

华泰柏瑞品质成长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：招商银行股份有限公司

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、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。

基金托管人招商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。

本报告中的财务资料未经审计。

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

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	16
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	17
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	17
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	18
6.1 资产负债表	18
6.2 利润表	19
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	20

6.4 报表附注.....	21
§7 投资组合报告.....	50
7.1 期末基金资产组合情况.....	50
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	50
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	51
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	56
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.....	56
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.....	56
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.....	56
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.....	56
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	57
7.12 投资组合报告附注.....	57
§8 基金份额持有人信息.....	58
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	58
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	58
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.....	58
§9 开放式基金份额变动.....	60
§10 重大事件揭示.....	61
10.1 基金份额持有人大会决议.....	61
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.....	61
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	61
10.4 基金投资策略的改变.....	61
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	61
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.....	61
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	61
10.8 其他重大事件.....	63
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	65
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.....	65

11.2 影响投资者决策的其他重要信息	65
§12 备查文件目录.....	66
12.1 备查文件目录.....	66
12.2 存放地点.....	66
12.3 查阅方式.....	66

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞品质成长混合型证券投资基金	
基金简称	华泰柏瑞品质成长混合	
基金主代码	011357	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 3 月 3 日	
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	4,160,816,333.49 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	华泰柏瑞品质成长混合 A	华泰柏瑞品质成长混合 C
下属分级基金的交易代码:	011357	011358
报告期末下属分级基金的份额总额	3,992,108,348.22 份	168,707,985.27 份

2.2 基金产品说明

投资目标	通过对行业及公司深入的研究分析，精选优质上市公司，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，力争实现基金资产的稳健增值。
投资策略	在分析宏观经济的基础上，结合政策面、市场资金面等情况，在经济周期不同阶段，根据市场不同表现，在大类资产中进行配置，把握各类资产的投资机会，保证整体投资业绩的持续性。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率*60%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*20%+上证国债指数收益率*20%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险和预期收益水平高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。本基金可能投资港股通标的股票，除需承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险，还需承担汇率风险以及香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华泰柏瑞基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘万方	张燕
	联系电话	021-38601777	0755-83199084
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-888-0001	95555
传真		021-38601799	0755-83195201
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	200135	518040
法定代表人	贾波	缪建民

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	http://www.huatai-pb.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	华泰柏瑞品质成长混合 A	华泰柏瑞品质成长混合 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021 年 3 月 3 日 - 2021 年 6 月 30 日)	报告期(2021 年 3 月 3 日 - 2021 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	38,772,281.87	1,265,177.09
本期利润	777,714,584.72	28,969,186.65
加权平均基金份额本期利润	0.1627	0.1630
本期加权平均净值利润率	15.61%	15.63%
本期基金份额净值增长率	16.36%	16.17%
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	38,800,982.80	1,349,820.99
期末可供分配基金份额利润	0.0097	0.0080
期末基金资产净值	4,645,313,373.16	195,993,572.80
期末基金份额净值	1.1636	1.1617
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	16.36%	16.17%

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

华泰柏瑞品质成长混合 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	3.23%	1.71%	-0.83%	0.57%	4.06%	1.14%
过去三个月	16.83%	1.37%	3.15%	0.65%	13.68%	0.72%
自基金合同生效起至今	16.36%	1.19%	-0.39%	0.85%	16.75%	0.34%

