

# 华泰柏瑞量化创盈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

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	8
2.4 信息披露方式.....	8
2.5 其他相关资料.....	8
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>9</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	9
3.2 基金净值表现.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>12</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	15
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	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.....	18
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>19</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	19
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.....	19
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.....	19
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>20</b>
6.1 资产负债表.....	20
6.2 利润表.....	21
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	22

6.4 报表附注.....	23
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>51</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	51
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	51
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.....	52
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.....	59
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.....	59
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.....	59
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.....	59
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.....	59
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	60
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	60
7.12 投资组合报告附注.....	60
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>62</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	62
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	62
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.....	62
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>64</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>65</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	65
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.....	65
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	65
10.4 基金投资策略的改变.....	65
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	65
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.....	65
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	65
10.8 其他重大事件.....	68
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>71</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况.....	71

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	71
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>72</b>
12.1 备查文件目录.....	72
12.2 存放地点.....	72
12.3 查阅方式.....	72

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞量化创盈混合型证券投资基金	
基金简称	华泰柏瑞量化创盈混合	
基金主代码	010303	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 11 月 12 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	266,474,956.45 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	华泰柏瑞量化创盈混合 A	华泰柏瑞量化创盈混合 C
下属分级基金的交易代码:	010303	010304
报告期末下属分级基金的份额总额	197,343,684.27 份	69,131,272.18 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	利用定量投资模型，在力求有效控制投资风险的前提下，力争实现达到或超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	<p>(一) 股票投资策略</p> <p>本基金主要利用定量投资模型，跟踪创业板指数和上证科创板 50 成份指数，通过主动管理，使用量化方法选取并持有预期收益较好的股票构成投资组合，在有效控制风险的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。</p> <p>本基金运用的量化投资模型主要包括：</p> <p>1、多因子 alpha 模型——股票超额回报预测</p> <p>多因子 alpha 模型以中国股票市场较长期的回测研究为基础，结合前瞻性市场判断，用精研的多个因子捕捉市场有效性暂时缺失之处，以多因子在不同个股上的不同体现估测个股的超值回报。概括来讲，本基金 alpha 模型的因子可归为如下几类：价值(value)、质量(quality)、动量(momentum)、成长(growth)、市场预期等等。具体来说：</p> <p>1) 价值 (value)：包括市盈率 (PE)、市净率 (PB)、股息率、企业价值倍数 (EV/EBITDA)、市净率-净资产收益率 (PBROE) 等定量因子；</p> <p>2) 质量 (quality)：包括自由现金流 (FCF)、毛利率等定量因子；</p> <p>3) 动量 (momentum)：包括过去一段时间的股价涨跌幅、流动性等定量因子；</p> <p>4) 成长 (growth)：包括销售收入、净利润成长等定量因子。</p> <p>公司的量化投研团队会持续研究市场的状态以及市场变化，并对模型和模型所采用的因子做出适当更新或调整。多因子 alpha 模型利用长期积累并最新扩展的数据库，科学地考虑了大量的各类信息，包括来自市场各类投资者、公司各类报表、分析师预测等等多方的信息。基金经理根据市场状况及变化对各类信息的重要性做出具有一定前瞻性的判断，适合调整各因子类别的具体组成及权重。</p> <p>2、风险估测模型——有效控制预期风险</p>

	<p>本基金将利用风险预测模型和适当的控制措施，有效控制投资组合的预期投资风险，并力求将投资组合的实现风险控制在目标范围内。</p> <p>3、交易成本模型——控制交易成本以保护投资业绩</p> <p>本基金的交易成本模型既考虑固定成本，也考虑交易的市场冲击效应，以减少交易对业绩造成的负面影响。在控制交易成本的基础上，进行投资收益的优化。</p> <p>4、投资组合的优化和调整</p> <p>本基金将综合考虑预期回报，风险及交易成本进行投资组合优化。其选股范围将包括流动性和基本面信息较好的股票。构建投资组合时，将 alpha 因子、风险估测因子、交易成本模型、业绩基准等信息先后输入量化系统。系统以业绩基准做为基准，在控制各项风险指标并兼顾交易成本的同时找出 alpha 最优的投资组合，以期在风险收益表现上会达到我们旨在超越创业板指数的目标。投资组合构建完成后，本基金将充分考虑各种市场信息的变化情况，对投资组合进行相应调整，并根据市场的实际情况适当控制和调整组合的换手率。</p> <p>（二）债券投资策略</p> <p>本基金债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。本基金管理人将基于对国内外宏观经济形势的深入分析、国内财政政策与货币市场政策等因素对债券的影响，进行合理的利率预期，判断市场的基本走势，制定久期控制下的资产类属配置策略。在债券投资组合构建和管理过程中，本基金管理人将具体采用期限结构配置、市场转换、信用利差和相对价值判断、信用风险评估、现金管理等管理手段进行个券选择。</p> <p>（三）资产支持证券投资策略</p> <p>在对市场利率环境深入研究的基础上，本基金投资于资产支持证券将采用久期配置策略与期限结构配置策略，结合定量分析和定性分析的方法，综合分析资产支持证券的利率风险、提前偿付风险、流动性风险、税收溢价等因素，选择具有较高投资价值的资产支持证券进行配置。</p> <p>（四）金融衍生工具投资策略</p> <p>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、股票期权等相关金融衍生工具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、交易活跃的衍生品合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。若法律法规或监管机构以后允许基金投资如互换等其他金融衍生品种，本基金将以风险管理和组合优化为目的，根据届时法律法规的相关规定参与投资。</p> <p>（五）融资业务的投资策略</p> <p>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。待监管机构允许本基金参与融券交易及转融通证券出借业务后，在法律法规允许的范围内，在不改变基金的风险收益特征及对基金份额持有人无不利影响的前提下，本基金可参与相关业务，以提高组合的投资效率，从而更好地实现投资目标。具体参与投资的比例将按照届时相关法律法规的规定执行。</p>
<p>业绩比较基准</p>	<p>创业板指数收益率*85%+上证科创板 50 成份指数收益率*10%+银行活期存款利率(税后)*5%。</p>

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	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.huatai-pb.com">http://www.huatai-pb.com</a>
基金中期报告备置地点	上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层及基金托管人住所

