

华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

送出日期：2022 年 3 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 3 月 30 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。

本年度报告财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2021 年 9 月 14 日（基金合同生效日）起至 2021 年 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9 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	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	17
§ 6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
§ 7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	21
7.4 报表附注	22
§ 8 投资组合报告	49

8.1 期末基金资产组合情况	49
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	49
8.3 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	50
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	52
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	54
8.6 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
8.7 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
8.8 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
8.9 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
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	54
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55
8.12 投资组合报告附注	55
§ 9 基金份额持有人信息	56
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	56
9.3 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情况	56
§ 10 开放式基金份额变动	57
§ 11 重大事件揭示	57
11.1 基金份额持有人大会决议	57
11.2 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	57
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	57
11.4 基金投资策略的改变	57
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	57
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	58
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	58
11.8 其他重大事件	59
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	60
12.1 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	60
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	60
§ 13 备查文件目录	60
13.1 备查文件目录	60
13.2 存放地点	61
13.3 查阅方式	61

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金	
基金简称	华泰柏瑞恒利混合	
基金主代码	012953	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 9 月 14 日	
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	918,856,368.72 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华泰柏瑞恒利混合 A	华泰柏瑞恒利混合 C
下属分级基金的交易代码	012953	012954
报告期末下属分级基金的份额总额	786,934,530.55 份	131,921,838.17 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的前提下，通过积极灵活合理配置，追求超越业绩比较基准的投资回报力争金产持续稳健增值。
投资策略	1、大类资产配置本基金将通过研究宏观经济、国家政策等可能影响证券市场的重要因素，对股票、债券和货币资产的风险收益特征进行深入分析，合理预测各类资产的价格变动趋势，确定不同资产类别的投资比例。在此基础上，积极跟踪由于市场短期波动引起的各类资产的价格偏差和风险收益特征的相对变化，动态调整各大类资产之间的投资比例，在保持总体风险水平相对平稳的基础上，获取相对较高的基金投资益。2、债券组合投资策略；3、股票投资策略；4、存托凭证投资策略；5、资产支持证券投资策略；6、股指期货投资策略；7、融资业务的投资策略。
业绩比较基准	上证国债指数收益率×80%+沪深 300 指数收益率×15%+中证港股通综合指数（人民币）收益率×5%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。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	兴业银行股份有限公司
信息披露 姓名	刘万方	林兴盛

负责人	联系电话	021-38601777	021-52629999-213707
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	linxingsheng@cib.com.cn
客户服务电话		400-888-0001	95561
传真		021-38601799	021-62159217
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	福州市湖东路 154 号
办公地址		上海市浦东新区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层	上海市银城路 167 号兴业大厦 4 楼
邮政编码		200135	200120
法定代表人		贾波	吕家进

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.huatai-pb.com
基金年度报告备置地点	上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2021 年 9 月 13 日(基金合同生效日)-2021 年 12 月 31 日	
	华泰柏瑞恒利混合 A	华泰柏瑞恒利混合 C
本期已实现收益	5,193,509.33	1,819,482.31
本期利润	8,849,604.23	2,676,196.74
加权平均基金份额本期利润	0.0147	0.0129
本期加权平均净值利润率	1.48%	1.30%
本期基金份额净值增长率	0.67%	0.61%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末	
期末可供分配利润	5,287,102.84	802,970.67

期末可供分配基金份额利润	0.0067	0.0061
期末基金资产净值	792,221,633.39	132,724,808.84
期末基金份额净值	1.0067	1.0061
3.1.3 累计期末指标	2021 年末	
基金份额累计净值增长率	0.67%	0.61%

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

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

3、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

4、本基金合同于 2021 年 9 月 14 日生效。

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

华泰柏瑞恒利混合 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
过去三个月	2.37%	0.19%	0.74%	0.16%	1.63%	0.03%
自基金合同生效起至今	0.67%	0.23%	0.24%	0.16%	0.43%	0.07%

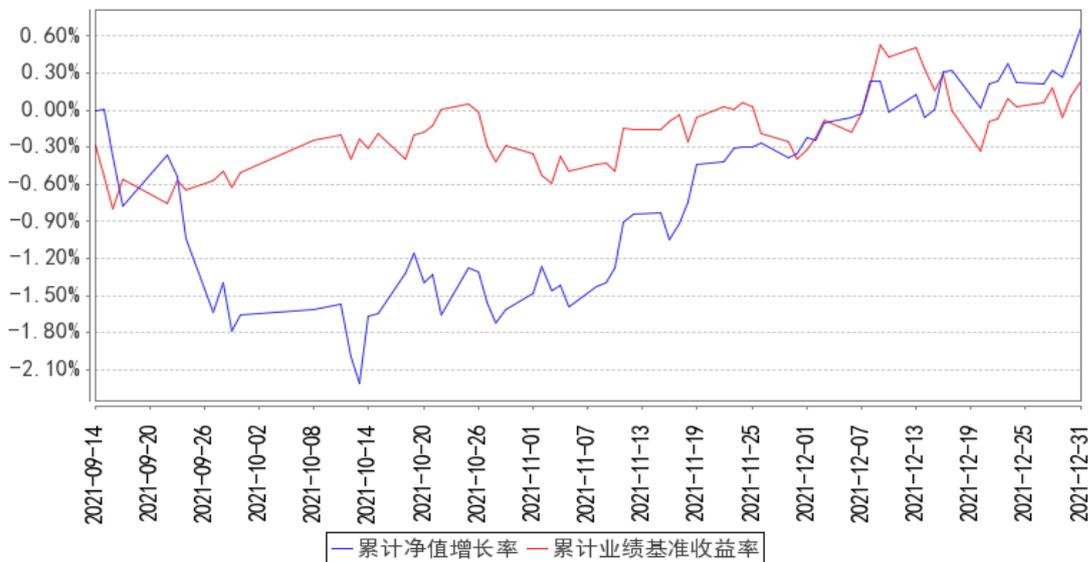
华泰柏瑞恒利混合 C

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
过去三个月	2.33%	0.19%	0.74%	0.16%	1.59%	0.03%

