

华泰柏瑞成长智选混合型证券投资基金 2021 年第 2 季度报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 7 月 21 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 7 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 4 月 1 日起至 2021 年 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	华泰柏瑞成长智选混合
交易代码	010345
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 11 月 23 日
报告期末基金份额总额	708,688,703.14 份
投资目标	本基金结合指标与基本面研究，选择质地优良的成长性公司，在合理控制组合风险及考虑流动性的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争基金资产的持续稳健增值。
投资策略	本基金在分析宏观经济的基础上，结合政策面、市场资金面等情况，在经济周期不同阶段，根据市场不同表现，在大类资产中进行配置，把握各类资产的投资机会，保证整体投资业绩的持续性。具体投资策略包括：1、大类资产配置；2、股票投资策略；3、债券投资策略；4、资产支持证券投资策略；5、股指期货投资策略；6、融资业务的投资策略。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率*60%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*20%+中债综合指数收益率*20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险和预期收益水平高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。 本基金可能投资港股通标的股票，除需承担与境

	内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险，还需承担汇率风险以及香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。	
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	
下属分级基金的基金简称	华泰柏瑞成长智选混合 A	华泰柏瑞成长智选混合 C
下属分级基金的交易代码	010345	010346
报告期末下属分级基金的份额总额	598,686,272.41 份	110,002,430.73 份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2021年4月1日—2021年6月30日）	
	华泰柏瑞成长智选混合 A	华泰柏瑞成长智选混合 C
1. 本期已实现收益	125,170,800.88	18,460,531.08
2. 本期利润	326,539,283.15	44,359,134.22
3. 加权平均基金份额本期利润	0.3491	0.3487
4. 期末基金资产净值	754,850,361.86	138,282,670.06
5. 期末基金份额净值	1.2608	1.2571

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华泰柏瑞成长智选混合 A

阶段	净值增长率①	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	38.55%	1.87%	5.49%	0.55%	33.06%	1.32%
过去六个月	16.91%	2.46%	5.54%	0.79%	11.37%	1.67%

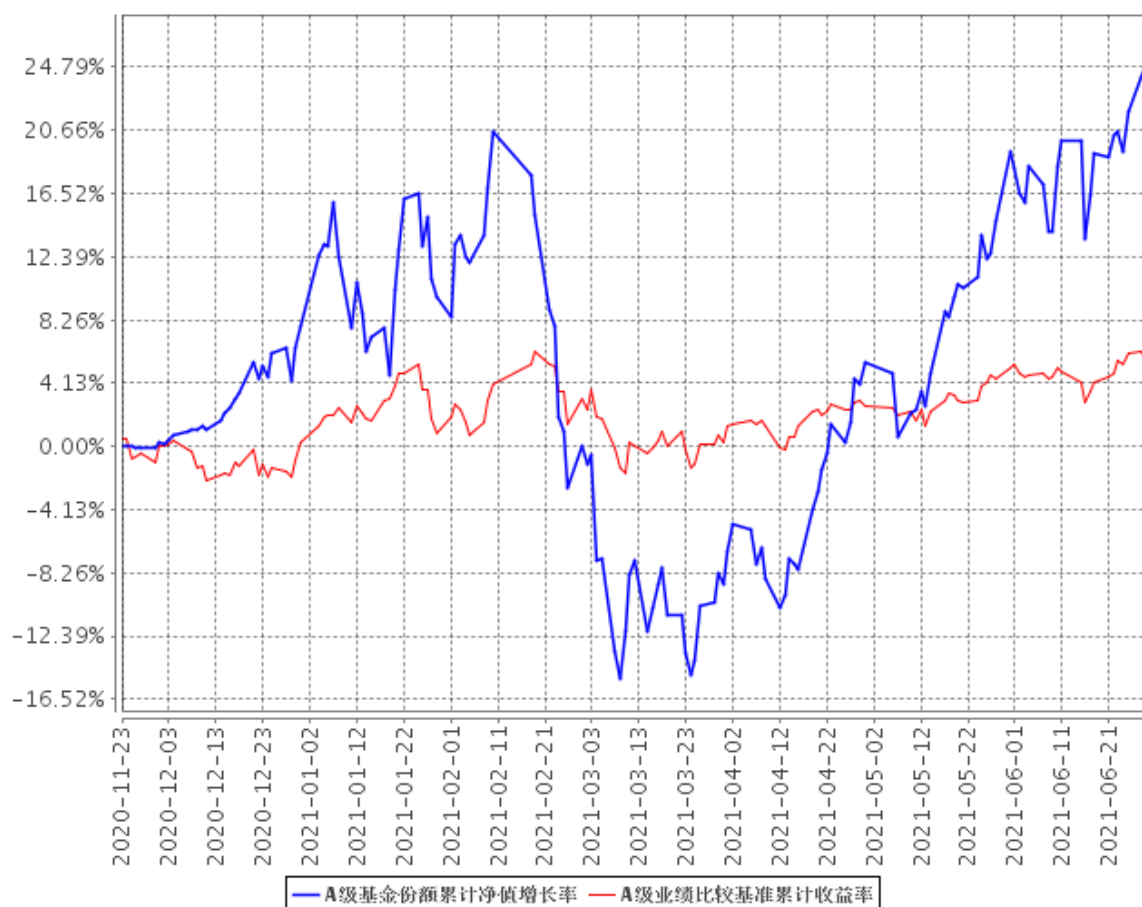
自基金合同生效起至今	26.08%	2.23%	5.75%	0.78%	20.33%	1.45%
------------	--------	-------	-------	-------	--------	-------

