

华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资 基金 2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 30 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责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 29 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，投资者在做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 2022 年 1 月 1 日起至 2022 年 6 月 30 日止。

华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金于 2018 年 6 月 19 日根据收费方式分不同，新增 C 类份额，C 类相关指标从 2018 年 6 月 19 日开始计算。

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	6
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	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	12
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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 净资产（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	21
§ 7 投资组合报告	49
7.1 期末基金资产组合情况	49
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	49
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	50
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	61
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	62
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	62

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	62
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	62
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	62
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	62
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	62
7.12 投资组合报告附注	63
§ 8 基金份额持有人信息	63
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	63
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	64
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情况	64
§ 9 开放式基金份额变动	64
§ 10 重大事件揭示	65
10.1 基金份额持有人大会决议	65
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	65
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	65
10.4 基金投资策略的改变	65
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	65
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	65
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	65
10.8 其他重大事件	68
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	68
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	68
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	69
§ 12 备查文件目录	69
12.1 备查文件目录	69
12.2 存放地点	69
12.3 查阅方式	69

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	华泰柏瑞量化智慧混合	
基金主代码	001244	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 6 月 3 日	
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	246,101,035.21 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	华泰柏瑞量化智慧混合 A	华泰柏瑞量化智慧混合 C
下属分级基金的交 易代码	001244	006104
报告期末下属分级 基金的份额总额	199,868,196.37 份	46,232,838.84 份

2.2 基金产品说明

投资目标	利用定量投资模型，在有效控制风险的前提下，追求资产的长期增值，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	<p>本基金投资策略如下：</p> <p>1、股票投资策略</p> <p>本基金主要通过定量投资模型，选取并持有预期收益较好的股票构成投资组合，在有效控制风险的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。但在极端市场情况下，为保护投资者的本金安全，股票资产比例可降至 0%。</p> <p>2、固定收益资产投资策略</p> <p>本基金固定收益资产投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。</p> <p>3、资产支持证券投资策略</p> <p>在对市场利率环境深入研究的基础上，本基金投资于资产支持证券将采用久期配置策略与期限结构配置策略，结合定量分析和定性分析的方法，综合分析资产支持证券的利率风险、提前偿付风险、流动性风险、税收溢价等因素，选择具有较高投资价值的资产支持证券进行配置。</p> <p>4、权证投资策略</p> <p>权证为本基金辅助性投资工具，其投资原则为有利于基金资产增值，有利于加强基金风险控制。本基金在权证投资中将对权证标的证券的基本面进行研究，同时综合考虑权证定价模型、市场供求关系、交易制度设计等多种因素对权证进行定价。</p> <p>5、其他金融衍生工具投资策略</p>

	在法律法规允许的范围内，本基金可基于谨慎原则运用股指期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险，提高投资效率。本基金主要采用流动性好、交易活跃的衍生品合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。若法律法规或监管机构以后允许基金投资如期权、互换等其他金融衍生品种，本基金将以风险管理和组合优化为目的，根据届时法律法规的相关规定参与投资。
业绩比较基准	95%*中证 500 指数收益率+5%*银行活期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	华泰柏瑞基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	刘万方
	联系电话	021-38601777
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com
客户服务电话	400-888-0001	95588
传真	021-38601799	010-66105798
注册地址	上海市浦东新区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	上海市浦东新区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	200135	100140
法定代表人	贾波	陈四清

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据 和指标	报告期(2022 年 01 月 01 日-2022 年 06 月 30 日)	
	华泰柏瑞量化智慧混合 A	华泰柏瑞量化智慧混合 C

本期已实现收益	-11,700,953.41	-3,997,752.47
本期利润	-18,977,006.78	-4,261,369.35
加权平均基金份额本期利润	-0.0978	-0.0840
本期加权平均净值利润率	-6.67%	-5.50%
本期基金份额净值增长率	-4.67%	-4.79%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)	
期末可供分配利润	106,334,502.44	27,913,298.51
期末可供分配基金份额利润	0.5320	0.6038
期末基金资产净值	306,202,698.81	74,146,137.35
期末基金份额净值	1.5320	1.6038
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	78.42%	70.09%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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、本基金于 2018 年 6 月 19 日新增 C 类份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华泰柏瑞量化智慧混合 A

阶段	份额净值增长	份额净值增长率标	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差	①—③	②—④
----	--------	----------	------------	--------------	-----	-----

	率①	准差②		④		
过去一个月	7.99%	0.98%	6.74%	1.05%	1.25%	-0.07%
过去三个月	5.32%	1.51%	1.99%	1.66%	3.33%	-0.15%
过去六个月	-4.67%	1.45%	-11.65%	1.55%	6.98%	-0.10%
过去一年	3.38%	1.23%	-4.83%	1.26%	8.21%	-0.03%
过去三年	68.25%	1.26%	29.13%	1.28%	39.12%	-0.02%
自基金合同生效起 至今	78.42%	1.47%	-38.33%	1.60%	116.75 %	-0.13%

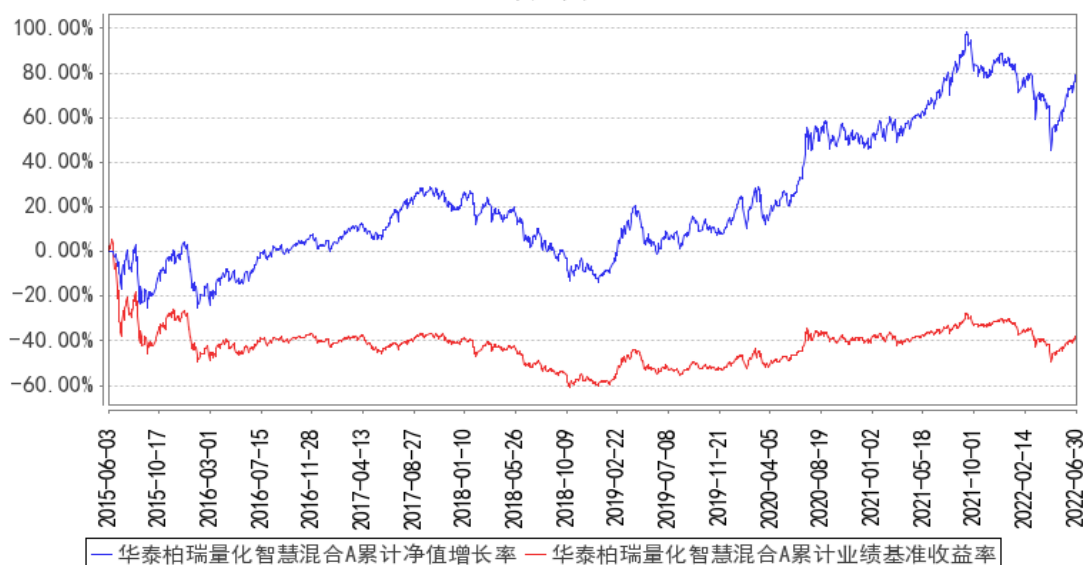
华泰柏瑞量化智慧混合 C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准 收益率标准 差④	①-③	②-④
过去一个月	7.98%	0.98%	-6.32%	1.05%	14.30%	-0.07%
过去三个月	5.26%	1.51%	1.99%	1.66%	3.27%	-0.15%
过去六个月	-4.79%	1.45%	-11.65%	1.55%	6.86%	-0.10%
过去一年	3.13%	1.23%	-4.83%	1.26%	7.96%	-0.03%
过去三年	67.02%	1.26%	29.13%	1.28%	37.89%	-0.02%
自基金合同生效起 至今	70.09%	1.33%	24.81%	1.37%	45.28%	-0.04%

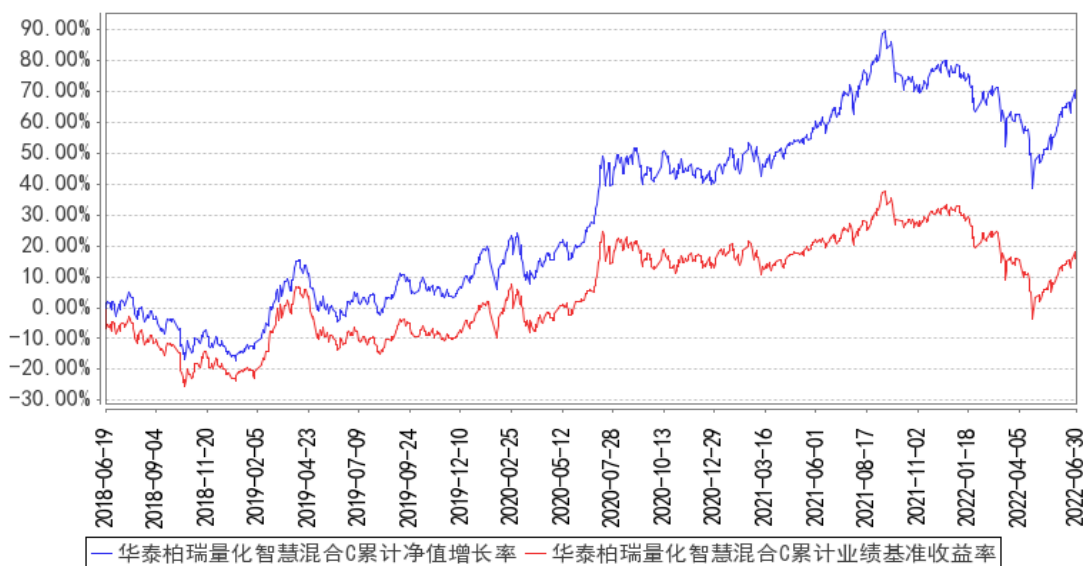
注：A 级份额业绩计算期间为 2015 年 6 月 3 日至 2022 年 6 月 30 日；C 级份额业绩计算期间为 2018 年 6 月 19 日至 2022 年 6 月 30 日。

