

# 华泰柏瑞量化创优灵活配置混合型证券投资 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

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人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 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	错误!未定义书签。
4.10 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
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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真实、准确和完整发表意见	16
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>17</b>
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>19</b>
7.1 资产负债表	19
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

<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>51</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	51
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	52
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 .....	52
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	57
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	58
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 .....	58
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 .....	58
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 .....	58
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 .....	58
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	58
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	59
8.12 投资组合报告附注 .....	59
<b>§ 9 基金份额持有人信息</b> .....	<b>60</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	60
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	60
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 .....	60
<b>§ 10 开放式基金份额变动</b> .....	<b>60</b>
<b>§ 11 重大事件揭示</b> .....	<b>61</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	61
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 .....	61
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	61
11.4 基金投资策略的改变 .....	61
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	61
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 .....	61
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	61
11.8 其他重大事件 .....	64
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>66</b>
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 .....	66
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	66
<b>§ 13 备查文件目录</b> .....	<b>67</b>
13.1 备查文件目录 .....	67
13.2 存放地点 .....	67
13.3 查阅方式 .....	67

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞量化创优灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	华泰柏瑞量化创优
基金主代码	004394
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 5 月 12 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	57,507,434.74 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，在力求有效控制投资风险的前提下，力争实现达到或超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	<p>1、股票投资策略</p> <p>本基金主要利用定量投资模型，跟踪创业板指数，通过主动管理，使用量化方法选取并持有预期收益较好的股票构成投资组合，在有效控制风险的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%，在极端市场情况下，为保护投资者的本金安全，股票资产比例可降至 0%。</p> <p>2、固定收益资产投资策略</p> <p>本基金固定收益资产投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。</p> <p>固定收益资产包括债券（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、货币市场工具等。</p> <p>本基金管理人将基于对国内外宏观经济形势的深入分析、国内财政政策与货币市场政策等因素对固定收益资产的影响，进行合理的利率预期，判断市场的基本走势，制定久期控制下的资产类属配置策略。在固定收益资产投资组合构建和管理过程中，本基金管理人将具体采用期限结构配置、市场转换、信用利差和相对价值判断、信用风险评估、现金管理等管理手段进行个券选择。</p> <p>3、权证投资策略</p> <p>权证为本基金辅助性投资工具，其投资原则为有利于基金资产增值，有利于加强基金风险控制。本基金在权证投资中将权证标的证券的基本面进行研究，同时综合考虑权证定价模型、市场供求关系、交易制度设计等多种因素对权证进行定价。</p> <p>4、其他金融衍生工具投资策略</p> <p>在法律法规允许的范围内，本基金可基于谨慎原则运用股指期货、期权等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以套期保值为</p>

	<p>目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险，提高投资效率。本基金主要采用流动性好、交易活跃的衍生品合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。若法律法规或监管机构以后允许基金投资如互换等其他金融衍生品种，本基金将以风险管理和组合优化为目的，根据届时法律法规的相关规定参与投资。</p> <p>5、融资业务的投资策略</p> <p>本基金参与融资业务，将综合考虑融资成本、保证金比例、冲抵保证金证券折算率、信用资质等条件，选择合适的交易对手方。同时，在保障基金投资组合充足流动性以及有效控制融资杠杆风险的前提下，确定融资比例。待监管机构允许本基金参与融券交易及转融通证券出借业务后，在法律法规允许的范围内，在不改变基金的风险收益特征及对基金份额持有人无不利影响的前提下，本基金可参与相关业务，以提高组合的投资效率，从而更好地实现投资目标。具体参与投资的比例将按照届时相关法律法规的规定执行。</p>
业绩比较基准	90%×创业板指数收益率+10%×银行活期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为混合型基金，跟踪创业板指数，并力求实现超越创业板指数收益率的投资回报。其预期风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金，属于较高风险的产品。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华泰柏瑞基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	刘万方	李申
	联系电话	021-38601777	021-60637102
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		400-888-0001	021-60637111
传真		021-38601799	021-60635778
注册地址		上海市浦东新区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		上海市浦东新区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		200135	100033
法定代表人		贾波	田国立

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.huatai-pb.com">http://www.huatai-pb.com</a>
基金年度报告备置地点	上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层及基金托管人住所

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
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	46,628,101.01	102,622,732.08	84,291,740.60
本期利润	22,913,950.84	123,762,264.60	135,963,007.60
加权平均基金份额本期利润	0.2924	0.7136	0.4133
本期加权平均净值利润率	14.06%	47.32%	42.75%
本期基金份额净值增长率	15.85%	72.35%	48.84%
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	70,139,832.91	81,305,029.05	13,601,998.10
期末可供分配基金份额利润	1.2197	0.6714	0.0618
期末基金资产净值	127,647,267.65	232,014,245.50	244,549,655.46
期末基金份额净值	2.2197	1.9160	1.1117
3.1.3 累计期末指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
基金份额累计净值增长率	121.97%	91.60%	11.17%

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	0.84%	1.08%	2.20%	0.99%	-1.36%	0.09%
过去六个月	-2.01%	1.46%	-3.86%	1.39%	1.85%	0.07%
过去一年	15.85%	1.66%	11.16%	1.58%	4.69%	0.08%
过去三年	197.19%	1.66%	143.79%	1.61%	53.40%	0.05%
自基金合同生效起至今	121.97%	1.56%	78.97%	1.53%	43.00%	0.03%

