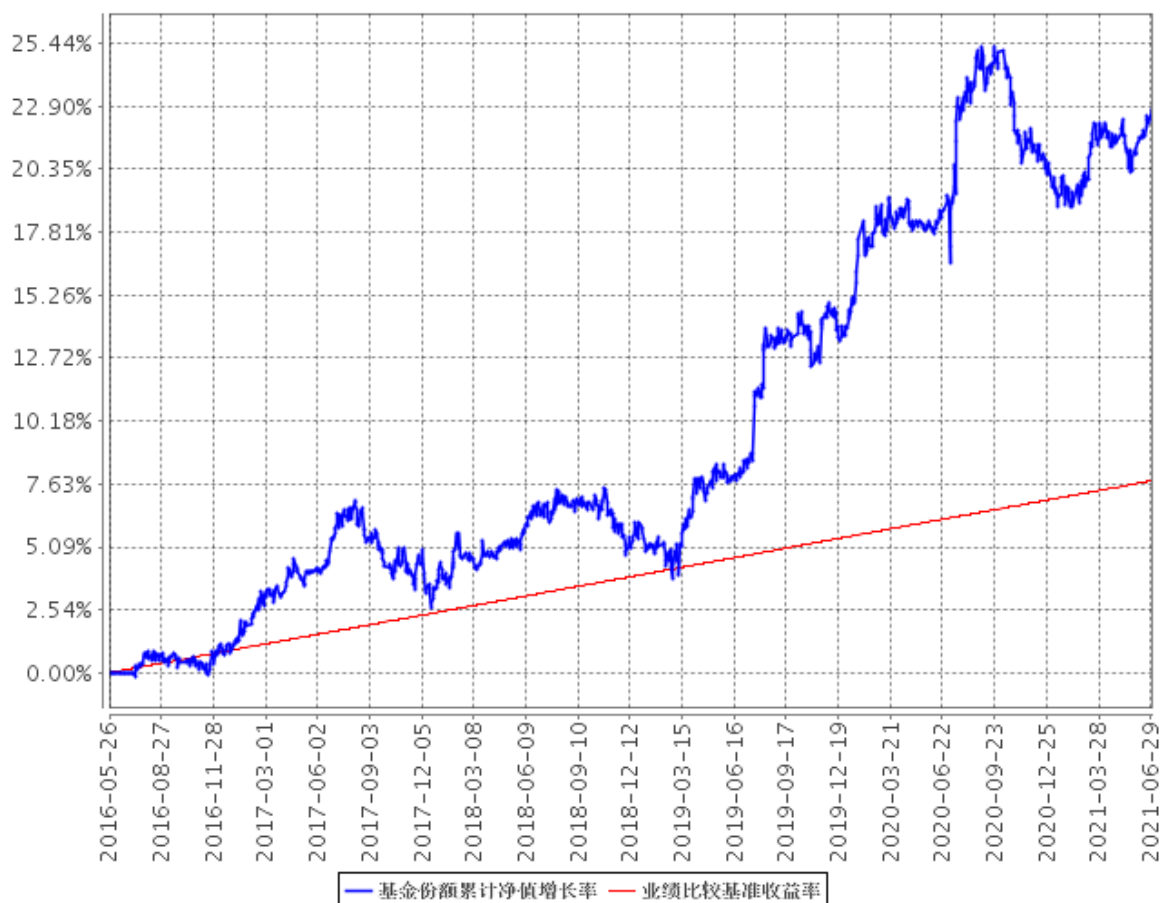
3.2 基金净值表现

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

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	1.44%	0.15%	0.12%	0.00%	1.32%	0.15%
过去三个月	0.50%	0.24%	0.35%	0.00%	0.15%	0.24%
过去六个月	2.23%	0.28%	0.70%	0.00%	1.53%	0.28%
过去一年	2.93%	0.37%	1.43%	0.00%	1.50%	0.37%
过去三年	15.41%	0.32%	4.43%	0.00%	10.98%	0.32%
过去五年	22.80%	0.28%	7.60%	0.00%	15.20%	0.28%
自合同生效日至今	22.79%	0.28%	7.76%	0.00%	15.03%	0.28%

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

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：图示日期为 2016 年 5 月 26 日至 2021 年 6 月 30 日。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司。华泰柏瑞基金管理有限公司是经中国证监会批准，于 2004 年 11 月 18 日成立的合资基金管理公司，注册资本为 2 亿元人民币。目前的股东构成为华泰证券股份有限公司、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		
田汉卿	副总经理、本基金的基金经理	2016 年 5 月 26 日	-	19 年	副总经理。曾在美国巴克莱全球投资管理有限公司（BGI）担任投资经理，2012 年 8 月加入华泰柏瑞

				<p>基金管理有限公司，2013 年 8 月起任华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金的基金经理，2013 年 10 月起任公司副总经理，2014 年 12 月至 2020 年 7 月任华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2015 年 3 月起任华泰柏瑞量化先行混合型证券投资基金的基金经理，2015 年 3 月至 2020 年 7 月任华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2015 年 6 月起任华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金的基金经理和华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金的基金经理。2016 年 5 月起任华泰柏瑞量化对冲稳健收益定期开放混合型发起式证券投资基金的基金经理。2017 年 3 月至 2018 年 11 月任华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 5 月起任华泰柏瑞量化创优灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 9 月起任华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 12 月至 2020 年 7 月任华泰柏瑞港股通量化灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 11 月起任华泰柏瑞量化创盈混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 12 月起任华泰柏瑞量化创享混合型证券投资基金的基</p>
--	--	--	--	--

					金经理。本科与研究生毕业于清华大学，MBA 毕业于美国加州大学伯克利分校哈斯商学院。
曾鸿	本基金的基金经理	2017 年 8 月 30 日	-	8 年	复旦大学世界经济学硕士。2013 年 7 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，任量化投资部研究员。2017 年 8 月起任华泰柏瑞量化对冲稳健收益定期开放混合型发起式证券投资基金的基金经理。

注：证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。任职日期和离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。