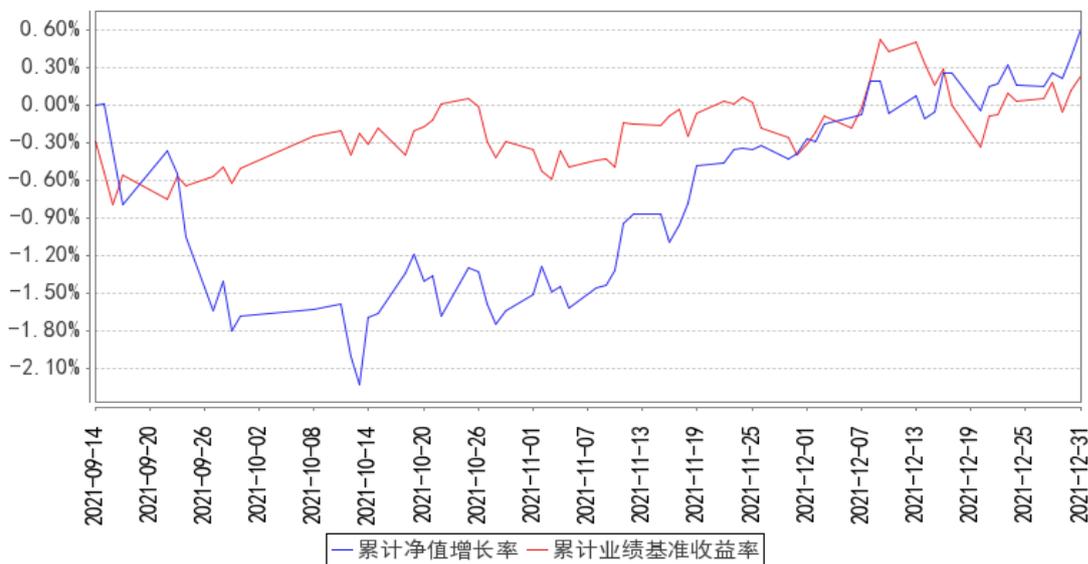
自基金合同生效起 至今	0.61%	0.23%	0.24%	0.16%	0.37%	0.07%
----------------	-------	-------	-------	-------	-------	-------

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

华泰柏瑞恒利混合A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



华泰柏瑞恒利混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



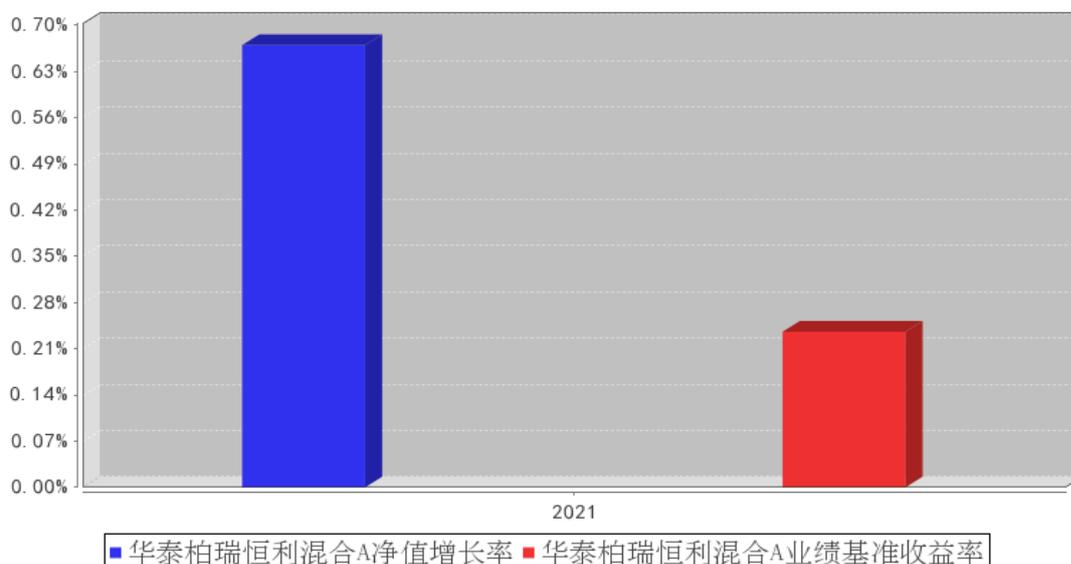
注：1、A 级和 C 级图示日期均为 2021 年 9 月 14 日至 2021 年 12 月 31 日。

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仍在建仓期。

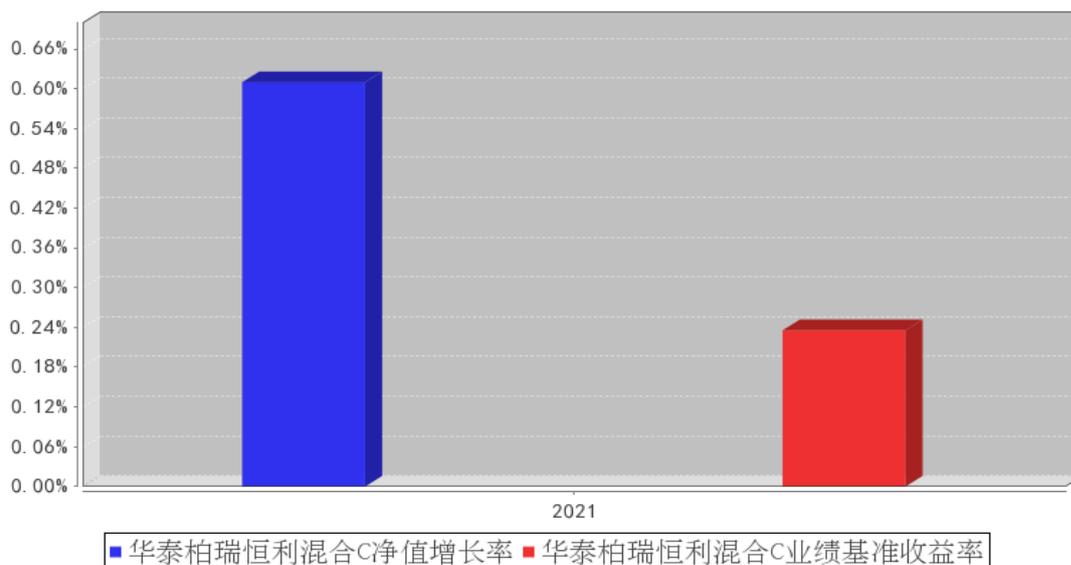
3、自基金合同生效起至本报告期末不满一年。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华泰柏瑞恒利混合A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



华泰柏瑞恒利混合C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金报告期末A级可供分配利润为5,287,102.84元，C级为802,970.67元。本基金2021年未实施过利润分配。

§ 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、华泰柏瑞质量精选混合型证券投资基金、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、华泰柏瑞港股通时代机遇混合型证券投资基金、华泰柏瑞南方东英恒生科技指数交易型开放式指数证券投资基金、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、华泰柏瑞中证沪港深创新药产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞远见智选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金、华泰柏瑞景气成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞创业板科技交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、华泰柏瑞锦元债券型证券投资基金、华泰柏瑞上证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞中证沪港深品牌消费 50 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 增强策略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发起式联接基金。截至 2021 年 12 月 31 日，公司基金管理规模为 2443.87 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		
董辰	本基金的基金经理	2021 年 9 月 14 日	-	8 年	上海理工大学金融学硕士，曾任长江证券首席分析师，2016 年 6 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任投资研究部高级研究员、研究总监助理兼基金经理助理。2020 年 7 月起任华泰柏瑞富利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 8 月起任华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 12 月起任华泰柏瑞多策略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的基金经理。2021 年 6 月起任华泰柏瑞景气优选混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月起任华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金的基金经理。
何子建	固定收益部副总监、本基金的基金经理	2021 年 9 月 14 日	-	7 年	工商管理硕士，经济学学士。2014 年 5 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任固定收益部助理研究员、基金经理助理。2019 年 3 月起任华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金的基金经理。2020 年 1 月起任华泰柏瑞锦兴 39 个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2020 年 10 月起任华泰柏瑞锦泰一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2021 年 1 月起任华泰柏瑞锦瑞债券型证券投资基金、华泰柏瑞景利混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月起任华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金的基金经理。