#### 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

华泰柏瑞量化创优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

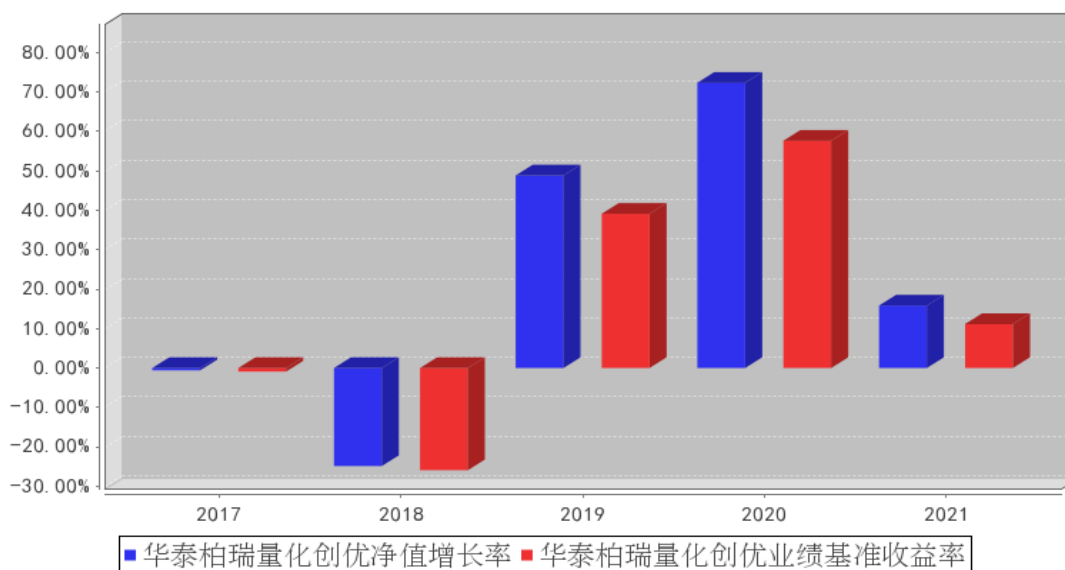


注：图示日期为 2017 年 5 月 12 日至 2021 年 12 月 31 日。



### 3.2.3 自基金合同生效以来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

华泰柏瑞量化创优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	2017 年 5 月 12 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

					<p>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>
<p>简算</p>	<p>本基金的基金经理</p>	<p>2020 年 5 月 11 日</p>	<p>-</p>	<p>7 年</p>	<p>美国明尼苏达大学双城分校金融数学硕士，曾任中国金融期货交易所债券事业部助理经理。2016 年 6 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任量化与海外投资部助理研究员、研究员、高级研究员。2020 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。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。2021 年 9 月起任华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金和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。</p>

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

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

注：无。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

害基金份额持有人利益的行为。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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。

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

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末的基金份额净值为 2.2197 元，本报告期基金份额净值增长率为 15.85%，同期业绩比较基准收益率为 11.16%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2021 年，一方面新冠病毒新变种传播再一次强化疫情对生产和贸易的抑制，另一方面全球流动性宽松转向、国内商品价格管控、地产行业风险显露等新变量影响凸显。从市场来看，外部货币政策边际收紧，我国经济增长受压。2022 年，如果要对冲经济下行的压力，我们预期政策边际宽松。

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。消费、医药等行业中少数较高估值的板块短期估值上仍有一定的压力；周期等板块的政策扰动集中释放后，可能回归基本面改善的逻辑；新能源等节能环保板块尽管短期已经涨幅较大，但是从我国 2030 节能减排目标看该板块长期空间仍然巨大。我们预计接下来市场将对新一年的政策导向与上市公司年报业绩反应比较敏感，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。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。

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，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事先进行合规性设置，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

本报告期内，中国建设银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在华泰柏瑞量化创优灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。



## § 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 28150 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	华泰柏瑞量化创优灵活配置混合型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创优灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“华泰柏瑞量化创优基金”)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创优基金 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创优基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>华泰柏瑞量化创优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创优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创优基金、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创优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>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创优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创优基金不能持续经营。</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</p>	<p>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 3 月 30 日</p>	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞量化创优灵活配置混合型证券投资基金

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
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	10,998,656.23	18,600,337.56
结算备付金		1,338,348.11	318,489.58
存出保证金		17,589.08	58,298.49
交易性金融资产	7.4.7.2	115,619,234.18	216,336,551.74
其中：股票投资		115,619,234.18	216,215,451.74
基金投资		-	-
债券投资		-	121,100.00
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		69,822.31	1,627,202.08
应收利息	7.4.7.5	1,972.27	2,266.16
应收股利		-	-
应收申购款		93,376.31	85,104.14
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		128,138,998.49	237,028,249.75
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2020 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		127.01	-
应付赎回款		52,139.31	4,225,879.29
应付管理人报酬		164,458.75	296,570.89
应付托管费		27,409.79	49,428.50
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	72,535.49	255,159.63
应交税费		-	0.69
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	175,060.49	186,965.25
负债合计		491,730.84	5,014,004.25
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	57,507,434.74	121,095,582.45
未分配利润	7.4.7.10	70,139,832.91	110,918,663.05
所有者权益合计		127,647,267.65	232,014,245.50
负债和所有者权益总计		128,138,998.49	237,028,249.75

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 2.2197 元，基金份额总额 57,507,434.74 份。

