

# 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 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 28 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 2021 年 6 月 30 日止。（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于 2018 年 7 月 2 日根据收费方式分不同，新增 C 类份额，C 类相关指标从 2018 年 7 月 2 日开始计算）。

## 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>6</b>  |
| 2.1 基金基本情况                              | 6         |
| 2.2 基金产品说明                              | 6         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 7         |
| 2.4 信息披露方式                              | 7         |
| 2.5 其他相关资料                              | 8         |
| <b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b>                 | <b>9</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 9         |
| 3.2 基金净值表现                              | 9         |
| <b>§4 管理人报告</b>                         | <b>12</b> |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 12        |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 15        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 15        |
| 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             | 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             | 16        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 17        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 17        |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明       | 17        |
| <b>§5 托管人报告</b>                         | <b>18</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 18        |
| 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 | 18        |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见       | 18        |
| <b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>               | <b>19</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 19        |
| 6.2 利润表                                 | 20        |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表                      | 21        |

|                                            |           |
|--------------------------------------------|-----------|
| 6.4 报表附注.....                              | 22        |
| <b>§7 投资组合报告.....</b>                      | <b>49</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况.....                        | 49        |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....                    | 49        |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....     | 50        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                   | 58        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                  | 59        |
| 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....    | 60        |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细..... | 60        |
| 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细..... | 60        |
| 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....    | 60        |
| 7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细.....   | 60        |
| 7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....             | 60        |
| 7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....             | 61        |
| 7.13 投资组合报告附注.....                         | 61        |
| <b>§8 基金份额持有人信息.....</b>                   | <b>63</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....                 | 63        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....              | 63        |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....     | 63        |
| <b>§9 开放式基金份额变动.....</b>                   | <b>65</b> |
| <b>§10 重大事件揭示.....</b>                     | <b>66</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议.....                      | 66        |
| 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....      | 66        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....           | 66        |
| 10.4 基金投资策略的改变.....                        | 66        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....                 | 66        |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....         | 66        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....                | 66        |
| 10.8 其他重大事件.....                           | 69        |
| <b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>             | <b>72</b> |

|                                          |           |
|------------------------------------------|-----------|
| 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 ..... | 72        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                | 72        |
| <b>§12 备查文件目录.....</b>                   | <b>73</b> |
| 12.1 备查文件目录.....                         | 73        |
| 12.2 存放地点.....                           | 73        |
| 12.3 查阅方式.....                           | 73        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                               |                    |
|-----------------|-------------------------------|--------------------|
| 基金名称            | 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 |                    |
| 基金简称            | 华泰柏瑞沪深 300ETF 联接              |                    |
| 基金主代码           | 460300                        |                    |
| 基金运作方式          | 契约型开放式                        |                    |
| 基金合同生效日         | 2012 年 5 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           | 中国工商银行股份有限公司                  |                    |
| 报告期末基金份额总额      | 1,780,212,322.94 份            |                    |
| 基金合同存续期         | 不定期                           |                    |
| 下属分级基金的基金简称:    | 华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 A            | 华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 C |
| 下属分级基金的交易代码:    | 460300                        | 006131             |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 365,679,860.99 份              | 1,414,532,461.95 份 |

#### 2.1.1 目标基金基本情况

|              |                           |
|--------------|---------------------------|
| 基金名称         | 华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 |
| 基金主代码        | 510300                    |
| 基金运作方式       | 交易型开放式                    |
| 基金合同生效日      | 2012 年 5 月 4 日            |
| 基金份额上市的证券交易所 | 上海证券交易所                   |
| 上市日期         | 2012 年 5 月 28 日           |
| 基金管理人名称      | 华泰柏瑞基金管理有限公司              |
| 基金托管人名称      | 中国工商银行股份有限公司              |

### 2.2 基金产品说明

|        |                                                                                                                                                                                               |
|--------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。                                                                                                                                                                  |
| 投资策略   | 本基金为沪深 300ETF 的联接基金。沪深 300ETF 是采用完全复制法实现对沪深 300 指数紧密跟踪的全被动指数基金，本基金主要通过投资于沪深 300ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪。在投资运作过程中，本基金将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，决定采用一级市场申购赎回的方式或二级市场买卖的方式投资于华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数 $\times$ 95% + 银行活期存款税后收益率 $\times$ 5%                                                                                                                                              |
| 风险收益特征 | 本基金为沪深 300ETF 的联接基金，采用主要投资于华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金实现对业绩比较基准的紧密跟踪。因此，本基金的业绩表现与沪深 300 指数的表现密切相关。本基金的风险与收益水平高于混合型                                                                              |

|  |                  |
|--|------------------|
|  | 基金、债券型基金与货币市场基金。 |
|--|------------------|

### 2.2.1 目标基金产品说明

|        |                                                                                                                                                    |
|--------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化                                                                                                                        |
| 投资策略   | 本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现      |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数                                                                                                                                          |
| 风险收益特征 | 本基金属于股票型基金中的指数型基金，股票最低仓位为 95%，并采用完全复制的被动式投资策略：一方面，相对于混合基金、债券基金与货币市场基金而言，其风险和收益较高，属于股票型基金中高风险、高收益的产品；另一方面，相对于采用抽样复制的指数型基金而言，其风险和收益特征将更能与标的指数保持基本一致。 |

### 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                        | 中国工商银行股份有限公司        |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 刘万方                                 | 郭明                  |
|         | 联系电话 | 021-38601777                        | 010-66105799        |
|         | 电子邮箱 | cs4008880001@huatai-pb.com          | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话  |      | 400-888-0001                        | 95588               |
| 传真      |      | 021-38601799                        | 010-66105798        |
| 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 | 北京市西城区复兴门内大街 55 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 | 北京市西城区复兴门内大街 55 号   |
| 邮政编码    |      | 200135                              | 100140              |
| 法定代表人   |      | 贾波                                  | 陈四清                 |

### 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                                                            |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网 | <a href="http://www.huatai-pb.com">http://www.huatai-pb.com</a> |

|            |                                    |
|------------|------------------------------------|
| 址          |                                    |
| 基金中期报告备置地点 | 上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层 |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称           | 办公地址                               |
|--------|--------------|------------------------------------|
| 注册登记机构 | 华泰柏瑞基金管理有限公司 | 上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层 |

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 基金级别          | 华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 A                    | 华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 C                    |
|---------------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2021 年 1 月 1 日 - 2021 年 6 月 30 日) | 报告期(2021 年 1 月 1 日 - 2021 年 6 月 30 日) |
| 本期已实现收益       | 38,962,726.59                         | 163,673,215.48                        |
| 本期利润          | 7,868,363.61                          | -8,729,213.83                         |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0238                                | -0.0060                               |
| 本期加权平均净值利润率   | 1.77%                                 | -0.45%                                |
| 本期基金份额净值增长率   | 1.04%                                 | 0.92%                                 |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2021 年 6 月 30 日)                 |                                       |
| 期末可供分配利润      | 95,892,572.85                         | 342,928,945.95                        |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.2622                                | 0.2424                                |
| 期末基金资产净值      | 461,572,433.84                        | 1,770,731,423.54                      |
| 期末基金份额净值      | 1.2622                                | 1.2518                                |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2021 年 6 月 30 日)                 |                                       |
| 基金份额累计净值增长率   | 141.78%                               | 52.69%                                |

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

华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 A

| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月      | -1.24%   | 0.76%       | -1.91%     | 0.76%         | 0.67%  | 0.00%  |
| 过去三个月      | 4.31%    | 0.92%       | 3.32%      | 0.93%         | 0.99%  | -0.01% |
| 过去六个月      | 1.04%    | 1.24%       | 0.29%      | 1.25%         | 0.75%  | -0.01% |
| 过去一年       | 26.81%   | 1.25%       | 24.19%     | 1.27%         | 2.62%  | -0.02% |
| 过去三年       | 53.74%   | 1.28%       | 46.42%     | 1.30%         | 7.32%  | -0.02% |
| 过去五年       | 74.47%   | 1.10%       | 62.31%     | 1.12%         | 12.16% | -0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | 141.78%  | 1.32%       | 95.49%     | 1.38%         | 46.29% | -0.06% |

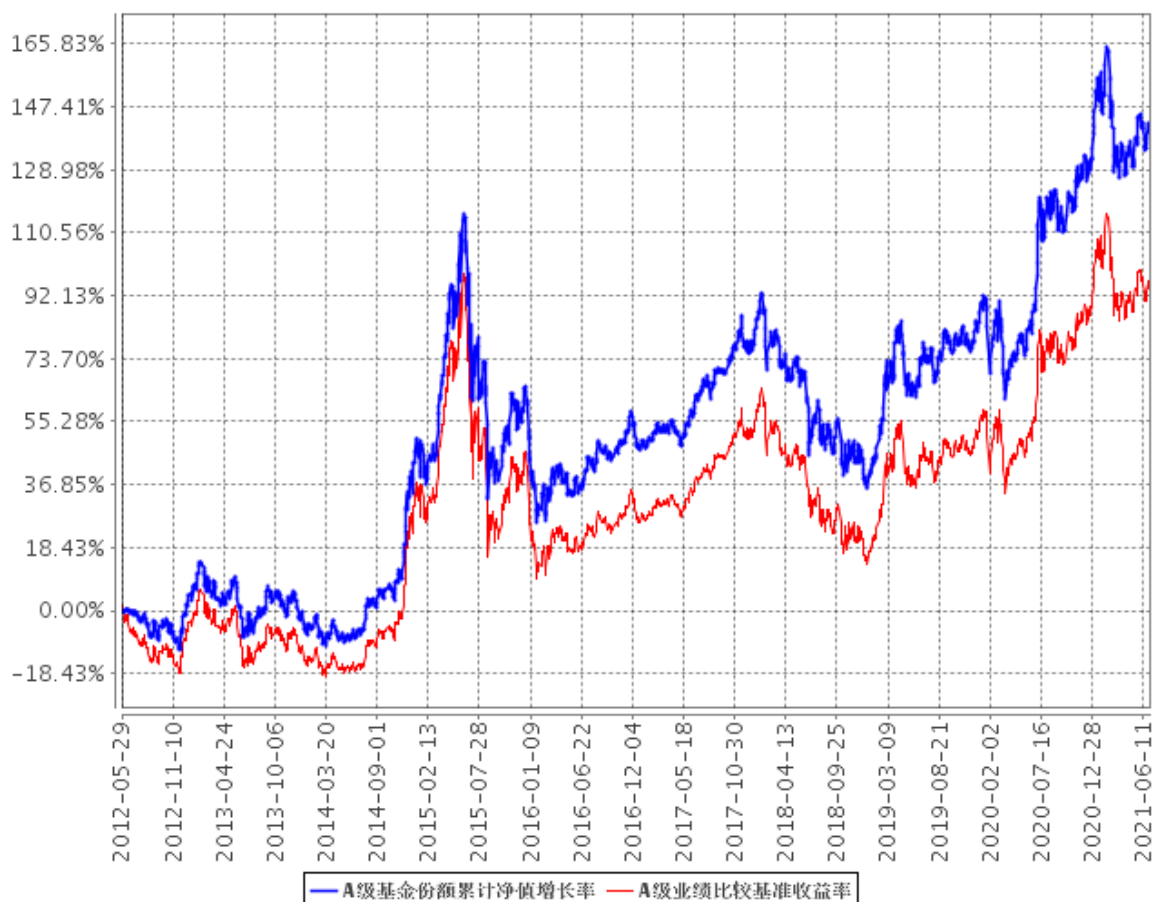
华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 C

| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③   | ②—④    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去一个月      | -1.26%   | 0.76%       | -1.91%     | 0.76%         | 0.65% | 0.00%  |
| 过去三个月      | 4.24%    | 0.92%       | 3.32%      | 0.93%         | 0.92% | -0.01% |
| 过去六个月      | 0.92%    | 1.24%       | 0.29%      | 1.25%         | 0.63% | -0.01% |
| 过去一年       | 26.50%   | 1.25%       | 24.19%     | 1.27%         | 2.31% | -0.02% |
| 过去三年       | 52.69%   | 1.28%       | 46.42%     | 1.30%         | 6.27% | -0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | 52.69%   | 1.28%       | 46.42%     | 1.30%         | 6.27% | -0.02% |