### 2.5 其他相关资料

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

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	华泰柏瑞量化创盈混合 A	华泰柏瑞量化创盈混合 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	2,676,014.63	427,222.10
本期利润	24,975,182.61	8,566,359.53
加权平均基金份额本期利润	0.0839	0.0697
本期加权平均净值利润率	8.35%	6.96%
本期基金份额净值增长率	10.81%	10.37%
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	2,799,049.27	622,097.79
期末可供分配基金份额利润	0.0142	0.0090
期末基金资产净值	218,744,396.24	76,239,054.06
期末基金份额净值	1.1084	1.1028
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	10.84%	10.28%

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

华泰柏瑞量化创盈混合 A

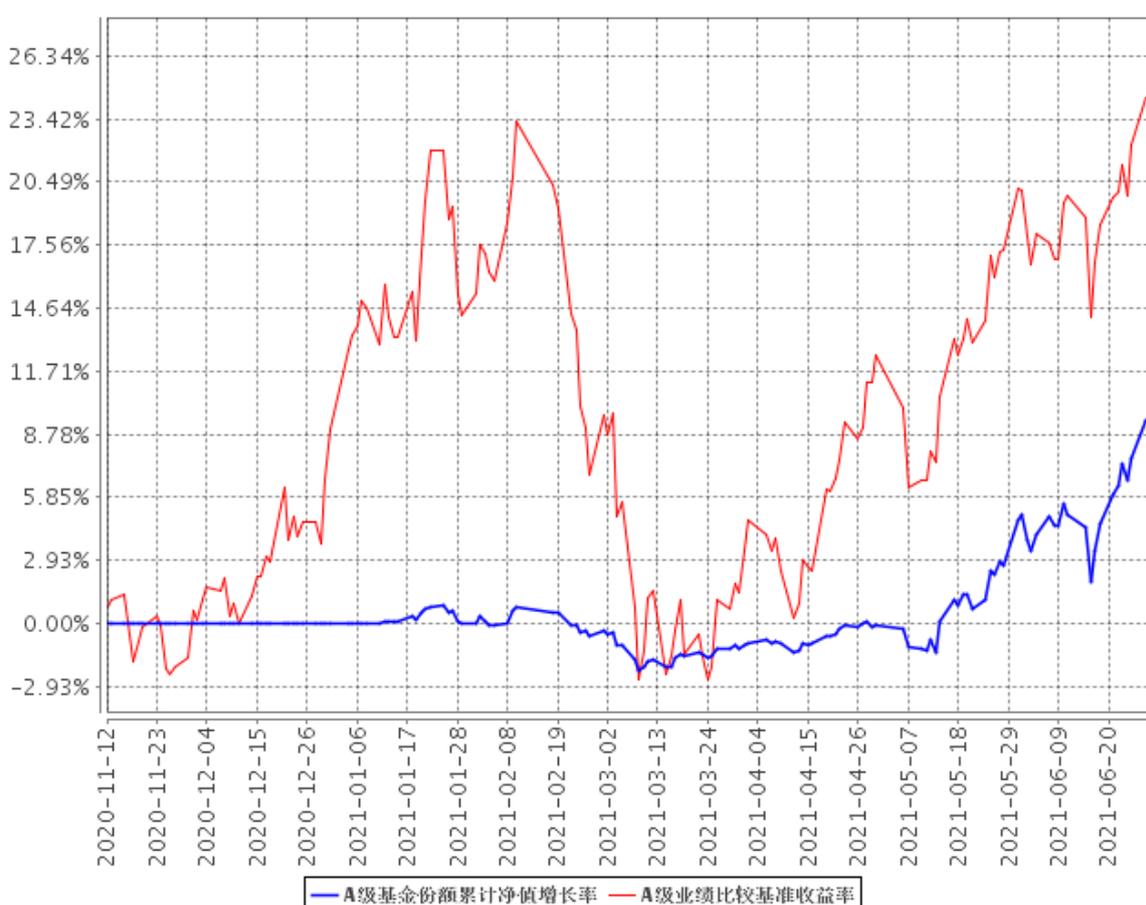
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	5.78%	1.02%	5.33%	1.53%	0.45%	-0.51%
过去三个月	12.13%	0.74%	24.80%	1.49%	-12.67%	-0.75%
过去六个月	10.81%	0.56%	16.19%	1.79%	-5.38%	-1.23%
自合同生效日至今	10.84%	0.50%	26.62%	1.68%	-15.78%	-1.18%

华泰柏瑞量化创盈混合 C

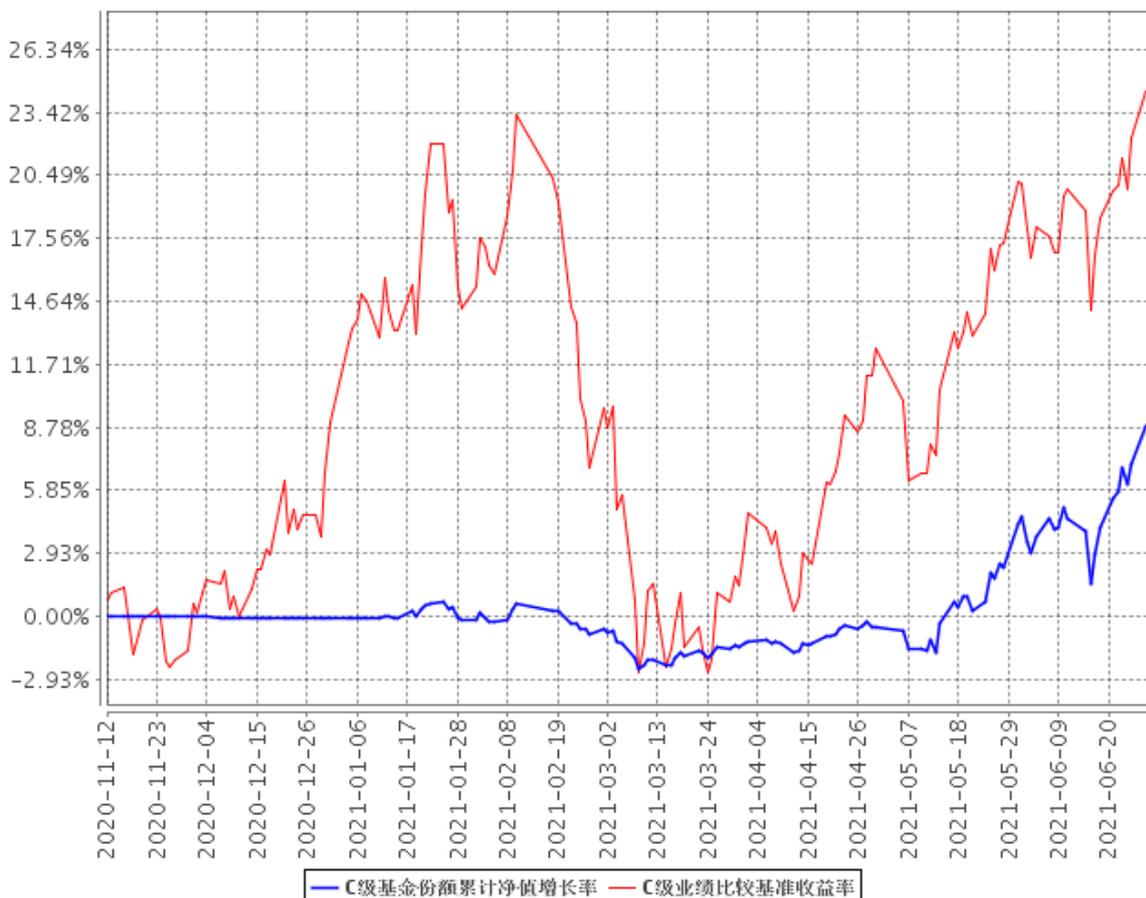
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	5.71%	1.02%	5.33%	1.53%	0.38%	-0.51%
过去三个月	11.90%	0.74%	24.80%	1.49%	-12.90%	-0.75%
过去六个月	10.37%	0.56%	16.19%	1.79%	-5.82%	-1.23%
自合同生效日至今	10.28%	0.49%	26.62%	1.68%	-16.34%	-1.19%