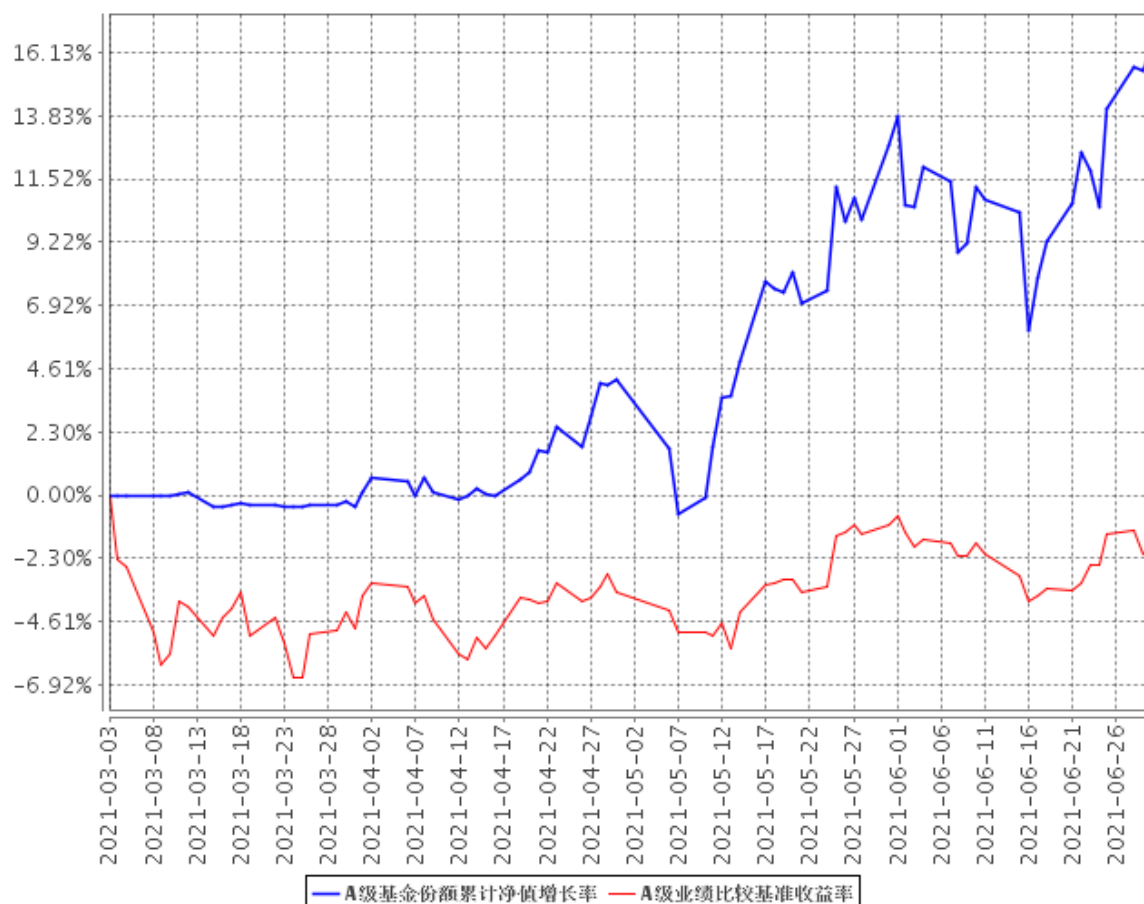
华泰柏瑞品质成长混合 C

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	3.19%	1.71%	-0.83%	0.57%	4.02%	1.14%
过去三个月	16.68%	1.37%	3.15%	0.65%	13.53%	0.72%
自基金合同生效起至今	16.17%	1.19%	-0.39%	0.85%	16.56%	0.34%

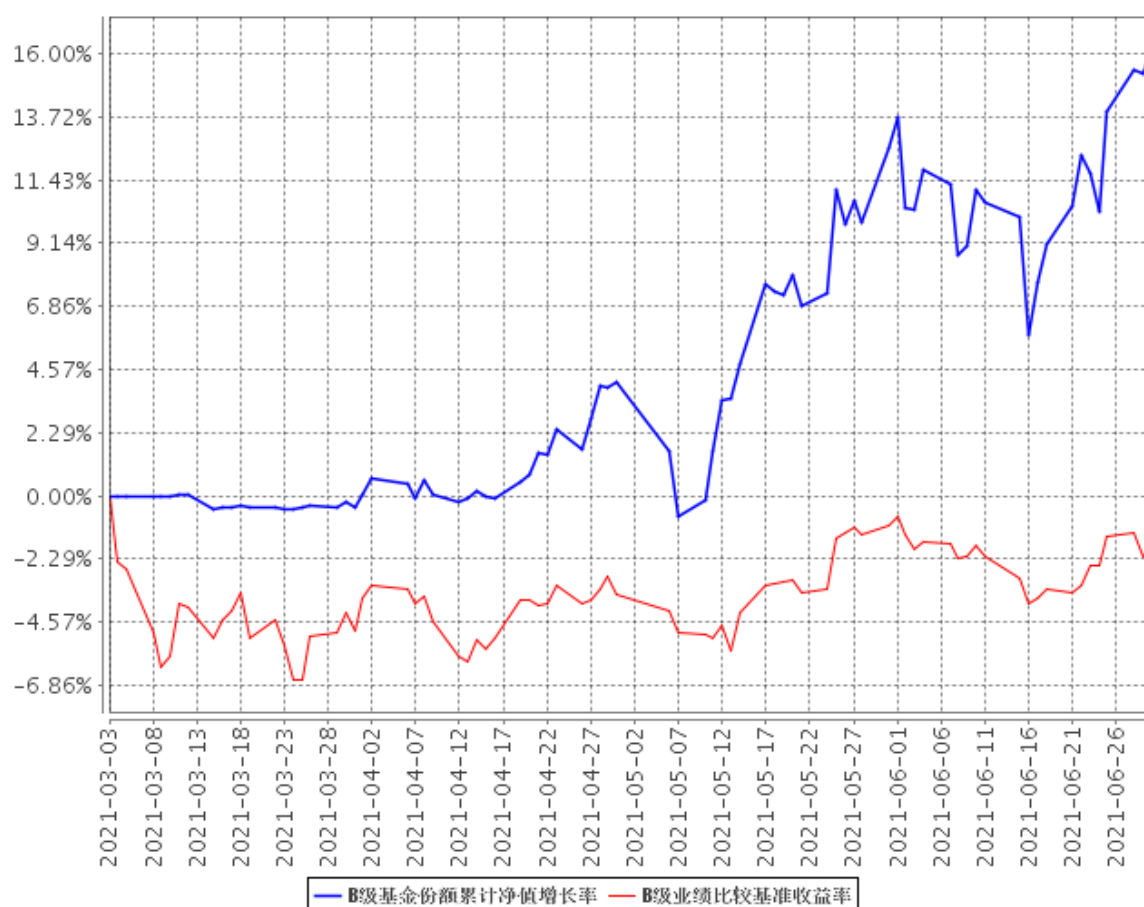
生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

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



B级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、图示日期为 2021 年 3 月 3 日（基金合同生效日）起至 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第十二部分（二）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		
沈雪峰	总经理助理、本基金的基金经	2021 年 3 月 3 日	-	28 年	上海财经大学经济学硕士。28 年证券基金行业从业经验。曾任安徽省国际信托投资公司投资银行

	理				部、股票自营部投资经理；华安基金管理有限公司研究员；华富基金管理有限公司投研部副总监、基金经理；华安基金管理有限公司基金经理；华泰柏瑞基金管理有限公司基金经理、投资部总监、专户投资部总监，现任公司总经理助理兼投资三部总监。2020 年 6 月起任华泰柏瑞激励动力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 8 月起任华泰柏瑞品质优选混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 9 月起任华泰柏瑞优势领航混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月起任华泰柏瑞品质成长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

