

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 2021 年中期报告

2021 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：2021 年 8 月 28 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 2021 年 8 月 27 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 2021 年 1 月 1 日起至 2021 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
§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	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§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.....	49
7.1 期末基金资产组合情况.....	49
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	49
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	50
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	57
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	58
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.....	58
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.....	58
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.....	58
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.....	58
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	59
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	59
7.12 市场中性策略执行情况.....	59
7.13 投资组合报告附注.....	60
§8 基金份额持有人信息.....	61
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	61
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	61
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.....	61
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	61
§9 开放式基金份额变动.....	62
§10 重大事件揭示.....	63
10.1 基金份额持有人大会决议.....	63
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.....	63
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	63
10.4 基金投资策略的改变.....	63
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	63
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.....	63
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	63
10.8 其他重大事件.....	66

§11 影响投资者决策的其他重要信息	69
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	69
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	69
§12 备查文件目录	70
12.1 备查文件目录	70
12.2 存放地点	70
12.3 查阅方式	70

§ 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	206,179,211.05 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	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	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(2021 年 1 月 1 日 - 2021 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	58,634,028.62
本期利润	4,175,209.43
加权平均基金份额本期利润	0.0063
本期加权平均净值利润率	0.52%
本期基金份额净值增长率	1.08%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	42,271,630.84
期末可供分配基金份额利润	0.2050
期末基金资产净值	250,360,087.69
期末基金份额净值	1.2143
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	21.43%

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	1.37%	0.19%	0.09%	0.00%	1.28%	0.19%
过去三个月	0.12%	0.24%	0.28%	0.00%	-0.16%	0.24%
过去六个月	1.08%	0.27%	0.55%	0.00%	0.53%	0.27%
过去一年	0.19%	0.36%	1.12%	0.00%	-0.93%	0.36%
过去三年	11.06%	0.31%	3.35%	0.00%	7.71%	0.31%
过去五年	20.36%	0.27%	5.58%	0.00%	14.78%	0.27%
自基金合同 生效起至今	21.43%	0.25%	6.83%	0.00%	14.60%	0.25%

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 2021 年 6 月 30 日。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司。华泰柏瑞基金管理有限公司是经中国证监会批准，于 2004 年 11 月 18 日成立的合资基金管理公司，注册资本为 2 亿元人民币。目前的股东构成为华泰证券股份有限公司、柏瑞投资有限责任公司（原 AIGGIC）和苏州新区高新技术产业股份有限公司，出资比例分别为 49%、49%和 2%。目前公司旗下管理华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金、华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金、上证红利交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金、华泰柏瑞货币市场证券投资基金、华泰柏瑞行业领先混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化先行混合型证券投资基金、华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金、上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金、华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金、华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金、华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金、华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金、华泰柏瑞交易型货币市场基金、华泰柏瑞激励动力灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化对冲稳健收益定期开放混合型发起式证券投资基金、华泰柏瑞天添宝货币市场基金、华泰柏瑞多策略灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞新经济沪港深灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞享利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化创优灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞生物医药灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞富利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞港股通量化灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞战略新兴产业混合型证券投资基金、华泰柏瑞新金

融地产灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数基金、华泰柏瑞医疗健康混合型证券投资基金、华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通指数基金联接基金、华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞量化明选混合型证券投资基金、华泰柏瑞基本面智选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞锦泰一年定期开放债券型证券投资基金、华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞益通三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、华泰柏瑞研究精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞景气回报一年持有期混合型证券投资基金、华泰柏瑞锦兴 39 个月定期开放债券型证券投资基金、华泰柏瑞锦瑞债券型证券投资基金、华泰柏瑞益商一年定期开放债券型发起式证券投资基金、华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞质量成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞行业精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞鸿利中短债债券型证券投资基金、华泰柏瑞景气优选混合型证券投资基金、华泰柏瑞品质优选混合型证券投资基金、华泰柏瑞景利混合型证券投资基金、华泰柏瑞优势领航混合型证券投资基金、华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞锦乾债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化创盈混合型证券投资基金、华泰柏瑞成长智选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞量化创享混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞质量领先混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证稀土产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞品质成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证物联网主题交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞质量精选混合型证券投资基金、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。截至 2021 年 6 月 30 日，公司基金管理规模为 2174.24 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	—	19 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 月至 2020 年 7 月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，2015 年 3 月至 2020 年 7 月任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 月至 2020 年 7 月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。2020 年 11 月起任华泰柏瑞量化创盈混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 12 月起任华泰柏瑞量化创享混合型证券投资基金的基
--	--	--	--	--	--

					金经理。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

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。

2021 年上半年，市场风格在春节前后出现较大的转变。春节前，市场延续 2020 年四季度的行情，继续交易抱团股。节后一些高估值的抱团股出现比较快速的调整，市场逐步企稳反弹后，行情结构更偏向高景气行业主题和中小盘，一些高估值的抱团股和传统行业板块表现较弱。年初至 6 月 30 日期间，传统行业占比较高的上证 50 和沪深 300 分别下跌 3.90%、上涨 0.24%，代表高景气成长类的创业板指、科创 50 分别上涨 17.22%、14.01%，相对估值偏低的中小市值指数中证 500 和中证 1000 分别上涨 6.93%、6.58%。整体来看市场一方面对基本面复苏比较敏感，另一方面对前期的估值分化有一定的修正。

报告期内我们在 800 成分股选股，并坚持基本面多因子的量化选股策略，结合对市场的研判，采取比较稳健的投资策略。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.2143 元；本报告期基金份额净值增长率为 1.08%，业绩比较基准收益率为 0.55%。

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，基差在上半年运行平稳，反映了期指市场和股票市场的一致性在加强。我们仍会采取择时展仓的交易策略，并会衡量模型的预期超额收益以及未来基差走势，来决策仓位水平，虽不依赖于短线基差套利，但基差若有大的波动机会的时候也会把握。

我们观察到宏观经济仍处在新冠疫情的复苏之中，但全球的流动性宽松叠加供给端的约束带动了大宗商品价格的快速上升，市场博弈集中在通胀预期与货币政策的边际变化。随着全球经济的复苏，各国货币政策可能会边际收紧，短期货币政策维持中性。