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、A级和C级图示日期均为2020年11月12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。

3、自基金合同生效起至本报告期末不满一年。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

融地产灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数基金、华泰柏瑞医疗健康混合型证券投资基金、华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通指数基金联接基金、华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞量化明选混合型证券投资基金、华泰柏瑞基本面智选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞锦泰一年定期开放债券型证券投资基金、华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞益通三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、华泰柏瑞研究精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞景气回报一年持有期混合型证券投资基金、华泰柏瑞锦兴 39 个月定期开放债券型证券投资基金、华泰柏瑞锦瑞债券型证券投资基金、华泰柏瑞益商一年定期开放债券型发起式证券投资基金、华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞质量成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞行业精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞鸿利中短债债券型证券投资基金、华泰柏瑞景气优选混合型证券投资基金、华泰柏瑞品质优选混合型证券投资基金、华泰柏瑞景利混合型证券投资基金、华泰柏瑞优势领航混合型证券投资基金、华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞锦乾债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化创盈混合型证券投资基金、华泰柏瑞成长智选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞量化创享混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞质量领先混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证稀土产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞品质成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证物联网主题交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞质量精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞港股通时代机遇混合型证券投资基金、华泰柏瑞行业严选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证企业核心竞争力 50 交易型开放式指数证券投资基金。截至 2021 年 6 月 30 日，公司基金管理规模为 2174.24 亿元。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
田汉卿	副总经理、本基金的基金经理	2020 年 11 月 12 日	-	19 年	副总经理。曾在美国巴克莱全球投资管理有限公司（BGI）担任投资经理，2012 年 8 月加入华泰柏瑞

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

					金经理。本科与研究生毕业于清华大学，MBA 毕业于美国加州大学伯克利分校哈斯商学院。
筭算	本基金的基金经理	2020 年 11 月 12 日	-	7 年	美国明尼苏达大学双城分校金融数学硕士，曾任中国金融期货交易所债券事业部助理经理。2016 年 6 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任量化与海外投资部助理研究员、研究员、高级研究员。2020 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。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。

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

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创盈混合 A 基金份额净值为 1.1084 元，本报告期基金份额净值增长率为 10.81%；截至本报告期末华泰柏瑞量化创盈混合 C 基金份额净值为 1.1028 元，本报告期基金份额净值增长率为 10.37%；同期业绩比较基准收益率为 16.19%。

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

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

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

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，基金管理人严格执行基金估值控制流程，定期评估估值技术的合理性，每日将估值结果报托管银行复核后对外披露。参与估值流程的人员包括负责运营的副总经理以及投资研究、风险控制、金融工程和基金事务部门负责人，基金经理不参与估值流程。参与人员的相关工作经历均在五年以上。参与各方之间不存在任何重大利益冲突。已采用的估值技术相关参数或定价服务均来自独立第三方。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利按照除权除息日的基金份额净值自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

2、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；

3、本基金各基金份额类别在费用收取上不同，其对应的可分配收益可能有所不同；本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

4、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

5、本基金本报告期内未进行利润分配。

#### **4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

本基金本报告期内未进行利润分配。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞量化创盈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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	38,464,792.65	97,546,402.16
结算备付金		3,923,870.35	265,011,745.91
存出保证金		92,614.35	-
交易性金融资产	6.4.7.2	261,937,151.34	-
其中：股票投资		261,937,151.34	-
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	-	240,000,000.00
应收证券清算款		185,659.29	-
应收利息	6.4.7.5	7,936.66	370,460.16
应收股利		-	-
应收申购款		245,267.77	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		304,857,292.41	602,928,608.23
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2020 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		2,407.80	-
应付赎回款		9,001,650.10	-
应付管理人报酬		402,123.93	764,623.41
应付托管费		67,020.68	127,437.23
应付销售服务费		57,372.10	139,452.97
应付交易费用	6.4.7.7	216,924.75	-
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	126,342.75	20,000.00
负债合计		9,873,842.11	1,051,513.61
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	266,474,956.45	601,904,551.17
未分配利润	6.4.7.10	28,508,493.85	-27,456.55
所有者权益合计		294,983,450.30	601,877,094.62
负债和所有者权益总计		304,857,292.41	602,928,608.23