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

华泰柏瑞量化智慧混合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



华泰柏瑞量化智慧混合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：A 级图示日期为 2015 年 6 月 3 日至 2022 年 6 月 30 日。C 级图示日期为 2018 年 6 月 19 日至 2022 年 6 月 30 日。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司。华泰柏瑞基金管理有限公司是经中国证监会批准，于 2004 年 11 月 18 日成立的合资基金管理公司，注册资本为 2 亿元人民币。目前的股东构成

为华泰证券股份有限公司、柏瑞投资有限责任公司（原 AIGGIC）和苏州新区高新技术产业股份有限公司，出资比例分别为 49%、49%和 2%。目前公司旗下管理华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金、华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金、上证红利交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金、华泰柏瑞货币市场证券投资基金、华泰柏瑞行业领先混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化先行混合型证券投资基金、华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金、上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金、华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金、华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金、华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金、华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金、华泰柏瑞交易型货币市场基金、华泰柏瑞激励动力灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化对冲稳健收益定期开放混合型发起式证券投资基金、华泰柏瑞天添宝货币市场基金、华泰柏瑞多策略灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞新经济沪港深灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞享利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化创优灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞生物医药灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞富利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞港股通量化灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞战略新兴产业混合型证券投资基金、华泰柏瑞新金融地产灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数基金、华泰柏瑞医疗健康混合型证券投资基金、华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通指数基金联接基金、华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞量化明选混合型证券投资基金、华泰柏瑞基本面智选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞锦泰一年定期开放债券型证券投资基金、华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞益通三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、华泰柏瑞研

究精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞景气回报一年持有期混合型证券投资基金、华泰柏瑞锦兴 39 个月定期开放债券型证券投资基金、华泰柏瑞锦瑞债券型证券投资基金、华泰柏瑞益商一年定期开放债券型发起式证券投资基金、华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞质量成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞行业精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞鸿利中短债债券型证券投资基金、华泰柏瑞景气优选混合型证券投资基金、华泰柏瑞品质优选混合型证券投资基金、华泰柏瑞景利混合型证券投资基金、华泰柏瑞优势领航混合型证券投资基金、华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞锦乾债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化创盈混合型证券投资基金、华泰柏瑞成长智选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞量化创享混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞质量领先混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证稀土产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞品质成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞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、华泰柏瑞景气汇选三年持有期混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞聚优智选一年持有期混合型证券投资基金、华泰柏瑞匠心汇选混合型证券投资基金、华泰柏瑞鸿益 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金 (QDII)、华泰柏瑞恒悦混合型证券投资基金、华泰柏

瑞中证全指电力公用事业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 指数增强型证券投资基金、华泰柏瑞鸿裕 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金、华泰柏瑞恒泽混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、华泰柏瑞匠心臻选混合型证券投资基金。截至 2022 年 6 月 30 日，公司基金管理规模为 2750.48 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		
笪篁	本基金的基金经理	2021 年 9 月 17 日	-	8 年	美国明尼苏达大学双城分校金融数学硕士，曾任中国金融期货交易所债券事业部助理经理。2016 年 6 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任量化与海外投资部助理研究员、研究员、高级研究员。2020 年 5 月起任华泰柏瑞量化创优灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 11 月起任华泰柏瑞量化创盈混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月起任华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞量化对冲稳健收益定期开放混合型发起式证券投资基金的基金经理。

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及其他相关法律、法规的规定以及本基金的《基金合同》的约定，在严格控制风险的基础上，忠实履行基金管理职责，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金投资管理符合有关法律、法规的规定及基金合同的约定，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司将投资管理职能和交易执行职能完全隔离，实行集中交易制度，由交易部为公募基金、专户理财和海外投资等业务统一交易服务，为公平交易的实施提供了较好的保障。

目前公司公募基金经理有兼任私募资产管理计划投资经理的情况，兼任业务遵照相关法律法规

规要求进行，同时遵守公司公平交易制度。公司机构设置合理，公平交易的相关管理制度健全，投资决策流程完善，各项制度执行情况良好。交易价差分析表明公司旗下各基金均得到了公平对待，不存在非公平交易和利益输送的行为。经过对不同基金之间交易相同证券时的同向交易价差进行分析发现，报告期内基金之间的买卖交易价差总体上处于正常的合理水平。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金管理人根据《异常交易监控与管理办法》对投资交易过程中可能发生的异常交易行为进行监督和管理。投资部负责对异常交易行为进行事前识别和检查，交易部负责对异常交易行为的事中监督和控制，风险管理部及异常交易评估小组负责异常交易行为的事后审查和评估。本报告期内，该制度执行情况良好，无论在二级市场还是在大宗交易或者一级市场申购等交易中，均没有发现影响证券价格或者严重误导其他投资者等异常交易行为。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2022 年上半年，A 股市场表现先抑后扬：受国内新冠疫情影响，叠加地缘政治环境恶化，全球通胀冲击和美国加息预期，A 股市场各个股票指数在 1-4 月份出现向下调整；之后深圳上海等地疫情得到一定程度的控制，房地产、汽车等支柱产业数据边际改善、国务院出台促进经济恢复改善的多项政策，A 股市场在 4 月底触底之后持续反弹。

本报告期，传统行业占比较高的上证 50、沪深 300 分别下跌 6.59% 和 9.22%；代表成长类上市公司的创业板指和科创 50 分别下跌 15.41% 和 20.92%；中小市值指数中证 500 和中证 1000 分别下跌 12.30% 和 12.67%。如果单看 4 月 26 日市场出现阶段性底部之后的反弹，则是创业板、科创板和中小市值指数反弹幅度较高。

本报告期内，我们坚持基本面多因子的量化选股策略，结合对市场的研判，采取比较稳健的投资策略。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末华泰柏瑞量化智慧混合 A 的基金份额净值为 1.5320 元，本报告期基金份额净值增长率为-4.67%，同期业绩比较基准收益率为-11.65%，截至本报告期末华泰柏瑞量化智慧混合 C 的基金份额净值为 1.6038 元，本报告期基金份额净值增长率为-4.79%，同期业绩比较基准收益率为-11.65%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

受房地产市场调整、新冠疫情反复和出口增速可能放缓等因素的影响，今年国内经济增长的压力较大。在高基数的影响下，上市公司的盈利增速也不会像去年那样高。但是，A 股市场自去年以来，已经出现了较大幅度的调整，这些不利影响很大程度上应该已经反映在股价中。在短期反弹情绪释放之后，市场将重回基本面驱动，优势行业、优质公司的表现值得期待。所以，尽管市场近期仍可能有波动，如果不进一步出现极端情况，我们对于整体股票市场的中长期表现保持乐观。

量化策略方面，我们预期未来的市场风格会更加有利于华泰柏瑞量化模型争取获取超额收益。从因子表现来看，压抑两年的估值因子出现反转，而我们自己的成长因子预期会继续表现良好。市场抱团的龙头股也出现估值下修，继续获得超额收益的机会不大；市场将由搏赛道转为回归基本面；未来大小市值、各行业股票的表现将更加均衡；量化投资全市场选股的优势将得以更好体现。虽然市场未来可能还会有一定的反复，但大方向上是比较确定的。

如上所述，短期市场可能还会有一定的波动，但我们认为，当前 A 股市场整体估值合理，如果出现比较大的波动，会是很不错的买入风格更加均衡的量化基金的机会。

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未实施收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地

履行了基金托管人应尽的义务。

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，本基金的管理人——华泰柏瑞基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，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

本托管人依法对华泰柏瑞基金管理有限公司编制和披露的本基金 2022 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	26,851,718.82	22,442,453.98
结算备付金		2,790,125.82	16,350,706.12
存出保证金		49,007.63	2,526,203.39
交易性金融资产	6.4.7.2	352,285,732.66	459,576,207.20
其中：股票投资		352,285,732.66	449,627,207.20
基金投资		-	-
债券投资		-	9,949,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		143,333.55	7,229,049.98
应收股利		-	-

应收申购款		359,620.58	98,126.90
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	29,841.89
资产总计		382,479,539.06	508,252,589.46
负债和净资产	附注号	本期末 2022年6月30日	上年度末 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		501,637.87	3,857,904.74
应付赎回款		735,258.00	262,220.54
应付管理人报酬		449,152.86	635,250.06
应付托管费		74,858.79	105,875.03
应付销售服务费		15,228.61	17,405.68
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	354,566.77	546,213.54
负债合计		2,130,702.90	5,424,869.59
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	246,101,035.21	310,546,384.78
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	134,247,800.95	192,281,335.09
净资产合计		380,348,836.16	502,827,719.87
负债和净资产总计		382,479,539.06	508,252,589.46

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额总额 246,101,035.21 份，其中下属 A 类基金份额净值 1.5320 元，基金份额总额 199,868,196.37 份；下属 C 类基金份额净值 1.6038 元，基金份额总额 46,232,838.84 份。

6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-19,897,856.82	55,883,540.22
1. 利息收入		102,376.97	148,227.77
其中：存款利息收入	6.4.7.13	93,852.21	148,017.44

