

# 华泰柏瑞质量精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、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自 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	5
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>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
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	13
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	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	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
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>15</b>
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 净资产（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	21
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>48</b>
7.1 期末基金资产组合情况	48
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	48
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	49
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	55
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	56

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	56
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	56
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	56
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	56
7.12 投资组合报告附注 .....	56
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>57</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	57
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	57
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	58
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>58</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>58</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	58
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	59
10.4 基金投资策略的改变 .....	59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	59
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 .....	59
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	59
10.8 其他重大事件 .....	62
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>62</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 .....	62
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	62
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>63</b>
12.1 备查文件目录 .....	63
12.2 存放地点 .....	63
12.3 查阅方式 .....	63

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞质量精选混合型证券投资基金	
基金简称	华泰柏瑞质量精选混合	
基金主代码	010415	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 3 月 31 日	
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	212,605,713.06 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	华泰柏瑞质量精选混合 A	华泰柏瑞质量精选混合 C
下属分级基金的交 易代码	010415	010416
报告期末下属分级 基金的份额总额	205,357,141.73 份	7,248,571.33 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过深入的公司基本面研究，精选具有可持续高质量成长且估值具有吸引力的公司进行价值投资，在控制组合风险的基础上，实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金将通过研究国内国际宏观经济趋势、货币政策、财政政策、企业盈利周期、估值水平等可能影响证券市场的重要因素，对各大类资产的风险收益特征进行深入分析，在严格控制组合风险的基础上，调整或确定各大类资产的配置比例，实现基金资产的长期、稳定和持续增值。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率*70%+恒生指数收益率(使用估值汇率折算)*20%+上证国债指数收益率*10%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。 本基金可能投资港股通标的股票，除需承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险，还需承担汇率风险以及香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华泰柏瑞基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	刘万方	李申
	联系电话	021-38601777	021-60637102
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	lishen.zh@ccb.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	证券日报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.huatai-pb.com">http://www.huatai-pb.com</a>
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)		
	华泰柏瑞质量精选混合 A	华泰柏瑞质量精选混合 C	
本期已实现收益	-50,187,400.25	-1,818,887.45	
本期利润	-36,465,808.38	-1,334,202.42	
加权平均基金份额本期利润	-0.1752	-0.1785	
本期加权平均净值利润率	-19.99%	-20.48%	
本期基金份额净值增长率	-16.35%	-16.56%	
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	-25,295,359.19	-932,358.24
	期末可供分配基	-0.1232	-0.1286

基金份额利润		
期末基金资产净值	180,061,782.54	6,316,213.09
期末基金份额净值	0.8768	0.8714
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	-12.32%	-12.86%

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

华泰柏瑞质量精选混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	6.24%	1.57%	6.88%	0.99%	-0.64%	0.58%
过去三个月	-0.52%	1.85%	4.86%	1.30%	-5.38%	0.55%
过去六个月	-16.35%	1.68%	-7.03%	1.35%	-9.32%	0.33%
过去一年	-22.61%	1.83%	-12.33%	1.11%	-10.28%	0.72%
自基金合同生效起至今	-12.32%	1.76%	-9.97%	1.05%	-2.35%	0.71%

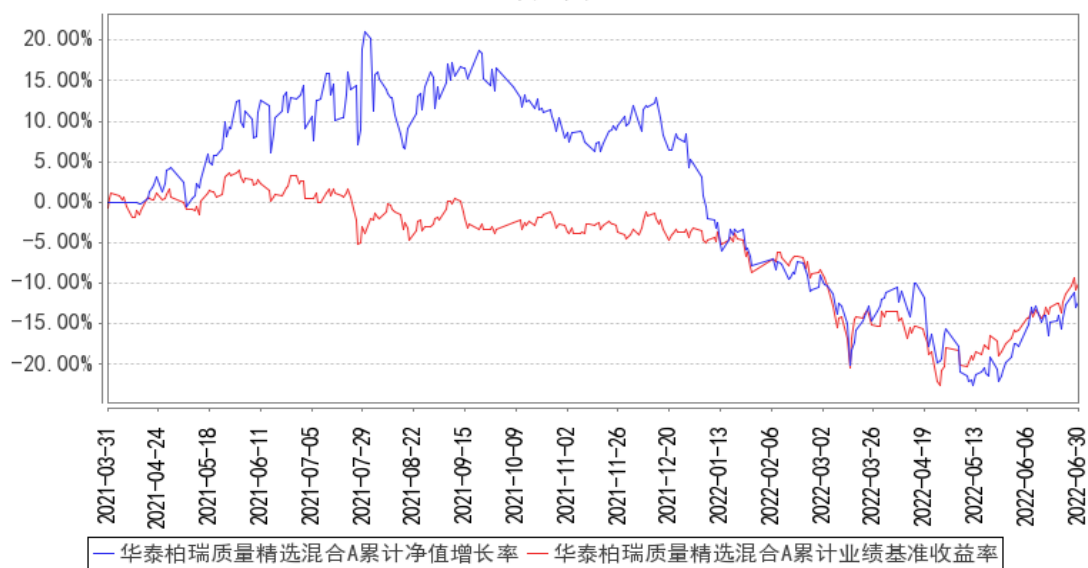
华泰柏瑞质量精选混合 C

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

	率①	准差②		④		
过去一个月	6.20%	1.57%	6.88%	0.99%	-0.68%	0.58%
过去三个月	-0.64%	1.85%	4.86%	1.30%	-5.50%	0.55%
过去六个月	-16.56%	1.68%	-7.03%	1.35%	-9.53%	0.33%
过去一年	-22.99%	1.83%	-12.33%	1.11%	-10.66%	0.72%
自基金合同生效起至今	-12.86%	1.76%	-9.97%	1.05%	-2.89%	0.71%