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，华泰柏瑞量化创盈混合 A 基金份额净值 1.1084 元，基金份额总额 197,343,684.27 份；华泰柏瑞量化创盈混合 C 基金份额净值 1.1028 元，基金份额总额 69,131,272.18 份。华泰柏瑞量化创盈混合份额总额合计为 266,474,956.45 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞量化创盈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
<b>一、收入</b>		38,245,545.52
1.利息收入		2,369,784.19
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,836,921.93
债券利息收入		21.18
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		532,841.08
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		4,923,996.50
其中：股票投资收益	6.4.7.12	3,494,313.85
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	69,339.93
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	1,360,342.72
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	30,438,305.41
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	513,459.42
<b>减：二、费用</b>		4,704,003.38
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,153,444.69
2. 托管费	6.4.10.2.2	525,574.15
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	490,675.81
4. 交易费用	6.4.7.19	418,107.87
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		0.08
7. 其他费用	6.4.7.20	116,200.78
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		33,541,542.14
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		33,541,542.14

注：本基金成立于 2020 年 11 月 12 日，无上年度可比期间数据。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华泰柏瑞量化创盈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）	601,904,551.17	-27,456.55	601,877,094.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	33,541,542.14	33,541,542.14
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-335,429,594.72	-5,005,591.74	-340,435,186.46
其中：1.基金申购款	16,092,629.15	126,306.25	16,218,935.40
2.基金赎回款	-351,522,223.87	-5,131,897.99	-356,654,121.86
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)	266,474,956.45	28,508,493.85	294,983,450.30

注：本基金成立于 2020 年 11 月 12 日，无上年度可比期间数据。

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

华泰柏瑞量化创盈混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2020]2242号《关于准予华泰柏瑞量化创盈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《华泰柏瑞量化创盈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 601,785,727.97 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 0925 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华泰柏瑞量化创盈混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 11 月 12 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 601,785,727.97 份基金份额，其中认购资金利息折合 118,823.20 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《华泰柏瑞量化创盈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《华泰柏瑞量化创盈混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股

票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、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）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货、股票期权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。本基金股票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、股票期权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创业板指数收益率\*85%+上证科创板 50 成份指数收益率\*10%+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 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 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 重要会计政策和会计估计

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。

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止，本期财务报表的实际编制期间为 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日。

#### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

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

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

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

##### (2) 金融负债的分类

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

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

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

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 6.4.4.7 实收基金

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

#### 6.4.4.8 损益平准金

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

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

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

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

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

#### 6.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票

的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

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

#### **6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **6.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### **6.4.5.3 差错更正的说明**

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### **6.4.6 税项**

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

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

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

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

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

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

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	38,464,792.65

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：	38,464,792.65

#### 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	231,498,845.93	261,937,151.34	30,438,305.41
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	231,498,845.93	261,937,151.34	30,438,305.41

#### 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	6,195.82
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1,699.14
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	41.70
合计	7,936.66

#### 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	216,924.75
银行间市场应付交易费用	-
合计	216,924.75

#### 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	27,163.80
应付证券出借违约金	-
预提费用	99,178.95
合计	126,342.75

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

华泰柏瑞量化创盈混合 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	395,976,677.32	395,976,677.32
本期申购	5,836,825.25	5,836,825.25
本期赎回(以“-”号填列)	-204,469,818.30	-204,469,818.30
- 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	197,343,684.27	197,343,684.27

金额单位：人民币元

华泰柏瑞量化创盈混合 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	205,927,873.85	205,927,873.85
本期申购	10,255,803.90	10,255,803.90
本期赎回(以“-”号填列)	-147,052,405.57	-147,052,405.57
- 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	69,131,272.18	69,131,272.18

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

华泰柏瑞量化创盈混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	127,004.90	-	127,004.90
本期利润	2,676,014.63	22,299,167.98	24,975,182.61
本期基金份额交易产生的变动数	-3,970.26	-3,697,505.28	-3,701,475.54
其中：基金申购款	-1,890.05	69,337.78	67,447.73
基金赎回款	-2,080.21	-3,766,843.06	-3,768,923.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,799,049.27	18,601,662.70	21,400,711.97

单位：人民币元

华泰柏瑞量化创盈混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-154,461.45	-	-154,461.45
本期利润	427,222.10	8,139,137.43	8,566,359.53
本期基金份额交易产生的变动数	349,337.14	-1,653,453.34	-1,304,116.20
其中：基金申购款	-23,656.78	82,515.30	58,858.52
基金赎回款	372,993.92	-1,735,968.64	-1,362,974.72
本期已分配利润	-	-	-
本期末	622,097.79	6,485,684.09	7,107,781.88

#### 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	197,248.32
定期存款利息收入	13,500.00
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,625,886.70
其他	286.91
合计	1,836,921.93

#### 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	61,522,354.84
减：卖出股票成本总额	58,028,040.99
买卖股票差价收入	3,494,313.85

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2021年1月1日至2021年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	69,339.93
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	69,339.93

#### 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	277,561.83
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	208,200.00
减：应收利息总额	21.90
买卖债券差价收入	69,339.93

#### 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贵金属投资收益。

##### 6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

##### 6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

##### 6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,360,342.72
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,360,342.72

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	30,438,305.41
——股票投资	30,438,305.41
——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	30,438,305.41

### 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	480,756.42
转换费收入 010303	32,703.00
合计	513,459.42

- 注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额不低于 25% 的部分归入基金财产。
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，其中转出基金的赎回费不低于 25% 的部分归入转出基金的基金财产。

### 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	418,107.87
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	418,107.87

### 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	39,671.58
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	11,021.83
银行间账户服务费	6,000.00
合计	116,200.78

## 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

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

## 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	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
华泰证券	46,481,015.87	13.32%

#### 6.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本期未发生与关联方进行的权证交易。

#### 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	42,814.28	13.32%	42,814.28	19.74%

注：本基金成立于 2020 年 11 月 12 日，无上年度可比期间数据。

## 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
当期发生的基金应支付的管理费	3,153,444.69
其中：支付销售机构的客户维护费	1,128,810.42

注：1、支付基金管理人华泰柏瑞基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.50% / 当年天数。

2、本基金成立于 2020 年 11 月 12 日，无上年度可比期间数据。

### 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
当期发生的基金应支付的托管费	525,574.15

注：1、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 X 0.25% / 当年天数。

2、本基金成立于 2020 年 11 月 12 日，无上年度可比期间数据。

### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的	本期
----------	----

各关联方名称	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		
	华泰柏瑞量化创盈 混合 A	华泰柏瑞量化创盈 混合 C	合计
中国银行股份有限公司	0.00	53,651.68	53,651.68
华泰证券股份有限公司	0.00	40,509.80	40,509.80
华泰柏瑞基金管理有限 公司	0.00	151.61	151.61
合计	0.00	94,313.09	94,313.09

