

华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金
2021 年中期报告
2021 年 6 月 30 日

基金管理人：华泰证券（上海）资产管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年八月三十一日

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 26 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 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	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11
5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	11
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	11
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	11
6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	14
6.4 报表附注	15
7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
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	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	54
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	54
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	54
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	54
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55
7.12 本报告期投资基金情况	55
7.13 投资组合报告附注	55

8 基金份额持有人信息	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	57
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.....	57
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	57
9 开放式基金份额变动	57
10 重大事件揭示	58
10.1 基金份额持有人大会决议.....	58
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.....	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	58
10.4 基金投资策略的改变.....	58
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件.....	58
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	58
10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	58
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	58
10.9 其他重大事件.....	59
11 影响投资者决策的其他重要信息	60
12 备查文件目录	61
12.1 备查文件目录.....	61
12.2 存放地点.....	61
12.3 查阅方式.....	61

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金
基金简称	华泰紫金智能量化股票发起
基金主代码	005502
交易代码	005502
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年2月1日
基金管理人	华泰证券（上海）资产管理有限公司
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	168,869,879.26 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过量化选股模型精选股票，在有效控制风险的前提下，力争获取超越业绩比较基准的投资回报，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	管理人先根据宏观分析和市场判断确定大类资产的配置，然后充分利用量化模型，先将原始行业数据进行深层次的加工、计算，建立各个行业的分析逻辑，再通过模型构造，建立起因子分析框架，然后挖掘数据形成因子，通过因子拟合趋势，进行回溯和验证，从而挖掘出不同行业的敏感因子，提取合成不同行业的观察指标，结合管理人线下的研究进行行业配置和个股选择，构建合理的投资组合。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率*90%+上证国债指数收益率*10%
风险收益特征	本基金为股票型基金，基金的预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金、货币市场基金。

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		华泰证券（上海）资产管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	白海燕	许俊
	联系电话	4008895597	010-66594319
	电子邮箱	baihaiyan@htsc.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		4008895597	95566
传真		021-28972120	010-66594942
注册地址		中国(上海)自由贸易试验区基隆路6号1222室	北京市复兴门内大街1号
办公地址		中国(上海)自由贸易试验区东	北京市复兴门内大街1号

	方路18号21楼	
邮政编码	200120	100818
法定代表人	崔春	刘连舸

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	htamc.htsc.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人、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	华泰证券(上海)资产管理有限公司	中国(上海)自由贸易试验区东方路 18 号 21 楼

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2021年1月1日至2021年6月30日）
本期已实现收益	-10,278,518.75
本期利润	-11,484,129.57
加权平均基金份额本期利润	-0.0722
本期加权平均净值利润率	-4.93%
本期基金份额净值增长率	0.82%
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	75,268,362.55
期末可供分配基金份额利润	0.4457
期末基金资产净值	250,145,657.85
期末基金份额净值	1.4813
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	48.13%

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用（例如，开放式基金的转换费等），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、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.17%	0.86%	-1.15%	0.69%	1.32%	0.17%
过去三个月	5.81%	0.84%	4.31%	0.79%	1.50%	0.05%
过去六个月	0.82%	1.35%	1.80%	1.09%	-0.98%	0.26%
过去一年	33.15%	1.41%	21.08%	1.16%	12.07%	0.25%
过去三年	55.63%	1.32%	41.60%	1.23%	14.03%	0.09%
自基金合同生效起至今	48.13%	1.25%	19.69%	1.22%	28.44%	0.03%

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

华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 (2018年2月1日至2021年6月30日)



注：1、本基金业绩比较基准收益率=中证 800 指数收益率*90%+上证国债指数收益率*10%；

2、本基金合同于 2018 年 2 月 1 日生效，截止本报告期末基金成立已满一年；自基金成立日起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

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

华泰证券（上海）资产管理有限公司是经中国证监会证监许可〔2014〕679 号文批准，由华泰证券股份有限公司设立的全资资产管理子公司。2014 年 10 月成立时，注册资本 3 亿元人民币。2015 年 10 月增加注册资本至 10 亿元人民币。2016 年 7 月增加注册资本至 26 亿元人民币。2016 年 7 月，公司经中国证监会证监许可〔2016〕1682 号文批准，获得公开募集证券投资基金管理业务资格。公司主要业务为证券资产管理业务、公开募集证券投资基金业务及中国证监会批准的其它业务。

截至 2021 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理华泰紫金信息科技主题 6 个月定期开放混合型发起式证券投资基金、华泰紫金丰和偏债混合型发起式证券投资基金、华泰紫金丰睿债券型发起式证券投资基金、华泰紫金丰安 27 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、华泰紫金科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金、华泰紫金周周购 12 个月滚动持有债券型发起式证券投资基金、华泰紫金月月购 3 个月滚动持有债券型证券投资基金、华泰紫金中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金、华泰紫金周周购 3 个月滚动持有债券型证券投资基金、华泰紫金智鑫 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、华泰紫金泰盈混合型证券投资基金、华泰紫金丰益中短债债券型发起式证券投资基金、华泰紫金丰利中短债债券型发起式证券投资基金、华泰紫金丰泰纯债债券型发起式证券投资基金、华泰紫金智惠定期开放债券型证券投资基金、华泰紫金季季享定期开放债券型发起式证券投资基金、华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金、华泰紫金智盈债券型证券投资基金、华泰紫金零钱宝货币市场基金、华泰紫金天天金交易型货币市场基金二十只证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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		
毛甜	本基金的基金 经理	2018-03-1 0	-	11	毛甜女士，武汉大学金融工程硕士。2010 年至 2012 年曾任国信证券经济研究所金融工程部助理分析师；2012 年至 2017 年任职光大富尊投资有限公司，历任量化研究员、量化投资经理。2017 年 7 月加入华泰证券(上海)资产管理有限公司，2017 年 12 月至 2020 年 12 月担任华泰紫金中证红利低波动指数型发起式证券投资基金基

					金经理。2018 年 3 月起担任华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金基金经理。2021 年 7 月起担任华泰紫金中证细分食品饮料产业主题指数型发起式证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：1、上述基金经理的任职日期及离任日期均以基金公告为准；首任基金经理的任职日期为基金合同生效日。

2、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。

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

本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划的投资经理情况。

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投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和《华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金基金合同》的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

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

本基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》建立并健全了有效的公平交易执行体系，保证公平对待旗下的每一个基金组合。

公司建立了公募基金投资决策委员会领导下的投资决策及授权制度，以科学规范的投资决策体系，采用集中交易管理加强交易执行环节的内部控制，通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现；通过建立层级完备的公司股票池和债券库，完善各类具体资产管理业务组织结构，规范各项业务之间的关系，在保证各投资组合既具有相对独立性的同时，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过对异常交易行为的监控、分析评估、监察稽核和信息披露确保公平交易过程和结果的有效监督。

本报告期内，本公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动和环节得到公平对待，各投资组合均严格按照法律、法规和公司制度执行投资交易，本报告期内未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

本报告期内，所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的 5%。

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

一季度市场冲高回落，受通胀及流动性收紧预期影响，春节后市场在高估值核心资产杀跌的带动下，快速回调，大盘成长风格冲高回落，价值风格相对走强；二季度市场随着宏观流动性和一季报超预期震荡上行，板块间（顺周期、核心资产、医药&消费、新能源&半导体）轮动频繁，二季度市场成长风格占优，中盘成长领涨，价值风格走弱。上半年市场整体呈现的特征是波动加大，风格轮动、板块轮动较快，赚取超额收益的难度加大。截至本报告期末，上证综指上涨 3.40%，深证成份指数上涨 4.78%，沪深 300 指数上涨 0.24%，中证 800 指数上涨 1.72%。在操作上，本基金利用量化模型精选个股，辅以量化行业轮动及事件驱动策略，严格遵守基金合同，在有效控制风险的前提下，力争获取超越业绩比较基准的投资回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金份额净值增长率为 0.82%，同期业绩比较基准收益率为 1.80%。

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 2021 年下半年，国内宏观经济预计延续复苏态势、企业盈利继续回升，货币政策将保持稳定性，通胀总体可控，权益市场的机会主要存在于高景气的板块；同时考虑到下半年经济增速和企业盈利增速是逐季回落的，如果出现经济数据和业绩的不及预期叠加流动性的收紧，市场将会受到短期冲击。管理人将依据量化模型，在有效控制风险的前提下，力争获取超越业绩比较基准的投资回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值小组，公司领导担任估值小组组长，投资研究部门、运营部、交易部、风险管理部指定人员担任委员。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经

历。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

与估值相关的机构包括上海、深圳证券交易所，中国证券登记结算有限责任公司，中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司以及中国证券业协会等。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配。

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

- 1、本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形；
- 2、本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。

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”）在华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”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：华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	5,528,833.26	11,080,178.74
结算备付金		2,407,532.82	1,081,692.00
存出保证金		314,570.86	661,157.43
交易性金融资产	6.4.7.2	242,914,305.58	74,529,684.06
其中：股票投资		234,814,305.58	74,460,184.06
基金投资		-	-
债券投资		8,100,000.00	69,500.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		273,967.31	-
应收利息	6.4.7.5	168,349.24	1,049.56
应收股利		-	-
应收申购款		2,396.40	5,398,576.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	97,620.99
资产总计		251,609,955.47	92,849,958.78
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		105,966.46	6,435,757.05
应付赎回款		319,634.31	262,267.03
应付管理人报酬		305,793.29	82,469.24
应付托管费		50,965.53	13,744.89
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	622,415.90	67,290.68
应交税费		-	7,758.15