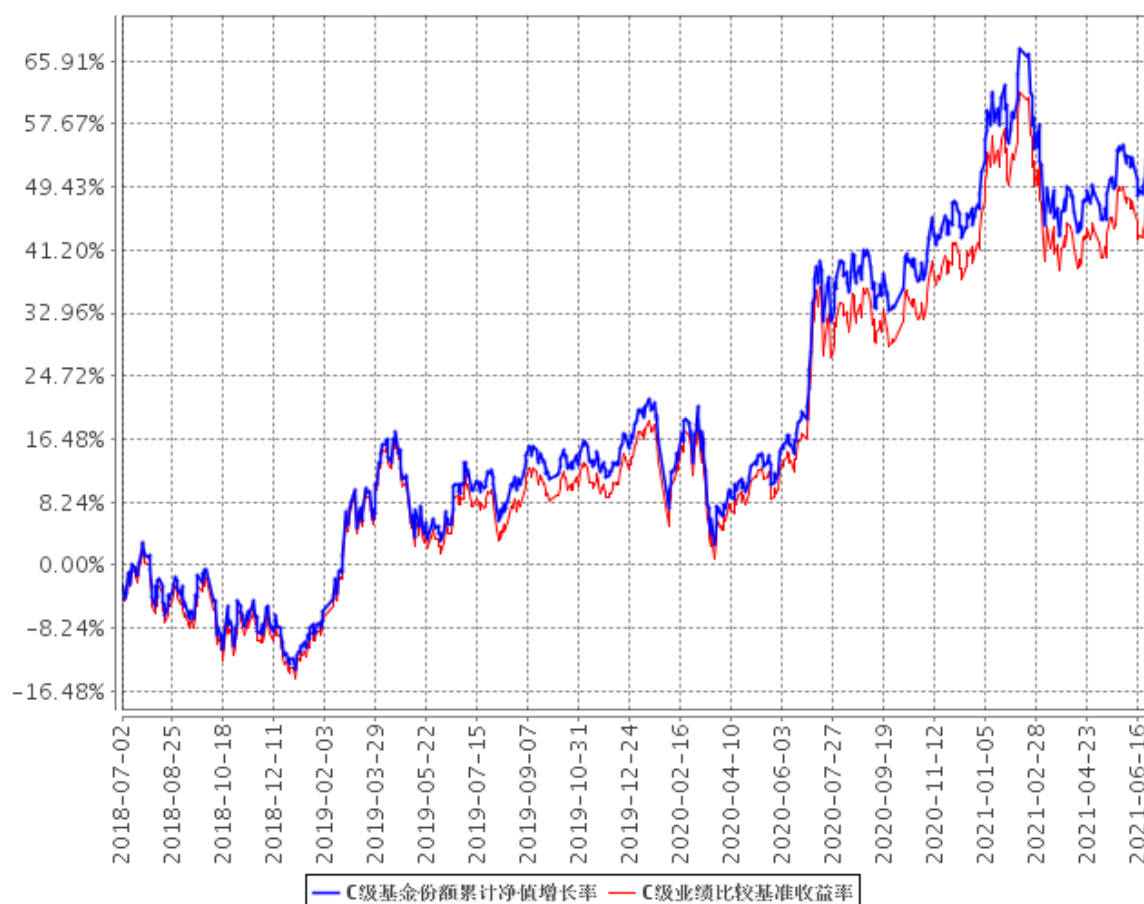
注：C 类份额业绩计算期间为 2018 年 7 月 2 日至 2021 年 6 月 30 日。

### 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

**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：A类图示日期为2012年5月29日至2021年6月30日。C类图示日期为2018年7月2日至2021年6月30日。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

融地产灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数基金、华泰柏瑞医疗健康混合型证券投资基金、华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通指数基金联接基金、华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞量化明选混合型证券投资基金、华泰柏瑞基本面智选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞锦泰一年定期开放债券型证券投资基金、华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞益通三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、华泰柏瑞研究精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞景气回报一年持有期混合型证券投资基金、华泰柏瑞锦兴 39 个月定期开放债券型证券投资基金、华泰柏瑞锦瑞债券型证券投资基金、华泰柏瑞益商一年定期开放债券型发起式证券投资基金、华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞质量成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞行业精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞鸿利中短债债券型证券投资基金、华泰柏瑞景气优选混合型证券投资基金、华泰柏瑞品质优选混合型证券投资基金、华泰柏瑞景利混合型证券投资基金、华泰柏瑞优势领航混合型证券投资基金、华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞锦乾债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化创盈混合型证券投资基金、华泰柏瑞成长智选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞量化创享混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞质量领先混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证稀土产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞品质成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证物联网主题交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞质量精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞港股通时代机遇混合型证券投资基金、华泰柏瑞行业严选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证企业核心竞争力 50 交易型开放式指数证券投资基金。截至 2021 年 6 月 30 日，公司基金管理规模为 2174.24 亿元。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务           | 任本基金的基金经理（助理）期限 |      | 证券从业年限 | 说明                                                    |
|----|--------------|-----------------|------|--------|-------------------------------------------------------|
|    |              | 任职日期            | 离任日期 |        |                                                       |
| 柳军 | 指数投资部总监、本基金的 | 2012 年 5 月 29 日 | -    | 20 年   | 20 年证券（基金）从业经历，复旦大学财务管理硕士，2000-2001 年任上海汽车集团财务有限公司财务， |

|  |          |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
|--|----------|--|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | 基金经<br>理 |  |  | <p>2001-2004 年任华安基金管理有限公司高级基金核算员，2004 年 7 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任基金事务部总监、上证红利 ETF 基金经理助理。2009 年 6 月起任上证红利交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2010 年 10 月起担任指数投资部副总监。2011 年 1 月至 2020 年 2 月任华泰柏瑞上证中小盘 ETF 基金、华泰柏瑞上证中小盘 ETF 联接基金基金经理。2012 年 5 月起任华泰柏瑞沪深 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的基金经理。2015 年 2 月起任指数投资部总监。2015 年 5 月起任华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2018 年 3 月至 2018 年 11 月任华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 3 月至 2018 年 10 月任华泰柏瑞泰利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 4 月起任华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2018 年 10 月起任华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2018 年 12 月起任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的基金经理。2019 年 7 月起任华</p> |
|--|----------|--|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |
|--|--|--|--|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | 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的基金经理。2019 年 9 月至 2021 年 4 月任华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2020 年 2 月至 2021 年 4 月任华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2020 年 9 月起任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的基金经理。2021 年 3 月起任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的基金经理。2021 年 5 月起任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（QDII）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。任职日期和离任日期指基金管理公司作出决定之日。

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

注：无。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司将投资管理职能和交易执行职能完全隔离，实行集中交易制度，由交易部为公募基金、专户理财和海外投资等业务统一交易服务，为公平交易的实施提供了较好的保障。

目前公司公募基金经理有兼任私募资产管理计划投资经理的情况，兼任业务遵照相关法律法规

规要求进行，同时遵守公司公平交易制度。公司机构设置合理，公平交易的相关管理制度健全，投资决策流程完善，各项制度执行情况良好。交易价差分析表明公司旗下各基金均得到了公平对待，不存在非公平交易和利益输送的行为。经过对不同基金之间交易相同证券时的同向交易价差进行分析发现，报告期内基金之间的买卖交易价差总体上处于正常的合理水平。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金管理人根据《异常交易监控与管理办法》对投资交易过程中可能发生的异常交易行为进行监督和管理。投资部负责对异常交易行为进行事前识别和检查，交易部负责对异常交易行为的事中监督和控制，风险管理部及异常交易评估小组负责异常交易行为的事后审查和评估。本报告期内，该制度执行情况良好，无论在二级市场还是在大宗交易或者一级市场申购等交易中，均没有发现影响证券价格或者严重误导其他投资者等异常交易行为。

本报告期本基金与公司所管理的其他投资组合没有参与交易所公开竞价单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的同日反向交易。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年上半年市场以结构性机会为主。其中电气设备、钢铁、化工等行业录得正收益，期间电气设备行业指数上涨达 23.83%，钢铁行业指数上涨达 23.62%。整体来看，沪深 300、中证 500、中证 1000 和创业板涨跌幅分别为 0.24%、6.93%、6.58%、和 17.22%。从市场风格来看，成长风格表现相对强势，优于价值风格，期间沪深 300 价值指数和沪深 300 成长指数分别涨幅为 0.28% 和 4.78%。

我们严格按照基金合同的规定，紧密跟踪业绩基准、跟踪偏离最小化的投资策略进行被动投资。本报告期内，本基金的日均绝对跟踪偏离度为 0.023%，期间日跟踪误差为 0.036%，较好地实现了本基金的投资目标。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 A 基金份额净值为 1.2622 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.04%；截至本报告期末华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 C 基金份额净值为 1.2518 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.92%；同期业绩比较基准收益率为 0.29%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

二季度的全球股票市场摆脱了之前两个季度的高一致性，即周期股持续跑赢成长风格。期间各类市场风格此起彼伏，驱动市场风格在成长和价值间反复徘徊。年初以来以宏观流动性边际收

紧，很多投资者担心高估值板块承压，然而我们发现，上半年 A 股表现分化加剧，高估值板块涨幅反而更大，无论是从细分行业还是概念指数，年初以来涨幅较高的板块大都处于相对较高的估值水平。原因还是在于投资者风险偏好高，愿意为高景气板块给予更高估值。

新冠疫情后中国经济增速或逐渐向新平台回归。外需层面上来看，全球复苏的主线逐渐从商品转向服务，可能意味着对全球、中国商品贸易的溢出效应下降。内需层面上来看，基建的支撑作用消退，政策严控下地产可能也面临逐渐降温，而消费虽然仍有缺口，受限于居民消费意愿回升较慢。随着经济波动的下降，政策的关注重点也转向中长期问题。而从长期来看，在存量债务压力下，政策重心从控制新增债务转向存量债务的维系问题，从这个角度来看，央行的货币政策或“易松难紧”。展望下半年，A 股市场或将伴随国内货币政策防范化解金融风险、保供稳价和碳中和等政策的方向不断小幅微调。结构上看，A 股分化趋势还将继续延续，建议成长和价值均衡配置。

本基金将继续严格遵守跟踪偏离最小化的被动投资策略，从而为基金投资人谋求与业绩基准基本一致的投资回报。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定，在符合有关基金分红条件的前提下，基金每年收益分配次数最多为 12 次；每份基金份额每次分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 10%，若基金合同生效不满 3 个月，可不进行收益分配。本报告期内，本基金符合分红条件，分别于 2021 年 1 月 28 日每 10 份基金份额派发红利 0.75 元，利润分配合计 140,501,379.75 元；2021 年 2 月 25 日每 10 份基金份额派发红利 0.73 元，利润分配合计 142,355,612.89 元；2021 年 6 月 28 日每 10 份基金份额派发红利 0.6 元，利润分配合计 103,821,405.92 元。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，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的管理人——华泰柏瑞基金管理有限公司在华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对华泰柏瑞基金管理有限公司编制和披露的华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2021 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产             | 附注号        | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资 产：</b>     |            |                                |                                  |
| 银行存款            | 6.4.7.1    | 106,362,994.34                 | 141,503,654.11                   |
| 结算备付金           |            | 7,147,937.97                   | 6,487,900.76                     |
| 存出保证金           |            | 379,917.56                     | 462,654.44                       |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 2,118,976,702.46               | 2,121,529,718.21                 |
| 其中：股票投资         |            | 73,710,268.06                  | 64,606,995.20                    |
| 基金投资            |            | 2,036,249,721.70               | 2,056,907,723.01                 |
| 债券投资            |            | 9,016,712.70                   | 15,000.00                        |
| 资产支持证券投资        |            | -                              | -                                |
| 贵金属投资           |            | -                              | -                                |
| 衍生金融资产          | 6.4.7.3    | -                              | -                                |
| 买入返售金融资产        | 6.4.7.4    | -                              | -                                |
| 应收证券清算款         |            | 372,584.97                     | 28,127.66                        |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 196,723.02                     | 22,202.43                        |
| 应收股利            |            | -                              | -                                |
| 应收申购款           |            | 2,582,713.63                   | 974,641.44                       |
| 递延所得税资产         |            | -                              | -                                |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                              | -                                |
| 资产总计            |            | 2,236,019,573.95               | 2,271,008,899.05                 |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2021 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>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          | 6.4.7.3    | -                              | -                                |
| 卖出回购金融资产款       |            | -                              | -                                |
| 应付证券清算款         |            | -                              | -                                |
| 应付赎回款           |            | 3,051,240.04                   | 5,323,475.28                     |
| 应付管理人报酬         |            | 85,142.58                      | 78,766.25                        |
| 应付托管费           |            | 17,028.53                      | 15,753.27                        |
| 应付销售服务费         |            | 381,694.17                     | 297,596.26                       |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | 69,133.15                      | 90,904.94                        |
| 应交税费            |            | -                              | 16,815.01                        |

|               |          |                  |                  |
|---------------|----------|------------------|------------------|
| 应付利息          |          | -                | -                |
| 应付利润          |          | -                | -                |
| 递延所得税负债       |          | -                | -                |
| 其他负债          | 6.4.7.8  | 111,478.10       | 224,559.19       |
| 负债合计          |          | 3,715,716.57     | 6,047,870.20     |
| <b>所有者权益：</b> |          |                  |                  |
| 实收基金          | 6.4.7.9  | 1,780,212,322.94 | 1,570,004,742.58 |
| 未分配利润         | 6.4.7.10 | 452,091,534.44   | 694,956,286.27   |
| 所有者权益合计       |          | 2,232,303,857.38 | 2,264,961,028.85 |
| 负债和所有者权益总计    |          | 2,236,019,573.95 | 2,271,008,899.05 |