注：1、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 0.8% 的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.8\% \div \text{当年天数}$$

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。

2、本基金成立于 2020 年 11 月 12 日，无上年度可比期间数据。

#### 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：本基金本报告期内基金管理人未投资本基金。

##### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金本报告期内除基金管理人之外的其它关联方未投资本基金。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	38,464,792.65	197,248.32

注：1、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。

2、本基金成立于 2020 年 11 月 12 日，无上年度可比期间数据。

#### 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	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

注：本基金成立于 2020 年 11 月 12 日，无上年度可比期间数据。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

注：本基金本报告期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
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	英科再生	2021年6月30日	2021年7月9日	新股未上市	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
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	-
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	801	10,044.54	22,339.89	-
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	462	3,529.68	17,939.46	
688425	铁建重工	2021年6月11日	2021年12月22日	新股锁定期内	2.87	4.75	36,178	103,830.86	171,845.50	
688621	阳光诺和	2021年6月11日	2021年12月21日	新股锁定期内	26.89	63.99	1,485	39,931.65	95,025.15	

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

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

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

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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	5,613	1,086,237.45	1,881,814.38	

### 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：本基金本报告期末没有在银行间市场债券正回购交易中抵押的债券。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：本基金本报告期末没有在交易所市场债券正回购交易中抵押的债券。

### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未参与转融通证券的出借业务。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金，为证券投资基金中的中高风险、中高收益品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人建立的风险管理体系由“组织、制度、流程和报告”等四个方面构成。组织是指公司的风险管理组织架构包括董事会下设的风险管理与审计委员会、公司管理层的风险控制委员会、风险管理部和合规法律部以及公司各业务部门，董事会对建立基金风险管理内部控制系统和维持其有效性承担最终责任；制度是指风险管理相关的规章制度，是对组织职能及其工作流程等的具体规定；流程是风险管理的工作流程，它详细规定了各部门之间风险管理工作的内容和程序；报告是对流程的必要反映和记录，既是风险管理工作的重要环节，也是对风险管理工作的总结和披露。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程

度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### **6.4.13.2 信用风险**

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国银行，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 0.87%。

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	38,464,792.65	-	-	-	-	-	38,464,792.65
结算备付金	3,923,870.35	-	-	-	-	-	3,923,870.35
存出保证金	92,614.35	-	-	-	-	-	92,614.35
交易性金融资产	-	-	-	-	-	261,937,151.34	261,937,151.34
应收证券清算款	-	-	-	-	-	185,659.29	185,659.29
应收利息	-	-	-	-	-	7,936.66	7,936.66
应收申购款	-	-	-	-	-	245,267.77	245,267.77
资产总计	42,481,277.35	-	-	-	-	262,376,015.06	304,857,292.41
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	2,407.80	2,407.80
应付赎回款	-	-	-	-	-	9,001,650.10	9,001,650.10
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	402,123.93	402,123.93
应付托管费	-	-	-	-	-	67,020.68	67,020.68
应付销售服务费	-	-	-	-	-	57,372.10	57,372.10
应付交易费用	-	-	-	-	-	216,924.75	216,924.75
其他负债	-	-	-	-	-	126,342.75	126,342.75
负债总计	-	-	-	-	-	9,873,842.11	9,873,842.11
利率敏感度缺口	42,481,277.35	-	-	-	-	-252,502,172.95	294,983,450.30
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	97,546,402.16	-	-	-	-	-	97,546,402.16
结算备付金	265,011,745.91	-	-	-	-	-	265,011,745.91
买入返售金融资产	240,000,000.00	-	-	-	-	-	240,000,000.00
应收利息	-	-	-	-	-	370,460.16	370,460.16
资产总计	602,558,148.07	-	-	-	-	370,460.16	602,928,608.23

负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	764,623.41	764,623.41
应付托管费	-	-	-	-	-	127,437.23	127,437.23
应付销售服务费	-	-	-	-	-	139,452.97	139,452.97
其他负债	-	-	-	-	-	20,000.00	20,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	1,051,513.61	1,051,513.61
利率敏感度缺口	602,558,148.07	-	-	-	-	-681,053.45	601,877,094.62

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资产及存托凭证投

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、股票期权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	261,937,151.34	88.80	-	-
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	261,937,151.34	88.80	-	-

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除创业板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）
	创业板指数上升 5%		9,352,193.43
创业板指数下降 5%		-9,352,193.43	0.00

#### 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	261,937,151.34	85.92
	其中：股票	261,937,151.34	85.92
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	42,388,663.00	13.90
8	其他各项资产	531,478.07	0.17
9	合计	304,857,292.41	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	2,185,880.80	0.74
B	采矿业	1,009,014.00	0.34
C	制造业	207,332,425.19	70.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00
E	建筑业	400,214.44	0.14
F	批发和零售业	11,861,063.06	4.02
G	交通运输、仓储和邮政业	3,004,175.10	1.02
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,640,985.16	6.32
J	金融业	4,557,109.10	1.54
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	4,618,018.00	1.57
M	科学研究和技术服务业	2,212,538.05	0.75

N	水利、环境和公共设施管理业	3,597,795.70	1.22
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	375,934.10	0.13
R	文化、体育和娱乐业	2,128,978.25	0.72
S	综合	-	-
	合计	261,937,151.34	88.80