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
沈雪峰	公募基金	4	9,680,998,082.26	2020-06-30
	私募资产管理计划	5	3,508,880,972.26	2016-08-15
	其他组合	—	—	—
	合计	9	13,189,879,054.52	—

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

本基金三月初正式投资运作，考虑当时市场依然处于风险释放过程中，基于确定性的角度，避免产品净值出现大幅回撤，本基金遵循了新基金封闭期绝对收益的投资策略，谨慎分批建仓。进入到四月中旬以后，虽然市场震荡依然较大，但是年报、季报预期逐步明朗，我们在对核心关注品种进行新一轮评估后，发现多品种投资性价比在快速提升，进入可投资区间，我们迅速提高基金仓位，重点布局在医美、新能源车、新能源光伏、医疗服务、部分业绩高增速白酒等细分领域。我们还看好以半导体、人工智能、自主可控、计算机等为代表的科技、科创板行情，组合里显著增加了科技板块投资比重。从结果看，市场的走势和我们的预判较为一致。本基金成立以来的建仓策略、加仓时点、行业和个股判断也均较为理想，符合我们一直秉承的在风险可控的前提下，实现资产的保值增值的投资理念。

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品质成长混合 A 基金份额净值为 1.1636 元,本报告期基金份额净值增长率为 16.36%;截至本报告期末华泰柏瑞品质成长混合 C 基金份额净值为 1.1617 元,本报告期基金份额净值增长率为 16.17%;同期业绩比较基准收益率为-0.39%。

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,我们认为结构性行情的特点仍将持续。从行业角度,我们在寻找新增长点,如同我们在早先挖掘出医美行业 and 新能源产业链的投资价值,我们也在尝试寻找更多的景气方向。我们认为好的机会大多停留在长坡厚雪的领域,并且行业价值链的竞争格局清晰,同时也有可预见的不断向上的景气度作为催化。经过几个月持续不断的跟踪和下游多领域的验证,我们看到了半导体景气度上行带来的机会。从长期的视角来看,新能源+智能汽车不断推陈出新和渗透率的提升,以及智能家居、智能设备的不断升级和渗透,或带来电子、电池、光学等领域的持续增长。从中期的视角来看,我们在高端制造业的很多链条上存在缺位或者市占率较低的状况,越来越多的公司正尝试在价值链的每个节点,尤其是关键的节点上实现补位或者国产替代,或许有望成为专精特新的小巨人。而眼下,高景气度也在支撑公司的扩展,资本市场在享受公司增长带来的回报的同时,也在通过 IPO 和再融资为这些公司的进一步扩张提供资本,形成了供需双旺的格局。我们认为这些新的机会,都应给投资者带来相对可观的回报。

风险角度而言,我们依然对于美联储收紧流动性、全球地缘政治风险、国内调结构带来的衍生不确定性保持一份警惕。

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

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;基金收益分配后基金份额净值不能低于面值;即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;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；每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。截止本报告期末，本基金可分配收益为 A 级 0.0097 元/份，C 级 0.0080 元/份。

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

托管人声明，招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞品质成长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
资 产：		
银行存款	6.4.7.1	280,761,034.82
结算备付金		48,612,387.17
存出保证金		1,471,116.96
交易性金融资产	6.4.7.2	4,584,350,176.53
其中：股票投资		4,584,350,176.53
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	40,000,000.00
应收证券清算款		65,902,951.46
应收利息	6.4.7.5	54,047.36
应收股利		—
应收申购款		31,414,419.31
递延所得税资产		—
其他资产	6.4.7.6	—
资产总计		5,052,566,133.61
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 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		0.18
应付赎回款		196,274,707.00
应付管理人报酬		6,165,090.49
应付托管费		1,027,515.07
应付销售服务费		77,577.52
应付交易费用	6.4.7.7	7,158,864.55
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	555,432.84
负债合计		211,259,187.65
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	4,160,816,333.49
未分配利润	6.4.7.10	680,490,612.47
所有者权益合计		4,841,306,945.96
负债和所有者权益总计		5,052,566,133.61

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额总额 4,160,816,333.49 份，其中华泰柏瑞品质成长混合 A 基金份额净值 1.1636 元，份额总额 3,992,108,348.22 份；华泰柏瑞品质成长混合 C 基金份额净值 1.1617 元，份额总额 168,707,985.27 份；

6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞品质成长混合型证券投资基金

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

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021 年 3 月 3 日(基金 合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日
一、收入		848,538,799.19
1.利息收入		14,628,155.30
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,033,441.42
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		13,594,713.88
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		62,863,632.69
其中：股票投资收益	6.4.7.12	53,620,966.90
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	9,242,665.79
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	766,646,312.41
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	4,400,698.79
减：二、费用		41,855,027.82
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	25,283,087.56
2. 托管费	6.4.10.2.2	4,213,847.92
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	302,298.55
4. 交易费用	6.4.7.19	11,960,530.01
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	6.4.7.20	95,263.78
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		806,683,771.37
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		806,683,771.37

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华泰柏瑞品质成长混合型证券投资基金

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

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 3 月 3 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	5,116,470,532.58	-	5,116,470,532.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	806,683,771.37	806,683,771.37
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）	-955,654,199.09	-126,193,158.90	-1,081,847,357.99
其中：1.基金申购款	635,071,010.78	69,277,144.43	704,348,155.21
2. 基金赎回款	-1,590,725,209.87	-195,470,303.33	-1,786,195,513.20
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）	4,160,816,333.49	680,490,612.47	4,841,306,945.96