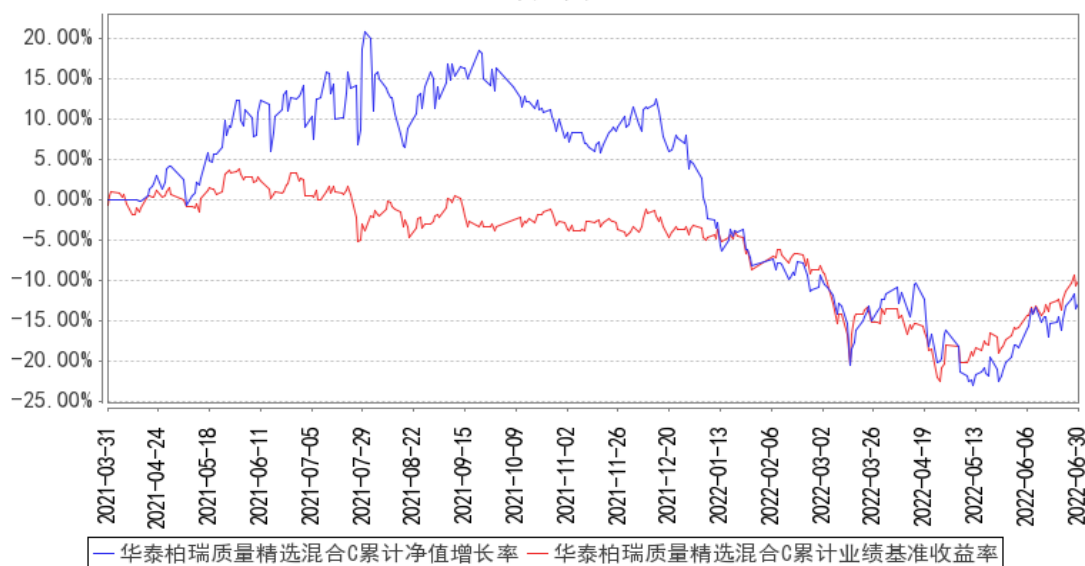
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华泰柏瑞质量精选混合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





华泰柏瑞质量精选混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、图示日期为 2021 年 3 月 31 日至 2022 年 6 月 30 日。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期，截至报告期末本基金的各项投资比例已达到基金合同投资范围中规定的比例。

## § 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		
李晓西	副总经理、本基金的基金经理	2021 年 3 月 31 日	-	23 年	副总经理，美国杜克大学工商管理硕士。曾任中银信托投资公司外汇交易结算员，银建实业股份有限公司证券投资经理，汉唐证券有限责任公司高级经理，美国信安环球股票有限公司董事总经理兼基金经理。2018 年 7 月加入华泰柏瑞基金管理有

					<p>限公司，2018 年 8 月起任公司副总经理。2020 年 2 月起任华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金、华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 3 月起任华泰柏瑞质量成长混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 1 月起任华泰柏瑞质量领先混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月起任华泰柏瑞质量精选混合型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。任职日期和离职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 年初以来，在全球经济增速预期放缓的背景下，国内外市场出现了一定波动。国内主要的全市场指数都有不同程度的回调。具体而言，今年 1 季度，新能源、医药、国防军工和消费等成长板块回调较大，而以金融、地产和大宗商品为代表的价值板块超额收益明显。5 月以来，新能源、国防军工和农林牧渔等板块迎来了较大幅度反弹，而医药和食品饮料总体反弹较弱；部分地产企业由于面临一定债务压力，近期也有一定回调。同时，在市场流动性较为充裕的背景下，A 股市场近期中小市值板块总体表现活跃。报告期内本基金表现低于业绩基准。

今年上半年，新冠疫情在海外有所回升并蔓延，国内部分地区也有零星发生，给我国宏观经济增速和消费复苏带来了一定压力。根据国家统计局公布的数据，今年 2 季度我国 GDP 增速为 0.4%，上半年为 2.5%，增速放缓。一些周期性行业由于受宏观经济增速放缓影响，近期表现不佳。同时受疫情影响的部分消费行业等也跑输市场。

在此期间，我们对投资组合进行了一定调整，总体方向是尽量增加受宏观经济增速放缓影响较小的行业配置，同时增加对企业盈利还处于稳健上升趋势的行业配置，降低基本面和盈利趋势下降行业的配置。由于今年市场行业轮动和市场风格变化较快，本基金在成长和价值、周期和非周期等领域均有所配置。考虑到部分高景气成长赛道业绩增长较为确定，本基金适当增加了一些高景气成长领域中高质量公司的配置。

##### 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质量精选混合 A 的基金份额净值为 0.8768 元，本报告期基金份额净值增长率为-16.35%，同期业绩比较基准收益率为-7.03%，截至本报告期末华泰柏瑞质量精选混合 C 的基金份额净值为 0.8714 元，本报告期基金份额净值增长率为-16.56%，同期业绩比较基准收益率为-7.03%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，从国内市场来看，之前疫情比较突出的地方疫情已经得到有效控制，复工复产和复商复市正稳步推进。国家稳增长的决心和政策还在进一步加强，财政、货币、产业政策等仍在继续发力，基建、新能源和汽车家电消费等刺激经济的政策或措施相继落地。各地对房地产市场的政策也在陆续边际优化，因城施策的范围和力度有所扩张，政策层面有助于地产市场的健康稳

定发展，相信接下来对我国稳经济和稳增长都将有一定作用。此外，随着部分互联网平台公司处罚的落地，平台经济也将在监管框架里逐步回到合理健康发展的轨道。总体而言，我国稳经济和稳增长的政策效果接下来将会逐渐体现。

海外市场来看，美国通胀自今年 3 月以来一直处于高位，6 月美国 CPI 同比 9.1% 创近 40 年新高，市场对于美国央行收紧预期的担忧提升，预计美国加息周期还将继续。由于全球能源价格高企，欧洲近期通胀也处于高位。欧美高通胀令市场担心美欧经济陷入衰退，从而对全球需求造成负面影响。在国内和国外一年的错位复苏后，各国由于经济复苏进度和通胀水平的不同，部分国家可能迎来刺激政策的退出。美国货币政策退出快于欧日。在美国本轮加息过程中，美债利率和美元指数上升，相对其他主要经济体货币有一定升值，导致美元回流美国，部分新兴市场有一定资金流出。此外，海外地缘政治也存在一定的不确定性，尤其是俄罗斯和乌克兰的局势紧张，导致原油和部分农产品价格上涨较多，将给全球权益类资产带来了一定的不确定性。

