

# 华泰柏瑞量化明选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：中国建设银行股份有限公司

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、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设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，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 2022 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	16
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	16
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>16</b>
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	17
6.3 净资产（基金净值）变动表	19
6.4 报表附注	22
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>45</b>
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
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	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	54
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	54

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	54
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	54
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	54
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	54
7.12 投资组合报告附注 .....	54
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>55</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	56
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 .....	56
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>56</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>57</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	57
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 .....	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	57
10.4 基金投资策略的改变 .....	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	57
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 .....	57
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	57
10.8 其他重大事件 .....	60
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>60</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	60
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>60</b>
12.1 备查文件目录 .....	60
12.2 存放地点 .....	60
12.3 查阅方式 .....	60

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞量化明选混合型证券投资基金	
基金简称	华泰柏瑞量化明选	
基金主代码	006942	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 3 月 25 日	
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	22,502,975.34 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华泰柏瑞量化明选 A	华泰柏瑞量化明选 C
下属分级基金的交易代码	006942	006943
报告期末下属分级基金的份额总额	22,313,902.39 份	189,072.95 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	利用定量投资模型，在力求有效控制投资风险的前提下，力争实现达到或超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	<p>1、股票投资策略</p> <p>本基金主要利用定量投资模型，通过主动管理，使用量化方法选取并持有预期收益较好的股票构成投资组合，在有效控制风险的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。本基金股票资产的投资比例占基金资产的 60-95%。</p> <p>2、债券组合投资策略</p> <p>本基金债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。本基金管理人将基于对国内外宏观经济形势的深入分析、国内财政政策与货币市场政策等因素对债券的影响，进行合理的利率预期，判断市场的基本走势，制定久期控制下的资产类属配置策略。在债券投资组合构建和管理过程中，本基金管理人将具体采用期限结构配置、市场转换、信用利差和相对价值判断、信用风险评估、现金管理等管理手段进行个券选择。</p> <p>3、资产支持证券投资策略 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 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</p>

	<p>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、股指期货投资策略 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、交易活跃的股指期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。若法律法规或监管机构以后允许基金投资如互换等其他金融衍生品种，本基金将以风险管理和组合优化为目的，根据届时法律法规的相关规定参与投资。</p> <p>6、融资业务的投资策略 本基金参与融资业务，将综合考虑融资成本、保证金比例、冲抵保证金证券折算率、信用资质等条件，选择合适的交易对手方。同时，在保障基金投资组合充足流动性以及有效控制融资杠杆风险的前提下，确定融资比例。待监管机构允许本基金参与融券交易及转融通证券出借业务后，在法律法规允许的范围内，在不改变基金的风险收益特征及对基金份额持有人无不利影响的前提下，本基金可参与相关业务，以提高组合的投资效率，从而更好地实现投资目标。具体参与投资的比例将按照届时相关法律法规的规定执行。</p>
业绩比较基准	95%*MSCI 中国 A 股国际指数收益率+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	中国建设银行股份有限公司
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	021-60637111
传真	021-38601799	021-60635778
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	北京市西城区金融大街 25 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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	200135	100033
法定代表人	贾波	田国立

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.huatai-pb.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
----	----	------

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

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

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)	
	华泰柏瑞量化明选 A	华泰柏瑞量化明选 C
本期已实现收益	-2,238,149.50	-19,243.17
本期利润	-2,641,690.96	-22,527.41
加权平均基金份额 本期利润	-0.1142	-0.1135
本期加权平均净 值利润率	-7.69%	-7.73%
本期基金份额净 值增长率	-6.29%	-6.41%
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	12,330,780.33	100,978.13
期末可供分配基 金份额利润	0.5526	0.5341
期末基金资产净 值	34,644,682.72	290,051.08
期末基金份额净 值	1.5526	1.5341
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	55.26%	53.41%

注：1、所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。

### 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

华泰柏瑞量化明选 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	8.93%	0.95%	9.10%	1.02%	-0.17%	-0.07%
过去三个月	6.47%	1.35%	6.54%	1.41%	-0.07%	-0.06%
过去六个月	-6.29%	1.33%	-8.46%	1.40%	2.17%	-0.07%
过去一年	-8.88%	1.13%	-11.59%	1.18%	2.71%	-0.05%
过去三年	52.85%	1.19%	26.98%	1.20%	25.87%	-0.01%
自基金合同生效起至今	55.26%	1.15%	25.19%	1.23%	30.07%	-0.08%

华泰柏瑞量化明选 C

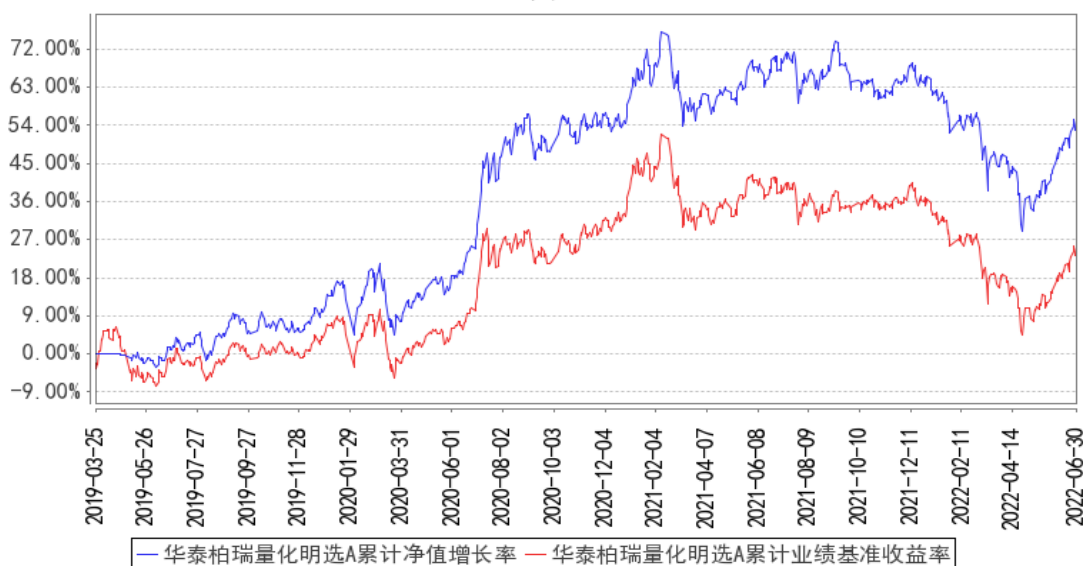
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	8.92%	0.95%	9.10%	1.02%	-0.18%	-0.07%
过去三个月	6.41%	1.35%	6.54%	1.41%	-0.13%	-0.06%
过去六个月	-6.41%	1.33%	-8.46%	1.40%	2.05%	-0.07%
过去一年	-9.11%	1.14%	-11.59%	1.18%	2.48%	-0.04%



