

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 2020 年中期报告

2020 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：2020 年 8 月 29 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 2020 年 8 月 28 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 2020 年 1 月 1 日起至 2020 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	错误！未定义书签。
§4 管理人报告	10
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	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	18

6.3 所有者权益（基金净值）变动表	19
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	43
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	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52
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	52
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	52
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	52
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	52
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
7.12 市场中性策略执行情况	53
7.13 投资组合报告附注	53
§8 基金份额持有人信息	55
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	55
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	55
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	55
§9 开放式基金份额变动	56
§10 重大事件揭示	57
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	59
§11 影响投资者决策的其他重要信息	62
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
§12 备查文件目录	63
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	华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金
基金简称	华泰柏瑞量化绝对收益混合
基金主代码	001073
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 6 月 29 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	921,765,698.36 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	利用定量投资模型，灵活应用多种策略对冲投资组合的市场风险，谋求投资组合资产的长期增值。
投资策略	在力求有效控制投资风险的前提下，通过全市场选股构建预期收益高于市场回报的投资组合，同时利用股指期货等多种策略对冲投资组合的市场风险，以求获得不依赖市场整体走向的比較稳定的长期资产增值。
业绩比较基准	三个月银行定期存款税后收益率
风险收益特征	本基金为特殊的混合型基金，通过采用量化对冲策略剥离市场系统性风险，因此相对股票型基金和一般的混合型基金，其预期风险较小。

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	陈晖	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	021-60635778
传真		021-38601799	021-60637111
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	上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

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(2020 年 1 月 1 日 - 2020 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-1,384,609.93
本期利润	12,709,693.82
加权平均基金份额本期利润	0.0220
本期加权平均净值利润率	1.83%
本期基金份额净值增长率	5.24%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	161,562,959.55
期末可供分配基金份额利润	0.1753
期末基金资产净值	1,117,223,035.68
期末基金份额净值	1.2120
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	21.20%

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。3、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

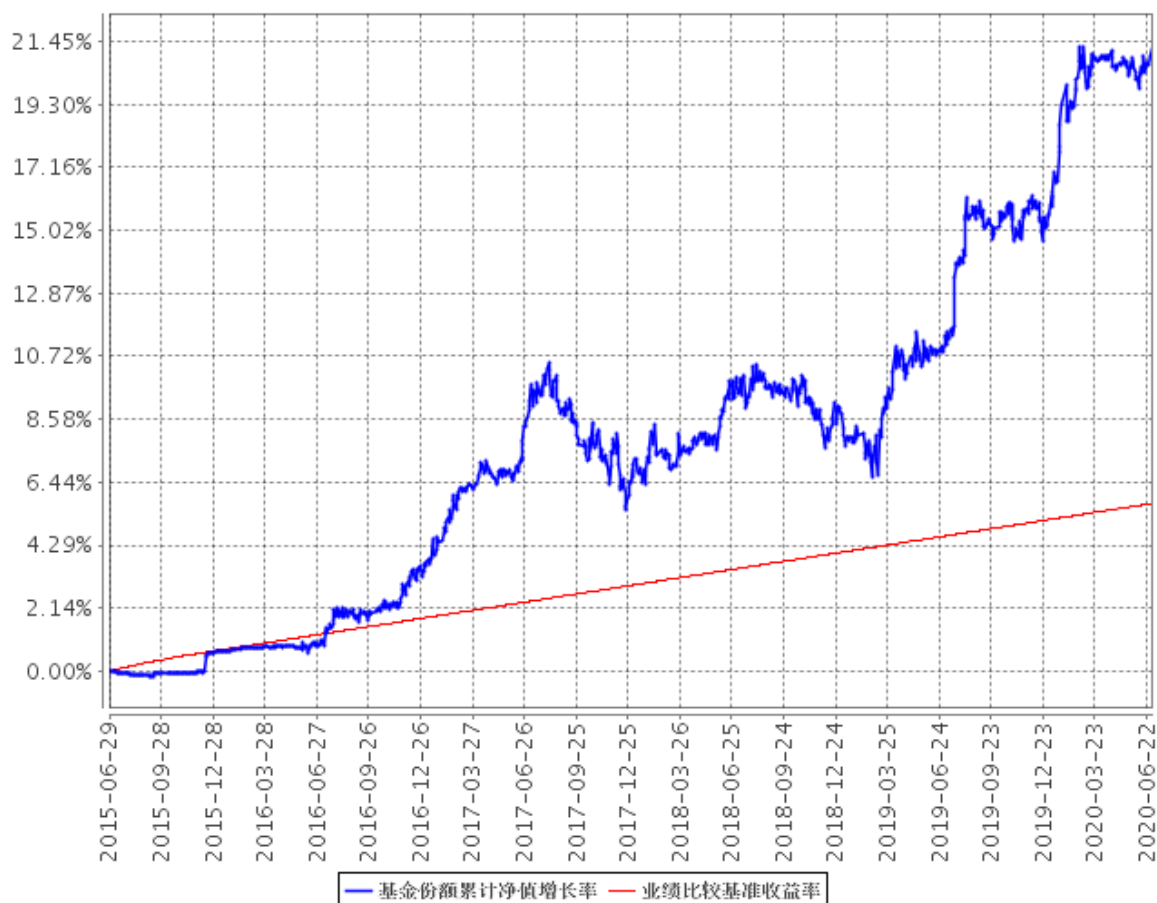
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.27%	0.21%	0.09%	0.00%	0.18%	0.21%
过去三个月	0.29%	0.15%	0.28%	0.00%	0.01%	0.15%
过去六个月	5.24%	0.27%	0.56%	0.00%	4.68%	0.27%
过去一年	9.29%	0.27%	1.12%	0.00%	8.17%	0.27%
过去三年	11.69%	0.27%	3.35%	0.00%	8.34%	0.27%
自基金合同 生效起至今	21.20%	0.22%	5.71%	0.00%	15.49%	0.22%

