

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 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2022 年 3 月 31 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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 3 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本年度报告财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 2021 年 12 月 31 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	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	8
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9 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	16
§ 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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	16
§ 6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
§ 7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	21
7.4 报表附注	22
§ 8 投资组合报告	55
8.1 期末基金资产组合情况	55
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	55

8.3	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	56
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动	64
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	65
8.6	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	65
8.7	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	65
8.8	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	65
8.9	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	65
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	65
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	66
8.12	市场中性策略执行情况	66
8.13	投资组合报告附注	66
§ 9	基金份额持有人信息	67
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	67
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	67
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	67
9.4	发起式基金发起资金持有份额情况	67
§ 10	开放式基金份额变动	68
§ 11	重大事件揭示	68
11.1	基金份额持有人大会决议	68
11.2	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	68
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	69
11.4	基金投资策略的改变	69
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	69
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	69
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	69
11.8	其他重大事件	72
§ 12	影响投资者决策的其他重要信息	75
12.1	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	75
12.2	影响投资者决策的其他重要信息	76
§ 13	备查文件目录	76
13.1	备查文件目录	76
13.2	存放地点	76
13.3	查阅方式	76

§ 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	117,667,755.57 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较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
	联系电话	021-38601777
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com
客户服务电话	400-888-0001	021-60637111
传真	021-38601799	021-60635778
注册地址	上海市浦东新区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	上海市浦东新区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	200135	100033
法定代表人	贾波	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
----------------	-------

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.huatai-pb.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2021 年	2020 年	2019 年
本期已实现收益	67,846,780.70	-61,637,466.33	1,574,793.37
本期利润	3,234,316.62	-1,049,790.89	12,577,438.77
加权平均基金份额本期利润	0.0073	-0.0013	0.0648
本期加权平均净值利润率	0.61%	-0.11%	5.73%
本期基金份额净值增长率	2.45%	4.31%	5.67%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
期末可供分配利润	27,142,441.79	94,916,251.63	20,562,922.35
期末可供分配基金份额利润	0.2307	0.1133	0.1204
期末基金资产净值	144,810,197.36	1,006,483,739.89	196,754,004.13
期末基金份额净值	1.2307	1.2013	1.1517
3.1.3 累计期末指	2021 年末	2020 年末	2019 年末

标			
基金份额 累计净值 增长率	23.07%	20.13%	15.17%

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
过去三个月	-0.76%	0.26%	0.28%	0.00%	-1.04%	0.26%
过去六个月	1.35%	0.33%	0.56%	0.00%	0.79%	0.33%
过去一年	2.45%	0.30%	1.12%	0.00%	1.33%	0.30%
过去三年	12.92%	0.32%	3.35%	0.00%	9.57%	0.32%
过去五年	19.02%	0.29%	5.58%	0.00%	13.44%	0.29%
自基金合同生效起至今	23.07%	0.26%	7.39%	0.00%	15.68%	0.26%

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

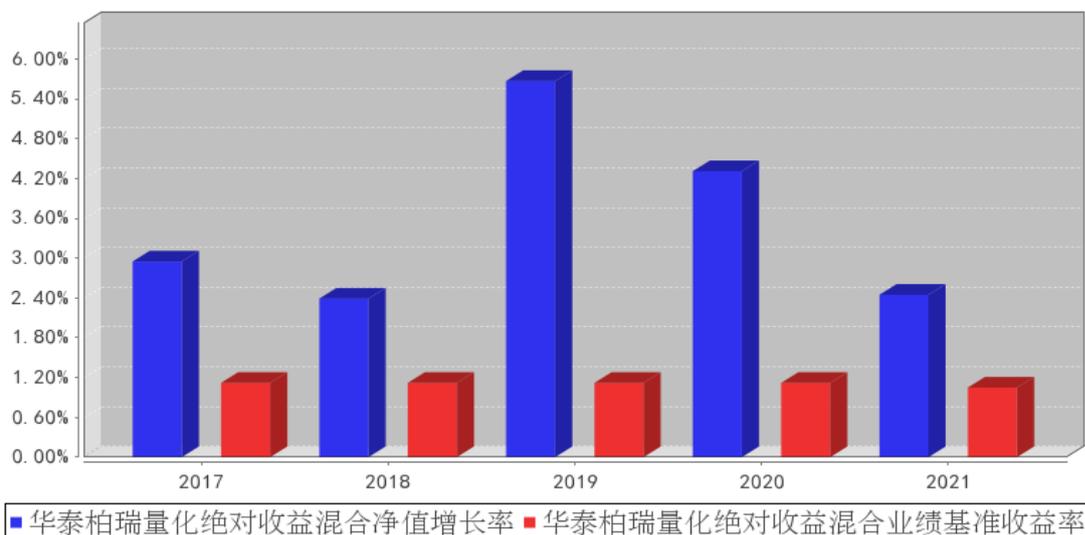
华泰柏瑞量化绝对收益混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：图示日期为 2015 年 6 月 29 日至 2021 年 12 月 31 日。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华泰柏瑞量化绝对收益混合基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

融地产灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数基金、华泰柏瑞医疗健康混合型证券投资基金、华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通指数基金联接基金、华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞量化明选混合型证券投资基金、华泰柏瑞基本面智选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞锦泰一年定期开放债券型证券投资基金、华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞益通三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、华泰柏瑞研究精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞景气回报一年持有期混合型证券投资基金、华泰柏瑞锦兴 39 个月定期开放债券型证券投资基金、华泰柏瑞锦瑞债券型证券投资基金、华泰柏瑞益商一年定期开放债券型发起式证券投资基金、华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞质量成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞行业精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞鸿利中短债债券型证券投资基金、华泰柏瑞景气优选混合型证券投资基金、华泰柏瑞品质优选混合型证券投资基金、华泰柏瑞景利混合型证券投资基金、华泰柏瑞优势领航混合型证券投资基金、华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞锦乾债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化创盈混合型证券投资基金、华泰柏瑞成长智选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞量化创享混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞质量领先混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证稀土产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞品质成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞质量精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证物联网主题交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞港股通时代机遇混合型证券投资基金、华泰柏瑞南方东英恒生科技指数交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞行业严选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证企业核心竞争力 50 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证沪港深创新药产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞远见智选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金、华泰柏瑞景气成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞创业板科技交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、华泰柏瑞锦元债券型证券投资基金、华泰柏瑞上证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞中证沪港深品牌消费 50 交易型开放式指数证券投资基金、华

泰柏瑞中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证稀土产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金。截至 2021 年 12 月 31 日，公司基金管理规模为 2443.87 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	<p>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 月至 2021 年 11 月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。2021 年 12 月起任华泰柏瑞中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。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。</p>

盛豪	量化与海外投资部 量化投资 总监、本 基金的基 金经理	2021 年 9 月 17 日	-	13 年	英国剑桥大学数学系硕士。2007 年 10 月至 2010 年 3 月任 Wilshire Associates 量化研究员，2010 年 11 月至 2012 年 8 月任 Goldenberg Hehmeyer Trading Company 交易员。2012 年 9 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任量化投资部研究员、基金经理助理。2015 年 1 月起任量化投资部副总监，2015 年 10 月起任华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 12 月至 2018 年 11 月任华泰柏瑞行业竞争优势灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 3 月至 2018 年 10 月任华泰柏瑞盛利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 3 月至 2018 年 11 月任华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 3 月至 2018 年 3 月任华泰柏瑞嘉利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 4 月至 2018 年 4 月任华泰柏瑞泰利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 4 月至 2019 年 3 月任华泰柏瑞睿利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 6 月至 2020 年 6 月任华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 9 月起任华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 12 月起任华泰柏瑞港股通量化灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 3 月起任华泰柏瑞量化明选混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 12 月起任华泰柏瑞量化创享混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月起任华泰柏瑞量化先行混合型证券投资基金和华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金的基金经理。
----	---	--------------------	---	------	--