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额总额 1,780,212,322.94 份，其中华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 A 基金份额净值 1.2622 元，份额总额 365,679,860.99 份；华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 C 基金份额净值 1.2518 元，份额总额 1,414,532,461.95 份；

## 6.2 利润表

会计主体：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

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目                   | 附注号        | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至<br>2021 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至<br>2020 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|------------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| <b>一、收入</b>           |            | 2,970,145.64                             | 203,065,750.75                                |
| 1.利息收入                |            | 393,881.41                               | 816,730.55                                    |
| 其中：存款利息收入             | 6.4.7.11   | 319,561.22                               | 804,637.38                                    |
| 债券利息收入                |            | 74,320.19                                | 12,093.17                                     |
| 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）      |            | 205,898,632.39                           | 167,200,488.52                                |
| 其中：股票投资收益             | 6.4.7.12   | 27,255,627.49                            | 15,238,872.91                                 |
| 基金投资收益                | 6.4.7.13   | 150,487,823.15                           | 134,074,927.58                                |
| 债券投资收益                | 6.4.7.14   | 13,473.67                                | 15,972.58                                     |
| 资产支持证券投资收益            | 6.4.7.14.5 | -                                        | -                                             |
| 贵金属投资收益               | 6.4.7.15   | -                                        | -                                             |
| 衍生工具收益                | 6.4.7.16   | -                                        | 17,206,368.93                                 |
| 股利收益                  | 6.4.7.17   | 28,141,708.08                            | 664,346.52                                    |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.18   | -203,496,792.29                          | 32,724,127.75                                 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）     |            | -                                        | -                                             |

|                            |            |              |                |
|----------------------------|------------|--------------|----------------|
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）          | 6.4.7.19   | 174,424.13   | 2,324,403.93   |
| <b>减：二、费用</b>              |            | 3,830,995.86 | 3,713,917.54   |
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2.1 | 555,822.75   | 710,547.70     |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 111,164.55   | 142,109.58     |
| 3. 销售服务费                   | 6.4.10.2.3 | 2,430,398.73 | 1,738,748.04   |
| 4. 交易费用                    | 6.4.7.20   | 624,147.89   | 970,608.70     |
| 5. 利息支出                    |            | -            | -              |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | -            | -              |
| 6. 税金及附加                   |            | -            | 61,942.92      |
| 7. 其他费用                    | 6.4.7.21   | 109,461.94   | 89,960.60      |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | -860,850.22  | 199,351,833.21 |
| 减：所得税费用                    |            | -            | -              |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | -860,850.22  | 199,351,833.21 |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：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

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |                 |                   |
|----------------------------------------|---------------------------------------|-----------------|-------------------|
|                                        | 实收基金                                  | 未分配利润           | 所有者权益合计           |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 1,570,004,742.58                      | 694,956,286.27  | 2,264,961,028.85  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                     | -860,850.22     | -860,850.22       |
| 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）      | 210,207,580.36                        | 144,674,496.95  | 354,882,077.31    |
| 其中：1. 基金申购款                            | 1,329,921,526.00                      | 574,139,411.60  | 1,904,060,937.60  |
| 2. 基金赎回款                               | -1,119,713,945.64                     | -429,464,914.65 | -1,549,178,860.29 |
| 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） | -                                     | -386,678,398.56 | -386,678,398.56   |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 1,780,212,322.94                      | 452,091,534.44  | 2,232,303,857.38  |

| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |                 |                   |
|----------------------------------------|--------------------------------------------|-----------------|-------------------|
|                                        | 实收基金                                       | 未分配利润           | 所有者权益合计           |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 2,605,360,317.64                           | 499,809,983.41  | 3,105,170,301.05  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | 0.00                                       | 199,351,833.21  | 199,351,833.21    |
| 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）      | -15,433,853.08                             | -165,680,960.25 | -181,114,813.33   |
| 其中：1. 基金申购款                            | 2,020,725,441.59                           | 89,826,845.82   | 2,110,552,287.41  |
| 2. 基金赎回款                               | -2,036,159,294.67                          | -255,507,806.07 | -2,291,667,100.74 |
| 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） | 0.00                                       | -139,549,366.97 | -139,549,366.97   |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 2,589,926,464.56                           | 393,931,489.40  | 2,983,857,953.96  |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

|             |              |              |
|-------------|--------------|--------------|
| _____<br>韩勇 | _____<br>房伟力 | _____<br>赵景云 |
| 基金管理人负责人    | 主管会计工作负责人    | 会计机构负责人      |

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（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[2012]392 号《关于核准华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金及联接基金募集的批复》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《华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》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 366,989,094.83 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2012)第 171 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《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基金合同》于 2012 年 5 月 29 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 367,019,682.35 份基金份额，其中认购资金利息折合 30,587.52 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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于 2018 年 6 月 29 日发布的《关于华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金增加 C 类份额并修改基金合同的公告》，经与基金托管人协商一致并报中国证监会备案，自 2018 年 7 月 2 日起对本基金增加 C 类基金份额并相应修改法律文件。在投资者申购时收取申购费用而不计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资者申购时不收取申购费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码，分别计算基金份额净值并分别公告。投资者可自行选择申购的基金份额类别，但不同基金份额类别之间不得互相转换。

本基金为华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“目标 ETF”)的联接基金。目标 ETF 是采用完全复制法实现对沪深 300 指数紧密跟踪的全被动指数基金，本基金主要通过投资于目标 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪，力争使本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.3%，年跟踪误差不超过 4%。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《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基金合同》的有关规定，本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具，包括目标 ETF、沪深 300 指数成份股及备选成份股、非成份股、存托凭证、债券、新股(一级市场初次发行和增发)、权证、股指期货、货币市场工具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。正常情况下，本基金资产中投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%；现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；股指期货以套期保值为目的，权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数  $\times$  95% + 银行活期存款税后收益率  $\times$  5%。

本财务报表由本基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于 2021 年 8 月 28 日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本

准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期采用的会计政策和会计估计与上年度相一致。

### 6.4.5 会计差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错。

### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目             | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 106,362,994.34         |
| 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             | 106,362,994.34         |

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            |       | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |                  |                |
|---------------|-------|------------------------|------------------|----------------|
|               |       | 成本                     | 公允价值             | 公允价值变动         |
| 股票            |       | 75,375,867.23          | 73,710,268.06    | -1,665,599.17  |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       | —                      | —                | —              |
| 债券            | 交易所市场 | 9,022,700.00           | 9,016,712.70     | -5,987.30      |
|               | 银行间市场 | —                      | —                | —              |
|               | 合计    | 9,022,700.00           | 9,016,712.70     | -5,987.30      |
| 资产支持证券        |       | —                      | —                | —              |
| 基金            |       | 1,778,501,706.50       | 2,036,249,721.70 | 257,748,015.20 |
| 其他            |       | —                      | —                | —              |
| 合计            |       | 1,862,900,273.73       | 2,118,976,702.46 | 256,076,428.73 |

注：基金投资均为本基金持有的目标 ETF 的份额，按估值日目标 ETF 的份额净值确定公允价值。

本基金可采用股票组合申赎的方式或证券二级市场交易的方式进行目标 ETF 份额的买卖。

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：截至本报告期末，本基金未持有衍生金融资产/负债。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：截至本报告期末，本基金买入返售金融资产余额为 0。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：截至本报告期末，本基金未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |
|------------|------------------------|
| 应收活期存款利息   | 10,887.55              |
| 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  | 2,995.84               |
| 应收债券利息     | 182,668.63             |
| 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         | 171.00                 |
| 合计         | 196,723.02             |

#### 6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 69,133.15              |
| 银行间市场应付交易费用 | —                      |
| 合计          | 69,133.15              |

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | —                      |
| 应付赎回费       | 2,382.16               |

|           |            |
|-----------|------------|
| 应付证券出借违约金 | -          |
| 预提费用      | 109,095.94 |
| 合计        | 111,478.10 |

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 A |                                       |                 |
|--------------------|---------------------------------------|-----------------|
| 项目                 | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |                 |
|                    | 基金份额（份）                               | 账面金额            |
| 上年度末               | 349,653,736.56                        | 349,653,736.56  |
| 本期申购               | 202,254,344.08                        | 202,254,344.08  |
| 本期赎回(以“-”号填列)      | -186,228,219.65                       | -186,228,219.65 |
| - 基金拆分/份额折算前       | -                                     | -               |
| 基金拆分/份额折算变动份额      | -                                     | -               |
| 本期申购               | -                                     | -               |
| 本期赎回(以“-”号填列)      | -                                     | -               |
| 本期末                | 365,679,860.99                        | 365,679,860.99  |

金额单位：人民币元

| 华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 C |                                       |                  |
|--------------------|---------------------------------------|------------------|
| 项目                 | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |                  |
|                    | 基金份额（份）                               | 账面金额             |
| 上年度末               | 1,220,351,006.02                      | 1,220,351,006.02 |
| 本期申购               | 1,127,667,181.92                      | 1,127,667,181.92 |
| 本期赎回(以“-”号填列)      | -933,485,725.99                       | -933,485,725.99  |
| - 基金拆分/份额折算前       | -                                     | -                |
| 基金拆分/份额折算变动份额      | -                                     | -                |
| 本期申购               | -                                     | -                |
| 本期赎回(以“-”号填列)      | -                                     | -                |
| 本期末                | 1,414,532,461.95                      | 1,414,532,461.95 |

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 A |       |       |         |
|--------------------|-------|-------|---------|
| 项目                 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |

|                |                |                |                |
|----------------|----------------|----------------|----------------|
| 上年度末           | 174,374,301.40 | -17,241,387.15 | 157,132,914.25 |
| 本期利润           | 38,962,726.59  | -31,094,362.98 | 7,868,363.61   |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 4,520,788.43   | -7,556,544.53  | -3,035,756.10  |
| 其中：基金申购款       | 95,296,658.08  | -22,529,598.76 | 72,767,059.32  |
| 基金赎回款          | -90,775,869.65 | 14,973,054.23  | -75,802,815.42 |
| 本期已分配利润        | -66,072,948.91 | -              | -66,072,948.91 |
| 本期末            | 151,784,867.51 | -55,892,294.66 | 95,892,572.85  |

单位：人民币元

| 华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 C |                 |                 |                 |
|--------------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 项目                 | 已实现部分           | 未实现部分           | 未分配利润合计         |
| 上年度末               | 400,911,216.03  | 136,912,155.99  | 537,823,372.02  |
| 本期利润               | 163,673,215.48  | -172,402,429.31 | -8,729,213.83   |
| 本期基金份额交易产生的变动数     | 98,949,964.09   | 48,760,288.96   | 147,710,253.05  |
| 其中：基金申购款           | 380,654,090.77  | 120,718,261.51  | 501,372,352.28  |
| 基金赎回款              | -281,704,126.68 | -71,957,972.55  | -353,662,099.23 |
| 本期已分配利润            | -320,605,449.65 | -               | -320,605,449.65 |
| 本期末                | 342,928,945.95  | 13,270,015.64   | 356,198,961.59  |

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 249,931.82                            |
| 定期存款利息收入  | -                                     |
| 其他存款利息收入  | 3,212.77                              |
| 结算备付金利息收入 | 66,366.62                             |
| 其他        | 50.01                                 |
| 合计        | 319,561.22                            |

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目       | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|----------|---------------------------------------|
| 卖出股票成交总额 | 172,562,904.92                        |

|            |                |
|------------|----------------|
| 减：卖出股票成本总额 | 145,307,277.43 |
| 买卖股票差价收入   | 27,255,627.49  |

#### 6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|---------------|---------------------------------------|
| 卖出/赎回基金成交总额   | 915,625,247.30                        |
| 减：卖出/赎回基金成本总额 | 765,137,424.15                        |
| 基金投资收益        | 150,487,823.15                        |

#### 6.4.7.14 债券投资收益

##### 6.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                            | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|-------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | 13,473.67                  |
| 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                            | 13,473.67                  |

##### 6.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                      | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|-------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额   | 88,484.40                  |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 75,000.00                  |
| 减：应收利息总额                | 10.73                      |
| 买卖债券差价收入                | 13,473.67                  |

##### 6.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

#### 6.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

#### 6.4.7.14.5 资产支持证券投资收益

注：无。

#### 6.4.7.15 贵金属投资收益

##### 6.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

##### 6.4.7.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

##### 6.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

##### 6.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

#### 6.4.7.16 衍生工具收益

##### 6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

##### 6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

#### 6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|---------------|---------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 633,660.17                            |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | -                                     |
| 基金投资产生的股利收益   | 27,508,047.91                         |
| 合计            | 28,141,708.08                         |

### 6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                       | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|----------------------------|---------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产                 | -203,496,792.29                       |
| ——股票投资                     | -24,454,562.34                        |
| ——债券投资                     | -5,987.30                             |
| ——基金投资                     | -179,036,242.65                       |
| ——资产支持证券投资                 | -                                     |
| ——贵金属投资                    | -                                     |
| ——其他                       | -                                     |
| 2. 衍生工具                    | -                                     |
| ——权证投资                     | -                                     |
| 3. 其他                      | -                                     |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估<br>增值税 | -                                     |
| 合计                         | -203,496,792.29                       |