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

基金份额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 2015 年 6 月 29 日至 2020 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、华泰柏瑞丰汇债券型证券投资基金、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、华泰柏瑞亨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、华泰柏瑞国企整合精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞医疗健康混合型证券投资基金、华泰柏瑞现代服务业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、华泰柏瑞核心优势混合型证券投资基金、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华泰柏瑞益商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。截至 2020 年 6 月 30 日，公司基金管理规模为 1317.21 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		
田汉卿	副总经理、本基金的基金经理	2015 年 6 月 29 日	-	18 年	副总经理。曾在美国巴克莱全球投资管理有限公司（BGI）担任投资经理，2012 年 8 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，2013 年 8 月起任华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金的基金经理，2013 年 10 月起任公司副总经理，2014 年 12 月起任华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2015 年 3 月起任华泰柏瑞量化先行混合型证券投资基金的基金经理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，2015 年 6 月起任华泰柏瑞量化智慧灵活配

					置混合型证券投资基金的基金经理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。2016 年 5 月起任华泰柏瑞量化对冲稳健收益定期开放混合型发起式证券投资基金的基金经理。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 5 月起任华泰柏瑞量化创优灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。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。本科与研究生毕业于清华大学，MBA 毕业于美国加州大学伯克利分校哈斯商学院。
--	--	--	--	--	---

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

本报告期内，本基金继续采用完全对冲策略，通过量化选股模型构建跟踪沪深 300 指数的增强股票组合，同时利用沪深 300 股指期货合约进行对冲，以获得绝对收益。

今年以来，A 股市场出现大幅的波动。1-2 月，国内新冠疫情开始发酵，但国内疫情整体可控，并且在流动性超预期宽松以及科技产业政策催化下，以半导体、云计算、5G、新能源汽车等为代表的科技板块持续创新高。2 月下旬及 3 月以来，随着疫情全球蔓延，市场情绪迅速转向，全球权益市场开始暴跌，A 股开始第二轮回调。在悲观情绪驱动下，市场加深了对后续全球经济基本面恶化、失业率上升，甚至激化更多大国矛盾等风险的担忧。与此同时，各国在疫情防控、货币政策、财政政策等方面紧急出台措施。6 月 A 股市场延续疫情以来的上行走势，结构分化较大。创业板开始实行注册制，带动科创类公司股价继续上行，相对而言，金融和周期类低估值公司股价涨幅落后。

报告期内我们坚持在 800 成分股选股，同时坚持了一贯的量化选股策略，并监控各项风险暴

露，控制个股风险，模型运行比较平稳。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.2120 元；本报告期基金份额净值增长率为 5.24%，业绩比较基准收益率为 0.56%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

量化对冲策略的对冲成本方面，较过往已有稳定改善。股指期货负基差是量化对冲产品的主要成本，18 年 12 月以后随着股指期货政策上的松绑，其所带来的流动性的提升对基差的改善产生了一定积极正面的影响，量化对冲策略的成本端显著改善。今年 3 月份股指期货贴水扩大，我们认为更多是受到市场情绪的短期影响，短期影响消除后，基差仍然会收敛到合理范围，6 月底后市场情绪回暖，也看到了基差收敛的迹象。

量化模型获取超额收益方面，2018 和 2019 年，市场在经历了极端事件冲击之后，投资人风险偏好起伏较大，市场交易不怎么注重基本面，进入到 2020 年，投资者的风险偏好恢复正常，尽管 2、3 月份由于国内外疫情影响市场风险偏好有所反复，但从 4 月份至今，市场情绪在受到负面影响后由恢复逐步走向活跃，基本面因子的超额收益取得了较好回报。预计未来市场仍将在结构性行情中寻找积极的投资方向，基本面因子的超额收益可以达到预期水平，全市场选股的超额收益大概率恢复到长期趋势线上。股票操作上，我们将继续让量化模型发挥选股功能，同时我们人工监控各行业、主题、个股、因子的风险暴露，beta 敞口暴露继续控制在较小的暴露。

此外，本基金将积极参与主板和创业板 IPO 打新，及在理性研究的基础上参与科创板打新，以获得模型之外的额外收益。

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

注：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

注：无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本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，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、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：华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	56,793,762.82	984,147.93
结算备付金		43,144,013.48	2,738,391.47
存出保证金		74,266,454.44	16,758,766.15
交易性金融资产	6.4.7.2	756,160,383.88	171,262,440.31
其中：股票投资		756,160,383.88	171,262,440.31
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		195,309,643.93	5,889,274.94
应收利息	6.4.7.5	35,787.68	9,682.60
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,125,710,046.23	197,642,703.40
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		6,058,364.60	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,332,799.52	346,311.96
应付托管费		222,133.25	57,718.65
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	784,205.58	304,668.66
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	89,507.60	180,000.00
负债合计		8,487,010.55	888,699.27
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	921,765,698.36	170,833,960.33
未分配利润	6.4.7.10	195,457,337.32	25,920,043.80
所有者权益合计		1,117,223,035.68	196,754,004.13
负债和所有者权益总计		1,125,710,046.23	197,642,703.40

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.2120 元，基金份额总额 921,765,698.36 份。

6.2 利润表

会计主体：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

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		20,196,477.99	2,685,986.64
1.利息收入		2,277,492.49	131,043.61
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,008,629.15	91,068.46
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,268,863.34	39,975.15
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		3,284,164.30	-3,797,861.63
其中：股票投资收益	6.4.7.12	19,906,728.57	14,927,766.43
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-24,082,692.13	-20,133,007.81
股利收益	6.4.7.16	7,460,127.86	1,407,379.75
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	14,094,303.75	6,142,148.63
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	540,517.45	210,656.03
减：二、费用		7,486,784.17	1,930,448.23
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	5,152,973.77	960,647.05
2. 托管费	6.4.10.2.2	858,828.92	160,107.84

3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	1,349,361.51	606,721.77
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		22,601.02	12,937.28
7. 其他费用	6.4.7.20	103,018.95	190,034.29
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		12,709,693.82	755,538.41
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		12,709,693.82	755,538.41

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：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

