

华泰柏瑞行业精选混合型证券投资基金 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

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。

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	7
2.4 信息披露方式	8
2.5 其他相关资料	8
§3 主要财务指标和基金净值表现	9
3.1 主要会计数据和财务指标	9
3.2 基金净值表现	9
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	15
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	15
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的真实、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.....	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.....	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	54
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	54
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	54
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	54
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	54
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	54
7.12 投资组合报告附注.....	55
§8 基金份额持有人信息.....	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	56
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	56
§9 开放式基金份额变动.....	58
§10 重大事件揭示.....	59
10.1 基金份额持有人大会决议.....	59
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	59
10.4 基金投资策略的改变.....	59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	59
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	59
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	59
10.8 其他重大事件.....	63
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	66
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.....	66

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	66
§12 备查文件目录.....	67
12.1 备查文件目录.....	67
12.2 存放地点.....	67
12.3 查阅方式.....	67

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞行业精选混合型证券投资基金	
基金简称	华泰柏瑞行业精选混合	
基金主代码	008526	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 4 月 22 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	106,911,193.14 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	华泰柏瑞行业精选混合 A	华泰柏瑞行业精选混合 C
下属分级基金的交易代码:	008526	008527
报告期末下属分级基金的份额总额	85,093,296.54 份	21,817,896.60 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过把握中国经济的长期发展趋势和阶段性发展特征，分析不同市场环境下的企业盈利变化情况，在严格控制风险和保持资产流动性的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争基金资产的持续稳健增值。
投资策略	<p>1、大类资产配置：本基金将通过研究宏观经济、国家政策等可能影响证券市场的重要因素，对股票、债券和货币资产的风险收益特征进行深入分析，合理预测各类资产的价格变动趋势，确定不同资产类别的投资比例。在此基础上，积极跟踪由于市场短期波动引起的各类资产的价格偏差和风险收益特征的相对变化，动态调整各大类资产之间的投资比例，在保持总体风险水平相对平稳的基础上，获取相对较高的基金投资收益。</p> <p>2、股票投资策略：本基金在大类资产配置策略研究的基础上，分析上下游行业在价值链分配的变化，重点研究盈利向好的行业，挖掘具有核心竞争力公司，投资于盈利向好、估值合理的优势企业。</p> <p>3、债券投资策略：本基金将在对宏观经济走势、利率变化趋势、收益率曲线形态变化和发债主体基本面分析的基础上，综合运用久期管理策略、期限结构配置策略、骑乘策略、息差策略等主动投资策略，选择合适的时机和品种构建债券组合。</p> <p>4、资产支持证券投资策略：本基金将深入研究资产支持证券的发行条款、市场利率、支持资产的构成及质</p>

	<p>量、支持资产的现金流变动情况以及提前偿还率水平等因素，评估资产支持证券的信用风险、利率风险、流动性风险和提前偿付风险，通过信用分析和流动性管理，辅以量化模型分析，精选那些经风险调整后收益率较高的品种进行投资，力求获得长期稳定的投资收益。</p> <p>5、股指期货投资策略：在法律法规允许的范围内，本基金可基于谨慎原则运用股指期货对基金投资组合进行管理，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险，提高投资效率。本基金主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。</p> <p>6、融资业务的投资策略：本基金参与融资业务，将综合考虑融资成本、保证金比例、冲抵保证金证券折算率、信用资质等条件，选择合适的交易对手方。同时，在保障基金投资组合充足流动性以及有效控制融资杠杆风险的前提下，确定融资比例。</p>
业绩比较基准	中证 800 指数收益率*80%+上证国债指数收益率*10%+银行活期存款利率(税后)*10%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。

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	证券日报
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	华泰柏瑞行业精选混合 A	华泰柏瑞行业精选混合 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	36,121,182.57	9,164,279.59
本期利润	12,415,243.00	3,525,549.69
加权平均基金份额本期利润	0.1090	0.1204
本期加权平均净值利润率	8.27%	9.15%
本期基金份额净值增长率	7.99%	7.85%
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	37,672,109.44	9,565,241.71
期末可供分配基金份额利润	0.4427	0.4384
期末基金资产净值	122,765,405.98	31,383,138.31
期末基金份额净值	1.4427	1.4384
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	44.27%	43.84%