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	17,000	9,091,600.00	3.08
2	300122	智飞生物	48,200	9,000,386.00	3.05
3	600884	杉杉股份	233,800	5,452,216.00	1.85
4	688116	天奈科技	42,716	5,040,488.00	1.71
5	601636	旗滨集团	270,000	5,011,200.00	1.70
6	688099	晶晨股份	42,747	4,796,213.40	1.63
7	300769	德方纳米	23,100	4,774,539.00	1.62
8	300059	东方财富	136,200	4,465,998.00	1.51
9	300463	迈克生物	100,964	4,249,574.76	1.44
10	688396	华润微	44,510	4,051,300.20	1.37
11	300433	蓝思科技	133,800	3,935,058.00	1.33
12	603659	璞泰来	27,800	3,797,480.00	1.29
13	300782	卓胜微	6,980	3,751,750.00	1.27
14	300223	北京君正	36,500	3,683,580.00	1.25
15	300142	沃森生物	58,300	3,597,110.00	1.22
16	603267	鸿远电子	26,400	3,377,088.00	1.14
17	688036	传音控股	16,080	3,368,760.00	1.14
18	603599	广信股份	111,800	3,362,944.00	1.14
19	300363	博腾股份	39,500	3,322,740.00	1.13
20	603566	普莱柯	145,200	3,310,560.00	1.12
21	002603	以岭药业	110,575	3,224,367.00	1.09
22	002645	华宏科技	199,900	3,194,402.00	1.08
23	603738	泰晶科技	89,500	3,089,540.00	1.05

24	000028	国药一致	79,700	3,015,848.00	1.02
25	300755	华致酒行	73,700	3,007,697.00	1.02
26	603186	华正新材	81,917	2,986,693.82	1.01
27	600196	复星医药	40,800	2,942,904.00	1.00
28	603355	莱克电气	45,900	2,856,357.00	0.97
29	603678	火炬电子	39,164	2,643,570.00	0.90
30	000725	京东方 A	411,800	2,569,632.00	0.87
31	300726	宏达电子	35,600	2,509,444.00	0.85
32	603606	东方电缆	124,068	2,498,729.52	0.85
33	688139	海尔生物	23,573	2,477,522.30	0.84
34	603337	杰克股份	91,800	2,453,814.00	0.83
35	688508	芯朋微	22,070	2,441,824.80	0.83
36	603489	八方股份	10,100	2,387,438.00	0.81
37	601607	上海医药	112,100	2,368,673.00	0.80
38	603185	上机数控	12,956	2,318,476.20	0.79
39	601598	中国外运	458,482	2,315,334.10	0.78
40	600426	华鲁恒升	74,100	2,293,395.00	0.78
41	688111	金山办公	5,800	2,289,840.00	0.78
42	300748	金力永磁	70,080	2,216,630.40	0.75
43	300623	捷捷微电	56,100	2,122,263.00	0.72
44	688005	容百科技	17,060	2,067,672.00	0.70
45	300529	健帆生物	22,400	1,934,464.00	0.66
46	688368	晶丰明源	5,613	1,881,814.38	0.64
47	603043	广州酒家	72,800	1,872,416.00	0.63
48	002027	分众传媒	195,200	1,836,832.00	0.62
49	300662	科锐国际	30,300	1,836,786.00	0.62
50	002833	弘亚数控	47,220	1,829,775.00	0.62
51	300406	九强生物	92,700	1,828,971.00	0.62
52	603179	新泉股份	53,500	1,759,080.00	0.60
53	002064	华峰氨纶	121,800	1,729,560.00	0.59
54	600845	宝信软件	33,020	1,680,718.00	0.57
55	603806	福斯特	15,980	1,679,977.40	0.57
56	300316	晶盛机电	33,200	1,676,600.00	0.57
57	603486	科沃斯	7,300	1,664,984.00	0.56
58	002727	一心堂	47,200	1,562,792.00	0.53
59	300124	汇川技术	19,350	1,436,931.00	0.49
60	600989	宝丰能源	104,300	1,426,824.00	0.48
61	603568	伟明环保	62,300	1,422,309.00	0.48
62	002714	牧原股份	22,540	1,370,882.80	0.46

63	002179	中航光电	17,300	1,367,046.00	0.46
64	600176	中国巨石	87,439	1,356,178.89	0.46
65	300601	康泰生物	9,100	1,355,900.00	0.46
66	300687	赛意信息	63,314	1,353,020.18	0.46
67	300642	透景生命	15,100	1,295,731.00	0.44
68	002648	卫星石化	32,600	1,277,594.00	0.43
69	300659	中孚信息	37,900	1,272,303.00	0.43
70	603877	太平鸟	23,300	1,243,754.00	0.42
71	603260	合盛硅业	15,600	1,199,796.00	0.41
72	688300	联瑞新材	19,287	1,195,794.00	0.41
73	603233	大参林	22,960	1,173,485.60	0.40
74	601865	福莱特	29,100	1,150,323.00	0.39
75	300196	长海股份	64,200	1,101,672.00	0.37
76	601900	南方传媒	139,200	1,085,760.00	0.37
77	603416	信捷电气	17,100	1,085,337.00	0.37
78	688202	美迪西	2,081	1,081,911.90	0.37
79	300450	先导智能	17,820	1,071,694.80	0.36
80	002139	拓邦股份	58,950	1,060,510.50	0.36
81	600885	宏发股份	16,900	1,059,630.00	0.36
82	002978	安宁股份	16,700	1,009,014.00	0.34
83	300747	锐科激光	8,700	992,322.00	0.34
84	688389	普门科技	32,000	981,120.00	0.33
85	600746	江苏索普	62,100	952,614.00	0.32
86	300763	锦浪科技	5,270	951,762.00	0.32
87	601828	美凯龙	78,700	944,400.00	0.32
88	000157	中联重科	100,500	928,620.00	0.31
89	300724	捷佳伟创	8,000	928,080.00	0.31
90	300014	亿纬锂能	8,900	924,977.00	0.31
91	603638	艾迪精密	21,280	912,273.60	0.31
92	002025	航天电器	18,100	908,077.00	0.31
93	600332	白云山	26,600	900,410.00	0.31
94	300562	乐心医疗	60,300	895,455.00	0.30
95	002156	通富微电	37,100	891,884.00	0.30
96	603986	兆易创新	4,740	890,646.00	0.30
97	000403	双林生物	28,600	890,032.00	0.30
98	002007	华兰生物	23,800	872,984.00	0.30
99	002614	奥佳华	37,700	853,151.00	0.29
100	601689	拓普集团	22,100	827,203.00	0.28
101	300138	晨光生物	53,800	823,140.00	0.28