华泰柏瑞成长智选混合 C

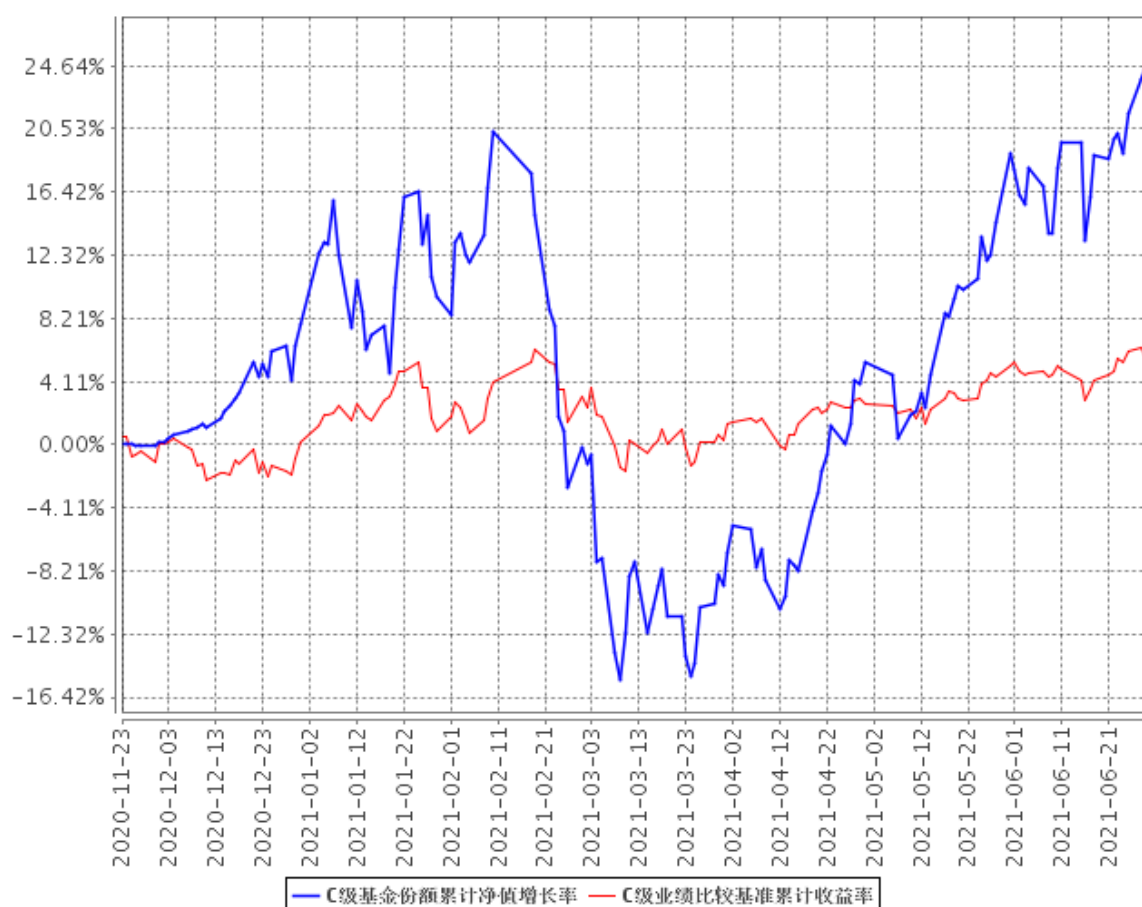
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	38.39%	1.87%	5.49%	0.55%	32.90%	1.32%
过去六个月	16.62%	2.46%	5.54%	0.79%	11.08%	1.67%
自基金合同生效起至今	25.71%	2.23%	5.75%	0.78%	19.96%	1.45%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、图示日期为 2020 年 11 月 23 日至 2021 年 6 月 30 日。

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

3、自基金合同生效起至本报告期末不满一年。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
牛勇	权益投资部副总监、本基金的基金经理	2020 年 11 月 23 日	-	13 年	经济学硕士，FRM。曾在泰康人寿保险股份有限公司从事研究工作。2008 年 5 月加入华安基金管理有限公司任高级金融工程师，2010 年 9 月起担任基金经理，