本报告期内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

本报告期内，本基金继续采用完全对冲策略，通过量化选股模型构建跟踪沪深 300 指数的增强股票组合，同时利用沪深 300 股指期货合约进行对冲，以获得绝对收益。

2021 年上半年，市场风格在春节前后出现较大的转变。春节前，市场延续 2020 年四季度的行情，继续交易抱团股。节后一些高估值的抱团股出现比较快速的调整，市场逐步企稳反弹后，行情结构更偏向高景气行业主题和中小盘，一些高估值的抱团股和传统行业板块表现较弱。年初至 6 月 30 日期间，传统行业占比较高的上证 50 和沪深 300 分别下跌 3.90%、上涨 0.24%，代表高景气成长类的创业板指、科创 50 分别上涨 17.22%、14.01%，相对估值偏低的中小市值指数中证 500 和中证 1000 分别上涨 6.93%、6.58%。整体来看市场一方面对基本面复苏比较敏感，另一方面对前期的估值分化有一定的修正。

报告期内我们在 800 成分股选股，并坚持基本面多因子的量化选股策略，结合对市场的研判，采取比较稳健的投资策略。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.2279 元；本报告期基金份额净值增长率为 2.23%，业绩比较基准收益率为 0.70%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

量化对冲策略的对冲成本方面，基差在上半年运行平稳，反映了期指市场和股票市场的一致性在加强。我们仍会采取择时展仓的交易策略，并会衡量模型的预期超额收益以及未来基差走势，来决策仓位水平，虽不依赖于短线基差套利，但基差若有大的波动机会的时候也会把握。

我们观察到宏观经济仍处在新冠疫情的复苏之中，但全球的流动性宽松叠加供给端的约束带动了大宗商品价格的快速上升，市场博弈集中在通胀预期与货币政策的边际变化。随着全球经济的复苏，各国货币政策可能会边际收紧，短期货币政策维持中性。

A 股市场在经历了比较长时间的估值分化的市场环境之后，逐步进入基本面业绩驱动的环境。医药等部分高估值的行业板块短期上涨明显，存在股价调整的风险；同时周期等板块的基本面改善未完全反应在股价当中，估值性价比在逐步凸显。我们预计接下来市场将对上市公司中报业绩反应较强，如果市场是理性的话，会切换到性价比相对较好的股票或者板块上。所以，从基本面的角度看，我们对于整体市场不悲观。

量化策略方面，我们预期未来的市场风格会更加有利于华泰柏瑞量化模型获取超额收益。从因子表现来看，压抑两年的估值因子会出现反转，而成长因子预期会继续表现良好。市场抱团的龙头股估值已经很高，抱团的投资策略也已经比较拥挤。市场将回归基本面，未来大小市值、各行业股票的表现将更加均衡，量化投资全市场选股的优势将得以更好体现。近期，我们也观察到，市场也正在朝着我们预期的方向转化，尽管可能仍会有一些的反复，但大方向上应该还是比较确定的。

当然，短期市场走势上可能会有一定的波动。原因可能来自全球流动性边际收紧或经济复苏边际降速带来的市场情绪上的影响。但我们认为，当前 A 股市场整体基本面较好，如果出现比较大的波动，会是很不错的买入风格更加均衡的量化基金的机会。

在组合管理方面，本基金还是坚持利用量化选股策略，在有效控制主动投资风险的前提下，力求继续获得超越市场的超额收益。

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、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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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。本基金本报告期未进行收益分配。

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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在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（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。

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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞量化对冲稳健收益定期开放混合型发起式证券投资基金

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	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	14,189,710.32	14,916,136.89
结算备付金		63,730,539.14	39,160,749.88
存出保证金		14,114,497.23	46,397,599.78
交易性金融资产	6.4.7.2	120,776,913.82	387,011,014.96
其中：股票投资		120,776,913.82	386,226,850.96
基金投资		-	-
债券投资		-	784,164.00
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		193,812.30	442,641.91
应收利息	6.4.7.5	37,073.34	32,436.44
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		213,042,546.15	487,960,579.86
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		259,291.45	622,157.28
应付托管费		43,215.21	103,692.89
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	484,969.56	370,314.15
应交税费		-	2.30

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	89,260.15	180,000.00
负债合计		876,736.37	1,276,166.62
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	172,791,267.40	405,199,202.90
未分配利润	6.4.7.10	39,374,542.38	81,485,210.34
所有者权益合计		212,165,809.78	486,684,413.24
负债和所有者权益总计		213,042,546.15	487,960,579.86

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.2279 元，基金份额总额 172,791,267.40 份。

6.2 利润表

会计主体：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

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		12,362,048.04	12,723,125.96
1.利息收入		717,593.88	622,012.48
其中：存款利息收入	6.4.7.11	673,008.02	226,109.91
债券利息收入		1,033.09	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		43,552.77	395,902.57
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		38,900,488.53	9,277,948.50
其中：股票投资收益	6.4.7.12	51,264,864.55	10,352,703.48
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	134,763.82	-
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	-13,591,696.89	-3,734,433.20
股利收益	6.4.7.16	1,092,557.05	2,659,678.22
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-27,269,401.85	2,823,124.45
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	13,367.48	40.53
减：二、费用		5,449,319.45	2,693,935.08
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,144,081.45	1,742,529.96
2. 托管费	6.4.10.2.2	524,013.53	290,421.70

3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	1,673,046.76	550,153.87
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		1,823.93	6,669.74
7. 其他费用	6.4.7.20	106,353.78	104,159.81
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		6,912,728.59	10,029,190.88
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		6,912,728.59	10,029,190.88

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：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

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 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）	405,199,202.90	81,485,210.34	486,684,413.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	6,912,728.59	6,912,728.59
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）	-232,407,935.50	-49,023,396.55	-281,431,332.05
其中：1. 基金申购款	13,249,107.99	2,833,096.05	16,082,204.04
2. 基金赎回款	-245,657,043.49	-51,856,492.60	-297,513,536.09
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）	172,791,267.40	39,374,542.38	212,165,809.78
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		

26 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 79,761,839.44 份基金份额，其中认购资金利息折合 7,001.00 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。

本基金为发起式基金。发起认购金额均为华泰柏瑞基金管理有限公司使用自有资金认购本基金的净有效认购金额合计 10,000,000.00 元及认购资金利息 1,600.00 元，折合为 10,001,600.00 份基金份额，承诺持有期限为 3 年。

