

华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券 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的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，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、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 2021 年 6 月 30 日止。

华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金于 2018 年 10 月 16 日根据收费方式分不同，新增 C 类份额，C 类相关指标从 2018 年 10 月 16 日开始计算。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	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	11
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	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	15
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	17
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
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	17
§5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	18
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	18
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	18
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	19
6.1 资产负债表	19
6.2 利润表	20
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	21

6.4 报表附注.....	22
§7 投资组合报告.....	50
7.1 期末基金资产组合情况.....	50
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	50
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.....	51
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	58
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	60
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.....	60
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.....	60
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.....	61
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.....	61
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	61
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	61
7.12 投资组合报告附注.....	61
§8 基金份额持有人信息.....	63
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	63
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	63
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.....	63
§9 开放式基金份额变动.....	65
§10 重大事件揭示.....	66
10.1 基金份额持有人大会决议.....	66
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.....	66
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	66
10.4 基金投资策略的改变.....	66
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	66
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.....	66
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	66
10.8 其他重大事件.....	69
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	72
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.....	72

11.2 影响投资者决策的其他重要信息	72
§12 备查文件目录.....	73
12.1 备查文件目录.....	73
12.2 存放地点.....	73
12.3 查阅方式.....	73

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	华泰柏瑞量化阿尔法	
基金主代码	005055	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 9 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	179,497,382.09 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	华泰柏瑞量化阿尔法 A	华泰柏瑞量化阿尔法 C
下属分级基金的交易代码:	005055	006532
报告期末下属分级基金的份额总额	179,348,846.28 份	148,535.81 份

2.2 基金产品说明

投资目标	利用定量投资模型，在严格控制风险的前提下，追求资产的长期增值，力争实现超越业绩比较基准的投资回报
投资策略	本基金为灵活配置混合型基金，基金管理人将跟踪宏观经济变量和国家财政、税收和货币政策等指标，判断经济周期的阶段和未来经济发展的趋势，研究预测宏观经济和国家政策等因素对证券市场的影响，分析比较股票、债券等市场和不同金融工具的风险收益特征，估计各子资产类的相关性矩阵，并在此基础上确定基金资产在各类别资产间的分配比例。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险与预期收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华泰柏瑞基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	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	北京市西城区复兴门内大街 1

	弄上海证大五道口广场 1 号 17 层	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	中国证券报
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	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华泰柏瑞基金管理有限公司	上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	华泰柏瑞量化阿尔法 A	华泰柏瑞量化阿尔法 C
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)	报告期(2021 年 1 月 1 日 – 2021 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	32,266,439.55	26,305.36
本期利润	22,343,489.07	13,371.98
加权平均基金份额本期利润	0.1112	0.0754
本期加权平均净值利润率	7.55%	5.08%
本期基金份额净值增长率	7.34%	7.21%
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	95,405,169.44	80,621.85
期末可供分配基金份额利润	0.5320	0.5428
期末基金资产净值	274,754,015.72	229,157.66
期末基金份额净值	1.5320	1.5428
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	53.20%	86.06%

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

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

华泰柏瑞量化阿尔法 A

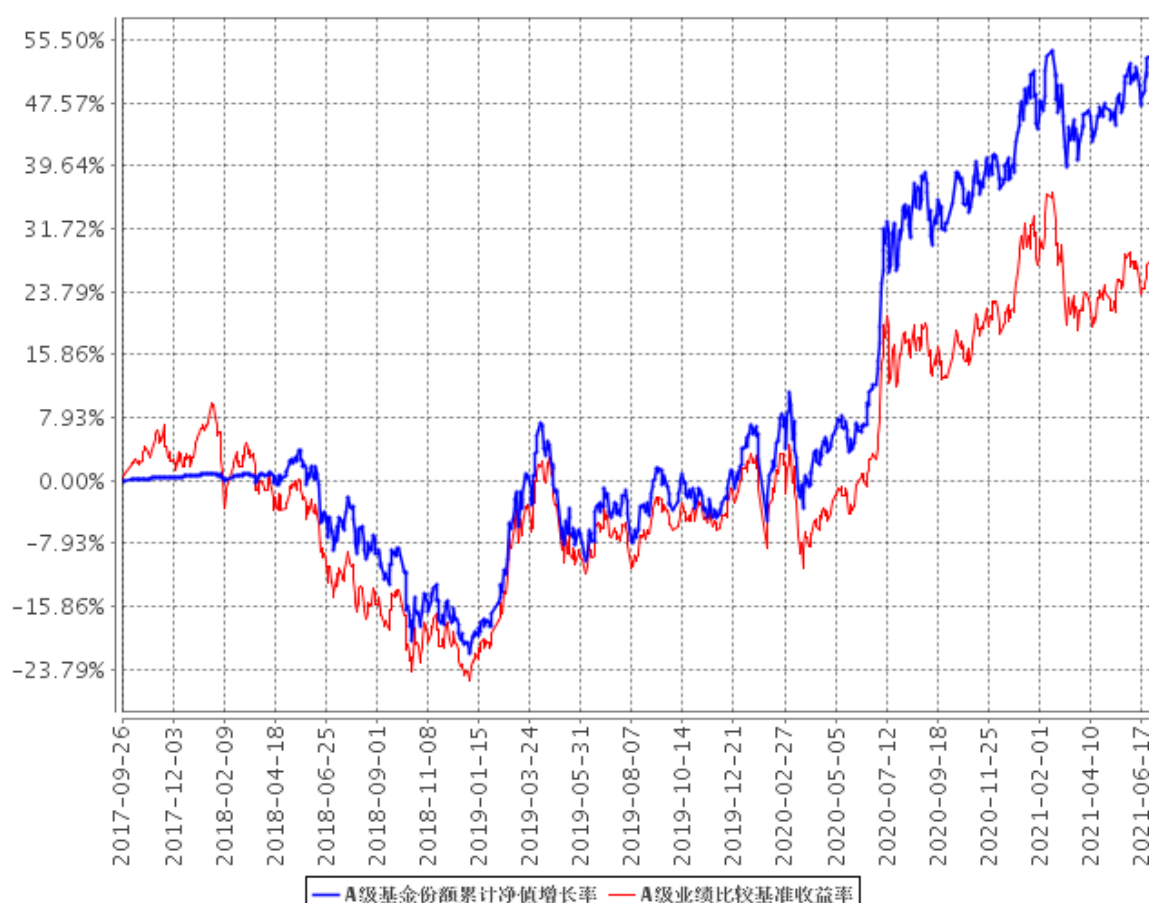
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.91%	0.77%	-1.23%	0.73%	2.14%	0.04%
过去三个月	6.01%	0.73%	4.46%	0.84%	1.55%	-0.11%
过去六个月	7.34%	1.05%	1.69%	1.15%	5.65%	-0.10%
过去一年	34.23%	1.19%	21.97%	1.22%	12.26%	-0.03%
过去三年	60.82%	1.29%	42.12%	1.29%	18.70%	0.00%
自基金合同生效起至今	53.20%	1.18%	26.93%	1.24%	26.27%	-0.06%