债券利息收入		-	210.33
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		8,524.76	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-12,822,483.36	51,546,748.97
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-18,061,021.67	47,726,309.27
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	93,707.46	64,334.43
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-11,914.69	1,418,316.39
股利收益	6.4.7.19	5,156,745.54	2,337,788.88
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-7,539,670.25	3,583,489.25
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	361,919.82	605,074.23
减：二、营业总支出		3,340,519.31	4,628,437.90
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,696,949.78	2,499,412.57
2. 托管费	6.4.10.2.2	449,491.67	416,568.71
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	96,230.04	6,283.40
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	5,106.13
8. 其他费用	6.4.7.23	97,847.82	1,701,067.09
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-23,238,376.13	51,255,102.32
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-23,238,376.13	51,255,102.32
五、其他综合收益的税后净额		-	-

六、综合收益总额		-23,238,376.13	51,255,102.32
----------	--	----------------	---------------

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	310,546,384.78	-	192,281,335.09	502,827,719.87
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	310,546,384.78	-	192,281,335.09	502,827,719.87
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-64,445,349.57	-	-58,033,534.14	-122,478,883.71
(一)、综合收益总额	-	-	-23,238,376.13	-23,238,376.13
(二)、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)	-64,445,349.57	-	-34,795,158.01	-99,240,507.58

其中:1. 基金申购款	59,128,015.58	-	26,641,014.16	85,769,029.74
2. 基金赎回款	-123,573,365.15	-	-61,436,172.17	-185,009,537.32
(三)、 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)	-	-	-	-
(四)、 其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	246,101,035.21	-	134,247,800.95	380,348,836.16
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	468,657,969.25	-	135,598,982.95	604,256,952.20
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本年期初净资产(基	468,657,969.25	-	135,598,982.95	604,256,952.20

金净值)				
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-291,491,484.41	-	-49,518,940.96	-341,010,425.37
(一)、综合收益总额	-	-	51,255,102.32	51,255,102.32
(二)、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)	-291,491,484.41	-	-100,774,043.28	-392,265,527.69
其中:1.基金申购款	48,623,433.91	-	18,767,173.74	67,390,607.65
2.基金赎回款	-340,114,918.32	-	-119,541,217.02	-459,656,135.34
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净	177,166,484.84	-	86,080,041.99	263,246,526.83

资产(基金净值)				
----------	--	--	--	--

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：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞量化智慧灵活配置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”)证监基金字[2015]第 439 号《关于准予华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准,由华泰柏瑞基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞量化智慧灵活配置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 906,808,361.90 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(2015)第 664 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 6 月 3 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 906,942,174.07 份基金份额,其中认购资金利息折合 133,812.17 份基金份额。本基金的基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于 2018 年 6 月 15 日发布的《华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金增加 C 类份额并修改基金合同的公告》,经与基金托管人协商一致并报中国证监会备案,本基金自 2018 年 6 月 19 日起增加 C 类基金份额。根据修改后的《华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金基金合同》,本基金根据申购费、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者申购基金份额时收取申购费用而不计提销售服务费的,称为 A 类基金份额;在投资者申购基金份额时不收取申购费用,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代码,分别计算基金份额净值并分别公告。投资者可自行选择申购的基金份额类别,但不同基金份额类别之间不得互相转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞量化智慧灵活配置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

的股票(包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票)、存托凭证、债券(国债、金融债、企业/公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货、权证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。本基金的投资组合比例为：股票资产的投资比例占基金资产的 0%-95%；在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：95% X 中证 500 指数收益率+5% X 银行活期存款利率(税后)。

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 8 月 30 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

除 6.4.5 的会计政策变更外,其他项目与上年度一致。

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

财政部于 2017 年颁布了修订后的《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》及《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”),财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》,公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外,中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《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>》,本基金的基金管理人已

采用上述准则及通知编制本基金财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

(a) 金融工具

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，将金融工具分类为以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

新金融工具准则要求对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。金融资产减值计量方式的变更对于本基金的影响不重大。

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。

(i) 于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、应收利息、应收证券清算款和应收申购款，金额分别为 22,442,453.98 元、16,350,706.12 元、2,526,203.39 元、0.00 元、29,841.89 元、7,229,049.98 元和 98,126.90 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、其他资产-应收利息、应收清算款和应收申购款，金额分别为 22,444,641.12 元、16,364,629.40 元、2,526,238.81 元、-5,197.36 元、0.00 元、7,229,049.98 元和 98,126.90 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 459,576,207.20 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 459,595,100.61 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 3,857,904.74 元、262,220.54 元、635,250.06 元、105,875.03 元、17,405.68 元、370,889.43 元和 324.11 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 3,857,904.74 元、262,220.54 元、635,250.06 元、105,875.03 元、17,405.68 元、

370,889.43 元和 324.11 元。

i) 于 2021 年 12 月 31 日,“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日,根据新金融工具准则下的计量类别,将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示,本基金无期初留存收益影响。

(b) 修订后的《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>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《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>》,本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露,这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

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

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税,对国债、地方政府

债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	26,851,718.82
等于：本金	26,848,960.82
加：应计利息	2,758.00
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-

减：坏账准备	-
合计	26,851,718.82

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	349,482,073.93	-	352,285,732.66	2,803,658.73
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	349,482,073.93	-	352,285,732.66	2,803,658.73

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：截至本报告期末，本基金未持有期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：截至本报告期末，本基金未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

注：无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.8 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,248.41
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	266,537.91
其中：交易所市场	266,537.91
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	86,780.45
合计	354,566.77

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

华泰柏瑞量化智慧混合 A

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	261,802,718.41	261,802,718.41
本期申购	48,755,000.24	48,755,000.24
本期赎回（以“-”号填列）	-110,689,522.28	-110,689,522.28
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	199,868,196.37	199,868,196.37

华泰柏瑞量化智慧混合 C

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	48,743,666.37	48,743,666.37
本期申购	10,373,015.34	10,373,015.34
本期赎回（以“-”号填列）	-12,883,842.87	-12,883,842.87
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	46,232,838.84	46,232,838.84

6.4.7.11 其他综合收益

注：截至本报告期末，本基金无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

华泰柏瑞量化智慧混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	184,007,052.44	-25,084,885.91	158,922,166.53
本期利润	-11,700,953.41	-7,276,053.37	-18,977,006.78
本期基金份额交易产生的变动数	-45,243,114.25	11,632,456.94	-33,610,657.31
其中：基金申购款	31,456,495.89	-10,247,270.30	21,209,225.59
基金赎回款	-76,699,610.14	21,879,727.24	-54,819,882.90
本期已分配利润	-	-	-
本期末	127,062,984.78	-20,728,482.34	106,334,502.44

华泰柏瑞量化智慧混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	33,036,271.19	322,897.37	33,359,168.56
本期利润	-3,997,752.47	-263,616.88	-4,261,369.35
本期基金份额交易产生的变动数	-1,042,859.80	-141,640.90	-1,184,500.70
其中：基金申购款	6,829,324.83	-1,397,536.26	5,431,788.57
基金赎回款	-7,872,184.63	1,255,895.36	-6,616,289.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	27,995,658.92	-82,360.41	27,913,298.51

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
活期存款利息收入	40,136.85
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	53,163.67
其他	551.69
合计	93,852.21

注：其他为结算保证金利息收入、直销申购款利息收入和期货备付金利息收入。

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-18,061,021.67
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-18,061,021.67

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	384,426,387.33
减：卖出股票成本总额	401,386,200.03
减：交易费用	1,101,208.97
买卖股票差价收入	-18,061,021.67

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期无股票投资收益——证券出借差价收入。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	55,499.64
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	38,207.82

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	93,707.46

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	15,405,127.70
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	15,291,865.00
减：应计利息总额	74,891.95
减：交易费用	162.93
买卖债券差价收入	38,207.82

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——申购差价收入。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	-11,914.69

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	5,156,745.54
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	5,156,745.54

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-7,072,918.25
股票投资	-7,070,428.25
债券投资	-2,490.00
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-466,752.00
权证投资	-
期货投资	-466,752.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-7,539,670.25

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	361,551.87
基金转换费收入	367.95
合计	361,919.82

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 25% 归入基金资产。对持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5% 的赎回费，并全额计入基金财产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的不低于赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.7.22 信用减值损失

注：无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	27,273.08
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行间账户服务费	9,000.00
银行划款手续费	2,067.37
合计	97,847.82

6.4.7.24 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，不需要进行分部报告的披露。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无其它需作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华泰柏瑞基金管理有限公司（“华泰柏瑞基金”）	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人、基金销售机构
华泰证券股份有限公司（“华泰证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
华泰联合证券有限责任公司（“华泰联合证券”）	基金管理人的股东华泰证券的控股子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例(%)
华泰证券	136,292,232.53	19.91	-	-

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)
华泰证券	7,000,000.00	100.00	-	-

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022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	126,931.35	20.03	71,416.41	26.79
关联方名称	上年度可比期间 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 (%)
-	-	-	-	-

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。

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 2022年1月1日至2022年6 月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,696,949.78	2,499,412.57
其中：支付销售机构的客户维护费	614,165.72	500,425.16

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

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.50\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6 月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	449,491.67	416,568.71

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰柏瑞量化智慧混合 A	华泰柏瑞量化智慧混合 C	合计
华泰柏瑞基金管理有限公司	0.00	67,573.22	67,573.22
合计	0.00	67,573.22	67,573.22
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰柏瑞量化智慧混合 A	华泰柏瑞量化智慧混合 C	合计
华泰柏瑞基金管理有限公司	0.00	397.48	397.48
合计	0.00	397.48	397.48