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

华泰柏瑞行业精选混合 A

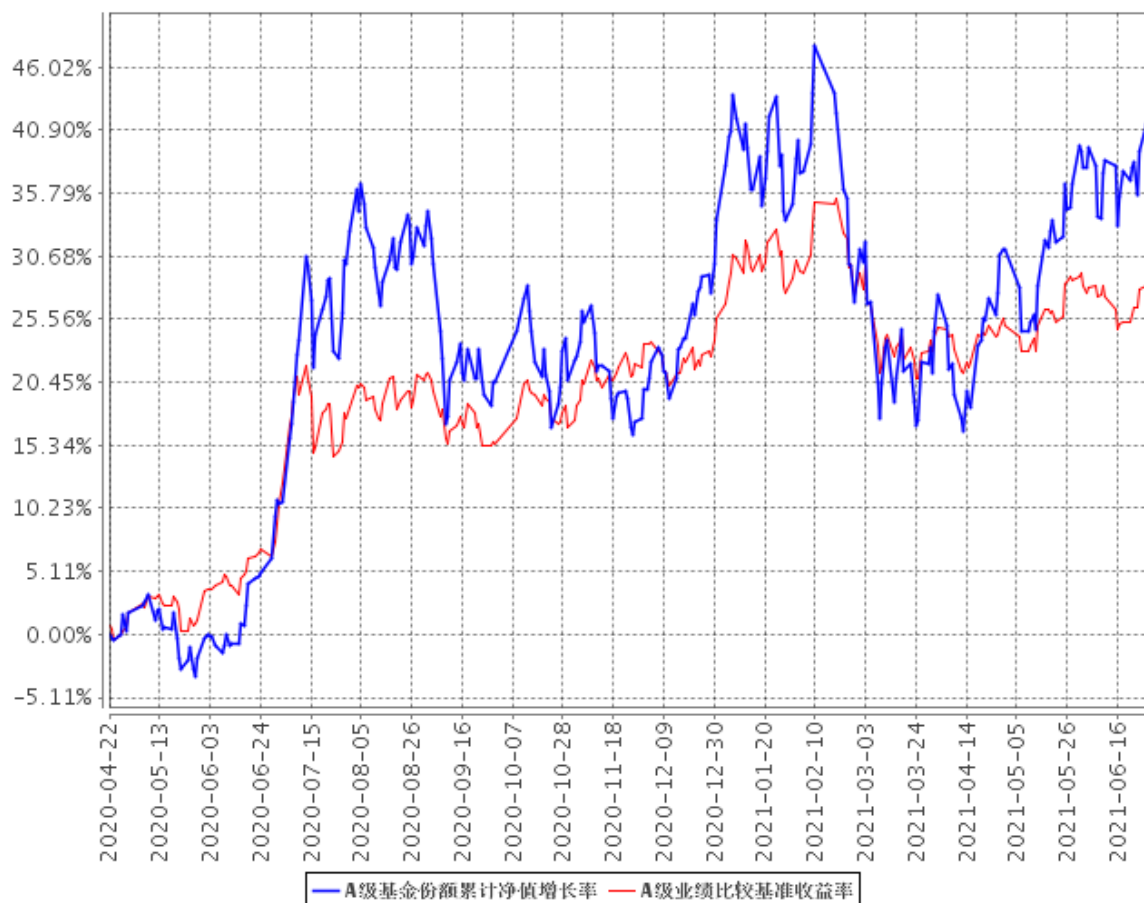
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	3.34%	1.65%	-1.02%	0.62%	4.36%	1.03%
过去三个月	19.03%	1.72%	3.86%	0.71%	15.17%	1.01%
过去六个月	7.99%	2.02%	1.70%	0.97%	6.29%	1.05%
过去一年	31.68%	1.89%	18.80%	1.03%	12.88%	0.86%
自基金合同生效起至今	44.27%	1.79%	27.74%	0.98%	16.53%	0.81%

华泰柏瑞行业精选混合 C

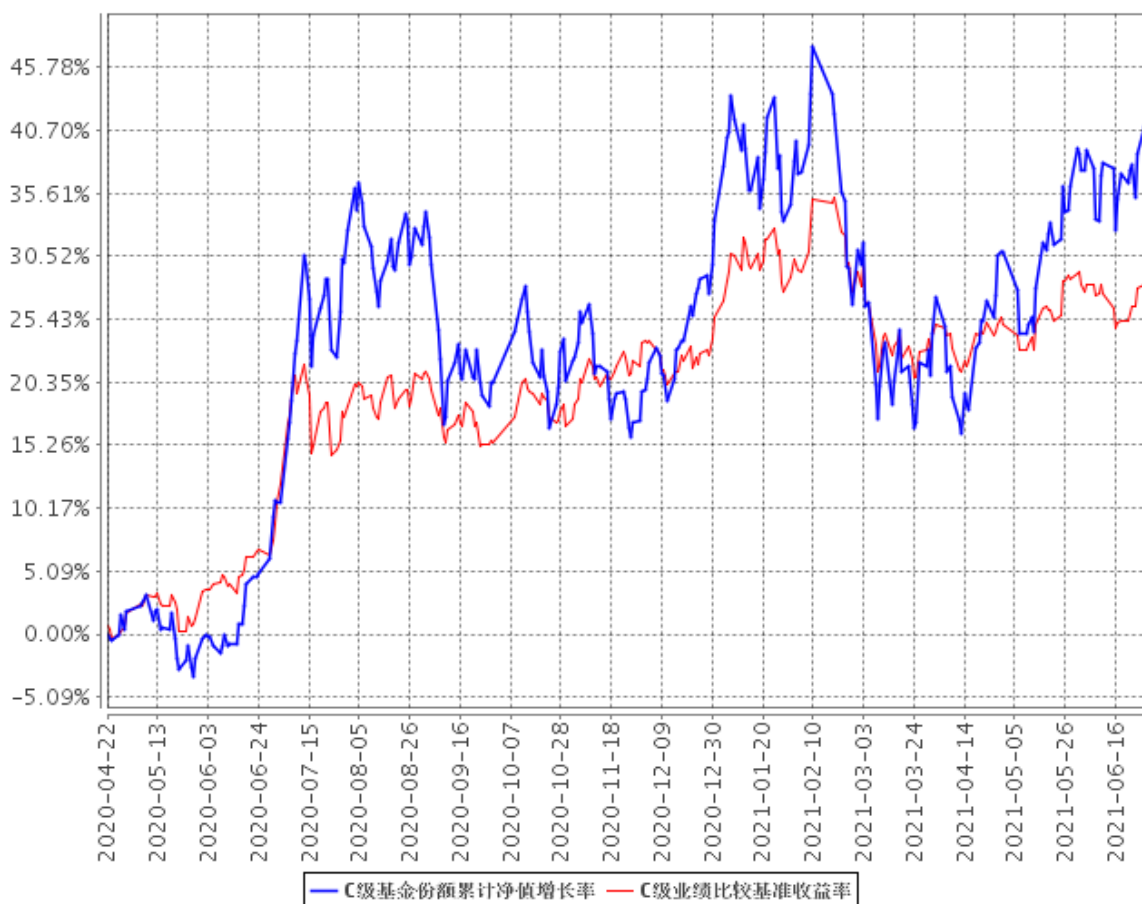
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	3.32%	1.65%	-1.02%	0.62%	4.34%	1.03%
过去三个月	18.96%	1.73%	3.86%	0.71%	15.10%	1.02%
过去六个月	7.85%	2.02%	1.70%	0.97%	6.15%	1.05%
过去一年	31.36%	1.89%	18.80%	1.03%	12.56%	0.86%
自基金合同生效起至今	43.84%	1.79%	27.74%	0.98%	16.10%	0.81%