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	59,522.13	120,217.74
负债合计		1,464,297.62	6,989,504.78
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	168,869,879.26	58,437,321.58
未分配利润	6.4.7.10	81,275,778.59	27,423,132.42
所有者权益合计		250,145,657.85	85,860,454.00
负债和所有者权益总计		251,609,955.47	92,849,958.78

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额总额 168,869,879.26 份，基金份额净值 1.4813 元。

6.2 利润表

会计主体：华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		-7,834,861.21	5,175,092.23
1.利息收入		106,252.07	14,499.03
其中：存款利息收入	6.4.7.11	36,700.74	11,744.86
债券利息收入		69,551.33	2,754.17
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-7,536,788.25	5,714,035.91
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-8,872,188.30	5,320,330.18
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	6.4.7.14	1,633.09	51,927.93
资产支持证券投资收益	6.4.7.15	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.16	-	-
衍生工具收益	6.4.7.17	-214,720.78	-
股利收益	6.4.7.18	1,548,487.74	341,777.80
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	-1,205,610.82	-575,254.41
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	801,285.79	21,811.70
减：二、费用		3,649,268.36	851,643.58
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,754,832.23	356,439.02

2. 托管费	6.4.10.2.2	292,472.01	59,406.50
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.21	1,532,789.57	352,771.73
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		36.36	0.06
7. 其他费用	6.4.7.22	69,138.19	83,026.27
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-11,484,129.57	4,323,448.65
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-11,484,129.57	4,323,448.65

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	58,437,321.58	27,423,132.42	85,860,454.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-11,484,129.57	-11,484,129.57
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）	110,432,557.68	65,336,775.74	175,769,333.42
其中：1.基金申购款	199,422,929.43	112,619,764.29	312,042,693.72
2.基金赎回款	-88,990,371.75	-47,282,988.55	-136,273,360.30
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）	168,869,879.26	81,275,778.59	250,145,657.85
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	78,607,735.38	1,615,599.49	80,223,334.87
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利	-	4,323,448.65	4,323,448.65

润)			
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)	-42,507,467.12	-1,877,274.24	-44,384,741.36
其中: 1.基金申购款	2,089,648.13	121,980.48	2,211,628.61
2.基金赎回款	-44,597,115.25	-1,999,254.72	-46,596,369.97
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)	36,100,268.26	4,061,773.90	40,162,042.16

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:

基金管理人负责人: 王锦海, 主管会计工作负责人: 刘博文, 会计机构负责人: 白海燕

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金(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”)《关于准予华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金注册的批复》(证监许可[2017]1224 号)批准, 由华泰证券(上海)资产管理有限公司(以下简称“华泰资管”)依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金基金合同》发售, 基金合同于 2018 年 2 月 1 日生效。本基金为契约型开放式发起式基金, 存续期限不定, 首次设立募集规模为 343,068,498.19 份基金份额。本基金的基金管理人为华泰资管, 基金托管人为中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”)。该资金已由毕马威华振会计师事务所审验并出具验资报告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金基金合同》和《华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金招募说明书(更新)》的有关规定, 本基金投资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(包括创业板、中小板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、中小企业私募债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、货币市场工具(含同业存单)、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的业绩比较基准为: 中证 800 指数收

益率*90%+上证国债指数收益率*10%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则的要求,同时亦按照中国证监会颁布的《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>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的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 日的财务状况及 2021 年上半年的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 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

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

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 [2004] 78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2012] 85 号文《财政部、国家税务总局、证监会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《财政部、国家税务总局、证监会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 [2005] 103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字 [2008] 16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日

发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2008] 1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2016] 36 号文《财政部、国家税务总局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 号文《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 号文《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》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a)对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(b)自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

2018 年 1 月 1 日（含）以后，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，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 日以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，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(c)基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d)对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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% 计入个人所得税应纳税所得额。

(e)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。

(f)对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(g)对基金在 2018 年 1 月 1 日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理

人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

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	5,528,833.26
定期存款	-	
其他存款	-	
合计	5,528,833.26	

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	227,649,636.96	234,814,305.58	7,164,668.62
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	8,089,770.00	10,230.00
	银行间市场	-	-
	合计	8,089,770.00	10,230.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	235,739,406.96	242,914,305.58	7,174,898.62

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	1,329,080.00	-	-	-
——股指期货	1,329,080.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	1,329,080.00	-	-	-

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

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

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	510.89
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	787.70
应收债券利息	166,993.15
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	57.50
合计	168,349.24

6.4.7.6 其他资产

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	622,415.90
银行间市场应付交易费用	-
合计	622,415.90

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	14.76
应付证券出借违约金	-
预提费用	59,507.37
合计	59,522.13

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	58,437,321.58	58,437,321.58
本期申购	199,422,929.43	199,422,929.43
本期赎回（以“-”号填列）	-88,990,371.75	-88,990,371.75
本期末	168,869,879.26	168,869,879.26

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	24,647,954.81	2,775,177.61	27,423,132.42
本期利润	-10,278,518.75	-1,205,610.82	-11,484,129.57
本期基金份额交易产生的变动数	60,899,209.39	4,437,566.35	65,336,775.74
其中：基金申购款	103,303,888.98	9,315,875.31	112,619,764.29
基金赎回款	-42,404,679.59	-4,878,308.96	-47,282,988.55
本期已分配利润	-	-	-
本期末	75,268,645.45	6,007,133.14	81,275,778.59

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
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	15,581.45
其他	908.56
合计	36,700.74

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	711,969,964.16
减：卖出股票成本总额	720,842,152.46
买卖股票差价收入	-8,872,188.30

6.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期无基金投资收益。

6.4.7.14 债券投资收益

6.4.7.14.1 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	1,633.09
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	1,633.09

6.4.7.14.2 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	71,151.80
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	69,500.00
减：应收利息总额	18.71
买卖债券差价收入	1,633.09

6.4.7.15 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.17 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股指期货投资收益	-214,720.78

6.4.7.18 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	1,548,487.74
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	1,548,487.74

6.4.7.19 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	-1,052,765.77
——股票投资	-1,062,995.77
——债券投资	10,230.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-157,560.00
——权证投资	-
——股指期货	-157,560.00
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-4,714.95
合计	-1,205,610.82

6.4.7.20 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	801,285.79
合计	801,285.79

6.4.7.21 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	1,519,848.54
银行间市场交易费用	-
期货市场交易费用	12,941.03
合计	1,532,789.57

6.4.7.21.1 持有基金产生的费用

本基金本报告期无持有基金产生的费用。

6.4.7.22 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	19,835.79
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
银行手续费	9,630.82
合计	69,138.19

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，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明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

本基金本报告期内存在控制关系或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
华泰证券(上海)资产管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
华泰证券股份有限公司（以下简称“华泰证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

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，并以一般交易价格为定价基础。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的 比例	成交金额	占当期股票成交总额的 比例
华泰证券	638,182,943.77	40.16%	309,756,435.60	100.00%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的 比例	成交金额	占当期债券成交总额的 比例
华泰证券	8,160,898.41	100.00%	1,443,719.47	100.00%

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 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	49,986.96	22.61%	49,986.96	8.03%
关联方名称	上年度可比期间			

	2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
华泰证券	146,872.38	100.00%	59,269.89	100.00%

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2、根据《证券交易单元租用协议》，本基金管理人在租用华泰证券证券交易专用交易单元进行股票、债券、权证及回购交易的同时，还从华泰证券获得证券研究综合服务。

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	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年6月 30日	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	1,754,832.23	356,439.02
其中：支付销售机构的客户维护费	160,645.75	135,451.66

注：本基金的基金管理费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。计算公式为：

$$\text{日基金管理费} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年6月 30日	2020年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	292,472.01	59,406.50

注：本基金的基金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。计算公式为：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

6.4.10.2.3 销售服务费

本基金无销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金在本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行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

本基金未参与转融通证券出借业务。

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

本基金未参与转融通证券出借业务。

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自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
基金合同生效日（2018年2月1日）持有的基金份额	10,000,900.09	10,000,900.09
期初持有的基金份额	10,000,900.09	10,000,900.09
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	10,000,900.09	10,000,900.09
期末持有的基金份额占基金总份额比例	5.92%	27.70%

注：基金管理人投资本基金适用的申购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
华泰紫金常鑫集合资产管理计划	58,934,789.32	34.90%	-	-

注：基金管理人投资本基金适用的申购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日

	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	5,528,833.26	20,210.73	2,500,858.69	9,060.01