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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 公平交易制度和控制方法

报告期内，本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求，建立了科学完善的公平交易管理制度，从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能发生的利益输送。投资部和研究部通过规范的决策流程公平对待不同投资组合。交易部对投资指令的合规性、有效性及合理性进行独立审核，对于场内交易的非组合指令启用投资管理系统中的公平交易模块；对于场外交易按照时间优先价格优先的原则公平对待不同帐户。风险管理部对报告期内的交易进行日常监控和分析评估，同时对投资组合的交易价差在不同时间窗（如日内、3日、5日）下进行分析，综合判断各基金之间是否存在不公平交易或利益输送的可能，确保公平交易的实施。

4.3.2 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。

4.3.3 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。

本报告期内，本基金与公司所管理的其他投资组合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% 的同日反向交易共 1 次，系与公司建仓产品发生反向交易，不存在利益输送行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年，债市收益率震荡下行。中美经济体现出互补以及分化的特征。互补上，美国商品消费需求旺盛，中国加大了制造业生产力度进而带动出口。美国消费，中国生产。分化上，美国的

货币超发幅度较大，叠加美国消费需求旺盛，刺激通胀创数十年新高。中国工业生产旺盛，上游供给减少，加剧供需矛盾，PPI 高涨，但消费比较低迷，CPI 处于偏低水平。中美 CPI 的分化导致中美国债利率走势也出现分化，美国利率上升，中国利率下降，中美利差收缩。四季度，出口持续保持高增长，对制造业投资形成了较好拉动；但由于下游需求大幅走弱，企业库存预期较差，“被动补库”转向“主动去库”成为压制。另外，“三条红线”背景下，恒大债务风波触发监管政策严控预售款，房企财务流动性冲击走向负反馈；地产施工显著下滑，进一步扩大房企财务压力。12 月份召开的中央经济工作会议强调，“坚持高质量发展，坚持以经济建设为中心”，这标志着 2022 年各项政策将协同发展，支持经济增长。消极的财政政策与产业政策可能在 2022 年出现边际的改善，与货币政策一起向稳定经济的方向回归，形成对经济共同的支撑力量。市场表现上看，收益率震荡下行。基本面对债券市场仍然有利。

2021 年市场震荡向上，以结构性行情为主，新能源、周期、军工等板块表现亮眼。

国内宏观经济在新冠疫情的影响下表现疲弱，消费、地产、基建不振，出口尚可。随着 12 月中央经济工作会议政策重心转向稳增长，后续宏观经济有望企稳回升，受冬季开工条件限制以及国内疫情反复的影响，政策发力可能没那么快产生效果，2022 年春季开工旺季是值得期待的时间窗口。稳增长相关的股票在未来一两个季度可能有一些投资机会。

受益于稳增长政策的落地，工业品的需求也可以期待，部分工业品库存处于低位，开工旺季可能有不错的价格表现。受益于全球通胀，贵金属也是值得关注的方向。

全球疫情发展出现一些转机，虽然新增病例较多，但致死率下降明显，如果后续没有意外变异，在疫苗接种范围扩大和特效药相继面世的作用下，新冠疫情有望朝着“低毒化”方向发展，最终实现全球社会经济活动的正常化。因此，疫情受损类如航空酒店旅游存在一些修复机会。

风险方面，随着美国经济复苏以及通胀加剧，美联储缩表和加息的预期不断加强，可能对接下来全球货币流动性产生一些不利影响，进而对金融资产价格带来一定压力；另一方面，国内地产数据仍不乐观，虽然一些融资端的政策相继出台，但需求端放松的政策寥寥无几，房地产的信用风险仍未完全解除，是值得重视的风险因素。

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恒利混合 A 的基金份额净值为 1.0067 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.67%，同期业绩比较基准收益率为 0.24%，截至本报告期末华泰柏瑞恒利混合 C 的基金份额净值为 1.0061 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.61%，同期业绩比较基准收益率为 0.24%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

货币政策保持相对宽松，但由于财政支出力度加大，市场短期缺乏继续下行的催化因素，在

此背景下收益率或处震荡局面。

策略上，维持适当的久期与适中的杠杆水平，有效规避信用风险，同时把握时机博取资本利得。

整体上，在货币政策保持流动性合理充裕的情况下，我认为 A 股市场趋势性下跌的风险较小，后续仍以结构行情为主。本基金将继续在公司质量、景气度和成长空间三个维度精选个股，尽力控制回撤，争取获取超额收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2021 年度，本基金管理人在为基金份额持有人谋求最大利益的同时，始终将合规运作、防范风险工作放在各项工作的首位。依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。公司监察部门按照规定的权限和程序，通过实时监控、现场检查、重点抽查和人员询问等方法，独立地开展基金运作和公司管理的合规性稽核，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向董事长和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

(1) 全面开展基金运作合规监察工作，确保基金投资的独立性、公平性及合法合规

主要措施有：严格执行集中交易制度，各基金相互独立，交易指令由中央交易室统一执行完成；对基金投资交易系统进行事先合规性设置，并由风险控制部门进行实时监控，杜绝出现违规行为；严格检查基金的投资决策、研究支持、交易过程是否符合规定的程序；通过以上措施，保证了投资运作遵循投资决策程序与业务流程，保证了基金投资组合符合相关法规及基金合同规定，确保了基金投资行为的独立、公平及合法合规。

(2) 开展定期和专项监察稽核工作，确保各项业务活动的合法合规

本年度公司监察稽核部门开展了对公司基金投资、研究、销售、后台运营、反洗钱等方面的专项监察稽核活动。对稽核中发现问题及时发出合规提示函，要求相关部门限期整改，并对改进情况安排后续跟踪检查，确保各项业务开展合法合规。

(3) 促进公司各项内部管理制度的完善

按照相关法规、证监会等监管机关的相关规定和公司业务的发展的要求，公司法律监察部门及时要求各部门制订或修改相应制度，促进公司各项内部管理制度的进一步完善。

(4) 通过各种合规培训提高员工合规意识

本年度公司监察稽核部门通过对公司所有新入职员工进行入职前合规培训、对全体人员开展行为规范培训、对基金投资管理人员进行专项合规培训、对员工进行反洗钱培训等，有效提高了公司

员工的合规意识。

通过以上工作的开展，在本报告期内本基金运作过程中未发生违规情形，基金运作整体合法合规。在今后的工作中，本基金管理人承诺将一如既往的本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，为基金持有人谋求最大利益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