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

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、图示日期为 2020 年 4 月 22 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日。

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

§ 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		
吕慧建	权益投资部副总监、本基金的	2020 年 4 月 22 日	2021 年 6 月 23 日	23 年	经济学硕士。23 年证券（基金）从业经历，新加坡国立大学 MBA。历任中大投资管理有限公司行业

	基金经 理				研究员及中信基金管理有 限公司的行业研究员。 2007 年 6 月加入本公司， 历任高级研究员、基金经 理助理、基金经理、投资 研究部副总监，现任公司 权益投资部副总监。2007 年 11 月起担任基金经理 助理，自 2009 年 11 月起 担任华泰柏瑞（原友邦华 泰）行业领先混合基金基 金经理。2015 年 6 月起任 华泰柏瑞健康生活灵活配 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。2021 年 6 月起任 华泰柏瑞行业严选混合型 证券投资基金的基金经 理。2020 年 4 月至 2021 年 6 月任华泰柏瑞行业精 选混合型证券投资基金的 基金经理。
刘芷冰	本基金 的基金 经理	2021 年 6 月 23 日	-	10 年	北京大学西方经济学硕 士。曾任上海申银万国证 券研究所有限公司研究 员，中国中投证券有限责 任公司研究员，中信证券 股份有限公司高级研究 员。2017 年 9 月加入华泰 柏瑞基金管理有限公司， 历任研究部高级研究员、 研究部副总监兼基金经理 助理，2021 年 6 月起任华 泰柏瑞行业精选混合型证 券投资基金的基金经理。

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：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。

本报告期本基金与公司所管理的其他投资组合没有参与交易所公开竞价单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的同日反向交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾上半年 A 股市场，一季度市场波动较大，二季度平稳向上。春节前，A 股市场延续了去年以来的结构性行情，医药和大消费包括食品饮料、休闲服务等行业涨幅大幅居前。港股通也持续有南向资金流入，港股恒生指数在春节期间突破 30000 点，并创出 2019 年以来的新高，其中港

股科技、消费和医药等行业涨幅较大。春节后，A 股和港股市场投资风格发生了较大变化，叠加港股市场盘中宣布提高印花税，在 2019 年以来涨幅居前的行业包括食品饮料、电气设备、医药服务等纷纷回调，其中一些前期强势个股在短时间跌幅达到 20%-30%，而之前涨幅较小、估值较低的行业如银行、钢铁、采掘等则相对表现较强。3 月中下旬，前期大幅下跌的行业如休闲服务、食品饮料、医药板块出现小幅反弹。4 月市场核心资产大幅反弹，创业板指涨幅显著领先，医药领涨；5 月市场普涨走势，核心资产、中小市值均大幅上涨，国防军工、食品饮料领涨；6 月指数呈现震荡走势，创业板大幅上涨 5.1%，其中 TMT 板块领涨。上半年整体来看，涨幅居前的板块为钢铁、采掘、电气设备，而农林牧渔、家用电器、非银金融等行业跌幅居前。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末华泰柏瑞行业精选混合 A 基金份额净值为 1.4427 元，本报告期基金份额净值增长率为 7.99%；截至本报告期末华泰柏瑞行业精选混合 C 基金份额净值为 1.4384 元，本报告期基金份额净值增长率为 7.85%；同期业绩比较基准收益率为 1.70%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，随着新冠疫苗的普遍接种，国内疫后经济进入正常化阶段，经济环比高增将不再继续，国内经济增速逐渐往中长期中枢回归，政策也进入常态化回归过程。上半年，财政支出明显后置，预计财政发力的主要时段大概率落在三季度和四季度前半段，对下半年经济形成支撑作用；房地产在严监管的政策条件下，销售前高后低，竣工端有望维持高增长，在按揭利率没有显著变化的背景下未来不会太差；出口 1-5 月达到了超预期的 40% 增长，下半年在海外发达国家新冠疫苗接种加速、新兴国家疫情减缓的预期下，出口下半年增速将回落；消费行业上半年恢复较慢，必需消费特别是服务类消费仍未恢复到疫情前的水平，下半年仍有恢复的空间。海外方面，随着新冠疫苗接种率的提升，发达国家经济受疫情影响的约束下半年将会大幅缓解，经济恢复和通胀预期下，加息预期或往前移。