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	170,833,960.33	25,920,043.80	196,754,004.13
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	12,709,693.82	12,709,693.82
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	750,931,738.03	156,827,599.70	907,759,337.73
其中：1. 基金申购款	874,996,161.79	182,303,754.28	1,057,299,916.07
2. 基金赎回款	-124,064,423.76	-25,476,154.58	-149,540,578.34
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	921,765,698.36	195,457,337.32	1,117,223,035.68
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	145,253,753.70	13,061,047.20	158,314,800.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	755,538.41	755,538.41
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	125,751,558.51	15,718,468.75	141,470,027.26
其中：1.基金申购款	225,345,306.37	24,451,246.71	249,796,553.08
2.基金赎回款	-99,593,747.86	-8,732,777.96	-108,326,525.82
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	271,005,312.21	29,535,054.36	300,540,366.57

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

华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]42号《关于准予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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《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基金合同》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招募说明书》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 496,894,780.21 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第 801 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《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基金合同》于 2015

年 6 月 29 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 496,952,339.78 份基金份额，其中认购资金利息折合 57,559.57 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。

本基金为发起式基金。发起资金认购金额均为华泰柏瑞基金管理有限公司使用固有资金认购本基金基金份额而投入的人民币 10,002,400 元，折合为 10,002,400 份基金份额，承诺持有期限为 3 年。

根据《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基金合同》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招募说明书》的有关规定，本基金每三个月开放一次，每次开放期不超过 5 个工作日，每个开放期所在月份为基金合同生效日所在月份后续每三个日历月中最后一个日历月，每个开放期的首日为当月沪深 300 股指期货交割日前五个工作日的第一个工作日。本基金的首个封闭期为自基金合同生效日起至第一个开放期的首日（不含该日）之间的期间，之后的封闭期为每相邻两个开放期之间的期间。本基金在封闭期内不办理申购与赎回业务。

根据《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》、《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基金合同》和最新公布的《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招募说明书》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）、股指期货、权证、债券（国债、金融债、企业/公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产和现金以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的投资组合比例为：本基金权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的比例范围为 80%-120%，其中，权益类空头头寸的价值是指融券卖出的股票市值、卖出股指期货的合约价值及卖出其他权益类衍生工具的合约价值的合计值；权益类多头头寸的价值是指买入持有的股票市值、买入股指期货的合约价值及买入其他权益类衍生工具的合约价值的合计值。开放期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；封闭期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%。开放期内，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的

现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。在封闭期内，本基金不受上述 5% 的限制。本基金的业绩比较基准为：三个月银行定期存款税后收益率。

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 2020 年 8 月 29 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》、《华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年 1 月 1 日至 2020 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 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 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 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

注：本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

注：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

注：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：

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

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

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

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

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

(e) 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 2020 年 6 月 30 日
活期存款	56,793,762.82
定期存款	—
其中：存款期限 1 个月以内	—
存款期限 1-3 个月	—
存款期限 3 个月以上	—
其他存款	—
合计：	56,793,762.82

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	700,766,418.83	756,160,383.88	55,393,965.05
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	700,766,418.83	756,160,383.88	55,393,965.05

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	—	—	—	
货币衍生工具	—	—	—	
权益衍生工具	-708,141,300.00	—	—	

IF2007	-688,567,020.00	-	-	
IF2008	-19,574,280.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	-708,141,300.00	-	-	

注：按照股指期货每日无负债结算的结算规则、《基金股指期货投资会计业务核算细则(试行)》及《企业会计准则-金融工具列报》的相关规定，“其他衍生工具-股指期货投资”与“证券清算款-股指期货每日无负债结算暂收暂付款”，符合金融资产与金融负债相抵销的条件，故将“其他衍生工具-股指期货投资”的期末公允价值以抵销后的净额列报，净额为零。

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：无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	10,394.73
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	25,321.05
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	71.90
合计	35,787.68

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	784,205.58
银行间市场应付交易费用	—
合计	784,205.58

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	—
应付证券出借违约金	—
预提费用	89,507.60
合计	89,507.60

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	170,833,960.33	170,833,960.33
本期申购	874,996,161.79	874,996,161.79
本期赎回(以“-”号填列)	-124,064,423.76	-124,064,423.76
— 基金拆分/份额折算前	—	—
基金拆分/份额折算变动份额	—	—
本期申购	—	—
本期赎回(以“-”号填列)	—	—
本期末	921,765,698.36	921,765,698.36

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	20,562,922.35	5,357,121.45	25,920,043.80
本期利润	-1,384,609.93	14,094,303.75	12,709,693.82
本期基金份额交易产生的变动数	142,384,647.13	14,442,952.57	156,827,599.70

其中：基金申购款	163,987,252.52	18,316,501.76	182,303,754.28
基金赎回款	-21,602,605.39	-3,873,549.19	-25,476,154.58
本期已分配利润	-	-	-
本期末	161,562,959.55	33,894,377.77	195,457,337.32

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	491,564.81
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	516,676.71
其他	387.63
合计	1,008,629.15

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	247,475,127.10
减：卖出股票成本总额	227,568,398.53
买卖股票差价收入	19,906,728.57

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无。

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
国债期货投资收益	-
股指期货-投资收益	-24,082,692.13

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	7,460,127.86
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	7,460,127.86

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	41,492,093.42
——股票投资	41,492,093.42
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-27,397,789.67
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	14,094,303.75

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	540,278.38
转换费收入	239.07
合计	540,517.45

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	1,349,361.51
银行间市场交易费用	-

交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	1,349,361.51

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
审计费用	29,835.26
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
其他费用-场内交易费用	4,511.35
银行间账户服务费	9,000.00
合计	103,018.95

6.4.7.21 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

注：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

注：截至本财务报表批准报出日，本基金并无须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、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

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 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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	0.00	0.00%	41,897,150.40	10.38%

注：本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期内与上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内与上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

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 2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量	期末应付佣金余额	占期末应付佣金

		的比例		总额的比例
华泰证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%
关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019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	38,181.23	11.08%	0.00	0.00%

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 2020年1月1日至2020年6月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	5,152,973.77	960,647.05
其中：支付销售机构的客户维护费	164,597.65	122,435.12

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

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	858,828.92	160,107.84

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：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