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

华泰柏瑞品质成长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] 3713 号《关于准予华泰柏瑞品质成长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《华泰柏瑞品质成长混合型证券投资基金基金合同》和《华泰柏瑞品质成长混合型证券投资基金招募说明书》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 5,116,470,452.50 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2021)第 0242 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华泰柏瑞品质成长混合型证券投资基金基金合同》于 2021 年 3 月 3 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 5,116,470,532.58 份基金份额，其中认购资金利息折合 80.08 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，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《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》、《华泰柏瑞品质成长混合型证券投资基金基金合同》和最新公布的《华泰柏瑞品质成长混合型证券投资基金招募说明书》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）、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许投资的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、存托凭证、债券（国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券（含分离交易可转债的纯债部分）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、股指期货以及法律法规或中国证监

会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金还可以根据相关法律法规的规定参与融资业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金股票及存托凭证资产的投资比例占基金资产的 60%-95%;投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为:中证 800 指数收益率*60%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*20%+上证国债指数收益率*20%。

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》、《华泰柏瑞品质成长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 3 月 3 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日止财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 3 月 3 日至 2021 年 6 月 30 日止的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

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。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入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卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

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，于交易日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；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，应当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。

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，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。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

基金管理人在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，应符合《企业会计准则》、监管部

门有关规定。

（一）对存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，在估值日有报价的，除会计准则规定的例外情况外，应将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种形同，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其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

（二）对不存在活跃市场的投资品种，应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。采用估值技术确定公允价值时，应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。

（三）如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25%以上的，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。当本基金依法有权抵销债权债务且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。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。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；处置时其公允价值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也可按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金每一类别的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

(1) 计量属性

本基金除特别说明对金融资产和金融负债采用公允价值等作为计量属性之外，一般采用历史成本计量。

(2) 重要会计估计及其关键假设

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：

(a) 对于特殊事项停牌股票，根据中国证监会公告[2008]38 号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，本基金采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票估值，通过停牌股票所处行业的行业指数变动以大致反映市场因素在停牌期间对于停牌股票公允价值的影响。上述指数收益法的关键假设包括所选取行业指数的变动能在重大方面基本反映停牌股票公允价值的变动，停牌股票的发行者在停牌期间的各项变化未对停牌股票公允价值产生重大影响等。本基金自 2009 年 6 月 15 日起，采用中证协(SAC)基金行业股票估值指数以取代原交易所发布的行业指数。

(b) 对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会基金部通知[2006]37 号《关于进一步加强基金投资非公开发行股票风险控制有关问题的通知》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确

认为估值增值。

(c)在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21 号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

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

无。

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[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	280,761,034.82
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：	280,761,034.82

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	3,817,703,864.12	4,584,350,176.53	766,646,312.41
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	3,817,703,864.12	4,584,350,176.53	766,646,312.41

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

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	40,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	40,000,000.00	-

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	31,509.76
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	21,875.60

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	662.00
合计	54,047.36

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	7,158,864.55
银行间市场应付交易费用	-
合计	7,158,864.55

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	468,590.04
应付证券出借违约金	-
预提费用	86,842.80
合计	555,432.84

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

华泰柏瑞品质成长混合 A		
项目	本期 2021 年 3 月 3 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	4,935,940,581.32	4,935,940,581.32

本期申购	598,298,715.60	598,298,715.60
本期赎回(以“-”号填列)	-1,542,130,948.70	-1,542,130,948.70
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	3,992,108,348.22	3,992,108,348.22

金额单位：人民币元

华泰柏瑞品质成长混合 C		
项目	本期 2021 年 3 月 3 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	180,529,951.26	180,529,951.26
本期申购	36,772,295.18	36,772,295.18
本期赎回(以“-”号填列)	-48,594,261.17	-48,594,261.17
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	168,707,985.27	168,707,985.27

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

华泰柏瑞品质成长混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	38,772,281.87	738,942,302.85	777,714,584.72
本期基金份额交易产生的变动数	28,700.93	-124,538,260.71	-124,509,559.78
其中：基金申购款	1,786,353.60	63,448,811.32	65,235,164.92
基金赎回款	-1,757,652.67	-187,987,072.03	-189,744,724.70
本期已分配利润	-	-	-
本期末	38,800,982.80	614,404,042.14	653,205,024.94

单位：人民币元

华泰柏瑞品质成长混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-

本期利润	1,265,177.09	27,704,009.56	28,969,186.65
本期基金份额交易产生的变动数	84,643.90	-1,768,243.02	-1,683,599.12
其中：基金申购款	53,258.24	3,988,721.27	4,041,979.51
基金赎回款	31,385.66	-5,756,964.29	-5,725,578.63
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,349,820.99	25,935,766.54	27,285,587.53

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 3 月 3 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	671,481.03
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	357,737.69
其他	4,222.70
合计	1,033,441.42

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 3 月 3 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	2,686,276,521.08
减：卖出股票成本总额	2,632,655,554.18
买卖股票差价收入	53,620,966.90

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 3 月 3 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日
----	---

股票投资产生的股利收益	9,242,665.79
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	9,242,665.79

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 3 月 3 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	766,638,308.80
——股票投资	766,638,308.80
——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	8,003.61
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	766,646,312.41

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 3 月 3 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	4,397,306.74
转换费收入 011357	3,392.05
合计	4,400,698.79

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 3 月 3 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	11,960,530.01