华泰柏瑞量化阿尔法 C

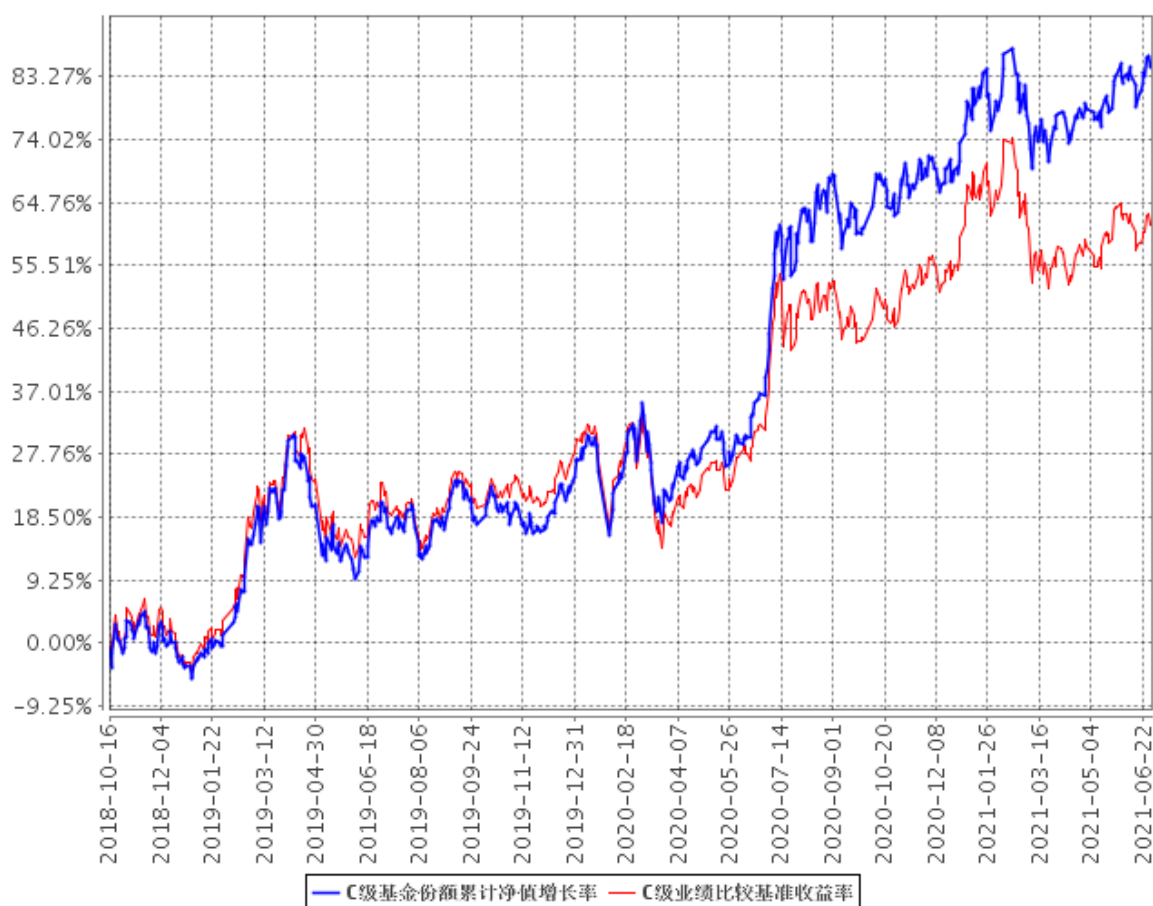
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.89%	0.77%	-1.23%	0.73%	2.12%	0.04%
过去三个月	5.94%	0.73%	4.46%	0.84%	1.48%	-0.11%
过去六个月	7.21%	1.05%	1.69%	1.15%	5.52%	-0.10%
过去一年	33.85%	1.19%	21.97%	1.22%	11.88%	-0.03%
自基金合同生效起至今	86.06%	1.27%	62.33%	1.28%	23.73%	-0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：A 级图示日期为 2017 年 9 月 26 日至 2021 年 6 月 30 日。C 级图示日期为 2018 年 10 月 16 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		
盛豪	量化与海外投资部量化投资	2017 年 9 月 26 日	—	13 年	英国剑桥大学数学系硕士。2007 年 10 月至 2010 年 3 月任 Wilshire Associates 量化研究员，

	总监、本基金的基金经理				2010 年 11 月至 2012 年 8 月任 Goldenberg Hehmeyer Trading Company 交易员。2012 年 9 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任量化投资部研究员、基金经理助理。2015 年 1 月起任量化投资部副总监，2015 年 10 月起任华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金和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。2016 年 12 月至 2018 年 11 月任华泰柏瑞行业竞争优势灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 3 月至 2018 年 10 月任华泰柏瑞盛利灵活配置混合型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 3 月至 2018 年 3 月任华泰柏瑞嘉利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 4 月至 2018 年 4 月任华泰柏瑞泰利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 4 月至 2019 年 3 月任华泰柏瑞睿利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 6 月至 2020 年 6 月任华泰柏瑞精选回报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 月起任华泰柏瑞港股通量化灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 3 月起任华泰柏瑞量化明选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金经理。
田汉卿	副总经理、本基金的基金经理	2017 年 9 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。
--	--	--	--	--	---

注：证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。任职日期和离任日期指基金管理公司作出决定之日。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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，不存在不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

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 下跌 3.90%，沪深 300 微涨 0.24%；代表成长类的创业板指和科创 50 分别上涨 17.22% 和 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% 和 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。

本报告期内，我们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

截至本报告期末华泰柏瑞量化阿尔法 A 基金份额净值为 1.5320 元，本报告期基金份额净值增长率为 7.34%；截至本报告期末华泰柏瑞量化阿尔法 C 基金份额净值为 1.5428 元，本报告期基金份额净值增长率为 7.21%；同期业绩比较基准收益率为 1.69%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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。消费、医药等少数分高估值的行业板块短期估值上有一定的压力；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比较敏感，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，尽管可能仍会有一定的反复，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