未来一段时间，我们重点关注的事件包括：国内经济数据的变化、国内货币政策的走向、中美通胀数据、美联储货币政策的走向、“Delta” 变异病毒的进展。

本基金坚持以深入的基本面研究为核心，坚持至下而上的研究框架，淡化宏观至上而下的分析方法，选取符合中国未来经济结构方向的、具有核心竞争力和壁垒的公司进行长期投资。具体来说，本基金投资的方向主要是医药、大消费、先进制造业（包括但不限于新能源、新能源汽车、高端装备、电子等行业），同时，也保持对新兴行业的密切关注，力求找出其中空间大、竞争壁垒高的有中长期投资价值的公司。本基金将坚持估值和基本面相结合的选股思路，控制回撤风险，做到业绩的可持续、可复制，希望为投资者创造持续稳健的收益。

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 47,237,351.15 元。

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”）在对华泰柏瑞行业精选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：华泰柏瑞行业精选混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	15,952,005.30	18,735,832.68
结算备付金		590,493.80	1,074,704.13
存出保证金		99,941.43	200,567.50
交易性金融资产	6.4.7.2	144,805,181.53	285,737,050.47
其中：股票投资		144,805,181.53	285,737,050.47
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		-	5,408,526.68
应收利息	6.4.7.5	1,682.71	2,708.25
应收股利		-	-
应收申购款		59,320.41	80,930.94
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		161,508,625.18	311,240,320.65
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		1,559,726.21	-
应付赎回款		5,029,110.53	7,368,187.57
应付管理人报酬		196,813.87	397,181.66
应付托管费		32,802.30	66,196.95
应付销售服务费		6,567.71	13,692.48
应付交易费用	6.4.7.7	431,999.64	640,198.36
应交税费		-	0.02

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	103,060.63	163,603.56
负债合计		7,360,080.89	8,649,060.60
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	106,911,193.14	226,566,528.28
未分配利润	6.4.7.10	47,237,351.15	76,024,731.77
所有者权益合计		154,148,544.29	302,591,260.05
负债和所有者权益总计		161,508,625.18	311,240,320.65

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，华泰柏瑞行业精选混合 A 基金份额净值 1.4427 元，基金份额总额 85,093,296.54 份；华泰柏瑞行业精选混合 C 基金份额净值 1.4384 元，基金份额总额 21,817,896.60 份。华泰柏瑞行业精选混合份额总额合计为 106,911,193.14 份。

6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞行业精选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 4 月 22 日(基金 合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		19,684,038.71	82,238,752.03
1.利息收入		29,134.35	112,080.60
其中：存款利息收入	6.4.7.11	29,134.35	111,928.33
债券利息收入		-	152.27
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）		48,739,159.29	7,418,655.16
其中：股票投资收益	6.4.7.12	48,390,037.98	2,651,844.16
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资	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	349,121.31	4,766,811.00
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-29,344,669.47	74,357,526.45
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	260,414.54	350,489.82
减：二、费用		3,743,246.02	5,552,347.33
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,417,455.73	2,420,881.05
2. 托管费	6.4.10.2.2	236,242.59	403,480.17
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	48,138.84	45,797.40
4. 交易费用	6.4.7.19	1,936,361.03	2,633,736.81
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	0.55
7. 其他费用	6.4.7.20	105,047.83	48,451.35
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		15,940,792.69	76,686,404.70
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		15,940,792.69	76,686,404.70

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华泰柏瑞行业精选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）	226,566,528.28	76,024,731.77	302,591,260.05
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	15,940,792.69	15,940,792.69
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）	-119,655,335.14	-44,728,173.31	-164,383,508.45
其中：1.基金申购款	24,438,172.47	7,359,337.32	31,797,509.79
2.基金赎回款	-144,093,507.61	-52,087,510.63	-196,181,018.24
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)	106,911,193.14	47,237,351.15	154,148,544.29
项目	上年度可比期间 2020年4月22日(基金合同生效日)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)	858,637,018.38	-	858,637,018.38
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	76,686,404.70	76,686,404.70
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)	-112,365,274.23	-5,400,038.34	-117,765,312.57
其中：1.基金申购款	4,155,234.31	202,307.36	4,357,541.67
2.基金赎回款	-116,520,508.54	-5,602,345.70	-122,122,854.24
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)	746,271,744.15	71,286,366.36	817,558,110.51

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 韩勇 _____ 房伟力 _____ 赵景云
 基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞行业精选混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]1819号《关于准予华泰柏瑞行业精选混合型证券投资基金注册的批复》核准,由华泰柏瑞基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞行业精选混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,

存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 858,396,034.05 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(2020)第 0278 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华泰柏瑞行业精选混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 4 月 22 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 858,637,018.38 份基金份额，其中认购资金利息折合 240,984.33 份基金份额。本基金的基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《华泰柏瑞行业精选混合型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞行业精选混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、存托凭证、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、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金将根据相关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 60-95%；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%。本基金的业绩比较基准为中证 800 指数收益率×80%+上证国债指数收益率×10%+银行活期存款利率(税后)×10%。

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

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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》、《华泰柏瑞行业精选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重大会计差错。

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:

(a) 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 日前取得的基金、非货物期货,可以选择按照实际买入价计算销售额,或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(b)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。

(c)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。

(d)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。

(e)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	15,952,005.30
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：	15,952,005.30

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	124,085,221.00	144,805,181.53	20,719,960.53
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		124,085,221.00	144,805,181.53	20,719,960.53

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无。

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：无。

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	1,371.91
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	265.80
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	45.00
合计	1,682.71

6.4.7.6 其他资产

注：无。

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	431,999.64
银行间市场应付交易费用	-
合计	431,999.64

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	13,800.48
应付证券出借违约金	-
预提费用	89,260.15
合计	103,060.63