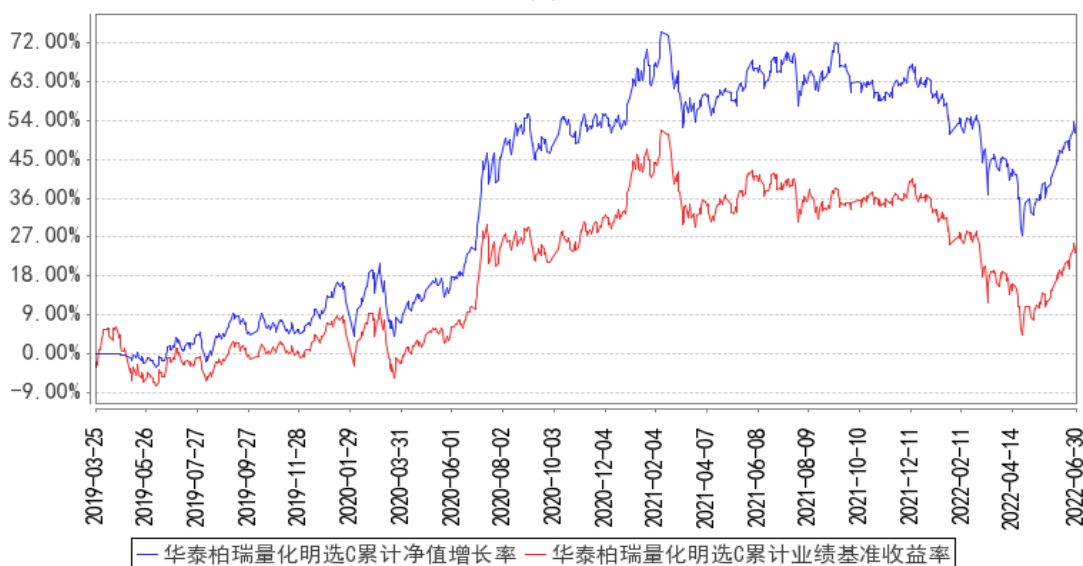
过去三年	51.28%	1.19%	26.98%	1.20%	24.30%	-0.01%
自基金合同生效起至今	53.41%	1.15%	25.19%	1.23%	28.22%	-0.08%

### 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

华泰柏瑞量化明选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



华泰柏瑞量化明选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：图示日期为 2019 年 3 月 25 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		
凌若冰	本基金的基金经理	2021 年 9 月 17 日	-	10 年	芝加哥大学金融数学硕士。2012 年 10 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任产品开发专员、高级产品经理、研究员、高级研究员、专户投资经理。2021 年 9 月起任华泰柏瑞量化明选混合型证券投资基金和华泰柏瑞港股通量化灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
盛豪	量化与海外投资部量化投资总监、本基金的基金经理	2019 年 3 月 25 日	-	14 年	英国剑桥大学数学系硕士。2007 年 10 月至 2010 年 3 月任 Wilshire Associates 量化研究员，2010 年 11 月至 2012 年 8 月任 Goldenberg Hehmeyer Trading Company 交易员。2012 年 9 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任量化投资部研究员、基金经理助理。2015 年 1 月起任量化投资部副总监，2015 年 10 月起任华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 12 月至 2018 年 11 月任华泰柏瑞行业竞争优势灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 3 月至 2018 年 10 月任华泰柏瑞盛利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 3 月至 2018 年 11 月任华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 3 月至 2018 年 3 月任华泰柏瑞嘉利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 4 月至 2018 年 4 月任华泰柏

					<p>瑞泰利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 4 月至 2019 年 3 月任华泰柏瑞睿利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 6 月至 2020 年 6 月任华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 9 月起任华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 12 月起任华泰柏瑞港股通量化灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 3 月起任华泰柏瑞量化明选混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 12 月起任华泰柏瑞量化创享混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月起任华泰柏瑞量化先行混合型证券投资基金和华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	--	---

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

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

目前公司公募基金经理有兼任私募资产管理计划投资经理的情况，兼任业务遵照相关法律法规要求进行，同时遵守公司公平交易制度。公司机构设置合理，公平交易的相关管理制度健全，投资决策流程完善，各项制度执行情况良好。交易价差分析表明公司旗下各基金均得到了公平对

待，不存在非公平交易和利益输送的行为。经过对不同基金之间交易相同证券时的同向交易价差进行分析发现，报告期内基金之间的买卖交易价差总体上处于正常的合理水平。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

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

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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明选 A 的基金份额净值为 1.5526 元，本报告期基金份额净值增长率为-6.29%，同期业绩比较基准收益率为-8.46%，截至本报告期末华泰柏瑞量化明选 C 的基金份额净值为 1.5341 元，本报告期基金份额净值增长率为-6.41%，同期业绩比较基准收益率为-8.46%。

## 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可能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

截止本报告期末，因赎回等原因，本基金存在连续 60 个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形，但无基金份额持有人数量低于 200 人的情形。

本基金管理人已于 2021 年 9 月 1 日将《华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞量化明选混合型证券投资基金基金资产净值低于五千万元情况的报告》上报中国证监会。

## § 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金

法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了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，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支、等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