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	11,960,530.01

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 3 月 3 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	47,368.80
信息披露费	39,474.00
证券出借违约金	-
银行划款手续费	8,020.98
其他费用	400.00
合计	95,263.78

6.4.7.21 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金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。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

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、基金销售机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	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：关联方与基金进行的关联交易均在正常业务范围内按照一般商业条款而订立的。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

注：无。

6.4.10.1.2 债券交易

注：无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

6.4.10.1.4 权证交易

注：无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 3 月 3 日(基金合同生效 日)至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付 的管理费	25,283,087.56	-
其中:支付销售机构的客 户维护费	10,345,980.16	-

注:支付基金管理人华泰柏瑞基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日管理人报酬=前一日基金资产净值 ×1.5% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2021 年 3 月 3 日(基金合同生效 日)至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付 的托管费	4,213,847.92	-

注:本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下: $H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$; H 为每日应计提的基金托管费, E 为前一日的基金资产净值。基金托管费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的 各关联方名称	本期 2021 年 3 月 3 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰柏瑞品质成长 混合 A	华泰柏瑞品质成长 混合 C	合计
招商银行股份有限公司	0.00	69,453.33	69,453.33
华泰证券股份有限公司	0.00	70,924.81	70,924.81
华泰柏瑞基金管理有限 公司	0.00	2,602.57	2,602.57
合计	0.00	142,980.71	142,980.71
获得销售服务费的 各关联方名称	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		

	华泰柏瑞品质成长 混合 A	华泰柏瑞品质成长 混合 C	合计
合计	-	-	-

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

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

C 类基金份额销售服务费每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前 5 个工作日内从基金资产中一次性支取。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：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，基金管理人未投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本报告期内，除基金管理人之外的其它关联方未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 3 月 3 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
	招商银行	280,761,034.82	671,481.03	-

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2021 年 3 月 3 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：份）	总金额
华泰联合证 券有限责任 公司	688097	博众精工	网下申购	3,983	44,888.41
华泰联合证 券有限责任 公司	688314	康拓医疗	网下申购	1,085	18,813.90
华泰联合证 券有限责任 公司	688613	奥精医疗	网下申购	2,617	42,997.31
华泰联合证 券有限责任 公司	605499	东鹏饮料	网下申购	632	29,242.64
华泰联合证 券有限责任 公司	688161	威高骨科	网下申购	3,069	111,159.18
上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：份）	总金额
-	-	-	-	-	-

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

注：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
301018	申菱环境	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 7 日	新股流通受限	8.29	8.29	7,811	64,753.19	64,753.19	-
688239	航宇科技	2021 年 6 月 25 日	2021 年 7 月 5 日	新股流通受限	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48	-
688087	英科再生	2021 年 6 月 30 日	2021 年 7 月 9 日	新股流通受限	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
301017	漱玉平民	2021 年 6 月 23 日	2021 年 7 月 5 日	新股流通受限	8.86	8.86	5,550	49,173.00	49,173.00	-
301020	密封科技	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股流通受限	10.64	10.64	4,210	44,794.40	44,794.40	-
301021	英诺激光	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股流通受限	9.46	9.46	2,899	27,424.54	27,424.54	-
688226	威腾电气	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 7 日	新股流通受限	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
605287	德才股份	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股流通受限	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
605162	新中港	2021 年 6 月 29 日	2021 年 7 月 7 日	新股流通受限	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
688700	东威科技	2021 年 6 月 7 日	2021 年 12 月 15 日	新股流通受限	9.41	38.46	3,049	28,691.09	117,264.54	-
688625	呈和科技	2021 年 5 月 31 日	2021 年 12 月 7 日	新股流通受限	16.48	42.63	2,672	44,034.56	113,907.36	-

300979	华利集团	2021 年 4 月 15 日	2021 年 10 月 26 日	新股流通受限	33.22	87.50	925	30,728.50	80,937.50	-
688359	三孚新科	2021 年 5 月 14 日	2021 年 11 月 22 日	新股流通受限	11.03	26.35	2,213	24,409.39	58,312.55	-
300981	中红医疗	2021 年 4 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	新股流通受限	48.59	90.39	601	29,202.59	54,324.39	-
301009	可靠股份	2021 年 6 月 8 日	2021 年 12 月 17 日	新股流通受限	12.54	27.89	801	10,044.54	22,339.89	-
301015	百洋医药	2021 年 6 月 22 日	2021 年 12 月 30 日	新股流通受限	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
300982	苏文电能	2021 年 4 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	新股流通受限	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300614	百川畅银	2021 年 5 月 18 日	2021 年 11 月 25 日	新股流通受限	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
301013	利和兴	2021 年 6 月 21 日	2021 年 12 月 29 日	新股流通受限	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81	-
300997	欢乐家	2021 年 5 月 26 日	2021 年 12 月 2 日	新股流通受限	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
301002	崧盛股份	2021 年 5 月 27 日	2021 年 12 月 7 日	新股流通受限	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
300986	志特新材	2021 年 4 月 21 日	2021 年 11 月 1 日	新股流通受限	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300987	川网传媒	2021 年 4 月 28 日	2021 年 11 月 11 日	新股流通受限	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-

			日							
300978	东箭科技	2021 年 4 月 15 日	2021 年 10 月 26 日	新股流通受限	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300985	致远新能	2021 年 4 月 21 日	2021 年 10 月 29 日	新股流通受限	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	-
300991	创益通	2021 年 5 月 12 日	2021 年 11 月 22 日	新股流通受限	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
301011	华立科技	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 17 日	新股流通受限	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
300995	奇德新材	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 26 日	新股流通受限	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
301007	德迈仕	2021 年 6 月 4 日	2021 年 12 月 16 日	新股流通受限	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
300998	宁波方正	2021 年 5 月 25 日	2021 年 12 月 2 日	新股流通受限	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
300992	泰福泵业	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 25 日	新股流通受限	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-