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

报告期内，本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求，建立了科学完善的公平交易管理制度，从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能发生的利益输送。投资部和研究部通过规范的决策流程公平对待不同投资组合。交易部对投资指令的合规性、有效性及合理性进行独立审核，对于场内交易的非组合指令启用投资管理系统中的公平交易模块；对于场外交易按照时间优先价格优先的原则公平对待不同帐户。风险管理部对报告期内的交易进行日常监控和分析评估，同时对投资组合的交易价差在不同时间窗（如日内、3 日、5 日）下进行分析，综合判断各基金之间是否存在不公平交易或利益输送的可能，确保公平交易的实施。

4.3.2 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。

4.3.3 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

2021 年，市场风格经历了几次较大的转变。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。三季度在上游资源品供给不足、“能耗双控”等因素的影响下，周期、中小市值板块表现较好；四季度周期品价格在调控之后有明显的回落，前期较为强势的新能源主题呈现震荡，市场行情进一步集中至中小市值、题材板块。全年区间，传统行业占比较高的上证 50 下跌 10.06%，沪深 300 下跌 5.20%；代表成长类的创业板指和科创 50 分别上涨 12.02% 和 0.37%；相对估值偏低的中小市值指数中证 500 和中证 1000 分别上涨 15.58% 和 20.52%。整体来看市场一方面对基本面复苏、上游供需变化比较敏感，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

截至本报告期末的基金份额净值为 1.2307 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.45%，同期业绩比较基准收益率为 1.12%。

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，IF 基差全年呈现前贴后升的态势，基差在 3 月贴水达到最大幅度，9 月之后负基差逐渐至 12 月全面转为升水。我们会根据模型的预期超额收益以及对未来基差的判断，来增减对冲仓位。另外，策略虽不依赖基差套利，但基差若有大的波动机会也尽量把握，来补贴对冲成本。

量化策略方面，我们预期未来的市场风格会更加有利于华泰柏瑞量化模型争取获取超额收益。从因子表现来看，压抑两年的估值因子出现一定反转，而我们计算的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，当前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。虽

然近期市场有一定的反复，但大方向上应该还是比较确定的。

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

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2021 年度，本基金管理人在为基金份额持有人谋求最大利益的同时，始终将合规运作、防范风险工作放在各项工作的首位。依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。公司监察部门按照规定的权限和程序，通过实时监控、现场检查、重点抽查和人员询问等方法，独立地开展基金运作和公司管理的合规性稽核，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向董事长和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

(1) 全面开展基金运作合规监察工作，确保基金投资的独立性、公平性及合法合规

主要措施有：严格执行集中交易制度，各基金相互独立，交易指令由中央交易室统一执行完成；对基金投资交易系统进行事先合规性设置，并由风险控制部门进行实时监控，杜绝出现违规行为；严格检查基金的投资决策、研究支持、交易过程是否符合规定的程序；通过以上措施，保证了投资运作遵循投资决策程序与业务流程，保证了基金投资组合符合相关法规及基金合同规定，确保了基金投资行为的独立、公平及合法合规。

(2) 开展定期和专项监察稽核工作，确保各项业务活动的合法合规

本年度公司监察稽核部门开展了对公司基金投资、研究、销售、后台运营、反洗钱等方面的专项监察稽核活动。对稽核中发现问题及时发出合规提示函，要求相关部门限期整改，并对改进情况安排后续跟踪检查，确保各项业务开展合法合规。

(3) 促进公司各项内部管理制度的完善

按照相关法规、证监会等监管机关的相关规定和公司业务的发展的要求，公司法律监察部门及时要求各部门制订或修改相应制度，促进公司各项内部管理制度的进一步完善。

(4) 通过各种合规培训提高员工合规意识

本年度公司监察稽核部门通过对公司所有新入职员工进行入职前合规培训、对全体人员开展行为规范培训、对基金投资管理人员进行专项合规培训、对员工进行反洗钱培训等，有效提高了公司员工的合规意识。

通过以上工作的开展，在本报告期内本基金运作过程中未发生违规情形，基金运作整体合法合规。在今后的工作中，本基金管理人承诺将一如既往的本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和

运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，为基金持有人谋求最大利益。

4.7 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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定，在符合有关基金分红条件的前提下，可进行收益分配。本报告期内，本基金未进行利润分配。

4.9 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遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本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 托管人对本年度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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字（2022）第 28138 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	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全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了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“华泰柏瑞量化绝对收益混合基金”)的财务报表,包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表,2021 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了华泰柏瑞量化绝对收益混合基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于华泰柏瑞量化绝对收益混合基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>华泰柏瑞量化绝对收益混合基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估华泰柏瑞量化绝对收益混合基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算华泰柏瑞量化绝对收益混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督华泰柏瑞量化绝对收益混合基金的财务报告过程。</p>

<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对华泰柏瑞量化绝对收益混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致华泰柏瑞量化绝对收益混合基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
<p>会计师事务所的名称</p>	<p>普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)</p>
<p>注册会计师的姓名</p>	<p>张炯 朱宏宇</p>
<p>会计师事务所的地址</p>	<p>中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼</p>
<p>审计报告日期</p>	<p>2022 年 03 月 30 日</p>

§ 7 年度财务报表

7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	2,652,833.63	9,301,971.74
结算备付金		4,699,611.37	70,168,674.30
存出保证金		14,705,240.33	99,039,091.80
交易性金融资产	7.4.7.2	123,683,497.60	827,403,886.56
其中：股票投资		123,683,497.60	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		70,955.06	3,400,351.97
应收利息	7.4.7.5	2,761.43	57,323.38
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		145,814,899.42	1,009,371,299.75
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
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		310,446.49	1,453,145.53
应付托管费		51,741.09	242,190.91
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	462,514.48	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	7.4.7.8	180,000.00	205,000.00
负债合计		1,004,702.06	2,887,559.86
所有者权益：			

实收基金	7.4.7.9	117,667,755.57	837,807,793.64
未分配利润	7.4.7.10	27,142,441.79	168,675,946.25
所有者权益合计		144,810,197.36	1,006,483,739.89
负债和所有者权益总计		145,814,899.42	1,009,371,299.75

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.2307 元，基金份额总额 117,667,755.57 份。

7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		17,203,014.22	20,652,558.24
1. 利息收入		1,611,858.06	3,200,721.29
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,461,511.48	1,757,130.19
债券利息收入		387.91	249.22
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		149,958.67	1,443,341.88
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		79,145,338.17	-44,571,188.86
其中：股票投资收益	7.4.7.12	113,122,625.11	207,116,499.40
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	222,651.75	33,847.35
资产支持证券投资	7.4.7.13.5	-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-38,390,665.28	-268,054,826.85
股利收益	7.4.7.16	4,190,726.59	16,333,291.24
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-64,612,464.08	60,587,675.44
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	1,058,282.07	1,435,350.37
减：二、费用		13,968,697.60	21,702,349.13
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	8,146,366.71	14,242,921.53

2. 托管费	7.4.10.2.2	1,357,727.68	2,373,820.11
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	4,259,489.29	4,831,496.54
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	22,601.92
7. 其他费用	7.4.7.20	205,113.31	231,509.03
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,234,316.62	-1,049,790.89
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,234,316.62	-1,049,790.89

7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 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）	-	3,234,316.62	3,234,316.62
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）	-720,140,038.07	-144,767,821.08	-864,907,859.15
其中：1. 基金申购款	205,001,620.57	51,339,031.75	256,340,652.32
2. 基金赎回款	-925,141,658.64	-196,106,852.83	-1,121,248,511.47
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	117,667,755.57	27,142,441.79	144,810,197.36

项目	上年度可比期间		
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
权益(基金净值)			
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)	-	-1,049,790.89	-1,049,790.89
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)	666,973,833.31	143,805,693.34	810,779,526.65
其中：1. 基金申购款	1,116,470,624.24	242,280,040.57	1,358,750,664.81
2. 基金赎回款	-449,496,790.93	-98,474,347.23	-547,971,138.16
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)	837,807,793.64	168,675,946.25	1,006,483,739.89

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

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

7.4 报表附注

7.4.1 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》和《华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发

起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 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。发起资金认购部分为 10,002,400.00 份基金份额，发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 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 2022 年 3 月 30 日批准报出。

7.4.2 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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年度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 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件,应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的;且 2) 交易双方准备按净额结算时,金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列,并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则

按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 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) 本基金的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，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后