### 6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

| 项目           | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|--------------|---------------------------------------|
| 基金赎回费收入      | 172,895.52                            |
| 转换费收入 460300 | 1,528.61                              |
| 合计           | 174,424.13                            |

### 6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 541,392.83                            |
| 银行间市场交易费用 | -                                     |
| 交易基金产生的费用 | 82,755.06                             |
| 其中：申购费    | -                                     |
| 赎回费       | -                                     |
| 合计        | 624,147.89                            |

### 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 审计费用    | 49,588.57                             |
| 信息披露费   | 59,507.37                             |
| 证券出借违约金 | -                                     |
| 银行划款手续费 | 366.00                                |
| 合计      | 109,461.94                            |

### 6.4.7.22 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金无资产负债表日后事项。

### 6.4.9 关联方关系

#### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

无。

#### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称                 | 与本基金的关系              |
|-----------------------|----------------------|
| 华泰柏瑞基金管理有限公司          | 基金管理人、基金注册登记人、基金直销机构 |
| 中国工商银行股份有限公司          | 基金托管人、基金代销机构         |
| 华泰证券股份有限公司            | 基金管理人的股东、基金代销机构      |
| 华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券 | 本基金的基金管理人管理的其他基金     |

|                        |                    |
|------------------------|--------------------|
| 投资基金                   |                    |
| 华泰联合证券有限责任公司(“华泰联合证券”) | 基金管理人的股东华泰证券的控股子公司 |

注：1、关联方与基金进行的关联交易均在正常业务范围内按照一般商业条款而订立的。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本报告期和上年可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 6.4.10.1.2 基金交易

注：本报告期及上年可比期间本基金未通过关联方交易单元进行基金交易。

###### 6.4.10.1.3 权证交易

注：本报告期及上年可比期间本基金与关联方未进行权证交易。

###### 6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期和上年可比期间无应支付关联方的佣金。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
|-----------------|---------------------------------------|--------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 555,822.75                            | 710,547.70                                 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 493,170.15                            | 905,303.49                                 |

注：本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费，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扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分(若为负数，则取 0)的 0.5%年费率计提，计算方法如下： $H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$ 。  
H 为每日应支付的管理人报酬；E 为前一日基金资产净值 - 基金财产中目标 ETF 份额所对应的资产净值。基金管理人报酬每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前三个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
|----------------|---------------------------------------|--------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 111,164.55                            | 142,109.58                                 |

注：本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费，支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分（若为负数，则取 0）的 0.1% 年费率计提。计算方法如下： $H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$ 。H 为每日应支付的托管费；E 为前一日基金资产净值 - 基金财产中目标 ETF 份额所对应的资产净值。基金托管费每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前三个工作日内从基金资产中一次性支取。

### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日      |                    |              |
|----------------|--------------------------------------------|--------------------|--------------|
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                           |                    |              |
|                | 华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 A                         | 华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 C | 合计           |
| 华泰柏瑞基金管理有限公司   | 0.00                                       | 2,135,930.99       | 2,135,930.99 |
| 合计             | 0.00                                       | 2,135,930.99       | 2,135,930.99 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |                    |              |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                           |                    |              |
|                | 华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 A                         | 华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 C | 合计           |
| 华泰柏瑞基金管理有限公司   | 0.00                                       | 1,373,415.08       | 1,373,415.08 |
| 合计             | 0.00                                       | 1,373,415.08       | 1,373,415.08 |

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.25% 的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

C 类基金份额销售服务费每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前 5 个工作日内从基金资产中一次性支取。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本期及上年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。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：无。

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：无。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期内与上年度可比期间，基金管理人未投资本基金。

##### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本报告期及上年度可比期间内，除基金管理人之外的其它关联方未投资本基金。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期                              |            | 上年度可比期间                         |            |
|-------|---------------------------------|------------|---------------------------------|------------|
|       | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |            | 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |            |
|       | 期末余额                            | 当期利息收入     | 期末余额                            | 当期利息收入     |
| 工商银行  | 106,362,994.34                  | 249,931.82 | 91,145,585.20                   | 616,572.34 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

| 本期                              |      |      |      |           |
|---------------------------------|------|------|------|-----------|
| 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |      |      |      |           |
| 关联方名称                           | 证券代码 | 证券名称 | 发行方式 | 基金在承销期内买入 |

|                                            |        |      |      | 数量（单位：份）  | 总金额        |
|--------------------------------------------|--------|------|------|-----------|------------|
| 华泰联合证券                                     | 300952 | 恒辉安防 | 网下申购 | 3,398     | 39,824.56  |
| 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                                     | 688097 | 博众精工 | 网下申购 | 3,983     | 44,888.41  |
| 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                                     | 600905 | 三峡能源 | 网上申购 | 33,000    | 87,450.00  |
| 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                                     | 605499 | 东鹏饮料 | 网下申购 | 632       | 29,242.64  |
| 华泰联合证券                                     | 688161 | 威高骨科 | 网下申购 | 3,069     | 111,159.18 |
| 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |        |      |      |           |            |
| 关联方名称                                      | 证券代码   | 证券名称 | 发行方式 | 基金在承销期内买入 |            |
|                                            |        |      |      | 数量（单位：份）  | 总金额        |
| -                                          | -      | -    | -    | -         | -          |

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

注：于本报告期末，本基金持有 386,781,469 份目标 ETF 基金份额，占目标 ETF 基金总份额的比例为 4.21%。

#### 6.4.11 利润分配情况

华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 A

金额单位：人民币元

| 序号 | 权益<br>登记日             | 除息日             | 每 10 份<br>基金份额分<br>红数 | 现金形式<br>发放总额  | 再投资形式<br>发放总额 | 本期利润分配<br>合计  | 备注 |
|----|-----------------------|-----------------|-----------------------|---------------|---------------|---------------|----|
| 1  | 2021 年<br>6 月 28<br>日 | 2021 年 6 月 28 日 | 0.600                 | 13,914,406.05 | 7,546,127.53  | 21,460,533.58 |    |
| 2  | 2021 年<br>2 月 25<br>日 | 2021 年 2 月 25 日 | 0.730                 | 14,490,657.25 | 7,868,408.27  | 22,359,065.52 |    |

|    |                    |                 |       |               |               |               |  |
|----|--------------------|-----------------|-------|---------------|---------------|---------------|--|
| 3  | 2021 年<br>1 月 28 日 | 2021 年 1 月 28 日 | 0.750 | 15,300,860.90 | 6,952,488.91  | 22,253,349.81 |  |
| 合计 | -                  | -               | 2.080 | 43,705,924.20 | 22,367,024.71 | 66,072,948.91 |  |

## 华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 C

金额单位：人民币元

| 序号 | 权益<br>登记日          | 除息日             | 每 10 份<br>基金份额<br>分红数 | 现金形式<br>发放总额   | 再投资形式<br>发放总额  | 本期利润分配<br>合计   | 备注 |
|----|--------------------|-----------------|-----------------------|----------------|----------------|----------------|----|
| 1  | 2021 年<br>6 月 28 日 | 2021 年 6 月 28 日 | 0.600                 | 30,339,558.21  | 52,021,314.13  | 82,360,872.34  |    |
| 2  | 2021 年<br>2 月 25 日 | 2021 年 2 月 25 日 | 0.730                 | 51,856,004.36  | 68,140,543.01  | 119,996,547.37 |    |
| 3  | 2021 年<br>1 月 28 日 | 2021 年 1 月 28 日 | 0.750                 | 54,696,686.76  | 63,551,343.18  | 118,248,029.94 |    |
| 合计 | -                  | -               | 2.080                 | 136,892,249.33 | 183,713,200.32 | 320,605,449.65 |    |

## 6.4.12 期末（2021 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

## 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 |          |                       |                      |            |          |            |                  |            |            |    |
|----------------------|----------|-----------------------|----------------------|------------|----------|------------|------------------|------------|------------|----|
| 证券<br>代码             | 证券<br>名称 | 成功<br>认购日             | 可流<br>通日             | 流通受<br>限类型 | 认购<br>价格 | 期末估<br>值单价 | 数量<br>(单位：<br>股) | 期末<br>成本总额 | 期末估值总<br>额 | 备注 |
| 688239               | 航宇<br>科技 | 2021 年<br>6 月 25<br>日 | 2021<br>年 7 月<br>5 日 | 新股未<br>上市  | 11.48    | 11.48      | 4,926            | 56,550.48  | 56,550.48  | -  |
| 688087               | 英科<br>再生 | 2021 年<br>6 月 30      | 2021<br>年 7 月        | 新股未<br>上市  | 21.96    | 21.96      | 2,469            | 54,219.24  | 54,219.24  | -  |

|        |      |                 |                  |        |       |       |       |           |            |   |
|--------|------|-----------------|------------------|--------|-------|-------|-------|-----------|------------|---|
|        |      | 日               | 9 日              |        |       |       |       |           |            |   |
| 688226 | 威腾电气 | 2021 年 6 月 28 日 | 2021 年 7 月 7 日   | 新股未上市  | 6.42  | 6.42  | 2,693 | 17,289.06 | 17,289.06  | - |
| 605287 | 德才股份 | 2021 年 6 月 28 日 | 2021 年 7 月 6 日   | 新股未上市  | 31.56 | 31.56 | 349   | 11,014.44 | 11,014.44  | - |
| 605162 | 新中港  | 2021 年 6 月 29 日 | 2021 年 7 月 7 日   | 新股未上市  | 6.07  | 6.07  | 1,377 | 8,358.39  | 8,358.39   | - |
| 688630 | 芯碁微装 | 2021 年 3 月 25 日 | 2021 年 10 月 8 日  | 新股锁定期内 | 15.23 | 58.42 | 3,397 | 51,736.31 | 198,452.74 | - |
| 688613 | 奥精医疗 | 2021 年 5 月 13 日 | 2021 年 11 月 22 日 | 新股锁定期内 | 16.43 | 63.50 | 2,617 | 42,997.31 | 166,179.50 | - |
| 688575 | 亚辉龙  | 2021 年 5 月 10 日 | 2021 年 11 月 17 日 | 新股锁定期内 | 14.80 | 32.09 | 3,435 | 50,838.00 | 110,229.15 | - |
| 688565 | 力源科技 | 2021 年 5 月 6 日  | 2021 年 11 月 15 日 | 新股锁定期内 | 9.39  | 14.00 | 2,464 | 23,136.96 | 34,496.00  | - |
| 688517 | 金冠电气 | 2021 年 6 月 10 日 | 2021 年 12 月 20 日 | 新股锁定期内 | 7.71  | 11.88 | 2,892 | 22,297.32 | 34,356.96  | - |
| 300956 | 英力股份 | 2021 年 3 月 16 日 | 2021 年 9 月 27 日  | 新股锁定期内 | 12.85 | 25.80 | 371   | 4,767.35  | 9,571.80   | - |
| 300952 | 恒辉安防 | 2021 年 3 月 3 日  | 2021 年 9 月 13 日  | 新股锁定期内 | 11.72 | 27.08 | 340   | 3,984.80  | 9,207.20   | - |
| 300950 | 德固特  | 2021 年 2 月 24 日 | 2021 年 9 月 3 日   | 新股锁定期内 | 8.41  | 39.13 | 219   | 1,841.79  | 8,569.47   | - |

| 6.4.12.1.2 受限证券类别：债券 |      |                 |                 |        |        |        |              |        |        |    |
|----------------------|------|-----------------|-----------------|--------|--------|--------|--------------|--------|--------|----|
| 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<br>(单位：张) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 113049               | 长汽转债 | 2021 年 6 月 10 日 | 2021 年 7 月 8 日  | 新债未上市  | 100.00 | 100.00 | 30           | 3000   | 3000   | -  |
| 123117               | 健帆转债 | 2021 年 6 月 23 日 | 2021 年 7 月 12 日 | 新债未上市  | 100.00 | 100.00 | 12           | 1200   | 1200   | -  |
| 127038               | 国微转债 | 2021 年 6 月 10 日 | 2021 年 7 月 14 日 | 新债未上市  | 100.00 | 100.00 | 64           | 6400   | 6400   | -  |

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，锁定期限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。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

| 股票代码   | 股票名称 | 停牌日期       | 停牌原因 | 期末估值单价 | 复牌日期       | 复牌开盘单价 | 数量（股） | 期末成本总额    | 期末估值总额    | 备注 |
|--------|------|------------|------|--------|------------|--------|-------|-----------|-----------|----|
| 002024 | 苏宁易购 | 2021 年 6 月 | 临时停牌 | 5.59   | 2021 年 7 月 | 6.15   | 4,500 | 31,898.54 | 25,155.00 | -  |

|  |  |           |  |  |          |  |  |  |  |  |
|--|--|-----------|--|--|----------|--|--|--|--|--|
|  |  | 月 16<br>日 |  |  | 月 6<br>日 |  |  |  |  |  |
|--|--|-----------|--|--|----------|--|--|--|--|--|