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	期末估值单	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
------	------	------	----	-------	------	--------	-------	--------	--------	----

			原因	价						
600460	士兰微	2021 年 6 月 30 日	临时停牌	56.35	2021 年 7 月 1 日	59.49	10,000	512,602.00	563,500.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：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，将风险控制在此可承受的范围内。

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同责任，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招商银行，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。

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公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本

基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 0.03%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金和买入返售金融资产等。

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	280,761,034.82	-	-	-	-	-	280,761,034.82
结算备付金	48,612,387.17	-	-	-	-	-	48,612,387.17
存出保证金	1,471,116.96	-	-	-	-	-	1,471,116.96
交易性金融资 产	-	-	-	-	-	4,584,350,176.53	4,584,350,176.53
买入返售金融 资产	40,000,000.00	-	-	-	-	-	40,000,000.00
应收证券清算 款	-	-	-	-	-	65,902,951.46	65,902,951.46
应收利息	-	-	-	-	-	54,047.36	54,047.36
应收申购款	-	-	-	-	-	31,414,419.31	31,414,419.31
资产总计	370,844,538.95	-	-	-	-	4,681,721,594.66	5,052,566,133.61
负债							
应付证券清算 款	-	-	-	-	-	0.18	0.18
应付赎回款	-	-	-	-	-	196,274,707.00	196,274,707.00
应付管理人报 酬	-	-	-	-	-	6,165,090.49	6,165,090.49
应付托管费	-	-	-	-	-	1,027,515.07	1,027,515.07
应付销售服务 费	-	-	-	-	-	77,577.52	77,577.52
应付交易费用	-	-	-	-	-	7,158,864.55	7,158,864.55
其他负债	-	-	-	-	-	555,432.84	555,432.84
负债总计	-	-	-	-	-	211,259,187.65	211,259,187.65
利率敏感度缺	370,844,538.95	-	-	-	-	4,470,462,407.01	4,841,306,945.96

口							
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							
资产总计	-	-	-	-	-	-	-
负债							
负债总计	-	-	-	-	-	-	-
利率敏感度缺 口	-	-	-	-	-	-	-

注：各期限分类的标准按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

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，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有不以记账本位币人民币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票及存托凭证投资比例为基金净资产的 60%-95%；投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%。每个交易日日

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	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	4,584,350,176.53	94.69
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	4,584,350,176.53	94.69

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	548,568,751.90	—
	业绩比较基准下降 5%	-548,568,751.90	—

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	4,584,350,176.53	90.73
	其中：股票	4,584,350,176.53	90.73
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	40,000,000.00	0.79
	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	329,373,421.99	6.52
8	其他各项资产	98,842,535.09	1.96
9	合计	5,052,566,133.61	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	3,487,552,483.38	72.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00
E	建筑业	25,371.37	0.00
F	批发和零售业	59,915,952.46	1.24
G	交通运输、仓储和邮政业	596,200.00	0.01
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,630,800.21	0.26
J	金融业	6,591,409.50	0.14
K	房地产业	18,042,000.00	0.37
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	332,055,862.28	6.86

N	水利、环境和公共设施管理业	13,285.02	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	666,098,353.52	13.76
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	4,583,534,738.13	94.68

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
00 能源	-	-
01 原材料	-	-
02 工业	-	-
03 可选消费	-	-
04 主要消费	-	-
05 医药卫生	815,438.40	0.02
06 金融地产	-	-
07 信息技术	-	-
08 电信业务	-	-
09 公用事业	-	-
99 无	-	-
合计	815,438.40	0.02

注：以上分类采用中证行业分类标准。

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	751,480	401,891,504.00	8.30
2	300896	爱美客	466,183	367,762,445.04	7.60
3	600763	通策医疗	690,096	283,629,456.00	5.86
4	300760	迈瑞医疗	501,500	240,745,075.00	4.97
5	300347	泰格医药	1,200,000	231,960,000.00	4.79
6	600436	片仔癀	463,400	207,742,220.00	4.29
7	300595	欧普康视	2,000,178	207,118,431.90	4.28
8	603259	药明康德	1,250,780	195,859,640.20	4.05
9	600519	贵州茅台	85,600	176,053,520.00	3.64
10	688363	华熙生物	600,017	166,720,723.62	3.44
11	600809	山西汾酒	357,000	159,936,000.00	3.30
12	000568	泸州老窖	606,300	143,050,422.00	2.95