## 7.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞量化创优灵活配置混合型证券投资基金

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		27,002,489.50	130,369,877.14
1. 利息收入		63,574.02	112,165.40
其中：存款利息收入	7.4.7.11	63,461.11	112,120.14
债券利息收入		112.91	45.26
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		50,020,456.41	108,056,123.69
其中：股票投资收益	7.4.7.12	48,985,616.94	106,742,434.90
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	250,993.96	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	783,845.51	1,313,688.79
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-23,714,150.17	21,139,532.52
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	632,609.24	1,062,055.53
减: 二、费用		4,088,538.66	6,607,612.54
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	2,463,007.50	3,920,419.28
2. 托管费	7.4.10.2.2	410,501.24	653,403.18
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	1,015,314.59	1,825,419.49
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.42	0.16
7. 其他费用	7.4.7.20	199,714.91	208,370.43
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)		22,913,950.84	123,762,264.60
减: 所得税费用		-	-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)		22,913,950.84	123,762,264.60

### 7.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体: 华泰柏瑞量化创优灵活配置混合型证券投资基金

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)	121,095,582.45	110,918,663.05	232,014,245.50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	22,913,950.84	22,913,950.84
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)	-63,588,147.71	-63,692,780.98	-127,280,928.69
其中: 1. 基金申购款	34,439,020.82	37,215,396.70	71,654,417.52
2. 基金赎回款	-98,027,168.53	-100,908,177.68	-198,935,346.21
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）	57,507,434.74	70,139,832.91	127,647,267.65
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
一、期初所有者权益（基金净值）	219,970,938.06	24,578,717.40	244,549,655.46
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	123,762,264.60	123,762,264.60
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）	-98,875,355.61	-37,422,318.95	-136,297,674.56
其中：1. 基金申购款	237,728,916.36	107,375,099.87	345,104,016.23
2. 基金赎回款	-336,604,271.97	-144,797,418.82	-481,401,690.79
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）	121,095,582.45	110,918,663.05	232,014,245.50

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：

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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞量化创优灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理

委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]2237号《关于准予华泰柏瑞量化创优灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》和机构部函[2016]3005号《关于华泰柏瑞量化创优灵活配置混合型证券投资基金延期募集备案的回函》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《华泰柏瑞量化创优灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币521,772,904.46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(2017)第501号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞量化创优灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2017年5月12日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为522,063,986.47份基金份额,其中认购资金利息折合288,082.01份基金份额。本基金的基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞量化创优灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、存托凭证、债券(国债、金融债、企业/公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金还可依规定参与融资业务。本基金持有的股票资产及存托凭证占基金资产的0%-95%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%;本基金参与融资业务时,在任何交易日日终,持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的95%。本基金的业绩比较基准为:90%×创业板指数收益率+10%×银行活期存款利率(税后)。

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》、《华泰柏瑞量化创优灵活配置混合型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和债券投资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。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和债券投资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。

(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适用比例计算缴纳。

#### 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	10,998,656.23	18,600,337.56
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	10,998,656.23	18,600,337.56

##### 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	90,662,280.84	115,619,234.18	24,956,953.34
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	90,662,280.84	115,619,234.18	24,956,953.34
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	167,565,448.23	216,215,451.74	48,650,003.51
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	100,000.00	121,100.00
	银行间市场	-	-
	合计	100,000.00	121,100.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-

其他	-	-	-
合计	167,665,448.23	216,336,551.74	48,671,103.51

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无。

#### 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：无。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

#### 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	1,160.30	2,031.16
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	803.28	159.50
应收债券利息	-	46.68
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	8.69	28.82
合计	1,972.27	2,266.16

#### 7.4.7.6 其他资产

注：无。

#### 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	72,535.49	255,159.63
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	72,535.49	255,159.63

#### 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	60.49	6,965.25
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	175,000.00	180,000.00
合计	175,060.49	186,965.25

#### 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	121,095,582.45	121,095,582.45
本期申购	34,439,020.82	34,439,020.82
本期赎回（以“-”号填列）	-98,027,168.53	-98,027,168.53
- 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	57,507,434.74	57,507,434.74

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 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	81,305,029.05	29,613,634.00	110,918,663.05
本期利润	46,628,101.01	-23,714,150.17	22,913,950.84
本期基金份额交易产生的变动数	-55,535,644.60	-8,157,136.38	-63,692,780.98
其中：基金申购款	30,461,835.85	6,753,560.85	37,215,396.70
基金赎回款	-85,997,480.45	-14,910,697.23	-100,908,177.68
本期已分配利润	-	-	-
本期末	72,397,485.46	-2,257,652.55	70,139,832.91

#### 7.4.7.11 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12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
	活期存款利息收入	38,071.12
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	24,600.69	9,469.29
其他	789.30	1,293.59
合计	63,461.11	112,120.14

#### 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 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
股票投资收益——买卖股票差价收入	48,985,616.94	106,742,434.90
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	48,985,616.94	106,742,434.90

##### 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	386,304,100.84	665,396,095.53
减：卖出股票成本总额	337,318,483.90	558,653,660.63
买卖股票差价收入	48,985,616.94	106,742,434.90

##### 7.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

#### 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	250,993.96	-
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	250,993.96	-

#### 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	1,199,557.04	-
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	948,400.00	-
减：应收利息总额	163.08	-
买卖债券差价收入	250,993.96	-

#### 7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

#### 7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

#### 7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：无。

#### 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：无。

##### 7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

##### 7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

##### 7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

#### 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：无。

#### 7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

#### 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	783,845.51	1,313,688.79
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	783,845.51	1,313,688.79