102	300676	华大基因	6,900	818,340.00	0.28
103	300761	立华股份	24,600	814,998.00	0.28
104	600409	三友化工	80,300	811,833.00	0.28
105	603010	万盛股份	38,700	811,539.00	0.28
106	601231	环旭电子	47,400	796,794.00	0.27
107	300593	新雷能	18,240	792,528.00	0.27
108	300785	值得买	8,300	788,500.00	0.27
109	002266	浙富控股	156,500	780,935.00	0.26
110	603298	杭叉集团	42,900	778,206.00	0.26
111	600111	北方稀土	37,400	774,180.00	0.26
112	300639	凯普生物	23,276	768,340.76	0.26
113	688388	嘉元科技	7,833	712,489.68	0.24
114	002034	旺能环境	44,506	709,870.70	0.24
115	002901	大博医疗	9,600	699,744.00	0.24
116	601827	三峰环境	72,300	684,681.00	0.23
117	601928	凤凰传媒	94,200	672,588.00	0.23
118	002048	宁波华翔	34,400	670,800.00	0.23
119	603898	好莱客	48,904	669,984.80	0.23
120	300119	瑞普生物	19,600	662,872.00	0.22
121	002430	杭氧股份	18,800	650,292.00	0.22
122	300408	三环集团	15,200	644,784.00	0.22
123	000513	丽珠集团	12,700	635,254.00	0.22
124	300035	中科电气	24,800	606,360.00	0.21
125	002332	仙琚制药	48,200	604,428.00	0.20
126	600998	九州通	38,500	591,745.00	0.20
127	603444	吉比特	1,100	583,000.00	0.20
128	002384	东山精密	26,500	552,260.00	0.19
129	603612	索通发展	30,400	546,288.00	0.19
130	002726	龙大肉食	51,200	518,144.00	0.18
131	002129	中环股份	13,400	517,240.00	0.18
132	603713	密尔克卫	4,700	507,506.00	0.17
133	002106	莱宝高科	43,600	490,500.00	0.17
134	002138	顺络电子	12,400	480,748.00	0.16
135	002084	海鸥住工	87,070	469,307.30	0.16
136	300496	中科创达	2,900	455,474.00	0.15
137	603396	金辰股份	7,900	451,169.00	0.15
138	002925	盈趣科技	11,320	440,461.20	0.15
139	300661	圣邦股份	1,650	417,004.50	0.14
140	600741	华域汽车	15,800	415,066.00	0.14

141	603392	万泰生物	1,540	399,137.20	0.14
142	000498	山东路桥	69,500	389,200.00	0.13
143	300482	万孚生物	5,881	380,441.89	0.13
144	002254	泰和新材	18,700	379,049.00	0.13
145	300229	拓尔思	42,000	376,740.00	0.13
146	000012	南玻A	35,800	366,592.00	0.12
147	002230	科大讯飞	5,300	358,174.00	0.12
148	300207	欣旺达	10,500	341,880.00	0.12
149	002850	科达利	3,800	332,120.00	0.11
150	603225	新凤鸣	16,100	326,830.00	0.11
151	688516	奥特维	2,200	325,600.00	0.11
152	603501	韦尔股份	1,000	322,000.00	0.11
153	603609	禾丰股份	30,700	319,894.00	0.11
154	600867	通化东宝	26,300	314,022.00	0.11
155	000039	中集集团	16,300	296,334.00	0.10
156	688106	金宏气体	10,720	289,761.60	0.10
157	600183	生益科技	12,200	285,602.00	0.10
158	300274	阳光电源	2,200	253,132.00	0.09
159	300476	胜宏科技	11,000	240,350.00	0.08
160	300760	迈瑞医疗	500	240,025.00	0.08
161	600562	国睿科技	15,900	239,613.00	0.08
162	000999	华润三九	8,600	230,050.00	0.08
163	688188	柏楚电子	500	218,000.00	0.07
164	603466	风语筑	12,315	201,350.25	0.07
165	601233	桐昆股份	8,300	199,947.00	0.07
166	300395	菲利华	4,100	197,702.00	0.07
167	300759	康龙化成	900	195,291.00	0.07
168	002241	歌尔股份	4,500	192,330.00	0.07
169	600380	健康元	13,400	183,982.00	0.06
170	603056	德邦股份	16,500	181,335.00	0.06
171	600586	金晶科技	19,100	177,821.00	0.06
172	300347	泰格医药	900	173,970.00	0.06
173	688425	铁建重工	36,178	171,845.50	0.06
174	603103	横店影视	11,500	169,280.00	0.06
175	603809	豪能股份	12,320	162,870.40	0.06
176	300653	正海生物	2,000	156,600.00	0.05
177	300015	爱尔眼科	1,945	138,056.10	0.05
178	002609	捷顺科技	13,300	133,133.00	0.05
179	300258	精锻科技	9,900	132,363.00	0.04

180	600761	安徽合力	11,400	126,084.00	0.04
181	002483	润邦股份	25,300	121,693.00	0.04
182	688363	华熙生物	400	111,144.00	0.04
183	688621	阳光诺和	1,485	95,025.15	0.03
184	688016	心脉医疗	200	90,922.00	0.03
185	601138	工业富联	7,200	89,352.00	0.03
186	300595	欧普康视	840	86,982.00	0.03
187	002567	唐人神	11,700	77,337.00	0.03
188	601100	恒立液压	900	77,328.00	0.03
189	000501	鄂武商 A	6,300	73,710.00	0.02
190	688012	中微公司	400	66,368.00	0.02
191	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.02
192	603882	金域医学	400	63,908.00	0.02
193	300373	扬杰科技	1,000	60,540.00	0.02
194	000425	徐工机械	9,500	60,515.00	0.02
195	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.02
196	300033	同花顺	500	56,390.00	0.02
197	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.02
198	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.02
199	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.02
200	688001	华兴源创	1,100	41,756.00	0.01
201	002651	利君股份	2,900	35,061.00	0.01
202	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.01
203	002026	山东威达	2,400	32,784.00	0.01
204	603728	鸣志电器	1,800	31,662.00	0.01
205	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.01
206	603456	九洲药业	500	24,290.00	0.01
207	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.01
208	002949	华阳国际	1,300	21,970.00	0.01
209	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.01
210	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.01
211	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
212	301013	利和兴	471	12,768.81	0.00
213	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
214	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
215	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
216	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
217	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
218	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00