注：本基金本期与上年度可比期间无发生关联方销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期与关联方未进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2015 年 6 月 29 日）持有的基金份额	10,002,400.00	10,002,400.00
报告期初持有的基金份额	18,752,966.66	38,255,366.66
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	19,502,400.00
报告期末持有的基金份额	18,752,966.66	18,752,966.66
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.0345%	6.9198%

注：1. 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交易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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 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	56,793,762.82	491,564.81	20,641,439.49	41,953.96

行股份有限				
-------	--	--	--	--

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

注：无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

注：无。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2020 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688528	秦川物联	2020 年 6 月 19 日	2020 年 7 月 1 日	新股未上市	11.33	11.33	8,337	94,458.21	94,458.21	—
688600	皖仪科技	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 3 日	新股未上市	15.50	15.50	5,468	84,754.00	84,754.00	—
300847	中船汉光	2020 年 6 月 29 日	2020 年 7 月 9 日	新股未上市	6.94	6.94	1,421	9,861.74	9,861.74	—
300845	捷安高科	2020 年 6 月 24 日	2020 年 7 月 3 日	新股未上市	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	—
300843	胜蓝股份	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 2 日	新股未上市	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	—
300840	酷特智能	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 8 日	新股未上市	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	—
300846	首都在线	2020 年 6 月 22 日	2020 年 7 月 1 日	新股未上市	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	—
688298	东方	2020 年	2020	新股锁	21.25	144.17	4,704	99,960.00	678,175.68	—

	生物	1 月 20 日	年 8 月 5 日	定期内						
688228	开普云	2020 年 3 月 19 日	2020 年 9 月 28 日	新股锁定期内	59.26	73.20	1,793	106,253.18	131,247.60	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

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

本基金为特殊的混合型基金，通过采用量化对冲策略剥离市场系统性风险，因此相对股票型基金和一般的混合型基金，其预期风险较小。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和衍生工具等。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同责任，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 2020 年 6 月 30 日，本基金无债券投资(2019 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于约定开放日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于开放期内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 2020 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，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 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

6.4.13.3.1.1 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》且于基金开放期内按照《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）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%，于开放期内，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 2020 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 0.09%。

于开放期内，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 2020 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	56,793,762.82	-	-	-	-	-	56,793,762.82
结算备付金	43,144,013.48	-	-	-	-	-	43,144,013.48
存出保证金	159,830.44	-	-	-	-	74,106,624.00	74,266,454.44
交易性金融资产	-	-	-	-	-	756,160,383.88	756,160,383.88
应收证券清算款	-	-	-	-	-	195,309,643.93	195,309,643.93
应收利息	-	-	-	-	-	35,787.68	35,787.68
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	100,097,606.74	-	-	-	-	1,025,612,439.49	1,125,710,046.23
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	6,058,364.60	6,058,364.60
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,332,799.52	1,332,799.52
应付托管费	-	-	-	-	-	222,133.25	222,133.25
应付交易费用	-	-	-	-	-	784,205.58	784,205.58
其他负债	-	-	-	-	-	89,507.60	89,507.60
负债总计	-	-	-	-	-	8,487,010.55	8,487,010.55

利率敏感度缺口	100,097,606.74	-	-	-	-	-1,017,125,428.94	1,117,223,035.68
上年度末 2019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	984,147.93	-	-	-	-	-	984,147.93
结算备付金	2,738,391.47	-	-	-	-	-	2,738,391.47
存出保证金	73,576.15	-	-	-	-	16,685,190.00	16,758,766.15
交易性金融资产	-	-	-	-	-	171,262,440.31	171,262,440.31
应收证券清算款	-	-	-	-	-	11,416,425.27	11,416,425.27
应收利息	-	-	-	-	-	9,682.60	9,682.60
其他资产	-	-	-	-	-	-5,527,150.33	-5,527,150.33
资产总计	3,796,115.55	-	-	-	-	193,846,587.85	197,642,703.40
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	346,311.96	346,311.96
应付托管费	-	-	-	-	-	57,718.65	57,718.65
应付交易费用	-	-	-	-	-	304,668.66	304,668.66
其他负债	-	-	-	-	-	180,000.00	180,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	888,699.27	888,699.27
利率敏感度缺口	3,796,115.55	-	-	-	-	192,957,888.58	196,754,004.13

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2020 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2019 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（2019 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的股票，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。本基金投资组合中权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的价值的比例范围为 80%-120%，其中，权益类空头头寸的价值是指融券卖出的股票市值、卖出股指期货的合约价值及卖出其他权益类衍生工具的合约价值的合计值；权益类多头头寸的价值是指买入持有的股票市值、买入股指期货的合约价值及买入其他权益类衍生工具的合约价值的合计值。开放期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；封闭期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%。开放期内，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制。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 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 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	756,160,383.88	67.68	171,262,440.31	87.04
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
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	756,160,383.88	67.68	171,262,440.31	87.04

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除三个月银行定期存款收益率(税后)以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额(单位:人民币元)	
		本期末(2020年6月 30日)	上年度末(2019年12月 31日)
	三个月银行定期存款收益率 (税后)上升 5%	10,355,860.05	98,480,224.67
	三个月银行定期存款收益率 (税后)下降 5%	-10,355,860.05	-98,480,224.67

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注:无。

6.4.14 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	756,160,383.88	67.17
	其中：股票	756,160,383.88	67.17
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	99,937,776.30	8.88
8	其他各项资产	269,611,886.05	23.95
9	合计	1,125,710,046.23	100.00

7.2 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	6,399,226.00	0.57
B	采矿业	7,331,629.70	0.66
C	制造业	377,286,725.77	33.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	26,221,680.32	2.35
E	建筑业	27,658,304.00	2.48
F	批发和零售业	15,435,839.60	1.38
G	交通运输、仓储和邮政业	14,624,195.30	1.31
H	住宿和餐饮业	1,409,700.00	0.13
I	信息传输、软件和信息技术服务业	28,960,673.17	2.59
J	金融业	202,850,798.58	18.16
K	房地产业	26,756,403.00	2.39
L	租赁和商务服务业	1,114,380.00	0.10
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	12,115,666.28	1.08
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	7,995,162.16	0.72
S	综合	-	-
	合计	756,160,383.88	67.68