的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于2017年颁布了修订后的《企业会计准则第14号—收入》,本基金于2021年1月1日起执行。本基金在编制2021年度财务报表时已采用该准则,该准则的采用未对本基金财务报表产生重大影响。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

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

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品

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

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

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

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

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

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	2,652,833.63	9,301,971.74
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	2,652,833.63	9,301,971.74

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	121,522,284.94	123,683,497.60	2,161,212.66
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	121,522,284.94	123,683,497.60	2,161,212.66
项目	上年度末 2020年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	739,388,004.54	825,744,393.56	86,356,389.02
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	1,604,000.00	1,659,493.00
	银行间市场	-	-
	合计	1,604,000.00	1,659,493.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	740,992,004.54	827,403,886.56	86,411,882.02

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	-123,968,680.00	-	-	
其中：股指期货投资	-123,968,680.00	-	-	
其他衍生	-	-	-	

工具				
合计	-123,968,680.00	-	-	-
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 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	-806,821,874.72	-	-	-
其他衍生 工具	-	-	-	-
合计	-806,821,874.72	-	-	-

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的股指期货合约情况如下：

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IF2201	沪深 2201	-5	-7,421,100.00	186,700.00
IF2203	沪深 2203	-77	-114,358,860.00	2,002,020.00
总额合计		-82	-121,779,960.00	2,188,720.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	-2,188,720.00
股指期货投资净额	-	-	-	-

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	310.39	2,416.13

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	2,405.61	54,616.07
应收债券利息	-	228.59
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	45.43	62.59
合计	2,761.43	57,323.38

7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
交易所市场应付交易费用	462,514.48	987,217.94
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	462,514.48	987,217.94

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31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	180,000.00	205,000.00
合计	180,000.00	205,000.00

7.4.7.9 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12月31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	205,001,620.57	205,001,620.57
本期赎回（以“-”号填列）	-925,141,658.64	-925,141,658.64
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-

本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	117,667,755.57	117,667,755.57

注：1. 申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

2. 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。

7.4.7.10 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	67,846,780.70	-64,612,464.08	3,234,316.62
本期基金份额交易产生的变动数	-131,813,697.34	-12,954,123.74	-144,767,821.08
其中：基金申购款	50,452,801.14	886,230.61	51,339,031.75
基金赎回款	-182,266,498.48	-13,840,354.35	-196,106,852.83
本期已分配利润	-	-	-
本期末	30,949,334.99	-3,806,893.20	27,142,441.79

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
活期存款利息收入	209,452.72	670,011.83
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	1,249,274.21	1,085,055.81
其他	2,784.55	2,062.55
合计	1,461,511.48	1,757,130.19

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日

	日	31日
股票投资收益——买卖 股票差价收入	113,122,625.11	207,116,499.40
股票投资收益——赎回 差价收入	-	-
股票投资收益——申购 差价收入	-	-
股票投资收益——证券 出借差价收入	-	-
合计	113,122,625.11	207,116,499.40

7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31 日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12 月31日
卖出股票成交总额	1,633,020,798.68	1,343,815,950.18
减：卖出股票成本总 额	1,519,898,173.57	1,136,699,450.78
买卖股票差价收入	113,122,625.11	207,116,499.40

7.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无股票投资收益-证券出借差价收入。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 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12月31 日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31 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	33,847.35
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	33,847.35

7.4.7.13.2 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12月31 日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月 31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	3,415,973.37	194,075.44
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	3,192,700.00	160,200.00
减：应收利息总额	621.62	28.09
买卖债券差价收入	222,651.75	33,847.35

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间无债权赎回差价收入。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间无债券申购差价收入。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间无买卖权证差价收入。

7.4.7.15.2 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	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	收益金额 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
股指期货-投资收益	-38,390,665.28	-268,054,826.85

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	4,190,726.59	16,333,291.24
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	4,190,726.59	16,333,291.24

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-84,250,669.36	72,510,010.39
股票投资	-84,195,176.36	72,454,517.39
债券投资	-55,493.00	55,493.00
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	19,638,205.28	-11,922,334.95
权证投资	-	-
期货投资	19,638,205.28	-11,922,334.95
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-64,612,464.08	60,587,675.44

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	1,004,103.91	1,306,231.29

基金转换费收入	434.30	129,119.08
其他收入	53,743.86	-
合计	1,058,282.07	1,435,350.37

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，其中赎回费总额不低于 25% 的部分归入基金资产。对持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5% 的赎回费，并全额计入基金财产。

2. 本基金的转换费由转出基金赎回费用及基金申购补差费用构成，其中不低于转出基金赎回费用的 25% 的部分归入转出基金的基金资产。

3. 其他为康美药业赔偿款。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	4,259,489.29	4,831,496.54
银行间市场交易费用	-	-
合计	4,259,489.29	4,831,496.54

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
审计费用	60,000.00	85,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行划款手续费	5,225.12	-
银行间账户服务费	18,000.00	18,000.00
其他费用	1,888.19	-
其他费用-场内交易费用	-	8,509.03
合计	205,113.31	231,509.03

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金的基金管理人于 2022 年 3 月 23 日宣告 2022 年度第 1 次分红，向截至 2022 年 3 月 24 日止在本基金注册登记人华泰柏瑞基金管理有限公司登记在册的全体持有人，按每 10 份基金份额派发红利 0.6240 元。

7.4.9 关联方关系

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
PineBridge Investment LLC	基金管理人的股东
苏州新区高新技术产业股份有限公司	基金管理人的股东
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
柏瑞爱建资产管理（上海）有限公司	基金管理人的控股子公司

注：关联方与基金进行的关联交易均在正常业务范围内按照一般商业条款而订立的。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31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	284,168,314.27	11.28	532,637,276.32	17.56

7.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31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	260,035.84	11.88	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31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	492,389.22	18.44	113,146.57	11.46

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	8,146,366.71	14,242,921.53
其中：支付销售机构的客户维护费	201,424.86	330,178.41

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,357,727.68	2,373,820.11

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。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31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/卖出总份额		0.00		0.00
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		15.9372%		2.2383%

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。

7.4.10.5.2 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：本报告期末及上年度末，除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

7.4.10.6 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12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31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	2,652,833.63	209,452.72	9,301,971.74	670,011.83

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。

7.4.10.7 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 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 张）	总金额
华泰联合证券	688083	中望软件	网下申购	1,837	276,468.50
华泰联合证券	301155	海力风电	网下申购	3,043	184,588.38
华泰联合证券	688192	迪哲医药	网下申购	3,179	167,151.82
华泰联合证券	688151	华强科技	网下申购	4,308	151,167.72
华泰联合证券	688280	精进电动	网下申购	9,969	137,372.82
华泰联合证券	688161	威高骨科	网下申购	3,069	111,159.18
华泰联合证券	301093	华兰股份	网下申购	1,757	102,046.56
华泰联合证券	301179	泽宇智能	网下申购	1,871	82,305.29
华泰联合证券	688236	春立医疗	网下申购	2,594	77,327.14
华泰联合证券	688656	浩欧博	网下申购	1,371	48,341.46
华泰联合证券	688097	博众精工	网下申购	3,983	44,888.41
华泰联合证券	301078	孩子王	网下申购	7,551	43,569.27
华泰联合证券	688613	奥精医疗	网下申购	2,617	42,997.31
华泰联合证券	300952	恒辉安防	网下申购	3,398	39,824.56
华泰联合证券	688350	富淼科技	网下申购	2,552	34,656.16
华泰联合证券	688787	海天瑞声	网下申购	817	30,179.98
华泰联合证券	605499	东鹏饮料	网下申购	632	29,242.64
华泰联合证券	688314	康拓医疗	网下申购	1,085	18,813.90
华泰联合证券	688722	同益中	网下申购	3,687	16,628.37
华泰联合证券	301033	迈普医学	网下申购	1,076	16,290.64
华泰联合证券	605389	长龄液压	网下申购	356	14,026.40
华泰联合证券	605208	永茂泰	网下申购	801	10,733.40
华泰联合证券	001234	泰慕士	网下申购	333	5,504.49
上年度可比期间					
2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 张）	总金额
华泰联合证券	300919	中伟股份	网下申购	6,093	149,887.80
华泰联合证券	300907	康平科技	网下申购	4,724	67,553.20