A 股市场在经历了比较长时间的估值分化的市场环境之后，逐步进入基本面业绩驱动的环境。医药等部分高估值的行业板块短期上涨明显，存在股价调整的风险；同时周期等板块的基本面改善未完全反应在股价当中，估值性价比在逐步凸显。我们预计接下来市场将对上市公司中报业绩反应较强，如果市场是理性的话，会切换到性价比相对较好的股票或者板块上。所以，从基本面的角度看，我们对于整体市场不悲观。

量化策略方面，我们预期未来的市场风格会更加有利于量化模型获取超额收益。从因子表现来看，压抑两年的估值因子会出现反转，而成长因子预期会继续表现良好。市场抱团的龙头股估值已经很高，抱团的投资策略也已经比较拥挤。市场将回归基本面，未来大小市值、各行业股票的表现将更加均衡，量化投资全市场选股的优势将得以更好体现。近期，我们也观察到，市场也正在朝着我们预期的方向转化，尽管可能仍会有一些反复，但大方向上应该还是比较确定的。

当然，短期市场走势上可能会有一定的波动。原因可能来自全球流动性边际收紧或经济复苏边际降速带来的市场情绪上的影响。但我们认为，当前 A 股市场整体基本面较好，如果出现比较大的波动，会是很不错的买入风格更加均衡的量化基金的机会。

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内基金未实施收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞量化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：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	16,860,172.73	9,301,971.74
结算备付金		36,452,549.79	70,168,674.30
存出保证金		21,273,822.63	99,039,091.80
交易性金融资产	6.4.7.2	176,927,642.68	827,403,886.56
其中：股票投资		176,927,642.68	825,744,393.56
基金投资		-	-
债券投资		-	1,659,493.00
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		537,605.64	3,400,351.97
应收利息	6.4.7.5	22,488.58	57,323.38
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		252,074,282.05	1,009,371,299.75
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 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		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		602,472.48	1,453,145.53
应付托管费		100,412.05	242,190.91
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	902,213.89	987,217.94
应交税费		-	5.48

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	109,095.94	205,000.00
负债合计		1,714,194.36	2,887,559.86
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	206,179,211.05	837,807,793.64
未分配利润	6.4.7.10	44,180,876.64	168,675,946.25
所有者权益合计		250,360,087.69	1,006,483,739.89
负债和所有者权益总计		252,074,282.05	1,009,371,299.75

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.2143 元，基金份额总额 206,179,211.05 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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		14,311,508.56	20,196,477.99
1.利息收入		1,279,607.38	2,277,492.49
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,129,260.80	1,008,629.15
债券利息收入		387.91	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		149,958.67	1,268,863.34
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		66,947,747.20	3,284,164.30
其中：股票投资收益	6.4.7.12	99,916,553.64	19,906,728.57
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	222,651.75	-
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	-35,474,434.37	-24,082,692.13
股利收益	6.4.7.16	2,282,976.18	7,460,127.86
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-54,458,819.19	14,094,303.75
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	542,973.17	540,517.45
减：二、费用		10,136,299.13	7,486,784.17
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	5,980,381.45	5,152,973.77
2. 托管费	6.4.10.2.2	996,730.22	858,828.92

3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	3,036,407.56	1,349,361.51
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.61	22,601.02
7. 其他费用	6.4.7.20	122,779.29	103,018.95
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,175,209.43	12,709,693.82
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,175,209.43	12,709,693.82

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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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）	837,807,793.64	168,675,946.25	1,006,483,739.89
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,175,209.43	4,175,209.43
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）	-631,628,582.59	-128,670,279.04	-760,298,861.63
其中：1.基金申购款	58,183,549.38	11,948,872.59	70,132,421.97
2.基金赎回款	-689,812,131.97	-140,619,151.63	-830,431,283.60
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）	206,179,211.05	44,180,876.64	250,360,087.69
项目	上年度可比期间 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

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》、《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》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上市的股票）、存托凭证、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及存托凭证市值、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及存托凭证市值、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 2021 年 8 月 28 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 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表仍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 2021 年 1 月 1 日至 2021 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 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 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

本报告期内本基金采用的会计政策、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

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

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

本基金在本报告期无重大会计差错。

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 2021 年 6 月 30 日
活期存款	16,860,172.73
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：	16,860,172.73

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	161,561,554.22	176,927,642.68	15,366,088.46
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	161,561,554.22	176,927,642.68	15,366,088.46

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 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	-174,576,049.09	—	—	

IF2107	-62,423,209.09	-	-	
IF2109	-112,152,840.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	-174,576,049.09	-	-	

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 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	2,861.74
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	19,527.34
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	99.50
合计	22,488.58

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 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	902,213.89
银行间市场应付交易费用	—
合计	902,213.89

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 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	109,095.94
合计	109,095.94

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	837,807,793.64	837,807,793.64
本期申购	58,183,549.38	58,183,549.38
本期赎回(以“-”号填列)	-689,812,131.97	-689,812,131.97
- 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	206,179,211.05	206,179,211.05

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	94,916,251.63	73,759,694.62	168,675,946.25
本期利润	58,634,028.62	-54,458,819.19	4,175,209.43
本期基金份额交易产生的变动数	-111,278,649.41	-17,391,629.63	-128,670,279.04

其中：基金申购款	9,315,337.19	2,633,535.40	11,948,872.59
基金赎回款	-120,593,986.60	-20,025,165.03	-140,619,151.63
本期已分配利润	-	-	-
本期末	42,271,630.84	1,909,245.80	44,180,876.64

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	159,190.20
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	968,568.08
其他	1,502.52
合计	1,129,260.80

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,221,554,351.08
减：卖出股票成本总额	1,121,637,797.44
买卖股票差价收入	99,916,553.64

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

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	222,651.75
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	222,651.75

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	3,415,973.37
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	3,192,700.00
减：应收利息总额	621.62
买卖债券差价收入	222,651.75

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
国债期货投资收益	-
股指期货-投资收益	-35,474,434.37

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	2,282,976.18
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	2,282,976.18

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-71,045,793.56
——股票投资	-70,990,300.56
——债券投资	-55,493.00
——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	16,586,974.37
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	-54,458,819.19