2、基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

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

4、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

本基金本报告期内未进行利润分配。

4.9 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

注：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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2022)第 28215 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金(以下简称“华泰柏瑞恒利混合基金”)的财务报表,包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表,2021 年 9 月 14 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了华泰柏瑞恒利混合基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年 9 月 14 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于华泰柏瑞恒利混合基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>

<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>华泰柏瑞恒利混合基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估华泰柏瑞恒利混合基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算华泰柏瑞恒利混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督华泰柏瑞恒利混合基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能对华泰柏瑞恒利混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致华泰柏瑞恒利混合基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容,并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>

会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	张炯	朱宏宇
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼	
审计报告日期	2022 年 3 月 30 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	7.4.7.1	4,723,299.06
结算备付金		719,334.91
存出保证金		103,292.39
交易性金融资产	7.4.7.2	1,021,600,311.63
其中：股票投资		177,386,311.63
基金投资		-
债券投资		844,214,000.00
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	119,000,392.50
应收证券清算款		1,044,174.04
应收利息	7.4.7.5	8,815,978.60
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		1,156,006,783.13
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		219,999,070.00

应付证券清算款		-
应付赎回款		10,038,903.42
应付管理人报酬		440,839.16
应付托管费		73,473.18
应付销售服务费		27,952.63
应付交易费用	7.4.7.7	268,317.81
应交税费		6,430.08
应付利息		105,354.62
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	100,000.00
负债合计		231,060,340.90
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	918,856,368.72
未分配利润	7.4.7.10	6,090,073.51
所有者权益合计		924,946,442.23
负债和所有者权益总计		1,156,006,783.13

注：1. 报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额总额 918,856,368.72 份，其中华泰柏瑞恒利混合 A 类基金份额净值 1.0067 元，份额总额 786,934,530.55 份；华泰柏瑞恒利混合 C 类基金份额净值 1.0061 元，份额总额 131,921,838.17 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2021 年 9 月 14 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间。

7.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 9 月 14 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 9 月 14 日（基金合同 生效日）至 2021 年 12 月 31 日
一、收入		14,781,322.95
1. 利息收入		5,867,377.94
其中：存款利息收入	7.4.7.11	59,068.19
债券利息收入		5,294,774.56
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		513,535.19
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		4,155,482.08
其中：股票投资收益	7.4.7.12	5,813,479.78

基金投资收益	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-1,693,761.70
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-
股利收益	7.4.7.16	35,764.00
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	4,512,809.33
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	245,653.60
减：二、费用		3,255,521.98
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,415,765.51
2. 托管费	7.4.10.2.2	235,960.91
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	121,169.76
4. 交易费用	7.4.7.19	737,755.14
5. 利息支出		638,782.66
其中：卖出回购金融资产支出		638,782.66
6. 税金及附加		1,694.56
7. 其他费用	7.4.7.20	104,393.44
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		11,525,800.97
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		11,525,800.97

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 9 月 14 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 9 月 14 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 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）	240,023,948.90	-	240,023,948.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	11,525,800.97	11,525,800.97
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）	678,832,419.82	-5,435,727.46	673,396,692.36
其中：1. 基金申购款	920,047,186.21	-4,946,990.55	915,100,195.66

2. 基金赎回款	-241,214,766.39	-488,736.91	-241,703,503.30
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）	918,856,368.72	6,090,073.51	924,946,442.23

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞恒利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[2021]2247号《关于准予华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金注册的批复》注册,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《华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币240,004,598.81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0910号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金基金合同》于2021年9月14日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为240,023,948.90份基金份额,其中认购资金利息折合19,350.09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,基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金基金合同》和《华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购基金份额时收取认购、申购费用而不从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为A类基金份额;在投资者认购、申购基金份额时不收取认购、申购费用,且从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为C类基金份额。本基金A类基金份额和C类基金份额分别设置基金代码。由于基金费用的不同,本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行或上市的股票（包含创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、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（包含国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、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。本基金的投资组合比例为：股票及存托凭证资产的投资比例占基金资产的 0%-30%；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%。本基金投资同业存单的比例不高于基金资产的 20%。本基金的业绩比较基准为上证国债指数收益率×80%+沪深 300 指数收益率×15%+中证港股通综合指数（人民币）收益率×5%。

本财务报表由本基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于 2022 年 3 月 30 日批准报出。

7.4.2 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》、《华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年 9 月 14 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日止期间的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 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年 9 月 14 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

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

年 9 月 14 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

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

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

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

(2) 金融负债的分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。

终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 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)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，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，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，即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。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 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。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

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

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于2017年颁布了修订后的《企业会计准则第14号—收入》，本基金在编制2021年9月14日(基金合同生效日)至2021年12月31日止期间的财务报表时已采用该准则，该准则的采用未对本基金财务报表产生重大影响。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

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

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末
	2021 年 12 月 31 日
活期存款	4,723,299.06
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	4,723,299.06

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2021 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	176,252,361.36	177,386,311.63	1,133,950.27	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	49,921,000.00	49,970,000.00	49,000.00
	银行间市场	790,914,140.94	794,244,000.00	3,329,859.06
	合计	840,835,140.94	844,214,000.00	3,378,859.06
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	1,017,087,502.30	1,021,600,311.63	4,512,809.33	

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：截至本报告期末，本基金未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 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 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-

银行间市场	119,000,392.50	-
合计	119,000,392.50	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：截至本报告期末，本基金未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日
应收活期存款利息	1,838.80
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	356.07
应收债券利息	8,807,310.15
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	6,422.43
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	51.15
合计	8,815,978.60

7.4.7.6 其他资产

注：截至本报告期末，本基金未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日
交易所市场应付交易费用	238,469.33
银行间市场应付交易费用	29,848.48
合计	268,317.81

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	100,000.00
合计	100,000.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

华泰柏瑞恒利混合 A

项目	本期 2021 年 9 月 13 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	170,011,448.81	170,011,448.81
本期申购	707,489,399.77	707,489,399.77
本期赎回（以“-”号填列）	-90,566,318.03	-90,566,318.03
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	786,934,530.55	786,934,530.55

华泰柏瑞恒利混合 C

项目	本期 2021 年 9 月 13 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	70,012,500.09	70,012,500.09
本期申购	212,557,786.44	212,557,786.44
本期赎回（以“-”号填列）	-150,648,448.36	-150,648,448.36
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	131,921,838.17	131,921,838.17

注：1. 申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

2. 本基金自 2021 年 9 月 6 日至 2021 年 9 月 9 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币 240,004,598.81 元，折合为 240,004,598.81 份基金份额（其中 A 类基金份额 170,001,098.81 份，C 类基金份额 70,003,500.00 份）。根据《华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币 19,350.09 元在本基金成立后，折合为 19,350.09 份基金份额（其中 A 类基金份额 10,350.00 份，C 类基金份额 9,000.09 份），划入基金份额持有人账户。

3. 根据《华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金基金合同》、《华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金招募说明书》及《华泰柏瑞恒利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》的相关规定，本基金于 2021 年 9 月 14 日（基金合同生效日）至 2021 年 9 月 16 日止期间暂不向投资人开放基金交易，申购业务、赎回业务、转换业务和定期定额投资业务自 2021 年 9 月 17 日起开始办理。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