注：无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末(2021 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
688235	百济神州	2021 年 12 月 6 日	2022 年 6 月 15 日	新股锁定期内	192.60	136.46	3,603	693,937.80	491,665.38	-
688303	大全能源	2021 年 7 月 15 日	2022 年 1 月 24 日	新股锁定期内	21.49	60.51	4,004	86,045.96	242,282.04	-
688110	东芯股份	2021 年 12 月 3 日	2022 年 6 月 10 日	新股锁定期内	30.18	40.37	4,495	135,659.10	181,463.15	-
688167	炬光科技	2021 年 12 月 17 日	2022 年 6 月 24 日	新股锁定期内	78.69	176.67	863	67,909.47	152,466.21	-
688793	倍轻松	2021 年 7 月 7 日	2022 年 1 月 17 日	新股锁定期内	27.40	101.73	1,454	39,839.60	147,915.42	-
688257	新锐股份	2021 年 10 月 19 日	2022 年 4 月 27 日	新股锁定期内	62.30	61.10	2,271	141,483.30	138,758.10	-
688739	成大生物	2021 年 10 月 21 日	2022 年 4 月 28 日	新股锁定期内	110.00	70.32	1,482	163,020.00	104,214.24	-
688509	正元地信	2021 年 7 月 22 日	2022 年 2 月 7 日	新股锁定期内	1.97	6.17	15,433	30,403.01	95,221.61	-
688091	上海谊众	2021 年 9 月 1 日	2022 年 3 月 9 日	新股锁定期内	38.10	42.81	1,910	72,771.00	81,767.10	-
688262	国芯科技	2021 年 12 月 28 日	2022 年 1 月 6 日	新股未上市	41.98	41.98	1,242	52,139.16	52,139.16	-
301136	招标股份	2021 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 11 日	新股未上市	10.52	10.52	4,793	50,422.36	50,422.36	-
688701	卓锦股份	2021 年 9 月 8 日	2022 年 3 月 16 日	新股锁定期内	7.48	13.50	2,340	17,503.20	31,590.00	-

301155	海力风电	2021年 11月17 日	2022年 5月24 日	新股锁 定期内	60.66	96.75	305	18,501.30	29,508.75	-
301069	凯盛新材	2021年 9月16 日	2022年 3月28 日	新股锁 定期内	5.17	44.21	539	2,786.63	23,829.19	-
301018	申菱环境	2021年 6月28 日	2022年 1月7 日	新股锁 定期内	8.29	26.06	782	6,482.78	20,378.92	-
301149	隆华新材	2021年 11月3 日	2022年 5月10 日	新股锁 定期内	10.07	16.76	1,214	12,224.98	20,346.64	-
301177	迪阿股份	2021年 12月8 日	2022年 6月15 日	新股锁 定期内	116.88	116.08	165	19,285.20	19,153.20	-
301035	润丰股份	2021年 7月21 日	2022年 1月28 日	新股锁 定期内	22.04	56.28	296	6,523.84	16,658.88	-
301101	明月镜片	2021年 12月9 日	2022年 6月16 日	新股锁 定期内	26.91	43.36	371	9,983.61	16,086.56	-
301087	可孚医疗	2021年 10月15 日	2022年 4月25 日	新股锁 定期内	93.09	75.34	209	19,455.81	15,746.06	-
301118	恒光股份	2021年 11月9 日	2022年 5月18 日	新股锁 定期内	22.70	49.02	315	7,150.50	15,441.30	-
301089	拓新药业	2021年 10月20 日	2022年 4月27 日	新股锁 定期内	19.11	67.93	220	4,204.20	14,944.60	-
301111	粤万年青	2021年 11月30 日	2022年 6月7 日	新股锁 定期内	10.48	36.68	379	3,971.92	13,901.72	-
301168	通灵股份	2021年 12月2 日	2022年 6月10 日	新股锁 定期内	39.08	52.13	260	10,160.80	13,553.80	-
301090	华润材料	2021年 10月19 日	2022年 4月26 日	新股锁 定期内	10.45	11.22	1,195	12,487.75	13,407.90	-
301188	力诺特玻	2021年 11月4 日	2022年 5月11 日	新股锁 定期内	13.00	20.48	647	8,411.00	13,250.56	-
301017	漱玉平民	2021年 6月23 日	2022年 1月5 日	新股锁 定期内	8.86	23.80	555	4,917.30	13,209.00	-

		日	日								
301020	密封科技	2021年 6月28 日	2022年 1月6 日	新股锁 定期内	10.64	30.44	421	4,479.44	12,815.24		-
301138	华研精机	2021年 12月8 日	2022年 6月15 日	新股锁 定期内	26.17	44.86	285	7,458.45	12,785.10		-
301026	浩通科技	2021年 7月8 日	2022年 1月17 日	新股锁 定期内	18.03	62.73	203	3,660.09	12,734.19		-
301126	达嘉维康	2021年 11月30 日	2022年 6月7 日	新股锁 定期内	12.37	19.23	662	8,188.94	12,730.26		-
301166	优宁维	2021年 12月21 日	2022年 6月28 日	新股锁 定期内	86.06	94.50	131	11,273.86	12,379.50		-
301021	英诺激光	2021年 6月28 日	2022年 1月6 日	新股锁 定期内	9.46	41.43	290	2,743.40	12,014.70		-
301189	奥尼电子	2021年 12月21 日	2022年 6月28 日	新股锁 定期内	66.18	56.62	208	13,765.44	11,776.96		-
301039	中集车辆	2021年 7月1 日	2022年 1月10 日	新股锁 定期内	6.96	12.51	926	6,444.96	11,584.26		-
301100	风光股份	2021年 12月10 日	2022年 6月17 日	新股锁 定期内	27.81	31.14	360	10,011.60	11,210.40		-
301199	迈赫股份	2021年 11月30 日	2022年 6月7 日	新股锁 定期内	29.28	32.00	325	9,516.00	10,400.00		-
301028	东亚机械	2021年 7月12 日	2022年 1月20 日	新股锁 定期内	5.31	13.50	733	3,892.23	9,895.50		-
301179	泽宇智能	2021年 12月1 日	2022年 6月8 日	新股锁 定期内	43.99	50.77	188	8,270.12	9,544.76		-
301190	善水科技	2021年 12月17 日	2022年 6月24 日	新股锁 定期内	27.85	27.46	338	9,413.30	9,281.48		-
301078	孩子王	2021年 9月30 日	2022年 4月14 日	新股锁 定期内	5.77	12.14	756	4,362.12	9,177.84		-
301182	凯旺	2021年	2022年	新股锁	27.12	30.58	294	7,973.28	8,990.52		-

	科技	12月16日	6月23日	定期内							
301093	华兰股份	2021年10月21日	2022年5月5日	新股锁定期内	58.08	49.85	176	10,222.08	8,773.60		-
301092	争光股份	2021年10月21日	2022年5月5日	新股锁定期内	36.31	35.52	235	8,532.85	8,347.20		-
301096	百诚医药	2021年12月13日	2022年6月20日	新股锁定期内	79.60	78.53	106	8,437.60	8,324.18		-
301088	戎美股份	2021年10月19日	2022年4月28日	新股锁定期内	33.16	24.67	321	10,644.36	7,919.07		-
300814	中富电路	2021年8月4日	2022年2月14日	新股锁定期内	8.40	23.88	328	2,755.20	7,832.64		-
301133	金钟股份	2021年11月19日	2022年5月26日	新股锁定期内	14.33	26.95	286	4,098.38	7,707.70		-
301198	喜悦智行	2021年11月25日	2022年6月2日	新股锁定期内	21.76	29.20	262	5,701.12	7,650.40		-
301108	洁雅股份	2021年11月25日	2022年6月6日	新股锁定期内	57.27	53.71	138	7,903.26	7,411.98		-
301081	严牌股份	2021年10月13日	2022年4月20日	新股锁定期内	12.95	17.44	403	5,218.85	7,028.32		-
301033	迈普医学	2021年7月15日	2022年1月26日	新股锁定期内	15.14	59.97	108	1,635.12	6,476.76		-
301032	新柴股份	2021年7月15日	2022年1月24日	新股锁定期内	4.97	12.51	513	2,549.61	6,417.63		-
301036	双乐股份	2021年7月21日	2022年2月16日	新股锁定期内	23.38	29.93	205	4,792.90	6,135.65		-
301041	金百泽	2021年8月2日	2022年2月11日	新股锁定期内	7.31	28.21	215	1,571.65	6,065.15		-
301072	中捷精工	2021年9月22日	2022年3月29日	新股锁定期内	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21		-