根据《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基金合同》和《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招募说明书》的有关规定，本基金每六个月开放一次，每次开放期不超过 5 个工作日，每个开放期所在月份为基金合同生效日所在月份后续每六个日历月中最后一个日历月，每个开放期的首日为当月沪深 300 股指期货交割日前五个工作日的第一个工作日。本基金的首个封闭期为自基金合同生效日起至第一个开放期的首日（不含该日）之间的期间，之后的封闭期为每相邻两个开放期之间的期间。本基金在封闭期内不办理申购与赎回业务。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《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上市的股票）、存托凭证、股指期货、权证、债券（国债、金融债、企业/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。本基金的投资组合比例为：本基金权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的价值的比例范围为 80%-120%，其中，权益类空头头寸的价值是指融券卖出的股票市值、卖出股指期货的合约价值及卖出其他权益类衍生工具的合约价值的合计值；权益类多头头寸的价值是指买入持有的股票市值、买入股指期货的合约价值及买入其他权益类衍生工具的合约价值的合计值。开放期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；封闭期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%。开放期内，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。

在封闭期内,本基金不受上述 5%的限制。本基金的业绩比较基准为:1 年期银行定期存款收益率(税后)。

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》、《华泰柏瑞量化对冲稳健收益定期开放混合型发起式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 1 月 1 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 1 月 1 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 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本年度采用的会计政策和会计估计与上年度相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错。

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[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。

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	14,189,710.32
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：	14,189,710.32

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	111,493,683.94	120,776,913.82	9,283,229.88
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	111,493,683.94	120,776,913.82	9,283,229.88

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	-113,601,240.00	-	-	

股指期货	-113,601,240.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	-113,601,240.00	-	-	

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：无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有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	1,390.38
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	35,608.56
应收债券利息	-
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	74.40
合计	37,073.34

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

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	484,969.56

银行间市场应付交易费用	-
合计	484,969.56

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	89,260.15
合计	89,260.15

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	405,199,202.90	405,199,202.90
本期申购	13,249,107.99	13,249,107.99
本期赎回(以“-”号填列)	-245,657,043.49	-245,657,043.49
- 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	172,791,267.40	172,791,267.40

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	19,249,828.92	62,235,381.42	81,485,210.34
本期利润	34,182,130.44	-27,269,401.85	6,912,728.59
本期基金份额交易产生的变动数	-27,268,477.51	-21,754,919.04	-49,023,396.55
其中：基金申购款	1,486,713.84	1,346,382.21	2,833,096.05
基金赎回款	-28,755,191.35	-23,101,301.25	-51,856,492.60
本期已分配利润	-	-	-

本期末	26,163,481.85	13,211,060.53	39,374,542.38
-----	---------------	---------------	---------------

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	66,008.73
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	606,282.15
其他	717.14
合计	673,008.02

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1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	624,141,366.38
减：卖出股票成本总额	572,876,501.83
买卖股票差价收入	51,264,864.55

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

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30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	134,763.82
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	134,763.82

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	16,027,726.49
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	15,637,000.00
减：应收利息总额	255,962.67
买卖债券差价收入	134,763.82

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：本基金本报告期末无衍生工具收益。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
国债期货投资收益	-
股指期货-投资收益	-13,591,696.89

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,092,557.05
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	1,092,557.05

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 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-30,188,641.85
——股票投资	-30,162,477.85
——债券投资	-26,164.00
——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	2,919,240.00
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	-27,269,401.85

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	13,367.48
合计	13,367.48

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	1,673,046.76
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	1,673,046.76

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	8,093.63
银行间账户服务费	9,000.00
合计	106,353.78

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

注：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

注：截止资产负债表日，本基金并无须作披露的资产负债表或有事项。

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	基金管理人、基金注册登记人、基金直销机构
中国银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
华泰证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
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：关联方与基金进行的关联交易均在正常业务范围内按照一般商业条款而订立的。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
华泰证券	19,748,402.43	2.07%	-	-

6.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期与上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量 的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
华泰证券	18,284.51	2.07%	18,284.51	2.07%
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日			

	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
-	-	-	-	-

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1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,144,081.45	1,742,529.96
其中：支付销售机构的客户维护费	74,612.12	71,971.98

注：本基金应支付基金管理人报酬，按前一日基金资产净值的 1.50% 的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的管理人报酬

E 为前一日的基金资产净值

基金管理人报酬每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	524,013.53	290,421.70

注：本基金应支付基金托管人托管费，按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前两个工作日内从

基金资产中一次性支取。

6.4.10.2.3 销售服务费

注：本基金本期与上年度可比期间无发生关联方销售服务费。

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：本基金本期与上年度可比期间未发生与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：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

份额单位：份

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
基金合同生效日（2016年5月26日）持有的基金份额	10,001,600.00	10,001,600.00
报告期初持有的基金份额	10,001,600.00	10,001,600.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	10,001,600.00	10,001,600.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	5.7883%	2.3415%

注：1. 期间买入/申购总份额含转换入份额，期间卖出/赎回总份额含转换出份额。

2. 基金管理人投资本基金适用的认(申)购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本报告期及上年度可比期间内，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1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	14,189,710.32	66,008.73	67,333,025.72	63,504.76

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。

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1月1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	688656	浩欧博	网下申购	1,371	48,341.46
华泰联合证券	688350	富淼科技	网下申购	2,552	34,656.16
华泰联合证券	300952	恒辉安防	网下申购	3,398	39,824.56
华泰联合证券	688083	中望软件	网下申购	1,158	174,279.00
华泰联合证券	605389	长龄液压	网下申购	356	14,026.40
华泰联合证券	688097	博众精工	网下申购	3,983	44,888.41
华泰联合证券	688314	康拓医疗	网下申购	1,085	18,813.90
华泰联合证券	688613	奥精医疗	网下申购	2,617	42,997.31
华泰联合证券	605499	东鹏饮料	网下申购	632	29,242.64
上年度可比期间 2020年1月1日至2020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
-	-	-	-	-	-

6.4.10.8 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须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：无。

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
688239	航宇科技	2021年6月25日	2021年7月5日	新股未上市	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48	-
688087	英科再生	2021年6月30日	2021年7月9日	新股未上市	21.96	21.96	1,728	37,946.88	37,946.88	-
688226	威腾电气	2021年6月28日	2021年7月7日	新股未上市	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
605287	德才股份	2021年6月28日	2021年7月6日	新股未上市	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	新股未上市	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
688690	纳微科技	2021年6月16日	2021年12月23日	新股锁定期内	8.07	79.89	3,477	28,059.39	277,777.53	-
688609	九联科技	2021年3月15日	2021年9月23日	新股锁定期内	3.99	15.29	10,372	41,384.28	158,587.88	-
688687	凯因科技	2021年1月29日	2021年8月9日	新股锁定期内	18.98	27.98	5,354	101,618.92	149,804.92	-
300957	贝泰妮	2021年3月18日	2021年9月27日	新股锁定期内	47.33	251.96	349	16,518.17	87,934.04	-
688662	富信	2021年	2021	新股锁	15.61	29.51	2,556	39,899.16	75,427.56	-