未来一段时间，我们重点关注的事件包括：国内经济数据的变化、国内财政和货币政策的走向、地产政策的边际变化、新冠疫情变化以及俄乌局势的变化。此外，近期市场将进入中报密集披露期，我们将密切关注基本面有实质改善，业绩可持续的高质量成长投资机会。

本基金将继续坚持以深入的基本面研究为核心，在个股选择上，坚持“成长、质量和估值”相结合的系统化投资理念，自下而上精选优秀个股，力争实现投资业绩的可复制性和可持续性。

展望下半年，本基金将继续加大在受宏观经济影响较小的行业的配置。新能源行业为国家战略发展方向，将会持续出现一些高质量的优质公司。食品饮料等消费行业持仓由于调整时间较长，基本面也接近底部区间，估值较为便宜，我们将继续坚定持有。在中小市值板块也将挖掘一些投资机会。配置的方向将兼顾成长与价值、周期和非周期、消费和稳增长等。总体而言，虽然市场短期有波动，我们对本基金目前的配置和持仓充满信心。需要特别提到的是一些消费和医药股票在经历了 2021 年 2 月以来大幅回调后，目前估值已经在合理区间，具有较好的长线投资价值。此外，全球疫情已经持续了一段时间，部分在疫情中业绩受损的投资标的目前估值还处于相对低位，预计等到国内和国外疫情进一步改善的阶段，这类股票业绩和估值可能会有一定修复。

我们还将继续扎根于寻找有长期业绩增长的高质量公司，寻找各行各业中长期可以胜出的公司，力争实现长期稳定的投资回报。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，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，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：华泰柏瑞质量精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	17,537,386.66	5,656,751.22
结算备付金		642,557.80	909,440.09
存出保证金		149,926.66	297,078.80
交易性金融资产	6.4.7.2	167,177,357.93	224,578,885.10

其中：股票投资		166,799,290.63	214,624,885.10
基金投资		-	-
债券投资		378,067.30	9,954,000.00
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		4,721,734.69	1,953,692.10
应收股利		732,036.13	-
应收申购款		17,411.04	134,982.50
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	39,498.45
资产总计		190,978,410.91	233,570,328.26
<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		3,720,374.91	203,601.63
应付赎回款		40,820.71	217,087.06
应付管理人报酬		223,792.32	313,328.81
应付托管费		37,298.71	52,221.45
应付销售服务费		2,535.22	3,810.46
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	575,593.41	749,337.99
负债合计		4,600,415.28	1,539,387.40
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	212,605,713.06	221,390,084.30
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-26,227,717.43	10,640,856.56
净资产合计		186,377,995.63	232,030,940.86
负债和净资产总计		190,978,410.91	233,570,328.26



注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额总额 212,605,713.06 份，其中下属 A 类基金份额净值 0.8768 元，基金份额总额 205,357,141.73 份；下属 C 类基金份额净值 0.8714 元，基金份额总额 7,248,571.33 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞质量精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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 3 月 31 日（基金合 同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-36,037,989.08	62,759,539.04
1. 利息收入		44,242.79	586,301.91
其中：存款利息收入	6.4.7.13	44,242.79	83,703.57
债券利息收入		-	73,652.74
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	428,945.60
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-50,307,328.08	10,370,439.21
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-51,576,814.05	9,753,584.03
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	9,243.74	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-
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	1,260,242.23	616,855.18
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	14,206,276.90	51,802,797.92
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	18,819.31	-
<b>减：二、营业总支出</b>		1,762,021.72	4,374,012.42

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,411,937.48	1,734,062.56
2. 托管费	6.4.10.2.2	235,322.91	289,010.45
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	16,239.71	12,290.17
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		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	98,521.62	2,338,649.24
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-37,800,010.80	58,385,526.62
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-37,800,010.80	58,385,526.62
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-37,800,010.80	58,385,526.62

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华泰柏瑞质量精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)	221,390,084.30	-	10,640,856.56	232,030,940.86
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)	221,390,084.30	-	10,640,856.56	232,030,940.86
三、本期增减变	-8,784,371.24	-	-36,868,573.99	-45,652,945.23

动额(减少以“-”号填列)				
(一)、综合收益总额	-	-	-37,800,010.80	-37,800,010.80
(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)	-8,784,371.24	-	931,436.81	-7,852,934.43
其中:1.基金申购款	7,082,660.51	-	-777,339.07	6,305,321.44
2.基金赎回款	-15,867,031.75	-	1,708,775.88	-14,158,255.87
(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)	212,605,713.06	-	-26,227,717.43	186,377,995.63
项目	上年度可比期间			

	2021 年 3 月 31 日（基金合同生效日）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)	439,483,211.76	-	-	439,483,211.76
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期末期初净资产(基金净值)	439,483,211.76	-	-	439,483,211.76
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-	-	58,385,526.62	58,385,526.62
(一)、综合收益总额	-	-	58,385,526.62	58,385,526.62
(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)	-	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-	-
(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)	439,483,211.76	-	58,385,526.62	497,868,738.38

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

韩勇

房伟力

赵景云

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞质量精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[2020]2462号《关于准予华泰柏瑞质量精选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《华泰柏瑞质量精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439,322,195.11元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2021)第0319号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞质量精选混合型证券投资基金基金合同》于2021年3月31日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为439,483,211.76份基金份额,其中认购资金利息折合161,016.65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。

根据《华泰柏瑞质量精选混合型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞质量精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，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许投资的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、存托凭证、债券（国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、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、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金还可以根据相关法律法规的规定参与融资业务。本基金股票资产的投资比例占基金资产的 60%-95%；投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率×70%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×20%+上证国债指数收益率×10%。