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

华泰柏瑞行业精选混合 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	180,334,149.84	180,334,149.84
本期申购	11,524,569.98	11,524,569.98
本期赎回(以“-”号填列)	-106,765,423.28	-106,765,423.28
- 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	85,093,296.54	85,093,296.54

金额单位：人民币元

华泰柏瑞行业精选混合 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	46,232,378.44	46,232,378.44
本期申购	12,913,602.49	12,913,602.49
本期赎回(以“-”号填列)	-37,328,084.33	-37,328,084.33
- 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	21,817,896.60	21,817,896.60

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

华泰柏瑞行业精选混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	63,430,295.59	-2,833,536.75	60,596,758.84
本期利润	36,121,182.57	-23,705,939.57	12,415,243.00
本期基金份额交易产生的变动数	-47,137,969.03	11,798,076.63	-35,339,892.40
其中：基金申购款	6,264,901.61	-2,939,485.39	3,325,416.22
基金赎回款	-53,402,870.64	14,737,562.02	-38,665,308.62
本期已分配利润	-	-	-
本期末	52,413,509.13	-14,741,399.69	37,672,109.44

单位：人民币元

华泰柏瑞行业精选混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	16,152,328.59	-724,355.66	15,427,972.93
本期利润	9,164,279.59	-5,638,729.90	3,525,549.69
本期基金份额交易产生的变动数	-11,977,293.64	2,589,012.73	-9,388,280.91
其中：基金申购款	6,832,659.14	-2,798,738.04	4,033,921.10
基金赎回款	-18,809,952.78	5,387,750.77	-13,422,202.01
本期已分配利润	-	-	-
本期末	13,339,314.54	-3,774,072.83	9,565,241.71

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	21,630.68
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	6,310.34
其他	1,193.33
合计	29,134.35

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	695,524,564.40
减：卖出股票成本总额	647,134,526.42
买卖股票差价收入	48,390,037.98

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无。

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：无。

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：无。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

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：无。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

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	349,121.31
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	349,121.31

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	-29,344,669.47
——股票投资	-29,344,669.47
——债券投资	-
——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	-29,344,669.47

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	249,064.48
转换费收入	11,350.06
合计	260,414.54

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，其中 A 类基金份额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。C 类基金份额的赎回费全额计入基金财产。

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	1,936,361.03
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	1,936,361.03

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	6,787.68
银行间账户服务费	9,000.00
合计	105,047.83

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截止资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截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	上年度可比期间
-------	----	---------

	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		2020 年 4 月 22 日 (基金合同生效日) 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	81,252,419.64	6.62%	0.00	0.00%

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	75,309.70	6.68%	75,309.70	17.43%
关联方名称	上年度可比期间 2020 年 4 月 22 日 (基金合同生效日) 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
华泰证券	-	-	-	-

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 4 月 22 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 6 月 30 日
	当期发生的基金应支付的管理费	1,417,455.73
其中：支付销售机构的客户维护费	518,522.55	1,173,760.13

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	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 4 月 22 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	236,242.59	403,480.17

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		
	华泰柏瑞行业精选混合 A	华泰柏瑞行业精选混合 C	合计
中国银行股份有限公司	0.00	5,491.74	5,491.74
华泰证券股份有限公司	0.00	343.89	343.89
华泰柏瑞基金管理有限公司	0.00	159.46	159.46
合计	0.00	5,995.09	5,995.09
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2020 年 4 月 22 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰柏瑞行业精选混合 A	华泰柏瑞行业精选混合 C	合计
中国银行股份有限公司	0.00	5,432.23	5,432.23
华泰证券股份有限公司	0.00	228.80	228.80
华泰柏瑞基金管理有限公司	0.00	75.97	75.97
合计	0.00	5,737.00	5,737.00

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：无。

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 4 月 22 日(基金合同生效日)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	15,952,005.30	21,630.68	55,222,673.61	100,281.67

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	688656	浩欧博	网下申购	1,371	48,341.46

券					
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	3,114	36,496.08
华泰联合证 券	688083	中望软件	网下申购	439	66,069.50
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	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：无。

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
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	24.6	163	360	8,856.00	58,680.00	
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	443	10,937.67	14,047.53	-
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 科技	2021 年 2 月 2 日	2021 年 8 月 9 日	新股锁 定期内	21.31	49.94	252	5,370.12	12,584.88	-
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	312	3,656.64	8,448.96	-
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	353	4,536.05	9,107.40	-
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	117	5,537.61	29,479.32	-
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	315	2,671.20	6,952.05	-
300962	中金	2021 年	2021	新股锁	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-

	辐照	3月29日	2021年10月11日	定期内						
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	598	4,108.26	7,217.86	-
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	138	3,902.64	15,967.98	-
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	527	4,437.34	7,167.20	-
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	185	6,145.70	16,187.50	-
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	86	4,178.74	7,773.54	-
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	118	2,938.20	2,927.58	-
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	179	2,647.41	5,472.03	-
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	新股锁定期内	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-

		日	月 22 日							
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 2 日	新股锁定期内	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
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	401	5,028.54	11,183.89	-
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	346	2,643.44	13,435.18	-
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	7,351	60,939.79	60,939.79	-
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	3,886	41,347.04	41,347.04	-
301021	英诺	2021 年	2021	新股未	9.46	9.46	2,899	27,424.54	27,424.54	-

	激光	6月28日	2021年7月6日	上市						
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	-
688676	金盘科技	2021年3月2日	2021年9月9日	新股锁定期内	10.10	16.24	3,750	37,875.00	60,900.00	-
688686	奥普特	2020年12月24日	2021年7月1日	新股锁定期内	78.49	451.00	1,243	97,563.07	560,593.00	-