001234	泰慕士	2021年 12月31 日	2023年 1月11 日	新股未 上市	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
301027	华蓝集团	2021年 7月8 日	2022年 1月19 日	新股锁 定期内	11.45	16.65	286	3,274.70	4,761.90	-
301073	君亭酒店	2021年 9月22 日	2022年 3月30 日	新股锁 定期内	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	-
301079	邵阳液压	2021年 10月11 日	2022年 4月19 日	新股锁 定期内	11.92	24.82	140	1,668.80	3,474.80	-

注：1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

2、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

3、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末未从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

7.4.13.2.4 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 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	-	1,341,000.00
AAA 以下	-	318,493.00
未评级	-	-
合计	-	1,659,493.00

注：债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

7.4.13.3 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 2021 年 12 月 31 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。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》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 7.4.12。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 12 月 31 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 1.60%。

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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年12月 31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	2,652,833.63	-	-	-	-	-	2,652,833.63
结算备付金	4,699,611.37	-	-	-	-	-	4,699,611.37
存出保证金	91,645.13	-	-	-	-	14,613,595.20	14,705,240.33
交易性金融资产	-	-	-	-	-	123,683,497.60	123,683,497.60
应收利息	-	-	-	-	-	2,761.43	2,761.43
应收证券清算款	-	-	-	-	-	70,955.06	70,955.06
资产总计	7,444,090.13	-	-	-	-	138,370,809.29	145,814,899.42

负债							
应付管理人报酬						310,446.49	310,446.49
应付托管费						51,741.09	51,741.09
应付交易费用						462,514.48	462,514.48
其他负债						180,000.00	180,000.00
负债总计						1,004,702.06	1,004,702.06
利率敏感度缺口	7,444,090.13					137,366.107.23	144,810.197.36
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						3,400,351.97	3,400,351.97
应收利息						57,323.38	57,323.38
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

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

者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2021 年 12 月 31 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)。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 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	123,683,497.60	85.41	825,744,393.56	82.04
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	123,683,497.60	85.41	825,744,393.56	82.04

注：注：其他包含在期货交易所交易的期货投资(附注 7.4.7.3)。在当日无负债结算制度下期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

7.4.13.4.3.2 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		
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 12 月 31 日)	上年度末(2020 年 12 月 31 日)	
分析	三个月银行定期存款收益率(税后)上升 5%	730,113.77	319,893,688.90
	三个月银行定期存款收益率(税后)下降 5%	-730,113.77	-319,893,688.90

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最

低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 121,366,368.36 元，属于第二层次的余额为 2,317,129.24 元，无属于第三层次的余额(2020 年 12 月 31 日：第一层次 821,476,987.23 元，第二层次 5,926,899.33 元，无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2020 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关衔接规定，以及财政部、银保监会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。截至 2021 年 12 月 31 日，本基金已完成了执行新金融工具准则对财务报表潜在影响的评估。鉴于本基金业务的性质，新金融工具准则预期不会对本基金的财

务状况和经营成果产生重大影响。

本基金将自 2022 年 1 月 1 日起追溯执行相关新规定，并采用准则允许的实务简便方法，调整期初所有者权益，2021 年的比较数据将不作重述。

(3)除公允价值和执行新金融工具准则外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	123,683,497.60	84.82
	其中：股票	123,683,497.60	84.82
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	7,352,445.00	5.04
8	其他各项资产	14,778,956.82	10.14
9	合计	145,814,899.42	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	768,384.00	0.53
B	采矿业	2,272,851.00	1.57
C	制造业	70,248,514.53	48.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,942,848.00	2.03
E	建筑业	3,302,865.80	2.28
F	批发和零售业	1,351,829.87	0.93
G	交通运输、仓储和邮政业	3,023,774.67	2.09
H	住宿和餐饮业	4,608.00	0.00

I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,270,835.92	3.64
J	金融业	26,560,159.79	18.34
K	房地产业	2,313,499.00	1.60
L	租赁和商务服务业	1,720,491.55	1.19
M	科学研究和技术服务业	1,283,146.25	0.89
N	水利、环境和公共设施管理业	31,590.00	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,008,692.10	0.70
R	文化、体育和娱乐业	1,579,407.12	1.09
S	综合	-	-
	合计	123,683,497.60	85.41

8.2.2 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通过港股通投资股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	2,731	5,598,550.00	3.87
2	600036	招商银行	67,877	3,306,288.67	2.28
3	300750	宁德时代	5,200	3,057,600.00	2.11
4	601166	兴业银行	122,400	2,330,496.00	1.61
5	603986	兆易创新	10,300	1,811,255.00	1.25
6	300059	东方财富	45,509	1,688,838.99	1.17
7	601318	中国平安	30,067	1,515,677.47	1.05
8	601012	隆基股份	16,278	1,403,163.60	0.97
9	002736	国信证券	119,300	1,369,564.00	0.95
10	000333	美的集团	17,900	1,321,199.00	0.91
11	601328	交通银行	279,700	1,289,417.00	0.89
12	600104	上汽集团	60,485	1,247,805.55	0.86
13	601919	中远海控	65,543	1,224,998.67	0.85
14	300122	智飞生物	9,700	1,208,620.00	0.83
15	600741	华域汽车	42,400	1,199,920.00	0.83
16	600132	重庆啤酒	7,800	1,180,296.00	0.82
17	300223	北京君正	8,800	1,179,200.00	0.81
18	600438	通威股份	25,900	1,164,464.00	0.80
19	002594	比亚迪	4,300	1,152,916.00	0.80
20	601668	中国建筑	219,400	1,097,000.00	0.76
21	600299	安迪苏	88,300	1,087,856.00	0.75

22	000858	五 粮 液	4,600	1,024,236.00	0.71
23	600809	山西汾酒	3,200	1,010,496.00	0.70
24	000999	华润三九	28,800	986,112.00	0.68
25	603517	绝味食品	14,400	983,952.00	0.68
26	600050	中国联通	249,400	980,142.00	0.68
27	600919	江苏银行	167,700	977,691.00	0.68
28	601985	中国核电	117,000	971,100.00	0.67
29	601881	中国银河	86,000	962,340.00	0.66
30	002410	广联达	14,700	940,506.00	0.65
31	000596	古井贡酒	3,800	927,200.00	0.64
32	600000	浦发银行	107,644	918,203.32	0.63
33	601336	新华保险	23,248	903,882.24	0.62
34	601211	国泰君安	50,400	901,656.00	0.62
35	600380	健康元	68,900	884,676.00	0.61
36	603659	璞泰来	5,500	883,355.00	0.61
37	300347	泰格医药	6,900	881,820.00	0.61
38	002460	赣锋锂业	6,000	857,100.00	0.59
39	600027	华电国际	159,200	851,720.00	0.59
40	688111	金山办公	3,200	848,000.00	0.59
41	600373	中文传媒	68,100	841,716.00	0.58
42	601988	中国银行	275,300	839,665.00	0.58
43	002142	宁波银行	21,410	819,574.80	0.57
44	600030	中信证券	31,000	818,710.00	0.57
45	300274	阳光电源	5,600	816,480.00	0.56
46	601186	中国铁建	103,000	803,400.00	0.55
47	300033	同花顺	5,500	795,190.00	0.55
48	002475	立讯精密	16,100	792,120.00	0.55
49	601319	中国人保	165,800	779,260.00	0.54
50	002714	牧原股份	14,400	768,384.00	0.53
51	601899	紫金矿业	78,500	761,450.00	0.53
52	002812	恩捷股份	3,000	751,200.00	0.52
53	601601	中国太保	27,300	740,376.00	0.51
54	300014	亿纬锂能	6,121	723,379.78	0.50
55	002129	中环股份	17,300	722,275.00	0.50
56	600760	中航沈飞	10,600	721,224.00	0.50
57	600325	华发股份	119,800	721,196.00	0.50
58	601878	浙商证券	54,400	716,992.00	0.50
59	002415	海康威视	13,600	711,552.00	0.49
60	002241	歌尔股份	13,100	708,710.00	0.49
61	603799	华友钴业	6,400	705,984.00	0.49
62	600887	伊利股份	16,700	692,382.00	0.48
63	601555	东吴证券	77,480	686,472.80	0.47