根据基金合同的规定，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准；基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值。截止本报告期末，本基金可分配收益为 95,485,791.29 元，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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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”部分未在本托管人复核范围内）、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：华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置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	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	17,979,098.94	21,754,328.87
结算备付金		770,309.16	1,071,420.69
存出保证金		71,137.58	158,837.48
交易性金融资产	6.4.7.2	257,904,130.45	337,336,972.50
其中：股票投资		252,926,630.45	336,247,028.50
基金投资		-	-
债券投资		4,977,500.00	1,089,944.00
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		199,742.81	2,803,450.67
应收利息	6.4.7.5	9,458.51	3,234.77
应收股利		-	-
应收申购款		111,025.07	5,334.81
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		277,044,902.52	363,133,579.79
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		7,212.32	-
应付赎回款		1,198,072.43	5,719,739.98
应付管理人报酬		343,133.64	473,707.82
应付托管费		57,188.94	78,951.29
应付销售服务费		54.21	76.18
应付交易费用	6.4.7.7	366,744.10	488,864.12
应交税费		-	3.11

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	89,323.50	192,358.72
负债合计		2,061,729.14	6,953,701.22
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	179,497,382.09	249,559,408.97
未分配利润	6.4.7.10	95,485,791.29	106,620,469.60
所有者权益合计		274,983,173.38	356,179,878.57
负债和所有者权益总计		277,044,902.52	363,133,579.79

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，华泰柏瑞量化阿尔法 A 基金份额净值 1.5320 元，基金份额总额 179,348,846.28 份；华泰柏瑞量化阿尔法 C 基金份额净值 1.5428 元，基金份额总额 148,535.81 份。华泰柏瑞量化阿尔法份额总额合计为 179,497,382.09 份。

6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金

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		26,449,730.04	99,667,047.82
1.利息收入		48,646.11	530,655.33
其中：存款利息收入	6.4.7.11	41,448.70	170,614.35
债券利息收入		7,197.41	360,040.98
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		36,310,551.69	121,377,401.67
其中：股票投资收益	6.4.7.12	33,631,089.69	113,394,409.31
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	71,211.04	47,400.00
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	2,608,250.96	7,935,592.36
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-9,935,883.86	-22,298,447.75
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	26,416.10	57,438.57
减：二、费用		4,092,868.99	11,945,236.11
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,209,851.88	6,358,012.32
2. 托管费	6.4.10.2.2	368,308.66	1,059,668.77
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	325.76	416.80
4. 交易费用	6.4.7.19	1,410,030.58	4,391,983.59
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.34	-
7. 其他费用	6.4.7.20	104,351.77	135,154.63
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		22,356,861.05	87,721,811.71
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		22,356,861.05	87,721,811.71

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金

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）	249,559,408.97	106,620,469.60	356,179,878.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	22,356,861.05	22,356,861.05
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）	-70,062,026.88	-33,491,539.36	-103,553,566.24
其中：1.基金申购款	5,833,367.99	2,760,339.10	8,593,707.09
2. 基金赎回款	-75,895,394.87	-36,251,878.46	-112,147,273.33
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)	179,497,382.09	95,485,791.29	274,983,173.38
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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)	1,483,278,696.49	30,411,654.80	1,513,690,351.29
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	87,721,811.71	87,721,811.71
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)	-997,414,038.48	-49,492,937.15	-1,046,906,975.63
其中：1.基金申购款	15,655,080.80	625,191.29	16,280,272.09
2.基金赎回款	-1,013,069,119.28	-50,118,128.44	-1,063,187,247.72
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)	485,864,658.01	68,640,529.36	554,505,187.37

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：

<u>韩勇</u>	<u>房伟力</u>	<u>赵景云</u>
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

华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2017]1197号《关于准予华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置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《华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开

募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 5,153,838,894.45 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2017)第 811 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 9 月 26 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 5,155,449,845.39 份基金份额，其中认购资金利息折合 1,610,950.94 份基金份额。本基金的基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于 2018 年 10 月 15 日发布的《华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金基金增加 C 类份额并修改基金合同的公告》，经与基金托管人协商一致并报中国证监会备案，本基金自 2018 年 10 月 16 日起增加 C 类基金份额。根据修改后的《华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金基金合同》，本基金根据申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者申购基金份额时收取申购费用而不计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资者申购基金份额时不收取申购费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码，分别计算基金份额净值并分别公告。投资者可自行选择申购的基金份额类别，但不同基金份额类别之间不得互相转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、存托凭证、债券(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、权证、股指期货、国债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)。本基金将根据法律法规的规定参与融资业务。本基金持有的股票及存托凭证资产的投资比例占基金资产的 0-95%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债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×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。

本财务报表由本基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于 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颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[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。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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费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	17,979,098.94
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：	17,979,098.94

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		241,670,252.74	252,926,630.45	11,256,377.71
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	4,977,600.00	4,977,500.00	-100.00
	合计	4,977,600.00	4,977,500.00	-100.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		246,647,852.74	257,904,130.45	11,256,277.71

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/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：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有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	1,547.93
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	350.01
应收债券利息	7,528.57

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	32.00
合计	9,458.51

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	366,581.60
银行间市场应付交易费用	162.50
合计	366,744.10

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	63.35
应付证券出借违约金	-
预提费用	89,260.15
合计	89,323.50

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

华泰柏瑞量化阿尔法 A		
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	249,396,859.18	249,396,859.18
本期申购	5,578,198.80	5,578,198.80

本期赎回(以“-”号填列)	-75,626,211.70	-75,626,211.70
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	179,348,846.28	179,348,846.28

金额单位：人民币元

华泰柏瑞量化阿尔法 C		
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	162,549.79	162,549.79
本期申购	255,169.19	255,169.19
本期赎回(以“-”号填列)	-269,183.17	-269,183.17
- 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	148,535.81	148,535.81

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

华泰柏瑞量化阿尔法 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	130,858,938.55	-24,309,844.64	106,549,093.91
本期利润	32,266,439.55	-9,922,950.48	22,343,489.07
本期基金份额交易产生的变动数	-40,622,058.42	7,134,644.88	-33,487,413.54
其中：基金申购款	3,312,604.68	-678,726.55	2,633,878.13
基金赎回款	-43,934,663.10	7,813,371.43	-36,121,291.67
本期已分配利润	-	-	-
本期末	122,503,319.68	-27,098,150.24	95,405,169.44

单位：人民币元

华泰柏瑞量化阿尔法 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	67,466.02	3,909.67	71,375.69
本期利润	26,305.36	-12,933.38	13,371.98