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	542,640.71
转换费收入	332.46
合计	542,973.17

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	3,036,407.56
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	3,036,407.56

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	49,588.57
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
其他费用-场内交易费用	4,683.35
银行间账户服务费	9,000.00
合计	122,779.29

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、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：1、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

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。

6.4.10.1 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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	153,834,830.06	8.76%	-	-

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 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	140,189.48	9.34%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020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
-	-	-	-	-

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 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	5,980,381.45	5,152,973.77
其中：支付销售机构的客户维护费	72,034.17	164,597.65

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 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	996,730.22	858,828.92

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：本基金本报告期与上年度可比期间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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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	18,752,966.66
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	0.00	0.00

额		
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	9.0955%	2.0345%

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

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

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本报告期及上年度可比期间内，除基金管理人之外的其它关联方未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	16,860,172.73	159,190.20	56,793,762.82	491,564.81

注：本报告期，基金托管人建设银行股份有限公司保管的银行存款按银行间同业存款利率计息。

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：份）	总金额
华泰联合证券有限责任公司	688350	富淼科技	网下申购	2,552	34,656.16
华泰联合证券有限责任公司	300952	恒辉安防	网下申购	3,398	39,824.56
华泰联合证券有限责任公司	688083	中望软件	网下申购	1,837	276,468.50
华泰联合证券有限责任公司	688161	威高骨科	网下申购	3,069	111,159.18
华泰联合证券有限责任公司	605389	长龄液压	网下申购	356	14,026.40

华泰联合证 券有限责任 公司	688314	康拓医疗	网下申购	1,085	18,813.90
华泰联合证 券有限责任 公司	688613	奥精医疗	网下申购	2,617	42,997.31
华泰联合证 券有限责任 公司	605499	东鹏饮料	网下申购	632	29,242.64
华泰联合证 券有限责任 公司	688097	博众精工	网下申购	3,983	44,888.41
华泰联合证 券有限责任 公司	688656	浩欧博	网下申购	1,371	48,341.46
上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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：份）	总金额
-	-	-	-	-	-

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（2021 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
300614	百川 畅银	2021 年 5 月 18 日	2021 年 11 月 25 日	新股 流通 受限	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300926	博俊 科技	2020 年 12 月 29 日	2021 年 7 月 7 日	新股 流通 受限	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-

			日							
300929	华骐 环保	2021 年 1 月 12 日	2021 年 7 月 20 日	新股 流通 受限	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
300930	屹通 新材	2021 年 1 月 13 日	2021 年 7 月 21 日	新股 流通 受限	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-
300931	通用 电梯	2021 年 1 月 13 日	2021 年 7 月 21 日	新股 流通 受限	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300932	三友 联众	2021 年 1 月 15 日	2021 年 7 月 22 日	新股 流通 受限	24.69	31.71	492	12,147.48	15,601.32	-
300933	中辰 股份	2021 年 1 月 15 日	2021 年 7 月 22 日	新股 流通 受限	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
300937	药易 购	2021 年 1 月 20 日	2021 年 7 月 27 日	新股 流通 受限	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
300940	南极 光	2021 年 1 月 27 日	2021 年 8 月 3 日	新股 流通 受限	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-
300941	创识 科技	2021 年 2 月 2 日	2021 年 8 月 9 日	新股 流通 受限	21.31	49.94	399	8,502.69	19,926.06	-
300942	易瑞 生物	2021 年 2 月 2 日	2021 年 8 月 9 日	新股 流通 受限	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300945	曼卡 龙	2021 年 2 月 3 日	2021 年 8 月 10 日	新股 流通 受限	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中 生态	2021 年 2 月 18 日	2021 年 8 月 25 日	新股 流通 受限	13.00	27.42	324	2,808.00	8,884.08	-

			日							
300950	德固特	2021 年 2 月 24 日	2021 年 9 月 3 日	新股 流通 受限	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
300952	恒辉 安防	2021 年 3 月 3 日	2021 年 9 月 13 日	新股 流通 受限	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-
300956	英力 股份	2021 年 3 月 16 日	2021 年 9 月 27 日	新股 流通 受限	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-
300957	贝泰 妮	2021 年 3 月 18 日	2021 年 9 月 27 日	新股 流通 受限	47.33	251.96	721	34,124.93	181,663.16	-
300961	深水 海纳	2021 年 3 月 23 日	2021 年 9 月 30 日	新股 流通 受限	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300962	中金 辐照	2021 年 3 月 29 日	2021 年 10 月 11 日	新股 流通 受限	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300963	中洲 特材	2021 年 3 月 30 日	2021 年 10 月 11 日	新股 流通 受限	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-
300966	共同 药业	2021 年 3 月 31 日	2021 年 10 月 11 日	新股 流通 受限	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300968	格林 精密	2021 年 4 月 6 日	2021 年 10 月 15 日	新股 流通 受限	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-
300973	立高 食品	2021 年 4 月 8 日	2021 年 10 月 15 日	新股 流通 受限	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	-
300978	东箭 科技	2021 年 4 月 15 日	2021 年 10 月 26 日	新股 流通 受限	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-

			日							
300979	华利集团	2021 年 4 月 15 日	2021 年 10 月 26 日	新股流通受限	33.22	87.50	805	26,742.10	70,437.50	-
300981	中红医疗	2021 年 4 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	新股流通受限	48.59	90.39	382	18,561.38	34,528.98	-
300982	苏文电能	2021 年 4 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	新股流通受限	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300985	致远新能	2021 年 4 月 21 日	2021 年 10 月 29 日	新股流通受限	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	-
300986	志特新材	2021 年 4 月 21 日	2021 年 11 月 1 日	新股流通受限	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300987	川网传媒	2021 年 4 月 28 日	2021 年 11 月 11 日	新股流通受限	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300991	创益通	2021 年 5 月 12 日	2021 年 11 月 22 日	新股流通受限	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300992	泰福泵业	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 25 日	新股流通受限	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
300995	奇德新材	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 26 日	新股流通受限	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
300997	欢乐家	2021 年 5 月 26 日	2021 年 12 月 2 日	新股流通受限	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
300998	宁波方正	2021 年 5 月 25 日	2021 年 12 月 2 日	新股流通受限	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-