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”）、中国证监会公告[2010]5 号《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〉》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华泰柏瑞质量精选混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注 6.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

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 5,656,751.22 元、909,440.09 元、297,078.80 元、39,498.45 元、1,953,692.10 元和 134,982.50 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 5,658,152.59 元、909,890.21 元、297,225.76 元、0.00 元、1,953,692.10 元和 134,982.50 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 224,578,885.10 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 224,616,385.10 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 203,601.63 元、217,087.06 元、313,328.81 元、52,221.45 元、3,810.46 元、603,536.65 元和 801.34 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 203,601.63 元、217,087.06 元、313,328.81 元、52,221.45 元、3,810.46 元、603,536.65 元和 801.34 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[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

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

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册，H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	17,537,386.66
等于：本金	17,536,114.82
加：应计利息	1,271.84
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	17,537,386.66

##### 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	150,846,895.43	-	166,799,290.63	15,952,395.20	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	371,148.40	6,993.10	378,067.30	-74.20
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	371,148.40	6,993.10	378,067.30	-74.20
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	

其他	-	-	-	-
合计	151,218,043.83	6,993.10	167,177,357.93	15,952,321.00

### 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	73.89
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	488,739.07
其中：交易所市场	488,739.07
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	86,780.45
合计	575,593.41

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

##### 华泰柏瑞质量精选混合 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	213,414,103.03	213,414,103.03
本期申购	6,210,221.96	6,210,221.96
本期赎回（以“-”号填列）	-14,267,183.26	-14,267,183.26
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	205,357,141.73	205,357,141.73

##### 华泰柏瑞质量精选混合 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	7,975,981.27	7,975,981.27
本期申购	872,438.55	872,438.55
本期赎回（以“-”号填列）	-1,599,848.49	-1,599,848.49
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	7,248,571.33	7,248,571.33

#### 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

华泰柏瑞质量精选混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	26,761,745.83	-16,474,086.33	10,287,659.50
本期利润	-50,187,400.25	13,721,591.87	-36,465,808.38
本期基金份额交易产生的变动数	176,645.19	706,144.50	882,789.69
其中：基金申购款	-117,165.11	-546,681.36	-663,846.47
基金赎回款	293,810.30	1,252,825.86	1,546,636.16
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-23,249,009.23	-2,046,349.96	-25,295,359.19

华泰柏瑞质量精选混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	965,818.24	-612,621.18	353,197.06
本期利润	-1,818,887.45	484,685.03	-1,334,202.42
本期基金份额交易产生的变动数	-6,926.60	55,573.72	48,647.12
其中：基金申购款	-42,485.27	-71,007.33	-113,492.60
基金赎回款	35,558.67	126,581.05	162,139.72
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-859,995.81	-72,362.43	-932,358.24

#### 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	24,888.62
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	17,155.11
其他	2,199.06
合计	44,242.79

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	-51,576,814.05
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	-51,576,814.05

#### 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	617,536,260.29
减：卖出股票成本总额	667,049,705.24
减：交易费用	2,063,369.10
买卖股票差价收入	-51,576,814.05

#### 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	9,211.40
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	32.34
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	9,243.74

##### 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	10,338,394.60
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	10,287,533.20
减：应计利息总额	50,828.00
减：交易费用	1.06

买卖债券差价收入	32.34
----------	-------

**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**

注：本基金本报告期内无衍生工具收益——其他投资收益。

**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	1,260,242.23
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,260,242.23

#### 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	14,206,276.90
股票投资	14,205,951.10
债券投资	325.80
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	14,206,276.90

#### 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	17,927.64
基金转换费收入	891.67
合计	18,819.31

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	-
证券组合费	1,216.40
银行间账户服务费	9,300.00
银行划款手续费	1,224.77
合计	98,521.62

#### 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
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	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3月31日（基金合同生效日） 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	143,924,563.73	11.82	-	-

#### 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

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回购交易。

#### 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	133,837.08	12.02	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2021年3月31日（基金合同生效日）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	上年度可比期间
----	----	---------

	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 3 月 31 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,411,937.48	1,734,062.56
其中：支付销售机构的客户维护费	646,723.22	802,214.66

注：支付基金管理人华泰柏瑞基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 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 3 月 31 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	235,322.91	289,010.45

注：支付基金托管人中国建设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		
	华泰柏瑞质量精选混合 A	华泰柏瑞质量精选混合 C	合计
华泰证券股份有限公司	0.00	1,253.92	1,253.92
华泰柏瑞基金管理有限公司	0.00	31.38	31.38
合计	0.00	1,285.30	1,285.30
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021 年 3 月 31 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰柏瑞质量精选混合 A	华泰柏瑞质量精选混合 C	合计
华泰证券股份有限公司	0.00	1,745.50	1,745.50
华泰柏瑞基金管理有限公司	0.00	23.96	23.96

合计	0.00	1,769.46	1,769.46
----	------	----------	----------

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

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

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

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：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 3 月 31 日（基金合同生效日）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	17,537,386.66	24,888.62	102,435,934.67	69,387.29

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，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
华泰联合证券有限责任公司	301207	华兰疫苗	网下申购	1,212	68,938.56
上年度可比期间 2021 年 3 月 31 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张）	总金额
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

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	153	8,502.21	4,594.59	-
301110	青木股份	2022 年 3 月 4 日	6 个月	新股锁定期内	63.10	39.85	99	6,246.90	3,945.15	-
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	169	7,909.20	9,200.36	-
301122	采纳股份	2022 年 1 月 19 日	6 个月	新股锁定期内	50.31	70.37	139	6,993.09	9,781.43	-