本期基金份额交易产生的变动数	-8,695.18	4,569.36	-4,125.82
其中：基金申购款	123,062.24	3,398.73	126,460.97
基金赎回款	-131,757.42	1,170.63	-130,586.79
本期已分配利润	-	-	-
本期末	85,076.20	-4,454.35	80,621.85

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	35,471.77
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	5,194.73
其他	782.20
合计	41,448.70

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	498,983,224.00
减：卖出股票成本总额	465,352,134.31
买卖股票差价收入	33,631,089.69

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	71,211.04

券到期兑付) 差价收入	
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	71,211.04

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	1,489,493.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,418,000.00
减：应收利息总额	281.96
买卖债券差价收入	71,211.04

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：本基金本报告期内无买卖权证差价收入。

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 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	2,608,250.96
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	2,608,250.96

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	-9,935,883.86
——股票投资	-9,913,839.86
——债券投资	-22,044.00
——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	-9,935,883.86

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	18,398.64

转换费收入	8,017.46
合计	26,416.10

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。对持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5% 的赎回费，并全额计入基金财产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的不低于赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.7.19 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	1,409,868.08
银行间市场交易费用	162.50
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	1,410,030.58

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	6,091.62
银行间账户服务费	9,000.00
合计	104,351.77

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无其它需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、基金注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金销售机构
华泰证券股份有限公司（“华泰证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
华泰联合证券有限责任公司（“华泰联合证券”）	基金管理人的股东华泰证券的控股子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	79,557,988.73	8.99%	-	-

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	73,694.81	9.03%	73,694.81	20.10%
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	2,209,851.88	6,358,012.32
其中：支付销售机构的客户维护费	925,934.14	2,770,024.91

注：支付基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬＝前一日基金资产净值×1.5% / 当年天数。

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	368,308.66	1,059,668.77

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费＝前一日基金资产净值×0.25% / 当年天数。

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 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰柏瑞量化阿尔法 A	华泰柏瑞量化阿尔法 C	合计

华泰柏瑞基金管理有限公司	0.00	1.65	1.65
合计	0.00	1.65	1.65
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰柏瑞量化阿尔法 A	华泰柏瑞量化阿尔法 C	合计
华泰柏瑞基金管理有限公司	0.00	4.72	4.72
合计	0.00	4.72	4.72

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 0.25% 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 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

C 类基金份额销售服务费每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前 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

注：本报告期内与上年度可比期间，基金管理人未投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本报告期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	17,979,098.94	35,471.77	41,158,302.10	130,725.00

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	718	108,059.00
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

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：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
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	-
300919	中伟股份	2020 年 12 月 25 日	2021 年 7 月 2 日	新股锁定期内	24.60	163.00	409	10,061.40	66,667.00	-
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	-
300929	华骐环保	2021 年 1 月 12 日	2021 年 7 月 20 日	新股锁定期内	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
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	-
300931	通用电梯	2021 年 1 月 13 日	2021 年 7 月 21 日	新股锁定期内	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
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	-
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	-
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	-
300940	南极光	2021 年 1 月 27 日	2021 年 8 月 3 日	新股锁定期内	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-
300941	创识	2021 年	2021	新股锁	21.31	49.94	343	7,309.33	17,129.42	-

	科技	2月2日	年8月9日	定期内						
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	-
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	-
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	-
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	-
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	-
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	206	9,749.98	51,903.76	-
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	-
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	-
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	-
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	-
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	1,000	6,870.00	12,070.00	-
300973	立高	2021年	2021	新股锁	28.28	115.71	234	6,617.52	27,076.14	-

	食品	4月8日	年10月15日	定期内						
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	-
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	315	10,464.30	27,562.50	-
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	151	7,337.09	13,648.89	-
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	-
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	204	5,079.60	5,061.24	-
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	-
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	-
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	-
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	-
300998	宁波方正	2021年5月25日	2021年12月	新股锁定期内	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-

		日	月 2 日							
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	-
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	-
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	689	8,640.06	19,216.21	-
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	-
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	-
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	462	3,529.68	17,939.46	-
301017	漱玉平民	2021 年 6 月 23 日	2021 年 7 月 5 日	新股未上市	8.86	8.86	5,550	49,173.00	49,173.00	-
301018	申菱环境	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 7 日	新股未上市	8.29	8.29	7,811	64,753.19	64,753.19	-
301020	密封科技	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股未上市	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	新股未上市	9.46	9.46	2,899	27,424.54	27,424.54	-
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	-
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	-
688087	英科	2021 年	2021	新股未	21.96	21.96	2,320	50,947.20	50,947.20	-

	再生	6 月 30 日	年 7 月 9 日	上市						
688092	爱科科技	2021 年 3 月 12 日	2021 年 9 月 22 日	新股锁定期内	19.11	33.21	1,137	21,728.07	37,759.77	-
688195	腾景科技	2021 年 3 月 18 日	2021 年 9 月 27 日	新股锁定期内	13.60	19.87	2,693	36,624.80	53,509.91	-
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	-
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	-
688315	诺禾致源	2021 年 4 月 2 日	2021 年 10 月 13 日	新股锁定期内	12.76	39.20	3,711	47,352.36	145,471.20	-
688359	三孚新科	2021 年 5 月 14 日	2021 年 11 月 22 日	新股锁定期内	11.03	26.35	2,213	24,409.39	58,312.55	-
688626	翔宇医疗	2021 年 3 月 23 日	2021 年 10 月 8 日	新股锁定期内	28.82	104.16	2,139	61,645.98	222,798.24	-
688639	华恒生物	2021 年 4 月 14 日	2021 年 10 月 22 日	新股锁定期内	23.16	42.28	2,302	53,314.32	97,328.56	-
688665	四方光电	2021 年 2 月 2 日	2021 年 8 月 9 日	新股锁定期内	29.53	129.46	1,687	49,817.11	218,399.02	-

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。

2、本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得转让；本基金参与网上申购获得的新股，在新股上市之前不得转

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	停牌原因	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
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	800	245,091.92	268,208.00	-

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。

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	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	4,977,500.00	0.00
合计	4,977,500.00	0.00

注：未评级的债券包括国债。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

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	964,000.00
AAA 以下	0.00	125,944.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	1,089,944.00

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约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(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公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 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 0.72%。

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	17,979,098.94	-	-	-	-	-	17,979,098.94
结算备付金	770,309.16	-	-	-	-	-	770,309.16
存出保证金	71,137.58	-	-	-	-	-	71,137.58
交易性金融	-4,977,500.00	-	-	-	-	252,926,630.45	257,904,130.45