219	301007	德迈仕	303	4,375.32	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	300122	智飞生物	9,658,480.00	1.60
2	300750	宁德时代	6,836,887.00	1.14
3	300142	沃森生物	5,625,370.00	0.93
4	300463	迈克生物	5,551,928.96	0.92
5	688099	晶晨股份	4,953,866.68	0.82
6	601636	旗滨集团	4,373,485.00	0.73
7	603678	火炬电子	4,355,808.04	0.72
8	600884	杉杉股份	3,887,475.15	0.65
9	603267	鸿远电子	3,848,055.00	0.64
10	300769	德方纳米	3,757,775.00	0.62
11	300433	蓝思科技	3,754,708.00	0.62
12	300601	康泰生物	3,677,493.28	0.61
13	300059	东方财富	3,646,970.00	0.61
14	688036	传音控股	3,542,372.14	0.59
15	300223	北京君正	3,499,647.00	0.58
16	603599	广信股份	3,285,973.15	0.55
17	603566	普莱柯	3,260,196.00	0.54
18	000028	国药一致	3,191,847.00	0.53
19	002645	华宏科技	3,184,021.00	0.53
20	002603	以岭药业	3,114,752.75	0.52

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	688005	容百科技	3,020,442.93	0.50
2	300142	沃森生物	2,565,294.00	0.43
3	688122	西部超导	2,317,871.19	0.39

4	300450	先导智能	2,033,002.00	0.34
5	688099	晶晨股份	1,980,403.49	0.33
6	603678	火炬电子	1,905,847.00	0.32
7	688002	睿创微纳	1,744,253.34	0.29
8	601231	环旭电子	1,723,897.00	0.29
9	600206	有研新材	1,700,629.00	0.28
10	300119	瑞普生物	1,672,005.00	0.28
11	300601	康泰生物	1,621,528.54	0.27
12	601828	美凯龙	1,494,557.00	0.25
13	300394	天孚通信	1,466,857.00	0.24
14	603806	福斯特	1,419,100.40	0.24
15	002985	北摩高科	1,408,415.00	0.23
16	002139	拓邦股份	1,377,390.00	0.23
17	688036	传音控股	1,327,854.98	0.22
18	002241	歌尔股份	1,321,328.00	0.22
19	603466	风语筑	1,203,558.20	0.20
20	300035	中科电气	1,180,448.00	0.20

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	289,526,886.92
卖出股票收入（成交）总额	61,522,354.84

注：不考虑相关交易费用。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

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

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

### 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。

### 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	92,614.35
2	应收证券清算款	185,659.29
3	应收股利	-
4	应收利息	7,936.66
5	应收申购款	245,267.77
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	531,478.07

#### **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
华泰柏瑞量化创盈混合 A	4,410	44,749.13	11,320,385.34	5.74%	186,023,298.93	94.26%
华泰柏瑞量化创盈混合 C	15,447	4,475.39	0.00	0.00%	69,131,272.18	100.00%
合计	19,644	13,565.21	11,320,385.34	4.25%	255,154,571.11	95.75%

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	华泰柏瑞量化创盈混合 A	2,550.58	0.0013%
	华泰柏瑞量化创盈混合 C	31,525.78	0.0456%
	合计	34,076.36	0.0128%

### 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	华泰柏瑞量化创盈混合 A	0
	华泰柏瑞量化创盈混合 C	0

	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	华泰柏瑞量化创盈混合 A	0
	华泰柏瑞量化创盈混合 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华泰柏瑞量化创盈混合 A	华泰柏瑞量化创盈混合 C
基金合同生效日（2020 年 11 月 12 日）基金份额总额	395,976,677.32	205,927,873.85
本报告期期初基金份额总额	395,976,677.32	205,927,873.85
本报告期基金总申购份额	5,836,825.25	10,255,803.90
减：本报告期基金总赎回份额	204,469,818.30	147,052,405.57
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	197,343,684.27	69,131,272.18

## § 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。

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未改聘为其审计的会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
银河证券	3	78,257,131.64	22.42%	71,316.78	22.19%	-
长江证券	4	77,132,317.26	22.10%	71,829.39	22.35%	-
申万宏源	2	60,110,247.64	17.22%	55,416.06	17.25%	-
华泰证券	4	46,481,015.87	13.32%	42,814.28	13.32%	-
中金公司	2	28,713,663.77	8.23%	26,168.37	8.14%	-
方正证券	2	15,637,589.02	4.48%	14,561.85	4.53%	-
国金证券	1	13,766,473.53	3.94%	12,820.75	3.99%	-

东方证券	3	9,976,989.08	2.86%	9,092.08	2.83%	-
万联证券	2	7,467,588.64	2.14%	6,805.19	2.12%	-
申港证券	2	5,476,209.00	1.57%	5,015.00	1.56%	-
中信证券	3	5,406,472.80	1.55%	4,927.03	1.53%	-
华创证券	1	176,695.00	0.05%	161.02	0.05%	-
安信证券	3	108,205.36	0.03%	100.78	0.03%	-
中泰证券	1	95,962.79	0.03%	89.37	0.03%	-
国信证券	1	67,655.70	0.02%	63.03	0.02%	-
西藏东方财富	2	67,229.13	0.02%	62.29	0.02%	-
兴业证券	3	56,953.38	0.02%	52.10	0.02%	-
中银国际	3	45,736.51	0.01%	42.59	0.01%	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
新时代证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
华龙证券	1	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
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，未受监管机构重大处罚；
- 3) 资金雄厚，信誉良好。内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求。
- 4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服务。
- 5) 具备研究实力，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、股票分析的研究报告及周到的信息服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告。

2、选择代理证券买卖的证券经营机构的程序

基金管理人根据以上标准进行考察后确定证券经营机构的选择。基金管理人与被选择的证券经营机构签订交易单元租用协议和证券研究服务协议。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
银河证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	400,000,000.00	66.67%	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	277,561.83	100.00%	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	100,000,000.00	16.67%	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

华创证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	100,000,000.00	16.67%	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
华龙证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
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	证监会规定报刊和	2021年6月22日

	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	网站	
2	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
3	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
4	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
5	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
6	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
7	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
8	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
9	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
10	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
11	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
12	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
13	华泰柏瑞量化创盈混合型证	证监会规定报刊和	2021 年 1 月 21 日

	券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资、费率优惠等业务公告	网站	
14	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
15	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

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

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

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

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

### 12.2 存放地点

上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

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

华泰柏瑞基金管理有限公司

2021 年 8 月 28 日