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	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	22,500	32,914,800.00	2.95
2	601318	中国平安	345,709	24,683,622.60	2.21
3	601818	光大银行	4,792,900	17,158,582.00	1.54
4	000661	长春高新	37,800	16,454,340.00	1.47
5	601336	新华保险	354,260	15,686,632.80	1.40
6	601390	中国中铁	3,110,900	15,616,718.00	1.40
7	600027	华电国际	4,278,800	14,633,496.00	1.31
8	000858	五粮液	84,500	14,459,640.00	1.29
9	600060	海信视像	1,148,400	13,953,060.00	1.25
10	603444	吉比特	24,500	13,450,745.00	1.20
11	300433	蓝思科技	472,000	13,234,880.00	1.18
12	601998	中信银行	2,465,900	12,699,385.00	1.14
13	603233	大参林	150,240	12,202,492.80	1.09
14	601601	中国太保	441,300	12,025,425.00	1.08
15	000488	晨鸣纸业	2,274,300	11,235,042.00	1.01
16	600276	恒瑞医药	119,462	11,026,342.60	0.99
17	600216	浙江医药	540,420	10,408,489.20	0.93
18	002475	立讯精密	199,025	10,219,933.75	0.91
19	002555	三七互娱	217,920	10,198,656.00	0.91
20	600109	国金证券	890,100	10,156,041.00	0.91
21	002241	歌尔股份	345,200	10,135,072.00	0.91
22	600809	山西汾酒	67,400	9,773,000.00	0.87
23	600926	杭州银行	1,090,356	9,725,975.52	0.87
24	000157	中联重科	1,448,780	9,315,655.40	0.83
25	600745	闻泰科技	71,400	8,992,830.00	0.80

26	600999	招商证券	401,700	8,817,315.00	0.79
27	601615	明阳智能	694,500	8,646,525.00	0.77
28	300070	碧水源	1,049,694	8,523,515.28	0.76
29	601881	中国银河	736,300	8,445,361.00	0.76
30	601988	中国银行	2,425,000	8,439,000.00	0.76
31	300059	东方财富	417,640	8,436,328.00	0.76
32	002352	顺丰控股	149,939	8,201,663.30	0.73
33	000876	新希望	274,545	8,181,441.00	0.73
34	600299	安迪苏	667,500	8,156,850.00	0.73
35	300558	贝达药业	55,186	7,724,936.28	0.69
36	601155	新城控股	246,400	7,697,536.00	0.69
37	300274	阳光电源	515,900	7,423,801.00	0.66
38	601328	交通银行	1,385,100	7,105,563.00	0.64
39	000625	长安汽车	641,056	7,051,616.00	0.63
40	601997	贵阳银行	984,440	7,048,590.40	0.63
41	000513	丽珠集团	140,762	6,757,983.62	0.60
42	600183	生益科技	224,401	6,568,217.27	0.59
43	000961	中南建设	721,100	6,417,790.00	0.57
44	000671	阳光城	979,900	6,212,566.00	0.56
45	600380	健康元	366,700	5,955,208.00	0.53
46	603486	科沃斯	193,357	5,841,314.97	0.52
47	002414	高德红外	198,060	5,799,196.80	0.52
48	600000	浦发银行	540,644	5,720,013.52	0.51
49	603501	韦尔股份	27,900	5,634,405.00	0.50
50	000895	双汇发展	109,000	5,023,810.00	0.45
51	600875	东方电气	565,838	5,007,666.30	0.45
52	600862	中航高科	279,700	4,732,524.00	0.42
53	000166	申万宏源	916,600	4,628,830.00	0.41
54	600104	上汽集团	270,838	4,601,537.62	0.41
55	000776	广发证券	321,700	4,542,404.00	0.41
56	601288	农业银行	1,271,000	4,295,980.00	0.38
57	300498	温氏股份	191,870	4,182,766.00	0.37
58	000333	美的集团	68,844	4,116,182.76	0.37
59	002007	华兰生物	82,080	4,113,028.80	0.37
60	000932	华菱钢铁	1,077,400	4,061,798.00	0.36
61	601098	中南传媒	378,252	4,001,906.16	0.36
62	601211	国泰君安	229,000	3,952,540.00	0.35
63	600449	宁夏建材	320,000	3,910,400.00	0.35
64	603707	健友股份	60,500	3,906,485.00	0.35

65	002304	洋河股份	35,900	3,774,526.00	0.34
66	603556	海兴电力	249,300	3,599,892.00	0.32
67	300033	同花顺	26,900	3,579,852.00	0.32
68	600016	民生银行	630,000	3,572,100.00	0.32
69	601012	隆基股份	84,360	3,435,982.80	0.31
70	603986	兆易创新	14,166	3,341,901.06	0.30
71	600346	恒力石化	236,100	3,305,400.00	0.30
72	603712	七一二	85,500	3,281,490.00	0.29
73	000090	天健集团	473,100	3,269,121.00	0.29
74	002028	思源电气	157,760	3,227,769.60	0.29
75	000600	建投能源	613,100	3,120,679.00	0.28
76	600036	招商银行	92,197	3,108,882.84	0.28
77	600011	华能国际	723,200	3,051,904.00	0.27
78	601992	金隅集团	977,900	2,992,374.00	0.27
79	600015	华夏银行	485,900	2,973,708.00	0.27
80	000967	盈峰环境	357,900	2,952,675.00	0.26
81	601117	中国化学	534,800	2,930,704.00	0.26
82	000528	柳工	461,900	2,914,589.00	0.26
83	601618	中国中冶	1,142,900	2,868,679.00	0.26
84	600585	海螺水泥	53,300	2,820,103.00	0.25
85	002399	海普瑞	106,400	2,664,256.00	0.24
86	600985	淮北矿业	341,530	2,660,518.70	0.24
87	000810	创维数字	216,400	2,614,112.00	0.23
88	601577	长沙银行	321,800	2,555,092.00	0.23
89	300133	华策影视	342,160	2,480,660.00	0.22
90	600958	东方证券	259,800	2,465,502.00	0.22
91	601166	兴业银行	153,200	2,417,496.00	0.22
92	600025	华能水电	628,400	2,381,636.00	0.21
93	600466	蓝光发展	425,100	2,291,289.00	0.21
94	600026	中远海能	348,100	2,248,726.00	0.20
95	002714	牧原股份	27,030	2,216,460.00	0.20
96	002048	宁波华翔	143,341	2,213,185.04	0.20
97	002233	塔牌集团	176,100	2,118,483.00	0.19
98	601808	中海油服	160,000	2,102,400.00	0.19
99	000739	普洛药业	89,300	2,079,797.00	0.19
100	002064	华峰氨纶	398,600	2,020,902.00	0.18
101	601006	大秦铁路	283,400	1,995,136.00	0.18
102	600048	保利地产	130,900	1,934,702.00	0.17
103	601066	中信建投	47,905	1,886,498.90	0.17