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：无。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：无。

### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为目标 ETF 的联接基金，采用主要投资于目标 ETF 基金实现对业绩比较基准的紧密跟踪。因此，本基金的业绩表现与沪深 300 指数的表现密切相关。本基金的风险与收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金投资的金融工具主要包括基金投资、股票投资及债券投资。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以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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

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

#### 6.4.13.2 信用风险

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

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

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| A-1    | 0.00                   | 0.00                     |
| A-1 以下 | 0.00                   | 0.00                     |
| 未评级    | 9,003,100.00           | 0.00                     |
| 合计     | 9,003,100.00           | 0.00                     |

注：未评级的债券包括国债。债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| AAA    | 3,000.00               | 13,000.00                |
| AAA 以下 | 10,612.70              | 2,000.00                 |
| 未评级    | 0.00                   | 0.00                     |
| 合计     | 13,612.70              | 15,000.00                |

注：债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人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。

于 2021 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，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。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

#### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》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公司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票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 0.03%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2021 年 6 月<br>30 日 | 1 个月以内         | 1-3 个<br>月 | 3 个月-1 年     | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息               | 合计               |
|---------------------------|----------------|------------|--------------|-------|-------|-------------------|------------------|
| 资产                        |                |            |              |       |       |                   |                  |
| 银行存款                      | 106,362,994.34 | -          | -            | -     | -     | -                 | 106,362,994.34   |
| 结算备付金                     | 7,147,937.97   | -          | -            | -     | -     | -                 | 7,147,937.97     |
| 存出保证金                     | 379,917.56     | -          | -            | -     | -     | -                 | 379,917.56       |
| 交易性金融资产                   | 8,000,000.00   | -          | 1,016,712.70 | -     | -     | -2,109,959,989.76 | 2,118,976,702.46 |
| 应收证券清算款                   | -              | -          | -            | -     | -     | 372,584.97        | 372,584.97       |
| 应收利息                      | -              | -          | -            | -     | -     | 196,723.02        | 196,723.02       |
| 应收申购款                     | -              | -          | -            | -     | -     | 2,582,713.63      | 2,582,713.63     |
| 资产总计                      | 121,890,849.87 | -          | 1,016,712.70 | -     | -     | -2,113,112,011.38 | 2,236,019,573.95 |

|                          |                |        |               |       |           |                   |                  |
|--------------------------|----------------|--------|---------------|-------|-----------|-------------------|------------------|
| 负债                       |                |        |               |       |           |                   |                  |
| 应付赎回款                    |                | -      | -             | -     | -         | 3,051,240.04      | 3,051,240.04     |
| 应付管理人报酬                  |                | -      | -             | -     | -         | 85,142.58         | 85,142.58        |
| 应付托管费                    |                | -      | -             | -     | -         | 17,028.53         | 17,028.53        |
| 应付销售服务费                  |                | -      | -             | -     | -         | 381,694.17        | 381,694.17       |
| 应付交易费用                   |                | -      | -             | -     | -         | 69,133.15         | 69,133.15        |
| 其他负债                     |                | -      | -             | -     | -         | 111,478.10        | 111,478.10       |
| 负债总计                     |                | -      | -             | -     | -         | 3,715,716.57      | 3,715,716.57     |
| 利率敏感度缺口                  | 121,890,849.87 |        | -1,016,712.70 |       |           | -2,109,396,294.81 | 2,232,303,857.38 |
| 上年度末<br>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                     | 141,503,654.11 | -      | -             | -     | -         | -                 | 141,503,654.11   |
| 结算备付金                    | 6,487,900.76   | -      | -             | -     | -         | -                 | 6,487,900.76     |
| 存出保证金                    | 462,654.44     | -      | -             | -     | -         | -                 | 462,654.44       |
| 交易性金融资产                  |                | -      | -             | -     | 15,000.00 | 2,121,514,718.21  | 2,121,529,718.21 |
| 应收证券清算款                  |                | -      | -             | -     | -         | 28,127.66         | 28,127.66        |
| 应收利息                     |                | -      | -             | -     | -         | 22,202.43         | 22,202.43        |
| 应收申购款                    |                | -      | -             | -     | -         | 974,641.44        | 974,641.44       |
| 资产总计                     | 148,454,209.31 | -      | -             | -     | 15,000.00 | 2,122,539,689.74  | 2,271,008,899.05 |
| 负债                       |                |        |               |       |           |                   |                  |
| 应付赎回款                    |                | -      | -             | -     | -         | 5,323,475.28      | 5,323,475.28     |
| 应付管理人报酬                  |                | -      | -             | -     | -         | 78,766.25         | 78,766.25        |
| 应付托管费                    |                | -      | -             | -     | -         | 15,753.27         | 15,753.27        |
| 应付销售服务费                  |                | -      | -             | -     | -         | 297,596.26        | 297,596.26       |
| 应付交易费用                   |                | -      | -             | -     | -         | 90,904.94         | 90,904.94        |
| 应交税费                     |                | -      | -             | -     | -         | 16,815.01         | 16,815.01        |

|         |                |   |   |   |           |                  |                  |
|---------|----------------|---|---|---|-----------|------------------|------------------|
| 其他负债    | -              | - | - | - | -         | 224,559.19       | 224,559.19       |
| 负债总计    | -              | - | - | - | -         | 6,047,870.20     | 6,047,870.20     |
| 利率敏感度缺口 | 148,454,209.31 | - | - | - | 15,000.00 | 2,116,491,819.54 | 2,264,961,028.85 |

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。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.40% (2020 年 12 月 31 日：0.0007%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2020 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于目标 ETF，所面临的其他价格风险主要来源于沪深 300 指数波动的影响。

本基金通过把全部或接近全部的基金资产投资于目标 ETF、标的指数成份股和备选成份股进行被动式指数化投资，正常情况下投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%；本基金投资于目标 ETF 的方式以二级市场交易买卖为主。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金资产中投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%。每个交易日日终，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。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |                          | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |                       |
|---------------|------------------------|--------------------------|--------------------------|-----------------------|
|               | 公允价值                   | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) | 公允价值                     | 占基金资<br>产净值比<br>例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资  | 73,710,268.06          | 3.30                     | 64,606,995.20            | 2.85                  |
| 交易性金融资产—基金投资  | 2,036,249,721.70       | 91.22                    | 2,056,907,723.01         | 90.81                 |
| 交易性金融资产—债券投资  | —                      | —                        | —                        | —                     |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | —                      | —                        | —                        | —                     |
| 衍生金融资产—权证投资   | —                      | —                        | —                        | —                     |
| 其他            | —                      | —                        | —                        | —                     |
| 合计            | 2,109,959,989.76       | 94.52                    | 2,121,514,718.21         | 93.66                 |

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变 |                                 |                           |
|----|-------------------------|---------------------------------|---------------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动               | 对资产负债表日基金资产净值的<br>影响金额（单位：人民币元） |                           |
|    |                         | 本期末（2021 年 6 月<br>30 日）         | 上年度末（2020 年 12 月<br>31 日） |
|    | 沪深 300 指数上升 5%          | 104,962,880.68                  | 105,425,960.67            |
|    | 沪深 300 指数下降 5%          | -104,962,880.68                 | -105,425,960.67           |

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额               | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|------------------|---------------|
| 1  | 权益投资              | 73,710,268.06    | 3.30          |
|    | 其中：股票             | 73,710,268.06    | 3.30          |
| 2  | 基金投资              | 2,036,249,721.70 | 91.07         |
| 3  | 固定收益投资            | 9,016,712.70     | 0.40          |
|    | 其中：债券             | 9,016,712.70     | 0.40          |
|    | 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      | 113,510,932.31   | 5.08          |
| 8  | 其他各项资产            | 3,531,939.18     | 0.16          |
| 9  | 合计                | 2,236,019,573.95 | 100.00        |

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|---------------|---------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | 531,261.52    | 0.02          |
| B  | 采矿业              | 2,364,930.72  | 0.11          |
| C  | 制造业              | 36,566,172.54 | 1.64          |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 1,634,240.39  | 0.07          |
| E  | 建筑业              | 1,538,977.44  | 0.07          |
| F  | 批发和零售业           | 639,829.60    | 0.03          |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 1,929,667.48  | 0.09          |
| H  | 住宿和餐饮业           | —             | —             |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 2,234,074.06  | 0.10          |
| J  | 金融业              | 20,474,747.63 | 0.92          |
| K  | 房地产业             | 1,455,802.36  | 0.07          |
| L  | 租赁和商务服务业         | 1,288,015.00  | 0.06          |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 1,127,448.00  | 0.05          |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 34,496.00     | 0.00          |

|   |               |               |      |
|---|---------------|---------------|------|
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | -             | -    |
| P | 教育            | 20,890.00     | 0.00 |
| Q | 卫生和社会工作       | 1,627,033.52  | 0.07 |
| R | 文化、体育和娱乐业     | 242,681.80    | 0.01 |
| S | 综合            | -             | -    |
|   | 合计            | 73,710,268.06 | 3.30 |

## 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股）   | 公允价值         | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------|--------------|--------------|
| 1  | 600519 | 贵州茅台 | 2,508   | 5,158,203.60 | 0.23         |
| 2  | 601318 | 中国平安 | 50,000  | 3,214,000.00 | 0.14         |
| 3  | 600036 | 招商银行 | 58,997  | 3,197,047.43 | 0.14         |
| 4  | 600276 | 恒瑞医药 | 28,196  | 1,916,482.12 | 0.09         |
| 5  | 601166 | 兴业银行 | 75,200  | 1,545,360.00 | 0.07         |
| 6  | 601012 | 隆基股份 | 17,268  | 1,534,089.12 | 0.07         |
| 7  | 600887 | 伊利股份 | 35,200  | 1,296,416.00 | 0.06         |
| 8  | 600436 | 片仔癀  | 2,800   | 1,255,240.00 | 0.06         |
| 9  | 600309 | 万华化学 | 10,800  | 1,175,256.00 | 0.05         |
| 10 | 601888 | 中国中免 | 3,900   | 1,170,390.00 | 0.05         |
| 11 | 600030 | 中信证券 | 46,800  | 1,167,192.00 | 0.05         |
| 12 | 603259 | 药明康德 | 7,200   | 1,127,448.00 | 0.05         |
| 13 | 600809 | 山西汾酒 | 2,400   | 1,075,200.00 | 0.05         |
| 14 | 600763 | 通策医疗 | 2,500   | 1,027,500.00 | 0.05         |
| 15 | 600031 | 三一重工 | 34,500  | 1,002,915.00 | 0.04         |
| 16 | 600900 | 长江电力 | 47,300  | 976,272.00   | 0.04         |
| 17 | 603288 | 海天味业 | 6,110   | 787,884.50   | 0.04         |
| 18 | 000858 | 五粮液  | 2,500   | 744,725.00   | 0.03         |
| 19 | 601899 | 紫金矿业 | 75,900  | 735,471.00   | 0.03         |
| 20 | 601328 | 交通银行 | 145,200 | 711,480.00   | 0.03         |
| 21 | 601919 | 中远海控 | 22,200  | 677,988.00   | 0.03         |
| 22 | 603501 | 韦尔股份 | 2,100   | 676,200.00   | 0.03         |
| 23 | 603986 | 兆易创新 | 3,528   | 662,911.20   | 0.03         |
| 24 | 300059 | 东方财富 | 20,040  | 657,111.60   | 0.03         |