## 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

本托管人复核审查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。

# § 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：华泰柏瑞量化明选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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	2,920,404.91	3,657,132.25
结算备付金		55,170.69	50,928.90
存出保证金		2,419.47	2,847.78
交易性金融资产	6.4.7.2	31,981,982.67	36,201,431.71
其中：股票投资		31,981,982.67	36,201,431.71
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		303,021.57	46,348.06
应收股利		-	-
应收申购款		808.18	3,835.38
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	404.60
资产总计		35,263,807.49	39,962,928.68
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年6月30日</b>	<b>上年度末 2021年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		182,724.05	352.22
应付赎回款		3,640.67	1,633.20
应付管理人报酬		41,482.21	51,016.66
应付托管费		6,913.71	8,502.76
应付销售服务费		58.23	79.90
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	94,254.82	144,686.12
负债合计		329,073.69	206,270.86
<b>净资产:</b>			
实收基金	6.4.7.10	22,502,975.34	23,997,220.41
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	12,431,758.46	15,759,437.41
净资产合计		34,934,733.80	39,756,657.82
负债和净资产总计		35,263,807.49	39,962,928.68

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额总额 22,502,975.34 份，其中下属 A 类基金份额净值 1.5526 元，基金份额总额 22,313,902.39 份；下属 C 类基金份额净值 1.5341 元，基金份额总额 189,072.95 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞量化明选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		-2,303,330.80	4,109,441.04

1. 利息收入		6,199.99	8,475.42
其中：存款利息收入	6.4.7.13	6,199.99	8,446.42
债券利息收入		-	29.00
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-1,903,321.58	4,708,489.01
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-2,279,707.57	4,272,423.79
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	3,126.97	12,211.15
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	-	-
股利收益	6.4.7.19	373,259.02	423,854.07
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	-406,825.70	-630,395.76
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	616.49	22,872.37
<b>减：二、营业总支出</b>		360,887.57	663,610.16
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	258,193.19	369,204.44
2. 托管费	6.4.10.2.2	43,032.27	61,533.99
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	361.73	775.27
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		-	0.05
8. 其他费用	6.4.7.23	59,300.38	232,096.41
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-2,664,218.37	3,445,830.88
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-2,664,218.37	3,445,830.88

五、其他综合收益的税后净额			-
六、综合收益总额			-2,664,218.37
			3,445,830.88

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华泰柏瑞量化明选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)	23,997,220.41	-	15,759,437.41	39,756,657.82
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)	23,997,220.41	-	15,759,437.41	39,756,657.82
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-1,494,245.07	-	-3,327,678.95	-4,821,924.02
(一)、综合收益总额	-	-	-2,664,218.37	-2,664,218.37
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以	-1,494,245.07	-	-663,460.58	-2,157,705.65

“-”号填列)				
其中:1. 基金申购款	228,762.76	-	115,018.14	343,780.90
2. 基金赎回款	-1,723,007.83	-	-778,478.72	-2,501,486.55
(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)	22,502,975.34	-	12,431,758.46	34,934,733.80
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)	36,000,187.93	-	21,219,228.22	57,219,416.15
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

二、本 期初 净 资 产(基 金 净 值)	36,000,187.93	-	21,219,228.22	57,219,416.15
三、本 期 增 减 变 动 额(减 少以“- ” 号 填 列)	-7,286,665.22	-	-1,009,380.22	-8,296,045.44
(一)、 综 合 收 益 总 额	-	-	3,445,830.88	3,445,830.88
(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)	-7,286,665.22	-	-4,455,211.10	-11,741,876.32
其中:1. 基 金 申 购 款	6,749,015.95	-	4,527,143.22	11,276,159.17
2 .基 金 赎 回 款	-14,035,681.17	-	-8,982,354.32	-23,018,035.49
(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、本期期末净资产(基金净值)	28,713,522.71	-	20,209,848.00	48,923,370.71

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

华泰柏瑞量化明选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[2018]第 1325 号《关于准予华泰柏瑞量化明选混合型证券投资基金募集的批复》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《华泰柏瑞量化明选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 969,420,400.50 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2019)第 0155 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞量化明选混合型证券投资基金基金合同》于 2019 年 3 月 25 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 970,069,050.67 份基金份额,其中认购资金利息折合 648,650.17 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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称“建设银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞量化明选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(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、存托凭证、债券(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、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(但须符合中国证监会相关规定)。本基金将根据法律法规的规定参与融资业务。本基金持有的股票资产及存托凭证占基金资产的 60%-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%;本基金参与

融资业务时，在任何交易日日终，持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%。本基金的业绩比较基准为： $95\% \times \text{MSCI 中国 A 股国际指数收益率} + 5\% \times \text{银行活期存款利率 (税后)}$ 。

本财务报表由本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》、《华泰柏瑞量化明选混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 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、应收利息、应收证券清算款和应收申购款，金额分别为 3,657,132.25 元、50,928.90 元、2,847.78 元、404.60 元、46,348.06 元和 3,835.38 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、其他资产-应收利息、应收清算款和应收申购款，金额分别为 3,657,504.02 元、50,960.30 元、2,849.21 元、0.00 元、46,348.06 元和 3,835.38 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 36,201,431.71 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 36,201,431.71 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、应付销售服务费和应付交易费用，金额分别为 352.22 元、1,633.20 元、51,016.66 元、8,502.76 元、79.90 元和 44,686.12 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、应付销售服务费和其他负债-应付交易费用，金额分别为 352.22 元、1,633.20 元、51,016.66 元、8,502.76 元、79.90 元和 44,686.12 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[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

(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费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	2,920,404.91
等于：本金	2,920,123.97
加：应计利息	280.94
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	2,920,404.91

##### 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	30,368,286.91	-	31,981,982.67	1,613,695.76
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		30,368,286.91	-	31,981,982.67	1,613,695.76

#### 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：无。

##### 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：无。

##### 6.4.7.4.2 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：截至本报告期末，本基金未持有债权投资。

##### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：截至本报告期末，本基金未持有债权投资。

#### 6.4.7.6 其他债权投资

##### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：截至本报告期末，本基金未持有其他债权投资。

##### 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：截至本报告期末，本基金未持有其他债权投资。

### 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：截至本报告期末，本基金未持有其他权益工具。

#### 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：截至本报告期末，本基金未持有其他权益工具。

### 6.4.7.8 其他资产

注：截至本报告期末，本基金未持有其他资产。

### 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	4.67
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	44,659.77
其中：交易所市场	44,659.77
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	49,590.38
合计	94,254.82

### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

#### 华泰柏瑞量化明选 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	23,794,410.07	23,794,410.07
本期申购	215,428.59	215,428.59
本期赎回（以“-”号填列）	-1,695,936.27	-1,695,936.27
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	22,313,902.39	22,313,902.39

#### 华泰柏瑞量化明选 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	202,810.34	202,810.34
本期申购	13,334.17	13,334.17

本期赎回（以“-”号填列）	-27,071.56	-27,071.56
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	189,072.95	189,072.95

#### 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

华泰柏瑞量化明选 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	19,456,678.80	-3,826,862.37	15,629,816.43
本期利润	-2,238,149.50	-403,541.46	-2,641,690.96
本期基金份额交易产生的变动数	-1,130,583.76	473,238.62	-657,345.14
其中：基金申购款	167,124.67	-58,564.24	108,560.43
基金赎回款	-1,297,708.43	531,802.86	-765,905.57
本期已分配利润	-	-	-
本期末	16,087,945.54	-3,757,165.21	12,330,780.33

华泰柏瑞量化明选 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	161,976.17	-32,355.19	129,620.98
本期利润	-19,243.17	-3,284.24	-22,527.41
本期基金份额交易产生的变动数	-10,152.49	4,037.05	-6,115.44
其中：基金申购款	10,247.79	-3,790.08	6,457.71
基金赎回款	-20,400.28	7,827.13	-12,573.15
本期已分配利润	-	-	-
本期末	132,580.51	-31,602.38	100,978.13

#### 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	5,757.18
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	421.79
其他	21.02
合计	6,199.99

注：其他为结算保证金利息收入和直销申购款利息收入。

#### 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
卖出股票成交总额	24,660,693.59
减：卖出股票成本总额	26,868,273.34
减：交易费用	72,127.82
买卖股票差价收入	-2,279,707.57

#### 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	7.75
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	3,119.22
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	3,126.97

##### 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	34,127.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	31,000.00
减：应计利息总额	7.75
减：交易费用	0.03
买卖债券差价收入	3,119.22

##### 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

##### 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

#### 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：无。

**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。

**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。

**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：无。

**6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

注：无。

**6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

注：无。

**6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

注：无。

**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：无。

**6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益**

注：无。

**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	373,259.02
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	373,259.02

**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	-406,825.70

股票投资	-406,825.70
债券投资	-
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	-406,825.70

#### 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	616.47
基金转换费收入	0.02
合计	616.49

#### 6.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期内无信用减值损失。

#### 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	24,795.19
信息披露费	24,795.19
证券出借违约金	-
银行划款手续费	710.00
银行间费用	9,000.00
合计	59,300.38

#### 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、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行股份有限公司”）	基金托管人
华泰证券（“华泰证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
华泰联合证券（“华泰联合证券”）	基金管理人的股东的子公司

注：关联方与基金进行的关联交易均在正常业务范围内按照一般商业条款而订立的。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

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	3,692,393.77	8.09	20,412,640.58	19.45

###### 6.4.10.1.2 权证交易

注：无。

###### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	3,428.19	8.24	-	-
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 (%)
华泰证券	18,601.72	21.21	-	-

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	258,193.19	369,204.44
其中：支付销售机构的客户维护费	79,628.23	129,760.38

注：本基金应支付基金管理人报酬，按前一日基金资产净值的 1.50%的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的管理人报酬

E 为前一日的基金资产净值

基金管理人报酬每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前三个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

##### 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	43,032.27	61,533.99

注：本基金应支付基金托管人托管费，按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前三个工作日内从基金资产中一次性支取。

#### 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		
	华泰柏瑞量化明选 A	华泰柏瑞量化明选 C	合计
华泰柏瑞基金管理有限公司	0.00	56.90	56.90
合计	0.00	56.90	56.90
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		
	华泰柏瑞量化明选 A	华泰柏瑞量化明选 C	合计
华泰柏瑞基金管理有限公司	0.00	63.35	63.35
合计	0.00	63.35	63.35

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.25% 的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

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

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：无。

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

注：无。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
		华泰柏瑞量化明选 A
基金合同生效日（2019 年 3 月 25 日）持有的基金份额	0.00	0.00
报告期初持有的基金份额	3,577,817.53	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份 额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	3,577,817.53	0.00
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	15.8993%	0.0000%
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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
		华泰柏瑞量化明选 A
基金合同生效日（2019 年 3 月 25 日）持有的基金份额	0.00	0.00
报告期初持有的基金份额	0.00	0.00
报告期间申购/买入总份额	3,577,817.53	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份 额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	3,577,817.53	0.00
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	12.4604%	0.0000%

注：1. 期间买入/申购总份额含转换入份额，期间卖出/赎回总份额含转换出份额。

2. 基金管理人投资本基金适用的认(申)购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

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

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
中国建设银行股份有限公司	2,920,404.91	5,757.18	4,545,894.03	7,477.43

注：本基金的银行存款由基金托管人建设银行保管，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
-	-	-	-	-	-
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
华泰联合证券有限责任公司	605389	长龄液压	网下申购	142	5,594.80
华泰联合证券有限责任公司	605499	东鹏饮料	网下申购	284	13,140.68

#### 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：无。

#### 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

注：截至本报告期末，本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

##### 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的流通受限股票。

### 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：无。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：无。

### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

### 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建设银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于 2022 年 6 月 30 日，本基金无债券投资(2021 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：无。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。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票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

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

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	2,920,404.91	-	-	-	-	-	2,920,404.91
结算备付金	55,170.69	-	-	-	-	-	55,170.69
存出保证金	2,419.47	-	-	-	-	-	2,419.47
交易性金融资产	-	-	-	-	-	31,981,982.67	31,981,982.67
应收申购款	-	-	-	-	-	808.18	808.18
应收清算款	-	-	-	-	-	303,021.57	303,021.57
资产总计	2,977,995.07	-	-	-	-	32,285,812.42	35,263,807.49
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	3,640.67	3,640.67
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	41,482.21	41,482.21
应付托管费	-	-	-	-	-	6,913.71	6,913.71
应付清算款	-	-	-	-	-	182,724.05	182,724.05
应付销售服务费	-	-	-	-	-	58.23	58.23
其他负债	-	-	-	-	-	94,254.82	94,254.82
负债总计	-	-	-	-	-	329,073.69	329,073.69
利率敏感度缺口	2,977,995.07	-	-	-	-	-31,956,738.73	34,934,733.80