104	601319	中国人保	292,400	1,883,056.00	0.17
105	601225	陕西煤业	259,500	1,870,995.00	0.17
106	600273	嘉化能源	212,500	1,857,250.00	0.17
107	600516	方大炭素	291,480	1,830,494.40	0.16
108	601628	中国人寿	66,800	1,817,628.00	0.16
109	600352	浙江龙盛	141,400	1,808,506.00	0.16
110	002242	九阳股份	48,200	1,796,414.00	0.16
111	600893	航发动力	75,500	1,772,740.00	0.16
112	600704	物产中大	419,800	1,767,358.00	0.16
113	600061	国投资本	137,300	1,747,829.00	0.16
114	600795	国电电力	943,100	1,744,735.00	0.16
115	000547	航天发展	119,600	1,634,932.00	0.15
116	000651	格力电器	28,900	1,634,873.00	0.15
117	600760	中航沈飞	49,100	1,611,462.00	0.14
118	601169	北京银行	328,000	1,607,200.00	0.14
119	601668	中国建筑	336,400	1,604,628.00	0.14
120	600967	内蒙一机	151,200	1,570,968.00	0.14
121	000425	徐工机械	259,900	1,536,009.00	0.14
122	002444	巨星科技	127,200	1,511,136.00	0.14
123	600050	中国联通	306,400	1,482,976.00	0.13
124	601607	上海医药	79,760	1,465,988.80	0.13
125	600754	锦江酒店	50,800	1,409,700.00	0.13
126	601186	中国铁建	163,300	1,368,454.00	0.12
127	000001	平安银行	101,500	1,299,200.00	0.12
128	600886	国投电力	162,400	1,276,464.00	0.11
129	600373	中文传媒	108,200	1,274,596.00	0.11
130	002146	荣盛发展	153,100	1,240,110.00	0.11
131	000672	上峰水泥	51,700	1,220,637.00	0.11
132	600219	南山铝业	559,000	1,134,770.00	0.10
133	002818	富森美	90,600	1,114,380.00	0.10
134	600018	上港集团	262,500	1,102,500.00	0.10
135	300760	迈瑞医疗	3,600	1,100,520.00	0.10
136	000400	许继电气	82,700	1,091,640.00	0.10
137	002080	中材科技	64,300	996,650.00	0.09
138	600563	法拉电子	15,800	976,440.00	0.09
139	002202	金风科技	87,800	875,366.00	0.08
140	002244	滨江集团	184,000	785,680.00	0.07
141	002078	太阳纸业	81,100	772,072.00	0.07
142	603208	江山欧派	7,540	734,396.00	0.07

143	603816	顾家家居	15,300	688,653.00	0.06
144	688298	东方生物	4,704	678,175.68	0.06
145	002837	英维克	22,000	651,640.00	0.06
146	002736	国信证券	56,400	637,320.00	0.06
147	600372	中航电子	47,400	631,368.00	0.06
148	600233	圆通速递	39,000	567,840.00	0.05
149	300482	万孚生物	5,300	551,200.00	0.05
150	601838	成都银行	65,300	519,788.00	0.05
151	603369	今世缘	12,700	505,333.00	0.05
152	601377	兴业证券	65,700	450,045.00	0.04
153	000975	银泰黄金	27,900	437,472.00	0.04
154	002572	索菲亚	18,000	435,060.00	0.04
155	300607	拓斯达	10,080	410,155.20	0.04
156	002705	新宝股份	11,200	408,576.00	0.04
157	002001	新 和 成	13,800	401,580.00	0.04
158	603609	禾丰牧业	25,000	372,500.00	0.03
159	603568	伟明环保	15,730	364,936.00	0.03
160	002311	海大集团	6,800	323,612.00	0.03
161	002511	中顺洁柔	13,800	307,740.00	0.03
162	002601	龙麟佰利	15,100	279,350.00	0.03
163	000826	启迪环境	37,000	274,540.00	0.02
164	002557	洽洽食品	4,600	249,274.00	0.02
165	601928	凤凰传媒	35,000	238,000.00	0.02
166	300115	长盈精密	9,900	226,215.00	0.02
167	002216	三全食品	8,500	203,150.00	0.02
168	601398	工商银行	38,700	192,726.00	0.02
169	002928	华夏航空	11,800	177,590.00	0.02
170	600383	金地集团	12,900	176,730.00	0.02
171	601298	青岛港	29,900	169,832.00	0.02
172	601872	招商轮船	27,600	160,908.00	0.01
173	600188	兖州煤业	16,400	143,664.00	0.01
174	601231	环旭电子	6,100	133,224.00	0.01
175	688228	开普云	1,793	131,247.60	0.01
176	000581	威孚高科	5,900	122,012.00	0.01
177	601168	西部矿业	20,100	116,580.00	0.01
178	600908	无锡银行	22,600	110,966.00	0.01
179	603087	甘李药业	1,076	107,922.80	0.01
180	603000	人民网	5,300	105,099.00	0.01
181	688528	秦川物联	8,337	94,458.21	0.01