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

6.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

本基金未投资基金。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末进行利润分配。

6.4.12 期末（2021年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300614	百川畅银	2021-05-18	2021-11-25	新股锁定	9.19	40.38	329.00	3,023.51	13,285.02	-
300950	德固特	2021-02-24	2021-09-03	新股锁定	8.41	39.13	219.00	1,841.79	8,569.47	-
300953	震裕科技	2021-03-11	2021-09-22	新股锁定	28.77	99.85	240.00	6,904.80	23,964.00	-
300955	嘉亨家化	2021-03-16	2021-09-24	新股锁定	16.53	46.07	232.00	3,834.96	10,688.24	-
300956	英力股份	2021-03-16	2021-09-27	新股锁定	12.85	25.80	371.00	4,767.35	9,571.80	-
300957	贝泰妮	2021-03-18	2021-09-27	新股锁定	47.33	251.96	217.00	10,270.61	54,675.32	-
300958	建工修复	2021-03-18	2021-09-29	新股锁定	8.53	27.22	300.00	2,559.00	8,166.00	-
30096	通业	2021-0	2021-0	新股	12.08	23.06	234.00	2,826.	5,396.	-

0	科技	3-22	9-29	锁定				72	04	
300961	深水海纳	2021-03-23	2021-09-30	新股锁定	8.48	22.07	394.00	3,341.12	8,695.58	-
300962	中金辐照	2021-03-29	2021-10-11	新股锁定	3.40	16.37	576.00	1,958.40	9,429.12	-
300963	中洲特材	2021-03-30	2021-10-11	新股锁定	12.13	22.49	283.00	3,432.79	6,364.67	-
300966	共同药业	2021-03-31	2021-10-11	新股锁定	8.24	31.54	286.00	2,356.64	9,020.44	-
300967	晓鸣股份	2021-04-02	2021-10-13	新股锁定	4.54	11.54	507.00	2,301.78	5,850.78	-
300968	格林精密	2021-04-06	2021-10-15	新股锁定	6.87	12.07	1,162.00	7,982.94	14,025.34	-
300971	博亚精工	2021-04-07	2021-10-15	新股锁定	18.24	28.29	245.00	4,468.80	6,931.05	-
300978	东箭科技	2021-04-15	2021-10-26	新股锁定	8.42	13.60	593.00	4,993.06	8,064.80	-
300979	华利集团	2021-04-15	2021-10-26	新股锁定	33.22	87.50	333.00	11,062.26	29,137.50	-
300981	中红医疗	2021-04-19	2021-10-27	新股锁定	48.59	90.39	211.00	10,252.49	19,072.29	-
300982	苏文电能	2021-04-19	2021-10-27	新股锁定	15.83	45.29	317.00	5,018.11	14,356.93	-
300985	致远新能	2021-04-21	2021-10-29	新股锁定	24.90	24.81	277.00	6,897.30	6,872.37	-
300986	志特新材	2021-04-21	2021-11-01	新股锁定	14.79	30.57	264.00	3,904.56	8,070.48	-
300991	创益通	2021-05-12	2021-11-22	新股锁定	13.06	26.51	254.00	3,317.24	6,733.54	-
300992	泰福泵业	2021-05-17	2021-11-25	新股锁定	9.36	20.32	200.00	1,872.00	4,064.00	-
300993	玉马遮阳	2021-05-17	2021-11-24	新股锁定	12.10	19.29	410.00	4,961.00	7,908.90	-
300995	奇德新材	2021-05-17	2021-11-26	新股锁定	14.72	23.32	191.00	2,811.52	4,454.12	-
300996	普联软件	2021-05-26	2021-12-03	新股锁定	20.81	42.23	241.00	5,015.21	10,177.43	-
300998	宁波方正	2021-05-25	2021-12-02	新股锁定	6.02	21.32	201.00	1,210.02	4,285.32	-
301002	崧盛股份	2021-05-27	2021-12-07	新股锁定	18.71	57.62	201.00	3,760.71	11,581.62	-
301004	嘉益股份	2021-06-18	2021-12-27	新股锁定	7.81	21.94	312.00	2,436.72	6,845.28	-
30100	德迈	2021-0	2021-1	新股	5.29	14.44	303.00	1,602.	4,375.	-

7	仕	6-04	2-16	锁定				87	32	
301009	可靠股份	2021-06-08	2021-12-17	新股锁定	12.54	27.89	801.00	10,044.54	22,339.89	-
301010	晶雪节能	2021-06-09	2021-12-20	新股锁定	7.83	17.61	218.00	1,706.94	3,838.98	-
301011	华立科技	2021-06-09	2021-12-17	新股锁定	14.20	33.84	175.00	2,485.00	5,922.00	-
301012	扬电科技	2021-06-15	2021-12-22	新股锁定	8.05	24.26	170.00	1,368.50	4,124.20	-
301013	利和兴	2021-06-21	2021-12-29	新股锁定	8.72	27.11	471.00	4,107.12	12,768.81	-
301015	百洋医药	2021-06-22	2021-12-30	新股锁定	7.64	38.83	462.00	3,529.68	17,939.46	-
301016	雷尔伟	2021-06-23	2021-12-30	新股锁定	13.75	32.98	275.00	3,781.25	9,069.50	-
301017	漱玉平民	2021-06-23	2021-07-05	新股未上市	8.86	8.86	4,995.00	44,255.70	44,255.70	-
301017	漱玉平民	2021-06-23	2022-01-05	新股锁定	8.86	8.86	555.00	4,917.30	4,917.30	-
301018	申菱环境	2021-06-28	2021-07-07	新股未上市	8.29	8.29	7,811.00	64,753.19	64,753.19	-
301020	密封科技	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	10.64	10.64	4,210.00	44,794.40	44,794.40	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	9.46	9.46	2,899.00	27,424.54	27,424.54	-
605162	新中港	2021-06-29	2021-07-07	新股未上市	6.07	6.07	1,377.00	8,358.39	8,358.39	-
605287	德才股份	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	31.56	31.56	349.00	11,014.44	11,014.44	-
688113	联测科技	2021-04-26	2021-11-08	新股锁定	19.14	49.29	1,415.00	27,083.10	69,745.35	-
688226	威腾电气	2021-06-28	2021-07-07	新股未上市	6.42	6.42	2,693.00	17,289.06	17,289.06	-
688239	航宇科技	2021-06-25	2021-07-05	新股未上市	11.48	11.48	4,926.00	56,550.48	56,550.48	-
68849	利元	2021-0	2021-0	新股	38.85	38.85	2,050.	79,642	79,642	-

9	亨	6-23	7-01	未上市			00	.50	.50	
688626	翔宇医疗	2021-03-23	2021-10-08	新股锁定	28.82	104.16	2,400.00	69,168.00	249,984.00	-
688676	金盘科技	2021-03-02	2021-09-09	新股锁定	10.10	16.24	3,750.00	37,875.00	60,900.00	-
688681	科汇股份	2021-06-04	2021-12-16	新股锁定	9.56	14.54	1,899.00	18,154.44	27,611.46	-
688683	莱尔科技	2021-04-01	2021-10-12	新股锁定	9.51	14.73	3,296.00	31,344.96	48,550.08	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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

本基金本报告期末未持有因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金未参与转融通证券出借业务。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金为股票基金，其预期收益和风险均高于债券型基金、混合型基金及货币市场基金。本基金通过量化选股模型精选股票，在有效控制风险的前提下，力争获取超越业绩比较基准的投资回报，谋求基金资产的长期增值。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。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

公司建立健全与自身发展战略相适应的全面风险管理体系。公司全面风险管理体系包括可操作的管理制度、健全的组织架构、可靠的信息技术系统、量化的风险指标体系、专业的人才队伍、有效的风险应对机制以及良好的风险管理文化。

公司风险管理组织架构包括五个主要部分：董事会及合规与风险控制委员会，监事，公司管理

层及风险管理委员会，风险管理部及各类专业风险管理部门、各其他职能部门以及业务部门。

公司董事会是风险管理的最高决策机构，承担公司全面风险管理体系的最终责任。董事会下设合规与风险控制委员会，主要负责审议公司风险管理制度、风险偏好、风险容忍度和风险评估报告。公司监事承担全面风险管理的监督责任，负责监督检查董事会和管理层在风险管理方面的履职尽责情况并督促整改。公司管理层对全面风险管理承担主要责任，负责制度及完善公司风险管理制度，建立健全公司全面风险管理的经营管理架构，制定风险偏好、风险容忍度并定期评估公司整体风险。公司管理层下设风险管理委员会，负责批准适合各项业务发展的风险管理政策，提升公司风险管理的有效性，研究制定重大事件、重大决策和重要业务流程的风险评估报告以及重大风险的解决方案，审议公司定期和临时风险报告，指导风险管理相关部门工作等。公司设首席风险官，负责分管领导全面风险管理工作，公司保障首席风险官能够充分行使履行职责所必要的知情权，同时保障首席风险官的独立性。公司指定风险管理部与合规稽核部履行全面风险管理职责，包括牵头建立完善公司全面风险管理体系，牵头管理公司的市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险、合规风险和法律风险，监测、计量、评估、报告公司整体风险水平和风险资本运用及牵头应对和处置公司层面重大风险事件。

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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的银行存款存放在商业信誉良好的股份制银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。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%。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年末 2020年12月31日
AAA	-	30,000.00
AAA 以下	-	39,500.00
未评级	81,000.00	-
合计	-	69,500.00

注：未评级债券均为国债。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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。

本基金所持大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，因此除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。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资产的公允价值。

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，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行

持续的监测和分析，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

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 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%。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的 15%。

综合上述各项流动性指标的监测结果以及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内的流动性情况良好。

6.4.13.4.2 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。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。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、存出保证金及债券投资等。

6.4.13.4.2.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	5,528,833.26	-	-	-	5,528,833.26