					2016年6月起任华安基金指数与量化投资事业部助理总监。2018年1月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，任投资部副总监。2018年5月起任华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金的基金经理。2019年3月起任投资研究部投资总监助理。2019年6月起任华泰柏瑞基本面智选混合型证券投资基金的基金经理。2020年11月起任华泰柏瑞成长智选混合型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

4.1.1 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

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
牛勇	公募基金	3	3,571,416,315.26	2018-05-03
	私募资产管理计划	1	1,765,147.44	2020-08-04
	其他组合	-	-	-
	合计	4	3,573,181,462.70	-

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内本基金的运作符合相关法律、法规以及基金合同的约定，不存在损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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，通过科学完善的制度及流程，从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能的利益输送。

首先投资部和研究部通过规范的决策流程来确保公平对待不同投资组合。其次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，在交易过程中启用投资交易系统内的公平交易模块，确保公平交易的实施。同时，风险管理部对报告期内的交易进行日常监控和分析评估。本报

告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本报告期内无下列情况：所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年二季度宏观经济延续稳健复苏，二季度 PMI 虽然较一季度环比有所回落，但仍处于积极扩张阶段。工业增加值在去年二季度的高基数效应消退后，仍处于历史中的较高水平。上半年猪肉价格同比大幅回落，加上黑色金属价格涨势趋缓，预计下半年 CPI 将处于合理范围，货币政策预计仍以平稳为主。市场在一季度震荡后，资金在二季度重新配置过程中，仍以中长期成长确定性高的成长板块为主。基金在期间降低了少部分估值极高的成长性品种配置，但对新能源车以及成长与估值匹配的大消费品种的中长期表现仍然坚定看好。

预计下半年内外需求将继续稳健复苏，新冠疫苗接种率将接近群体免疫水平，随着海外企业复工继续恢复与社交限制放松，外需拉动与内需复苏将继续共振。全球主要央行当前宽松的态度未发生根本变化，市场对海外央行的宽松政策长期退出开始逐渐消化，退出对市场的冲击效果预计将有限。我们对下半年国内外经济稳健复苏继续持乐观看法。优质成长股的估值水平仍处于合理范围内，在成长性行业与板块中，我们继续坚定看好新能源汽车、医疗服务、食品饮料中的优质成长性公司，这类公司的基本面仍维持较好的发展趋势。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末华泰柏瑞成长智选混合 A 基金份额净值为 1.2608 元，本报告期基金份额净值增长率为 38.55%；截至本报告期末华泰柏瑞成长智选混合 C 基金份额净值为 1.2571 元，本报告期基金份额净值增长率为 38.39%；同期业绩比较基准收益率为 5.49%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	837,555,229.08	89.12
	其中：股票	837,555,229.08	89.12
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	327,900.00	0.03
	其中：债券	327,900.00	0.03
	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	75,502,012.08	8.03
8	其他资产	26,374,858.63	2.81
9	合计	939,759,999.79	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	10,512.39	0.00
C	制造业	735,884,829.56	82.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00
E	建筑业	47,572.87	0.01
F	批发和零售业	89,166.82	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	9,014.76	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	40,226.27	0.00
J	金融业	33,164.10	0.00
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	10,586,772.72	1.19

N	水利、环境和公共设施管理业	22,987.31	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	16,262.03	0.00
Q	卫生和社会工作	90,801,699.86	10.17
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	837,555,229.08	93.78

5.2.2 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股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	161,735	86,495,878.00	9.68
2	600809	山西汾酒	189,433	84,865,984.00	9.50
3	300014	亿纬锂能	807,613	83,935,219.09	9.40
4	002709	天赐材料	776,079	82,714,499.82	9.26
5	600438	通威股份	1,780,792	77,054,869.84	8.63
6	300347	泰格医药	380,948	73,637,248.40	8.24
7	002812	恩捷股份	304,185	71,209,708.50	7.97
8	300450	先导智能	1,003,297	60,338,281.58	6.76
9	000799	酒鬼酒	197,356	50,444,193.60	5.65
10	002821	凯莱英	128,400	47,841,840.00	5.36

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	327,900.00	0.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	327,900.00	0.04

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	123117	健帆转债	3,279	327,900.00	0.04

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

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

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的情形，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情形。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,076,971.71
2	应收证券清算款	22,220,613.98
3	应收股利	-
4	应收利息	8,908.97
5	应收申购款	3,068,363.97
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	26,374,858.63

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告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。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华泰柏瑞成长智选混合 A	华泰柏瑞成长智选混合 C

报告期期初基金份额总额	1,073,931,184.33	133,068,909.65
报告期期间基金总申购份额	124,279,180.66	65,672,110.90
减:报告期期间基金总赎回份额	599,524,092.58	88,738,589.82
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	598,686,272.41	110,002,430.73

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：无。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无。

§ 9 备查文件目录

9.1 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

9.2 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

9.3 查阅方式

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

华泰柏瑞基金管理有限公司

2021 年 7 月 21 日