注：支付基金销售机构的基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.25% 年费率计提，计算方法如下： $H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$ H 为每日应计提的基金销售服务费 E 为前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前 3 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人支付给各基金销售机构。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间无与关联方进行银行间同业市场债券(含回购)的交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间无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。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间无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。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期内与上年度可比期间，基金管理人未投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本报告期及上年度可比期间内，除基金管理人之外的其它关联方未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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
中国工商银行	26,851,718.82	40,136.85	30,281,717.59	68,036.99

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2022年1月1日至2022年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张）	总金额
华泰联合证券有限责任公司	301298	东利机械	网下申购	6,340	80,391.20
华泰联合证券有限责任公司	301207	华兰疫苗	网下申购	2,299	130,767.12
华泰联合证券有限责任公司	301256	华融化学	网下申购	15,785	127,069.25
华泰联合证券有限责任公司	301160	翔楼新材	网下申购	3,918	123,652.08
华泰联合证券有限责任公司	688046	药康生物	网下申购	9,514	214,350.42
华泰联合证券有限责任公司	688209	英集芯	网下申购	5,730	138,837.90
华泰联合证券有限责任公司	301153	中科江南	网下申购	3,526	118,755.68
上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张）	总金额
华泰联合证券有	688656	浩欧博	网下申购	1,371	48,341.46

限责任公司					
华泰联合证券有 限责任公司	688350	富淼科技	网下申购	2,552	34,656.16
华泰联合证券有 限责任公司	300952	恒辉安防	网下申购	3,398	39,824.56
华泰联合证券有 限责任公司	688083	中望软件	网下申购	838	126,119.00
华泰联合证券有 限责任公司	605389	长龄液压	网下申购	356	14,026.40
华泰联合证券有 限责任公司	688097	博众精工	网下申购	3,983	44,888.41
华泰联合证券有 限责任公司	688314	康拓医疗	网下申购	1,085	18,813.90
华泰联合证券有 限责任公司	688613	奥精医疗	网下申购	2,617	42,997.31
华泰联合证券有 限责任公司	605499	东鹏饮料	网下申购	632	29,242.64
华泰联合证券有 限责任公司	600909	华安证券	配股	7,620	28,041.60

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

注：本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期无利润分配。

6.4.12 期末(2022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	受限期	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
300834	星辉 环材	2022年 1月6 日	6个月	新股锁 定期内	55.57	30.03	326	18,115.82	9,789.78	-
301102	兆讯 传媒	2022年 3月15 日	6个月	新股锁 定期内	39.88	31.09	349	13,918.12	10,850.41	-
301103	何氏 眼科	2022年 3月14 日	6个月	新股锁 定期内	42.50	32.02	377	12,325.00	12,071.54	-
301110	青木 股份	2022年 3月4 日	6个月	新股锁 定期内	63.10	39.85	202	12,746.20	8,049.70	-

		日									
301112	信邦智能	2022年6月20日	6个月	新股锁定期内	27.53	45.04	399	10,984.47	17,970.96		-
301116	益客食品	2022年1月10日	6个月	新股锁定期内	11.40	20.46	577	6,577.80	11,805.42		-
301117	佳缘科技	2022年1月7日	6个月	新股锁定期内	46.80	54.44	262	12,261.60	14,263.28		-
301122	采纳股份	2022年1月19日	6个月	新股锁定期内	50.31	70.37	270	13,583.70	18,999.90		-
301125	腾亚精工	2022年5月27日	6个月	新股锁定期内	22.49	27.42	327	7,354.23	8,966.34		-
301130	西点药业	2022年2月16日	6个月	新股锁定期内	22.55	37.70	237	5,344.35	8,934.90		-
301137	哈焊华通	2022年3月14日	6个月	新股锁定期内	15.37	15.99	644	9,898.28	10,297.56		-
301139	元道通信	2022年6月30日	1个月内(含)	新股未上市	38.46	38.46	4,521	173,877.66	173,877.66		-
301148	嘉戎技术	2022年4月14日	6个月	新股锁定期内	38.39	23.90	483	18,542.37	11,543.70		-
301150	中一科技	2022年4月14日	6个月	新股锁定期内	163.56	82.76	138	15,047.52	11,420.88		-
301153	中科江南	2022年5月10日	6个月	新股锁定期内	33.68	43.98	353	11,889.04	15,524.94		-
301158	德石股份	2022年1月7日	6个月	新股锁定期内	15.64	20.38	379	5,927.56	7,724.02		-
301160	翔楼新材	2022年5月25日	6个月	新股锁定期内	31.56	37.66	392	12,371.52	14,762.72		-
301163	宏德股份	2022年4月11日	6个月	新股锁定期内	26.27	32.33	277	7,276.79	8,955.41		-
301175	中科	2022年	1个月	新股未	3.82	3.82	35,827	136,859.14	136,859.14		-

	环保	6月30日	内(含)	上市							
301181	标榜股份	2022年2月11日	6个月	新股锁定期内	40.25	30.59	257	10,344.25	7,861.63		-
301187	欧圣电气	2022年4月13日	6个月	新股锁定期内	21.33	22.54	847	18,066.51	19,091.38		-
301196	唯科科技	2022年1月4日	6个月	新股锁定期内	64.08	37.52	174	11,149.92	6,528.48		-
301200	大族数控	2022年2月18日	6个月	新股锁定期内	76.56	51.92	263	20,135.28	13,654.96		-
301201	诚达药业	2022年1月12日	6个月	新股锁定期内	72.69	71.54	303	22,025.07	21,676.62		-
301206	三元生物	2022年1月26日	6个月	新股锁定期内	109.30	45.69	263	19,127.50	12,016.47		-
301207	华兰疫苗	2022年2月10日	6个月	新股锁定期内	56.88	56.42	230	13,082.40	12,976.60		-
301215	中汽股份	2022年2月28日	6个月	新股锁定期内	3.80	6.39	4,342	16,499.60	27,745.38		-
301216	万凯新材	2022年3月21日	6个月	新股锁定期内	35.68	29.84	402	14,343.36	11,995.68		-
301219	腾远钴业	2022年3月10日	6个月	新股锁定期内	173.98	87.82	108	10,438.80	9,484.56		-
301220	亚香股份	2022年6月15日	6个月	新股锁定期内	35.98	39.15	285	10,254.30	11,157.75		-
301222	浙江恒威	2022年3月2日	6个月	新股锁定期内	33.98	28.96	332	11,281.36	9,614.72		-
301233	盛帮股份	2022年6月24日	1个月内(含)	新股未上市	41.52	41.52	1,418	58,875.36	58,875.36		-
301233	盛帮股份	2022年6月24日	6个月	新股锁定期内	41.52	41.52	158	6,560.16	6,560.16		-

301235	华康医疗	2022年1月21日	6个月	新股锁定期内	39.30	37.93	418	16,427.40	15,854.74	-
301237	和顺科技	2022年3月16日	6个月	新股锁定期内	56.69	41.86	261	14,796.09	10,925.46	-
301238	瑞泰新材	2022年6月10日	6个月	新股锁定期内	19.18	32.07	982	18,834.76	31,492.74	-
301239	普瑞眼科	2022年6月22日	1个月内(含)	新股未上市	33.65	33.65	3,707	124,740.55	124,740.55	-
301239	普瑞眼科	2022年6月22日	6个月	新股锁定期内	33.65	33.65	412	13,863.80	13,863.80	-
301248	杰创智能	2022年4月13日	6个月	新股锁定期内	39.07	29.87	443	17,308.01	13,232.41	-
301256	华融化学	2022年3月14日	6个月	新股锁定期内	8.05	10.08	1,579	12,710.95	15,916.32	-
301258	富士莱	2022年3月21日	6个月	新股锁定期内	48.30	41.68	232	11,205.60	9,669.76	-
301259	艾布鲁	2022年4月18日	6个月	新股锁定期内	18.39	24.94	483	8,882.37	12,046.02	-
301263	泰恩康	2022年3月22日	6个月	新股锁定期内	19.93	31.38	643	12,814.99	20,177.34	-
301266	宇邦新材	2022年5月30日	6个月	新股锁定期内	26.86	47.07	517	13,886.62	24,335.19	-
301288	清研环境	2022年4月14日	6个月	新股锁定期内	19.09	19.98	452	8,628.68	9,030.96	-
301298	东利机械	2022年5月27日	6个月	新股锁定期内	12.68	20.83	634	8,039.12	13,206.22	-
301302	华如科技	2022年6月16日	6个月	新股锁定期内	52.03	56.42	323	16,805.69	18,223.66	-
688237	超卓航科	2022年6月24日	1个月内(含)	新股未上市	41.27	41.27	2,891	119,311.57	119,311.57	-

		日									
688267	中触媒	2022 年 2 月 9 日	6 个月	新股锁定期内	41.90	31.90	1,773	74,288.70	56,558.70		-
688283	坤恒顺维	2022 年 2 月 8 日	6 个月	新股锁定期内	33.80	45.41	1,595	53,911.00	72,428.95		-
688322	奥比中光	2022 年 6 月 30 日	1 个月内(含)	新股未上市	30.99	30.99	6,757	209,399.43	209,399.43		-
688400	凌云光	2022 年 6 月 27 日	1 个月内(含)	新股未上市	21.93	21.93	6,239	136,821.27	136,821.27		-