结算备付金	2,407,532.82	-	-	-	2,407,532.82
存出保证金	314,570.86	-	-	-	314,570.86
交易性金融资产	8,100,000.00	-	-	234,814,305.58	242,914,305.58
应收利息	-	-	-	168,349.24	168,349.24
应收申购款	-	-	-	2,396.40	2,396.40
应收证券清算款	-	-	-	273,967.31	273,967.31
资产总计	16,350,936.94	-	-	235,259,018.53	251,609,955.47
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	319,634.31	319,634.31
应付管理人报酬	-	-	-	305,793.29	305,793.29
应付托管费	-	-	-	50,965.53	50,965.53
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	622,415.90	622,415.90
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	105,966.46	105,966.46
其他负债	-	-	-	59,522.13	59,522.13
负债总计	-	-	-	1,464,297.62	1,464,297.62
利率敏感度缺口	16,350,936.94	-	-	233,794,720.91	250,145,657.85
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	11,080,178.74	-	-	-	11,080,178.74
结算备付金	1,081,692.00	-	-	-	1,081,692.00
存出保证金	661,157.43	-	-	-	661,157.43
交易性金融资产	-	-	69,500.00	74,460,184.06	74,529,684.06
应收利息	-	-	-	1,049.56	1,049.56
应收申购款	-	-	-	5,398,576.00	5,398,576.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	97,620.99	97,620.99

资产总计	12,823,028.17	-	69,500.00	79,957,430.61	92,849,958.78
负债					
应付赎回款	-	-	-	262,267.03	262,267.03
应付管理人报酬	-	-	-	82,469.24	82,469.24
应付托管费	-	-	-	13,744.89	13,744.89
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	67,290.68	67,290.68
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	7,758.15	7,758.15
应付证券清算款	-	-	-	6,435,757.05	6,435,757.05
其他负债	-	-	-	120,217.74	120,217.74
负债总计	-	-	-	6,989,504.78	6,989,504.78
利率敏感度缺口	12,823,028.17	-	69,500.00	72,967,925.83	85,860,454.00

注：上表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.2.2 利率风险的敏感性分析

假设	1.该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况；2.该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变；3.该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动；4.银行存款、结算备付金、存出保证金和部分应收申购款均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响；买入返售金融资产的利息收益在交易时已确定，不受利率变化影响。		
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
	市场利率上升 25 个基点	7,546.09	975.07
	市场利率下降 25 个基点	-7,532.06	-959.16

6.4.13.4.3 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。

6.4.13.4.4 其他价格风险

基金承受的其他市场价格风险，主要是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。本基金的其他市场价格风险，主要受到证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。

6.4.13.4.4.1 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	234,814,305.58	93.87	74,460,184.06	86.72
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	8,100,000.00	3.24	69,500.00	0.08
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	242,914,305.58	97.11	74,529,684.06	86.80

6.4.13.4.4.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1.本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变；2.以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
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%	25,696,429.60	6,863,518.88
业绩比较基准下降 5%	-25,696,429.60	-6,863,518.88	

注：本基金管理人运用资产-资本定价模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

6.4.13.4.5 采用风险价值法管理风险

假设	1.置信区间 95%		
	2.观察期自基金合同成立后至统计日前的所有交易日		
分析	风险价值	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	1 天	4,443,804.92	1,324,961.48
	合计	4,443,804.92	1,324,961.48

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)金融工具公允价值计量的方法公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 241,681,879.08 元，属于第二层次的余额为 1,232,426.50 元，无属于第三层次的余额(2020 年 12 月 31 日：第一层次 74,439,661.48 元，第二层次 90,022.58 元，无属于第三层次的余额)。

(ii)对于本基金投资的证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况时，本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值的层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

于 2021 年 6 月 30 日，本基金未持有公允价值归属于第三层次的金融工具。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 6 月 30 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2020 年 12 月 31 日：无)。

(d)不以公允价值计量的金融工具不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

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	234,814,305.58	93.32
	其中：股票	234,814,305.58	93.32
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	8,100,000.00	3.22
	其中：债券	8,100,000.00	3.22
	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	7,936,366.08	3.15
8	其他各项资产	759,283.81	0.30
9	合计	251,609,955.47	100.00

注：1、本基金本报告期末未持有港股通股票。

2、本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

7.2 报告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

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	1,504,455.58	0.60
B	采矿业	4,394,944.00	1.76
C	制造业	133,530,147.75	53.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,895,891.07	1.56
E	建筑业	3,063,236.37	1.22
F	批发和零售业	721,119.46	0.29
G	交通运输、仓储和邮政业	5,640,802.00	2.26
H	住宿和餐饮业	387,260.00	0.15
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,260,472.43	2.50
J	金融业	56,174,935.40	22.46
K	房地产业	4,779,929.00	1.91
L	租赁和商务服务业	4,060,158.00	1.62
M	科学研究和技术服务业	3,022,187.00	1.21
N	水利、环境和公共设施管理业	30,146.60	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	6,065,002.92	2.42
R	文化、体育和娱乐业	1,283,618.00	0.51
S	综合	-	-
	合计	234,814,305.58	93.87

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

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	600519	贵州茅台	5,100.00	10,489,170.00	4.19
2	000858	五粮液	26,935.00	8,023,667.15	3.21
3	600036	招商银行	125,600.00	6,806,264.00	2.72
4	601318	中国平安	76,400.00	4,910,992.00	1.96

5	000001	平安银行	209,300.00	4,734,366.00	1.89
6	601012	隆基股份	45,578.00	4,049,149.52	1.62
7	601211	国泰君安	206,700.00	3,542,838.00	1.42
8	601166	兴业银行	169,600.00	3,485,280.00	1.39
9	002142	宁波银行	83,275.00	3,245,226.75	1.30
10	601888	中国中免	10,400.00	3,121,040.00	1.25
11	300015	爱尔眼科	43,954.00	3,119,854.92	1.25
12	603259	药明康德	19,300.00	3,022,187.00	1.21
13	300059	东方财富	91,840.00	3,011,433.60	1.20
14	002415	海康威视	43,300.00	2,792,850.00	1.12
15	002594	比亚迪	10,900.00	2,735,900.00	1.09
16	000333	美的集团	37,700.00	2,690,649.00	1.08
17	601838	成都银行	212,700.00	2,688,528.00	1.07
18	300760	迈瑞医疗	5,600.00	2,688,280.00	1.07
19	002475	立讯精密	57,200.00	2,631,200.00	1.05
20	600276	恒瑞医药	37,420.00	2,543,437.40	1.02
21	600837	海通证券	215,800.00	2,481,700.00	0.99
22	600030	中信证券	98,500.00	2,456,590.00	0.98
23	000776	广发证券	158,100.00	2,393,634.00	0.96
24	601398	工商银行	434,700.00	2,247,399.00	0.90
25	600887	伊利股份	60,300.00	2,220,849.00	0.89
26	600900	长江电力	106,787.00	2,204,083.68	0.88
27	002304	洋河股份	10,500.00	2,175,600.00	0.87
28	601919	中远海控	70,300.00	2,146,962.00	0.86
29	300122	智飞生物	11,400.00	2,128,722.00	0.85
30	600926	杭州银行	142,281.00	2,098,644.75	0.84
31	000568	泸州老窖	8,800.00	2,076,272.00	0.83
32	601628	中国人寿	61,100.00	2,070,679.00	0.83
33	600031	三一重工	69,600.00	2,023,272.00	0.81
34	603501	韦尔股份	6,100.00	1,964,200.00	0.79
35	000725	京东方 A	287,400.00	1,793,376.00	0.72
36	002241	歌尔股份	41,300.00	1,765,162.00	0.71
37	300347	泰格医药	9,000.00	1,739,700.00	0.70
38	600884	杉杉股份	70,600.00	1,646,392.00	0.66
39	600438	通威股份	37,500.00	1,622,625.00	0.65
40	600690	海尔智家	61,100.00	1,583,101.00	0.63
41	600703	三安光电	48,600.00	1,557,630.00	0.62
42	601336	新华保险	33,300.00	1,528,803.00	0.61
43	002714	牧原股份	24,640.00	1,498,604.80	0.60
44	600132	重庆啤酒	7,501.00	1,484,822.95	0.59
45	603369	今世缘	27,350.00	1,481,276.00	0.59
46	600600	青岛啤酒	12,600.00	1,457,190.00	0.58
47	600060	海信视像	85,200.00	1,439,880.00	0.58
48	002508	老板电器	30,700.00	1,427,550.00	0.57