13	603986	兆易创新	700,340	131,593,886.00	2.72
14	300014	亿纬锂能	1,250,000	129,912,500.00	2.68
15	300759	康龙化成	584,192	126,763,822.08	2.62
16	002415	海康威视	1,900,000	122,550,000.00	2.53
17	000858	五 粮 液	350,000	104,261,500.00	2.15
18	688050	爱博医疗	269,377	101,765,243.06	2.10
19	688366	昊海生科	420,005	87,907,046.50	1.82
20	300143	盈康生命	2,774,647	71,474,906.72	1.48
21	000661	长春高新	168,473	65,199,051.00	1.35
22	600438	通威股份	1,503,300	65,047,791.00	1.34
23	000963	华东医药	1,300,000	59,813,000.00	1.24
24	002821	凯莱英	160,000	59,616,000.00	1.23
25	300957	贝泰妮	200,000	54,338,000.00	1.12
26	603345	安井食品	170,858	43,401,349.16	0.90
27	002709	天赐材料	400,000	42,632,000.00	0.88
28	300015	爱尔眼科	583,460	41,413,990.80	0.86
29	000799	酒鬼酒	150,000	38,340,000.00	0.79
30	688169	石头科技	30,000	37,830,000.00	0.78
31	000516	国际医学	2,000,000	37,620,000.00	0.78
32	002371	北方华创	100,000	27,738,000.00	0.57
33	603659	璞泰来	200,000	27,320,000.00	0.56
34	300573	兴齐眼药	191,300	26,979,039.00	0.56
35	688126	沪硅产业	908,628	26,513,765.04	0.55
36	002812	恩捷股份	100,000	23,410,000.00	0.48
37	300124	汇川技术	300,000	22,278,000.00	0.46
38	300363	博腾股份	250,000	21,030,000.00	0.43
39	688686	奥普特	37,988	17,132,588.00	0.35
40	000615	奥园美谷	600,000	13,200,000.00	0.27
41	600703	三安光电	400,000	12,820,000.00	0.26
42	688012	中微公司	69,901	11,597,973.92	0.24
43	002612	朗姿股份	204,600	11,052,492.00	0.23
44	300725	药石科技	60,047	9,542,068.77	0.20
45	002626	金达威	200,000	8,940,000.00	0.18
46	300450	先导智能	140,000	8,419,600.00	0.17
47	601012	隆基股份	93,652	8,320,043.68	0.17
48	300059	东方财富	199,960	6,556,688.40	0.14
49	300142	沃森生物	100,000	6,170,000.00	0.13
50	000538	云南白药	50,000	5,786,000.00	0.12
51	688099	晶晨股份	50,000	5,610,000.00	0.12

52	603127	昭衍新药	30,000	5,512,500.00	0.11
53	600893	航发动力	100,000	5,319,000.00	0.11
54	603893	瑞芯微	37,900	5,285,534.00	0.11
55	300207	欣旺达	150,000	4,884,000.00	0.10
56	600223	鲁商发展	300,000	4,842,000.00	0.10
57	300763	锦浪科技	25,500	4,605,300.00	0.10
58	603806	福斯特	40,000	4,205,200.00	0.09
59	688111	金山办公	10,000	3,948,000.00	0.08
60	688131	皓元医药	10,000	3,461,900.00	0.07
61	300274	阳光电源	30,000	3,451,800.00	0.07
62	688608	恒玄科技	10,000	3,169,100.00	0.07
63	688139	海尔生物	29,280	3,077,328.00	0.06
64	603501	韦尔股份	8,200	2,640,400.00	0.05
65	688005	容百科技	20,000	2,424,000.00	0.05
66	688626	翔宇医疗	20,000	2,416,800.00	0.05
67	002326	永太科技	100,000	1,999,000.00	0.04
68	300454	深信服	7,500	1,946,100.00	0.04
69	002409	雅克科技	20,000	1,620,000.00	0.03
70	600745	闻泰科技	16,700	1,618,230.00	0.03
71	688037	芯源微	10,000	1,490,000.00	0.03
72	603290	斯达半导	4,100	1,312,000.00	0.03
73	002756	永兴材料	20,000	1,187,800.00	0.02
74	688508	芯朋微	10,000	1,106,400.00	0.02
75	300474	景嘉微	10,000	979,200.00	0.02
76	688007	光峰科技	20,000	837,600.00	0.02
77	01951	锦欣生殖	50,000	815,438.40	0.02
78	688677	海泰新光	7,319	801,430.50	0.02
79	300604	长川科技	10,000	682,100.00	0.01
80	601127	小康股份	10,000	666,700.00	0.01
81	000596	古井贡酒	2,628	629,406.00	0.01
82	603565	中谷物流	20,000	596,200.00	0.01
83	600460	士兰微	10,000	563,500.00	0.01
84	300416	苏试试验	20,000	458,000.00	0.01
85	605499	东鹏饮料	632	158,505.60	0.00
86	688700	东威科技	3,049	117,264.54	0.00
87	688314	康拓医疗	1,085	114,619.40	0.00
88	688625	呈和科技	2,672	113,907.36	0.00
89	688085	三友医疗	2,175	94,895.25	0.00
90	300979	华利集团	925	80,937.50	0.00

91	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.00
92	688359	三孚新科	2,213	58,312.55	0.00
93	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.00
94	300981	中红医疗	601	54,324.39	0.00
95	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
96	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.00
97	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.00
98	003020	立方制药	700	35,840.00	0.00
99	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
100	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
101	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
102	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00
103	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
104	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
105	688580	伟思医疗	100	16,750.00	0.00
106	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
107	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
108	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
109	301013	利和兴	471	12,768.81	0.00
110	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
111	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
112	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
113	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
114	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
115	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
116	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
117	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
118	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
119	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
120	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
121	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
122	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
123	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
124	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
125	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	489,308,342.35	10.11
2	300750	宁德时代	376,175,623.05	7.77
3	300896	爱美客	314,829,851.35	6.50
4	000661	长春高新	273,430,929.73	5.65
5	300347	泰格医药	267,183,318.67	5.52
6	300760	迈瑞医疗	256,291,160.28	5.29
7	000568	泸州老窖	232,321,825.88	4.80
8	600809	山西汾酒	228,778,777.06	4.73
9	300595	欧普康视	212,353,756.08	4.39
10	603259	药明康德	204,476,574.44	4.22
11	600763	通策医疗	199,283,038.55	4.12
12	688363	华熙生物	168,741,622.85	3.49
13	600436	片仔癀	162,980,971.14	3.37
14	300759	康龙化成	157,521,903.28	3.25
15	000858	五粮液	141,705,657.25	2.93
16	601012	隆基股份	137,097,861.17	2.83
17	002415	海康威视	128,109,605.08	2.65
18	603986	兆易创新	119,902,189.04	2.48
19	300014	亿纬锂能	116,993,886.08	2.42
20	300122	智飞生物	111,434,427.06	2.30