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	3,657,132.25	-	-	-	-	-	3,657,132.25
结算备付金	50,928.90	-	-	-	-	-	50,928.90
存出保证金	2,847.78	-	-	-	-	-	2,847.78
交易性金融资产	-	-	-	-	-	36,201,431.71	36,201,431.71
应收申购款	-	-	-	-	-	3,835.38	3,835.38
应收证券清算款	-	-	-	-	-	46,348.06	46,348.06
其他资产	-	-	-	-	-	404.60	404.60
资产总计	3,710,908.93	-	-	-	-	36,252,019.75	39,962,928.68
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,633.20	1,633.20
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	51,016.66	51,016.66
应付托管费	-	-	-	-	-	8,502.76	8,502.76
应付证券清算款	-	-	-	-	-	352.22	352.22
应付销售服务费	-	-	-	-	-	79.90	79.90
其他负债	-	-	-	-	-	144,686.12	144,686.12
负债总计	-	-	-	-	-	206,270.86	206,270.86
利率敏感度缺口	3,710,908.93	-	-	-	-	-36,045,748.89	39,756,657.82

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：同），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。本基金投资组合中股票资产及存托凭证占基金资产的比例 60%-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%；本基金参与融资业务时，在任何交易日日终，持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%。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	31,981,982.67	91.55	36,201,431.71	91.06
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	31,981,982.67	91.55	36,201,431.71	91.06

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除 MSCI 中国 A 股国际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	MSCI 中国 A 股国际指数上升 5%	1,657,784.13	1,663,226.19
	MSCI 中国 A 股国际	-1,657,784.13	-1,663,226.19

	指数下降 5%		
--	---------	--	--

#### 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	31,981,982.67	36,197,927.35
第二层次	-	3,504.36
第三层次	-	-
合计	31,981,982.67	36,201,431.71

###### 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	31,981,982.67	90.69
	其中：股票	31,981,982.67	90.69
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	2,975,575.60	8.44
8	其他各项资产	306,249.22	0.87
9	合计	35,263,807.49	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	166,537.00	0.48
B	采矿业	1,769,978.00	5.07
C	制造业	18,055,001.56	51.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	795,724.00	2.28
E	建筑业	456,993.00	1.31
F	批发和零售业	342,958.00	0.98
G	交通运输、仓储和邮政业	1,750,489.64	5.01
H	住宿和餐饮业	102,856.00	0.29
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,103,593.75	3.16
J	金融业	5,619,733.30	16.09
K	房地产业	480,388.00	1.38

L	租赁和商务服务业	514,632.42	1.47
M	科学研究和技术服务业	332,087.00	0.95
N	水利、环境和公共设施管理业	199,141.00	0.57
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	120,830.00	0.35
R	文化、体育和娱乐业	171,040.00	0.49
S	综合	-	-
	合计	31,981,982.67	91.55

### 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投资股票。

### 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	600519	贵州茅台	700	1,431,500.00	4.10
2	300750	宁德时代	1,000	534,000.00	1.53
3	600036	招商银行	12,300	519,060.00	1.49
4	600873	梅花生物	38,500	434,280.00	1.24
5	002594	比亚迪	1,300	433,537.00	1.24
6	600900	XD 长江电	16,700	386,104.00	1.11
7	300457	赢合科技	11,600	329,556.00	0.94
8	300803	指南针	5,600	329,168.00	0.94
9	601328	交通银行	65,100	324,198.00	0.93
10	600919	江苏银行	45,400	323,248.00	0.93
11	688303	大全能源	4,500	307,440.00	0.88
12	601012	隆基绿能	4,610	307,164.30	0.88
13	601166	兴业银行	15,200	302,480.00	0.87
14	000596	古井贡酒	1,200	299,592.00	0.86
15	600438	通威股份	5,000	299,300.00	0.86
16	688005	容百科技	2,200	284,768.00	0.82
17	000568	泸州老窖	1,100	271,194.00	0.78
18	601919	中远海控	18,570	258,123.00	0.74
19	601601	中国太保	10,800	254,124.00	0.73
20	688200	华峰测控	693	246,985.20	0.71
21	600809	山西汾酒	760	246,848.00	0.71
22	601728	中国电信	63,600	237,228.00	0.68
23	601318	中国平安	5,000	233,450.00	0.67
24	600929	雪天盐业	24,300	225,504.00	0.65
25	688508	芯朋微	3,000	223,500.00	0.64
26	000858	五粮液	1,100	222,123.00	0.64

27	300171	东富龙	6,500	220,415.00	0.63
28	300390	天华超净	2,500	218,500.00	0.63
29	603565	中谷物流	13,704	217,482.48	0.62
30	601336	新华保险	6,700	215,673.00	0.62
31	002736	国信证券	22,500	215,325.00	0.62
32	601988	中国银行	65,700	214,182.00	0.61
33	000001	平安银行	14,200	212,716.00	0.61
34	600546	山煤国际	10,900	212,114.00	0.61
35	600566	济川药业	7,700	209,132.00	0.60
36	600030	中信证券	9,440	204,470.40	0.59
37	601319	中国人保	40,300	203,918.00	0.58
38	002034	旺能环境	9,700	199,141.00	0.57
39	600863	内蒙华电	53,900	196,735.00	0.56
40	002539	云图控股	12,200	195,078.00	0.56
41	601288	农业银行	63,600	192,072.00	0.55
42	601211	国泰君安	12,600	191,520.00	0.55
43	600048	保利发展	10,900	190,314.00	0.54
44	600662	外服控股	28,000	189,000.00	0.54
45	002466	天齐锂业	1,500	187,200.00	0.54
46	000848	承德露露	19,200	185,856.00	0.53
47	002978	安宁股份	4,800	185,424.00	0.53
48	605123	派克新材	1,300	182,936.00	0.52
49	603599	广信股份	6,440	181,286.00	0.52
50	000975	银泰黄金	18,600	181,164.00	0.52
51	002142	宁波银行	5,030	180,124.30	0.52
52	601598	中国外运	45,282	175,694.16	0.50
53	000951	中国重汽	13,500	175,365.00	0.50
54	000625	长安汽车	10,100	174,932.00	0.50
55	601668	中国建筑	32,600	173,432.00	0.50
56	300772	运达股份	6,700	170,448.00	0.49
57	601231	环旭电子	11,800	169,448.00	0.49
58	603198	迎驾贡酒	2,600	169,364.00	0.48
59	002475	立讯精密	5,000	168,950.00	0.48
60	000933	神火股份	12,800	167,424.00	0.48
61	601088	中国神华	5,000	166,500.00	0.48
62	601577	长沙银行	20,300	160,979.00	0.46
63	601658	邮储银行	29,700	160,083.00	0.46
64	600104	上汽集团	8,900	158,509.00	0.45
65	300037	新宙邦	3,000	157,680.00	0.45
66	600057	厦门象屿	17,700	155,583.00	0.45
67	603659	璞泰来	1,840	155,296.00	0.44
68	600089	特变电工	5,600	153,384.00	0.44