49	002230	科大讯飞	20,600.00	1,392,148.00	0.56
50	600809	山西汾酒	3,100.00	1,388,800.00	0.56
51	000651	格力电器	26,600.00	1,385,860.00	0.55
52	300142	沃森生物	22,400.00	1,382,080.00	0.55
53	300014	亿纬锂能	13,000.00	1,351,090.00	0.54
54	300124	汇川技术	17,750.00	1,318,115.00	0.53
55	000100	TCL 科技	169,000.00	1,292,850.00	0.52
56	601899	紫金矿业	130,300.00	1,262,607.00	0.50
57	603986	兆易创新	6,500.00	1,221,350.00	0.49
58	600309	万华化学	11,000.00	1,197,020.00	0.48
59	600958	东方证券	118,200.00	1,180,818.00	0.47
60	002460	赣锋锂业	9,600.00	1,162,464.00	0.46
61	600585	海螺水泥	28,100.00	1,153,505.00	0.46
62	601668	中国建筑	246,300.00	1,145,295.00	0.46
63	002271	东方雨虹	20,700.00	1,145,124.00	0.46
64	601939	建设银行	171,600.00	1,141,140.00	0.46
65	000002	万 科 A	47,200.00	1,123,832.00	0.45
66	002812	恩捷股份	4,800.00	1,123,680.00	0.45
67	300750	宁德时代	2,100.00	1,123,080.00	0.45
68	600660	福耀玻璃	19,000.00	1,061,150.00	0.42
69	601633	长城汽车	24,300.00	1,059,237.00	0.42
70	002648	卫星石化	26,880.00	1,053,427.20	0.42
71	601658	邮储银行	209,300.00	1,050,686.00	0.42
72	603799	华友钴业	9,200.00	1,050,640.00	0.42
73	600999	招商证券	54,580.00	1,038,111.60	0.42
74	002352	顺丰控股	15,300.00	1,035,810.00	0.41
75	601598	中国外运	204,900.00	1,034,745.00	0.41
76	600196	复星医药	14,300.00	1,031,459.00	0.41
77	002371	北方华创	3,700.00	1,026,306.00	0.41
78	688111	金山办公	2,590.00	1,022,532.00	0.41
79	601601	中国太保	34,500.00	999,465.00	0.40
80	600436	片仔癀	2,200.00	986,260.00	0.39
81	002466	天齐锂业	15,300.00	948,906.00	0.38
82	002027	分众传媒	99,800.00	939,118.00	0.38
83	000063	中兴通讯	28,100.00	933,763.00	0.37
84	002821	凯莱英	2,500.00	931,500.00	0.37
85	000661	长春高新	2,400.00	928,800.00	0.37
86	601689	拓普集团	24,600.00	920,778.00	0.37
87	600104	上汽集团	41,746.00	917,159.62	0.37
88	600570	恒生电子	9,800.00	913,850.00	0.37
89	000425	徐工机械	142,400.00	907,088.00	0.36
90	002414	高德红外	32,760.00	903,520.80	0.36
91	601288	农业银行	294,600.00	892,638.00	0.36
92	600064	南京高科	95,700.00	889,053.00	0.36

93	000930	中粮科技	98,400.00	886,584.00	0.35
94	002146	荣盛发展	153,700.00	866,868.00	0.35
95	601238	广汽集团	66,656.00	863,195.20	0.35
96	300274	阳光电源	7,500.00	862,950.00	0.34
97	601857	中国石油	159,300.00	842,697.00	0.34
98	600763	通策医疗	2,000.00	822,000.00	0.33
99	002049	紫光国微	5,200.00	801,788.00	0.32
100	601225	陕西煤业	67,600.00	801,060.00	0.32
101	600019	宝钢股份	104,500.00	798,380.00	0.32
102	600048	保利地产	64,800.00	780,192.00	0.31
103	601009	南京银行	73,680.00	775,113.60	0.31
104	002410	广联达	11,200.00	763,840.00	0.31
105	603345	安井食品	3,000.00	762,060.00	0.30
106	601088	中国神华	38,700.00	755,424.00	0.30
107	000625	长安汽车	28,400.00	746,352.00	0.30
108	000830	鲁西化工	39,100.00	732,343.00	0.29
109	603288	海天味业	5,600.00	722,120.00	0.29
110	300529	健帆生物	8,300.00	716,788.00	0.29
111	002030	达安基因	33,060.00	702,194.40	0.28
112	002311	海大集团	8,500.00	693,600.00	0.28
113	601006	大秦铁路	104,800.00	689,584.00	0.28
114	000961	中南建设	114,700.00	679,024.00	0.27
115	688012	中微公司	4,058.00	673,303.36	0.27
116	600893	航发动力	12,500.00	664,875.00	0.27
117	002129	中环股份	17,100.00	660,060.00	0.26
118	600588	用友网络	19,300.00	641,918.00	0.26
119	000807	云铝股份	53,600.00	637,840.00	0.25
120	600028	中国石化	145,100.00	632,636.00	0.25
121	601390	中国中铁	119,400.00	625,656.00	0.25
122	600346	恒力石化	23,600.00	619,264.00	0.25
123	300450	先导智能	10,200.00	613,428.00	0.25
124	601377	兴业证券	61,600.00	595,056.00	0.24
125	688126	沪硅产业	20,331.00	593,258.58	0.24
126	600426	华鲁恒升	18,950.00	586,502.50	0.23
127	002050	三花智控	24,200.00	580,316.00	0.23
128	300033	同花顺	5,100.00	575,178.00	0.23
129	601600	中国铝业	108,400.00	574,520.00	0.23
130	000963	华东医药	12,300.00	565,923.00	0.23
131	300413	芒果超媒	8,200.00	562,520.00	0.22
132	300628	亿联网络	6,600.00	553,080.00	0.22
133	600584	长电科技	14,600.00	550,128.00	0.22
134	002008	大族激光	13,600.00	549,304.00	0.22
135	002408	齐翔腾达	44,200.00	548,964.00	0.22
136	688363	华熙生物	1,951.00	542,104.86	0.22

137	688036	传音控股	2,518.00	527,521.00	0.21
138	002601	龙佰集团	15,000.00	518,700.00	0.21
139	002179	中航光电	6,400.00	505,728.00	0.20
140	002396	星网锐捷	23,500.00	501,725.00	0.20
141	300638	广和通	10,540.00	492,218.00	0.20
142	688396	华润微	5,156.00	469,299.12	0.19
143	000786	北新建材	11,900.00	467,075.00	0.19
144	000157	中联重科	49,900.00	461,076.00	0.18
145	600406	国电南瑞	19,320.00	448,996.80	0.18
146	300146	汤臣倍健	13,500.00	444,150.00	0.18
147	601155	新城控股	10,600.00	440,960.00	0.18
148	601989	中国重工	106,900.00	440,428.00	0.18
149	603659	璞泰来	3,200.00	437,120.00	0.17
150	000768	中航西飞	16,200.00	425,736.00	0.17
151	002493	荣盛石化	24,000.00	414,480.00	0.17
152	600760	中航沈飞	6,860.00	413,658.00	0.17
153	603806	福斯特	3,900.00	410,007.00	0.16
154	601186	中国铁建	54,000.00	401,220.00	0.16
155	601100	恒立液压	4,600.00	395,232.00	0.16
156	300037	新宙邦	3,900.00	390,390.00	0.16
157	600754	锦江股份	6,800.00	387,260.00	0.15
158	603882	金域医学	2,400.00	383,448.00	0.15
159	000429	粤高速 A	52,700.00	377,859.00	0.15
160	300595	欧普康视	3,640.00	376,922.00	0.15
161	603899	晨光文具	4,400.00	372,064.00	0.15
162	003816	中国广核	138,800.00	370,596.00	0.15
163	300433	蓝思科技	12,400.00	364,684.00	0.15
164	688169	石头科技	289.00	364,429.00	0.15
165	601098	中南传媒	41,200.00	363,384.00	0.15
166	601966	玲珑轮胎	8,200.00	358,668.00	0.14
167	601928	凤凰传媒	50,100.00	357,714.00	0.14
168	600018	上港集团	74,600.00	355,842.00	0.14
169	601669	中国电建	89,600.00	346,752.00	0.14
170	000977	浪潮信息	12,000.00	337,560.00	0.13
171	600795	国电电力	138,700.00	337,041.00	0.13
172	002624	完美世界	14,000.00	334,740.00	0.13
173	603019	中科曙光	12,000.00	331,320.00	0.13
174	600845	宝信软件	6,500.00	330,850.00	0.13
175	600886	国投电力	32,700.00	314,247.00	0.13
176	601985	中国核电	61,600.00	311,696.00	0.12
177	000596	古井贡酒	1,300.00	311,350.00	0.12
178	000066	中国长城	20,500.00	299,300.00	0.12
179	603833	欧派家居	2,100.00	298,116.00	0.12
180	601800	中国交建	41,500.00	268,920.00	0.11