	科技	3月25日	年10月8日	定期内							
688636	智明达	2021年3月30日	2021年10月8日	新股锁定期内	34.50	80.72	918	31,671.00	74,100.96		-
688113	联测科技	2021年4月26日	2021年11月8日	新股锁定期内	19.14	49.29	1,415	27,083.10	69,745.35		-
300979	华利集团	2021年4月15日	2021年10月26日	新股锁定期内	33.22	87.50	541	17,972.02	47,337.50		-
300973	立高食品	2021年4月8日	2021年10月15日	新股锁定期内	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60		-
300981	中红医疗	2021年4月19日	2021年10月27日	新股锁定期内	48.59	90.39	258	12,536.22	23,320.62		-
300941	创识科技	2021年2月2日	2021年8月9日	新股锁定期内	21.31	49.94	399	8,502.69	19,926.06		-
301015	百洋医药	2021年6月22日	2021年12月30日	新股锁定期内	7.64	38.83	436	3,331.04	16,929.88		-
300932	三友联众	2021年1月15日	2021年7月22日	新股锁定期内	24.69	31.71	492	12,147.48	15,601.32		-
300982	苏文电能	2021年4月19日	2021年10月27日	新股锁定期内	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93		-
301009	可靠股份	2021年6月8日	2021年12月17日	新股锁定期内	12.54	27.89	509	6,382.86	14,196.01		-
300968	格林精密	2021年4月6日	2021年10月15日	新股锁定期内	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34		-
300940	南极	2021年	2021	新股锁	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66		-

	光	1月27日	年8月3日	定期内							
300614	百川畅银	2021年5月18日	2021年11月25日	新股锁定期内	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02		-
300937	药易购	2021年1月20日	2021年7月27日	新股锁定期内	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24		-
301013	利和兴	2021年6月21日	2021年12月29日	新股锁定期内	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81		-
300942	易瑞生物	2021年2月2日	2021年8月9日	新股锁定期内	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36		-
300933	中辰股份	2021年1月15日	2021年7月22日	新股锁定期内	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28		-
301002	崧盛股份	2021年5月27日	2021年12月7日	新股锁定期内	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62		-
300956	英力股份	2021年3月16日	2021年9月27日	新股锁定期内	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80		-
300962	中金辐照	2021年3月29日	2021年10月11日	新股锁定期内	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12		-
300952	恒辉安防	2021年3月3日	2021年9月13日	新股锁定期内	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20		-
300966	共同药业	2021年3月31日	2021年10月11日	新股锁定期内	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44		-
300945	曼卡龙	2021年2月3日	2021年8月10日	新股锁定期内	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12		-
300948	冠中生态	2021年2月18日	2021年8月25日	新股锁定期内	13.00	27.42	324	2,808.00	8,884.08		-
300931	通用	2021年	2021	新股锁	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92		-

	电梯	1月13日	年7月21日	定期内							
300961	深水海纳	2021年3月23日	2021年9月30日	新股锁定期内	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-	
300950	德固特	2021年2月24日	2021年9月3日	新股锁定期内	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-	
300986	志特新材	2021年4月21日	2021年11月1日	新股锁定期内	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-	
300987	川网传媒	2021年4月28日	2021年11月11日	新股锁定期内	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-	
300978	东箭科技	2021年4月15日	2021年10月26日	新股锁定期内	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-	
300926	博俊科技	2020年12月29日	2021年7月7日	新股锁定期内	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-	
300930	屹通新材	2021年1月13日	2021年7月21日	新股锁定期内	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-	
300985	致远新能	2021年4月21日	2021年10月29日	新股锁定期内	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	-	
300991	创益通	2021年5月12日	2021年11月22日	新股锁定期内	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-	
300963	中洲特材	2021年3月30日	2021年10月11日	新股锁定期内	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-	
301011	华立科技	2021年6月9日	2021年12月17日	新股锁定期内	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-	
300929	华骐环保	2021年1月12日	2021年7月	新股锁定期内	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-	

		日	20 日							
300995	奇德新材	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 26 日	新股锁定期内	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	新股锁定期内	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	新股锁定期内	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	新股锁定期内	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
300919	中伟股份	2020 年 12 月 15 日	2021 年 7 月 2 日	新股锁定期内	24.60	163.00	530	13,038.00	86,390.00	-

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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	------	------	-----	--------	------	--------	-------	--------	--------	----

			因							
688368	晶丰明源	2021年6月21日	临时停牌	335.26	2021年7月5日	402.31	200	66,488.00	67,052.00	-

注：本基金截至 2021 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

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：无。

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、债券投资和股指期货投资等。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，将风险控制可在可承受的范围内。

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。

于 2021 年 6 月 30 日，本基金无债券投资。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	0.00	634,000.00
AAA 以下	0.00	150,164.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	784,164.00

注：债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

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于约定开放日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于开放期内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，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》且于基金开放期内按照《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组合持仓集中度指标、流通受限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上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%，于开放期内，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 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 0.77%。

于开放期内，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、结算备付金和存出保证金等。

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	14,189,710.32	-	-	-	-	-	14,189,710.32
结算备付金	63,730,539.14	-	-	-	-	-	63,730,539.14
存出保证金	165,217.23	-	-	-	-	13,949,280.00	14,114,497.23
交易性金融资产	-	-	-	-	-	120,776,913.82	120,776,913.82
应收证券清算款	-	-	-	-	-	2,836,572.30	2,836,572.30
应收利息	-	-	-	-	-	37,073.34	37,073.34
其他资产	-	-	-	-	-	-2,642,760.00	-2,642,760.00
资产总计	78,085,466.69	-	-	-	-	134,957,079.46	213,042,546.15
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	259,291.45	259,291.45
应付托管费	-	-	-	-	-	43,215.21	43,215.21