|    |        |      |         |            |      |
|----|--------|------|---------|------------|------|
| 25 | 600585 | 海螺水泥 | 15,900  | 652,695.00 | 0.03 |
| 26 | 600196 | 复星医药 | 8,700   | 627,531.00 | 0.03 |
| 27 | 600690 | 海尔智家 | 23,100  | 598,521.00 | 0.03 |
| 28 | 600000 | 浦发银行 | 59,200  | 592,000.00 | 0.03 |
| 29 | 600837 | 海通证券 | 48,600  | 558,900.00 | 0.03 |
| 30 | 601668 | 中国建筑 | 110,000 | 511,500.00 | 0.02 |
| 31 | 601601 | 中国太保 | 17,200  | 498,284.00 | 0.02 |
| 32 | 600570 | 恒生电子 | 5,280   | 492,360.00 | 0.02 |
| 33 | 601211 | 国泰君安 | 28,575  | 489,775.50 | 0.02 |
| 34 | 600048 | 保利地产 | 40,300  | 485,212.00 | 0.02 |
| 35 | 600999 | 招商证券 | 24,200  | 460,284.00 | 0.02 |
| 36 | 601288 | 农业银行 | 151,700 | 459,651.00 | 0.02 |
| 37 | 600703 | 三安光电 | 13,500  | 432,675.00 | 0.02 |
| 38 | 000333 | 美的集团 | 6,000   | 428,220.00 | 0.02 |
| 39 | 601229 | 上海银行 | 51,620  | 423,284.00 | 0.02 |
| 40 | 603799 | 华友钴业 | 3,700   | 422,540.00 | 0.02 |
| 41 | 600406 | 国电南瑞 | 17,640  | 409,953.60 | 0.02 |
| 42 | 600893 | 航发动力 | 7,671   | 408,020.49 | 0.02 |
| 43 | 601088 | 中国神华 | 20,400  | 398,208.00 | 0.02 |
| 44 | 601009 | 南京银行 | 37,100  | 390,292.00 | 0.02 |
| 45 | 600104 | 上汽集团 | 17,306  | 380,212.82 | 0.02 |
| 46 | 601766 | 中国中车 | 62,300  | 378,784.00 | 0.02 |
| 47 | 601169 | 北京银行 | 76,900  | 374,503.00 | 0.02 |
| 48 | 300015 | 爱尔眼科 | 5,274   | 374,348.52 | 0.02 |
| 49 | 300122 | 智飞生物 | 2,000   | 373,460.00 | 0.02 |
| 50 | 002714 | 牧原股份 | 6,136   | 373,191.52 | 0.02 |
| 51 | 600660 | 福耀玻璃 | 6,400   | 357,440.00 | 0.02 |
| 52 | 601628 | 中国人寿 | 10,200  | 345,678.00 | 0.02 |
| 53 | 601988 | 中国银行 | 110,000 | 338,800.00 | 0.02 |
| 54 | 600588 | 用友网络 | 10,060  | 334,595.60 | 0.01 |
| 55 | 600346 | 恒力石化 | 12,300  | 322,752.00 | 0.01 |
| 56 | 601390 | 中国中铁 | 61,200  | 320,688.00 | 0.01 |
| 57 | 600028 | 中国石化 | 72,400  | 315,664.00 | 0.01 |
| 58 | 000651 | 格力电器 | 6,000   | 312,600.00 | 0.01 |
| 59 | 300014 | 亿纬锂能 | 3,000   | 311,790.00 | 0.01 |
| 60 | 601818 | 光大银行 | 81,700  | 308,826.00 | 0.01 |
| 61 | 300124 | 汇川技术 | 4,050   | 300,753.00 | 0.01 |
| 62 | 600438 | 通威股份 | 6,900   | 298,563.00 | 0.01 |
| 63 | 601377 | 兴业证券 | 30,500  | 294,630.00 | 0.01 |

|     |        |       |         |            |      |
|-----|--------|-------|---------|------------|------|
| 64  | 002415 | 海康威视  | 4,500   | 290,250.00 | 0.01 |
| 65  | 600009 | 上海机场  | 5,900   | 283,967.00 | 0.01 |
| 66  | 600016 | 民生银行  | 63,700  | 280,917.00 | 0.01 |
| 67  | 603369 | 今世缘   | 5,000   | 270,800.00 | 0.01 |
| 68  | 600019 | 宝钢股份  | 34,900  | 266,636.00 | 0.01 |
| 69  | 600958 | 东方证券  | 26,500  | 264,735.00 | 0.01 |
| 70  | 600352 | 浙江龙盛  | 19,000  | 261,060.00 | 0.01 |
| 71  | 000001 | 平安银行  | 11,500  | 260,130.00 | 0.01 |
| 72  | 600745 | 闻泰科技  | 2,600   | 251,940.00 | 0.01 |
| 73  | 002594 | 比亚迪   | 1,000   | 251,000.00 | 0.01 |
| 74  | 601877 | 正泰电器  | 7,500   | 250,350.00 | 0.01 |
| 75  | 300142 | 沃森生物  | 4,000   | 246,800.00 | 0.01 |
| 76  | 000568 | 泸州老窖  | 1,000   | 235,940.00 | 0.01 |
| 77  | 601336 | 新华保险  | 5,100   | 234,141.00 | 0.01 |
| 78  | 002812 | 恩捷股份  | 1,000   | 234,100.00 | 0.01 |
| 79  | 002475 | 立讯精密  | 5,022   | 231,012.00 | 0.01 |
| 80  | 603993 | 洛阳钼业  | 43,300  | 223,428.00 | 0.01 |
| 81  | 600600 | 青岛啤酒  | 1,900   | 219,735.00 | 0.01 |
| 82  | 600547 | 山东黄金  | 11,276  | 216,724.72 | 0.01 |
| 83  | 601600 | 中国铝业  | 40,000  | 212,000.00 | 0.01 |
| 84  | 600050 | 中国联通  | 49,000  | 211,680.00 | 0.01 |
| 85  | 603899 | 晨光文具  | 2,500   | 211,400.00 | 0.01 |
| 86  | 601989 | 中国重工  | 50,600  | 208,472.00 | 0.01 |
| 87  | 002304 | 洋河股份  | 1,000   | 207,200.00 | 0.01 |
| 88  | 600015 | 华夏银行  | 32,800  | 203,032.00 | 0.01 |
| 89  | 000725 | 京东方 A | 32,500  | 202,800.00 | 0.01 |
| 90  | 600760 | 中航沈飞  | 3,360   | 202,608.00 | 0.01 |
| 91  | 600183 | 生益科技  | 8,500   | 198,985.00 | 0.01 |
| 92  | 688630 | 芯碁微装  | 3,397   | 198,452.74 | 0.01 |
| 93  | 600111 | 北方稀土  | 9,400   | 194,580.00 | 0.01 |
| 94  | 603160 | 汇顶科技  | 1,500   | 194,445.00 | 0.01 |
| 95  | 000661 | 长春高新  | 500     | 193,500.00 | 0.01 |
| 96  | 300347 | 泰格医药  | 1,000   | 193,300.00 | 0.01 |
| 97  | 600010 | 宝钢股份  | 123,800 | 191,890.00 | 0.01 |
| 98  | 601633 | 长城汽车  | 4,400   | 191,796.00 | 0.01 |
| 99  | 601788 | 光大证券  | 10,700  | 191,423.00 | 0.01 |
| 100 | 000002 | 万科 A  | 8,000   | 190,480.00 | 0.01 |
| 101 | 601857 | 中国石油  | 35,600  | 188,324.00 | 0.01 |
| 102 | 601155 | 新城控股  | 4,500   | 187,200.00 | 0.01 |

|     |        |        |        |            |      |
|-----|--------|--------|--------|------------|------|
| 103 | 600109 | 国金证券   | 14,500 | 184,005.00 | 0.01 |
| 104 | 600176 | 中国巨石   | 11,716 | 181,715.16 | 0.01 |
| 105 | 601100 | 恒立液压   | 2,100  | 180,432.00 | 0.01 |
| 106 | 688609 | 九联科技   | 10,372 | 179,228.16 | 0.01 |
| 107 | 601985 | 中国核电   | 35,000 | 177,100.00 | 0.01 |
| 108 | 600584 | 长电科技   | 4,600  | 173,328.00 | 0.01 |
| 109 | 601138 | 工业富联   | 13,500 | 167,535.00 | 0.01 |
| 110 | 688613 | 奥精医疗   | 2,617  | 166,179.50 | 0.01 |
| 111 | 600741 | 华域汽车   | 6,200  | 162,874.00 | 0.01 |
| 112 | 601607 | 上海医药   | 7,700  | 162,701.00 | 0.01 |
| 113 | 600522 | 中天科技   | 16,200 | 162,000.00 | 0.01 |
| 114 | 300498 | 温氏股份   | 11,000 | 158,070.00 | 0.01 |
| 115 | 601066 | 中信建投   | 5,000  | 157,150.00 | 0.01 |
| 116 | 601669 | 中国电建   | 39,600 | 153,252.00 | 0.01 |
| 117 | 600383 | 金地集团   | 14,700 | 150,528.00 | 0.01 |
| 118 | 300601 | 康泰生物   | 1,000  | 149,000.00 | 0.01 |
| 119 | 601555 | 东吴证券   | 17,820 | 148,618.80 | 0.01 |
| 120 | 300413 | 芒果超媒   | 2,083  | 142,893.80 | 0.01 |
| 121 | 688323 | 瑞华泰    | 4,513  | 142,565.67 | 0.01 |
| 122 | 603019 | 中科曙光   | 5,080  | 140,258.80 | 0.01 |
| 123 | 002371 | 北方华创   | 500    | 138,690.00 | 0.01 |
| 124 | 601108 | 财通证券   | 13,200 | 138,468.00 | 0.01 |
| 125 | 002142 | 宁波银行   | 3,500  | 136,395.00 | 0.01 |
| 126 | 601225 | 陕西煤业   | 11,500 | 136,275.00 | 0.01 |
| 127 | 002352 | 顺丰控股   | 2,000  | 135,400.00 | 0.01 |
| 128 | 002230 | 科大讯飞   | 2,000  | 135,160.00 | 0.01 |
| 129 | 600606 | 绿地控股   | 24,700 | 134,615.00 | 0.01 |
| 130 | 600705 | 中航资本   | 34,400 | 133,128.00 | 0.01 |
| 131 | 601360 | 三六零    | 10,900 | 133,089.00 | 0.01 |
| 132 | 600845 | 宝信软件   | 2,600  | 132,340.00 | 0.01 |
| 133 | 601006 | 大秦铁路   | 19,800 | 130,284.00 | 0.01 |
| 134 | 000100 | TCL 科技 | 17,000 | 130,050.00 | 0.01 |
| 135 | 600655 | 豫园股份   | 11,200 | 129,808.00 | 0.01 |
| 136 | 601618 | 中国中冶   | 43,300 | 129,034.00 | 0.01 |
| 137 | 002241 | 歌尔股份   | 3,000  | 128,220.00 | 0.01 |
| 138 | 300408 | 三环集团   | 3,000  | 127,260.00 | 0.01 |
| 139 | 600362 | 江西铜业   | 5,600  | 125,328.00 | 0.01 |
| 140 | 002841 | 视源股份   | 1,000  | 124,290.00 | 0.01 |
| 141 | 600068 | 葛洲坝    | 16,400 | 122,836.00 | 0.01 |

|     |        |      |        |            |      |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 142 | 600061 | 国投资本 | 14,440 | 122,595.60 | 0.01 |
| 143 | 601939 | 建设银行 | 18,400 | 122,360.00 | 0.01 |
| 144 | 601901 | 方正证券 | 13,000 | 121,680.00 | 0.01 |
| 145 | 002460 | 赣锋锂业 | 1,000  | 121,090.00 | 0.01 |
| 146 | 600489 | 中金黄金 | 14,000 | 120,680.00 | 0.01 |
| 147 | 600926 | 杭州银行 | 8,000  | 118,000.00 | 0.01 |
| 148 | 300433 | 蓝思科技 | 4,000  | 117,640.00 | 0.01 |
| 149 | 002027 | 分众传媒 | 12,500 | 117,625.00 | 0.01 |
| 150 | 002271 | 东方雨虹 | 2,050  | 113,406.00 | 0.01 |
| 151 | 300033 | 同花顺  | 1,000  | 112,780.00 | 0.01 |
| 152 | 600177 | 雅戈尔  | 17,100 | 112,689.00 | 0.01 |
| 153 | 601878 | 浙商证券 | 8,600  | 112,488.00 | 0.01 |
| 154 | 600795 | 国电电力 | 46,200 | 112,266.00 | 0.01 |
| 155 | 601117 | 中国化学 | 12,600 | 110,376.00 | 0.00 |
| 156 | 688575 | 亚辉龙  | 3,435  | 110,229.15 | 0.00 |
| 157 | 601816 | 京沪高铁 | 20,800 | 110,032.00 | 0.00 |
| 158 | 601990 | 南京证券 | 10,400 | 109,408.00 | 0.00 |
| 159 | 600011 | 华能国际 | 25,900 | 109,298.00 | 0.00 |
| 160 | 601933 | 永辉超市 | 22,900 | 108,317.00 | 0.00 |
| 161 | 600498 | 烽火通信 | 5,800  | 108,054.00 | 0.00 |
| 162 | 600369 | 西南证券 | 21,200 | 103,244.00 | 0.00 |
| 163 | 600271 | 航天信息 | 7,800  | 101,634.00 | 0.00 |
| 164 | 600487 | 亨通光电 | 8,800  | 100,320.00 | 0.00 |
| 165 | 000063 | 中兴通讯 | 3,000  | 99,690.00  | 0.00 |
| 166 | 000338 | 潍柴动力 | 5,500  | 98,285.00  | 0.00 |
| 167 | 601186 | 中国铁建 | 13,100 | 97,333.00  | 0.00 |
| 168 | 300003 | 乐普医疗 | 3,000  | 96,360.00  | 0.00 |
| 169 | 600637 | 东方明珠 | 11,700 | 95,823.00  | 0.00 |
| 170 | 300952 | 恒辉安防 | 3,398  | 95,320.48  | 0.00 |
| 171 | 600085 | 同仁堂  | 2,300  | 93,955.00  | 0.00 |
| 172 | 600872 | 中炬高新 | 2,200  | 92,444.00  | 0.00 |
| 173 | 601727 | 上海电气 | 21,100 | 89,464.00  | 0.00 |
| 174 | 300950 | 德固特  | 2,186  | 89,334.49  | 0.00 |
| 175 | 600161 | 天坛生物 | 2,600  | 89,050.00  | 0.00 |
| 176 | 601238 | 广汽集团 | 6,800  | 88,060.00  | 0.00 |
| 177 | 600208 | 新湖中宝 | 28,500 | 86,640.00  | 0.00 |
| 178 | 300529 | 健帆生物 | 1,000  | 86,360.00  | 0.00 |
| 179 | 600029 | 南方航空 | 14,200 | 85,484.00  | 0.00 |
| 180 | 600066 | 宇通客车 | 6,800  | 84,932.00  | 0.00 |