181	600050	中国联通	61,900.00	267,408.00	0.11
182	600111	北方稀土	12,500.00	258,750.00	0.10
183	000898	鞍钢股份	57,900.00	257,655.00	0.10
184	002938	鹏鼎控股	7,100.00	254,748.00	0.10
185	601618	中国中冶	83,900.00	250,022.00	0.10
186	688626	翔宇医疗	2,400.00	249,984.00	0.10
187	002600	领益智造	27,000.00	248,130.00	0.10
188	688005	容百科技	2,041.00	247,369.20	0.10
189	000876	新希望	16,800.00	246,456.00	0.10
190	000708	中信特钢	11,800.00	245,912.00	0.10
191	002916	深南电路	2,200.00	244,486.00	0.10
192	002157	正邦科技	19,100.00	228,245.00	0.09
193	600027	华电国际	64,500.00	221,880.00	0.09
194	600118	中国卫星	7,000.00	204,820.00	0.08
195	002966	苏州银行	25,800.00	189,630.00	0.08
196	600219	南山铝业	49,000.00	176,400.00	0.07
197	688009	中国通号	30,300.00	172,407.00	0.07
198	603195	公牛集团	700.00	141,400.00	0.06
199	600482	中国动力	7,500.00	130,650.00	0.05
200	600150	中国船舶	7,800.00	128,778.00	0.05
201	600025	华能水电	21,300.00	123,327.00	0.05
202	002563	森马服饰	10,300.00	123,085.00	0.05
203	002154	报喜鸟	19,300.00	122,941.00	0.05
204	002153	石基信息	5,180.00	121,781.80	0.05
205	600176	中国巨石	7,700.00	119,427.00	0.05
206	603605	珀莱雅	600.00	118,026.00	0.05
207	601808	中海油服	7,000.00	100,520.00	0.04
208	600655	豫园股份	7,600.00	88,084.00	0.04
209	688499	利元亨	2,050.00	79,642.50	0.03
210	688113	联测科技	1,415.00	69,745.35	0.03
211	301018	申菱环境	7,811.00	64,753.19	0.03
212	688676	金盘科技	3,750.00	60,900.00	0.02
213	688239	航宇科技	4,926.00	56,550.48	0.02
214	300957	贝泰妮	217.00	54,675.32	0.02
215	301017	漱玉平民	5,550.00	49,173.00	0.02
216	688683	莱尔科技	3,296.00	48,550.08	0.02
217	301020	密封科技	4,210.00	44,794.40	0.02
218	601528	瑞丰银行	2,230.00	34,721.10	0.01
219	300979	华利集团	333.00	29,137.50	0.01
220	688681	科汇股份	1,899.00	27,611.46	0.01
221	301021	英诺激光	2,899.00	27,424.54	0.01
222	300953	震裕科技	240.00	23,964.00	0.01
223	301009	可靠股份	801.00	22,339.89	0.01
224	300981	中红医疗	211.00	19,072.29	0.01

225	301015	百洋医药	462.00	17,939.46	0.01
226	688226	威腾电气	2,693.00	17,289.06	0.01
227	300982	苏文电能	317.00	14,356.93	0.01
228	300968	格林精密	1,162.00	14,025.34	0.01
229	001208	华菱线缆	1,754.00	13,558.42	0.01
230	300614	百川畅银	329.00	13,285.02	0.01
231	301013	利和兴	471.00	12,768.81	0.01
232	603171	税友股份	637.00	12,230.40	0.00
233	301002	崧盛股份	201.00	11,581.62	0.00
234	605287	德才股份	349.00	11,014.44	0.00
235	300955	嘉亨家化	232.00	10,688.24	0.00
236	300996	普联软件	241.00	10,177.43	0.00
237	300956	英力股份	371.00	9,571.80	0.00
238	300962	中金辐照	576.00	9,429.12	0.00
239	301016	雷尔伟	275.00	9,069.50	0.00
240	300966	共同药业	286.00	9,020.44	0.00
241	300961	深水海纳	394.00	8,695.58	0.00
242	300950	德固特	219.00	8,569.47	0.00
243	605162	新中港	1,377.00	8,358.39	0.00
244	300958	建工修复	300.00	8,166.00	0.00
245	300986	志特新材	264.00	8,070.48	0.00
246	300978	东箭科技	593.00	8,064.80	0.00
247	300993	玉马遮阳	410.00	7,908.90	0.00
248	300971	博亚精工	245.00	6,931.05	0.00
249	300985	致远新能	277.00	6,872.37	0.00
250	301004	嘉益股份	312.00	6,845.28	0.00
251	300991	创益通	254.00	6,733.54	0.00
252	300963	中洲特材	283.00	6,364.67	0.00
253	301011	华立科技	175.00	5,922.00	0.00
254	300967	晓鸣股份	507.00	5,850.78	0.00
255	300960	通业科技	234.00	5,396.04	0.00
256	605011	杭州热电	525.00	4,662.00	0.00
257	300995	奇德新材	191.00	4,454.12	0.00
258	301007	德迈仕	303.00	4,375.32	0.00
259	300998	宁波方正	201.00	4,285.32	0.00
260	301012	扬电科技	170.00	4,124.20	0.00
261	300992	泰福泵业	200.00	4,064.00	0.00
262	301010	晶雪节能	218.00	3,838.98	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	601318	中国平安	18,519,570.00	21.57
2	600519	贵州茅台	16,219,945.00	18.89
3	600036	招商银行	11,418,479.00	13.30
4	601166	兴业银行	11,223,000.00	13.07
5	000001	平安银行	9,375,116.96	10.92
6	600030	中信证券	8,708,132.14	10.14
7	000858	五粮液	8,329,452.85	9.70
8	000568	泸州老窖	7,667,572.00	8.93
9	601336	新华保险	7,611,412.00	8.86
10	002142	宁波银行	7,584,216.43	8.83
11	002475	立讯精密	7,535,762.60	8.78
12	600438	通威股份	7,361,482.00	8.57
13	300059	东方财富	7,177,205.00	8.36
14	000776	广发证券	7,173,673.00	8.36
15	600809	山西汾酒	7,118,238.62	8.29
16	600999	招商证券	6,969,909.96	8.12
17	600690	海尔智家	6,741,028.00	7.85
18	601601	中国太保	6,634,541.00	7.73
19	300122	智飞生物	6,604,394.00	7.69
20	601919	中远海控	6,524,292.13	7.60
21	603799	华友钴业	6,384,368.00	7.44
22	603259	药明康德	6,225,060.87	7.25
23	600887	伊利股份	6,205,740.63	7.23
24	603369	今世缘	6,151,785.50	7.16
25	600031	三一重工	6,150,446.00	7.16
26	300142	沃森生物	6,125,984.00	7.13
27	601689	拓普集团	6,004,342.00	6.99
28	000100	TCL 科技	5,983,876.00	6.97
29	600276	恒瑞医药	5,876,444.34	6.84
30	601012	隆基股份	5,876,368.12	6.84
31	002382	蓝帆医疗	5,871,954.06	6.84
32	002001	新 和 成	5,853,016.63	6.82
33	000725	京东方 A	5,705,626.00	6.65
34	002304	洋河股份	5,700,065.00	6.64
35	300760	迈瑞医疗	5,592,205.00	6.51
36	300015	爱尔眼科	5,589,098.00	6.51
37	600926	杭州银行	5,517,374.92	6.43
38	300274	阳光电源	5,431,722.00	6.33
39	601899	紫金矿业	5,427,504.00	6.32
40	300347	泰格医药	5,371,654.36	6.26
41	601628	中国人寿	5,356,677.00	6.24
42	002352	顺丰控股	5,310,724.80	6.19

43	002601	龙佰集团	5,309,430.00	6.18
44	600309	万华化学	5,239,919.00	6.10
45	600176	中国巨石	5,222,007.00	6.08
46	002594	比亚迪	5,173,285.84	6.03
47	002415	海康威视	5,098,351.00	5.94
48	300676	华大基因	5,056,054.49	5.89
49	603501	韦尔股份	4,993,390.00	5.82
50	601888	中国中免	4,935,588.80	5.75
51	300115	长盈精密	4,753,795.58	5.54
52	300146	汤臣倍健	4,724,666.00	5.50
53	600703	三安光电	4,686,354.73	5.46
54	002648	卫星石化	4,609,291.00	5.37
55	002557	洽洽食品	4,532,430.00	5.28
56	000786	北新建材	4,471,287.00	5.21
57	600660	福耀玻璃	4,471,003.00	5.21
58	601633	长城汽车	4,217,609.47	4.91
59	300316	晶盛机电	4,206,938.00	4.90
60	002460	赣锋锂业	4,136,760.96	4.82
61	688036	传音控股	4,133,735.15	4.81
62	300750	宁德时代	4,126,067.80	4.81
63	300124	汇川技术	4,125,013.00	4.80
64	603198	迎驾贡酒	3,977,356.00	4.63
65	600143	金发科技	3,966,812.00	4.62
66	300144	宋城演艺	3,848,625.64	4.48
67	603288	海天味业	3,787,886.00	4.41
68	601211	国泰君安	3,743,629.00	4.36
69	601939	建设银行	3,734,894.60	4.35
70	600585	海螺水泥	3,734,091.00	4.35
71	000651	格力电器	3,679,828.00	4.29
72	603993	洛阳钼业	3,670,692.00	4.28
73	300433	蓝思科技	3,665,137.00	4.27
74	601009	南京银行	3,653,216.40	4.25
75	601398	工商银行	3,529,996.00	4.11
76	600019	宝钢股份	3,499,591.00	4.08
77	002920	德赛西威	3,404,484.94	3.97
78	300408	三环集团	3,371,935.00	3.93
79	000661	长春高新	3,367,530.00	3.92
80	002216	三全食品	3,330,008.46	3.88
81	601658	邮储银行	3,322,132.00	3.87
82	601577	长沙银行	3,301,503.46	3.85
83	601100	恒立液压	3,296,725.20	3.84
84	002230	科大讯飞	3,293,654.00	3.84
85	688169	石头科技	3,288,229.65	3.83
86	002056	横店东磁	3,229,056.00	3.76