应付交易费用	-	-	-	-	-	484,969.56	484,969.56
其他负债	-	-	-	-	-	89,260.15	89,260.15
负债总计	-	-	-	-	-	876,736.37	876,736.37
利率敏感度缺口	78,085,466.69	-	-	-	-	134,080,343.09	212,165,809.78
上年度末 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	14,916,136.89	-	-	-	-	-	14,916,136.89
结算备付金	39,160,749.88	-	-	-	-	-	39,160,749.88
存出保证金	46,778.98	-	-	-	-	46,350,820.80	46,397,599.78
交易性金融资产	-	-	-	-	784,164.00	386,226,850.96	387,011,014.96
应收证券清算款	-	-	-	-	-	442,641.91	442,641.91
应收利息	-	-	-	-	-	32,436.44	32,436.44
资产总计	54,123,665.75	-	-	-	784,164.00	433,052,750.11	487,960,579.86
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	622,157.28	622,157.28
应付托管费	-	-	-	-	-	103,692.89	103,692.89
应付交易费用	-	-	-	-	-	370,314.15	370,314.15
应交税费	-	-	-	-	-	2.30	2.30
其他负债	-	-	-	-	-	180,000.00	180,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	1,276,166.62	1,276,166.62
利率敏感度缺口	54,123,665.75	-	-	-	784,164.00	431,776,583.49	486,684,413.24

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，本基金未持有交易性债券投资（2020 年 12 月 31 日：0.16%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2020 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金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。本基金的投资组合中权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的价值的比例范围为 80%-120%，其中，权益类空头头寸的价值是指融券卖出的股票及存托凭证市值、卖出股指期货的合约价值及卖出其他权益类衍生工具的合约价值的合计值；权益类多头头寸的价值是指买入持有的股票及存托凭证市值、买入股指期货的合约价值及买入其他权益类衍生工具的合约价值的合计值。开放期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；封闭期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%。开放期内，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制。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		上年度末 2020 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	120,776,913.82	56.93	386,226,850.96	79.36

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	120,776,913.82	56.93	386,226,850.96	79.36

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除 1 年期银行定期存款收益率(税后)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)	上年度末(2020年12月31日)
	1 年期银行定期存款收益率(税后)上升 5%	2,758,731.51	86,465,043.37
1 年期银行定期存款收益率(税后)下降 5%	-2,758,731.51	-86,465,043.37	

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	120,776,913.82	56.69
	其中：股票	120,776,913.82	56.69
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	77,920,249.46	36.57
8	其他各项资产	14,345,382.87	6.73
9	合计	213,042,546.15	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	268,824.40	0.13
B	采矿业	2,099,850.60	0.99
C	制造业	68,388,670.46	32.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,349,804.39	0.64
E	建筑业	2,081,918.37	0.98
F	批发和零售业	548,376.24	0.26
G	交通运输、仓储和邮政业	3,704,077.00	1.75
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,041,384.67	1.43
J	金融业	30,010,431.44	14.14
K	房地产业	2,203,770.00	1.04
L	租赁和商务服务业	2,624,420.00	1.24
M	科学研究和技术服务业	1,503,427.80	0.71
N	水利、环境和公共设施管理业	36,272.33	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,438,608.12	1.15
R	文化、体育和娱乐业	477,078.00	0.22
S	综合	-	-
	合计	120,776,913.82	56.93

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：本基金本报告期没有通过港股通投资的股票。

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	600519	贵州茅台	3,521	7,241,640.70	3.41
2	600036	招商银行	69,600	3,771,624.00	1.78
3	601318	中国平安	51,900	3,336,132.00	1.57
4	000858	五粮液	10,900	3,247,001.00	1.53
5	601919	中远海控	86,600	2,644,764.00	1.25
6	601012	隆基股份	24,347	2,162,987.48	1.02
7	600276	恒瑞医药	25,200	1,712,844.00	0.81
8	601166	兴业银行	81,800	1,680,990.00	0.79
9	300059	东方财富	49,860	1,634,909.40	0.77
10	601328	交通银行	309,700	1,517,530.00	0.72
11	688036	传音控股	6,943	1,454,558.50	0.69
12	601888	中国中免	4,700	1,410,470.00	0.66
13	000333	美的集团	19,500	1,391,715.00	0.66
14	002475	立讯精密	27,500	1,265,000.00	0.60
15	601336	新华保险	27,300	1,253,343.00	0.59
16	000157	中联重科	134,095	1,239,037.80	0.58
17	000001	平安银行	54,600	1,235,052.00	0.58
18	000725	京东方A	191,500	1,194,960.00	0.56
19	601636	旗滨集团	63,962	1,187,134.72	0.56
20	601818	光大银行	308,700	1,166,886.00	0.55
21	603444	吉比特	2,200	1,166,000.00	0.55
22	600809	山西汾酒	2,600	1,164,800.00	0.55
23	300244	迪安诊断	29,800	1,141,340.00	0.54
24	002415	海康威视	17,600	1,135,200.00	0.54
25	688396	华润微	12,400	1,128,648.00	0.53

26	000488	晨鸣纸业	136,400	1,110,296.00	0.52
27	600061	国投资本	124,944	1,060,774.56	0.50
28	601211	国泰君安	61,600	1,055,824.00	0.50
29	600999	招商证券	55,000	1,046,100.00	0.49
30	603355	莱克电气	16,600	1,033,018.00	0.49
31	600884	杉杉股份	44,200	1,030,744.00	0.49
32	601717	郑煤机	88,600	1,030,418.00	0.49
33	601288	农业银行	338,100	1,024,443.00	0.48
34	603259	药明康德	6,420	1,005,307.80	0.47
35	601169	北京银行	201,100	979,357.00	0.46
36	000568	泸州老窖	4,100	967,354.00	0.46
37	300122	智飞生物	5,100	952,323.00	0.45
38	300463	迈克生物	22,300	938,607.00	0.44
39	000898	鞍钢股份	206,100	917,145.00	0.43
40	002092	中泰化学	89,000	914,030.00	0.43
41	002027	分众传媒	95,000	893,950.00	0.42
42	300347	泰格医药	4,400	850,520.00	0.40
43	601628	中国人寿	24,600	833,694.00	0.39
44	601881	中国银河	76,849	828,432.22	0.39
45	000651	格力电器	15,500	807,550.00	0.38
46	002142	宁波银行	20,300	791,091.00	0.37
47	601186	中国铁建	103,500	769,005.00	0.36
48	600380	健康元	56,000	768,880.00	0.36
49	688099	晶晨股份	6,800	762,960.00	0.36
50	601899	紫金矿业	77,740	753,300.60	0.36
51	600060	海信视像	44,100	745,290.00	0.35
52	601390	中国中铁	138,400	725,216.00	0.34
53	300033	同花顺	6,400	721,792.00	0.34
54	600900	长江电力	34,700	716,208.00	0.34
55	603986	兆易创新	3,800	714,020.00	0.34
56	000656	金科股份	123,100	712,749.00	0.34
57	002812	恩捷股份	3,000	702,300.00	0.33
58	600000	浦发银行	70,200	702,000.00	0.33
59	601998	中信银行	134,446	685,674.60	0.32
60	600887	伊利股份	18,100	666,623.00	0.31
61	000528	柳工	81,200	665,840.00	0.31
62	300014	亿纬锂能	6,400	665,152.00	0.31
63	600438	通威股份	15,200	657,704.00	0.31
64	000776	广发证券	43,400	657,076.00	0.31