		日									
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	-	
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	-	
301181	标榜股份	2022年 2月11日	6个月	新股锁定期内	40.25	30.59	147	5,916.75	4,496.73	-	
301196	唯科科技	2022年 1月4日	6个月	新股锁定期内	64.08	37.52	76	4,870.08	2,851.52	-	
301200	大族数控	2022年 2月18日	6个月	新股锁定期内	76.56	51.92	126	9,646.56	6,541.92	-	
301201	诚达药业	2022年 1月12日	6个月	新股锁定期内	72.69	71.54	126	9,158.94	9,014.04	-	
301206	三元生物	2022年 1月26日	6个月	新股锁定期内	109.30	45.69	135	9,837.00	6,168.15	-	
301207	华兰疫苗	2022年 2月10日	6个月	新股锁定期内	56.88	56.42	122	6,939.36	6,883.24	-	
301215	中汽股份	2022年 2月28日	6个月	新股锁定期内	3.80	6.39	2,108	8,010.40	13,470.12	-	
301222	浙江恒威	2022年 3月2日	6个月	新股锁定期内	33.98	28.96	176	5,980.48	5,096.96	-	
301235	华康医疗	2022年 1月21日	6个月	新股锁定期内	39.30	37.93	215	8,449.50	8,154.95	-	
600938	中国海油	2022年 4月14日	6个月	新股锁定期内	10.80	15.86	84,004	907,243.20	1,332,303.44	-	
688175	高凌信息	2022年 3月8日	6个月	新股锁定期内	51.68	32.23	1,403	72,507.04	45,218.69	-	
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	1,690	69,746.30	69,746.30	-	
688322	奥比	2022年	1个月	新股未	30.99	30.99	3,542	109,766.58	109,766.58	-	

	中光	6月30日	内(含)	上市						
688349	三一重能	2022年6月15日	6个月	新股锁定期内	29.80	36.94	2,938	87,552.40	108,529.72	-
688400	凌云光	2022年6月27日	1个月内(含)	新股未上市	21.93	21.93	3,164	69,386.52	69,386.52	-

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，锁定期限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。

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	378,067.30	9,954,000.00
合计	378,067.30	9,954,000.00

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 0.99%。

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、存出保证金和债券投资等。

#### 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	17,537,386.66	-	-	-	-	-	17,537,386.66
结算备付金	642,557.80	-	-	-	-	-	642,557.80
存出保证金	149,926.66	-	-	-	-	-	149,926.66
交易性金融资产	378,067.30	-	-	-	-	166,799,290.63	167,177,357.93
应收股利	-	-	-	-	-	732,036.13	732,036.13
应收申购款	-	-	-	-	-	17,411.04	17,411.04
应收清算款	-	-	-	-	-	4,721,734.69	4,721,734.69
资产总计	18,707,938.42	-	-	-	-	172,270,472.49	190,978,410.91
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	40,820.71	40,820.71
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	223,792.32	223,792.32
应付托管费	-	-	-	-	-	37,298.71	37,298.71
应付清算款	-	-	-	-	-	3,720,374.91	3,720,374.91
应付销售服务费	-	-	-	-	-	2,535.22	2,535.22
其他负债	-	-	-	-	-	575,593.41	575,593.41
负债总计	-	-	-	-	-	4,600,415.28	4,600,415.28
利率敏感度缺口	18,707,938.42	-	-	-	-	-167,670,057.21	186,377,995.63
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	5,656,751.22	-	-	-	-	-	5,656,751.22
结算备付金	909,440.09	-	-	-	-	-	909,440.09
存出保证金	297,078.80	-	-	-	-	-	297,078.80
交易性金融资产	9,954,000.00	-	-	-	-	214,624,885.10	224,578,885.10
应收申购款	-	-	-	-	-	134,982.50	134,982.50

应收证券清算款	-	-	-	-	1,953,692.10	1,953,692.10
其他资产	-	-	-	-	39,498.45	39,498.45
资产总计	16,817,270.11	-	-	-	216,753,058.15	233,570,328.26
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	217,087.06	217,087.06
应付管理人报酬	-	-	-	-	313,328.81	313,328.81
应付托管费	-	-	-	-	52,221.45	52,221.45
应付证券清算款	-	-	-	-	203,601.63	203,601.63
应付销售服务费	-	-	-	-	3,810.46	3,810.46
其他负债	-	-	-	-	749,337.99	749,337.99
负债总计	-	-	-	-	1,539,387.40	1,539,387.40
利率敏感度缺口	16,817,270.11	-	-	-	-215,213,670.75	232,030,940.86

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，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.20% (2021 年 12 月 31 日：4.29%)，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。本基金持有不以记账本位币人民币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
交易性金融资产	-	57,646,796.49	-	57,646,796.49
应收股利	-	732,036.13	-	732,036.13
资产合计	-	58,378,832.62	-	58,378,832.62
以外币计价的 负债				

负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 汇风险敞口净 额	-	58,378,832.62	-	58,378,832.62
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民 币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
资产合计	-	-	-	-
以外币计价的 负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 汇风险敞口净 额	-	-	-	-

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变 动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
分析	所有外币相对人民 币升值 5%	2,918,941.63	-
	所有外币相对人民 币贬值 5%	-2,918,941.63	-

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单

个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票及存托凭证资产的投资比例为基金资产的 60%-95%；投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。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	166,799,290.63	89.50	214,624,885.10	92.50
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	166,799,290.63	89.50	214,624,885.10	92.50

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
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	业绩比较基准上升5%	13,562,730.51	16,374,128.64
	业绩比较基准下降	-13,562,730.51	-16,374,128.64

	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	164,945,675.88	213,297,944.64
第二层次	626,966.70	11,280,940.46
第三层次	1,604,715.35	-
合计	167,177,357.93	224,578,885.10

###### 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	166,799,290.63	87.34
	其中：股票	166,799,290.63	87.34
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	378,067.30	0.20
	其中：债券	378,067.30	0.20
	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	18,179,944.46	9.52
8	其他各项资产	5,621,108.52	2.94
9	合计	190,978,410.91	100.00

注：通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币 57,646,796.49 元，占基金资产净值的比例为 30.93%。

### 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	-	-
B	采矿业	4,129,207.40	2.22
C	制造业	94,842,460.28	50.89
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	42,074.20	0.02
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	56,430.90	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	15,222.00	0.01
H	住宿和餐饮业	14,977.44	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服	3,300,952.06	1.77