69	601898	中煤能源	14,700	152,586.00	0.44
70	000002	万 科 A	7,400	151,700.00	0.43
71	000959	首钢股份	31,800	151,368.00	0.43
72	002812	恩捷股份	600	150,270.00	0.43
73	603885	吉祥航空	8,300	149,317.00	0.43
74	002460	赣锋锂业	1,000	148,700.00	0.43
75	601225	陕西煤业	7,000	148,260.00	0.42
76	000039	中集集团	10,500	145,425.00	0.42
77	300662	科锐国际	2,800	145,292.00	0.42
78	300059	东方财富	5,664	143,865.60	0.41
79	603369	今世缘	2,800	142,800.00	0.41
80	002738	中矿资源	1,540	142,619.40	0.41
81	600312	平高电气	17,300	138,054.00	0.40
82	000059	华锦股份	23,300	137,936.00	0.39
83	000932	华菱钢铁	26,900	136,921.00	0.39
84	300661	圣邦股份	750	136,515.00	0.39
85	300014	亿纬锂能	1,400	136,500.00	0.39
86	600499	科达制造	6,600	136,224.00	0.39
87	601222	林洋能源	16,300	136,105.00	0.39
88	688388	嘉元科技	1,600	135,792.00	0.39
89	600029	南方航空	18,400	134,504.00	0.39
90	000785	居然之家	30,200	134,390.00	0.38
91	601899	紫金矿业	14,300	133,419.00	0.38
92	300122	智飞生物	1,200	133,212.00	0.38
93	600141	兴发集团	3,000	131,970.00	0.38
94	600690	海尔智家	4,800	131,808.00	0.38
95	600409	三友化工	16,000	131,040.00	0.38
96	601009	南京银行	12,200	127,124.00	0.36
97	300696	爱乐达	2,880	126,576.00	0.36
98	002468	申通快递	10,600	126,352.00	0.36
99	601717	郑煤机	8,700	125,367.00	0.36
100	603185	上机数控	800	124,792.00	0.36
101	300358	楚天科技	6,900	122,751.00	0.35
102	603383	顶点软件	4,800	118,512.00	0.34
103	600060	海信视像	9,400	117,500.00	0.34
104	688016	心脉医疗	600	116,886.00	0.33
105	301047	义翘神州	900	116,757.00	0.33
106	002605	姚记科技	7,000	116,550.00	0.33
107	688036	传音控股	1,300	115,999.00	0.33
108	002008	大族激光	3,500	115,955.00	0.33
109	300347	泰格医药	1,000	114,450.00	0.33
110	000728	国元证券	18,200	113,204.00	0.32



111	601515	东风股份	24,400	112,484.00	0.32
112	000792	盐湖股份	3,700	110,852.00	0.32
113	600392	盛和资源	4,900	110,740.00	0.32
114	002459	晶澳科技	1,400	110,460.00	0.32
115	300223	北京君正	1,000	106,250.00	0.30
116	600585	海螺水泥	3,000	105,840.00	0.30
117	000552	靖远煤电	24,500	105,595.00	0.30
118	002714	牧原股份	1,900	105,013.00	0.30
119	603501	韦尔股份	600	103,818.00	0.30
120	002410	广联达	1,900	103,436.00	0.30
121	601007	金陵饭店	9,200	102,856.00	0.29
122	600380	健康元	8,300	102,505.00	0.29
123	601928	凤凰传媒	14,200	101,530.00	0.29
124	300316	晶盛机电	1,500	101,385.00	0.29
125	600028	中国石化	24,600	100,368.00	0.29
126	603882	金域医学	1,200	99,060.00	0.28
127	300130	新国都	8,000	98,080.00	0.28
128	600233	圆通速递	4,800	97,872.00	0.28
129	601666	平煤股份	7,200	97,848.00	0.28
130	600309	万华化学	1,000	96,990.00	0.28
131	002601	龙佰集团	4,800	96,240.00	0.28
132	688298	东方生物	840	95,886.00	0.27
133	601881	中国银河	9,900	95,733.00	0.27
134	601066	中信建投	3,300	95,403.00	0.27
135	601699	潞安环能	6,500	95,030.00	0.27
136	600111	北方稀土	2,700	94,932.00	0.27
137	601857	中国石油	17,400	92,220.00	0.26
138	603317	天味食品	3,200	91,104.00	0.26
139	688289	圣湘生物	3,072	90,961.92	0.26
140	603043	广州酒家	3,600	90,792.00	0.26
141	300682	朗新科技	3,600	90,684.00	0.26
142	601669	中国电建	11,500	90,505.00	0.26
143	600027	华电国际	22,900	89,997.00	0.26
144	300450	先导智能	1,400	88,452.00	0.25
145	688617	惠泰医疗	400	87,632.00	0.25
146	600741	华域汽车	3,800	87,400.00	0.25
147	002241	歌尔股份	2,600	87,360.00	0.25
148	002709	天赐材料	1,400	86,884.00	0.25
149	601618	中国中冶	24,500	85,750.00	0.25
150	601169	北京银行	18,500	83,990.00	0.24
151	600362	江西铜业	4,700	83,801.00	0.24
152	601339	百隆东方	16,200	82,296.00	0.24