65	688083	中望软件	1,158	639,563.40	0.30
66	002124	天邦股份	89,800	629,498.00	0.30
67	600027	华电国际	180,400	620,576.00	0.29
68	000661	长春高新	1,600	619,200.00	0.29
69	600741	华域汽车	23,400	614,718.00	0.29
70	000039	中集集团	33,200	603,576.00	0.28
71	600030	中信证券	24,200	603,548.00	0.28
72	000671	阳光城	115,500	600,600.00	0.28
73	300223	北京君正	5,900	595,428.00	0.28
74	601598	中国外运	117,500	593,375.00	0.28
75	002048	宁波华翔	30,300	590,850.00	0.28
76	600409	三友化工	57,700	583,347.00	0.27
77	600782	新钢股份	104,400	582,552.00	0.27
78	601601	中国太保	20,000	579,400.00	0.27
79	603712	七一二	15,800	570,380.00	0.27
80	600383	金地集团	55,100	564,224.00	0.27
81	601618	中国中冶	188,700	562,326.00	0.27
82	300529	健帆生物	6,500	561,340.00	0.26
83	603799	华友钴业	4,800	548,160.00	0.26
84	002271	东方雨虹	9,900	547,668.00	0.26
85	002460	赣锋锂业	4,500	544,905.00	0.26
86	300142	沃森生物	8,800	542,960.00	0.26
87	300408	三环集团	12,300	521,766.00	0.25
88	603288	海天味业	4,000	515,800.00	0.24
89	600132	重庆啤酒	2,600	514,670.00	0.24
90	300207	欣旺达	15,600	507,936.00	0.24
91	601878	浙商证券	38,200	499,656.00	0.24
92	300676	华大基因	4,200	498,120.00	0.23
93	600196	复星医药	6,800	490,484.00	0.23
94	601377	兴业证券	50,100	483,966.00	0.23
95	600104	上汽集团	21,900	481,143.00	0.23
96	600426	华鲁恒升	15,040	465,488.00	0.22
97	300015	爱尔眼科	6,294	446,748.12	0.21
98	600660	福耀玻璃	7,900	441,215.00	0.21
99	600299	安迪苏	36,300	434,148.00	0.20
100	002925	盈趣科技	11,090	431,511.90	0.20
101	601088	中国神华	21,300	415,776.00	0.20
102	300433	蓝思科技	14,000	411,740.00	0.19
103	600176	中国巨石	26,135	405,353.85	0.19

104	601098	中南传媒	44,700	394,254.00	0.19
105	600522	中天科技	38,821	388,210.00	0.18
106	002384	东山精密	18,400	383,456.00	0.18
107	601658	邮储银行	74,900	375,998.00	0.18
108	600031	三一重工	12,700	369,189.00	0.17
109	600966	博汇纸业	28,000	365,400.00	0.17
110	000425	徐工机械	57,000	363,090.00	0.17
111	600309	万华化学	3,300	359,106.00	0.17
112	000799	酒鬼酒	1,400	357,840.00	0.17
113	002901	大博医疗	4,900	357,161.00	0.17
114	600989	宝丰能源	26,100	357,048.00	0.17
115	600015	华夏银行	56,800	351,592.00	0.17
116	300601	康泰生物	2,300	342,700.00	0.16
117	601607	上海医药	16,200	342,306.00	0.16
118	000625	长安汽车	12,800	336,384.00	0.16
119	002008	大族激光	8,300	335,237.00	0.16
120	000002	万科A	13,700	326,197.00	0.15
121	002064	华峰氨纶	22,800	323,760.00	0.15
122	600057	厦门象屿	51,200	320,000.00	0.15
123	002179	中航光电	3,900	308,178.00	0.15
124	600219	南山铝业	85,400	307,440.00	0.14
125	600919	江苏银行	42,800	303,880.00	0.14
126	601398	工商银行	58,700	303,479.00	0.14
127	601633	长城汽车	6,900	300,771.00	0.14
128	601225	陕西煤业	25,000	296,250.00	0.14
129	000932	华菱钢铁	44,700	295,020.00	0.14
130	600489	中金黄金	33,300	287,046.00	0.14
131	603659	璞泰来	2,100	286,860.00	0.14
132	688012	中微公司	1,700	282,064.00	0.13
133	688690	纳微科技	3,477	277,777.53	0.13
134	300037	新宙邦	2,700	270,270.00	0.13
135	002714	牧原股份	4,420	268,824.40	0.13
136	300450	先导智能	4,200	252,588.00	0.12
137	002709	天赐材料	2,360	251,528.80	0.12
138	002020	京新药业	28,900	245,650.00	0.12
139	002156	通富微电	10,000	240,400.00	0.11
140	603225	新凤鸣	11,800	239,540.00	0.11
141	601699	潞安环能	20,200	238,562.00	0.11
142	002007	华兰生物	6,200	227,416.00	0.11