			日							
301002	崧盛股份	2021 年 5 月 27 日	2021 年 12 月 7 日	新股流通受限	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
301007	德迈仕	2021 年 6 月 4 日	2021 年 12 月 16 日	新股流通受限	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
301009	可靠股份	2021 年 6 月 8 日	2021 年 12 月 17 日	新股流通受限	12.54	27.89	801	10,044.54	22,339.89	-
301011	华立科技	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 17 日	新股流通受限	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
301013	利和兴	2021 年 6 月 21 日	2021 年 12 月 29 日	新股流通受限	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81	-
301015	百洋医药	2021 年 6 月 22 日	2021 年 12 月 30 日	新股流通受限	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
301017	漱玉平民	2021 年 6 月 23 日	2021 年 7 月 5 日	新股流通受限	8.86	8.86	5,550	49,173.00	49,173.00	-
301018	申菱环境	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 7 日	新股流通受限	8.29	8.29	7,811	64,753.19	64,753.19	-
301020	密封科技	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股流通受限	10.64	10.64	4,210	44,794.40	44,794.40	-
301021	英诺激光	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股流通受限	9.46	9.46	2,899	27,424.54	27,424.54	-
605162	新中港	2021 年 6 月 29 日	2021 年 7 月 7 日	新股流通受限	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-

			日							
605287	德才股份	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股流通受限	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
688067	爱威科技	2021 年 6 月 7 日	2021 年 12 月 16 日	新股流通受限	14.71	24.83	1,259	18,519.89	31,260.97	-
688087	英科再生	2021 年 6 月 30 日	2021 年 7 月 9 日	新股流通受限	21.96	21.96	2,098	46,072.08	46,072.08	-
688131	皓元医药	2021 年 6 月 1 日	2021 年 12 月 8 日	新股流通受限	64.99	247.10	1,955	127,055.45	483,080.50	-
688226	威腾电气	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 7 日	新股流通受限	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
688239	航宇科技	2021 年 6 月 25 日	2021 年 7 月 5 日	新股流通受限	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48	-
688276	百克生物	2021 年 6 月 17 日	2021 年 12 月 27 日	新股流通受限	36.35	79.48	3,486	126,716.10	277,067.28	-
688315	诺禾致源	2021 年 4 月 2 日	2021 年 10 月 13 日	新股流通受限	12.76	39.20	3,711	47,352.36	145,471.20	-
688359	三孚新科	2021 年 5 月 14 日	2021 年 11 月 22 日	新股流通受限	11.03	26.35	2,213	24,409.39	58,312.55	-
688639	华恒生物	2021 年 4 月 14 日	2021 年 10 月 22 日	新股流通受限	23.16	42.28	2,302	53,314.32	97,328.56	-
688661	和林微纳	2021 年 3 月 19 日	2021 年 9 月 29 日	新股流通受限	17.71	84.01	1,452	25,714.92	121,982.52	-

			日							
688676	金盘科技	2021 年 3 月 2 日	2021 年 9 月 9 日	新股流通受限	10.10	16.24	3,750	37,875.00	60,900.00	-
688686	奥普特	2020 年 12 月 24 日	2021 年 7 月 1 日	新股流通受限	78.49	451.00	2,330	182,881.70	1,050,830.00	-
300919	中伟股份	2020 年 12 月 15 日	2021 年 7 月 2 日	新股流通受限	24.60	163.00	610	15,006.00	99,430.00	-

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

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

相匹配”的风险收益目标。

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国建设银行，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。

于 2021 年 6 月 30 日，本基金无债券投资。

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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	0.00	1,341,000.00
AAA 以下	0.00	318,493.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	1,659,493.00

注：债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

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。

于 2021 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同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。

6.4.13.3.2 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》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 2021 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 1.38%。

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 2021 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	16,860,172.73	-	-	-	-	-	16,860,172.73
结算备付金	36,452,549.79	-	-	-	-	-	36,452,549.79
存出保证金	221,195.43	-	-	-	-	21,052,627.20	21,273,822.63
交易性金融资 产	-	-	-	-	-	176,927,642.68	176,927,642.68
应收证券清算	-	-	-	-	-	1,400,116.55	1,400,116.55

款							
应收利息	-	-	-	-	-	22,488.58	22,488.58
其他资产	-	-	-	-	-	-862,510.91	-862,510.91
资产总计	53,533,917.95	-	-	-	-	-198,540,364.10	252,074,282.05
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	602,472.48	602,472.48
应付托管费	-	-	-	-	-	100,412.05	100,412.05
应付交易费用	-	-	-	-	-	902,213.89	902,213.89
其他负债	-	-	-	-	-	109,095.94	109,095.94
负债总计	-	-	-	-	-	1,714,194.36	1,714,194.36
利率敏感度缺口	53,533,917.95	-	-	-	-	-196,826,169.74	250,360,087.69
上年度末 2020 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	9,301,971.74	-	-	-	-	-	9,301,971.74
结算备付金	70,168,674.30	-	-	-	-	-	70,168,674.30
存出保证金	126,528.60	-	-	-	-	98,912,563.20	99,039,091.80
交易性金融资产	-	-	-1,659,493.00	-	-	-825,744,393.56	827,403,886.56
应收证券清算款	-	-	-	-	-	20,849,837.25	20,849,837.25
应收利息	-	-	-	-	-	57,323.38	57,323.38
其他资产	-	-	-	-	-	-17,449,485.28	-17,449,485.28
资产总计	79,597,174.64	-	-1,659,493.00	-	-	-928,114,632.11	1,009,371,299.75
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,453,145.53	1,453,145.53
应付托管费	-	-	-	-	-	242,190.91	242,190.91
应付交易费用	-	-	-	-	-	987,217.94	987,217.94
应交税费	-	-	-	-	-	5.48	5.48
其他负债	-	-	-	-	-	205,000.00	205,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	2,887,559.86	2,887,559.86
利率敏感度缺口	79,597,174.64	-	-1,659,493.00	-	-	-925,227,072.25	1,006,483,739.89