	务业		
J	金融业		-
K	房地产业	19,206.00	0.01
L	租赁和商务服务业	2,771,867.00	1.49
M	科学研究和技术服务业	1,225,514.87	0.66
N	水利、环境和公共设施管理业	13,973.88	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业		-
P	教育		-
Q	卫生和社会工作	2,699,631.00	1.45
R	文化、体育和娱乐业	20,977.11	0.01
S	综合		-
	合计	109,152,494.14	58.57

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
10 能源	10,915,494.13	5.86
15 原材料	-	-
20 工业	-	-
25 可选消费	15,960,086.00	8.56
30 主要消费	-	-
35 医药卫生	1,727,141.72	0.93
40 金融	-	-
45 信息技术	1,257,856.21	0.67
50 通信服务	27,786,218.43	14.91
55 公用事业	-	-
60 房地产	-	-
合计	57,646,796.49	30.93

注：以上分类采用中证行业分类标准。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	01024	快手-W	214,800	16,054,926.57	8.61
2	03690	美团-W	96,100	15,960,086.00	8.56
3	600519	贵州茅台	7,000	14,315,000.00	7.68
4	300750	宁德时代	25,000	13,350,000.00	7.16
5	601012	隆基绿能	179,580	11,965,415.40	6.42
6	00700	腾讯控股	38,707	11,731,291.86	6.29
7	603198	迎驾贡酒	154,400	10,057,616.00	5.40
8	600809	山西汾酒	25,600	8,314,880.00	4.46
9	000568	泸州老窖	32,200	7,938,588.00	4.26
10	002304	洋河股份	40,000	7,326,000.00	3.93
11	01088	中国神华	360,254	6,931,926.41	3.72

12	01171	兖矿能源	189,354	3,983,567.72	2.14
13	300595	欧普康视	66,500	3,803,135.00	2.04
14	600570	恒生电子	75,345	3,280,521.30	1.76
15	601888	中国中免	11,900	2,771,867.00	1.49
16	300015	爱尔眼科	60,300	2,699,631.00	1.45
17	601225	陕西煤业	126,122	2,671,263.96	1.43
18	000768	中航西飞	72,600	2,199,054.00	1.18
19	000858	五粮液	10,300	2,079,879.00	1.12
20	600438	通威股份	34,700	2,077,142.00	1.11
21	300568	星源材质	65,949	1,915,158.96	1.03
22	00241	阿里健康	374,000	1,727,141.72	0.93
23	002245	蔚蓝锂芯	65,000	1,508,650.00	0.81
24	600938	中国海油	91,204	1,457,943.44	0.78
25	300014	亿纬锂能	13,100	1,277,250.00	0.69
26	02382	舜宇光学科技	11,500	1,257,856.21	0.67
27	300207	欣旺达	39,300	1,241,880.00	0.67
28	688033	天宜上佳	57,272	1,216,457.28	0.65
29	603259	药明康德	11,520	1,197,964.80	0.64
30	600600	青岛啤酒	9,400	976,848.00	0.52
31	603659	璞泰来	11,500	970,600.00	0.52
32	688223	晶科能源	53,795	803,159.35	0.43
33	000661	长春高新	900	210,078.00	0.11
34	600487	亨通光电	12,800	186,112.00	0.10
35	688322	奥比中光	3,542	109,766.58	0.06
36	688349	三一重能	2,938	108,529.72	0.06
37	688047	龙芯中科	1,112	102,470.80	0.05
38	688237	超卓航科	1,690	69,746.30	0.04
39	688400	凌云光	3,164	69,386.52	0.04
40	688175	高凌信息	1,403	45,218.69	0.02
41	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.02
42	300073	当升科技	400	36,136.00	0.02
43	600048	保利发展	1,100	19,206.00	0.01
44	301155	海力风电	205	18,655.00	0.01
45	001215	千味央厨	295	16,605.55	0.01
46	603070	万控智造	775	16,197.50	0.01
47	001319	铭科精技	536	15,474.32	0.01
48	001317	三羊马	300	15,222.00	0.01
49	001216	华瓷股份	1,178	15,137.30	0.01
50	301073	君亭酒店	216	14,977.44	0.01
51	603230	内蒙新华	1,141	14,273.91	0.01
52	301101	明月镜片	278	14,269.74	0.01
53	605056	咸亨国际	934	14,168.78	0.01

54	603097	江苏华辰	577	13,617.20	0.01
55	301215	中汽股份	2,108	13,470.12	0.01
56	603216	梦天家居	772	12,498.68	0.01
57	605162	新中港	1,377	12,461.85	0.01
58	300997	欢乐家	928	12,398.08	0.01
59	605028	世茂能源	615	12,256.95	0.01
60	603215	比依股份	575	12,115.25	0.01
61	301116	益客食品	577	11,805.42	0.01
62	001218	丽臣实业	490	11,701.20	0.01
63	301126	达嘉维康	662	11,340.06	0.01
64	001268	联合精密	409	11,337.48	0.01
65	605365	立达信	645	10,687.65	0.01
66	605599	菜百股份	980	10,662.40	0.01
67	603219	富佳股份	528	10,517.76	0.01
68	301111	粤万年青	379	10,392.18	0.01
69	301017	漱玉平民	555	10,289.70	0.01
70	301009	可靠股份	801	9,996.48	0.01
71	301015	百洋医药	462	9,969.96	0.01
72	001296	长江材料	403	9,905.74	0.01
73	301122	采纳股份	139	9,781.43	0.01
74	603272	联翔股份	443	9,723.85	0.01
75	301020	密封科技	421	9,472.50	0.01
76	605069	正和生态	608	9,326.72	0.01
77	301048	金鹰重工	843	9,281.43	0.00
78	603048	浙江黎明	464	9,224.32	0.00
79	301117	佳缘科技	169	9,200.36	0.00
80	605138	盛泰集团	723	9,023.04	0.00
81	001234	泰慕士	333	9,017.64	0.00
82	301201	诚达药业	126	9,014.04	0.00
83	301130	西点药业	237	8,934.90	0.00
84	605580	恒盛能源	655	8,829.40	0.00
85	301021	英诺激光	290	8,758.00	0.00
86	605011	杭州热电	525	8,526.00	0.00
87	301013	利和兴	706	8,464.94	0.00
88	301168	通灵股份	181	8,159.48	0.00
89	301235	华康医疗	215	8,154.95	0.00
90	001219	青岛食品	353	8,066.05	0.00
91	301133	金钟股份	286	7,942.22	0.00
92	301028	东亚机械	733	7,931.06	0.00
93	301158	德石股份	379	7,724.02	0.00
94	301198	喜悦智行	340	7,667.00	0.00
95	301026	浩通科技	203	7,486.64	0.00