资产							
应收证券清算款	-	-	-	-	-	199,742.81	199,742.81
应收利息	-	-	-	-	-	9,458.51	9,458.51
应收申购款	-	-	-	-	-	111,025.07	111,025.07
资产总计	18,820,545.68	4,977,500.00	-	-	-	253,246,856.84	277,044,902.52
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	7,212.32	7,212.32
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,198,072.43	1,198,072.43
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	343,133.64	343,133.64
应付托管费	-	-	-	-	-	57,188.94	57,188.94
应付销售服务费	-	-	-	-	-	54.21	54.21
应付交易费用	-	-	-	-	-	366,744.10	366,744.10
其他负债	-	-	-	-	-	89,323.50	89,323.50
负债总计	-	-	-	-	-	2,061,729.14	2,061,729.14
利率敏感度缺口	18,820,545.68	4,977,500.00	-	-	-	251,185,127.70	274,983,173.38
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	21,754,328.87	-	-	-	-	-	21,754,328.87
结算备付金	1,071,420.69	-	-	-	-	-	1,071,420.69
存出保证金	158,837.48	-	-	-	-	-	158,837.48
交易性金融资产	-	-	-	-	1,089,944.00	336,247,028.50	337,336,972.50
应收证券清算款	-	-	-	-	-	2,803,450.67	2,803,450.67
应收利息	-	-	-	-	-	3,234.77	3,234.77
应收申购款	-	-	-	-	-	5,334.81	5,334.81
资产总计	22,984,587.04	-	-	-	1,089,944.00	339,059,048.75	363,133,579.79
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	5,719,739.98	5,719,739.98
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	473,707.82	473,707.82
应付托管费	-	-	-	-	-	78,951.29	78,951.29
应付销售服务费	-	-	-	-	-	76.18	76.18
应付交易费	-	-	-	-	-	488,864.12	488,864.12

用							
应交税费	-	-	-	-	-	3.11	3.11
其他负债	-	-	-	-	-	192,358.72	192,358.72
负债总计	-	-	-	-	-	6,953,701.22	6,953,701.22
利率敏感度 缺口	22,984,587.04	-	-	-	-1,089,944.00	332,105,347.53	356,179,878.57

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 1.81%(2020 年 12 月 31 日：0.31%)，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。本基金投资组合中股票资产及存托凭证占基金资产的比例 0%-95%。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%；本基金参与融资业务时，在任何交易日日终，持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%。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	252,926,630.45	91.98	336,247,028.50	94.40
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	252,926,630.45	91.98	336,247,028.50	94.40

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证 800 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	中证 800 指数上升 5%	11,745,237.64	16,112,528.33
	中证 800 指数下降 5%	-11,745,237.64	-16,112,528.33

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	252,926,630.45	91.29
	其中：股票	252,926,630.45	91.29
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,977,500.00	1.80
	其中：债券	4,977,500.00	1.80
	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	18,749,408.10	6.77
8	其他各项资产	391,363.97	0.14
9	合计	277,044,902.52	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	7,404,633.03	2.69
C	制造业	140,511,471.49	51.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,117,351.19	2.22
E	建筑业	5,318,050.37	1.93
F	批发和零售业	3,245,178.82	1.18
G	交通运输、仓储和邮政业	12,320,040.02	4.48
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,330,516.93	3.39
J	金融业	54,303,392.73	19.75
K	房地产业	6,024,285.48	2.19
L	租赁和商务服务业	1,470,148.06	0.53
M	科学研究和技术服务业	4,396,074.00	1.60

N	水利、环境和公共设施管理业	1,098,542.33	0.40
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	331,688.00	0.12
R	文化、体育和娱乐业	1,055,258.00	0.38
S	综合	-	-
	合计	252,926,630.45	91.98

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：本基金本报告期内未投资港股通股票。

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	600519	贵州茅台	5,800	11,928,860.00	4.34
2	600036	招商银行	117,000	6,340,230.00	2.31
3	000858	五粮液	18,200	5,421,598.00	1.97
4	601318	中国平安	81,700	5,251,676.00	1.91
5	601012	隆基股份	55,562	4,936,128.08	1.80
6	601328	交通银行	731,700	3,585,330.00	1.30
7	601919	中远海控	115,600	3,530,424.00	1.28
8	600884	杉杉股份	142,700	3,327,764.00	1.21
9	000333	美的集团	46,098	3,290,014.26	1.20
10	601288	农业银行	977,300	2,961,219.00	1.08
11	601166	兴业银行	136,700	2,809,185.00	1.02
12	600999	招商证券	143,600	2,731,272.00	0.99
13	600409	三友化工	264,600	2,675,106.00	0.97
14	603259	药明康德	16,920	2,649,502.80	0.96
15	601598	中国外运	523,600	2,644,180.00	0.96
16	300059	东方财富	78,180	2,563,522.20	0.93
17	002709	天赐材料	24,000	2,557,920.00	0.93
18	000028	国药一致	66,600	2,520,144.00	0.92
19	601186	中国铁建	307,500	2,284,725.00	0.83
20	300378	鼎捷软件	103,632	2,224,979.04	0.81
21	600900	长江电力	107,500	2,218,800.00	0.81
22	000776	广发证券	143,100	2,166,534.00	0.79
23	000951	中国重汽	79,900	2,162,094.00	0.79