87	002027	分众传媒	3,178,288.00	3.70
88	002508	老板电器	3,153,933.51	3.67
89	002493	荣盛石化	3,139,740.17	3.66
90	300033	同花顺	3,109,516.16	3.62
91	002414	高德红外	3,095,607.00	3.61
92	601997	贵阳银行	3,091,203.87	3.60
93	002841	视源股份	3,042,367.41	3.54
94	000338	潍柴动力	3,040,187.00	3.54
95	002812	恩捷股份	3,040,170.00	3.54
96	002050	三花智控	3,036,694.00	3.54
97	300496	中科创达	2,995,696.05	3.49
98	002714	牧原股份	2,977,272.00	3.47
99	000157	中联重科	2,963,144.00	3.45
100	600089	特变电工	2,860,655.00	3.33
101	600305	恒顺醋业	2,855,484.00	3.33
102	002242	九阳股份	2,810,391.00	3.27
103	600837	海通证券	2,802,097.00	3.26
104	601838	成都银行	2,801,875.00	3.26
105	601377	兴业证券	2,759,422.00	3.21
106	002030	达安基因	2,736,520.40	3.19
107	603345	安井食品	2,694,436.93	3.14
108	000963	华东医药	2,687,342.00	3.13
109	603939	益丰药房	2,667,518.00	3.11
110	601607	上海医药	2,658,413.50	3.10
111	000703	恒逸石化	2,637,988.25	3.07
112	000538	云南白药	2,630,800.00	3.06
113	600015	华夏银行	2,629,851.00	3.06
114	600346	恒力石化	2,628,712.00	3.06
115	603486	科沃斯	2,619,427.00	3.05
116	600845	宝信软件	2,606,583.36	3.04
117	601717	郑煤机	2,605,362.00	3.03
118	000002	万科A	2,601,966.00	3.03
119	601155	新城控股	2,582,081.00	3.01
120	002271	东方雨虹	2,580,385.60	3.01
121	000830	鲁西化工	2,538,953.00	2.96
122	002241	歌尔股份	2,531,335.97	2.95
123	600362	江西铜业	2,531,159.00	2.95
124	600196	复星医药	2,432,908.00	2.83
125	000975	银泰黄金	2,427,534.00	2.83
126	600760	中航沈飞	2,422,099.00	2.82
127	002607	中公教育	2,420,069.44	2.82
128	600584	长电科技	2,414,782.00	2.81
129	600900	长江电力	2,405,476.63	2.80
130	600588	用友网络	2,363,867.00	2.75

131	002010	传化智联	2,350,276.00	2.74
132	000932	华菱钢铁	2,342,600.80	2.73
133	002444	巨星科技	2,325,921.00	2.71
134	000807	云铝股份	2,295,602.00	2.67
135	000519	中兵红箭	2,286,709.00	2.66
136	601225	陕西煤业	2,274,212.00	2.65
137	002541	鸿路钢构	2,267,338.43	2.64
138	600060	海信视像	2,254,906.00	2.63
139	002008	大族激光	2,238,194.00	2.61
140	600183	生益科技	2,235,151.00	2.60
141	601319	中国人保	2,227,986.00	2.59
142	300783	三只松鼠	2,209,550.00	2.57
143	002028	思源电气	2,202,498.00	2.57
144	600600	青岛啤酒	2,156,120.00	2.51
145	300009	安科生物	2,149,069.00	2.50
146	600383	金地集团	2,141,799.00	2.49
147	002555	三七互娱	2,111,249.00	2.46
148	601128	常熟银行	2,097,058.00	2.44
149	000961	中南建设	2,084,746.00	2.43
150	002223	鱼跃医疗	2,079,010.00	2.42
151	000977	浪潮信息	2,061,358.72	2.40
152	002434	万里扬	2,053,189.68	2.39
153	000425	徐工机械	2,043,366.00	2.38
154	300699	光威复材	1,977,828.45	2.30
155	688363	华熙生物	1,970,014.62	2.29
156	000729	燕京啤酒	1,967,085.00	2.29
157	600132	重庆啤酒	1,951,819.00	2.27
158	001979	招商蛇口	1,942,510.00	2.26
159	002544	杰赛科技	1,925,078.00	2.24
160	000581	威孚高科	1,864,027.00	2.17
161	300014	亿纬锂能	1,859,457.00	2.17
162	300677	英科医疗	1,833,064.00	2.13
163	300003	乐普医疗	1,831,930.00	2.13
164	603290	斯达半导	1,828,241.00	2.13
165	000895	双汇发展	1,810,272.00	2.11
166	600406	国电南瑞	1,797,888.00	2.09
167	600258	首旅酒店	1,778,051.17	2.07
168	002624	完美世界	1,776,700.00	2.07
169	002233	塔牌集团	1,768,657.00	2.06
170	002025	航天电器	1,748,609.48	2.04
171	002384	东山精密	1,730,150.00	2.02

注：“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 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	601318	中国平安	13,697,498.60	15.95
2	601166	兴业银行	8,213,791.00	9.57
3	601601	中国太保	7,288,989.00	8.49
4	600519	贵州茅台	7,158,572.00	8.34
5	600809	山西汾酒	7,000,822.00	8.15
6	600030	中信证券	6,954,564.00	8.10
7	000568	泸州老窖	6,805,077.00	7.93
8	601336	新华保险	6,667,776.24	7.77
9	600690	海尔智家	6,633,531.68	7.73
10	300274	阳光电源	6,416,331.00	7.47
11	601919	中远海控	6,335,473.00	7.38
12	600176	中国巨石	6,292,298.58	7.33
13	600036	招商银行	6,209,583.00	7.23
14	002142	宁波银行	6,205,051.40	7.23
15	002001	新 和 成	5,771,470.82	6.72
16	600999	招商证券	5,486,924.00	6.39
17	601899	紫金矿业	5,467,324.00	6.37
18	000001	平安银行	5,459,912.00	6.36
19	300059	东方财富	5,456,075.00	6.35
20	600438	通威股份	5,406,136.00	6.30
21	002475	立讯精密	5,402,421.50	6.29
22	601689	拓普集团	5,386,007.00	6.27
23	002382	蓝帆医疗	5,380,031.51	6.27
24	603799	华友钴业	5,316,960.26	6.19
25	300676	华大基因	4,912,553.00	5.72
26	600926	杭州银行	4,715,757.00	5.49
27	300142	沃森生物	4,577,024.00	5.33
28	600309	万华化学	4,576,851.34	5.33
29	300146	汤臣倍健	4,519,180.00	5.26
30	300122	智飞生物	4,507,430.00	5.25
31	603259	药明康德	4,496,725.00	5.24
32	002557	洽洽食品	4,431,360.00	5.16
33	300750	宁德时代	4,425,931.00	5.15
34	000776	广发证券	4,423,116.00	5.15
35	002601	龙佰集团	4,422,404.00	5.15
36	002304	洋河股份	4,399,928.00	5.12
37	300115	长盈精密	4,321,336.75	5.03
38	000100	TCL 科技	4,281,611.00	4.99

39	002352	顺丰控股	4,231,929.00	4.93
40	603198	迎驾贡酒	4,224,116.00	4.92
41	600031	三一重工	4,220,428.00	4.92
42	000725	京东方 A	4,151,606.00	4.84
43	600660	福耀玻璃	4,119,604.00	4.80
44	300015	爱尔眼科	4,084,241.70	4.76
45	603288	海天味业	4,036,329.60	4.70
46	300347	泰格医药	4,020,130.00	4.68
47	300760	迈瑞医疗	3,987,763.00	4.64
48	300316	晶盛机电	3,986,668.00	4.64
49	601628	中国人寿	3,955,117.00	4.61
50	002460	赣锋锂业	3,856,098.00	4.49
51	300496	中科创达	3,854,884.00	4.49
52	601633	长城汽车	3,854,465.00	4.49
53	300408	三环集团	3,800,756.00	4.43
54	300144	宋城演艺	3,794,802.66	4.42
55	688036	传音控股	3,791,555.83	4.42
56	000786	北新建材	3,751,700.00	4.37
57	603369	今世缘	3,720,056.00	4.33
58	601012	隆基股份	3,642,231.01	4.24
59	600143	金发科技	3,551,764.00	4.14
60	002648	卫星石化	3,486,202.00	4.06
61	601577	长沙银行	3,453,189.00	4.02
62	002216	三全食品	3,451,727.87	4.02
63	002594	比亚迪	3,425,928.00	3.99
64	603501	韦尔股份	3,412,359.00	3.97
65	601939	建设银行	3,405,827.00	3.97
66	603993	洛阳钼业	3,333,160.00	3.88
67	300433	蓝思科技	3,324,686.70	3.87
68	603486	科沃斯	3,234,377.00	3.77
69	600276	恒瑞医药	3,199,308.00	3.73
70	300124	汇川技术	3,177,387.00	3.70
71	002812	恩捷股份	3,088,103.82	3.60
72	688169	石头科技	3,072,898.50	3.58
73	600362	江西铜业	3,066,344.00	3.57
74	002841	视源股份	3,057,321.00	3.56
75	600703	三安光电	3,053,638.00	3.56
76	002056	横店东磁	2,985,679.00	3.48
77	601997	贵阳银行	2,968,852.52	3.46
78	600887	伊利股份	2,959,544.00	3.45
79	000858	五粮液	2,909,699.00	3.39
80	300033	同花顺	2,882,214.00	3.36
81	601888	中国中免	2,876,660.00	3.35
82	002920	德赛西威	2,846,828.00	3.32