96	603150	万朗磁塑	251	7,472.27	0.00
97	301199	迈赫股份	219	7,016.76	0.00
98	301182	凯旺科技	294	6,985.44	0.00
99	301207	华兰疫苗	122	6,883.24	0.00
100	605577	龙版传媒	588	6,703.20	0.00
101	301200	大族数控	126	6,541.92	0.00
102	301002	崧盛股份	261	6,491.07	0.00
103	301206	三元生物	135	6,168.15	0.00
104	301062	上海艾录	523	6,103.41	0.00
105	300998	宁波方正	201	6,080.25	0.00
106	300814	中富电路	328	6,002.40	0.00
107	301096	百诚医药	75	5,925.00	0.00
108	301190	善水科技	247	5,861.31	0.00
109	300991	创益通	406	5,838.28	0.00
110	301057	汇隆新材	218	5,308.30	0.00
111	301179	泽宇智能	125	5,101.25	0.00
112	301222	浙江恒威	176	5,096.96	0.00
113	301032	新柴股份	513	4,770.90	0.00
114	301049	超越科技	196	4,647.16	0.00
115	301036	双乐股份	205	4,608.40	0.00
116	300834	星辉环材	153	4,594.59	0.00
117	301007	德迈仕	303	4,566.21	0.00
118	301033	迈普医学	108	4,547.88	0.00
119	301181	标榜股份	147	4,496.73	0.00
120	301059	金三江	259	4,351.20	0.00
121	301063	海锅股份	153	4,262.58	0.00
122	301041	金百泽	215	4,237.65	0.00
123	300995	奇德新材	191	4,087.40	0.00
124	301110	青木股份	99	3,945.15	0.00
125	301108	洁雅股份	96	3,798.72	0.00
126	301068	大地海洋	144	3,477.60	0.00
127	301196	唯科科技	76	2,851.52	0.00
128	600845	宝信软件	40	2,184.00	0.00

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	300750	宁德时代	32,092,927.88	13.83
2	02359	药明康德	2,503,047.68	1.08
3	603259	药明康德	19,735,126.77	8.51
4	03690	美团-W	21,412,117.79	9.23

5	01088	中国神华	15,495,630.48	6.68
6	601088	中国神华	5,153,542.00	2.22
7	01171	兖矿能源	15,613,484.65	6.73
8	600188	兖矿能源	1,900,203.60	0.82
9	000002	万科 A	16,925,768.00	7.29
10	00700	腾讯控股	16,905,471.82	7.29
11	01024	快手-W	15,440,021.81	6.65
12	06098	碧桂园服务	14,464,595.09	6.23
13	601225	陕西煤业	13,877,679.00	5.98
14	601155	新城控股	12,945,849.45	5.58
15	02007	碧桂园	12,883,534.10	5.55
16	601012	隆基绿能	12,680,060.88	5.46
17	600985	淮北矿业	11,788,743.46	5.08
18	600809	山西汾酒	11,279,970.85	4.86
19	000983	山西焦煤	11,174,989.35	4.82
20	00884	旭辉控股集团	10,698,181.27	4.61
21	000876	新希望	10,659,647.00	4.59
22	000568	泸州老窖	10,322,119.00	4.45
23	603198	迎驾贡酒	10,255,229.01	4.42
24	601211	国泰君安	9,444,595.02	4.07
25	000739	普洛药业	9,427,768.12	4.06
26	600048	保利发展	9,364,113.00	4.04
27	600938	中国海油	9,351,670.32	4.03
28	600383	金地集团	9,220,154.00	3.97
29	603456	九洲药业	9,099,964.00	3.92
30	300759	康龙化成	9,058,661.31	3.90
31	000860	顺鑫农业	9,041,145.82	3.90
32	600585	海螺水泥	8,788,269.00	3.79
33	601699	潞安环能	7,686,006.50	3.31
34	000069	华侨城 A	7,683,619.56	3.31
35	600570	恒生电子	7,568,140.72	3.26
36	600030	中信证券	7,556,968.85	3.26
37	600519	贵州茅台	7,269,650.00	3.13
38	601166	兴业银行	6,636,983.00	2.86
39	688599	天合光能	6,636,905.10	2.86
40	001979	招商蛇口	6,529,554.00	2.81
41	002304	洋河股份	6,396,549.34	2.76
42	002714	牧原股份	6,040,930.00	2.60
43	603806	福斯特	6,000,495.18	2.59
44	600153	建发股份	5,651,651.00	2.44
45	601666	平煤股份	5,437,122.00	2.34
46	000066	中国长城	5,307,607.63	2.29

47	601899	紫金矿业	5,304,830.00	2.29
48	603019	中科曙光	5,246,776.00	2.26
49	06618	京东健康	5,185,245.72	2.23
50	000768	中航西飞	5,070,279.00	2.19
51	300450	先导智能	4,893,812.00	2.11
52	600438	通威股份	4,781,175.70	2.06