24	688396	华润微	23,400	2,129,868.00	0.77
25	603186	华正新材	58,355	2,127,623.30	0.77
26	002475	立讯精密	46,200	2,125,200.00	0.77
27	603444	吉比特	4,000	2,120,000.00	0.77
28	000001	平安银行	92,600	2,094,612.00	0.76
29	601336	新华保险	45,067	2,069,025.97	0.75
30	000725	京东方 A	323,200	2,016,768.00	0.73
31	600104	上汽集团	91,646	2,013,462.62	0.73
32	000656	金科股份	347,700	2,013,183.00	0.73
33	600030	中信证券	80,500	2,007,670.00	0.73
34	300639	凯普生物	60,390	1,993,473.90	0.72
35	601818	光大银行	517,838	1,957,427.64	0.71
36	300122	智飞生物	10,400	1,941,992.00	0.71
37	300726	宏达电子	26,400	1,860,936.00	0.68
38	600966	博汇纸业	141,100	1,841,355.00	0.67
39	601628	中国人寿	54,300	1,840,227.00	0.67
40	601881	中国银河	164,700	1,775,466.00	0.65
41	300750	宁德时代	3,300	1,764,840.00	0.64
42	603056	德邦股份	155,698	1,711,121.02	0.62
43	000921	海信家电	118,000	1,695,660.00	0.62
44	601390	中国中铁	322,500	1,689,900.00	0.61
45	603337	杰克股份	62,300	1,665,279.00	0.61
46	603501	韦尔股份	5,000	1,610,000.00	0.59
47	300676	华大基因	13,500	1,601,100.00	0.58
48	600276	恒瑞医药	23,320	1,585,060.40	0.58
49	000002	万 科 A	64,000	1,523,840.00	0.55
50	600196	复星医药	20,900	1,507,517.00	0.55
51	600075	新疆天业	221,400	1,505,520.00	0.55
52	600782	新钢股份	267,400	1,492,092.00	0.54
53	688580	伟思医疗	8,800	1,474,000.00	0.54
54	002008	大族激光	36,100	1,458,079.00	0.53
55	300760	迈瑞医疗	3,000	1,440,150.00	0.52
56	600741	华域汽车	54,742	1,438,072.34	0.52
57	688526	科前生物	38,800	1,405,336.00	0.51
58	000671	阳 光 城	267,300	1,389,960.00	0.51
59	601398	工商银行	267,400	1,382,458.00	0.50
60	000488	晨鸣纸业	166,300	1,353,682.00	0.49
61	002142	宁波银行	34,370	1,339,398.90	0.49
62	601618	中国中冶	442,300	1,318,054.00	0.48

63	601222	林洋能源	158,500	1,313,965.00	0.48
64	002327	富安娜	168,700	1,305,738.00	0.47
65	300659	中孚信息	38,700	1,299,159.00	0.47
66	688036	传音控股	6,200	1,298,900.00	0.47
67	601211	国泰君安	75,400	1,292,356.00	0.47
68	601998	中信银行	251,200	1,281,120.00	0.47
69	600380	健康元	93,200	1,279,636.00	0.47
70	601899	紫金矿业	131,900	1,278,111.00	0.46
71	601139	深圳燃气	194,000	1,272,640.00	0.46
72	000898	鞍钢股份	284,830	1,267,493.50	0.46
73	600057	厦门象屿	201,700	1,260,625.00	0.46
74	600761	安徽合力	113,100	1,250,886.00	0.45
75	002106	莱宝高科	109,300	1,229,625.00	0.45
76	600027	华电国际	356,170	1,225,224.80	0.45
77	601169	北京银行	250,781	1,221,303.47	0.44
78	002048	宁波华翔	61,800	1,205,100.00	0.44
79	600061	国投资本	134,576	1,142,550.24	0.42
80	600483	福能股份	108,200	1,135,018.00	0.41
81	300014	亿纬锂能	10,800	1,122,444.00	0.41
82	600438	通威股份	25,800	1,116,366.00	0.41
83	600000	浦发银行	110,200	1,102,000.00	0.40
84	002034	旺能环境	66,600	1,062,270.00	0.39
85	601601	中国太保	36,593	1,060,099.21	0.39
86	000039	中集集团	58,100	1,056,258.00	0.38
87	600967	内蒙一机	101,400	1,026,168.00	0.37
88	000100	TCL 科技	133,900	1,024,335.00	0.37
89	000429	粤高速 A	142,700	1,023,159.00	0.37
90	002179	中航光电	12,800	1,011,456.00	0.37
91	300223	北京君正	10,000	1,009,200.00	0.37
92	000661	长春高新	2,600	1,006,200.00	0.37
93	603885	吉祥航空	65,200	994,952.00	0.36
94	300082	奥克股份	79,300	983,320.00	0.36
95	002241	歌尔股份	22,800	974,472.00	0.35
96	601000	唐山港	398,900	961,349.00	0.35
97	000157	中联重科	103,876	959,814.24	0.35
98	002645	华宏科技	59,300	947,614.00	0.34
99	688300	联瑞新材	15,200	942,400.00	0.34
100	002460	赣锋锂业	7,600	920,284.00	0.33
101	002092	中泰化学	89,500	919,165.00	0.33

102	600028	中国石化	210,600	918,216.00	0.33
103	601225	陕西煤业	77,467	917,983.95	0.33
104	002020	京新药业	107,740	915,790.00	0.33
105	603799	华友钴业	8,000	913,600.00	0.33
106	300142	沃森生物	14,800	913,160.00	0.33
107	601077	渝农商行	223,100	890,169.00	0.32
108	600486	扬农化工	7,800	871,806.00	0.32
109	000717	韶钢松山	185,500	851,445.00	0.31
110	601678	滨化股份	104,800	828,968.00	0.30
111	601717	郑煤机	69,900	812,937.00	0.30
112	600703	三安光电	25,300	810,865.00	0.29
113	600048	保利地产	67,162	808,630.48	0.29
114	600548	深高速	91,400	797,008.00	0.29
115	002110	三钢闽光	115,700	779,818.00	0.28
116	300740	御家汇	36,975	772,038.00	0.28
117	601088	中国神华	39,304	767,214.08	0.28
118	002614	奥佳华	32,710	740,227.30	0.27
119	002262	恩华药业	47,800	733,730.00	0.27
120	000550	江铃汽车	31,300	733,359.00	0.27
121	600746	江苏索普	47,600	730,184.00	0.27
122	300618	寒锐钴业	9,100	717,444.00	0.26
123	601928	凤凰传媒	99,600	711,144.00	0.26
124	002384	东山精密	34,000	708,560.00	0.26
125	600398	海澜之家	96,500	698,660.00	0.25
126	000933	神火股份	73,916	698,506.20	0.25
127	601319	中国人保	117,300	695,589.00	0.25
128	603887	城地香江	69,360	692,906.40	0.25
129	601699	潞安环能	56,100	662,541.00	0.24
130	603298	杭叉集团	35,685	647,325.90	0.24
131	603688	石英股份	27,500	646,250.00	0.24
132	688015	交控科技	20,500	640,420.00	0.23
133	002937	兴瑞科技	45,100	639,518.00	0.23
134	002315	焦点科技	35,300	638,930.00	0.23
135	601658	邮储银行	125,700	631,014.00	0.23
136	600489	中金黄金	71,900	619,778.00	0.23
137	600985	淮北矿业	50,400	615,384.00	0.22
138	600958	东方证券	60,900	608,391.00	0.22
139	603128	华贸物流	43,100	607,279.00	0.22
140	688508	芯朋微	5,400	597,456.00	0.22