143	300726	宏达电子	3,200	225,568.00	0.11
144	000717	韶钢松山	48,600	223,074.00	0.11
145	000012	南 玻 A	21,600	221,184.00	0.10
146	603893	瑞芯微	1,500	209,190.00	0.10
147	600141	兴发集团	11,000	207,130.00	0.10
148	601006	大秦铁路	30,900	203,322.00	0.10
149	600707	彩虹股份	21,000	197,610.00	0.09
150	000538	云南白药	1,700	196,724.00	0.09
151	300740	御家汇	8,900	185,832.00	0.09
152	601319	中国人保	31,300	185,609.00	0.09
153	601233	桐昆股份	7,700	185,493.00	0.09
154	002185	华天科技	11,800	181,602.00	0.09
155	002371	北方华创	600	166,428.00	0.08
156	002736	国信证券	15,000	161,250.00	0.08
157	688609	九联科技	10,372	158,587.88	0.07
158	600563	法拉电子	1,000	158,360.00	0.07
159	688111	金山办公	400	157,920.00	0.07
160	000100	TCL 科技	20,000	153,000.00	0.07
161	300146	汤臣倍健	4,600	151,340.00	0.07
162	688687	凯因科技	5,354	149,804.92	0.07
163	300677	英科医疗	1,200	149,760.00	0.07
164	688005	容百科技	1,232	149,318.40	0.07
165	688526	科前生物	4,100	148,502.00	0.07
166	688188	柏楚电子	330	143,880.00	0.07
167	000166	申万宏源	28,217	132,055.56	0.06
168	300595	欧普康视	1,260	130,473.00	0.06
169	000028	国药一致	3,400	128,656.00	0.06
170	600584	长电科技	2,700	101,736.00	0.05
171	600398	海澜之家	13,800	99,912.00	0.05
172	600019	宝钢股份	12,900	98,556.00	0.05
173	600018	上港集团	19,200	91,584.00	0.04
174	000513	丽珠集团	1,800	90,036.00	0.04
175	600028	中国石化	20,500	89,380.00	0.04
176	300957	贝泰妮	349	87,934.04	0.04
177	300919	中伟股份	530	86,390.00	0.04
178	601000	唐山港	35,000	84,350.00	0.04
179	600373	中文传媒	8,400	82,824.00	0.04
180	000429	粤高速 A	11,500	82,455.00	0.04
181	000887	中鼎股份	6,700	80,936.00	0.04

182	688662	富信科技	2,556	75,427.56	0.04
183	600690	海尔智家	2,900	75,139.00	0.04
184	688636	智明达	918	74,100.96	0.03
185	688113	联测科技	1,415	69,745.35	0.03
186	688208	道通科技	800	69,592.00	0.03
187	688368	晶丰明源	200	67,052.00	0.03
188	300659	中孚信息	1,900	63,783.00	0.03
189	002429	兆驰股份	10,200	61,914.00	0.03
190	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.03
191	300750	宁德时代	100	53,480.00	0.03
192	601615	明阳智能	3,000	48,570.00	0.02
193	300979	华利集团	541	47,337.50	0.02
194	603486	科沃斯	200	45,616.00	0.02
195	000977	浪潮信息	1,600	45,008.00	0.02
196	300973	立高食品	360	41,655.60	0.02
197	600729	重庆百货	1,400	38,430.00	0.02
198	688087	英科再生	1,728	37,946.88	0.02
199	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.02
200	002396	星网锐捷	1,500	32,025.00	0.02
201	601100	恒立液压	340	29,212.80	0.01
202	300981	中红医疗	258	23,320.62	0.01
203	300941	创识科技	399	19,926.06	0.01
204	600985	淮北矿业	1,600	19,536.00	0.01
205	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.01
206	600271	航天信息	1,300	16,939.00	0.01
207	301015	百洋医药	436	16,929.88	0.01
208	300932	三友联众	492	15,601.32	0.01
209	600216	浙江医药	900	14,409.00	0.01
210	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.01
211	301009	可靠股份	509	14,196.01	0.01
212	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.01
213	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.01
214	300940	南极光	307	13,317.66	0.01
215	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.01
216	300937	药易购	244	13,105.24	0.01
217	301013	利和兴	471	12,768.81	0.01
218	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.01
219	603171	税友股份	637	12,230.40	0.01
220	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.01

221	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.01
222	600837	海通证券	1,000	11,500.00	0.01
223	605287	德才股份	349	11,014.44	0.01
224	688002	睿创微纳	106	10,581.98	0.00
225	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
226	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
227	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
228	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
229	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
230	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
231	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
232	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
233	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
234	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
235	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
236	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
237	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
238	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
239	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
240	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
241	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
242	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
243	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
244	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
245	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
246	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
247	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
248	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
249	603128	华贸物流	300	4,227.00	0.00
250	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
251	000830	鲁西化工	200	3,746.00	0.00
252	688008	澜起科技	39	2,432.82	0.00
253	601009	南京银行	100	1,052.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	11,957,390.00	2.46
2	600276	恒瑞医药	5,538,917.00	1.14
3	601318	中国平安	5,168,866.00	1.06
4	000858	五粮液	4,402,152.00	0.90
5	000656	金科股份	4,131,326.00	0.85
6	600036	招商银行	4,074,835.00	0.84
7	603056	德邦股份	3,997,661.00	0.82
8	600061	国投资本	3,820,603.00	0.79
9	000725	京东方A	3,654,949.00	0.75
10	600000	浦发银行	3,567,690.00	0.73
11	600900	长江电力	3,545,033.00	0.73
12	300059	东方财富	3,392,801.17	0.70
13	002064	华峰氨纶	3,262,587.00	0.67
14	000001	平安银行	3,223,676.00	0.66
15	603259	药明康德	3,175,513.00	0.65
16	601658	邮储银行	3,152,582.00	0.65
17	000651	格力电器	3,124,721.00	0.64
18	601231	环旭电子	3,036,063.00	0.62
19	601818	光大银行	3,030,471.00	0.62
20	600809	山西汾酒	2,991,214.85	0.61

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	21,477,348.00	4.41
2	601318	中国平安	13,859,927.85	2.85
3	600036	招商银行	13,661,751.89	2.81
4	000858	五粮液	10,693,325.90	2.20
5	600809	山西汾酒	9,682,035.00	1.99
6	000333	美的集团	8,878,152.98	1.82
7	600276	恒瑞医药	7,314,438.00	1.50
8	000157	中联重科	7,196,160.00	1.48
9	601231	环旭电子	6,394,904.21	1.31

10	601166	兴业银行	6,058,779.58	1.24
11	601919	中远海控	6,024,763.00	1.24
12	601398	工商银行	5,830,385.00	1.20
13	002027	分众传媒	5,789,554.00	1.19
14	300122	智飞生物	5,377,272.96	1.10
15	601012	隆基股份	5,253,468.00	1.08
16	000932	华菱钢铁	5,132,983.82	1.05
17	601229	上海银行	4,908,150.90	1.01
18	600030	中信证券	4,684,446.00	0.96
19	002223	鱼跃医疗	4,611,985.03	0.95
20	603486	科沃斯	4,476,924.20	0.92

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	337,589,042.54
卖出股票收入（成交）总额	624,141,366.38

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

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 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

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IF2109	IF2109	-75	-116,244,000.00	-2,642,760.00	-

公允价值变动总额合计（元）	-2,642,760.00
股指期货投资本期收益（元）	-13,576,500.00
股指期货投资本期公允价值变动（元）	2,919,240.00