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。

6.4.12.2 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

注：截至本报告期末本基金无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：截至本报告期末本基金无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：截至本报告期末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

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国工商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发

行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

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。

6.4.13.2.1 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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	9,949,000.00
合计	-	9,949,000.00

注：未评级的债券包括国债。债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.3 流动性风险

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

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严

密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。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 2022 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 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上市公司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股票不得超过该上市公司可流通股股票的 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股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2022 年 6 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 0.44%。

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

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

交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或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。

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年6月30 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1 年	1-5 年	5年以 上	不计息	合计
资产							
银行存款	26,851,718.82	-	-	-	-	-	26,851,718.82
结算备付金	2,790,125.82	-	-	-	-	-	2,790,125.82
存出保证金	49,007.63	-	-	-	-	-	49,007.63
交易性金融资产	-	-	-	-	-	352,285,732.66	352,285,732.66
应收申购款	-	-	-	-	-	359,620.58	359,620.58
应收清算款	-	-	-	-	-	143,333.55	143,333.55
资产总计	29,690,852.27	-	-	-	-	352,788,686.79	382,479,539.06
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	735,258.00	735,258.00
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	449,152.86	449,152.86
应付托管费	-	-	-	-	-	74,858.79	74,858.79
应付清算款	-	-	-	-	-	501,637.87	501,637.87
应付销售服务费	-	-	-	-	-	15,228.61	15,228.61
其他负债	-	-	-	-	-	354,566.77	354,566.77
负债总计	-	-	-	-	-	2,130,702.90	2,130,702.90

利率敏感度缺口	29,690,852.27	-	-	-	-	-350,657,983.89	380,348,836.16
上年度末 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	22,442,453.98	-	-	-	-	-	22,442,453.98
结算备付金	16,350,706.12	-	-	-	-	-	16,350,706.12
存出保证金	71,454.59	-	-	-	-	2,454,748.80	2,526,203.39
交易性金融资产	-9,949,000.00	-	-	-	-	-449,627,207.20	459,576,207.20
应收申购款	-	-	-	-	-	98,126.90	98,126.90
应收证券清算款	-	-	-	-	-	7,229,049.98	7,229,049.98
其他资产	-	-	-	-	-	29,841.89	29,841.89
资产总计	38,864,614.69	9,949,000.00	-	-	-	-459,438,974.77	508,252,589.46
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	262,220.54	262,220.54
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	635,250.06	635,250.06
应付托管费	-	-	-	-	-	105,875.03	105,875.03
应付证券清算款	-	-	-	-	-	3,857,904.74	3,857,904.74
应付销售服务费	-	-	-	-	-	17,405.68	17,405.68
其他负债	-	-	-	-	-	546,213.54	546,213.54
负债总计	-	-	-	-	-	5,424,869.59	5,424,869.59
利率敏感度缺口	38,864,614.69	9,949,000.00	-	-	-	-454,014,105.18	502,827,719.87

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2021 年 12 月 31 日：1.98%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2021 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以

外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金股票资产及存托凭证的投资比例占基金资产的 0-95%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日		上年度末 2021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	352,285,732.66	92.62	449,627,207.20	89.42
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	352,285,732.66	92.62	449,627,207.20	89.42

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证 500 指数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（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月）	

			31 日)
分析	中证 500 指数上升 5%	17,554,473.50	25,430,375.58
	中证 500 指数下降 5%	-17,554,473.50	-25,430,375.58

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	350,616,589.56	447,224,789.63
第二层次	980,308.94	12,351,417.57
第三层次	688,834.16	-
合计	352,285,732.66	459,576,207.20

6.4.14.2.2 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。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2021 年 12 月 31 日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

注：无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	352,285,732.66	92.11
	其中：股票	352,285,732.66	92.11
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	29,641,844.64	7.75
8	其他各项资产	551,961.76	0.14
9	合计	382,479,539.06	100.00

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

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	1,612,692.00	0.42
B	采矿业	16,534,958.00	4.35
C	制造业	205,039,407.89	53.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,921,068.46	1.82
E	建筑业	7,322,840.84	1.93
F	批发和零售业	10,323,146.74	2.71

G	交通运输、仓储和邮政业	20,668,238.22	5.43
H	住宿和餐饮业	1,361,724.00	0.36
I	信息传输、软件和信息技术服务业	24,292,226.43	6.39
J	金融业	31,061,542.21	8.17
K	房地产业	7,930,180.15	2.08
L	租赁和商务服务业	6,267,790.95	1.65
M	科学研究和技术服务业	5,232,031.02	1.38
N	水利、环境和公共设施管理业	2,016,799.86	0.53
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	992,685.89	0.26
R	文化、体育和娱乐业	4,708,400.00	1.24
S	综合	-	-
	合计	352,285,732.66	92.62

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600873	梅花生物	447,800	5,051,184.00	1.33
2	600325	华发股份	488,800	3,700,216.00	0.97
3	600522	中天科技	145,100	3,351,810.00	0.88
4	600546	山煤国际	169,300	3,294,578.00	0.87
5	605123	派克新材	22,700	3,194,344.00	0.84
6	601615	明阳智能	89,219	3,015,602.20	0.79
7	688303	大全能源	43,559	2,975,950.88	0.78
8	000959	首钢股份	615,000	2,927,400.00	0.77
9	300457	赢合科技	100,000	2,841,000.00	0.75
10	300390	天华超净	31,800	2,779,320.00	0.73
11	600392	盛和资源	116,700	2,637,420.00	0.69
12	600256	广汇能源	244,300	2,574,922.00	0.68
13	600153	建发股份	196,600	2,569,562.00	0.68
14	000933	神火股份	193,900	2,536,212.00	0.67
15	600662	外服控股	373,800	2,523,150.00	0.66
16	600929	雪天盐业	264,100	2,450,848.00	0.64
17	600362	江西铜业	135,200	2,410,616.00	0.63
18	000830	鲁西化工	136,900	2,367,001.00	0.62
19	600012	皖通高速	311,600	2,327,652.00	0.61
20	600312	平高电气	290,200	2,315,796.00	0.61

21	600104	上汽集团	129,700	2,309,957.00	0.61
22	601881	中国银河	237,123	2,292,979.41	0.60
23	300573	兴齐眼药	14,900	2,284,468.00	0.60
24	000625	长安汽车	130,520	2,260,606.40	0.59
25	600282	南钢股份	701,000	2,208,150.00	0.58
26	601872	招商轮船	382,500	2,203,200.00	0.58
27	600863	内蒙华电	602,400	2,198,760.00	0.58
28	002978	安宁股份	55,300	2,136,239.00	0.56
29	601339	百隆东方	413,800	2,102,104.00	0.55
30	603043	广州酒家	83,200	2,098,304.00	0.55
31	600582	天地科技	437,100	2,089,338.00	0.55
32	601211	国泰君安	135,800	2,064,160.00	0.54
33	000166	申万宏源	478,400	2,052,336.00	0.54
34	688200	华峰测控	5,618	2,002,255.20	0.53
35	688005	容百科技	15,234	1,971,888.96	0.52
36	600030	中信证券	90,970	1,970,410.20	0.52
37	601717	郑煤机	134,700	1,941,027.00	0.51
38	601668	中国建筑	363,400	1,933,288.00	0.51
39	600060	海信视像	154,200	1,927,500.00	0.51
40	601101	昊华能源	186,400	1,919,920.00	0.50
41	600741	华域汽车	83,100	1,911,300.00	0.50
42	002180	纳思达	37,600	1,903,312.00	0.50
43	300223	北京君正	17,700	1,880,625.00	0.49
44	600380	健康元	151,893	1,875,878.55	0.49
45	601898	中煤能源	178,500	1,852,830.00	0.49
46	000975	银泰黄金	189,100	1,841,834.00	0.48
47	688508	芯朋微	24,600	1,832,700.00	0.48
48	300696	爱乐达	41,400	1,819,530.00	0.48
49	600901	江苏租赁	344,700	1,768,311.00	0.46
50	601988	中国银行	538,000	1,753,880.00	0.46
51	600057	厦门象屿	199,000	1,749,210.00	0.46
52	002539	云图控股	108,900	1,741,311.00	0.46
53	600409	三友化工	212,600	1,741,194.00	0.46
54	300772	运达股份	68,380	1,739,587.20	0.46
55	600061	国投资本	273,000	1,736,280.00	0.46
56	300803	指南针	29,500	1,734,010.00	0.46
57	603565	中谷物流	109,212	1,733,194.44	0.46
58	600566	济川药业	63,700	1,730,092.00	0.45
59	000059	华锦股份	291,900	1,728,048.00	0.45
60	002736	国信证券	180,500	1,727,385.00	0.45
61	601456	国联证券	140,200	1,720,254.00	0.45
62	600089	特变电工	62,500	1,711,875.00	0.45