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2021 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2020 年 12 月 31 日：0.16%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2020 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及存托凭证市值、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及存托凭证市值、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 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	176,927,642.68	70.67	825,744,393.56	82.04
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	1,659,493.00	0.16
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	176,927,642.68	70.67	827,403,886.56	82.21

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（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	三个月银行定期存款收益率(税后)上升 5%	1,382,985.11	319,893,688.90
	三个月银行定期存款收益率(税后)下降 5%	-1,382,985.11	-319,893,688.90

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	176,927,642.68	70.19
	其中：股票	176,927,642.68	70.19
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	53,312,722.52	21.15
8	其他各项资产	21,833,916.85	8.66
9	合计	252,074,282.05	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	469,530.40	0.19
B	采矿业	3,058,116.36	1.22
C	制造业	100,562,870.52	40.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,206,058.39	0.88
E	建筑业	3,358,624.37	1.34
F	批发和零售业	1,062,609.62	0.42
G	交通运输、仓储和邮政业	4,046,678.08	1.62
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,548,914.37	2.22
J	金融业	42,965,213.65	17.16
K	房地产业	3,295,862.06	1.32
L	租赁和商务服务业	3,095,573.45	1.24
M	科学研究和技术服务业	2,203,779.18	0.88
N	水利、环境和公共设施管理业	77,689.33	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	3,848,943.20	1.54
R	文化、体育和娱乐业	1,127,179.70	0.45
S	综合	-	-
	合计	176,927,642.68	70.67

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	5,131	10,552,927.70	4.22
2	600036	招商银行	102,077	5,531,552.63	2.21
3	000858	五粮液	13,800	4,110,882.00	1.64
4	601318	中国平安	62,509	4,018,078.52	1.60
5	601012	隆基股份	36,178	3,214,053.52	1.28
6	601919	中远海控	100,502	3,069,331.08	1.23
7	300059	东方财富	71,309	2,338,222.11	0.93
8	000333	美的集团	28,700	2,048,319.00	0.82
9	601328	交通银行	407,000	1,994,300.00	0.80
10	601818	光大银行	506,900	1,916,082.00	0.77
11	600884	杉杉股份	82,100	1,914,572.00	0.76
12	601211	国泰君安	111,500	1,911,110.00	0.76
13	600809	山西汾酒	4,200	1,881,600.00	0.75
14	002475	立讯精密	40,400	1,858,400.00	0.74
15	601336	新华保险	39,748	1,824,830.68	0.73
16	000001	平安银行	80,100	1,811,862.00	0.72
17	601636	旗滨集团	96,700	1,794,752.00	0.72
18	300122	智飞生物	9,600	1,792,608.00	0.72
19	002092	中泰化学	174,300	1,790,061.00	0.71
20	688099	晶晨股份	15,900	1,783,980.00	0.71
21	603444	吉比特	3,300	1,749,000.00	0.70
22	601166	兴业银行	84,100	1,728,255.00	0.69
23	688036	传音控股	8,126	1,702,397.00	0.68
24	300347	泰格医药	8,800	1,701,040.00	0.68
25	688396	华润微	18,600	1,692,972.00	0.68

26	000488	晨鸣纸业	206,800	1,683,352.00	0.67
27	000898	鞍钢股份	373,300	1,661,185.00	0.66
28	600276	恒瑞医药	24,046	1,634,406.62	0.65
29	002415	海康威视	25,100	1,618,950.00	0.65
30	601288	农业银行	526,100	1,594,083.00	0.64
31	600999	招商证券	81,630	1,552,602.60	0.62
32	600299	安迪苏	128,200	1,533,272.00	0.61
33	601888	中国中免	5,100	1,530,510.00	0.61
34	300463	迈克生物	35,824	1,507,832.16	0.60
35	002812	恩捷股份	6,200	1,451,420.00	0.58
36	601881	中国银河	133,700	1,441,286.00	0.58
37	000568	泸州老窖	6,100	1,439,234.00	0.57
38	300244	迪安诊断	37,200	1,424,760.00	0.57
39	601988	中国银行	460,400	1,418,032.00	0.57
40	601717	郑煤机	120,700	1,403,741.00	0.56
41	000725	京东方 A	223,100	1,392,144.00	0.56
42	000157	中联重科	150,310	1,388,864.40	0.55
43	603259	药明康德	8,772	1,373,607.48	0.55
44	600000	浦发银行	133,844	1,338,440.00	0.53
45	002027	分众传媒	141,545	1,331,938.45	0.53
46	600380	健康元	95,700	1,313,961.00	0.52
47	600061	国投资本	148,549	1,261,181.01	0.50
48	601390	中国中铁	234,100	1,226,684.00	0.49
49	603355	莱克电气	19,300	1,201,039.00	0.48
50	601225	陕西煤业	101,000	1,196,850.00	0.48
51	300529	健帆生物	13,600	1,174,496.00	0.47
52	002179	中航光电	14,836	1,172,340.72	0.47
53	002901	大博医疗	16,056	1,170,321.84	0.47
54	601186	中国铁建	156,100	1,159,823.00	0.46
55	002142	宁波银行	29,700	1,157,409.00	0.46
56	000425	徐工机械	176,200	1,122,394.00	0.45
57	300033	同花顺	9,600	1,082,688.00	0.43
58	000039	中集集团	58,800	1,068,984.00	0.43
59	600900	长江电力	51,500	1,062,960.00	0.42
60	688686	奥普特	2,330	1,050,830.00	0.42
61	300014	亿纬锂能	10,100	1,049,693.00	0.42
62	000656	金科股份	180,600	1,045,674.00	0.42
63	601628	中国人寿	30,700	1,040,423.00	0.42
64	601088	中国神华	52,318	1,021,247.36	0.41