|     |        |      |        |           |      |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 181 | 600390 | 五矿资本 | 14,200 | 84,916.00 | 0.00 |
| 182 | 600332 | 白云山  | 2,500  | 84,625.00 | 0.00 |
| 183 | 601198 | 东兴证券 | 7,700  | 84,161.00 | 0.00 |
| 184 | 601231 | 环旭电子 | 5,000  | 84,050.00 | 0.00 |
| 185 | 300628 | 亿联网络 | 1,000  | 83,800.00 | 0.00 |
| 186 | 601162 | 天风证券 | 17,210 | 83,640.60 | 0.00 |
| 187 | 600886 | 国投电力 | 8,700  | 83,607.00 | 0.00 |
| 188 | 601881 | 中国银河 | 7,700  | 83,006.00 | 0.00 |
| 189 | 600998 | 九州通  | 5,400  | 82,998.00 | 0.00 |
| 190 | 601800 | 中国交建 | 12,800 | 82,944.00 | 0.00 |
| 191 | 600297 | 广汇汽车 | 28,500 | 82,080.00 | 0.00 |
| 192 | 002311 | 海大集团 | 1,000  | 81,600.00 | 0.00 |
| 193 | 600150 | 中国船舶 | 4,900  | 80,899.00 | 0.00 |
| 194 | 600115 | 中国东航 | 15,800 | 80,264.00 | 0.00 |
| 195 | 601021 | 春秋航空 | 1,400  | 79,660.00 | 0.00 |
| 196 | 601916 | 浙商银行 | 20,000 | 79,400.00 | 0.00 |
| 197 | 601111 | 中国国航 | 10,100 | 78,578.00 | 0.00 |
| 198 | 002129 | 中环股份 | 2,000  | 77,200.00 | 0.00 |
| 199 | 002049 | 紫光国微 | 500    | 77,095.00 | 0.00 |
| 200 | 002736 | 国信证券 | 7,000  | 75,250.00 | 0.00 |
| 201 | 688009 | 中国通号 | 13,200 | 75,108.00 | 0.00 |
| 202 | 600018 | 上港集团 | 15,700 | 74,889.00 | 0.00 |
| 203 | 003816 | 中国广核 | 28,000 | 74,760.00 | 0.00 |
| 204 | 002624 | 完美世界 | 3,050  | 72,925.50 | 0.00 |
| 205 | 601838 | 成都银行 | 5,700  | 72,048.00 | 0.00 |
| 206 | 002938 | 鹏鼎控股 | 2,000  | 71,760.00 | 0.00 |
| 207 | 601236 | 红塔证券 | 5,200  | 70,512.00 | 0.00 |
| 208 | 601872 | 招商轮船 | 15,240 | 70,408.80 | 0.00 |
| 209 | 600118 | 中国卫星 | 2,400  | 70,224.00 | 0.00 |
| 210 | 300144 | 宋城演艺 | 4,060  | 68,208.00 | 0.00 |
| 211 | 002410 | 广联达  | 1,000  | 68,200.00 | 0.00 |
| 212 | 603156 | 养元饮品 | 2,300  | 65,734.00 | 0.00 |
| 213 | 000625 | 长安汽车 | 2,500  | 65,700.00 | 0.00 |
| 214 | 601319 | 中国人保 | 10,900 | 64,637.00 | 0.00 |
| 215 | 600482 | 中国动力 | 3,600  | 62,712.00 | 0.00 |
| 216 | 300136 | 信维通信 | 2,000  | 61,760.00 | 0.00 |
| 217 | 600340 | 华夏幸福 | 11,664 | 61,119.36 | 0.00 |
| 218 | 002493 | 荣盛石化 | 3,500  | 60,445.00 | 0.00 |
| 219 | 600918 | 中泰证券 | 5,400  | 58,428.00 | 0.00 |

|     |        |       |        |           |      |
|-----|--------|-------|--------|-----------|------|
| 220 | 600233 | 圆通速递  | 5,800  | 58,058.00 | 0.00 |
| 221 | 002001 | 新 和 成 | 2,020  | 57,933.60 | 0.00 |
| 222 | 000538 | 云南白药  | 500    | 57,860.00 | 0.00 |
| 223 | 002007 | 华兰生物  | 1,560  | 57,220.80 | 0.00 |
| 224 | 688239 | 航宇科技  | 4,926  | 56,550.48 | 0.00 |
| 225 | 600027 | 华电国际  | 16,300 | 56,072.00 | 0.00 |
| 226 | 600848 | 上海临港  | 3,120  | 55,848.00 | 0.00 |
| 227 | 688087 | 英科再生  | 2,469  | 54,219.24 | 0.00 |
| 228 | 000776 | 广发证券  | 3,500  | 52,990.00 | 0.00 |
| 229 | 002601 | 龙鳞佰利  | 1,500  | 51,870.00 | 0.00 |
| 230 | 000166 | 申万宏源  | 11,000 | 51,480.00 | 0.00 |
| 231 | 601696 | 中银证券  | 2,500  | 51,475.00 | 0.00 |
| 232 | 002050 | 三花智控  | 2,098  | 50,310.04 | 0.00 |
| 233 | 000963 | 华东医药  | 1,060  | 48,770.60 | 0.00 |
| 234 | 601216 | 君正集团  | 9,200  | 46,828.00 | 0.00 |
| 235 | 000157 | 中联重科  | 5,000  | 46,200.00 | 0.00 |
| 236 | 601658 | 邮储银行  | 9,200  | 46,184.00 | 0.00 |
| 237 | 001979 | 招商蛇口  | 4,000  | 43,800.00 | 0.00 |
| 238 | 600004 | 白云机场  | 3,900  | 43,602.00 | 0.00 |
| 239 | 002202 | 金风科技  | 3,562  | 43,313.92 | 0.00 |
| 240 | 002236 | 大华股份  | 2,000  | 42,200.00 | 0.00 |
| 241 | 002179 | 中航光电  | 520    | 41,090.40 | 0.00 |
| 242 | 601698 | 中国卫通  | 2,500  | 40,475.00 | 0.00 |
| 243 | 002008 | 大族激光  | 1,000  | 40,390.00 | 0.00 |
| 244 | 000768 | 中航西飞  | 1,500  | 39,420.00 | 0.00 |
| 245 | 000786 | 北新建材  | 1,000  | 39,250.00 | 0.00 |
| 246 | 000069 | 华侨城 A | 5,000  | 37,200.00 | 0.00 |
| 247 | 000876 | 新 希 望 | 2,500  | 36,675.00 | 0.00 |
| 248 | 002555 | 三七互娱  | 1,500  | 36,030.00 | 0.00 |
| 249 | 600989 | 宝丰能源  | 2,600  | 35,568.00 | 0.00 |
| 250 | 000425 | 徐工机械  | 5,500  | 35,035.00 | 0.00 |
| 251 | 601528 | 瑞丰银行  | 2,230  | 34,721.10 | 0.00 |
| 252 | 600299 | 安迪苏   | 2,900  | 34,684.00 | 0.00 |
| 253 | 688565 | 力源科技  | 2,464  | 34,496.00 | 0.00 |
| 254 | 688517 | 金冠电气  | 2,892  | 34,356.96 | 0.00 |
| 255 | 601998 | 中信银行  | 6,600  | 33,660.00 | 0.00 |
| 256 | 000938 | 紫光股份  | 1,524  | 33,345.12 | 0.00 |
| 257 | 002673 | 西部证券  | 4,000  | 33,000.00 | 0.00 |
| 258 | 000783 | 长江证券  | 4,500  | 32,940.00 | 0.00 |

|     |        |      |       |           |      |
|-----|--------|------|-------|-----------|------|
| 259 | 002600 | 领益智造 | 3,500 | 32,165.00 | 0.00 |
| 260 | 002044 | 美年健康 | 3,500 | 31,885.00 | 0.00 |
| 261 | 600025 | 华能水电 | 5,500 | 31,845.00 | 0.00 |
| 262 | 000895 | 双汇发展 | 1,000 | 31,800.00 | 0.00 |
| 263 | 002739 | 万达电影 | 2,000 | 31,580.00 | 0.00 |
| 264 | 002384 | 东山精密 | 1,500 | 31,260.00 | 0.00 |
| 265 | 601808 | 中海油服 | 2,100 | 30,156.00 | 0.00 |
| 266 | 002602 | 世纪华通 | 4,588 | 29,454.96 | 0.00 |
| 267 | 000066 | 中国长城 | 2,000 | 29,200.00 | 0.00 |
| 268 | 002414 | 高德红外 | 1,040 | 28,683.20 | 0.00 |
| 269 | 000977 | 浪潮信息 | 1,000 | 28,130.00 | 0.00 |
| 270 | 002024 | 苏宁易购 | 4,500 | 25,155.00 | 0.00 |
| 271 | 688008 | 澜起科技 | 400   | 24,952.00 | 0.00 |
| 272 | 000703 | 恒逸石化 | 2,082 | 24,879.90 | 0.00 |
| 273 | 000728 | 国元证券 | 3,000 | 23,910.00 | 0.00 |
| 274 | 002157 | 正邦科技 | 2,000 | 23,900.00 | 0.00 |
| 275 | 002773 | 康弘药业 | 1,020 | 23,592.60 | 0.00 |
| 276 | 002508 | 老板电器 | 500   | 23,250.00 | 0.00 |
| 277 | 002463 | 沪电股份 | 1,500 | 23,205.00 | 0.00 |
| 278 | 000656 | 金科股份 | 4,000 | 23,160.00 | 0.00 |
| 279 | 002252 | 上海莱士 | 3,000 | 22,470.00 | 0.00 |
| 280 | 002939 | 长城证券 | 2,000 | 22,260.00 | 0.00 |
| 281 | 002456 | 欧菲光  | 2,500 | 22,200.00 | 0.00 |
| 282 | 000860 | 顺鑫农业 | 500   | 21,090.00 | 0.00 |
| 283 | 002120 | 韵达股份 | 1,556 | 21,052.68 | 0.00 |
| 284 | 002607 | 中公教育 | 1,000 | 20,890.00 | 0.00 |
| 285 | 000708 | 中信特钢 | 1,000 | 20,840.00 | 0.00 |
| 286 | 601577 | 长沙银行 | 2,300 | 20,562.00 | 0.00 |
| 287 | 601077 | 渝农商行 | 5,000 | 19,950.00 | 0.00 |
| 288 | 688226 | 威腾电气 | 2,693 | 17,289.06 | 0.00 |
| 289 | 002153 | 石基信息 | 700   | 16,457.00 | 0.00 |
| 290 | 002945 | 华林证券 | 1,000 | 13,820.00 | 0.00 |
| 291 | 001208 | 华菱线缆 | 1,754 | 13,558.42 | 0.00 |
| 292 | 002558 | 巨人网络 | 1,000 | 13,300.00 | 0.00 |
| 293 | 603171 | 税友股份 | 637   | 12,230.40 | 0.00 |
| 294 | 605287 | 德才股份 | 349   | 11,014.44 | 0.00 |
| 295 | 300956 | 英力股份 | 371   | 9,571.80  | 0.00 |
| 296 | 605162 | 新中港  | 1,377 | 8,358.39  | 0.00 |
| 297 | 605011 | 杭州热电 | 525   | 4,662.00  | 0.00 |

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计买入金额     | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|--------------|----------------|
| 1  | 601318 | 中国平安 | 7,582,312.00 | 0.33           |
| 2  | 600519 | 贵州茅台 | 7,189,483.40 | 0.32           |
| 3  | 000858 | 五粮液  | 6,990,079.00 | 0.31           |
| 4  | 600036 | 招商银行 | 4,992,662.00 | 0.22           |
| 5  | 000333 | 美的集团 | 4,848,589.00 | 0.21           |
| 6  | 600276 | 恒瑞医药 | 3,365,071.00 | 0.15           |
| 7  | 000651 | 格力电器 | 3,219,178.46 | 0.14           |
| 8  | 300059 | 东方财富 | 2,577,274.00 | 0.11           |
| 9  | 000568 | 泸州老窖 | 2,371,316.00 | 0.10           |
| 10 | 601166 | 兴业银行 | 2,330,098.00 | 0.10           |
| 11 | 600887 | 伊利股份 | 2,318,310.00 | 0.10           |
| 12 | 600030 | 中信证券 | 2,281,225.00 | 0.10           |
| 13 | 600031 | 三一重工 | 2,277,286.00 | 0.10           |
| 14 | 002415 | 海康威视 | 2,268,599.44 | 0.10           |
| 15 | 000001 | 平安银行 | 2,195,956.30 | 0.10           |
| 16 | 000002 | 万科A  | 2,002,770.00 | 0.09           |
| 17 | 601012 | 隆基股份 | 1,928,251.18 | 0.09           |
| 18 | 002714 | 牧原股份 | 1,852,393.50 | 0.08           |
| 19 | 002475 | 立讯精密 | 1,840,512.01 | 0.08           |
| 20 | 000725 | 京东方A | 1,803,652.00 | 0.08           |