63	000951	中国重汽	131,260	1,705,067.40	0.45
64	000921	海信家电	120,067	1,702,550.06	0.45
65	000932	华菱钢铁	333,866	1,699,377.94	0.45
66	688556	高测股份	20,988	1,693,731.60	0.45
67	601728	中国电信	450,600	1,680,738.00	0.44
68	600050	中国联通	484,100	1,674,986.00	0.44
69	000792	盐湖股份	55,900	1,674,764.00	0.44
70	000630	铜陵有色	508,500	1,657,710.00	0.44
71	000848	承德露露	170,700	1,652,376.00	0.43
72	600499	科达制造	79,900	1,649,136.00	0.43
73	300347	泰格医药	14,300	1,636,635.00	0.43
74	002034	旺能环境	79,700	1,636,241.00	0.43
75	601928	凤凰传媒	227,700	1,628,055.00	0.43
76	601515	东风股份	352,680	1,625,854.80	0.43
77	002597	金禾实业	37,500	1,624,875.00	0.43
78	002048	宁波华翔	101,336	1,623,402.72	0.43
79	000429	粤高速 A	201,500	1,622,075.00	0.43
80	688016	心脉医疗	8,200	1,597,442.00	0.42
81	603599	广信股份	56,700	1,596,105.00	0.42
82	600141	兴发集团	36,200	1,592,438.00	0.42
83	603444	吉比特	4,100	1,590,800.00	0.42
84	002244	滨江集团	183,100	1,583,815.00	0.42
85	002410	广联达	28,900	1,573,316.00	0.41
86	300662	科锐国际	30,000	1,556,700.00	0.41
87	603185	上机数控	9,940	1,550,540.60	0.41
88	000672	上峰水泥	97,320	1,535,709.60	0.40
89	000039	中集集团	109,300	1,513,805.00	0.40
90	300171	东富龙	42,700	1,447,957.00	0.38
91	688078	龙软科技	28,891	1,429,237.77	0.38
92	601328	交通银行	285,800	1,423,284.00	0.37
93	002557	洽洽食品	25,000	1,423,250.00	0.37
94	603128	华贸物流	141,766	1,421,912.98	0.37
95	000728	国元证券	228,600	1,421,892.00	0.37
96	002605	姚记科技	85,100	1,416,915.00	0.37
97	688388	嘉元科技	16,480	1,398,657.60	0.37
98	601007	金陵饭店	121,800	1,361,724.00	0.36
99	300358	楚天科技	75,300	1,339,587.00	0.35
100	600705	中航产融	380,300	1,315,838.00	0.35
101	603659	璞泰来	15,500	1,308,200.00	0.34
102	601919	中远海控	91,820	1,276,298.00	0.34
103	688589	力合微	28,461	1,275,622.02	0.34
104	603096	新经典	67,740	1,249,803.00	0.33

105	605168	三人行	11,558	1,249,766.54	0.33
106	300037	新宙邦	23,760	1,248,825.60	0.33
107	601577	长沙银行	157,300	1,247,389.00	0.33
108	601186	中国铁建	157,100	1,241,090.00	0.33
109	600782	新钢股份	245,800	1,238,832.00	0.33
110	600548	深高速	129,100	1,231,614.00	0.32
111	600063	皖维高新	161,503	1,224,192.74	0.32
112	601098	中南传媒	129,300	1,220,592.00	0.32
113	600596	新安股份	55,720	1,206,338.00	0.32
114	601066	中信建投	41,700	1,205,547.00	0.32
115	688521	芯原股份	24,400	1,205,360.00	0.32
116	300384	三联虹普	64,700	1,203,420.00	0.32
117	002709	天赐材料	19,200	1,191,552.00	0.31
118	600761	安徽合力	99,700	1,186,430.00	0.31
119	603127	昭衍新药	10,400	1,183,520.00	0.31
120	300682	朗新科技	46,700	1,176,373.00	0.31
121	000898	鞍钢股份	365,200	1,175,944.00	0.31
122	601598	中国外运	303,000	1,175,640.00	0.31
123	300770	新媒股份	30,800	1,165,164.00	0.31
124	605266	健之佳	23,920	1,153,422.40	0.30
125	688036	传音控股	12,800	1,142,144.00	0.30
126	000789	万年青	104,400	1,131,696.00	0.30
127	601231	环旭电子	78,800	1,131,568.00	0.30
128	601555	东吴证券	162,800	1,128,204.00	0.30
129	601882	海天精工	54,500	1,123,245.00	0.30
130	603365	水星家纺	74,600	1,117,508.00	0.29
131	603920	世运电路	64,500	1,115,850.00	0.29
132	601618	中国中冶	318,700	1,115,450.00	0.29
133	600233	圆通速递	54,600	1,113,294.00	0.29
134	603180	金牌厨柜	35,800	1,108,368.00	0.29
135	000498	山东路桥	113,900	1,100,274.00	0.29
136	002601	龙佰集团	53,900	1,080,695.00	0.28
137	600039	四川路桥	102,200	1,076,166.00	0.28
138	600461	洪城环境	131,000	1,059,790.00	0.28
139	000034	神州数码	68,800	1,047,136.00	0.28
140	000552	靖远煤电	240,600	1,036,986.00	0.27
141	300910	瑞丰新材	16,400	1,036,808.00	0.27
142	688085	三友医疗	47,147	1,020,732.55	0.27
143	601006	大秦铁路	154,800	1,020,132.00	0.27
144	002240	盛新锂能	16,900	1,020,084.00	0.27
145	000733	振华科技	7,400	1,006,178.00	0.26
146	603208	江山欧派	13,900	1,003,997.00	0.26

147	300820	英杰电气	15,550	1,003,752.50	0.26
148	601828	美凯龙	164,900	999,294.00	0.26
149	603383	顶点软件	39,800	982,662.00	0.26
150	688586	江航装备	36,800	979,248.00	0.26
151	688298	东方生物	8,510	971,416.50	0.26
152	603825	华扬联众	56,000	964,880.00	0.25
153	603317	天味食品	33,700	959,439.00	0.25
154	601166	兴业银行	48,000	955,200.00	0.25
155	688289	圣湘生物	32,136	951,546.96	0.25
156	603678	火炬电子	20,300	950,243.00	0.25
157	601666	平煤股份	68,900	936,351.00	0.25
158	000999	华润三九	20,700	931,500.00	0.24
159	300639	凯普生物	43,300	925,754.00	0.24
160	603379	三美股份	40,900	910,025.00	0.24
161	688369	致远互联	20,166	909,688.26	0.24
162	603416	信捷电气	22,100	909,194.00	0.24
163	688690	纳微科技	11,240	908,304.40	0.24
164	300775	三角防务	18,800	905,220.00	0.24
165	600123	兰花科创	55,000	904,750.00	0.24
166	000539	粤电力 A	213,400	896,280.00	0.24
167	600875	东方电气	54,300	893,235.00	0.23
168	000825	太钢不锈	163,800	892,710.00	0.23
169	002191	劲嘉股份	83,200	891,904.00	0.23
170	600808	XD 马钢股	233,000	883,070.00	0.23
171	600027	华电国际	221,722	871,367.46	0.23
172	605016	百龙创园	20,700	869,814.00	0.23
173	000800	一汽解放	92,600	864,884.00	0.23
174	688682	霍莱沃	10,221	848,649.63	0.22
175	603882	金域医学	10,200	842,010.00	0.22
176	002008	大族激光	25,300	838,189.00	0.22
177	600219	南山铝业	226,700	836,523.00	0.22
178	300378	鼎捷软件	50,600	833,382.00	0.22
179	300087	荃银高科	49,800	819,708.00	0.22
180	603225	新凤鸣	70,500	813,570.00	0.21
181	300740	水羊股份	58,885	809,079.90	0.21
182	600350	山东高速	152,900	802,725.00	0.21
183	002041	登海种业	37,600	792,984.00	0.21
184	600487	亨通光电	54,200	788,068.00	0.21
185	600970	中材国际	80,600	781,014.00	0.21
186	300196	长海股份	40,400	763,156.00	0.20
187	603587	地素时尚	48,000	760,800.00	0.20
188	002645	华宏科技	34,800	759,336.00	0.20

189	603730	岱美股份	57,770	757,364.70	0.20
190	002233	塔牌集团	84,000	743,400.00	0.20
191	001965	招商公路	96,800	738,584.00	0.19
192	600398	海澜之家	154,400	733,400.00	0.19
193	002304	洋河股份	4,000	732,600.00	0.19
194	688155	先惠技术	7,014	730,858.80	0.19
195	688100	威胜信息	34,600	726,254.00	0.19
196	601229	上海银行	109,800	719,190.00	0.19
197	688558	国盛智科	20,600	708,434.00	0.19
198	600507	方大特钢	99,200	693,408.00	0.18
199	603997	继峰股份	60,900	662,592.00	0.17
200	600109	国金证券	73,600	662,400.00	0.17
201	300476	胜宏科技	35,800	657,288.00	0.17
202	688580	伟思医疗	9,996	650,739.60	0.17
203	300418	昆仑万维	40,600	649,600.00	0.17
204	300768	迪普科技	40,200	649,230.00	0.17
205	688196	卓越新能	8,400	646,800.00	0.17
206	600285	羚锐制药	51,300	642,789.00	0.17
207	002042	华孚时尚	169,900	642,222.00	0.17
208	300224	正海磁材	41,900	641,070.00	0.17
209	000739	普洛药业	31,000	639,840.00	0.17
210	002756	永兴材料	4,200	639,282.00	0.17
211	000785	居然之家	143,600	639,020.00	0.17
212	300783	三只松鼠	25,300	633,765.00	0.17
213	300873	海晨股份	22,240	628,724.80	0.17
214	002807	江阴银行	136,320	617,529.60	0.16
215	000960	锡业股份	36,600	613,782.00	0.16
216	688636	智明达	5,406	612,986.34	0.16
217	300182	捷成股份	110,900	609,950.00	0.16
218	603719	良品铺子	21,300	609,819.00	0.16
219	600383	金地集团	44,900	603,456.00	0.16
220	688330	宏力达	7,000	601,930.00	0.16
221	603993	洛阳钼业	104,000	595,920.00	0.16
222	002092	中泰化学	76,600	594,416.00	0.16
223	002801	微光股份	19,600	585,060.00	0.15
224	002396	星网锐捷	25,800	584,112.00	0.15
225	000408	藏格矿业	17,700	583,038.00	0.15
226	688202	美迪西	1,680	570,544.80	0.15
227	688617	惠泰医疗	2,600	569,608.00	0.15
228	300482	万孚生物	13,800	561,798.00	0.15
229	002155	湖南黄金	46,200	560,868.00	0.15
230	300363	博腾股份	7,100	553,729.00	0.15