65	688083	中望软件	1,837	1,014,575.10	0.41
66	601878	浙商证券	77,500	1,013,700.00	0.40
67	600219	南山铝业	280,300	1,009,080.00	0.40
68	601998	中信银行	197,700	1,008,270.00	0.40
69	300274	阳光电源	8,500	978,010.00	0.39
70	600438	通威股份	22,300	964,921.00	0.39
71	002048	宁波华翔	48,900	953,550.00	0.38
72	603225	新凤鸣	46,900	952,070.00	0.38
73	601618	中国中冶	317,700	946,746.00	0.38
74	601601	中国太保	32,100	929,937.00	0.37
75	300223	北京君正	9,200	928,464.00	0.37
76	000661	长春高新	2,300	890,100.00	0.36
77	000528	柳 工	107,800	883,960.00	0.35
78	600782	新钢股份	157,900	881,082.00	0.35
79	000671	阳 光 城	168,060	873,912.00	0.35
80	600409	三友化工	86,300	872,493.00	0.35
81	000776	广发证券	56,700	858,438.00	0.34
82	600027	华电国际	240,100	825,944.00	0.33
83	601000	唐山港	338,100	814,821.00	0.33
84	600741	华域汽车	31,000	814,370.00	0.33
85	603799	华友钴业	7,100	810,820.00	0.32
86	002460	赣锋锂业	6,600	799,194.00	0.32
87	600989	宝丰能源	58,400	798,912.00	0.32
88	300408	三环集团	18,800	797,496.00	0.32
89	600383	金地集团	77,400	792,576.00	0.32
90	688111	金山办公	2,000	789,600.00	0.32
91	600132	重庆啤酒	3,800	752,210.00	0.30
92	603288	海天味业	5,790	746,620.50	0.30
93	600060	海信视像	44,000	743,600.00	0.30
94	000012	南 玻 A	71,400	731,136.00	0.29
95	600196	复星医药	10,000	721,300.00	0.29
96	601377	兴业证券	74,300	717,738.00	0.29
97	002384	东山精密	34,000	708,560.00	0.28
98	601658	邮储银行	140,000	702,800.00	0.28
99	688012	中微公司	4,200	696,864.00	0.28
100	600104	上汽集团	31,285	687,331.45	0.27
101	601319	中国人保	111,000	658,230.00	0.26
102	601233	桐昆股份	27,300	657,657.00	0.26
103	600660	福耀玻璃	11,600	647,860.00	0.26

104	300015	爱尔眼科	8,995	638,465.10	0.26
105	600729	重庆百货	23,100	634,095.00	0.25
106	601398	工商银行	116,900	604,373.00	0.24
107	603712	七一二	16,700	602,870.00	0.24
108	603986	兆易创新	3,100	582,490.00	0.23
109	600373	中文传媒	55,600	548,216.00	0.22
110	600031	三一重工	18,400	534,888.00	0.21
111	600309	万华化学	4,800	522,336.00	0.21
112	002821	凯莱英	1,400	521,640.00	0.21
113	600030	中信证券	20,700	516,258.00	0.21
114	300601	康泰生物	3,400	506,600.00	0.20
115	601098	中南传媒	57,385	506,135.70	0.20
116	000625	长安汽车	18,800	494,064.00	0.20
117	688131	皓元医药	1,955	483,080.50	0.19
118	000538	云南白药	4,100	474,452.00	0.19
119	002714	牧原股份	7,720	469,530.40	0.19
120	002925	盈趣科技	12,060	469,254.60	0.19
121	300450	先导智能	7,600	457,064.00	0.18
122	600176	中国巨石	28,987	449,588.37	0.18
123	600597	光明乳业	30,800	443,828.00	0.18
124	601633	长城汽车	10,100	440,259.00	0.18
125	600522	中天科技	43,416	434,160.00	0.17
126	603486	科沃斯	1,900	433,352.00	0.17
127	600489	中金黄金	49,000	422,380.00	0.17
128	601899	紫金矿业	43,100	417,639.00	0.17
129	600837	海通证券	36,200	416,300.00	0.17
130	600584	长电科技	11,000	414,480.00	0.17
131	600823	世茂股份	102,300	413,292.00	0.17
132	000932	华菱钢铁	62,169	410,315.40	0.16
133	600919	江苏银行	56,600	401,860.00	0.16
134	603659	璞泰来	2,800	382,480.00	0.15
135	002396	星网锐捷	17,000	362,950.00	0.14
136	603893	瑞芯微	2,500	348,650.00	0.14
137	002185	华天科技	22,300	343,197.00	0.14
138	601607	上海医药	16,060	339,347.80	0.14
139	000651	格力电器	6,064	315,934.40	0.13
140	300037	新宙邦	3,000	300,300.00	0.12
141	688208	道通科技	3,400	295,766.00	0.12
142	600141	兴发集团	15,500	291,865.00	0.12

143	600779	水井坊	2,300	290,605.00	0.12
144	002156	通富微电	12,000	288,480.00	0.12
145	600201	生物股份	16,200	282,690.00	0.11
146	600707	彩虹股份	30,000	282,300.00	0.11
147	300740	御家汇	13,400	279,792.00	0.11
148	002008	大族激光	6,900	278,691.00	0.11
149	688276	百克生物	3,486	277,067.28	0.11
150	002709	天赐材料	2,400	255,792.00	0.10
151	600426	华鲁恒升	8,200	253,790.00	0.10
152	600346	恒力石化	8,900	233,536.00	0.09
153	600057	厦门象屿	37,300	233,125.00	0.09
154	000895	双汇发展	7,200	228,960.00	0.09
155	000977	浪潮信息	8,000	225,040.00	0.09
156	300677	英科医疗	1,800	224,640.00	0.09
157	600089	特变电工	17,200	221,020.00	0.09
158	600835	上海机电	13,200	214,500.00	0.09
159	300676	华大基因	1,700	201,620.00	0.08
160	601139	深圳燃气	28,800	188,928.00	0.08
161	000717	韶钢松山	40,500	185,895.00	0.07
162	300957	贝泰妮	721	181,663.16	0.07
163	002007	华兰生物	4,900	179,732.00	0.07
164	601231	环旭电子	10,655	179,110.55	0.07
165	600887	伊利股份	4,700	173,101.00	0.07
166	600845	宝信软件	3,370	171,533.00	0.07
167	600271	航天信息	12,900	168,087.00	0.07
168	688526	科前生物	4,540	164,438.80	0.07
169	002271	东方雨虹	2,950	163,194.00	0.07
170	601006	大秦铁路	24,700	162,526.00	0.06
171	600966	博汇纸业	12,300	160,515.00	0.06
172	688315	诺禾致源	3,711	145,471.20	0.06
173	603517	绝味食品	1,700	143,293.00	0.06
174	601100	恒立液压	1,600	137,472.00	0.05
175	600967	内蒙一机	12,500	126,500.00	0.05
176	600958	东方证券	12,400	123,876.00	0.05
177	688661	和林微纳	1,452	121,982.52	0.05
178	300316	晶盛机电	2,300	116,150.00	0.05
179	600011	华能国际	27,300	115,206.00	0.05
180	300433	蓝思科技	3,700	108,817.00	0.04
181	002078	太阳纸业	8,000	106,800.00	0.04