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金使用股指期货对冲市场风险，对冲掉投资组合对市场风险的暴露（贝塔）。基金经理会综合考虑各个月份期货合约之间的定价关系、套利机会、流动性以及保证金要求等因素，在各个月份期货合约之间进行动态配置，通过空头部分的优化创造额外收益。

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 市场中性策略执行情况

截至本报告期末，本基金持有股票资产 120,776,913.82 元，占基金资产净值的比例为 56.93%；运用股指期货进行对冲的空头合约市值 -116,244,000.00 元，占基金资产净值的比例为 -54.79%，空头合约市值占股票资产的比例为 -96.25%。

本报告期内，本基金执行市场中性策略的投资收益为 37,688,364.55 元，公允价值变动损益为 -27,243,237.85 元。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 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、处罚的情形。

7.13.2 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。

7.13.3 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	14,114,497.23
2	应收证券清算款	193,812.30
3	应收股利	-
4	应收利息	37,073.34
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,345,382.87

7.13.4 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。

7.13.5 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的情况。

§ 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

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
727	237,677.12	155,327,341.06	89.89%	17,463,926.34	10.11%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	1,099,419.69	0.6363%

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	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	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	0

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占 基金总份额 比例（%）	发起份额总数	发起份额占 基金总份额 比例（%）	发起份额承 诺持有期限
基金管理人固有资金	10,001,600.00	5.79	10,001,600.00	5.79	3年
基金管理人高级管理人员	0.00	0.00	0.00	0.00	-
基金经理等人员	0.00	0.00	0.00	0.00	-
基金管理人股东	0.00	0.00	0.00	0.00	-
其他	0.00	0.00	0.00	0.00	-
合计	10,001,600.00	5.79	10,001,600.00	5.79	-

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（ 2016 年 5 月 26 日 ）基金份额总额	79,761,839.44
本报告期期初基金份额总额	405,199,202.90
本报告期基金总申购份额	13,249,107.99
减：本报告期基金总赎回份额	245,657,043.49
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	172,791,267.40

§ 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	
银河证券	3	136,186,666.27	14.26%	124,456.71	14.11%	-
申万宏源	3	124,878,006.29	13.08%	115,332.38	13.08%	-
方正证券	3	112,430,875.41	11.77%	104,703.89	11.87%	-
中泰证券	2	108,578,907.50	11.37%	101,117.68	11.47%	-
长江证券	4	99,881,196.37	10.46%	91,812.80	10.41%	-
国信证券	2	66,052,777.78	6.92%	61,514.68	6.98%	-

中金公司	2	56,210,959.23	5.89%	52,175.07	5.92%	-
申港证券	2	42,659,068.63	4.47%	39,352.86	4.46%	-
兴业证券	3	38,699,357.35	4.05%	35,522.50	4.03%	-
西藏东方财富	2	38,329,223.55	4.01%	35,407.36	4.02%	-
国金证券	1	22,885,504.46	2.40%	21,312.75	2.42%	-
华泰证券	4	19,748,402.43	2.07%	18,284.51	2.07%	-
瑞银证券	2	19,180,695.34	2.01%	17,479.61	1.98%	-
东方证券	3	14,023,361.99	1.47%	12,779.45	1.45%	-
广发证券	2	13,698,273.27	1.43%	12,482.99	1.42%	-
中信证券	3	12,404,831.93	1.30%	11,304.68	1.28%	-
华福证券	1	10,852,378.74	1.14%	9,889.49	1.12%	-
中银国际	3	6,175,193.27	0.65%	5,748.87	0.65%	-
华创证券	1	6,093,897.00	0.64%	5,553.45	0.63%	-
万联证券	2	5,483,143.20	0.57%	4,996.54	0.57%	-
安信证券	3	630,807.21	0.07%	587.46	0.07%	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	3	-	-	-	-	-
新时代证券	2	-	-	-	-	-
西藏同信	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
华龙证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国联证券	2	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-

国都证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
北京高华	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为，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服务。
- 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
银河证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	814,925.80	2.69%	-	-	-	-
方正证券	28,520,263.02	94.17%	-	-	-	-

中泰证券	201,180.90	0.66%	120,000,000.00	70.59%	-	-
长江证券	383,019.30	1.26%	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	130,295.00	0.43%	-	-	-	-
申港证券	-	-	50,000,000.00	29.41%	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	237,061.65	0.78%	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
西藏同信	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
华龙证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-

国泰君安	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
北京高华	-	-	-	-	-	-

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
3	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
4	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
5	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
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14日
7	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对冲策略执行情况公告	证监会规定报刊和网站	2021年5月13日
8	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12日
9	关于华泰柏瑞量化对冲稳健收益	证监会规定报刊和	2021年5月7日

	定期开放混合型发起式证券投资基金第十个开放期开放日常申购、赎回、转换业务的公告	网站	
10	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
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	2021 年 4 月 30 日
12	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
13	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
14	华泰柏瑞基金管理有限公司关于调整旗下部分基金在招商银行定投起点的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 3 月 31 日
15	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金在东方财富证券股份有限公司开通基金定期定额投资业务及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 3 月 18 日
16	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 3 月 5 日
17	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 3 月 4 日
18	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 2 月 27 日
19	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	2021 年 2 月 19 日
20	关于终止包商银行股份有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 2 月 9 日
21	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 1 月 22 日
22	华泰柏瑞基金管理有限公司关于网上直销直连招商银行升级签约	证监会规定报刊和网站	2021 年 1 月 14 日

	方式的提示性公告		
23	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金参加北京增财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 1 月 7 日
24	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 1 月 7 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20210101-20210514;20210518-20210630;	107,055,351.56	0.00	61,000,000.00	46,055,351.56	26.65%
	2	20210101-20210630;	84,559,445.29	0.00	43,000,000.00	41,559,445.29	24.05%
	3	20210101-20210517;	85,920,976.25	0.00	85,920,976.25	0.00	0.00%
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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、本基金的中国证监会批准募集文件
- 2、本基金的《基金合同》
- 3、本基金的《招募说明书》
- 4、本基金的《托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、本基金的公告

12.2 存放地点

上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

托管人住所

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。投资者对本报告如有疑问，可咨询基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司。客户服务热线：400-888-0001（免长途费）021-3878 4638 公司网址：www.huatai-pb.com

华泰柏瑞基金管理有限公司

2021 年 8 月 28 日