#### 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	-23,714,150.17	21,139,532.52
股票投资	-23,693,050.17	21,118,432.52
债券投资	-21,100.00	21,100.00
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-23,714,150.17	21,139,532.52

#### 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	286,835.39	924,352.44
转换费收入	64,907.98	137,703.09
其他	280,865.87	-
合计	632,609.24	1,062,055.53

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金财产。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财产。

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	1,015,314.59	1,825,419.49
银行间市场交易费用	-	-
合计	1,015,314.59	1,825,419.49

#### 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	55,000.00	60,000.00
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	6,354.91	10,010.43
银行间账户服务费	18,000.00	18,000.00
其他费用	360.00	360.00
合计	199,714.91	208,370.43

#### 7.4.7.21 分部报告

本基金本报告期无分部报告。

#### 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

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 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

PineBridge Investment LLC	基金管理人的股东
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
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：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 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		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	
	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	140,250,776.34	21.89	132,481,396.86	11.29

###### 7.4.10.1.2 债券交易

注：无。

###### 7.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

###### 7.4.10.1.4 权证交易

注：无。

###### 7.4.10.1.5 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	128,215.36	22.65	-	-
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	122,191.34	12.12	20,069.27	7.87

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	2,463,007.50	3,920,419.28
其中：支付销售机构的客户维护费	888,477.86	1,078,485.47

注：支付基金管理人华泰柏瑞基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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	410,501.24	653,403.18

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：本基金本报告期内及上年度可比期间转融通证券出借业务未发生重大关联交易事项。

##### 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：本基金本报告期内及上年度可比期间转融通证券出借业务未发生重大关联交易事项。

#### 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固有资金投资本基金的情况

注：本报告期及上年度，基金管理人未投资本基金。

##### 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	10,998,656.23	38,071.12	18,600,337.56	101,357.26

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行股份有限公司保管，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	519	78,109.50
华泰联合证券	301155	海力风电	网下申购	1,053	63,874.98
华泰联合证券	688656	浩欧博	网下申购	1,233	43,475.58
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	301093	华兰股份	网下申购	654	37,984.32
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	301179	泽宇智能	网下申购	742	32,640.58
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	301078	孩子王	网下申购	5,034	29,046.18
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	300907	康平科技	网下申购	4,724	67,553.20
华泰联合证券	300919	中伟股份	网下申购	2,315	56,949.00

#### 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
001234	泰慕士	2021年12月31日	2022年1月11日	新股未上市	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
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	307	2,578.80	7,331.16	-
300854	中兰环保	2021年9月8日	2022年3月16日	新股锁定期内	9.96	27.29	203	2,021.88	5,539.87	-
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	-
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	-
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	-
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	-
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	-
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	-
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	504	2,676.24	6,804.00	-

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	-
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	-
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	199	4,385.96	11,199.72	-
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	174	4,068.12	5,207.82	-
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	-
301048	金鹰重工	2021年 8月11 日	2022年 2月28 日	新股锁 定期内	4.13	12.96	482	1,990.66	6,246.72	-
301049	超越科技	2021年 8月17 日	2022年 2月24 日	新股锁 定期内	19.34	32.92	154	2,978.36	5,069.68	-
301050	雷电微力	2021年 8月17 日	2022年 2月24 日	新股锁 定期内	60.64	234.74	74	4,487.36	17,370.76	-
301055	张小泉	2021年 8月26 日	2022年 3月7 日	新股锁 定期内	6.90	21.78	355	2,449.50	7,731.90	-
301056	森赫股份	2021年 8月27 日	2022年 3月7 日	新股锁 定期内	3.93	11.09	572	2,247.96	6,343.48	-
301057	汇隆新材	2021年 8月31 日	2022年 3月9 日	新股锁 定期内	8.03	19.02	218	1,750.54	4,146.36	-
301058	中粮工科	2021年 9月1日	2022年 3月9 日	新股锁 定期内	3.55	18.24	1,111	3,944.05	20,264.64	-
301059	金三江	2021年 9月3日	2022年 3月14 日	新股锁 定期内	8.09	19.30	259	2,095.31	4,998.70	-
301060	兰卫医学	2021年 9月6日	2022年 3月14 日	新股锁 定期内	4.17	30.94	587	2,447.79	18,161.78	-
301062	上海艾录	2021年 9月7日	2022年 3月14 日	新股锁 定期内	3.31	17.01	523	1,731.13	8,896.23	-



			日							
301063	海锅股份	2021年 9月9日	2022年 3月24日	新股锁 定期内	17.40	36.11	153	2,662.20	5,524.83	-
301068	大地海洋	2021年 9月16日	2022年 3月28日	新股锁 定期内	13.98	28.38	144	2,013.12	4,086.72	-
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	-
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	-
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	-
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	504	2,908.08	6,118.56	-
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	-
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	306	3,962.70	5,336.64	-
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	85	7,912.65	6,403.90	-
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	125	4,145.00	3,083.75	-
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	132	2,522.52	8,966.76	-
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	509	5,319.05	5,710.98	-
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	89	3,231.59	3,161.28	-
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	66	3,833.28	3,290.10	-
301096	百诚医	2021年	2022年	新股锁	79.60	78.53	41	3,263.60	3,219.73	-