231	002064	华峰化学	61,600	519,904.00	0.14
232	002110	三钢闽光	85,200	518,868.00	0.14
233	600967	内蒙一机	56,700	517,104.00	0.14
234	600299	安迪苏	53,200	509,656.00	0.13
235	688023	安恒信息	3,400	502,044.00	0.13
236	000596	古井贡酒	2,000	499,320.00	0.13
237	603308	应流股份	30,200	491,656.00	0.13
238	300709	精研科技	16,440	486,459.60	0.13
239	002154	报喜鸟	111,600	482,112.00	0.13
240	600998	九州通	40,200	478,782.00	0.13
241	600018	上港集团	81,400	474,562.00	0.12
242	688389	普门科技	27,100	473,979.00	0.12
243	300618	寒锐钴业	8,100	469,152.00	0.12
244	300481	濮阳惠成	19,800	465,300.00	0.12
245	600259	广晟有色	9,000	455,850.00	0.12
246	002985	北摩高科	7,710	451,651.80	0.12
247	600882	妙可蓝多	9,500	444,600.00	0.12
248	000725	京东方 A	112,500	443,250.00	0.12
249	688357	建龙微纳	3,929	441,776.76	0.12
250	603855	华荣股份	17,084	435,642.00	0.11
251	688033	天宜上佳	20,000	424,800.00	0.11
252	001914	招商积余	22,600	406,122.00	0.11
253	002414	高德红外	31,000	398,970.00	0.10
254	002935	天奥电子	17,490	398,946.90	0.10
255	300726	宏达电子	6,500	397,605.00	0.10
256	600765	中航重机	12,340	397,101.20	0.10
257	000401	冀东水泥	37,600	395,552.00	0.10
258	600007	中国国贸	26,800	395,300.00	0.10
259	600064	南京高科	35,800	393,800.00	0.10
260	300474	景嘉微	5,750	393,242.50	0.10
261	002128	电投能源	26,900	385,208.00	0.10
262	300219	鸿利智汇	44,200	384,540.00	0.10
263	000567	海德股份	25,810	381,988.00	0.10
264	600160	巨化股份	29,000	381,350.00	0.10
265	002637	赞宇科技	25,200	381,024.00	0.10
266	600497	驰宏锌锗	73,400	380,946.00	0.10
267	002497	雅化集团	11,600	378,740.00	0.10
268	600999	招商证券	26,200	377,542.00	0.10
269	002468	申通快递	31,500	375,480.00	0.10
270	600577	精达股份	67,400	374,070.00	0.10
271	002405	四维图新	24,800	373,736.00	0.10
272	601658	邮储银行	68,500	369,215.00	0.10

273	300661	圣邦股份	1,950	354,939.00	0.09
274	002745	木林森	35,400	345,858.00	0.09
275	000560	我爱我家	119,600	344,448.00	0.09
276	601985	中国核电	49,800	341,628.00	0.09
277	688536	思瑞浦	600	336,954.00	0.09
278	601916	浙商银行	101,300	336,316.00	0.09
279	000877	天山股份	27,200	334,560.00	0.09
280	002901	大博医疗	7,700	301,378.00	0.08
281	688120	华海清科	1,206	299,570.40	0.08
282	300861	美畅股份	3,200	296,608.00	0.08
283	600116	三峡水利	29,500	296,180.00	0.08
284	688006	杭可科技	4,200	294,252.00	0.08
285	000676	智度股份	52,800	293,568.00	0.08
286	300773	拉卡拉	15,400	293,524.00	0.08
287	002156	通富微电	18,800	289,520.00	0.08
288	603610	麒盛科技	21,120	285,331.20	0.08
289	300138	晨光生物	18,100	281,817.00	0.07
290	301266	宇邦新材	5,161	279,894.51	0.07
291	000923	河钢资源	20,300	276,689.00	0.07
292	000671	阳光城	126,185	276,345.15	0.07
293	600297	广汇汽车	103,700	270,657.00	0.07
294	688368	晶丰明源	1,635	261,371.10	0.07
295	002035	华帝股份	44,000	256,080.00	0.07
296	688516	奥特维	954	254,670.30	0.07
297	600167	联美控股	33,400	250,166.00	0.07
298	601991	大唐发电	100,400	243,972.00	0.06
299	601238	广汽集团	16,000	243,840.00	0.06
300	603067	振华股份	19,000	238,070.00	0.06
301	603026	石大胜华	1,600	232,560.00	0.06
302	688011	新光光电	9,723	224,990.22	0.06
303	000967	盈峰环境	43,500	220,110.00	0.06
304	603338	浙江鼎力	4,300	218,010.00	0.06
305	600028	中国石化	52,800	215,424.00	0.06
306	688621	阳光诺和	1,929	211,032.60	0.06
307	688322	奥比中光	6,757	209,399.43	0.06
308	688686	奥普特	800	206,920.00	0.05
309	000778	新兴铸管	42,500	204,850.00	0.05
310	002301	齐心集团	30,400	200,640.00	0.05
311	300548	博创科技	11,100	197,802.00	0.05
312	600990	四创电子	4,600	190,210.00	0.05
313	688131	皓元医药	1,302	185,001.18	0.05
314	603986	兆易创新	1,300	184,873.00	0.05

315	000878	云南铜业	15,900	181,101.00	0.05
316	301139	元道通信	4,521	173,877.66	0.05
317	601155	新城控股	6,800	172,924.00	0.05
318	000598	兴蓉环境	33,300	170,163.00	0.04
319	688601	力芯微	1,121	168,150.00	0.04
320	688315	诺禾致源	6,516	167,917.32	0.04
321	600011	华能国际	23,000	161,920.00	0.04
322	688526	科前生物	6,200	161,138.00	0.04
323	603801	志邦家居	5,860	158,102.80	0.04
324	002738	中矿资源	1,680	155,584.80	0.04
325	688800	瑞可达	1,195	150,940.45	0.04
326	603369	今世缘	2,900	147,900.00	0.04
327	688499	利元亨	665	147,164.50	0.04
328	600795	国电电力	36,700	143,497.00	0.04
329	688518	联赢激光	4,170	141,738.30	0.04
330	301239	普瑞眼科	4,119	138,604.35	0.04
331	301175	中科环保	35,827	136,859.14	0.04
332	688400	凌云光	6,239	136,821.27	0.04
333	300447	全信股份	6,600	134,442.00	0.04
334	600535	天士力	12,600	132,426.00	0.03
335	600642	申能股份	23,200	131,776.00	0.03
336	600728	佳都科技	19,900	128,554.00	0.03
337	601899	紫金矿业	13,300	124,089.00	0.03
338	688237	超卓航科	2,891	119,311.57	0.03
339	300415	伊之密	6,500	118,495.00	0.03
340	600985	淮北矿业	8,100	117,936.00	0.03
341	601222	林洋能源	13,800	115,230.00	0.03
342	002505	鹏都农牧	33,100	112,209.00	0.03
343	002332	仙琚制药	11,400	111,948.00	0.03
344	301125	腾亚精工	3,270	101,023.38	0.03
345	002540	亚太科技	14,700	98,784.00	0.03
346	002727	一心堂	4,300	98,599.00	0.03
347	000913	钱江摩托	5,600	98,336.00	0.03
348	002705	新宝股份	4,400	96,756.00	0.03
349	000883	湖北能源	18,900	96,579.00	0.03
350	300354	东华测试	2,600	83,590.00	0.02
351	002948	青岛银行	22,100	80,002.00	0.02
352	300130	新国都	6,500	79,690.00	0.02
353	601168	西部矿业	6,700	79,261.00	0.02
354	601390	中国中铁	12,306	75,558.84	0.02
355	688283	坤恒顺维	1,595	72,428.95	0.02
356	600489	中金黄金	9,700	71,683.00	0.02