64	600271	航天信息	50,600	677,534.00	0.47
65	601699	潞安环能	58,600	662,766.00	0.46
66	300244	迪安诊断	19,000	637,830.00	0.44
67	002027	分众传媒	76,945	630,179.55	0.44
68	600057	厦门象屿	74,200	629,958.00	0.44
69	600048	保利发展	39,600	618,948.00	0.43
70	600690	海尔智家	20,500	612,745.00	0.42
71	000039	中集集团	35,700	612,612.00	0.42
72	600406	国电南瑞	15,200	608,456.00	0.42
73	300316	晶盛机电	8,700	604,650.00	0.42
74	000932	华菱钢铁	117,969	602,821.59	0.42
75	600392	盛和资源	30,600	600,372.00	0.41
76	600884	杉杉股份	18,300	599,691.00	0.41
77	688012	中微公司	4,715	596,919.00	0.41
78	000568	泸州老窖	2,300	583,901.00	0.40
79	688005	容百科技	5,005	578,477.90	0.40
80	000830	鲁西化工	37,200	567,672.00	0.39
81	300529	健帆生物	10,500	559,650.00	0.39
82	601658	邮储银行	109,200	556,920.00	0.38
83	601288	农业银行	188,700	554,778.00	0.38
84	300037	新宙邦	4,900	553,700.00	0.38
85	600141	兴发集团	14,500	549,260.00	0.38
86	300896	爱美客	1,000	536,110.00	0.37
87	600585	海螺水泥	13,300	535,990.00	0.37
88	603225	新风鸣	35,900	533,115.00	0.37
89	002601	龙佰集团	17,900	511,761.00	0.35
90	002048	宁波华翔	23,400	506,142.00	0.35
91	601225	陕西煤业	41,100	501,420.00	0.35
92	688235	百济神州	3,603	491,665.38	0.34
93	603833	欧派家居	3,300	486,750.00	0.34
94	600779	水井坊	4,000	479,960.00	0.33
95	002821	凯莱英	1,100	478,500.00	0.33
96	601618	中国中冶	124,700	477,601.00	0.33
97	600089	特变电工	22,400	474,208.00	0.33
98	601098	中南传媒	49,485	473,571.45	0.33
99	601390	中国中铁	80,300	464,937.00	0.32
100	300662	科锐国际	7,400	460,354.00	0.32
101	000725	京东方 A	90,300	456,015.00	0.31
102	600795	国电电力	143,300	454,261.00	0.31
103	002557	洽洽食品	7,400	454,064.00	0.31
104	002233	塔牌集团	42,900	453,882.00	0.31
105	600066	宇通客车	40,900	450,718.00	0.31

106	600546	山煤国际	54,700	449,087.00	0.31
107	000338	潍柴动力	25,000	447,250.00	0.31
108	600201	生物股份	26,800	438,180.00	0.30
109	603198	迎驾贡酒	6,300	437,535.00	0.30
110	601615	明阳智能	16,500	430,650.00	0.30
111	000959	首钢股份	75,100	430,323.00	0.30
112	600835	上海机电	27,000	429,840.00	0.30
113	600999	招商证券	24,330	429,424.50	0.30
114	600079	人福医药	19,000	427,880.00	0.30
115	600998	九州通	28,300	416,576.00	0.29
116	600018	上港集团	73,000	400,040.00	0.28
117	000776	广发证券	16,100	395,899.00	0.27
118	600029	南方航空	58,100	395,661.00	0.27
119	601006	大秦铁路	61,800	395,520.00	0.27
120	601138	工业富联	32,900	392,168.00	0.27
121	688396	华润微	6,061	391,540.60	0.27
122	002466	天齐锂业	3,500	374,500.00	0.26
123	603882	金域医学	3,330	370,862.10	0.26
124	002013	中航机电	20,300	369,054.00	0.25
125	600535	天士力	22,300	353,455.00	0.24
126	601169	北京银行	78,900	350,316.00	0.24
127	601669	中国电建	42,900	346,632.00	0.24
128	000001	平安银行	20,900	344,432.00	0.24
129	002396	星网锐捷	14,400	339,408.00	0.23
130	600958	东方证券	22,700	334,598.00	0.23
131	603599	广信股份	8,500	331,500.00	0.23
132	603260	合盛硅业	2,500	329,925.00	0.23
133	601633	长城汽车	6,700	325,218.00	0.22
134	600765	中航重机	6,392	322,732.08	0.22
135	002212	天融信	16,200	310,554.00	0.21
136	300595	欧普康视	5,400	309,798.00	0.21
137	688536	思瑞浦	400	307,200.00	0.21
138	000625	长安汽车	19,920	302,584.80	0.21
139	000002	万科A	15,300	302,328.00	0.21
140	601818	光大银行	90,900	301,788.00	0.21
141	600487	亨通光电	19,700	297,864.00	0.21
142	603444	吉比特	700	295,295.00	0.20
143	002156	通富微电	15,100	293,393.00	0.20
144	600309	万华化学	2,800	282,800.00	0.20
145	688099	晶晨股份	2,161	281,362.20	0.19
146	600346	恒力石化	12,200	280,234.00	0.19
147	002223	鱼跃医疗	6,800	257,040.00	0.18

148	002202	金风科技	15,126	249,125.22	0.17
149	601009	南京银行	27,700	248,192.00	0.17
150	601398	工商银行	53,600	248,168.00	0.17
151	000425	徐工机械	40,900	244,991.00	0.17
152	000661	长春高新	900	244,260.00	0.17
153	600426	华鲁恒升	7,800	244,140.00	0.17
154	002371	北方华创	700	242,914.00	0.17
155	688248	南网科技	10,502	242,596.20	0.17
156	688303	大全能源	4,004	242,282.04	0.17
157	688276	百克生物	3,486	239,139.60	0.17
158	300413	芒果超媒	4,100	234,602.00	0.16
159	600011	华能国际	24,200	234,498.00	0.16
160	600315	上海家化	5,800	234,378.00	0.16
161	603369	今世缘	4,300	233,920.00	0.16
162	001979	招商蛇口	17,500	233,450.00	0.16
163	688188	柏楚电子	600	231,276.00	0.16
164	600511	国药股份	7,300	230,169.00	0.16
165	002120	韵达股份	10,700	218,922.00	0.15
166	601991	大唐发电	65,500	212,220.00	0.15
167	002841	视源股份	2,600	211,640.00	0.15
168	688190	云路股份	1,768	209,472.64	0.14
169	300450	先导智能	2,800	208,236.00	0.14
170	601857	中国石油	42,200	207,202.00	0.14
171	600967	内蒙一机	17,300	206,735.00	0.14
172	600115	中国东航	39,900	205,884.00	0.14
173	002508	老板电器	5,500	198,110.00	0.14
174	600167	联美控股	21,900	197,319.00	0.14
175	002092	中泰化学	20,400	194,616.00	0.13
176	000988	华工科技	6,900	192,234.00	0.13
177	000800	一汽解放	17,800	183,162.00	0.13
178	688110	东芯股份	4,495	181,463.15	0.13
179	601155	新城控股	6,000	174,780.00	0.12
180	601636	旗滨集团	10,200	174,420.00	0.12
181	000933	神火股份	18,600	169,074.00	0.12
182	600383	金地集团	12,500	162,125.00	0.11
183	600111	北方稀土	3,500	160,300.00	0.11
184	601229	上海银行	22,200	158,286.00	0.11
185	603392	万泰生物	700	155,050.00	0.11
186	301168	通灵股份	2,592	153,613.72	0.11
187	600031	三一重工	6,700	152,760.00	0.11
188	688206	概伦电子	4,160	152,630.40	0.11
189	688167	炬光科技	863	152,466.21	0.11