华泰柏瑞恒利混合 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	5,193,509.33	3,656,094.90	8,849,604.23
本期基金份额交易产生的变动数	722,669.59	-4,285,170.98	-3,562,501.39
其中：基金申购款	1,350,663.12	-4,736,642.44	-3,385,979.32
基金赎回款	-627,993.53	451,471.46	-176,522.07
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,916,178.92	-629,076.08	5,287,102.84

华泰柏瑞恒利混合 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	1,819,482.31	856,714.43	2,676,196.74
本期基金份额交易产生的变动数	-910,440.29	-962,785.78	-1,873,226.07
其中：基金申购款	-53,299.89	-1,507,711.34	-1,561,011.23
基金赎回款	-857,140.40	544,925.56	-312,214.84
本期已分配利润	-	-	-
本期末	909,042.02	-106,071.35	802,970.67

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年9月14日（基金合同生效日）至2021年12月31日
活期存款利息收入	41,096.81
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	17,664.37
其他	307.01
合计	59,068.19

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 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9月14日（基金合同生效日）至2021年12月31日
卖出股票成交总额	273,594,198.12
减：卖出股票成本总额	267,780,718.34
买卖股票差价收入	5,813,479.78

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年9月14日（基金合同生效日）至2021年12月31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	-1,693,761.70
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	-1,693,761.70

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年9月14日（基金合同生效日）至2021年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,653,184,081.20
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,649,369,512.13
减：应收利息总额	5,508,330.77
买卖债券差价收入	-1,693,761.70

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券申购差价收入

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资赎回差价收入。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资申购差价收入。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内无买卖权证差价收入。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期末无衍生工具其他投资收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年9月14日（基金合同生效日）至2021年12月31日
股票投资产生的股利收益	35,764.00
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	35,764.00

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021年9月14日（基金合同生效日）至2021年12月31日
1. 交易性金融资产	4,512,809.33
股票投资	1,133,950.27
债券投资	3,378,859.06
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	4,512,809.33

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年9月14日（基金合同生效日）至2021年12月31日
基金赎回费收入	245,653.60

合计	245,653.60
----	------------

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 50% 归入基金资产。C 类基金份额的赎回费全额归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的不低于赎回费的 50% 归入转出基金的基金资产。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 9 月 14 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	721,005.14
银行间市场交易费用	16,750.00
合计	737,755.14

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 9 月 14 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
审计费用	60,000.00
信息披露费	40,000.00
证券出借违约金	-
银行划款手续费	4,393.44
合计	104,393.44

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华泰柏瑞基金管理有限公司（“华泰柏瑞基金”）	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
兴业银行股份有限公司（“兴业银行”）	基金托管人
华泰证券股份有限公司（“华泰证券”）	基金管理人的股东
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
PineBridge Investment LLC	基金管理人的股东
苏州新区高新技术产业股份有限公司	基金管理人的股东

柏瑞爱建资产管理（上海）有限公司	基金管理人的控股子公司
------------------	-------------

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年9月14日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
华泰证券	288,169,382.90	40.74

7.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本期未发生与关联方进行的权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年9月14日（基金合同生效日）至2021年12月31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	262,610.99	74.78	175,699.58	73.68

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. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年9月14日（基金合同生效日）至2021年12月31日
	当期发生的基金应支付的管理费
其中：支付销售机构的客户维护费	27,891.56

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 0.60%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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.60\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 9 月 14 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	235,960.91

注：支付基金托管人兴业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10%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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.3 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 9 月 14 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰柏瑞恒利混合 A	华泰柏瑞恒利混合 C	合计
华泰柏瑞基金管理有限公司	0.00	104,506.70	104,506.70
合计	0.00	104,506.70	104,506.70

注：自 2021 年 9 月 15 日，支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给华泰柏瑞基金，再由华泰柏瑞基金计算并支付给各基金销售机构。A 类基金份额不收取销售服务费。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金份额的基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 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。

7.4.10.5.2 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：本报告期末，除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

7.4.10.6 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9月14日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
兴业银行	4,723,299.06	41,096.81

注：本基金的银行存款由基金托管人兴业银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.7 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9月14日（基金合同生效日）至2021年12月31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：张）	总金额
华泰联合证券	301155	海力风电	网下申购	7,900	479,214.00
华泰联合证券	688192	迪哲医药	网下申购	8,368	439,989.44
华泰联合证券	688151	华强科技	网下申购	11,259	395,078.31
华泰联合证券	688105	诺唯赞	网下申购	4,998	274,890.00
华泰联合证券	301179	泽宇智能	网下申购	2,941	129,374.59
华泰联合证券	688236	春立医疗	网下申购	4,052	120,790.12
华泰联合证券	001234	泰慕士	网下申购	333	5,504.49

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他需要说明的关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末(2021年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
001234	泰慕士	2021年12月31日	2022年1月11日	新股未上市	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
301096	百诚	2021年	2022年	新股锁	79.6	78.53	272	21,651.20	21,360.16	-

	医药	2021年12月13日	2022年6月20日	定期内						
301098	金埔园林	2021年11月4日	2022年5月12日	新股锁定期内	12.36	22.17	307	3,794.52	6,806.19	-
301099	雅创电子	2021年11月10日	2022年5月23日	新股锁定期内	21.99	71.36	351	7,718.49	25,047.36	-
301100	风光股份	2021年12月10日	2022年6月17日	新股锁定期内	27.81	31.14	599	16,658.19	18,652.86	-
301101	明月镜片	2021年12月9日	2022年6月16日	新股锁定期内	26.91	43.36	371	9,983.61	16,086.56	-
301108	洁雅股份	2021年11月25日	2022年6月6日	新股锁定期内	57.27	53.71	280	16,035.60	15,038.80	-
301111	粤万年青	2021年11月30日	2022年6月7日	新股锁定期内	10.48	36.68	379	3,971.92	13,901.72	-
301118	恒光股份	2021年11月9日	2022年5月18日	新股锁定期内	22.7	49.02	315	7,150.50	15,441.30	-
301126	达嘉维康	2021年11月30日	2022年6月7日	新股锁定期内	12.37	19.23	662	8,188.94	12,730.26	-
301133	金钟股份	2021年11月19日	2022年5月26日	新股锁定期内	14.33	26.95	286	4,098.38	7,707.70	-
301136	招标股份	2021年12月31日	2022年1月11日	新股未上市	10.52	10.52	7,172	75,449.44	75,449.44	-
301138	华研精机	2021年12月8日	2022年6月15日	新股锁定期内	26.17	44.86	285	7,458.45	12,785.10	-
301149	隆华新材	2021年11月3日	2022年5月10日	新股锁定期内	10.07	16.76	1,214	12,224.98	20,346.64	-
301155	海力风电	2021年11月17日	2022年5月24日	新股锁定期内	60.66	96.75	790	47,921.40	76,432.50	-
301166	优宁维	2021年12月21日	2022年6月28日	新股锁定期内	86.06	94.5	253	21,773.18	23,908.50	-