182	688600	皖仪科技	5,468	84,754.00	0.01
183	002508	老板电器	2,200	68,442.00	0.01
184	002214	大立科技	2,100	59,178.00	0.01
185	600369	西南证券	6,400	29,376.00	0.00
186	300824	北鼎股份	1,954	26,789.34	0.00
187	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.00
188	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.00
189	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.00
190	300847	中船汉光	1,421	9,861.74	0.00
191	601009	南京银行	1,200	8,796.00	0.00
192	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
193	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
194	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
195	300846	首都在线	1,131	3,811.47	0.00
196	000877	天山股份	107	1,615.70	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	600519	贵州茅台	25,448,905.77	12.93
2	601318	中国平安	21,875,938.82	11.12
3	601390	中国中铁	15,737,739.00	8.00
4	600027	华电国际	15,194,969.50	7.72
5	601818	光大银行	15,140,532.00	7.70
6	601336	新华保险	13,927,701.09	7.08
7	601601	中国太保	13,179,462.36	6.70
8	600060	海信视像	12,479,744.42	6.34
9	000488	晨鸣纸业	11,505,848.66	5.85
10	601998	中信银行	10,247,495.17	5.21
11	000858	五 粮 液	10,209,628.00	5.19
12	000661	长春高新	9,925,497.69	5.04
13	600276	恒瑞医药	9,723,625.70	4.94
14	603444	吉比特	9,698,317.86	4.93
15	600216	浙江医药	9,599,352.65	4.88

16	300070	碧水源	9,187,488.52	4.67
17	603233	大参林	9,010,316.00	4.58
18	600109	国金证券	8,938,617.22	4.54
19	601615	明阳智能	8,331,791.00	4.23
20	600926	杭州银行	8,249,457.54	4.19
21	300433	蓝思科技	8,092,636.58	4.11
22	600299	安迪苏	7,994,194.00	4.06
23	000876	新希望	7,979,811.03	4.06
24	002555	三七互娱	7,815,069.29	3.97
25	601155	新城控股	7,793,597.75	3.96
26	002352	顺丰控股	7,683,117.30	3.90
27	601988	中国银行	7,635,699.00	3.88
28	600745	闻泰科技	7,596,204.00	3.86
29	601881	中国银河	7,308,012.09	3.71
30	601328	交通银行	7,183,267.00	3.65
31	002241	歌尔股份	7,073,288.00	3.59
32	600809	山西汾酒	6,991,244.86	3.55
33	300558	贝达药业	6,957,429.53	3.54
34	000157	中联重科	6,796,620.56	3.45
35	000671	阳光城	6,739,499.00	3.43
36	600183	生益科技	6,678,717.22	3.39
37	300059	东方财富	6,645,801.37	3.38
38	002475	立讯精密	6,604,036.72	3.36
39	000625	长安汽车	6,354,738.56	3.23
40	603707	健友股份	6,259,679.58	3.18
41	600999	招商证券	6,182,723.79	3.14
42	000513	丽珠集团	5,920,278.24	3.01
43	000961	中南建设	5,871,060.86	2.98
44	601166	兴业银行	5,712,319.00	2.90
45	002048	宁波华翔	5,548,247.27	2.82
46	300274	阳光电源	5,516,699.51	2.80
47	603712	七一二	5,505,861.95	2.80
48	601288	农业银行	5,474,589.00	2.78
49	603486	科沃斯	5,466,766.30	2.78
50	603501	韦尔股份	5,389,877.00	2.74
51	601009	南京银行	5,323,895.00	2.71

52	600104	上汽集团	5,145,202.00	2.62
53	600875	东方电气	5,118,627.58	2.60
54	002414	高德红外	5,111,854.65	2.60
55	600000	浦发银行	5,087,974.25	2.59
56	601997	贵阳银行	4,944,967.40	2.51
57	300347	泰格医药	4,882,123.10	2.48
58	600837	海通证券	4,692,177.00	2.38
59	600380	健康元	4,677,749.44	2.38
60	000895	双汇发展	4,654,533.40	2.37
61	300529	健帆生物	4,484,856.75	2.28
62	601098	中南传媒	4,293,559.00	2.18
63	600449	宁夏建材	4,284,991.00	2.18
64	000932	华菱钢铁	4,212,042.00	2.14
65	000333	美的集团	4,126,607.20	2.10

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601009	南京银行	6,762,786.00	3.44
2	603160	汇顶科技	6,399,890.65	3.25
3	000425	徐工机械	5,801,172.36	2.95
4	002048	宁波华翔	5,796,071.00	2.95
5	600837	海通证券	5,757,201.96	2.93
6	300347	泰格医药	5,330,518.97	2.71
7	300529	健帆生物	5,176,103.15	2.63
8	000877	天山股份	4,740,793.23	2.41
9	603986	兆易创新	4,663,149.20	2.37
10	600276	恒瑞医药	4,540,267.02	2.31
11	601881	中国银河	4,112,813.92	2.09
12	603806	福斯特	4,082,169.93	2.07
13	600690	海尔智家	4,053,972.00	2.06
14	601318	中国平安	4,038,781.00	2.05
15	000671	阳光城	4,000,492.00	2.03
16	600606	绿地控股	3,815,462.00	1.94
17	601166	兴业银行	3,381,094.00	1.72

18	300659	中孚信息	3,348,167.96	1.70
19	601398	工商银行	3,280,473.00	1.67
20	603712	七一二	3,130,044.00	1.59

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	770,974,248.68
卖出股票收入（成交）总额	247,475,127.10

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。

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。

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IF2007	沪深300期货2007合约	-584	-721,473,600.00	-32,906,580.00	-
IF2008	沪深300期货2008合约	-16	-19,592,640.00	-18,360.00	-
公允价值变动总额合计(元)					-32,924,940.00
股指期货投资本期收益(元)					-23,894,350.33
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-27,397,789.67

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期内，本基金继续采用完全对冲策略，通过量化选股模型构建跟踪沪深 300 指数的增强股票组合，同时利用沪深 300 股指期货合约进行对冲，以获得绝对收益。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 市场中性策略执行情况