83	601009	南京银行	2,829,715.75	3.30
84	600019	宝钢股份	2,765,138.00	3.22
85	002541	鸿路钢构	2,747,218.00	3.20
86	000338	潍柴动力	2,736,169.00	3.19
87	601155	新城控股	2,726,987.02	3.18
88	600015	华夏银行	2,624,299.00	3.06
89	002027	分众传媒	2,601,456.48	3.03
90	002242	九阳股份	2,587,559.00	3.01
91	000157	中联重科	2,579,814.00	3.00
92	600760	中航沈飞	2,571,623.00	3.00
93	000703	恒逸石化	2,570,686.66	2.99
94	600089	特变电工	2,562,943.00	2.99
95	601100	恒立液压	2,557,646.00	2.98
96	000538	云南白药	2,546,500.00	2.97
97	002493	荣盛石化	2,541,263.00	2.96
98	600305	恒顺醋业	2,525,509.20	2.94
99	601607	上海医药	2,519,377.00	2.93
100	002010	传化智联	2,504,541.00	2.92
101	002028	思源电气	2,477,469.00	2.89
102	600782	新钢股份	2,410,386.00	2.81
103	601717	郑煤机	2,373,999.00	2.76
104	000975	银泰黄金	2,350,962.00	2.74
105	600196	复星医药	2,346,307.42	2.73
106	000661	长春高新	2,345,895.00	2.73
107	603939	益丰药房	2,344,073.00	2.73
108	601658	邮储银行	2,335,816.00	2.72
109	002415	海康威视	2,296,995.00	2.68
110	600383	金地集团	2,272,353.00	2.65
111	000932	华菱钢铁	2,268,499.00	2.64
112	000519	中兵红箭	2,266,373.00	2.64
113	002555	三七互娱	2,246,174.91	2.62
114	002050	三花智控	2,227,931.00	2.59
115	002607	中公教育	2,216,700.00	2.58
116	600845	宝信软件	2,214,275.00	2.58
117	002414	高德红外	2,201,912.66	2.56
118	601319	中国人保	2,197,333.00	2.56
119	600585	海螺水泥	2,193,832.00	2.56
120	300677	英科医疗	2,163,119.00	2.52
121	300783	三只松鼠	2,097,544.00	2.44
122	002230	科大讯飞	2,095,654.00	2.44
123	002444	巨星科技	2,093,894.00	2.44
124	600600	青岛啤酒	2,092,318.00	2.44
125	002271	东方雨虹	2,089,701.50	2.43
126	603267	鸿远电子	2,088,797.00	2.43

1	国家债券	8,100,000.00	3.24
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	8,100,000.00	3.24

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019640	20 国债 10	81,000.00	8,100,000.00	3.24

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

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

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

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量	合约市值	公允价值变动	风险说明
IC2109	IC2109	1.00	1,333,400.00	4,320.00	本报告期内，本基金继续使用

					量化模型精选个股, 辅以量化行业轮动及事件驱动策略, 力争获取超额业绩比较基准的投资回报, 买入股指期货合约的目的是为了进行套期保值, 力争获取正向超额收益。
公允价值变动总额合计					4,320.00
股指期货投资本期收益					-214,720.78
股指期货投资本期公允价值变动					-157,560.00

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金的股指期货投资将严格遵守证监会及相关法律法规的约束, 按照风险管理的原则, 以套期保值为主要目的, 主要采用流动性好、交易活跃的期货合约, 通过对现货和期货市场运行趋势的研究, 合理确定股指期货投资工具的比例, 在充分评估股指期货风险和收益的基础上, 谨慎地进行投资, 力争获得稳定的正向超额收益。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

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

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

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 本报告期投资基金情况

7.12.1 投资政策及风险说明

本基金未投资基金。

7.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

本基金未投资基金。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的投资决策说明

报告期内, 本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或在本报告编制日前一年

内受到公开谴责、处罚的情况。

7.13.2 基金投资前十名股票中投资于超出基金合同规定备选股票库之外的投资决策程序说明

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	314,570.86
2	应收证券清算款	273,967.31
3	应收股利	-
4	应收利息	168,349.24
5	应收申购款	2,396.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	759,283.81

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未持有流通受限的股票。

7.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的	持有人结构
----------	-------	-------

	基金份额	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
722	233,891.80	151,948,163.90	89.98%	16,921,715.36	10.02%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	0.00	0.00%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,900.09	5.92%	10,000,000.00	5.92%	3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,900.09	5.92%	10,000,000.00	5.92%	3 年

注：持有份额总数部分包含利息结转的份额。

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2018 年 2 月 1 日）基金份额总额	343,068,498.19
本报告期期初基金份额总额	58,437,321.58
本报告期基金总申购份额	199,422,929.43

减：本报告期基金总赎回份额	88,990,371.75
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	168,869,879.26

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无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

报告期内基金管理人发生以下重大人事变动：

自 2021 年 6 月 30 日起，席晓峰先生因个人原因辞职，不再担任公司副总经理职务。

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

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管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本报告期本基金未持有基金。

10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本告期为基金进行审计的会计师事务所未发生变更。

10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚；本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.8.1 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	
长江证券	2	950,756,789.86	59.84%	505,138.26	77.39%	-
华泰证券	2	638,182,943.77	40.16%	147,607.95	22.61%	-

注：1、我公司对基金交易单元的选择是综合考虑券商的研究能力及其它相关因素后决定的。

2、本报告期内本基金租用交易单元的变更情况：新增 2 个长江证券交易单元、减少 2 个华泰证

券交易单元、减少 2 个中信建投证券交易单元、减少 2 个天风证券交易单元、减少 2 个光大证券交易单元。

10.8.2 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		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
长江证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	8,160,898.41	100.00%	-	-	-	-

10.9 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	关于公司旗下华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金开展赎回费率优惠活动的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、证券日报等	2021-01-14
2	华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、证券日报等	2021-01-22
3	关于公司旗下华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金暂停大额申购限额的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、证券日报等	2021-02-08
4	关于公司旗下华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金在华泰期货有限公司开展申购及定投手续费优惠活动的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、证券日报等	2021-03-03
5	关于公司旗下华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金调整大额申购(含定期定额申购)的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、证券日报等	2021-03-09
6	华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金 2020 年年度报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、证券日报等	2021-03-31
7	华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、证券日报等	2021-04-21
8	华泰证券(上海)资产管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、	2021-06-30

	证券日报等	
--	-------	--

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2021-1-29 至 2021-6-30	0.00	64,703,332.25	0.00	64,703,332.25	38.32%
	2	2021-1-28 至 2021-6-30	0.00	63,129,789.32	4,195,000.00	58,934,789.32	34.90%
	3	2021-1-8 至 2021-1-24	10,000,900.09	0.00	0.00	10,000,900.09	5.92%
	4	2021-1-25 至 2021-1-28	0.00	30,995,598.54	20,000,000.00	10,995,598.54	6.51%
产品特有风险							
<p>1、本基金单一机构投资者所持有的基金份额占比较大，单一机构投资者的大额赎回，可能会对本基金的资产运作及净值表现产生较大影响；</p> <p>2、大额赎回有可能导致基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；</p> <p>3、因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，大额赎回导致基金净值出现较大波动；</p> <p>4、单一投资者的大额赎回时容易造成本基金发生巨额赎回。在发生巨额赎回情形时，在符合基金合同约定情况下，如基金管理人认为有必要，可延期办理本基金的赎回申请，投资者可能面临赎回申请被延期办理的风险；如果连续2个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；</p> <p>5、发起式基金在成立三年后继续存续的，单一机构投资者赎回后，若本基金连续60个工作日基金份额持有人低于200人或基金资产净值低于5000万情形的，基金管理人应当向中国证监会提出解决方案，或按基金合同约定，转换运作方式或终止基金合同，其他投资者可能面临基金转换运作方式或终止基金合同的风险；</p> <p>6、大额赎回导致本基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；</p> <p>7、大额赎回导致基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略。</p>							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、本基金管理人于 2021 年 3 月 9 日在本基金管理人官网及监管规定渠道发布《关于公司旗下华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金调整大额申购（含定期定额申购）的公告》，根据法律

法规和基金合同的相关规定,本基金管理人决定自 2021 年 3 月 9 日起单日每个基金账户累计申购(含定期定额申购业务)华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金的合计金额不得超过人民币 500 万元。若超过 500 万元,本基金管理人有权部分或全部拒绝该笔申购申请。具体见相关公告。

2、本基金管理人根据监管规定要求于 2021 年 6 月 30 日在本基金管理人官网及监管规定渠道发布了《华泰证券(上海)资产管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》,自 2021 年 6 月 30 日起,席晓峰先生因个人原因辞职,不再担任公司副总经理职务。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予本基金募集注册的文件;
- 2、《华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金基金合同》;
- 3、《华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金托管协议》;
- 4、《华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金招募说明书》;
- 5、报告期内披露的各项公告;
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照;
- 7、中国证监会规定的其他备查文件。

12.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人、基金托管人的办公场所。

12.3 查阅方式

部分备查文件可通过本基金管理人公司网站查询,也可咨询本基金管理人。客服电话(4008895597);公司网址:<https://htamc.htsc.com.cn/>。

华泰证券(上海)资产管理有限公司

二〇二一年八月三十一日