	药	12月13日	6月20日	定期内							
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	143	3,976.83	4,453.02		-
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	160	4,305.60	6,937.60		-
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	54	3,092.58	2,900.34		-
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	276	2,892.48	10,123.68		-
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	158	3,586.60	7,745.16		-
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	351	4,341.87	6,749.73		-
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	251	3,596.83	6,764.45		-
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	4,227	44,468.04	44,468.04		-
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	146	3,820.82	6,549.56		-
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	485	4,883.95	8,128.60		-
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	106	6,429.96	10,255.50		-
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	102	3,986.16	5,317.26		-
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	66	7,714.08	7,661.28		-
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	75	3,299.25	3,807.75		-

301182	凯旺科技	2021年 12月16 日	2022年 6月23 日	新股锁 定期内	27.12	30.58	160	4,339.20	4,892.80	-
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	358	4,654.00	7,331.84	-
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	82	5,426.76	4,642.84	-
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	136	3,787.60	3,734.56	-
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	167	3,633.92	4,876.40	-
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	124	3,630.72	3,968.00	-

注：1、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。

2、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：无。

#### 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：无。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：无。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未参与转融通证券出借业务的证券。

## 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和债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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

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

### 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	-	-
AAA 以下	-	121,100.00
未评级	-	-
合计	-	121,100.00

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可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严

密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 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，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 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》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股股票不得超过该上市公司可流通股股票的 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股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 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 0.38%。

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	10,998,656.23	-	-	-	-	-	10,998,656.23
结算备付金	1,338,348.11	-	-	-	-	-	1,338,348.11
存出保证金	17,589.08	-	-	-	-	-	17,589.08
交易性金融资产	-	-	-	-	-	115,619,234.18	115,619,234.18
应收利息	-	-	-	-	-	1,972.27	1,972.27
应收申购款	-	-	-	-	-	93,376.31	93,376.31
应收证券清算款	-	-	-	-	-	69,822.31	69,822.31
资产总计	12,354,593.42	-	-	-	-	115,784,405.07	128,138,998.49
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	52,139.31	52,139.31
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	164,458.75	164,458.75
应付托管费	-	-	-	-	-	27,409.79	27,409.79

应付证券清算款	-	-	-	-	-	127.01	127.01
应付交易费用	-	-	-	-	-	72,535.49	72,535.49
其他负债	-	-	-	-	-	175,060.49	175,060.49
负债总计	-	-	-	-	-	491,730.84	491,730.84
利率敏感度缺口	12,354,593.42	-	-	-	-	115,292,674.23	127,647,267.65
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	18,600,337.56	-	-	-	-	-	18,600,337.56
结算备付金	318,489.58	-	-	-	-	-	318,489.58
存出保证金	58,298.49	-	-	-	-	-	58,298.49
交易性金融资产	-	-	-	-	121,100.00	216,215,451.74	216,336,551.74
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,627,202.08	1,627,202.08
应收利息	-	-	-	-	-	2,266.16	2,266.16
应收申购款	-	-	-	-	-	85,104.14	85,104.14
资产总计	18,977,125.63	-	-	-	121,100.00	217,930,024.12	237,028,249.75
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	4,225,879.29	4,225,879.29
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	296,570.89	296,570.89
应付托管费	-	-	-	-	-	49,428.50	49,428.50
应付交易费用	-	-	-	-	-	255,159.63	255,159.63
应交税费	-	-	-	-	-	0.69	0.69
其他负债	-	-	-	-	-	186,965.25	186,965.25
负债总计	-	-	-	-	-	5,014,004.25	5,014,004.25
利率敏感度缺口	18,977,125.63	-	-	-	121,100.00	212,916,019.87	232,014,245.50

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：0.05%)，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或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票及存托凭证资产占基金资产的比例 0%-95%。本基金参与融资业务时，在任何交易日日终，持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 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	115,619,234.18	90.58	216,215,451.74	93.19
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	115,619,234.18	90.58	216,215,451.74	93.19

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除创业板指数以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021年12月31日）	上年度末（2020年12月31日）
分析	创业板指数上升 5%	5,991,235.66	10,681,435.56
	创业板指数下降 5%	-5,991,235.66	-10,681,435.56

#### 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 115,129,372.52 元，属于第二层次的余额为 489,861.66 元，无属于第三层次的余额(2020 年 12 月 31 日：第一层次 214,384,158.81 元，第二层次 1,952,392.93 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—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》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、中国银行保险监督管理委员会于 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	115,619,234.18	90.23
	其中：股票	115,619,234.18	90.23
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	12,337,004.34	9.63
8	其他各项资产	182,759.97	0.14
9	合计	128,138,998.49	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	1,961,282.96	1.54
B	采矿业	-	-
C	制造业	86,342,530.44	67.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	433,605.80	0.34
F	批发和零售业	870,992.32	0.68
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
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	7,027,657.84	5.51
J	金融业	11,764,996.83	9.22
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	995,360.00	0.78
M	科学研究和技术服务业	3,003,716.11	2.35
N	水利、环境和公共设施管理业	10,609.55	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,738,788.66	1.36
R	文化、体育和娱乐业	1,465,085.67	1.15
S	综合	-	-
	合计	115,619,234.18	90.58