190	300760	迈瑞医疗	400	152,320.00	0.11
191	600195	中牧股份	11,400	148,998.00	0.10
192	688793	倍轻松	1,454	147,915.42	0.10
193	600028	中国石化	33,100	140,013.00	0.10
194	688257	新锐股份	2,271	138,758.10	0.10
195	600875	东方电气	6,300	134,946.00	0.09
196	688036	传音控股	859	134,777.10	0.09
197	301166	优宁维	1,306	133,404.50	0.09
198	300463	迈克生物	4,424	129,136.56	0.09
199	301189	奥尼电子	2,075	123,834.30	0.09
200	688508	芯朋微	1,050	121,653.00	0.08
201	002745	木林森	8,000	121,040.00	0.08
202	688192	迪哲医药	3,179	117,654.79	0.08
203	688368	晶丰明源	364	116,516.40	0.08
204	600061	国投资本	14,000	115,080.00	0.08
205	601717	郑煤机	9,900	114,741.00	0.08
206	002049	紫光国微	500	112,500.00	0.08
207	300558	贝达药业	1,400	111,762.00	0.08
208	601000	唐山港	39,800	109,450.00	0.08
209	603712	七一二	2,500	108,250.00	0.07
210	688739	成大生物	1,482	104,214.24	0.07
211	301133	金钟股份	2,860	102,096.28	0.07
212	000069	华侨城 A	14,300	100,672.00	0.07
213	688509	正元地信	15,433	95,221.61	0.07
214	688210	统联精密	2,218	91,958.28	0.06
215	002901	大博医疗	1,656	83,826.72	0.06
216	688091	上海谊众	1,910	81,767.10	0.06
217	301108	洁雅股份	1,372	81,661.76	0.06
218	601628	中国人寿	2,700	81,243.00	0.06
219	601998	中信银行	16,800	77,616.00	0.05
220	688357	建龙微纳	400	76,776.00	0.05
221	300358	楚天科技	2,900	75,603.00	0.05
222	600597	光明乳业	5,000	72,600.00	0.05
223	000498	山东路桥	11,600	71,688.00	0.05
224	600332	白云山	1,800	61,560.00	0.04
225	000028	国药一致	1,600	59,168.00	0.04
226	000513	丽珠集团	1,400	56,294.00	0.04
227	688262	国芯科技	1,242	52,139.16	0.04
228	301136	招标股份	4,793	50,422.36	0.03
229	600733	北汽蓝谷	5,000	50,100.00	0.03
230	600085	同仁堂	1,100	49,478.00	0.03
231	002850	科达利	300	48,102.00	0.03

232	300474	景嘉微	300	45,660.00	0.03
233	000739	普洛药业	1,300	45,617.00	0.03
234	603893	瑞芯微	300	41,070.00	0.03
235	300009	安科生物	2,900	37,961.00	0.03
236	601800	中国交建	4,300	36,894.00	0.03
237	600183	生益科技	1,400	32,970.00	0.02
238	688701	卓锦股份	2,340	31,590.00	0.02
239	603288	海天味业	300	31,533.00	0.02
240	000063	中兴通讯	900	30,150.00	0.02
241	603230	内蒙新华	1,141	29,517.67	0.02
242	301155	海力风电	305	29,508.75	0.02
243	000519	中兵红箭	1,100	29,337.00	0.02
244	603589	口子窖	400	28,348.00	0.02
245	002648	卫星化学	700	28,021.00	0.02
246	000898	鞍钢股份	7,400	27,750.00	0.02
247	601598	中国外运	6,100	27,328.00	0.02
248	600801	华新水泥	1,400	27,020.00	0.02
249	601600	中国铝业	4,100	24,969.00	0.02
250	000672	上峰水泥	1,200	24,084.00	0.02
251	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.02
252	002468	申通快递	2,300	20,907.00	0.01
253	301018	申菱环境	782	20,378.92	0.01
254	301149	隆华新材	1,214	20,346.64	0.01
255	002572	索菲亚	900	19,980.00	0.01
256	000528	柳工	2,500	19,275.00	0.01
257	301177	迪阿股份	165	19,153.20	0.01
258	001296	长江材料	310	18,376.80	0.01
259	600219	南山铝业	3,900	18,369.00	0.01
260	002563	森马服饰	2,300	17,779.00	0.01
261	301035	润丰股份	296	16,658.88	0.01
262	002236	大华股份	700	16,436.00	0.01
263	000598	兴蓉环境	2,600	16,432.00	0.01
264	301101	明月镜片	371	16,086.56	0.01
265	301087	可孚医疗	209	15,746.06	0.01
266	002558	巨人网络	1,300	15,561.00	0.01
267	301118	恒光股份	315	15,441.30	0.01
268	000581	威孚高科	700	15,078.00	0.01
269	301089	拓新药业	220	14,944.60	0.01
270	301111	粤万年青	379	13,901.72	0.01
271	300573	兴齐眼药	100	13,680.00	0.01
272	301090	华润材料	1,195	13,407.90	0.01
273	301188	力诺特玻	647	13,250.56	0.01

274	301017	漱玉平民	555	13,209.00	0.01
275	301020	密封科技	421	12,815.24	0.01
276	301138	华研精机	285	12,785.10	0.01
277	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.01
278	301126	达嘉维康	662	12,730.26	0.01
279	688002	睿创微纳	160	12,571.20	0.01
280	600350	山东高速	2,400	12,384.00	0.01
281	600409	三友化工	1,400	12,180.00	0.01
282	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.01
283	301039	中集车辆	926	11,584.26	0.01
284	600398	海澜之家	1,800	11,538.00	0.01
285	301100	风光股份	360	11,210.40	0.01
286	600372	中航电子	500	11,195.00	0.01
287	301199	迈赫股份	325	10,400.00	0.01
288	301028	东亚机械	733	9,895.50	0.01
289	301179	泽宇智能	188	9,544.76	0.01
290	000157	中联重科	1,310	9,392.70	0.01
291	301190	善水科技	338	9,281.48	0.01
292	301078	孩子王	756	9,177.84	0.01
293	600580	卧龙电驱	500	9,145.00	0.01
294	601111	中国国航	1,000	9,130.00	0.01
295	301182	凯旺科技	294	8,990.52	0.01
296	301093	华兰股份	176	8,773.60	0.01
297	601233	桐昆股份	400	8,472.00	0.01
298	301092	争光股份	235	8,347.20	0.01
299	301096	百诚医药	106	8,324.18	0.01
300	301088	戎美股份	321	7,919.07	0.01
301	300814	中富电路	328	7,832.64	0.01
302	301198	喜悦智行	262	7,650.40	0.01
303	301081	严牌股份	403	7,028.32	0.00
304	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
305	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.00
306	301036	双乐股份	205	6,135.65	0.00
307	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
308	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
309	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
310	600060	海信视像	400	5,380.00	0.00
311	601139	深圳燃气	600	5,298.00	0.00
312	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
313	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
314	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
315	603885	吉祥航空	200	3,550.00	0.00

316	301079	邵阳液压	140	3,474.80	0.00
317	601577	长沙银行	400	3,124.00	0.00
318	002024	苏宁易购	300	1,236.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	19,687,789.86	1.96
2	300059	东方财富	12,599,378.50	1.25
3	600036	招商银行	10,597,501.00	1.05
4	600276	恒瑞医药	10,333,593.00	1.03
5	603259	药明康德	9,897,604.60	0.98
6	601318	中国平安	9,621,172.00	0.96
7	000725	京东方 A	9,614,503.00	0.96
8	000001	平安银行	9,524,059.00	0.95
9	600887	伊利股份	8,856,077.21	0.88
10	000858	五粮液	8,594,640.00	0.85
11	600030	中信证券	8,556,303.00	0.85
12	603501	韦尔股份	8,417,276.00	0.84
13	601166	兴业银行	8,197,383.00	0.81
14	300750	宁德时代	8,077,459.00	0.80
15	002714	牧原股份	7,432,482.80	0.74
16	002460	赣锋锂业	7,047,527.36	0.70
17	002142	宁波银行	6,655,461.77	0.66
18	300274	阳光电源	6,536,542.00	0.65
19	000656	金科股份	6,360,379.00	0.63
20	600900	长江电力	6,249,124.00	0.62