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	02359	药明康德	2,296,233.73	0.99
2	603259	药明康德	30,554,027.73	13.17
3	300750	宁德时代	28,557,973.57	12.31
4	000568	泸州老窖	19,945,033.17	8.60
5	600809	山西汾酒	16,506,603.60	7.11
6	01088	中国神华	9,950,533.15	4.29
7	601088	中国神华	6,258,146.00	2.70
8	000002	万 科 A	15,384,315.00	6.63
9	600570	恒生电子	15,223,030.00	6.56
10	601225	陕西煤业	14,882,568.62	6.41
11	600519	贵州茅台	14,081,041.00	6.07
12	01171	兖矿能源	12,061,655.34	5.20
13	600188	兖矿能源	1,956,768.00	0.84
14	000739	普洛药业	13,166,694.43	5.67
15	600030	中信证券	12,119,761.21	5.22
16	06098	碧桂园服务	11,663,236.81	5.03
17	600985	淮北矿业	11,502,754.00	4.96
18	300014	亿纬锂能	11,300,784.31	4.87
19	000983	山西焦煤	11,048,646.00	4.76
20	601155	新城控股	10,813,924.07	4.66
21	02007	碧桂园	10,555,097.75	4.55
22	002241	歌尔股份	10,433,649.00	4.50
23	300760	迈瑞医疗	10,309,820.80	4.44
24	600383	金地集团	10,179,913.00	4.39
25	001979	招商蛇口	9,874,235.00	4.26
26	000876	新 希 望	9,714,450.00	4.19
27	600048	保利发展	9,452,629.89	4.07
28	000799	酒鬼酒	9,223,910.54	3.98
29	600436	片仔癀	9,209,693.55	3.97
30	603198	迎驾贡酒	9,143,559.18	3.94
31	600938	中国海油	9,114,855.54	3.93

32	601211	国泰君安	8,661,436.00	3.73
33	603456	九洲药业	8,405,356.00	3.62
34	300759	康龙化成	8,338,845.65	3.59
35	600585	海螺水泥	8,186,386.98	3.53
36	603369	今世缘	7,999,455.98	3.45
37	00884	旭辉控股集团	7,594,670.36	3.27
38	03690	美团-W	6,893,907.31	2.97
39	600882	妙可蓝多	6,699,995.00	2.89
40	000860	顺鑫农业	6,627,776.00	2.86
41	000069	华侨城 A	6,620,675.20	2.85
42	600153	建发股份	6,589,574.00	2.84
43	601699	潞安环能	6,523,441.96	2.81
44	601166	兴业银行	6,252,669.00	2.69
45	000768	中航西飞	6,174,243.90	2.66
46	688599	天合光能	5,995,406.29	2.58
47	300450	先导智能	5,995,363.40	2.58
48	603806	福斯特	5,893,246.00	2.54
49	601899	紫金矿业	5,662,244.14	2.44
50	002714	牧原股份	5,415,013.72	2.33
51	600745	闻泰科技	5,362,846.39	2.31
52	603019	中科曙光	5,234,041.93	2.26
53	06618	京东健康	4,933,988.93	2.13
54	600893	航发动力	4,919,996.00	2.12
55	601666	平煤股份	4,857,018.00	2.09
56	000066	中国长城	4,801,822.00	2.07

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	605,018,159.67
卖出股票收入（成交）总额	617,536,260.29

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	378,067.30	0.20
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-

5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	378,067.30	0.20

### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019658	21 国债 10	3,710	378,067.30	0.20

### 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

注：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	149,926.66
2	应收清算款	4,721,734.69
3	应收股利	732,036.13
4	应收利息	-
5	应收申购款	17,411.04
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,621,108.52

#### 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 (%)
华泰柏瑞质量精选混合 A	3,896	52,709.74	0.00	0	205,357,141.73	100.00
华泰柏瑞质量精选混合 C	860	8,428.57	0.00	0	7,248,571.33	100.00
合计	4,683	45,399.47	0.00	0	212,605,713.06	100.00

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	华泰柏瑞质量精选混合 A	49,564.27	0.0241
	华泰柏瑞质量精选混合 C	20,010.11	0.2761
	合计	69,574.38	0.0327

### 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	华泰柏瑞质量精选混合 A	0
	华泰柏瑞质量精选混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	华泰柏瑞质量精选混合 A	0
	华泰柏瑞质量精选混合 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华泰柏瑞质量精选混合 A	华泰柏瑞质量精选混合 C
基金合同生效日 (2021年3月31日) 基金份额总额	430,132,918.49	9,350,293.27
本报告期期初基金份额总额	213,414,103.03	7,975,981.27
本报告期基金总申购份额	6,210,221.96	872,438.55
减：本报告期基金总赎回份额	14,267,183.26	1,599,848.49
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	205,357,141.73	7,248,571.33

## § 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 (%)	
中泰证券	2	251,736,469.08	20.68	242,845.14	21.81	-
天风证券	2	189,804,576.64	15.59	178,091.44	15.99	-
华泰证券	5	143,924,563.73	11.82	133,837.08	12.02	-
中信建投	3	140,808,583.36	11.57	121,651.40	10.92	-
粤开证券	1	116,622,827.48	9.58	106,768.63	9.59	-
长江证券	2	104,989,981.33	8.62	96,889.03	8.70	-
信达证券	2	87,144,517.63	7.16	63,728.75	5.72	-

南京证券	1	78,736,676.13	6.47	73,329.45	6.58	-
招商证券	4	59,319,973.30	4.87	55,244.71	4.96	-
安信证券	1	34,866,749.63	2.86	32,471.17	2.92	-
东方财富证券	2	9,438,657.40	0.78	8,790.28	0.79	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
财达证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
东亚前海证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
国元证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
宏信证券	2	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	4	-	-	-	-	-
摩根大通证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
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：

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，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、本报告期内本基金新增南京证券、安信证券、德邦证券、东亚前海证券、国元证券、摩根大通证券的交易单元。

## 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 (%)
中泰证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	1,037,348.20	100.00	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-

东亚前海 证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
摩根大通 证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证 券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
新时代证 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](http://www.huatai-pb.com)

华泰柏瑞基金管理有限公司

2022 年 8 月 30 日