### 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	300750	宁德时代	19,100	11,230,800.00	8.80

2	300059	东方财富	256,253	9,509,548.83	7.45
3	300014	亿纬锂能	56,141	6,634,743.38	5.20
4	300450	先导智能	68,060	5,061,622.20	3.97
5	300760	迈瑞医疗	12,385	4,716,208.00	3.69
6	300274	阳光电源	28,400	4,140,720.00	3.24
7	300124	汇川技术	50,900	3,491,740.00	2.74
8	300207	欣旺达	77,300	3,258,968.00	2.55
9	300142	沃森生物	51,004	2,866,424.80	2.25
10	300347	泰格医药	20,500	2,619,900.00	2.05
11	300037	新宙邦	21,500	2,429,500.00	1.90
12	300122	智飞生物	18,800	2,342,480.00	1.84
13	300033	同花顺	15,600	2,255,448.00	1.77
14	688005	容百科技	17,400	2,011,092.00	1.58
15	300223	北京君正	14,900	1,996,600.00	1.56
16	300782	卓胜微	6,020	1,967,336.00	1.54
17	300015	爱尔眼科	40,696	1,720,626.88	1.35
18	300661	圣邦股份	5,000	1,545,000.00	1.21
19	002410	广联达	23,700	1,516,326.00	1.19
20	688356	键凯科技	4,400	1,483,372.00	1.16
21	300294	博雅生物	38,200	1,464,970.00	1.15
22	300496	中科创达	9,100	1,259,622.00	0.99
23	300498	温氏股份	64,946	1,250,859.96	0.98
24	300601	康泰生物	12,500	1,231,750.00	0.96
25	300358	楚天科技	45,000	1,173,150.00	0.92
26	603659	璞泰来	7,300	1,172,453.00	0.92
27	300639	凯普生物	38,364	1,132,121.64	0.89
28	002648	卫星化学	25,900	1,036,777.00	0.81
29	300662	科锐国际	16,000	995,360.00	0.78
30	300769	德方纳米	2,000	982,320.00	0.77
31	600183	生益科技	40,200	946,710.00	0.74
32	603260	合盛硅业	6,900	910,593.00	0.71
33	300751	迈为股份	1,400	899,220.00	0.70
34	688519	南亚新材	17,600	887,216.00	0.70
35	600884	杉杉股份	26,700	874,959.00	0.69
36	300316	晶盛机电	12,500	868,750.00	0.68
37	300474	景嘉微	5,700	867,540.00	0.68
38	300390	天华超净	10,100	818,100.00	0.64
39	603707	健友股份	19,000	798,000.00	0.63
40	002129	中环股份	18,800	784,900.00	0.61
41	603517	绝味食品	10,500	717,465.00	0.56
42	688508	芯朋微	6,158	713,465.88	0.56
43	002458	益生股份	62,600	708,006.00	0.55

44	002821	凯莱英	1,600	696,000.00	0.55
45	300529	健帆生物	12,600	671,580.00	0.53
46	601098	中南传媒	68,100	651,717.00	0.51
47	688378	奥来德	7,800	624,780.00	0.49
48	300696	爱乐达	12,000	623,280.00	0.49
49	300146	汤臣倍健	22,900	617,384.00	0.48
50	600426	华鲁恒升	19,630	614,419.00	0.48
51	603986	兆易创新	3,400	597,890.00	0.47
52	688357	建龙微纳	3,000	575,820.00	0.45
53	000999	华润三九	16,500	564,960.00	0.44
54	000403	派林生物	20,000	560,600.00	0.44
55	603236	移远通信	2,700	550,530.00	0.43
56	688200	华峰测控	1,000	511,900.00	0.40
57	603444	吉比特	1,200	506,220.00	0.40
58	300755	华致酒行	9,300	465,744.00	0.36
59	688078	龙软科技	8,000	465,600.00	0.36
60	000725	京东方 A	89,700	452,985.00	0.35
61	600438	通威股份	9,600	431,616.00	0.34
62	000498	山东路桥	69,400	428,892.00	0.34
63	000039	中集集团	24,900	427,284.00	0.33
64	300768	迪普科技	10,200	420,750.00	0.33
65	600299	安迪苏	33,800	416,416.00	0.33
66	600373	中文传媒	31,000	383,160.00	0.30
67	601928	凤凰传媒	46,700	377,803.00	0.30
68	603636	南威软件	39,200	350,448.00	0.27
69	688369	致远互联	4,839	344,294.85	0.27
70	600845	宝信软件	5,530	336,389.90	0.26
71	688066	航天宏图	4,600	334,420.00	0.26
72	002460	赣锋锂业	2,300	328,555.00	0.26
73	603186	华正新材	7,600	317,604.00	0.25
74	603688	石英股份	4,900	309,239.00	0.24
75	603203	快克股份	8,200	302,334.00	0.24
76	688388	嘉元科技	2,400	301,320.00	0.24
77	000988	华工科技	10,300	286,958.00	0.22
78	300595	欧普康视	4,800	275,376.00	0.22
79	300759	康龙化成	1,900	268,413.00	0.21
80	600176	中国巨石	14,600	265,720.00	0.21
81	300783	三只松鼠	6,700	261,099.00	0.20
82	300253	卫宁健康	15,200	254,752.00	0.20
83	603039	泛微网络	3,300	230,241.00	0.18
84	688050	爱博医疗	1,000	210,230.00	0.16
85	002881	美格智能	4,600	197,248.00	0.15