注：1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起6个月。

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

注：无。

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：无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：无。

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。

于 2021 年 6 月 30 日，本基金无债券投资(2020 年 12 月 31 日：同)。

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

注：无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。

于 2021 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股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 0.81%。

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	15,952,005.30	-	-	-	-	-	15,952,005.30
结算备付金	590,493.80	-	-	-	-	-	590,493.80
存出保证金	99,941.43	-	-	-	-	-	99,941.43
交易性金融资 产	-	-	-	-	-	144,805,181.53	144,805,181.53

应收利息	-	-	-	-	-	1,682.71	1,682.71
应收申购款	-	-	-	-	-	59,320.41	59,320.41
资产总计	16,642,440.53	-	-	-	-	144,866,184.65	161,508,625.18
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	1,559,726.21	1,559,726.21
应付赎回款	-	-	-	-	-	5,029,110.53	5,029,110.53
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	196,813.87	196,813.87
应付托管费	-	-	-	-	-	32,802.30	32,802.30
应付销售服务费	-	-	-	-	-	6,567.71	6,567.71
应付交易费用	-	-	-	-	-	431,999.64	431,999.64
其他负债	-	-	-	-	-	103,060.63	103,060.63
负债总计	-	-	-	-	-	7,360,080.89	7,360,080.89
利率敏感度缺口	16,642,440.53	-	-	-	-	-137,506,103.76	154,148,544.29
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	18,735,832.68	-	-	-	-	-	18,735,832.68
结算备付金	1,074,704.13	-	-	-	-	-	1,074,704.13
存出保证金	200,567.50	-	-	-	-	-	200,567.50
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-285,737,050.47	285,737,050.47
应收证券清算款	-	-	-	-	-	5,408,526.68	5,408,526.68
应收利息	-	-	-	-	-	2,708.25	2,708.25
应收申购款	-	-	-	-	-	80,930.94	80,930.94
资产总计	20,011,104.31	-	-	-	-	-291,229,216.34	311,240,320.65
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	7,368,187.57	7,368,187.57
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	397,181.66	397,181.66
应付托管费	-	-	-	-	-	66,196.95	66,196.95
应付销售服务费	-	-	-	-	-	13,692.48	13,692.48
应付交易费用	-	-	-	-	-	640,198.36	640,198.36
应交税费	-	-	-	-	-	0.02	0.02
其他负债	-	-	-	-	-	163,603.56	163,603.56
负债总计	-	-	-	-	-	8,649,060.60	8,649,060.60
利率敏感度缺口	20,011,104.31	-	-	-	-	-282,580,155.74	302,591,260.05

□							
---	--	--	--	--	--	--	--

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：同)，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及存托凭证投资比例为基金净资产的 60%-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%。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	144,805,181.53	93.94	285,737,050.47	94.43
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	144,805,181.53	93.94	285,737,050.47	94.43

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%	12,032,961.90	16,446,583.28
	中证 800 指数下降 5%	-12,032,961.90	-16,446,583.28

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	144,805,181.53	89.66
	其中：股票	144,805,181.53	89.66
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	16,542,499.10	10.24
8	其他各项资产	160,944.55	0.10
9	合计	161,508,625.18	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	104,548,091.56	67.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.01
E	建筑业	25,371.37	0.02
F	批发和零售业	1,146,944.78	0.74
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	88,139.09	0.06
J	金融业	35,009.40	0.02
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	6,092,030.00	3.95
M	科学研究和技术服务业	16,174,889.00	10.49

N	水利、环境和公共设施管理业	34,528.80	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	16,647,157.14	10.80
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	144,805,181.53	93.94

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：无。

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	300750	宁德时代	27,100	14,493,080.00	9.40
2	002812	恩捷股份	51,100	11,962,510.00	7.76
3	600763	通策医疗	20,800	8,548,800.00	5.55
4	603259	药明康德	52,300	8,189,657.00	5.31
5	300759	康龙化成	36,800	7,985,232.00	5.18
6	002709	天赐材料	72,100	7,684,418.00	4.99
7	002791	坚朗五金	34,300	6,655,915.00	4.32
8	300595	欧普康视	61,100	6,326,905.00	4.10
9	601888	中国中免	20,300	6,092,030.00	3.95
10	600132	重庆啤酒	30,100	5,958,295.00	3.87
11	300015	爱尔眼科	70,793	5,024,887.14	3.26
12	002568	百润股份	52,900	5,014,391.00	3.25
13	300450	先导智能	81,100	4,877,354.00	3.16
14	300035	中科电气	181,000	4,425,450.00	2.87
15	300896	爱美客	5,500	4,338,840.00	2.81
16	300014	亿纬锂能	41,500	4,313,095.00	2.80
17	300124	汇川技术	53,300	3,958,058.00	2.57
18	002459	晶澳科技	79,000	3,871,000.00	2.51
19	601012	隆基股份	41,300	3,669,092.00	2.38
20	603901	永创智能	189,800	3,422,094.00	2.22
21	300347	泰格医药	15,900	3,073,470.00	1.99
22	000799	酒鬼酒	11,800	3,016,080.00	1.96
23	600809	山西汾酒	6,600	2,956,800.00	1.92