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

### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计卖出金额      | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------------|----------------|
| 1  | 688981 | 中芯国际 | 28,529,123.85 | 1.26           |
| 2  | 000858 | 五粮液  | 7,086,653.00  | 0.31           |
| 3  | 601318 | 中国平安 | 5,142,706.96  | 0.23           |
| 4  | 000333 | 美的集团 | 4,774,050.00  | 0.21           |

|    |        |        |              |      |
|----|--------|--------|--------------|------|
| 5  | 600519 | 贵州茅台   | 3,561,611.38 | 0.16 |
| 6  | 000651 | 格力电器   | 3,295,448.00 | 0.15 |
| 7  | 600036 | 招商银行   | 3,256,176.00 | 0.14 |
| 8  | 000001 | 平安银行   | 2,520,713.00 | 0.11 |
| 9  | 000002 | 万科A    | 2,357,051.00 | 0.10 |
| 10 | 002415 | 海康威视   | 2,324,021.00 | 0.10 |
| 11 | 688180 | 君实生物   | 2,323,737.12 | 0.10 |
| 12 | 300059 | 东方财富   | 2,267,170.00 | 0.10 |
| 13 | 000568 | 泸州老窖   | 2,207,852.00 | 0.10 |
| 14 | 002714 | 牧原股份   | 1,956,276.60 | 0.09 |
| 15 | 000725 | 京东方A   | 1,861,351.00 | 0.08 |
| 16 | 688538 | 和辉光电   | 1,701,214.82 | 0.08 |
| 17 | 600276 | 恒瑞医药   | 1,696,578.00 | 0.07 |
| 18 | 002475 | 立讯精密   | 1,453,058.00 | 0.06 |
| 19 | 000100 | TCL 科技 | 1,438,550.00 | 0.06 |
| 20 | 600030 | 中信证券   | 1,388,455.00 | 0.06 |

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

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

|              |                |
|--------------|----------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 178,952,562.63 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 172,562,904.92 |

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值         | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|--------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 9,003,100.00 | 0.40         |
| 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） | 13,612.70    | 0.00         |
| 8  | 同业存单      | —            | —            |
| 9  | 其他        | —            | —            |

|    |    |              |      |
|----|----|--------------|------|
| 10 | 合计 | 9,016,712.70 | 0.40 |
|----|----|--------------|------|

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称     | 数量（张）  | 公允价值         | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|--------|--------------|--------------|
| 1  | 019640 | 20 国债 10 | 80,000 | 8,000,000.00 | 0.36         |
| 2  | 019645 | 20 国债 15 | 10,000 | 1,003,100.00 | 0.04         |
| 3  | 127038 | 国微转债     | 64     | 6,400.00     | 0.00         |
| 4  | 127036 | 三花转债     | 23     | 3,012.70     | 0.00         |
| 5  | 113049 | 长汽转债     | 30     | 3,000.00     | 0.00         |

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 基金名称                 | 基金类型 | 运作方式       | 管理人                  | 公允价值             | 占基金资产净值比例（%） |
|----|----------------------|------|------------|----------------------|------------------|--------------|
| 1  | 华泰柏瑞<br>沪深<br>300ETF | 指数型  | 交易型开<br>放式 | 华泰柏瑞<br>基金管理<br>有限公司 | 2,036,249,721.70 | 91.22        |

## 7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.11.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：无。

### 7.11.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：无。

### 7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.12.1 本期国债期货投资政策

注：无。

#### 7.12.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：无。

#### 7.12.3 本期国债期货投资评价

注：无。

### 7.13 投资组合报告附注

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

报告期内本基金及目标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，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

#### 7.13.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金及目标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。

#### 7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额           |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | 379,917.56   |
| 2  | 应收证券清算款 | 372,584.97   |
| 3  | 应收股利    | —            |
| 4  | 应收利息    | 196,723.02   |
| 5  | 应收申购款   | 2,582,713.63 |
| 6  | 其他应收款   | —            |
| 7  | 待摊费用    | —            |
| 8  | 其他      | —            |
| 9  | 合计      | 3,531,939.18 |

#### 7.13.4 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。

#### **7.13.5 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 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别               | 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 |
| 华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 A | 37,189    | 9,833.01   | 65,249,136.80    | 17.84% | 300,430,724.19 | 82.16% |
| 华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 C | 11,928    | 118,589.24 | 1,371,637,548.16 | 96.97% | 42,894,913.79  | 3.03%  |
| 合计                 | 48,522    | 36,688.77  | 1,436,886,684.96 | 80.71% | 343,325,637.98 | 19.29% |

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 份额级别               | 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 | 华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 A | 6,363.42  | 0.0017%  |
|                  | 华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 C | 873.55    | 0.0001%  |
|                  | 合计                 | 7,236.97  | 0.0004%  |

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目 | 份额级别 | 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 | 华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 A | 0 |
|                                | 华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 C | 0 |
|                                | 合计                 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 A | 0 |
|                                | 华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 C | 0 |
|                                | 合计                 | 0 |

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                             | 华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 A | 华泰柏瑞沪深 300ETF 联接 C |
|--------------------------------|--------------------|--------------------|
| 基金合同生效日（2012 年 5 月 29 日）基金份额总额 | 367,019,682.35     | —                  |
| 本报告期期初基金份额总额                   | 349,653,736.56     | 1,220,351,006.02   |
| 本报告期基金总申购份额                    | 202,254,344.08     | 1,127,667,181.92   |
| 减：本报告期基金总赎回份额                  | 186,228,219.65     | 933,485,725.99     |
| 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                   | 365,679,860.99     | 1,414,532,461.95   |

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

上述人事变动已按相关规定备案、公告。

中国工商银行股份有限公司（以下简称“本公司”）根据工作需要，任命刘彤女士担任本公司资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未改聘为其审计的会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易           |              | 应支付该券商的佣金  |            | 备注 |
|------|--------|----------------|--------------|------------|------------|----|
|      |        | 成交金额           | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金         | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 中金公司 | 2      | 346,380,721.87 | 100.00%      | 319,412.86 | 100.00%    | -  |
| 安信证券 | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 中投证券 | 2      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 方正证券 | 2      | -              | -            | -          | -          | -  |

|      |   |   |   |   |   |   |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 华泰证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 瑞银证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国盛证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 齐鲁证券 | 3 | - | - | - | - | - |
| 湘财证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 上海证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 爱建证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东兴证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | 2 | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | 4 | - | - | - | - | - |
| 山西证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华宝证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 长江证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 平安证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 申万宏源 | 2 | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 德邦证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国都证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | 2 | - | - | - | - | - |

注：1、选择代理证券买卖的证券经营机构的标准：公司应选择财务状况良好，经营行为规范，具备研究实力的证券公司及专业研究机构，向其或其合作券商租用基金专用交易席位。公司选择的提供交易单元的券商应当满足下列基本条件：1）具有相应的业务经营资格；2）诚信记录良好，最近两年无重大违法违规行为，未受监管机构重大处罚；3）资金雄厚，信誉良好。内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求；4）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服务；5）具备研究实力，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、股票分析的研究报告及周到的信息服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告。2、选择代理证券买卖的证券经营机构的程序 基金管理人根据以上标准进行考察后确定证券经营机构的选择。基金管理人与被选择的证券经营机构签订交易单元租用协

议和证券研究服务协议。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易         |              | 债券回购交易 |                | 权证交易 |              | 基金交易             |              |
|------|--------------|--------------|--------|----------------|------|--------------|------------------|--------------|
|      | 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 | 成交金额             | 占当期基金成交总额的比例 |
| 中金公司 | 9,206,642.50 | 100.00%      | -      | -              | -    | -            | 1,839,140,912.79 | 100.00%      |
| 安信证券 | -            | -            | -      | -              | -    | -            | -                | -            |
| 中投证券 | -            | -            | -      | -              | -    | -            | -                | -            |
| 方正证券 | -            | -            | -      | -              | -    | -            | -                | -            |
| 华泰证券 | -            | -            | -      | -              | -    | -            | -                | -            |
| 兴业证券 | -            | -            | -      | -              | -    | -            | -                | -            |
| 瑞银证券 | -            | -            | -      | -              | -    | -            | -                | -            |
| 海通证券 | -            | -            | -      | -              | -    | -            | -                | -            |
| 国泰君安 | -            | -            | -      | -              | -    | -            | -                | -            |
| 国盛证券 | -            | -            | -      | -              | -    | -            | -                | -            |
| 银河证券 | -            | -            | -      | -              | -    | -            | -                | -            |
| 齐鲁证券 | -            | -            | -      | -              | -    | -            | -                | -            |
| 湘财证券 | -            | -            | -      | -              | -    | -            | -                | -            |
| 上海证券 | -            | -            | -      | -              | -    | -            | -                | -            |
| 爱建证券 | -            | -            | -      | -              | -    | -            | -                | -            |
| 东兴证  | -            | -            | -      | -              | -    | -            | -                | -            |

|          |   |   |   |   |   |   |   |   |
|----------|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 券        |   |   |   |   |   |   |   |   |
| 东方证<br>券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中信建<br>投 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 广发证<br>券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 山西证<br>券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 华宝证<br>券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 长江证<br>券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 平安证<br>券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 申万宏<br>源 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 招商证<br>券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 德邦证<br>券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 国都证<br>券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中信证<br>券 | - | - | - | - | - | - | - | - |

## 10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项                                                   | 法定披露方式     | 法定披露日期          |
|----|--------------------------------------------------------|------------|-----------------|
| 1  | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于参加交通银行股份有限公司申购及定期定额投资一折费率优惠活动的公告         | 证监会规定报刊和网站 | 2021 年 6 月 30 日 |
| 2  | 华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金收益分配公告                    | 证监会规定报刊和网站 | 2021 年 6 月 25 日 |
| 3  | 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暂停大额申购（含转换转入、定期定额投资）业务的公告 | 证监会规定报刊和网站 | 2021 年 6 月 25 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 6 月 24 日 |

|    |                                                                |            |                 |
|----|----------------------------------------------------------------|------------|-----------------|
| 5  | 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 |
| 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 6 月 3 日  |
| 7  | 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  |
| 8  | 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 |
| 9  | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告                             | 证监会规定报刊和网站 | 2021 年 5 月 20 日 |
| 10 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告                             | 证监会规定报刊和网站 | 2021 年 5 月 14 日 |
| 11 | 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 |
| 12 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参加浙商银行股份有限公司费率优惠活动的公告                      | 证监会规定报刊和网站 | 2021 年 4 月 30 日 |
| 13 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止上海尚善基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告                       | 证监会规定报刊和网站 | 2021 年 4 月 27 日 |
| 14 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参与蚂蚁（杭州）基金销售有限公司费率优惠活动的公告                  | 证监会规定报刊和网站 | 2021 年 4 月 20 日 |
| 15 | 华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金暂停大额申购（含转换转入、定期定额投资）业务的公告 | 证监会规定报刊和网站 | 2021 年 3 月 29 日 |
| 16 | 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  |
| 17 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告                             | 证监会规定报刊和网站 | 2021 年 2 月 27 日 |
| 18 | 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暂停大                               | 证监会规定报刊和网站 | 2021 年 2 月 24 日 |

|    |                                                        |            |                 |
|----|--------------------------------------------------------|------------|-----------------|
|    | 额申购（含转换转入、定期定额投资）业务的公告                                 |            |                 |
| 19 | 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收益分配公告                    | 证监会规定报刊和网站 | 2021 年 2 月 24 日 |
| 20 | 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 |
| 21 | 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  |
| 22 | 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暂停大额申购（含转换转入、定期定额投资）业务的公告 | 证监会规定报刊和网站 | 2021 年 1 月 27 日 |
| 23 | 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收益分配公告                    | 证监会规定报刊和网站 | 2021 年 1 月 27 日 |
| 24 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于网上直销直连招商银行升级签约方式的提示性公告                   | 证监会规定报刊和网站 | 2021 年 1 月 14 日 |
| 25 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金参加北京增财基金销售有限公司费率优惠活动的公告              | 证监会规定报刊和网站 | 2021 年 1 月 7 日  |

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

|    |
|----|
| 无。 |
|----|

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

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

### 12.2 存放地点

上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

### 12.3 查阅方式

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

华泰柏瑞基金管理有限公司

2021 年 8 月 28 日