301168	通灵股份	2021年 12月2 日	2022年 6月10 日	新股锁 定期内	39.08	52.13	329	12,857.32	17,150.77	-
301177	迪阿股份	2021年 12月8 日	2022年 6月15 日	新股锁 定期内	116.88	116.08	436	50,959.68	50,610.88	-
301179	泽宇智能	2021年 12月1 日	2022年 6月8 日	新股锁 定期内	43.99	50.77	295	12,977.05	14,977.15	-
301180	万祥科技	2021年 11月9 日	2022年 5月16 日	新股锁 定期内	12.2	22.72	654	7,978.80	14,858.88	-
301182	凯旺科技	2021年 12月16 日	2022年 6月23 日	新股锁 定期内	27.12	30.58	294	7,973.28	8,990.52	-
301188	力诺特玻	2021年 11月4 日	2022年 5月11 日	新股锁 定期内	13	20.48	647	8,411.00	13,250.56	-
301189	奥尼电子	2021年 12月21 日	2022年 6月28 日	新股锁 定期内	66.18	56.62	435	28,788.30	24,629.70	-
301190	善水科技	2021年 12月17 日	2022年 6月24 日	新股锁 定期内	27.85	27.46	575	16,013.75	15,789.50	-
301198	喜悦智行	2021年 11月25 日	2022年 6月2 日	新股锁 定期内	21.76	29.2	262	5,701.12	7,650.40	-
301199	迈赫股份	2021年 11月30 日	2022年 6月7 日	新股锁 定期内	29.28	32	402	11,770.56	12,864.00	-
688082	盛美上海	2021年 11月10 日	2022年 5月18 日	新股锁 定期内	85	114.28	5,669	481,865.00	647,853.32	-
688105	诺唯赞	2021年 11月5 日	2022年 5月16 日	新股锁 定期内	55	93.29	4,998	274,890.00	466,263.42	-
688110	东芯股份	2021年 12月3 日	2022年 6月10 日	新股锁 定期内	30.18	40.37	11,704	353,226.72	472,490.48	-
688236	春立医疗	2021年 12月23 日	2022年 6月30 日	新股锁 定期内	29.81	26.43	4,052	120,790.12	107,094.36	-
688262	国芯科技	2021年 12月28 日	2022年 1月6 日	新股未 上市	41.98	41.98	7,129	299,275.42	299,275.42	-

		日	日							
--	--	---	---	--	--	--	--	--	--	--

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

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

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

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：截至本报告期末，本基金未持有流通受限的证券。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 219,999,070.00 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
2120116	21 南京银行 01	2022 年 1 月 4 日	100.31	500,000	50,155,000.00
2128035	21 华夏银行 02	2022 年 1 月 4 日	100.61	171,000	17,204,310.00
2128041	21 广发银行小微债	2022 年 1 月 4 日	100.60	500,000	50,300,000.00
160417	16 农发 17	2022 年 1 月 5 日	101.33	300,000	30,399,000.00
180204	18 国开 04	2022 年 1 月 5 日	102.76	227,000	23,326,520.00
200202	20 国开 02	2022 年 1 月 5 日	99.35	300,000	29,805,000.00
200303	20 进出 03	2022 年 1 月 5 日	99.71	339,000	33,801,690.00
合计				2,337,000	234,991,520.00

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：截至本报告期末本基金未持有交易所市场债券正回购。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：截至本报告期末本基金未参与转融通证券出借业务。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人兴业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行

的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年12月31日
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	80,054,000.00
合计	80,054,000.00

注：未评级的债券包括短期融资券、国债、政策性金融债。债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

7.4.13.2.4 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12月31日
AAA	322,055,000.00
AAA 以下	-
未评级	442,105,000.00
合计	764,160,000.00

注：未评级的债券包括政策性金融债。债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

7.4.13.3 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。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。

于 2021 年 12 月 31 日，除卖出回购金融资产款余额中有 219,999,070.00 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他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，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。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 12 月 31 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 0.27%。

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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来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。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有银行存款、结算备付金、存出保证金和买入返售金融资产等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	4,723,299.06	-	-	-	-	-	-4,723,299.06
结算备付金	719,334.91	-	-	-	-	-	719,334.91
存出保证金	103,292.3	-	-	-	-	-	103,292.39

	9						
交易性金融资产			80,054,000.00	734,064,000.00	30,096,000.00	177,386,311.63	1,021,600,311.63
买入返售金融资产	119,000,392.50						119,000,392.50
应收利息						8,815,978.60	8,815,978.60
应收证券清算款						1,044,174.04	1,044,174.04
资产总计	124,546,318.86		80,054,000.00	734,064,000.00	30,096,000.00	187,246,464.27	1,156,006,783.13
负债							
应付赎回款						10,038,903.42	10,038,903.42
应付管理人报酬						-440,839.16	440,839.16
应付托管费						73,473.18	73,473.18
卖出回购金融资产款	219,999,070.00						219,999,070.00
应付销售服务费						27,952.63	27,952.63
应付交易费用						-268,317.81	268,317.81
应付利息						-105,354.62	105,354.62
应交税费						6,430.08	6,430.08
其他负债						-100,000.00	100,000.00
负债总计	219,999,070.00					11,061,270.90	231,060,340.90
利率敏感度缺口	-95,452,751.14		80,054,000.00	734,064,000.00	30,096,000.00	176,185,193.37	924,946,442.23

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
	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12月31日）
分析	市场利率下降25个基点	5,035,963.18
	市场利率上升25个基点	-4,978,382.97

	基点	
--	----	--

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 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占基金资产的比例 0%-30%；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%。本基金投资同业存单的比例不高于基金资产的 20%。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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 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	177,386,311.63	19.18
交易性金融资产—基金投资	—	—
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	177,386,311.63	19.18
----	----------------	-------

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为 19.18%，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.14 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 12 月 31 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 174,845,362.69 元，属于第二层次的余额为 846,754,948.94 元，无属于第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，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，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据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，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(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) 根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关衔接规定,以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》,公募基金证券投资基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。截至 2021 年 12 月 31 日,本基金已完成了执行新金融工具准则对财务报表潜在影响的评估。鉴于本基金业务的性质,新金融工具准则预期不会对本基金的财务状况和经营成果产生重大影响。

本基金将自 2022 年 1 月 1 日起追溯执行相关新规定,并采用准则允许的实务简便方法,调整期初所有者权益,2021 年的比较数据将不作重述。

(3)除公允价值和执行新金融工具准则外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	177,386,311.63	15.34
	其中:股票	177,386,311.63	15.34
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	844,214,000.00	73.03
	其中:债券	844,214,000.00	73.03
	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	119,000,392.50	10.29
	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	5,442,633.97	0.47
8	其他各项资产	9,963,445.03	0.86
9	合计	1,156,006,783.13	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	64,571,776.80	6.98