24	688059	华锐精密	9,360	1,571,544.00	1.02
25	300171	东富龙	37,400	1,520,310.00	0.99
26	688308	欧科亿	21,332	1,445,669.64	0.94
27	002415	海康威视	15,000	967,500.00	0.63
28	600976	健民集团	15,300	887,400.00	0.58
29	688686	奥普特	1,243	560,593.00	0.36
30	002614	奥佳华	20,500	463,915.00	0.30
31	300919	中伟股份	1,360	221,680.00	0.14
32	301015	百洋医药	3,460	188,317.42	0.12
33	605499	东鹏饮料	632	158,505.60	0.10
34	603799	华友钴业	1,000	114,200.00	0.07
35	301018	申菱环境	7,351	60,939.79	0.04
36	688676	金盘科技	3,750	60,900.00	0.04
37	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.03
38	688618	三旺通信	1,117	47,718.24	0.03
39	301020	密封科技	3,886	41,347.04	0.03
40	688111	金山办公	100	39,480.00	0.03
41	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.02
42	300763	锦浪科技	170	30,702.00	0.02
43	300957	贝泰妮	117	29,479.32	0.02
44	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.02
45	001207	联科科技	682	22,581.02	0.01
46	300979	华利集团	185	16,187.50	0.01
47	300973	立高食品	138	15,967.98	0.01
48	300925	法本信息	600	15,774.00	0.01
49	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.01
50	300932	三友联众	443	14,047.53	0.01
51	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.01
52	300940	南极光	307	13,317.66	0.01
53	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.01
54	300937	药易购	244	13,105.24	0.01
55	301013	利和兴	471	12,768.81	0.01
56	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.01
57	300941	创识科技	252	12,584.88	0.01
58	603171	税友股份	637	12,230.40	0.01
59	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.01
60	301009	可靠股份	401	11,183.89	0.01
61	605287	德才股份	349	11,014.44	0.01
62	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.01

63	300956	英力股份	353	9,107.40	0.01
64	300966	共同药业	286	9,020.44	0.01
65	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.01
66	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.01
67	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.01
68	300950	德固特	219	8,569.47	0.01
69	300952	恒辉安防	312	8,448.96	0.01
70	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.01
71	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.01
72	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.01
73	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.01
74	300981	中红医疗	86	7,773.54	0.01
75	300968	格林精密	598	7,217.86	0.00
76	300978	东箭科技	527	7,167.20	0.00
77	300961	深水海纳	315	6,952.05	0.00
78	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
79	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
80	300986	志特新材	179	5,472.03	0.00
81	002833	弘亚数控	140	5,425.00	0.00
82	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
83	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
84	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
85	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
86	300998	宁波方正	203	4,347.24	0.00
87	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
88	603529	爱玛科技	57	3,312.84	0.00
89	300985	致远新能	118	2,927.58	0.00
90	601665	齐鲁银行	31	288.30	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	26,825,105.97	8.87
2	000858	五粮液	18,753,960.00	6.20
3	300750	宁德时代	18,297,653.00	6.05
4	300144	宋城演艺	16,632,990.40	5.50

5	300010	豆神教育	15,664,172.70	5.18
6	600298	安琪酵母	15,212,534.26	5.03
7	300122	智飞生物	13,958,536.00	4.61
8	300014	亿纬锂能	13,925,235.11	4.60
9	600809	山西汾酒	13,245,741.00	4.38
10	000333	美的集团	11,798,613.00	3.90
11	300124	汇川技术	11,540,485.00	3.81
12	002241	歌尔股份	10,816,007.72	3.57
13	002414	高德红外	10,778,481.58	3.56
14	002027	分众传媒	10,100,615.00	3.34
15	000568	泸州老窖	9,900,582.36	3.27
16	600031	三一重工	9,509,373.00	3.14
17	002791	坚朗五金	9,471,530.00	3.13
18	300450	先导智能	9,338,983.54	3.09
19	002389	航天彩虹	8,754,886.00	2.89
20	601012	隆基股份	8,553,154.28	2.83
21	600763	通策医疗	8,423,702.00	2.78
22	002607	中公教育	8,127,522.00	2.69
23	603259	药明康德	7,895,906.80	2.61
24	300595	欧普康视	7,845,844.88	2.59
25	000799	酒鬼酒	7,680,033.00	2.54
26	002568	百润股份	7,482,973.60	2.47
27	000547	航天发展	7,393,705.20	2.44
28	002025	航天电器	7,257,216.12	2.40
29	600779	水井坊	7,179,119.00	2.37
30	688036	传音控股	7,144,702.45	2.36
31	000661	长春高新	6,723,126.00	2.22
32	300759	康龙化成	6,689,834.00	2.21
33	002812	恩捷股份	6,666,422.00	2.20
34	601888	中国中免	6,630,189.00	2.19