182	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.04
183	600529	山东药玻	2,900	98,455.00	0.04
184	000002	万科A	4,126	98,240.06	0.04
185	688639	华恒生物	2,302	97,328.56	0.04
186	002745	木林森	6,600	88,440.00	0.04
187	603882	金域医学	530	84,678.10	0.03
188	002705	新宝股份	3,000	78,750.00	0.03
189	000799	酒鬼酒	300	76,680.00	0.03
190	601928	凤凰传媒	10,200	72,828.00	0.03
191	000069	华侨城A	9,700	72,168.00	0.03
192	300979	华利集团	805	70,437.50	0.03
193	000786	北新建材	1,700	66,725.00	0.03
194	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.03
195	688676	金盘科技	3,750	60,900.00	0.02
196	002601	龙蟠佰利	1,700	58,786.00	0.02
197	688359	三孚新科	2,213	58,312.55	0.02
198	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.02
199	600019	宝钢股份	6,800	51,952.00	0.02
200	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.02
201	688087	英科再生	2,098	46,072.08	0.02
202	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.02
203	300973	立高食品	360	41,655.60	0.02
204	002266	浙富控股	8,300	41,417.00	0.02
205	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.01
206	300981	中红医疗	382	34,528.98	0.01
207	688067	爱威科技	1,259	31,260.97	0.01
208	600398	海澜之家	4,300	31,132.00	0.01
209	601615	明阳智能	1,859	30,097.21	0.01
210	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.01
211	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.01
212	300941	创识科技	399	19,926.06	0.01
213	300115	长盈精密	900	18,540.00	0.01
214	002736	国信证券	1,700	18,275.00	0.01
215	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.01
216	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.01
217	688002	睿创微纳	160	15,972.80	0.01
218	600563	法拉电子	100	15,836.00	0.01
219	300932	三友联众	492	15,601.32	0.01
220	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.01

221	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.01
222	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.01
223	300940	南极光	307	13,317.66	0.01
224	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.01
225	300937	药易购	244	13,105.24	0.01
226	301013	利和兴	471	12,768.81	0.01
227	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.01
228	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
229	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
230	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
231	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
232	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
233	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
234	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
235	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
236	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
237	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
238	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
239	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
240	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
241	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
242	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
243	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
244	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
245	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
246	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
247	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
248	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
249	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
250	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
251	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
252	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
253	000513	丽珠集团	100	5,002.00	0.00
254	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
255	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
256	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
257	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
258	300992	泰福泵业	200	4,064.00	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	600519	贵州茅台	13,543,149.92	1.35
2	300059	东方财富	10,383,246.66	1.03
3	600276	恒瑞医药	9,626,494.00	0.96
4	000725	京东方 A	8,748,938.00	0.87
5	603259	药明康德	8,563,045.60	0.85
6	603501	韦尔股份	8,383,125.00	0.83
7	601318	中国平安	6,909,835.00	0.69
8	600030	中信证券	6,821,968.00	0.68
9	000001	平安银行	6,783,675.00	0.67
10	000858	五 粮 液	6,489,578.00	0.64
11	000656	金科股份	6,360,379.00	0.63
12	002460	赣锋锂业	6,051,963.00	0.60
13	600900	长江电力	5,884,422.00	0.58
14	600887	伊利股份	5,852,556.21	0.58
15	600061	国投资本	5,801,699.88	0.58
16	002714	牧原股份	5,477,774.00	0.54
17	603056	德邦股份	5,431,538.80	0.54
18	002064	华峰氨纶	5,144,616.90	0.51
19	002271	东方雨虹	4,834,540.50	0.48
20	002142	宁波银行	4,693,839.07	0.47

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	600519	贵州茅台	39,503,018.95	3.92
2	601318	中国平安	30,154,357.77	3.00
3	600036	招商银行	26,818,298.19	2.66
4	000858	五 粮 液	21,933,940.00	2.18
5	000333	美的集团	18,635,210.97	1.85

6	600276	恒瑞医药	17,265,208.75	1.72
7	601166	兴业银行	15,530,232.18	1.54
8	000157	中联重科	15,325,834.40	1.52
9	600809	山西汾酒	14,997,926.00	1.49
10	601919	中远海控	14,071,839.25	1.40
11	002027	分众传媒	13,996,545.00	1.39
12	601231	环旭电子	13,643,106.36	1.36
13	600030	中信证券	11,776,438.00	1.17
14	601398	工商银行	11,455,049.00	1.14
15	601229	上海银行	11,208,392.42	1.11
16	000932	华菱钢铁	11,050,890.22	1.10
17	603486	科沃斯	10,988,595.79	1.09
18	300059	东方财富	10,814,975.94	1.07
19	601012	隆基股份	10,664,566.25	1.06
20	600031	三一重工	10,391,544.00	1.03

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	543,811,347.12
卖出股票收入（成交）总额	1,221,554,351.08

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
IF2107	沪深 300 期货 2107 合约	-40	-62,294,400.00	128,809.09	-
IF2109	沪深 300 期货 2109 合约	-73	-113,144,160.00	-991,320.00	-
公允价值变动总额合计（元）					-862,510.91
股指期货投资本期收益（元）					-35,474,434.37
股指期货投资本期公允价值变动（元）					16,586,974.37

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金使用股指期货对冲市场风险，对冲掉投资组合对市场风险的暴露（贝塔）。基金经理会综合考虑各个月份期货合约之间的定价关系、套利机会、流动性以及保证金要求等因素，在各个月份期货合约之间进行动态配置，通过空头部分的优化创造额外收益。