注：不考虑相关交易费用。

8.4.2 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	51,631,835.95	5.13
2	600036	招商银行	34,940,110.19	3.47
3	601318	中国平安	34,549,274.45	3.43
4	000858	五粮液	26,415,014.65	2.62
5	000333	美的集团	21,929,179.97	2.18
6	601166	兴业银行	19,924,475.18	1.98
7	600276	恒瑞医药	19,281,478.57	1.92
8	000157	中联重科	17,600,128.40	1.75

9	600809	山西汾酒	17,532,001.00	1.74
10	601919	中远海控	17,219,343.25	1.71
11	002027	分众传媒	15,235,493.00	1.51
12	601231	环旭电子	14,341,454.21	1.42
13	300059	东方财富	14,183,225.94	1.41
14	601012	隆基股份	14,173,492.25	1.41
15	000001	平安银行	13,444,026.90	1.34
16	600030	中信证券	13,335,278.00	1.32
17	002475	立讯精密	12,929,269.98	1.28
18	603486	科沃斯	12,705,667.79	1.26
19	601229	上海银行	12,112,005.42	1.20
20	601398	工商银行	12,102,985.00	1.20

注：不考虑相关交易费用。

8.4.3 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	902,032,453.97
卖出股票收入（成交）总额	1,633,020,798.68

注：不考虑相关交易费用。

8.5 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。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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
IF2203	沪深 300 期货 2203 合约	-77	-114,358,860 .00	2,002,020.00	-

IF2201	沪深 300 期货 2201 合约	-5	-7,421,100.0 0	186,700.00	-
公允价值变动总额合计（元）					2,188,720.00
股指期货投资本期收益（元）					-38,390,665.28
股指期货投资本期公允价值变动（元）					19,638,205.28

8.10.2 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.11.3 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。

8.12 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 123,683,497.60 元，占基金资产净值的比例为 85.41%；运用股指期货进行对冲的空头合约市值 121,779,960.00 元，占基金资产净值的比例为 84.10%，空头合约市值占股票资产的比例为 98.46%。本报告期内，本基金执行市场中性策略的投资收益为 74,731,959.83 元，公允价值变动损益为-64,556,971.08 元。

8.13 投资组合报告附注

8.13.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金本报告期内不存在投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.13.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情形。

8.13.3 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	14,705,240.33
2	应收证券清算款	70,955.06
3	应收股利	-
4	应收利息	2,761.43
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,778,956.82

8.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券

8.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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 (%)
1,176	100,057.62	97,774,795.23	83.09	19,892,960.34	16.91

9.2 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	0.0076

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	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

9.4 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	发起份额总数	发起份额占 基金总份额	发起份额承 诺持有期限

		份 额 比 例 (%)		比 例 (%)	
基金管理人固有资 金	18,752,966.66	15.94	10,002,400.00	8.50	3 年
基金管理人高级管 理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	18,752,966.66	15.94	10,002,400.00	8.50	-

§ 10 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	205,001,620.57
减：本报告期基金总赎回份额	925,141,658.64
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	117,667,755.57

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人的重大人事变动：

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。

2021 年 12 月 9 日，经公司董事会批准满黎先生担任公司副总经理。

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。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未改聘为其审计的会计师事务所。本报告期基金应支付给普华永道中天会计师事务所有限公司的报酬为 85000.00 元人民币，该事务所已向本基金提供了 6 的审计服务。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	443,294,756.13	17.53%	410,688.54	18.76%	-
华泰证券	5	284,168,314.27	11.28%	260,035.84	11.88%	-
招商证券	4	273,405,902.04	10.81%	252,349.17	11.53%	-
国信证券	2	236,308,869.68	9.35%	171,093.95	7.82%	-
国盛证券	2	228,189,588.92	9.03%	162,636.36	7.43%	-
宏信证券	2	197,586,374.43	7.82%	184,013.05	8.41%	-
东吴证券	2	171,987,660.12	6.80%	160,171.64	7.32%	-
华创证券	1	156,249,095.87	6.18%	145,517.14	6.65%	-
中信建投	3	108,603,252.73	4.30%	79,781.63	3.64%	-
天风证券	2	88,708,408.59	3.51%	83,514.16	3.82%	-
海通证券	2	70,407,122.7	2.78%	51,215.49	2.34%	-

		0				
粤开证券	1	54,874,677.09	2.17%	50,009.17	2.28%	-
民生证券	4	52,216,312.74	2.07%	47,022.14	2.15%	-
信达证券	3	51,258,576.33	2.03%	36,460.81	1.67%	-
西部证券	2	42,728,158.53	1.69%	31,245.97	1.43%	-
东方财富证券	2	35,291,056.25	1.40%	32,867.16	1.50%	-
太平洋证券	2	30,561,116.92	1.21%	28,461.89	1.30%	-
西南证券	1	1,870,471.22	0.07%	1,742.01	0.08%	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
财达证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	2	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
野村证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-

注：1、选择代理证券买卖的证券经营机构的标准

公司应选择财务状况良好，经营行为规范，具备研究实力的证券公司及专业研究机构，向其或其合作券商租用基金专用交易席位。公司选择的提供交易单元的券商应当满足下列基本条件：

- 1) 具有相应的业务经营资格；
- 2) 诚信记录良好，最近两年无重大违法违规行为，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。

11.7.2 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%	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	1,175,094.40	34.40%	100,000,000.00	15.63%	-	-
国盛证券	1,724,643.60	50.49%	170,000,000.00	26.56%	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	370,000,000.00	57.81%	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	308,896.37	9.04%	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-

恒泰证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
新时代证 券	-	-	-	-	-	-
野村证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 12 月 24 日
2	华泰柏瑞基金管理有限公司关于聘任副总经理的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 12 月 10 日
3	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 12 月 9 日
4	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二十六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 12 月 7 日
5	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 12 月 4 日
6	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 12 月 2 日
7	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 11 月 30 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 11 月 18 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 10 月 22 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 10 月 20 日

11	华泰柏瑞基金关于网上直销直连招商银行支付服务的补充提示性公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 9 月 27 日
12	华泰柏瑞基金管理有限公司关于直销赎回转认（申）购业务增加适用基金范围及费率优惠的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 9 月 22 日
13	华泰柏瑞基金管理有限公司关于聘任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经理的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 9 月 18 日
14	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参与泰信财富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 9 月 10 日
15	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 9 月 9 日
16	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二十五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 9 月 6 日
17	华泰柏瑞基金管理有限公司关于新增办公地址的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 8 月 9 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 8 月 6 日
19	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 7 月 16 日
20	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参与泛华普益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 7 月 2 日
21	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
22	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
23	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
24	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
25	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	证监会规定报刊和网站	2021 年 6 月 8 日

	十四个开放期开放申购赎回及转换业务的公告		
26	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
27	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
28	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
29	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
30	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
31	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 4 月 30 日
32	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
33	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
34	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
35	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
36	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
37	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
38	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
39	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期开放申购赎回及转换业	证监会规定报刊和网站	2021 年 3 月 3 日

	务的公告		
40	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
41	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
42	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
43	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
44	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方式的提示性公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 1 月 14 日
45	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
46	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

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	20210618-20210914;20211216-20211231;	41,580,041.58	0.00	13,150,000.00	28,430,041.58	24.16
	2	20211216-20211216;	0.00	39,354,584.81	22,000,000.00	17,354,584.81	14.75
	3	20210914-20210914;	0.00	40,296,330.79	40,296,330.79	0.00	0.00
	4	20210316-20210617;	165,234,633.18	0.00	165,234,633.18	0.00	0.00
产品特有风险							

本基金报告期内有单一持有人持有基金份额超过 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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 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

13.2 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
 托管人住所

13.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。投资者对本报告如有疑问，可咨询基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司。客户服务热线：400-888-0001（免长途费） 021-3878 4638 公司网址：www.huatai-pb.com

华泰柏瑞基金管理有限公司

2022 年 3 月 31 日