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	601888	中国中免	30,778,476.00	10.17
2	000333	美的集团	29,296,104.44	9.68
3	300750	宁德时代	27,848,986.00	9.20
4	002241	歌尔股份	26,892,707.76	8.89
5	600519	贵州茅台	25,462,275.99	8.41
6	002027	分众传媒	25,046,333.21	8.28
7	300014	亿纬锂能	22,318,826.18	7.38
8	688111	金山办公	21,944,569.17	7.25
9	300124	汇川技术	21,057,129.00	6.96
10	002475	立讯精密	19,665,096.10	6.50
11	000858	五粮液	19,018,149.90	6.29
12	600298	安琪酵母	18,592,572.42	6.14
13	002714	牧原股份	18,233,272.50	6.03
14	300144	宋城演艺	16,969,104.04	5.61
15	300601	康泰生物	15,184,408.00	5.02
16	603338	浙江鼎力	14,700,882.70	4.86
17	300122	智飞生物	13,804,017.52	4.56
18	000651	格力电器	13,621,300.50	4.50
19	002157	正邦科技	13,584,548.31	4.49
20	000661	长春高新	13,514,650.60	4.47
21	300010	豆神教育	13,446,136.00	4.44
22	600809	山西汾酒	13,029,032.00	4.31
23	300496	中科创达	11,673,453.10	3.86
24	000568	泸州老窖	10,557,712.00	3.49
25	002812	恩捷股份	10,544,646.00	3.48
26	002414	高德红外	10,043,480.00	3.32
27	002607	中公教育	9,083,139.20	3.00
28	002044	美年健康	8,506,013.00	2.81
29	600031	三一重工	7,884,880.00	2.61
30	600276	恒瑞医药	7,847,956.37	2.59
31	002389	航天彩虹	6,955,236.00	2.30
32	600779	水井坊	6,904,511.00	2.28
33	300142	沃森生物	6,774,183.00	2.24
34	002025	航天电器	6,763,219.00	2.24
35	688036	传音控股	6,571,400.00	2.17
36	300782	卓胜微	6,465,460.00	2.14

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	535,547,326.95
卖出股票收入（成交）总额	695,524,564.40

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：无。

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：无。

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：无。

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：无。

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：无。

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：无。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：无。

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：无。

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：无。

7.11.3 本期国债期货投资评价

注：无。

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	99,941.43
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,682.71
5	应收申购款	59,320.41
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	160,944.55

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
华泰柏瑞行业精选混合 A	3,125	27,229.85	692,579.67	0.81%	84,400,716.87	99.19%
华泰柏瑞行业精选混合 C	3,150	6,926.32	100,027.08	0.46%	21,717,869.52	99.54%
合计	6,171	17,324.78	792,606.75	0.74%	106,118,586.39	99.26%

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	华泰柏瑞行业精选混合 A	5,108.84	0.0060%
	华泰柏瑞行业精选混合 C	83,977.42	0.3849%
	合计	89,086.26	0.0833%

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	华泰柏瑞行业精选混合 A	0
	华泰柏瑞行业精选混合 C	0

	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	华泰柏瑞行业精选混合 A	0
	华泰柏瑞行业精选混合 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华泰柏瑞行业精 选混合 A	华泰柏瑞行业精 选混合 C
基金合同生效日（2020 年 4 月 22 日）基金份 额总额	759,700,334.51	98,936,683.87
本报告期期初基金份额总额	180,334,149.84	46,232,378.44
本报告期基金总申购份额	11,524,569.98	12,913,602.49
减：本报告期基金总赎回份额	106,765,423.28	37,328,084.33
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	85,093,296.54	21,817,896.60

§ 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	3	351,679,808.69	28.65%	322,576.40	28.63%	-
申港证券	2	162,373,175.70	13.23%	148,491.53	13.18%	-
银河证券	3	88,510,215.62	7.21%	80,777.41	7.17%	-
长江证券	4	86,241,571.39	7.03%	79,059.61	7.02%	-
华泰证券	4	81,252,419.64	6.62%	75,309.70	6.68%	-
中信证券	3	80,225,191.06	6.54%	73,109.03	6.49%	-

齐鲁证券	2	62,211,622.95	5.07%	57,937.02	5.14%	-
广发证券	2	54,690,935.86	4.46%	49,840.27	4.42%	-
西藏东方财富	2	48,286,065.89	3.93%	44,361.14	3.94%	-
兴业证券	3	46,033,446.42	3.75%	41,977.40	3.73%	-
方正证券	3	31,299,814.24	2.55%	29,149.65	2.59%	-
中金公司	2	28,053,972.67	2.29%	26,077.00	2.31%	-
华创证券	1	23,539,680.45	1.92%	21,451.83	1.90%	-
华福证券	2	14,786,268.08	1.20%	13,474.99	1.20%	-
安信证券	3	14,299,227.08	1.16%	13,316.71	1.18%	-
东方证券	3	14,258,854.89	1.16%	12,994.09	1.15%	-
瑞银证券	2	11,436,751.26	0.93%	10,422.51	0.93%	-
万联证券	2	7,866,883.59	0.64%	7,169.04	0.64%	-
国金证券	1	7,122,164.89	0.58%	6,632.84	0.59%	-
国信证券	2	6,758,624.08	0.55%	6,294.17	0.56%	-
中银国际	3	5,860,212.29	0.48%	5,437.68	0.48%	-
湘财证券	1	776,100.00	0.06%	722.75	0.06%	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	3	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
宏信证券	1	-	-	-	-	-
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，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	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-

银河证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
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华泰柏瑞行业精选混合型证券投资基金基金经理变更的公告	证监会规定报刊和网站	2021年6月24日
3	华泰柏瑞基金管理有限公司关于提醒客户及时更新身份证件及非自然人客户及时登记受益所有人信息的公告	证监会规定报刊和网站	2021年6月22日
4	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参与珠海盈米基金销售有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2021年6月2日
5	华泰柏瑞基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证监会规定报刊和网站	2021年5月21日
6	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2021年5月20日
7	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参加浙商	证监会规定报刊和网站	2021年4月30日

	银行股份有限公司费率优惠活动的公告		
8	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止上海尚善基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 4 月 27 日
9	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参与蚂蚁（杭州）基金销售有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 4 月 20 日
10	华泰柏瑞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
11	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
12	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 3 月 5 日
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 4 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 2 月 27 日
15	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
16	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
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 1 月 22 日
18	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
19	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

20	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

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