153	000921	海信家电	5,800	82,244.00	0.24
154	600050	中国联通	23,500	81,310.00	0.23
155	603128	华贸物流	8,000	80,240.00	0.23
156	000166	申万宏源	18,700	80,223.00	0.23
157	605168	三人行	734	79,367.42	0.23
158	688599	天合光能	1,200	78,300.00	0.22
159	300384	三联虹普	4,200	78,120.00	0.22
160	001979	招商蛇口	5,800	77,894.00	0.22
161	300573	兴齐眼药	500	76,660.00	0.22
162	000960	锡业股份	4,500	75,465.00	0.22
163	600188	兖矿能源	1,900	75,012.00	0.21
164	000776	广发证券	4,000	74,800.00	0.21
165	600582	天地科技	15,600	74,568.00	0.21
166	603416	信捷电气	1,800	74,052.00	0.21
167	300769	德方纳米	180	73,562.40	0.21
168	603026	石大胜华	500	72,675.00	0.21
169	300073	当升科技	800	72,272.00	0.21
170	002623	亚玛顿	1,800	72,108.00	0.21
171	300724	捷佳伟创	800	71,480.00	0.20
172	000923	河钢资源	5,200	70,876.00	0.20
173	300639	凯普生物	3,300	70,554.00	0.20
174	000672	上峰水泥	4,440	70,063.20	0.20
175	002493	荣盛石化	4,500	69,255.00	0.20
176	601615	明阳智能	2,000	67,600.00	0.19
177	601633	长城汽车	1,800	66,672.00	0.19
178	000725	京东方 A	16,900	66,586.00	0.19
179	600999	招商证券	4,600	66,286.00	0.19
180	600926	杭州银行	4,400	65,912.00	0.19
181	688690	纳微科技	800	64,648.00	0.19
182	300709	精研科技	2,160	63,914.40	0.18
183	601390	中国中铁	10,400	63,856.00	0.18
184	000429	粤高速 A	7,900	63,595.00	0.18
185	002645	华宏科技	2,900	63,278.00	0.18
186	600660	福耀玻璃	1,500	62,715.00	0.18
187	600153	建发股份	4,700	61,429.00	0.18
188	688100	威胜信息	2,900	60,871.00	0.17
189	600761	安徽合力	5,100	60,690.00	0.17
190	600383	金地集团	4,500	60,480.00	0.17
191	600875	东方电气	3,600	59,220.00	0.17
192	001965	招商公路	7,700	58,751.00	0.17
193	600132	重庆啤酒	400	58,640.00	0.17
194	002821	凯莱英	200	57,800.00	0.17

195	002405	四维图新	3,800	57,266.00	0.16
196	000034	神州数码	3,700	56,314.00	0.16
197	600018	上港集团	9,600	55,968.00	0.16
198	603096	新经典	3,000	55,350.00	0.16
199	300548	博创科技	3,100	55,242.00	0.16
200	000898	鞍钢股份	17,000	54,740.00	0.16
201	601985	中国核电	7,800	53,508.00	0.15
202	002129	TCL 中环	900	53,001.00	0.15
203	688686	奥普特	200	51,730.00	0.15
204	601398	工商银行	10,700	51,039.00	0.15
205	600548	深高速	4,900	46,746.00	0.13
206	600985	淮北矿业	3,200	46,592.00	0.13
207	600426	华鲁恒升	1,500	43,800.00	0.13
208	300378	鼎捷软件	2,600	42,822.00	0.12
209	600745	闻泰科技	500	42,555.00	0.12
210	002124	天邦食品	6,300	42,336.00	0.12
211	601838	成都银行	2,500	41,450.00	0.12
212	600282	南钢股份	13,100	41,265.00	0.12
213	603589	口子窖	700	41,027.00	0.12
214	601001	晋控煤业	2,300	40,825.00	0.12
215	000999	华润三九	900	40,500.00	0.12
216	601869	长飞光纤	1,300	40,196.00	0.12
217	603486	科沃斯	327	39,858.03	0.11
218	300363	博腾股份	500	38,995.00	0.11
219	600011	华能国际	5,500	38,720.00	0.11
220	603365	水星家纺	2,500	37,450.00	0.11
221	000799	酒鬼酒	200	37,162.00	0.11
222	000401	冀东水泥	3,500	36,820.00	0.11
223	600350	山东高速	7,000	36,750.00	0.11
224	601872	招商轮船	6,200	35,712.00	0.10
225	601995	中金公司	800	35,592.00	0.10
226	601868	中国能建	15,000	35,550.00	0.10
227	000789	万年青	3,200	34,688.00	0.10
228	601818	光大银行	11,300	34,013.00	0.10
229	000877	天山股份	2,700	33,210.00	0.10
230	000915	华特达因	800	33,080.00	0.09
231	688586	江航装备	1,200	31,932.00	0.09
232	688521	芯原股份	631	31,171.40	0.09
233	603456	九洲药业	600	31,020.00	0.09
234	000598	兴蓉环境	6,000	30,660.00	0.09
235	000567	海德股份	2,030	30,044.00	0.09
236	600063	皖维高新	3,900	29,562.00	0.08

237	603993	洛阳钼业	5,000	28,650.00	0.08
238	300482	万孚生物	700	28,497.00	0.08
239	600123	兰花科创	1,700	27,965.00	0.08
240	300219	鸿利智汇	3,100	26,970.00	0.08
241	300476	胜宏科技	1,400	25,704.00	0.07
242	601882	海天精工	1,200	24,732.00	0.07
243	601006	大秦铁路	3,700	24,383.00	0.07
244	600808	XD 马钢股	6,300	23,877.00	0.07
245	601077	渝农商行	6,400	23,680.00	0.07
246	603127	昭衍新药	200	22,760.00	0.07
247	300244	迪安诊断	700	21,770.00	0.06
248	600348	华阳股份	1,400	21,644.00	0.06
249	300218	安利股份	1,500	21,405.00	0.06
250	601916	浙商银行	6,200	20,584.00	0.06
251	300866	安克创新	300	19,896.00	0.06
252	002048	宁波华翔	1,200	19,224.00	0.06
253	600598	北大荒	1,300	19,188.00	0.05
254	601089	福元医药	895	18,839.75	0.05
255	000100	TCL 科技	3,800	18,202.00	0.05
256	600596	新安股份	760	16,454.00	0.05
257	300481	濮阳惠成	700	16,450.00	0.05
258	600782	新钢股份	3,000	15,120.00	0.04
259	601098	中南传媒	1,500	14,160.00	0.04
260	600998	九州通	1,100	13,101.00	0.04
261	600110	诺德股份	1,100	12,782.00	0.04
262	600219	南山铝业	3,300	12,177.00	0.03
263	600737	中粮糖业	1,500	11,280.00	0.03
264	002092	中泰化学	1,400	10,864.00	0.03
265	002233	塔牌集团	1,100	9,735.00	0.03
266	300861	美畅股份	100	9,269.00	0.03
267	601186	中国铁建	1,000	7,900.00	0.02
268	002497	雅化集团	200	6,530.00	0.02
269	001268	联合精密	218	6,042.96	0.02
270	300768	迪普科技	69	1,114.35	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	600919	江苏银行	340,315.00	0.86
2	300390	天华超净	330,854.00	0.83
3	601728	中国电信	302,573.00	0.76