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	309,405,114.48	6.39
2	000661	长春高新	160,268,474.46	3.31
3	601012	隆基股份	135,943,352.85	2.81
4	600809	山西汾酒	112,327,144.43	2.32
5	300122	智飞生物	103,513,651.22	2.14

6	000568	泸州老窖	87,541,574.54	1.81
7	300750	宁德时代	83,668,697.36	1.73
8	300896	爱美客	82,307,140.99	1.70
9	300347	泰格医药	79,080,242.00	1.63
10	300759	康龙化成	56,638,895.00	1.17
11	000799	酒鬼酒	56,134,763.56	1.16
12	300595	欧普康视	51,819,423.69	1.07
13	000858	五粮液	47,274,357.00	0.98
14	002230	科大讯飞	46,800,480.80	0.97
15	601888	中国中免	46,205,098.38	0.95
16	603259	药明康德	45,239,713.60	0.93
17	000596	古井贡酒	42,677,520.44	0.88
18	688169	石头科技	39,279,150.00	0.81
19	688202	美迪西	38,318,941.85	0.79
20	000615	奥园美谷	36,819,895.00	0.76

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	6,450,359,418.30
卖出股票收入（成交）总额	2,686,276,521.08

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：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票。

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

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

本基金投资的前十名证券的发行主体未涉及相关事项。

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未有超出基金合同规定的备选股票库的情况。

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	1,471,116.96
2	应收证券清算款	65,902,951.46
3	应收股利	—
4	应收利息	54,047.36
5	应收申购款	31,414,419.31
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	98,842,535.09

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：期末未持有的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：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
华泰柏瑞品质成长混合 A	55,755	71,600.90	11,672,612.22	0.29%	3,980,435,736.00	99.71%
华泰柏瑞品质成长混合 C	8,310	20,301.80	0.00	0.00%	168,707,985.27	100.00%
合计	63,657	65,363.06	11,672,612.22	0.28%	4,149,143,721.27	99.72%

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	华泰柏瑞品质成长混合 A	277,908.36	0.0070%
	华泰柏瑞品质成长混合 C	484,826.12	0.2874%
	合计	762,734.48	0.0183%

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	华泰柏瑞品质成长混合 A	0
	华泰柏瑞品质成长混合 C	10~50

	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	华泰柏瑞品质成长混合 A	10~50
	华泰柏瑞品质成长混合 C	0
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华泰柏瑞品质成长混合 A	华泰柏瑞品质成长混合 C
基金合同生效日（2021 年 3 月 3 日）基金份额总额	4,935,940,581.32	180,529,951.26
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	598,298,715.60	36,772,295.18
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	1,542,130,948.70	48,594,261.17
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	3,992,108,348.22	168,707,985.27

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，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。

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	
中信建投	2	2,695,812,885.87	29.52%	2,456,695.54	29.23%	-
方正证券	2	2,009,490,111.68	22.00%	1,851,198.18	22.02%	-
银河证券	2	1,873,724,426.55	20.52%	1,744,995.30	20.76%	-
平安证券	2	932,160,354.31	10.21%	858,447.12	10.21%	-
招商证券	2	817,501,010.43	8.95%	761,334.90	9.06%	-
中信证券	2	803,741,192.24	8.80%	732,449.44	8.71%	-
上海证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-

华泰证券	2	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---	---

注：1、公司应选择财务状况良好，经营行为规范，具备研究实力的证券公司及专业研究机构，向其或其合作券商租用基金专用交易席位。公司选择的提供交易单元的券商应当满足下列基本条件：

- 1) 具有相应的业务经营资格；
- 2) 诚信记录良好，最近两年无重大违法违规行为，未受监管机构重大处罚；
- 3) 资金雄厚，信誉良好。内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求。
- 4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服务。
- 5) 具备研究实力，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、股票分析的研究报告及周到的信息服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告。

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

3、本报告期内，无变更租用证券公司交易单元的情况。

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
中信建投	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	29,907,100,000.00	64.29%	-	-
银河证券	-	-	15,624,700,000.00	33.59%	-	-
平安证券	-	-	365,000,000.00	0.78%	-	-
招商证券	-	-	620,000,000.00	1.33%	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华泰柏瑞基金管理有限公司关于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 6 月 24 日
2	华泰柏瑞基金管理有限公司关于提醒客户及时更新身份证件及非自然人客户及时登记受益所有人信息的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 6 月 22 日
3	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参与珠海盈米基金销售有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 6 月 2 日
4	华泰柏瑞品质成长混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资、费率优惠等业务公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 5 月 26 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基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 5 月 14 日
8	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 5 月 12 日
9	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 4 月 30 日
10	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参加浙商银行股份有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 4 月 30 日
11	华泰柏瑞基金管理有限公司关于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
12	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	证监会规定报刊和网站	2021 年 4 月 20 日

	率优惠活动的公告		
13	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
14	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
15	华泰柏瑞品质成长混合型证券投资基金基金合同生效公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 3 月 4 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的文件
- 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