86	002850	科达利	1,200	192,408.00	0.15
87	688389	普门科技	8,200	188,600.00	0.15
88	300073	当升科技	2,100	182,427.00	0.14
89	300613	富瀚微	1,000	163,050.00	0.13
90	300568	星源材质	4,200	154,266.00	0.12
91	002415	海康威视	2,500	130,800.00	0.10
92	688368	晶丰明源	400	128,040.00	0.10
93	603185	上机数控	700	116,886.00	0.09
94	002746	仙坛股份	10,200	106,998.00	0.08
95	603609	禾丰股份	9,000	92,160.00	0.07
96	000830	鲁西化工	4,800	73,248.00	0.06
97	002709	天赐材料	600	68,790.00	0.05
98	301072	中捷精工	1,802	67,726.26	0.05
99	688185	康希诺	200	59,910.00	0.05
100	002727	一心堂	1,400	53,914.00	0.04
101	300896	爱美客	100	53,611.00	0.04
102	000062	深圳华强	3,100	53,413.00	0.04
103	301136	招标股份	4,227	44,468.04	0.03
104	603259	药明康德	360	42,688.80	0.03
105	603230	内蒙新华	1,141	29,517.67	0.02
106	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.02
107	300413	芒果超媒	400	22,888.00	0.02
108	301018	申菱环境	782	20,378.92	0.02
109	300327	中颖电子	300	20,370.00	0.02
110	301058	中粮工科	1,111	20,264.64	0.02
111	001296	长江材料	310	18,376.80	0.01
112	301060	兰卫医学	587	18,161.78	0.01
113	301050	雷电微力	74	17,370.76	0.01
114	301017	漱玉平民	555	13,209.00	0.01
115	301020	密封科技	421	12,815.24	0.01
116	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.01
117	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.01
118	301035	润丰股份	199	11,199.72	0.01
119	301155	海力风电	106	10,255.50	0.01
120	301111	粤万年青	276	10,123.68	0.01
121	301089	拓新药业	132	8,966.76	0.01
122	301062	上海艾录	523	8,896.23	0.01
123	301149	隆华新材	485	8,128.60	0.01
124	301118	恒光股份	158	7,745.16	0.01
125	301055	张小泉	355	7,731.90	0.01
126	301177	迪阿股份	66	7,661.28	0.01
127	301188	力诺特玻	358	7,331.84	0.01

128	300814	中富电路	307	7,331.16	0.01
129	301101	明月镜片	160	6,937.60	0.01
130	301028	东亚机械	504	6,804.00	0.01
131	301133	金钟股份	251	6,764.45	0.01
132	301126	达嘉维康	351	6,749.73	0.01
133	301138	华研精机	146	6,549.56	0.01
134	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.01
135	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.01
136	301087	可孚医疗	85	6,403.90	0.01
137	301056	森赫股份	572	6,343.48	0.00
138	301048	金鹰重工	482	6,246.72	0.00
139	301078	孩子王	504	6,118.56	0.00
140	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
141	301090	华润材料	509	5,710.98	0.00
142	300854	中兰环保	203	5,539.87	0.00
143	301063	海锅股份	153	5,524.83	0.00
144	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
145	301081	严牌股份	306	5,336.64	0.00
146	301168	通灵股份	102	5,317.26	0.00
147	301036	双乐股份	174	5,207.82	0.00
148	301049	超越科技	154	5,069.68	0.00
149	301059	金三江	259	4,998.70	0.00
150	301182	凯旺科技	160	4,892.80	0.00
151	301198	喜悦智行	167	4,876.40	0.00
152	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
153	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
154	301189	奥尼电子	82	4,642.84	0.00
155	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
156	301100	风光股份	143	4,453.02	0.00
157	301057	汇隆新材	218	4,146.36	0.00
158	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
159	301199	迈赫股份	124	3,968.00	0.00
160	301179	泽宇智能	75	3,807.75	0.00
161	301190	善水科技	136	3,734.56	0.00
162	301079	邵阳液压	140	3,474.80	0.00
163	301093	华兰股份	66	3,290.10	0.00
164	688016	心脉医疗	13	3,233.62	0.00
165	301096	百诚医药	41	3,219.73	0.00
166	301092	争光股份	89	3,161.28	0.00
167	301088	戎美股份	125	3,083.75	0.00
168	301108	洁雅股份	54	2,900.34	0.00
169	002299	圣农发展	100	2,417.00	0.00



170	688039	当虹科技	3	230.46	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	300014	亿纬锂能	8,434,615.00	3.64
2	300450	先导智能	7,710,467.00	3.32
3	300207	欣旺达	4,511,290.00	1.94
4	300037	新宙邦	4,475,806.80	1.93
5	300033	同花顺	4,415,431.00	1.90
6	300529	健帆生物	4,356,327.00	1.88
7	601689	拓普集团	3,428,743.00	1.48
8	300759	康龙化成	3,233,655.00	1.39
9	688005	容百科技	3,153,149.57	1.36
10	300433	蓝思科技	3,037,257.00	1.31
11	300750	宁德时代	2,934,054.00	1.26
12	300687	赛意信息	2,743,011.00	1.18
13	300661	圣邦股份	2,735,333.00	1.18
14	600885	宏发股份	2,688,370.00	1.16
15	603659	璞泰来	2,550,305.00	1.10
16	002027	分众传媒	2,501,743.00	1.08
17	300122	智飞生物	2,489,206.00	1.07
18	603236	移远通信	2,466,651.00	1.06
19	002603	以岭药业	2,409,682.00	1.04
20	688016	心脉医疗	2,397,161.47	1.03