357	000403	派林生物	3,200	70,272.00	0.02
358	300319	麦捷科技	7,600	70,072.00	0.02
359	000811	冰轮环境	6,700	69,881.00	0.02
360	600869	远东股份	13,400	69,010.00	0.02
361	601699	潞安环能	4,600	67,252.00	0.02
362	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.02
363	688123	聚辰股份	600	63,912.00	0.02
364	300735	光弘科技	6,100	63,745.00	0.02
365	002818	富森美	5,000	62,950.00	0.02
366	600023	浙能电力	17,000	58,990.00	0.02
367	300082	奥克股份	5,000	58,600.00	0.02
368	601678	滨化股份	9,600	57,504.00	0.02
369	688267	中触媒	1,773	56,558.70	0.01
370	002532	天山铝业	8,600	56,158.00	0.01
371	601369	陕鼓动力	5,600	53,760.00	0.01
372	603267	鸿远电子	400	53,732.00	0.01
373	300866	安克创新	800	53,056.00	0.01
374	601388	怡球资源	14,700	51,450.00	0.01
375	300858	科拓生物	1,900	50,635.00	0.01
376	600376	首开股份	10,200	50,082.00	0.01
377	002043	兔宝宝	4,200	48,720.00	0.01
378	688080	映翰通	1,200	48,108.00	0.01
379	300065	海兰信	3,600	47,160.00	0.01
380	002585	双星新材	2,300	41,607.00	0.01
381	688550	瑞联新材	591	40,536.69	0.01
382	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.01
383	002563	森马服饰	6,200	36,704.00	0.01
384	600389	江山股份	600	36,438.00	0.01
385	603368	柳药集团	2,000	34,440.00	0.01
386	601600	中国铝业	7,000	33,250.00	0.01
387	301238	瑞泰新材	982	31,492.74	0.01
388	603859	能科科技	1,000	30,360.00	0.01
389	002821	凯莱英	100	28,900.00	0.01
390	688012	中微公司	247	28,837.25	0.01
391	301215	中汽股份	4,342	27,745.38	0.01
392	002384	东山精密	1,100	25,223.00	0.01
393	002408	齐翔腾达	2,980	24,167.80	0.01
394	300035	中科电气	800	22,360.00	0.01
395	301201	诚达药业	303	21,676.62	0.01
396	603155	新亚强	580	21,610.80	0.01
397	301263	泰恩康	643	20,177.34	0.01
398	301187	欧圣电气	847	19,091.38	0.01

399	301122	采纳股份	270	18,999.90	0.00
400	603277	银都股份	900	18,999.00	0.00
401	301302	华如科技	323	18,223.66	0.00
402	301112	信邦智能	399	17,970.96	0.00
403	301256	华融化学	1,579	15,916.32	0.00
404	301235	华康医疗	418	15,854.74	0.00
405	301153	中科江南	353	15,524.94	0.00
406	002460	赣锋锂业	100	14,870.00	0.00
407	301160	翔楼新材	392	14,762.72	0.00
408	301117	佳缘科技	262	14,263.28	0.00
409	301200	大族数控	263	13,654.96	0.00
410	301248	杰创智能	443	13,232.41	0.00
411	301298	东利机械	634	13,206.22	0.00
412	301207	华兰疫苗	230	12,976.60	0.00
413	301103	何氏眼科	377	12,071.54	0.00
414	301259	艾布鲁	483	12,046.02	0.00
415	301206	三元生物	263	12,016.47	0.00
416	301216	万凯新材	402	11,995.68	0.00
417	301116	益客食品	577	11,805.42	0.00
418	301148	嘉戎技术	483	11,543.70	0.00
419	301150	中一科技	138	11,420.88	0.00
420	002533	金杯电工	1,600	11,344.00	0.00
421	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
422	301220	亚香股份	285	11,157.75	0.00
423	301237	和顺科技	261	10,925.46	0.00
424	301102	兆讯传媒	349	10,850.41	0.00
425	603456	九州药业	200	10,340.00	0.00
426	301137	哈焊华通	644	10,297.56	0.00
427	300834	星辉环材	326	9,789.78	0.00
428	301258	富士莱	232	9,669.76	0.00
429	301222	浙江恒威	332	9,614.72	0.00
430	301219	腾远钴业	108	9,484.56	0.00
431	301288	清研环境	452	9,030.96	0.00
432	301163	宏德股份	277	8,955.41	0.00
433	301130	西点药业	237	8,934.90	0.00
434	000717	韶钢松山	2,400	8,400.00	0.00
435	301110	青木股份	202	8,049.70	0.00
436	301181	标榜股份	257	7,861.63	0.00
437	301158	德石股份	379	7,724.02	0.00
438	301196	唯科科技	174	6,528.48	0.00
439	600266	城建发展	900	3,672.00	0.00
440	002345	潮宏基	600	2,754.00	0.00

441	688233	神工股份	16	899.20	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	603565	中谷物流	3,441,685.96	0.68
2	000951	中国重汽	3,229,455.80	0.64
3	300390	天华超净	3,048,332.84	0.61
4	605123	派克新材	3,005,742.00	0.60
5	600362	江西铜业	2,751,510.00	0.55
6	600057	厦门象屿	2,745,874.00	0.55
7	600153	建发股份	2,654,665.00	0.53
8	688303	大全能源	2,611,486.98	0.52
9	600061	国投资本	2,526,517.00	0.50
10	600030	中信证券	2,500,969.10	0.50
11	600123	兰花科创	2,424,735.00	0.48
12	300457	赢合科技	2,379,030.00	0.47
13	600662	外服控股	2,318,583.00	0.46
14	600285	羚锐制药	2,310,375.00	0.46
15	600863	内蒙华电	2,192,633.00	0.44
16	002180	纳思达	2,187,708.00	0.44
17	600050	中国联通	2,167,497.00	0.43
18	601872	招商轮船	2,135,855.00	0.42
19	002935	天奥电子	2,131,765.00	0.42
20	688200	华峰测控	2,119,202.27	0.42

注：本项买入金额均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑其他交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600123	兰花科创	4,239,551.00	0.84
2	600188	兖矿能源	3,228,008.00	0.64
3	002533	金杯电工	2,906,200.00	0.58
4	000999	华润三九	2,893,027.00	0.58
5	600373	中文传媒	2,869,766.00	0.57
6	600483	福能股份	2,868,503.73	0.57
7	603799	华友钴业	2,787,978.09	0.55
8	601328	交通银行	2,773,957.00	0.55
9	603566	普莱柯	2,655,255.00	0.53
10	000723	美锦能源	2,607,583.00	0.52
11	601001	晋控煤业	2,487,955.95	0.49

12	002978	安宁股份	2,352,196.00	0.47
13	000498	山东路桥	2,319,871.00	0.46
14	000733	振华科技	2,299,483.00	0.46
15	603886	元祖股份	2,250,746.00	0.45
16	601225	陕西煤业	2,244,662.00	0.45
17	601117	中国化学	2,214,211.00	0.44
18	600057	厦门象屿	2,146,468.00	0.43
19	601699	潞安环能	2,121,657.00	0.42
20	000090	天健集团	2,094,374.00	0.42

注：本项卖出金额均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑其他交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	311,115,153.74
卖出股票收入（成交）总额	384,426,387.33

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 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 投资组合报告附注

7.12.1 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情形，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票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情形。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	49,007.63
2	应收清算款	143,333.55
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	359,620.58
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	551,961.76

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
华泰柏瑞	133,606	1,495.95	65,583,579.59	32.81	134,284,616.78	67.19

量化智慧混合 A						
华泰柏瑞量化智慧混合 C	1,682	27,486.82	33,329,677.32	72.09	12,903,161.52	27.91
合计	134,795	1,825.74	98,913,256.91	40.19	147,187,778.30	59.81

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	华泰柏瑞量化智慧混合 A	474,962.96	0.2376
	华泰柏瑞量化智慧混合 C	62,116.24	0.1344
	合计	537,079.20	0.2182

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情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	华泰柏瑞量化智慧混合 A	0
	华泰柏瑞量化智慧混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	华泰柏瑞量化智慧混合 A	10~50
	华泰柏瑞量化智慧混合 C	0
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华泰柏瑞量化智慧混合 A	华泰柏瑞量化智慧混合 C
基金合同生效日 (2015年6月3日) 基金份额总额	906,942,174.07	-
本报告期期初基金份额总额	261,802,718.41	48,743,666.37
本报告期基金总申购份额	48,755,000.24	10,373,015.34

减：本报告期基金总赎回份额	110,689,522.28	12,883,842.87
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	199,868,196.37	46,232,838.84

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人的重大人事变动：
 2022年3月15日，公司股东批准Kirk Chester SWEENEY先生担任公司董事，Anthony Gerard Fasso先生不再担任公司董事。
 上述人事变动已按相关规定备案、报告。
 基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
华泰证券	2	136,292,232.	19.91	126,931.35	20.03	-

		53				
东方证券	2	111,718,750.83	16.32	102,958.52	16.24	-
东兴证券	2	104,912,512.03	15.33	95,727.92	15.10	-
中信证券	3	97,902,149.78	14.30	91,179.01	14.38	-
广发证券	4	95,381,975.94	13.94	88,825.61	14.01	-
中金公司	2	84,632,691.69	12.36	78,820.59	12.44	-
华宝证券	1	41,332,163.56	6.04	38,080.90	6.01	-
长江证券	2	12,296,027.05	1.80	11,328.80	1.79	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
湘财证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中金财富证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-

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。

3、本报告期内本基金无变更租用证券公司交易单元的情况。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
华泰证券	-	-	7,000,000.00	100.00	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	405,127.70	100.00	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-

上海证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金财富 证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2022 年 5 月 28 日
2	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	2022 年 5 月 26 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	2022 年 5 月 11 日
4	华泰柏瑞基金管理有限公司关于参加工商银行基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2022 年 1 月 4 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	2022 年 1 月 1 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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	20220107-20220630;	60,218,308.49	0.00	0.00	60,218,308.49	24.4689
产品特有风险							

本基金报告期内有单一机构持有基金份额超过 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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层及托管人住所

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司。

客户服务热线：400-888-0001（免长途费） 021-3878 4638

公司网址：www.huatai-pb.com

华泰柏瑞基金管理有限公司

2022 年 8 月 30 日