C	制造业	55,368,660.53	5.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	2,874,539.99	0.31
F	批发和零售业	153,395.02	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	17,077,424.00	1.85
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	314,252.57	0.03
J	金融业	21,686,179.03	2.34
K	房地产业	14,456,488.00	1.56
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	854,078.02	0.09
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	29,517.67	0.00
S	综合	-	-
	合计	177,386,311.63	19.18

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票。

8.3 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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000975	银泰黄金	2,504,980	21,993,724.40	2.38
2	600547	山东黄金	786,260	14,797,413.20	1.60
3	600048	保利发展	583,900	9,126,357.00	0.99
4	603916	苏博特	286,228	7,373,233.28	0.80
5	600150	中国船舶	294,163	7,292,300.77	0.79
6	601872	招商轮船	1,696,420	6,955,322.00	0.75
7	601899	紫金矿业	709,746	6,884,536.20	0.74
8	600030	中信证券	253,400	6,692,294.00	0.72
9	002353	杰瑞股份	152,200	6,088,000.00	0.66
10	601111	中国国航	566,400	5,171,232.00	0.56
11	600029	南方航空	727,000	4,950,870.00	0.54
12	600489	中金黄金	575,900	4,739,657.00	0.51
13	000776	广发证券	169,717	4,173,341.03	0.45
14	603035	常熟汽饰	228,000	4,040,160.00	0.44
15	601878	浙商证券	304,400	4,011,992.00	0.43

16	600958	东方证券	270,800	3,991,592.00	0.43
17	603979	金诚信	167,400	3,595,752.00	0.39
18	600348	华阳股份	294,700	3,492,195.00	0.38
19	000932	华菱钢铁	621,439	3,175,553.29	0.34
20	001979	招商蛇口	229,900	3,066,866.00	0.33
21	601666	平煤股份	361,000	3,021,570.00	0.33
22	601857	中国石油	613,500	3,012,285.00	0.33
23	000921	海信家电	188,500	2,855,775.00	0.31
24	000630	铜陵有色	780,000	2,714,400.00	0.29
25	002318	久立特材	150,300	2,687,364.00	0.29
26	000922	佳电股份	187,200	2,285,712.00	0.25
27	601222	林洋能源	186,600	2,263,458.00	0.24
28	600383	金地集团	174,500	2,263,265.00	0.24
29	601211	国泰君安	121,600	2,175,424.00	0.24
30	002960	青鸟消防	39,000	1,893,450.00	0.20
31	000928	中钢国际	201,400	1,873,020.00	0.20
32	300007	汉威科技	57,000	1,722,540.00	0.19
33	601168	西部矿业	113,900	1,550,179.00	0.17
34	601952	苏垦农发	128,405	1,529,303.55	0.17
35	000983	山西焦煤	179,500	1,484,465.00	0.16
36	600282	南钢股份	310,900	1,150,330.00	0.12
37	688377	迪威尔	59,556	1,108,337.16	0.12
38	603279	景津装备	23,700	1,099,206.00	0.12
39	002438	江苏神通	51,100	1,048,061.00	0.11
40	601117	中国化学	82,500	990,000.00	0.11
41	002859	洁美科技	21,500	799,800.00	0.09
42	600801	华新水泥	39,100	754,630.00	0.08
43	688082	盛美上海	5,669	647,853.32	0.07
44	000166	申万宏源	125,300	641,536.00	0.07
45	600519	贵州茅台	300	615,000.00	0.07
46	688110	东芯股份	11,704	472,490.48	0.05
47	688105	诺唯赞	4,998	466,263.42	0.05
48	002531	天顺风能	22,400	434,336.00	0.05
49	688257	新锐股份	5,280	349,536.00	0.04
50	688262	国芯科技	7,129	299,275.42	0.03
51	300384	三联虹普	12,100	291,005.00	0.03
52	300765	新诺威	12,800	196,352.00	0.02
53	301168	通灵股份	3,281	194,447.89	0.02
54	301108	洁雅股份	2,800	166,667.20	0.02
55	688236	春立医疗	4,052	107,094.36	0.01
56	301155	海力风电	790	76,432.50	0.01
57	301136	招标股份	7,172	75,449.44	0.01

58	301177	迪阿股份	436	50,610.88	0.01
59	603071	物产环能	1,627	41,098.02	0.00
60	603230	内蒙新华	1,141	29,517.67	0.00
61	301099	雅创电子	351	25,047.36	0.00
62	301189	奥尼电子	435	24,629.70	0.00
63	301166	优宁维	253	23,908.50	0.00
64	301096	百诚医药	272	21,360.16	0.00
65	301149	隆华新材	1,214	20,346.64	0.00
66	301100	风光股份	599	18,652.86	0.00
67	001296	长江材料	310	18,376.80	0.00
68	301101	明月镜片	371	16,086.56	0.00
69	301190	善水科技	575	15,789.50	0.00
70	301118	恒光股份	315	15,441.30	0.00
71	301179	泽宇智能	295	14,977.15	0.00
72	301180	万祥科技	654	14,858.88	0.00
73	301111	粤万年青	379	13,901.72	0.00
74	301188	力诺特玻	647	13,250.56	0.00
75	301199	迈赫股份	402	12,864.00	0.00
76	301138	华研精机	285	12,785.10	0.00
77	301126	达嘉维康	662	12,730.26	0.00
78	301182	凯旺科技	294	8,990.52	0.00
79	301133	金钟股份	286	7,707.70	0.00
80	301198	喜悦智行	262	7,650.40	0.00
81	301098	金埔园林	307	6,806.19	0.00
82	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
83	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	000975	银泰黄金	22,809,612.40	2.47
2	600547	山东黄金	18,581,230.31	2.01
3	002353	杰瑞股份	14,703,403.00	1.59
4	601899	紫金矿业	14,577,458.66	1.58
5	600048	保利发展	13,843,815.00	1.50
6	600489	中金黄金	13,775,503.00	1.49
7	601666	平煤股份	11,988,067.00	1.30
8	600150	中国船舶	10,138,392.80	1.10
9	601872	招商轮船	8,424,611.00	0.91
10	000630	铜陵有色	8,226,121.00	0.89
11	603916	苏博特	7,866,127.11	0.85

12	002531	天顺风能	7,832,366.80	0.85
13	002013	中航机电	7,729,896.00	0.84
14	002028	思源电气	7,697,775.60	0.83
15	601222	林洋能源	7,630,981.24	0.83
16	601857	中国石油	7,601,660.00	0.82
17	002003	伟星股份	7,318,937.21	0.79
18	600030	中信证券	6,499,974.00	0.70
19	600023	浙能电力	6,086,450.00	0.66
20	600406	国电南瑞	6,006,031.20	0.65