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	300750	宁德时代	23,749,251.88	10.24
2	300059	东方财富	11,059,770.40	4.77
3	300760	迈瑞医疗	8,640,623.00	3.72
4	300015	爱尔眼科	7,866,444.19	3.39
5	300014	亿纬锂能	7,353,293.00	3.17
6	300124	汇川技术	6,551,561.00	2.82
7	300122	智飞生物	6,334,738.29	2.73
8	300142	沃森生物	5,364,722.00	2.31
9	300450	先导智能	5,148,166.80	2.22
10	300274	阳光电源	4,926,045.00	2.12
11	300033	同花顺	4,769,082.00	2.06

12	300433	蓝思科技	4,210,429.46	1.81
13	603267	鸿远电子	3,934,641.08	1.70
14	600845	宝信软件	3,848,872.00	1.66
15	300498	温氏股份	3,594,472.64	1.55
16	300759	康龙化成	3,514,400.00	1.51
17	601689	拓普集团	3,403,452.05	1.47
18	002056	横店东磁	3,383,897.00	1.46
19	603466	风语筑	3,346,808.45	1.44
20	300073	当升科技	3,254,768.32	1.40

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	260,415,316.51
卖出股票收入（成交）总额	386,304,100.84

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。

#### 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投资。

#### 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投资。

#### 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。

#### 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

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

##### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

## 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 投资组合报告附注

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

本基金本报告期末投资的前十名证券中，沃森生物（300142）于 2021 年 7 月 3 日公告收到中国证券监督管理委员会云南监管局出具的行政监管措施决定书，对横琴沃森的投资决策和投后管理过程中，投资决策程序执行不到位，并且投后跟踪管理不到位，导致违反了《企业内部控制应用指引第 6 号——资金活动》第十二条至第十五条的规定行为，采取责令改正的行政监管措施。对该证券投资决策程序的说明：根据我司的基金投资管理相关制度，以相应的研究报告为基础，结合其未来增长前景，由基金经理决定具体投资行为。

本基金本报告期末投资的前十名证券中，汇川技术（300124）于 2021 年 5 月 18 日收到广东省通信管理局下发的《责令整改通知书》，因现场检查发现网络安全相关业务系统存在若干中高危安全隐患，存在违规行为，故对责令公司整改。对该证券投资决策程序的说明：根据我司的基金投资管理相关制度，以相应的研究报告为基础，结合其未来增长前景，由基金经理决定具体投资行为。

### 8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	17,589.08
2	应收证券清算款	69,822.31
3	应收股利	-
4	应收利息	1,972.27
5	应收申购款	93,376.31
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	182,759.97

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：截至本报告期末，本基金前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

### § 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 (%)
4,935	11,652.98	33,317.79	0.06	57,474,116.95	99.94

#### 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	116,812.37	0.2031

#### 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

### § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2017 年 5 月 12 日) 基金份额总额	522,063,986.47
本报告期期初基金份额总额	121,095,582.45
本报告期基金总申购份额	34,439,020.82
减：本报告期基金总赎回份额	98,027,168.53
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	57,507,434.74

## § 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、报告。

报告期内基金托管人未发生重大人事变动。

### 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

注：报告期内无策略改变。

### 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（特殊普通合伙）的报酬为 55,000 元人民币，该事务所已向本基金提供了 5 年的审计服务。

### 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	
华泰证券	5	140,250,776.34	21.89%	128,215.36	22.65%	-
中泰证券	2	72,343,066.76	11.29%	66,903.42	11.82%	-
招商证券	4	65,846,613.2	10.28%	60,765.47	10.74%	-

		5				
国信证券	2	55,436,749.97	8.65%	40,541.06	7.16%	-
天风证券	2	44,695,047.28	6.98%	42,182.74	7.45%	-
中信建投	3	36,100,847.94	5.64%	29,207.59	5.16%	-
民生证券	4	35,087,518.91	5.48%	31,975.37	5.65%	-
国盛证券	2	34,054,777.00	5.32%	24,907.33	4.40%	-
华创证券	1	33,903,953.24	5.29%	31,573.32	5.58%	-
西南证券	1	26,561,932.25	4.15%	24,737.45	4.37%	-
宏信证券	2	21,997,423.79	3.43%	20,484.75	3.62%	-
东方财富证券	2	20,667,533.71	3.23%	19,247.83	3.40%	-
粤开证券	1	20,512,243.84	3.20%	18,692.95	3.30%	-
东吴证券	2	11,122,393.85	1.74%	10,358.50	1.83%	-
海通证券	2	9,168,622.34	1.43%	6,702.95	1.18%	-
信达证券	3	7,436,717.04	1.16%	5,289.56	0.93%	-
西部证券	2	3,867,826.08	0.60%	2,829.18	0.50%	-
太平洋证券	2	1,522,178.36	0.24%	1,417.71	0.25%	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
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
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	1,066,687.04	88.92%	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
国盛证券	132,870.00	11.08%	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-

东吴证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证 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调整公司旗下公募基金风险等级相关事项的公告	证监会规定报刊和网站	2021年12月15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
4	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
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10月22日
6	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金参与海银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10月12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 10 月 1 日
8	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
9	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
10	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
11	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
12	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
13	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
14	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
15	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
16	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
17	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
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 5 月 20 日
19	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
20	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
21	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
22	华泰柏瑞基金管理有限公司关于调整旗下部分基金在招商银行定投起点的	证监会规定报刊和网站	2021 年 3 月 31 日

	公告		
23	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
24	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
25	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
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 2 月 27 日
27	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
28	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
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 1 月 22 日
30	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
31	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
32	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

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

### 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](http://www.huatai-pb.com)

华泰柏瑞基金管理有限公司

2022 年 3 月 31 日