4	300457	赢合科技	283,710.00	0.71
5	688200	华峰测控	264,787.11	0.67
6	300772	运达股份	262,623.00	0.66
7	002623	亚玛顿	251,809.00	0.63
8	688303	大全能源	247,818.03	0.62
9	300803	指南针	247,706.00	0.62
10	002475	立讯精密	227,812.00	0.57
11	600481	双良节能	215,929.00	0.54
12	002533	金杯电工	205,993.00	0.52
13	600863	内蒙华电	202,940.00	0.51
14	600566	济川药业	196,401.00	0.49
15	002597	金禾实业	196,166.00	0.49
16	600929	雪天盐业	186,540.00	0.47
17	002594	比亚迪	182,942.00	0.46
18	603993	洛阳钼业	180,987.00	0.46
19	600546	山煤国际	179,715.00	0.45
20	600519	贵州茅台	179,560.00	0.45

注：不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	385,270.00	0.97
2	600519	贵州茅台	363,971.00	0.92
3	002533	金杯电工	338,908.00	0.85
4	603444	吉比特	291,306.00	0.73
5	603986	兆易创新	291,289.00	0.73
6	300573	兴齐眼药	250,865.00	0.63
7	000498	山东路桥	244,353.00	0.61
8	600481	双良节能	229,098.00	0.58
9	002557	洽洽食品	213,078.00	0.54
10	300378	鼎捷软件	209,448.00	0.53
11	000830	鲁西化工	199,588.00	0.50
12	300740	水羊股份	198,659.15	0.50
13	002623	亚玛顿	198,092.00	0.50
14	002597	金禾实业	190,574.00	0.48
15	601398	工商银行	187,424.00	0.47
16	603566	普莱柯	187,302.00	0.47
17	688536	思瑞浦	186,412.00	0.47
18	603659	璞泰来	184,657.00	0.46
19	688357	建龙微纳	184,063.97	0.46
20	600036	招商银行	180,208.00	0.45

注：不考虑相关交易费用。

### 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	23,055,650.00
卖出股票收入（成交）总额	24,660,693.59

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投资。

### 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，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

#### 7.12.2 基金投资的前十名股票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。

### 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	2,419.47
2	应收清算款	303,021.57
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	808.18
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	306,249.22

### 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 量化明选 A	1,051	21,231.12	3,577,817.53	16.03	18,736,084.86	83.97
华泰柏瑞 量化明选 C	159	1,189.14	0.00	0	189,072.95	100.00
合计	1,186	18,973.84	3,577,817.53	15.90	18,925,157.81	84.10

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	华泰柏瑞量化明选 A	9.88	0.0000
	华泰柏瑞量化明选 C	12.02	0.0064
	合计	21.90	0.0001

### 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	华泰柏瑞量化明选 A	0
	华泰柏瑞量化明选 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	华泰柏瑞量化明选 A	0
	华泰柏瑞量化明选 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华泰柏瑞量化明选 A	华泰柏瑞量化明选 C
基金合同生效日 (2019年3月25日) 基金份额总额	967,664,458.17	2,404,592.50
本报告期期初基金份额总额	23,794,410.07	202,810.34
本报告期基金总申购份额	215,428.59	13,334.17
减：本报告期基金总赎回份额	1,695,936.27	27,071.56
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	22,313,902.39	189,072.95



## § 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。

报告期内基金托管人未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未改聘为其审计的会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中信建投	3	9,557,127.78	20.09	8,147.68	18.76	-
粤开证券	1	7,704,299.50	16.19	7,059.12	16.26	-
南京证券	2	6,437,145.38	13.53	5,994.52	13.80	-
天风证券	2	5,901,056.36	12.40	5,510.31	12.69	-
中泰证券	2	4,120,673.11	8.66	3,819.89	8.80	-
长江证券	2	4,072,617.12	8.56	3,792.35	8.73	-
华泰证券	5	3,692,393.77	7.76	3,428.19	7.89	-
招商证券	4	2,112,399.97	4.44	1,967.17	4.53	-

安信证券	1	1,963,306.48	4.13	1,828.10	4.21	-
民生证券	4	1,350,959.05	2.84	1,257.92	2.90	-
东方财富 证券	2	664,774.00	1.40	619.10	1.43	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
宏信证券	2	-	-	-	-	-
华宝证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证 券	2	-	-	-	-	-
万联证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
新时代证 券	1	-	-	-	-	-
信达证券	3	-	-	-	-	-
野村证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-

注：1、选择代理证券买卖的证券经营机构的标准：

- 1) 资金雄厚，信誉良好。
- 2) 财务状况良好，经营行为规范，最近一年未因重大违规行为而受到有关管理机关的处罚。
- 3) 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) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时、定期、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

议。

3. 本报告期内，新增安信证券的交易单元。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
中信建投	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	34,127.00	100.00	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-

西南证券	-	-	-	-	-	-
新时代证 券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
野村证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华泰柏瑞基金管理有限公司关于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
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 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

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

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

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

### 12.2 存放地点

上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

### 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。投资者对本报告如有疑问，可咨询基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司。客户服务热线：400-888-0001（免长途

费) 021-3878 4638 公司网址: [www.huatai-pb.com](http://www.huatai-pb.com)

华泰柏瑞基金管理有限公司

2022 年 8 月 30 日