注：不考虑相关交易费用。

8.4.2 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	002028	思源电气	9,289,742.00	1.00
2	002013	中航机电	9,057,230.00	0.98
3	601666	平煤股份	8,979,483.83	0.97
4	002531	天顺风能	8,774,854.00	0.95
5	002003	伟星股份	7,985,479.29	0.86
6	600489	中金黄金	7,973,418.00	0.86
7	600406	国电南瑞	6,804,031.10	0.74
8	002353	杰瑞股份	6,581,976.00	0.71
9	601899	紫金矿业	6,339,902.00	0.69
10	688663	新风光	6,278,719.66	0.68
11	600048	保利发展	6,218,191.00	0.67
12	600023	浙能电力	6,126,740.00	0.66
13	002179	中航光电	5,769,090.00	0.62
14	000959	首钢股份	5,562,250.00	0.60
15	601890	亚星锚链	5,106,852.12	0.55
16	000630	铜陵有色	4,875,162.00	0.53
17	601222	林洋能源	4,871,089.95	0.53
18	000960	锡业股份	4,220,936.00	0.46
19	601857	中国石油	3,930,378.00	0.42
20	000778	新兴铸管	3,930,376.64	0.42

注：不考虑相关交易费用。

8.4.3 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	444,033,079.70
卖出股票收入（成交）总额	273,594,198.12

注：不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	19,970,000.00	2.16
2	央行票据	-	-
3	金融债券	663,025,000.00	71.68
	其中：政策性金融债	472,105,000.00	51.04
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	30,084,000.00	3.25
6	中期票据	30,330,000.00	3.28
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	100,805,000.00	10.90
10	合计	844,214,000.00	91.27

8.6 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	092118002	21 农发清发 02	1,100,000	110,803,000.00	11.98
2	2128036	21 平安银行二级	500,000	50,670,000.00	5.48
3	2128035	21 华夏银行 02	500,000	50,305,000.00	5.44
4	2128041	21 广发银行小微债	500,000	50,300,000.00	5.44
5	210218	21 国开 18	500,000	50,230,000.00	5.43

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

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

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的。

8.12.3 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	103,292.39
2	应收证券清算款	1,044,174.04
3	应收股利	-
4	应收利息	8,815,978.60
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,963,445.03

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：截至本报告期末，本基金前十名股票中不存在流通受限的情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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 (%)
华泰柏瑞恒利混合 A	45	17,487,434.01	786,903,824.43	100.00	30,706.12	0.00
华泰柏瑞恒利混合 C	227	581,153.47	130,930,210.30	99.25	991,627.87	0.75
合计	270	3,403,171.74	917,834,034.73	99.89	1,022,333.99	0.11

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）。

9.2 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	华泰柏瑞恒利混合 A	0.00	0.0000
	华泰柏瑞恒利混合 C	0.00	0.0000
	合计	0.00	0.0000

9.3 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、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	华泰柏瑞恒利混合 A	0
	华泰柏瑞恒利混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	华泰柏瑞恒利混合 A	0
	华泰柏瑞恒利混合 C	0
	合计	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华泰柏瑞恒利混合 A	华泰柏瑞恒利混合 C
基金合同生效日 (2021 年 9 月 14 日) 基金份额总额	170,011,448.81	70,012,500.09
基金合同生效日起至 报告期期末基金总申 购份额	707,489,399.77	212,557,786.44
减：基金合同生效日 起至报告期期末基金 总赎回份额	90,566,318.03	150,648,448.36
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	786,934,530.55	131,921,838.17

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2021 年 5 月 19 日，经公司董事会批准陈晖女士不再担任公司督察长，刘万方先生担任公司督察长并不再担任公司副总经理。

2021 年 12 月 9 日，经公司董事会批准满黎先生担任公司副总经理。

上述人事变动已按相关规定备案、公告。

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

无。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期基金应支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)的报酬为 60,000.00 元人

民币，该事务所已向本基金提供了 1 年的审计服务。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
安信证券	1	419,226,748.82	59.26%	88,578.85	25.22%	-
华泰证券	2	288,169,382.90	40.74%	262,610.99	74.78%	-

注：1、选择代理证券买卖的证券经营机构的标准：

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

- 1) 具有相应的业务经营资格；
- 2) 诚信记录良好，最近两年无重大违法违规行为，未受监管机构重大处罚；
- 3) 资金雄厚，信誉良好。内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求。

4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服务。

5) 具备研究实力，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、股票分析的研究报告及周到的信息服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告。

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

11.7.2 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	成交金额	占当期债券回	成交金额	占当期权证

		成交总额的 比例		购成交总额的 比例		成交总额的 比例
安信证券	547,507,909.40	94.81%	1,640,000,000.00	100.00%	-	-
华泰证券	29,967,000.00	5.19%	-	-	-	-

11.8 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12月24日
2	华泰柏瑞基金管理有限公司关于聘任副总经理的公告	证监会规定报刊和网站	2021年12月10日
3	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12月4日
4	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2021年12月2日
5	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2021年11月30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11月18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11月6日
8	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金参与海银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10月12日
9	华泰柏瑞基金关于网上直销直连招商银行支付服务的补充提示性公告	证监会规定报刊和网站	2021年9月27日
10	华泰柏瑞基金管理有限公司关于直销赎回转认(申)购业务增加适用基金范围及费率优惠的公告	证监会规定报刊和网站	2021年9月22日
11	华泰柏瑞恒利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9月17日
12	华泰柏瑞恒利混合型基金基金合同生效公告	证监会规定报刊和网站	2021年9月15日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	20211230-20211230;	0.00	165,195,152.69	0.00	165,195,152.69	17.98
	2	20210923-20210928;	0.00	150,652,329.44	0.00	150,652,329.44	16.40
	3	20210914-20210917;	0.00	100,570,651.32	0.00	100,570,651.32	10.95
	4	20210914-20210922;	0.00	130,643,782.56	130,637,000.00	6,782.56	0.00

产品特有风险

本基金报告期内有单一持有人持有基金份额超过 20%的情形。如果这些份额持有比例较大的投资者赎回，可能导致巨额赎回，从而引发流动性风险，可能对基金产生如下影响：（1）延期办理赎回申请或暂停赎回的风险。当发生巨额赎回时，投资者可能面临赎回申请延期办理、延缓支付或暂停赎回的风险。（2）基金净值大幅波动的风险。基金管理人为了应对大额赎回可能短时间内进行资产变现，这将对基金资产净值产生不利影响，同时可能发生大额赎回费用归入基金资产、基金份额净值保留位数四舍五入等问题，这些都可能会造成基金资产净值的较大波动。（3）基金投资目标偏离的风险。单一投资者大额赎回后可能导致基金规模缩小，基金将面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形，从而使得实现基金投资目标存在一定的不确定性。（4）基金合同提前终止的风险。如果投资者大额赎回可能导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。本基金管理人将密切关注申赎动向，审慎评估大额申赎对基金持有集中度的影响，同时将完善流动性风险管控机制，最大限度的保护基金份额持有人的合法权益。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、本基金的中国证监会批准募集文件
- 2、本基金的《基金合同》
- 3、本基金的《招募说明书》

- 4、本基金的《托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、本基金的公告

13.2 存放地点

上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

托管人住所

13.3 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

2022 年 3 月 31 日