141	600919	江苏银行	82,500	585,750.00	0.21
142	600745	闻泰科技	5,900	571,710.00	0.21
143	300433	蓝思科技	19,400	570,554.00	0.21
144	688099	晶晨股份	5,000	561,000.00	0.20
145	000878	云南铜业	43,500	558,105.00	0.20
146	000625	长安汽车	21,200	557,136.00	0.20
147	600216	浙江医药	34,700	555,547.00	0.20
148	600688	上海石化	142,100	534,296.00	0.19
149	600219	南山铝业	148,200	533,520.00	0.19
150	603566	普莱柯	23,100	526,680.00	0.19
151	600346	恒力石化	20,000	524,800.00	0.19
152	603416	信捷电气	8,140	516,645.80	0.19
153	600141	兴发集团	27,000	508,410.00	0.18
154	000739	普洛药业	17,100	502,740.00	0.18
155	601633	长城汽车	11,500	501,285.00	0.18
156	688588	凌志软件	27,242	493,897.46	0.18
157	002124	天邦股份	70,420	493,644.20	0.18
158	603678	火炬电子	7,300	492,750.00	0.18
159	601857	中国石油	91,800	485,622.00	0.18
160	603686	龙马环卫	31,700	482,157.00	0.18
161	603587	地素时尚	19,300	480,763.00	0.17
162	603609	禾丰股份	45,500	474,110.00	0.17
163	300033	同花顺	4,200	473,676.00	0.17
164	600584	长电科技	11,800	444,624.00	0.16
165	002901	大博医疗	6,000	437,340.00	0.16
166	603661	恒林股份	8,900	436,723.00	0.16
167	688005	容百科技	3,600	436,320.00	0.16
168	600989	宝丰能源	31,800	435,024.00	0.16
169	600426	华鲁恒升	13,900	430,205.00	0.16
170	600111	北方稀土	20,600	426,420.00	0.16
171	603599	广信股份	13,900	418,112.00	0.15
172	600711	盛屯矿业	58,500	417,105.00	0.15
173	600837	海通证券	35,600	409,400.00	0.15
174	600507	方大特钢	59,135	400,935.30	0.15
175	601168	西部矿业	33,400	398,462.00	0.14
176	688083	中望软件	718	396,551.40	0.14
177	000932	华菱钢铁	59,100	390,060.00	0.14
178	002007	华兰生物	10,500	385,140.00	0.14
179	002539	云图控股	42,100	367,533.00	0.13

180	000026	飞亚达	25,700	357,744.00	0.13
181	603986	兆易创新	1,900	357,010.00	0.13
182	688366	昊海生科	1,700	355,810.00	0.13
183	300677	英科医疗	2,800	349,440.00	0.13
184	600373	中文传媒	34,900	344,114.00	0.13
185	002171	楚江新材	39,400	343,962.00	0.13
186	300463	迈克生物	8,000	336,720.00	0.12
187	601666	平煤股份	45,600	324,216.00	0.12
188	000059	华锦股份	39,700	323,952.00	0.12
189	601233	桐昆股份	12,900	310,761.00	0.11
190	000425	徐工机械	48,500	308,945.00	0.11
191	600299	安迪苏	25,400	303,784.00	0.11
192	000069	华侨城 A	38,800	288,672.00	0.10
193	300136	信维通信	9,200	284,096.00	0.10
194	603738	泰晶科技	8,200	283,064.00	0.10
195	002727	一心堂	8,400	278,124.00	0.10
196	600031	三一重工	9,400	273,258.00	0.10
197	688368	晶丰明源	800	268,208.00	0.10
198	600282	南钢股份	75,100	267,356.00	0.10
199	600461	洪城环境	34,800	252,648.00	0.09
200	601636	旗滨集团	13,500	250,560.00	0.09
201	002254	泰和新材	12,300	249,321.00	0.09
202	002064	华峰氨纶	17,300	245,660.00	0.09
203	002044	美年健康	25,800	235,038.00	0.09
204	603659	璞泰来	1,640	224,024.00	0.08
205	688626	翔宇医疗	2,139	222,798.24	0.08
206	600362	江西铜业	9,800	219,324.00	0.08
207	688665	四方光电	1,687	218,399.02	0.08
208	002483	润邦股份	44,100	212,121.00	0.08
209	002027	分众传媒	22,266	209,523.06	0.08
210	000708	中信特钢	9,500	197,980.00	0.07
211	300548	博创科技	5,100	181,509.00	0.07
212	002025	航天电器	3,500	175,595.00	0.06
213	600529	山东药玻	4,700	159,565.00	0.06
214	000733	振华科技	2,500	152,675.00	0.06
215	688315	诺禾致源	3,711	145,471.20	0.05
216	000830	鲁西化工	5,900	110,507.00	0.04
217	688639	华恒生物	2,302	97,328.56	0.04
218	300347	泰格医药	500	96,650.00	0.04

219	300450	先导智能	1,500	90,210.00	0.03
220	603606	东方电缆	4,239	85,373.46	0.03
221	000528	柳 工	9,900	81,180.00	0.03
222	300206	理邦仪器	4,900	77,910.00	0.03
223	300073	当升科技	1,300	73,047.00	0.03
224	002100	天康生物	7,500	66,825.00	0.02
225	300919	中伟股份	409	66,667.00	0.02
226	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.02
227	688359	三孚新科	2,213	58,312.55	0.02
228	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.02
229	688195	腾景科技	2,693	53,509.91	0.02
230	300957	贝泰妮	206	51,903.76	0.02
231	688087	英科再生	2,320	50,947.20	0.02
232	600029	南方航空	8,400	50,568.00	0.02
233	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.02
234	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.02
235	688092	爱科科技	1,137	37,759.77	0.01
236	300458	全志科技	400	35,064.00	0.01
237	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.01
238	300979	华利集团	315	27,562.50	0.01
239	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.01
240	300973	立高食品	234	27,076.14	0.01
241	301009	可靠股份	689	19,216.21	0.01
242	688100	威胜信息	700	18,690.00	0.01
243	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.01
244	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.01
245	300941	创识科技	343	17,129.42	0.01
246	300932	三友联众	492	15,601.32	0.01
247	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.01
248	300981	中红医疗	151	13,648.89	0.00
249	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
250	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
251	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
252	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
253	301013	利和兴	471	12,768.81	0.00
254	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
255	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
256	300968	格林精密	1,000	12,070.00	0.00
257	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00

258	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
259	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
260	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
261	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
262	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
263	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
264	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
265	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
266	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
267	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
268	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
269	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
270	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
271	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
272	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
273	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
274	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
275	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
276	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
277	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
278	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
279	300985	致远新能	204	5,061.24	0.00
280	601231	环旭电子	300	5,043.00	0.00
281	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
282	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
283	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
284	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
285	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	10,245,965.00	2.88
2	300059	东方财富	5,443,695.20	1.53
3	300033	同花顺	4,483,471.50	1.26
4	688200	华峰测控	3,722,575.12	1.05