截至本报告期末，本基金持有股票资产 756,160,383.88 元，占基金资产净值的比例为 67.68%；运用股指期货进行对冲的空头合约市值 741,066,240.00 元，占基金资产净值的比例为 66.33%，空头合约市值占股票资产的比例为 98.00%。

本报告期内，本基金执行市场中性策略的投资收益为 3,284,164.30 元，公允价值变动损益为 14,094,303.75 元。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

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。

7.13.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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。

7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	74,266,454.44
2	应收证券清算款	195,309,643.93
3	应收股利	-
4	应收利息	35,787.68
5	应收申购款	-

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	269,611,886.05

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 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
2,364	389,917.81	888,038,453.63	96.34%	33,727,244.73	3.66%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	9,823.10	0.0011%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占 基金总份额 比例（%）	发起份额总数	发起份额占 基金总份额 比例（%）	发起份额承 诺持有期限
基金管理人固有资金	18,752,966.66	2.03	10,002,400.00	1.09	3 年
基金管理人高级管理人员	0.00	—	0.00	0.00	—
基金经理等人员	0.00	0.00	0.00	0.00	—
基金管理人股东	0.00	0.00	0.00	0.00	—
其他	0.00	0.00	0.00	0.00	—
合计	18,752,966.66	2.03	10,002,400.00	1.09	—

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（ 2015 年 6 月 29 日 ）基金份额总额	496,952,339.78
本报告期期初基金份额总额	170,833,960.33
本报告期基金总申购份额	874,996,161.79
减：本报告期基金总赎回份额	124,064,423.76
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	921,765,698.36

§ 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

2020 年 2 月 10 日，经公司董事会批准程安至先生不再担任公司副总经理。
上述人事变动已按相关规定备案、公告。

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

2020 年 3 月，公司收到上海证监局对公司采取责令改正措施的决定。公司高度重视，立即制定并实施相关整改措施，落实整改要求。2020 年 4 月公司完成整改事项并及时向监管机构提交整改报告。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票 成交总额的比 例	佣金	占当期佣金 总量的比例	
华西证券	1	507,571,676.23	50.05%	472,700.04	51.51%	-
国盛证券	2	109,011,335.65	10.75%	77,709.80	8.47%	-
民生证券	2	84,591,146.50	8.34%	77,620.49	8.46%	-
宏信证券	2	72,538,277.81	7.15%	67,555.19	7.36%	-
天风证券	2	60,820,256.48	6.00%	57,858.87	6.30%	-
西藏东方财富	2	53,977,158.16	5.32%	50,146.36	5.46%	-

爱建证券	1	41,272,751.99	4.07%	38,436.98	4.19%	—
东吴证券	2	38,062,253.43	3.75%	35,446.90	3.86%	—
华创证券	1	25,395,846.99	2.50%	23,650.47	2.58%	—
海通证券	2	12,741,881.76	1.26%	9,063.58	0.99%	—
华宝证券	2	8,114,689.80	0.80%	7,557.57	0.82%	—
万联证券	2	—	—	—	—	—
华泰证券	5	—	—	—	—	—
新时代证券	1	—	—	—	—	—
国信证券	2	—	—	—	—	—
西南证券	1	—	—	—	—	—
方正证券	1	—	—	—	—	—
浙商证券	1	—	—	—	—	—
南京证券	1	—	—	—	—	—
中信建投	2	—	—	—	—	—
东北证券	1	—	—	—	—	—
财达证券	1	—	—	—	—	—
信达证券	1	—	—	—	—	—
恒泰证券	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为，未受监管机构重大处罚；
- 3) 资金雄厚，信誉良好。内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求。
- 4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服务。
- 5) 具备研究实力，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、股票分析的研究报告及周到的信息服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告。

2、选择代理证券买卖的证券经营机构的程序

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

3、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：本基金于 2015 年 6 月 29 日成立，本表中所列券商交易单元均为本报告期新增

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华西证券	-	-	8,340,000,000.00	52.96%	-	-
国盛证券	-	-	1,600,000,000.00	10.16%	-	-
民生证券	-	-	660,000,000.00	4.19%	-	-
宏信证券	-	-	400,000,000.00	2.54%	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富	-	-	867,000,000.00	5.51%	-	-
爱建证券	-	-	1,640,000,000.00	10.41%	-	-
东吴证券	-	-	800,000,000.00	5.08%	-	-
华创证券	-	-	1,440,000,000.00	9.14%	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-

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交通银行手机银行渠道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	2020 年 6 月 30 日
2	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对冲策略执行情况公告	证监会规定报刊和网站	2020 年 6 月 10 日
3	关于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第二十一个开放期开放申购赎回及转换业务的公告	证监会规定报刊和网站	2020 年 6 月 8 日
4	华泰柏瑞基金管理有限公司关于包商银行股份有限公司转让相关业务的提示性公告	证监会规定报刊和网站	2020 年 5 月 26 日
5	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金参加鼎信汇金（北京）投资管理有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2020 年 4 月 21 日
6	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金持有停牌证券估值调整的提示性公告	证监会规定报刊和网站	2020 年 3 月 19 日
7	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金参加中国国际期货有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2020 年 3 月 18 日
8	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下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参加中国银河证券股份有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2020 年 3 月 13 日
9	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对冲策略执行情况公告	证监会规定报刊和网站	2020 年 3 月 11 日
10	华泰柏瑞基金管理有限公司关于调整旗下基金最低申购金额、最低赎回份额和最低持有份额的公告	证监会规定报刊和网站	2020 年 3 月 9 日
11	关于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第十九个开放期开放申购赎回及转换业务的公告	证监会规定报刊和网站	2020 年 3 月 6 日
12	华泰柏瑞基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证监会规定报刊和网站	2020 年 2 月 14 日
13	华泰柏瑞基金管理有限公司关于调整旗下基金 2020 年春节假期	证监会规定报刊和网站	2020 年 1 月 30 日

	申购赎回等交易业务及清算交收 安排的提示性公告		
--	----------------------------	--	--

§ 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

华泰柏瑞基金管理有限公司

2020 年 8 月 29 日