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 176,927,642.68 元，占基金资产净值的比例为 70.67%；运用股指期货进行对冲的空头合约市值 -175,438,560.00 元，占基金资产净值的比例为 -70.07%，空头合约市值占股票资产的比例为 -99.16%。

本报告期内，本基金执行市场中性策略的投资收益为 125,192,104.92 元，公允价值变动损益为 -54,403,326.19 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	21,273,822.63
2	应收证券清算款	537,605.64
3	应收股利	—
4	应收利息	22,488.58
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	21,833,916.85

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
1,354	152,274.16	185,774,900.05	90.10%	20,404,311.00	9.90%

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	8,995.02	0.0044%

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	9.10	10,002,400.00	4.85	3 年
基金管理人高级管理人员	0.00	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	9.10	10,002,400.00	4.85	—

§ 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	837,807,793.64
本报告期基金总申购份额	58,183,549.38
减：本报告期基金总赎回份额	689,812,131.97
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	206,179,211.05

§ 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

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

上述人事变动已按相关规定备案、公告。

本报告期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

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	232,655,091.77	13.24%	216,287.27	14.41%	—
国盛证券	2	219,021,679.72	12.47%	160,171.22	10.67%	—
东吴证券	2	171,987,660.12	9.79%	160,171.64	10.67%	—
华创证券	1	156,249,095.87	8.89%	145,517.14	9.70%	—
国信证券	2	155,955,090.51	8.88%	114,049.47	7.60%	—
华泰证券	5	153,834,830.06	8.76%	140,189.48	9.34%	—

中信建投	3	108,603,252.73	6.18%	79,781.63	5.32%	—
宏信证券	2	100,325,952.36	5.71%	93,433.66	6.23%	—
天风证券	2	88,459,975.35	5.03%	83,282.54	5.55%	—
招商证券	3	85,233,651.64	4.85%	78,151.35	5.21%	—
海通证券	2	70,041,122.70	3.99%	51,215.49	3.41%	—
民生证券	3	51,598,520.00	2.94%	47,022.14	3.13%	—
信达证券	2	51,258,576.33	2.92%	36,460.81	2.43%	—
西部证券	1	42,728,158.53	2.43%	31,245.97	2.08%	—
粤开证券	1	39,867,748.07	2.27%	36,332.30	2.42%	—
西藏东方财富	2	29,254,263.25	1.66%	27,244.96	1.82%	—
恒泰证券	1	—	—	—	—	—
华西证券	1	—	—	—	—	—
西南证券	1	—	—	—	—	—
新时代证券	1	—	—	—	—	—
万联证券	2	—	—	—	—	—
东海证券	2	—	—	—	—	—
南京证券	1	—	—	—	—	—
浙商证券	1	—	—	—	—	—
方正证券	1	—	—	—	—	—
财达证券	1	—	—	—	—	—
爱建证券	1	—	—	—	—	—
东北证券	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。

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	207,339.00	6.07%	—	—	—	—
国盛证券	1,724,643.60	50.49%	170,000,000.00	26.56%	—	—
东吴证券	—	—	—	—	—	—
华创证券	—	—	—	—	—	—
国信证券	1,175,094.40	34.40%	100,000,000.00	15.63%	—	—
华泰证券	—	—	—	—	—	—
中信建投	—	—	—	—	—	—
宏信证券	—	—	—	—	—	—
天风证券	—	—	—	—	—	—
招商证券	—	—	—	—	—	—
海通证券	—	—	370,000,000.00	57.81%	—	—
民生证券	308,896.37	9.04%	—	—	—	—
信达证券	—	—	—	—	—	—
西部证券	—	—	—	—	—	—
粤开证券	—	—	—	—	—	—
西藏东方财富	—	—	—	—	—	—
恒泰证券	—	—	—	—	—	—
华西证券	—	—	—	—	—	—
西南证券	—	—	—	—	—	—
新时代证券	—	—	—	—	—	—
万联证券	—	—	—	—	—	—
东海证券	—	—	—	—	—	—
南京证券	—	—	—	—	—	—

浙商证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-

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股份有限公司申购及定期定额投资一折费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 6 月 30 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	2021 年 6 月 24 日
3	华泰柏瑞基金管理有限公司关于提醒客户及时更新身份证件及非自然人客户及时登记受益所有人信息的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 6 月 22 日
4	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	2021 年 6 月 9 日
5	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二十四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	2021 年 6 月 8 日
6	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参与珠海盈米基金销售有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 6 月 2 日
7	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	2021 年 5 月 21 日
8	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 5 月 20 日
9	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 5 月 14 日
10	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 5 月 12 日
11	华泰柏瑞基金管理有限公司关于	证监会规定报刊和	2021 年 4 月 30 日

	旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	网站	
12	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参加浙商银行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	2021 年 4 月 30 日
13	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止上海尚善基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 4 月 27 日
14	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参与蚂蚁（杭州）基金销售有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 4 月 20 日
15	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金在东方财富证券股份有限公司开通基金定期定额投资业务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	2021 年 3 月 18 日
16	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	2021 年 3 月 11 日
17	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 3 月 5 日
18	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 3 月 4 日
19	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二十三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	2021 年 3 月 3 日
20	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 2 月 27 日
21	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	2021 年 2 月 19 日
22	关于终止包商银行股份有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 2 月 9 日
23	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 1 月 22 日
24	华泰柏瑞基金管理有限公司关于网上直销直连招商银行升级签约	证监会规定报刊和网站	2021 年 1 月 14 日

	方式的提示性公告		
25	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金参加北京增财基金销售有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 1 月 7 日
26	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 1 月 7 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20210618-20210630;	41,580,041.58	0.00	0.00	41,580,041.58	20.17%
	2	20210316-20210617;	165,234,633.18	0.00	141,000,000.00	24,234,633.18	11.75%
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

本基金报告期内有单一机构持有基金份额超过 20%的情形。如果这些份额持有比例较大的投资者赎回，可能导致巨额赎回，从而引发流动性风险，可能对基金产生如下影响：（1）延期办理赎回申请或暂停赎回的风险。当发生巨额赎回时，投资者可能面临赎回申请延期办理、延缓支付或暂停赎回的风险。

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

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

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

2021 年 8 月 28 日