5	601998	中信银行	3,673,005.00	1.03
6	300659	中孚信息	3,611,288.00	1.01
7	601231	环旭电子	3,545,647.00	1.00
8	601888	中国中免	3,392,236.00	0.95
9	000488	晨鸣纸业	3,243,220.00	0.91
10	601336	新华保险	3,206,048.00	0.90
11	000651	格力电器	3,160,094.00	0.89
12	000921	海信家电	3,135,174.00	0.88
13	688005	容百科技	3,087,196.10	0.87
14	000858	五 粮 液	3,054,261.00	0.86
15	300413	芒果超媒	3,030,319.43	0.85
16	300639	凯普生物	2,900,366.00	0.81
17	600409	三友化工	2,874,908.00	0.81
18	600900	长江电力	2,846,107.00	0.80
19	600884	杉杉股份	2,827,208.00	0.79
20	600999	招商证券	2,819,523.00	0.79

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	000932	华菱钢铁	6,128,866.00	1.72
2	600809	山西汾酒	5,765,801.00	1.62
3	601658	邮储银行	5,309,165.00	1.49
4	601601	中国太保	5,125,911.00	1.44
5	600507	方大特钢	5,100,167.08	1.43
6	002027	分众传媒	5,095,267.87	1.43
7	600011	华能国际	5,003,160.15	1.40
8	002736	国信证券	4,756,667.92	1.34
9	600309	万华化学	4,678,880.00	1.31
10	000157	中联重科	4,630,068.00	1.30
11	601881	中国银河	4,570,949.00	1.28
12	601211	国泰君安	4,482,392.00	1.26
13	600999	招商证券	4,419,642.63	1.24
14	601390	中国中铁	4,299,931.00	1.21
15	688005	容百科技	4,247,511.92	1.19

16	000568	泸州老窖	4,181,422.00	1.17
17	300124	汇川技术	3,868,353.00	1.09
18	603416	信捷电气	3,840,498.00	1.08
19	601838	成都银行	3,834,835.00	1.08
20	600023	浙能电力	3,770,616.00	1.06

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	391,945,576.12
卖出股票收入（成交）总额	498,983,224.00

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	4,977,500.00	1.81
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
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	4,977,500.00	1.81

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	219924	21 贴现国债 24	50,000	4,977,500.00	1.81

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投资国债期货。

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投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

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被监管部门立案调查的情形，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票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	71,137.58
2	应收证券清算款	199,742.81
3	应收股利	-
4	应收利息	9,458.51
5	应收申购款	111,025.07
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	391,363.97

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：本基金本报告期末持有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

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
华泰柏瑞量化阿尔法 A	4,929	36,386.46	0.00	0.00%	179,348,846.28	100.00%
华泰柏瑞量化阿尔法 C	249	596.53	0.00	0.00%	148,535.81	100.00%
合计	5,165	34,752.64	0.00	0.00%	179,497,382.09	100.00%

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	华泰柏瑞量化阿尔法 A	136,860.03	0.0763%
	华泰柏瑞量化阿尔法 C	15.81	0.0106%
	合计	136,875.84	0.0763%

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	华泰柏瑞量化阿尔法 A	0
	华泰柏瑞量化阿尔法 C	0

	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	华泰柏瑞量化阿尔法 A	10~50
	华泰柏瑞量化阿尔法 C	0
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华泰柏瑞量化阿尔法 A	华泰柏瑞量化阿尔法 C
基金合同生效日（2017 年 9 月 26 日）基金份额总额	5,155,449,845.39	—
本报告期期初基金份额总额	249,396,859.18	162,549.79
本报告期基金总申购份额	5,578,198.80	255,169.19
减：本报告期基金总赎回份额	75,626,211.70	269,183.17
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	179,348,846.28	148,535.81

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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	
申万宏源	2	213,681,925.12	24.15%	197,436.09	24.18%	—
长江证券	4	95,527,421.58	10.80%	87,690.78	10.74%	—
华泰证券	4	79,557,988.73	8.99%	73,694.81	9.03%	—
齐鲁证券	1	78,525,729.86	8.87%	73,130.77	8.96%	—
方正证券	2	75,024,049.56	8.48%	69,871.82	8.56%	—
中金公司	2	48,187,795.10	5.45%	44,876.73	5.50%	—

兴业证券	3	44,304,179.72	5.01%	40,661.76	4.98%	—
银河证券	3	43,012,321.71	4.86%	39,199.55	4.80%	—
西藏东方财富	2	39,265,805.71	4.44%	36,044.11	4.41%	—
申港证券	2	27,704,443.29	3.13%	25,508.36	3.12%	—
瑞银证券	2	21,834,433.56	2.47%	19,897.97	2.44%	—
中银国际	3	20,968,204.46	2.37%	19,526.35	2.39%	—
广发证券	2	20,888,129.25	2.36%	19,035.79	2.33%	—
中信证券	3	20,201,168.71	2.28%	18,409.51	2.25%	—
华创证券	1	18,748,210.94	2.12%	17,085.47	2.09%	—
万联证券	2	14,633,661.03	1.65%	13,335.20	1.63%	—
华福证券	2	12,137,852.64	1.37%	11,061.26	1.35%	—
安信证券	3	9,326,082.27	1.05%	8,686.39	1.06%	—
国信证券	1	649,371.90	0.07%	604.77	0.07%	—
国金证券	1	479,107.96	0.05%	446.16	0.05%	—
东方证券	3	221,502.44	0.03%	201.86	0.02%	—
新时代证券	2	—	—	—	—	—
中信建投	2	—	—	—	—	—
中投证券	1	—	—	—	—	—
浙商证券	2	—	—	—	—	—
信达证券	1	—	—	—	—	—
湘财证券	1	—	—	—	—	—
西南证券	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	1	—	—	—	—	—
国都证券	1	—	—	—	—	—
光大证券	2	—	—	—	—	—
东吴证券	1	—	—	—	—	—
东北证券	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
申万宏源	1,127,631.60	75.71%	-	-	-	-
长江证券	177,020.80	11.88%	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	93,083.70	6.25%	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	91,756.90	6.16%	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-

瑞银证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
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
8	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
9	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
10	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
11	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
12	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	证监会规定报刊和网站	2021 年 3 月 18 日

	的公告		
13	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
14	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
15	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
16	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
17	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
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 1 月 22 日
19	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方式的提示性公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 1 月 14 日
20	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
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 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

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

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