

# 华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券 投资基金 2018 年年度报告

2018 年 12 月 31 日

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2019 年 3 月 27 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 3 月 26 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，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

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

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 2018 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>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.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 其他指标.....	错误!未定义书签。
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	10
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	16
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>17</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
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.....	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	17
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>18</b>

6.1 审计报告基本信息.....	18
6.2 审计报告的基本内容.....	18
<b>§7 年度财务报表.....</b>	<b>21</b>
7.1 资产负债表.....	21
7.2 利润表.....	22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	23
7.4 报表附注.....	24
<b>§8 投资组合报告.....</b>	<b>52</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	52
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	52
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	53
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	66
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	67
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	68
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细.....	68
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	68
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	68
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	68
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	68
8.12 投资组合报告附注.....	68
<b>§9 基金份额持有人信息.....</b>	<b>70</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	70
9.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	70
9.3 期末上市基金前十名持有人.....	70
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	70
9.5 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.....	70
<b>§10 开放式基金份额变动.....</b>	<b>72</b>
<b>§ 11 重大事件揭示.....</b>	<b>73</b>
11.1 基金份额持有人大会决议.....	73
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	73

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	73
11.4 基金投资策略的改变 .....	73
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	73
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	73
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	74
11.8 其他重大事件 .....	77
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>78</b>
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况 .....	78
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	79
<b>§13 备查文件目录.....</b>	<b>80</b>
13.1 备查文件目录 .....	80
13.2 存放地点 .....	80
13.3 查阅方式 .....	80

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华泰柏瑞中证 500ETF
基金主代码	512510
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2015 年 5 月 13 日
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	386,429,801.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2015 年 6 月 12 日

### 2.2 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。本基金力争将日均跟踪偏离度控制在 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 以内。
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	中证 500 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，采用完全复制的被动式投资策略：一方面，相对于混合型基金、债券型基金与货币市场基金而言，其风险和收益较高；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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈晖	王永民
	联系电话	021-38601777	010-66594896
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-888-0001	95566
传真		021-38601799	010-66594942

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 1 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 1 号
邮政编码	200135	100818
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	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.huatai-pb.com">http://www.huatai-pb.com</a>
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
注册登记机构	华泰柏瑞基金管理有限公司	上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

### § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018 年	2017 年	2016 年
本期已实现收益	-33,476,829.45	-18,852,060.35	-59,715,972.50
本期利润	-111,937,324.94	13,472,150.27	-75,320,257.10
加权平均基金份额本期利润	-0.3951	0.0576	-0.2525
本期加权平均净值利润率	-36.24%	4.47%	-20.33%
本期基金份额净值增长率	-31.70%	3.50%	-15.93%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
期末可供分配利润	-435,050,419.87	-147,550,539.32	-195,610,327.72
期末可供分配基金份额利润	-1.1258	-0.7148	-0.7342
期末基金资产净值	342,221,561.80	267,666,144.50	340,291,455.37
期末基金份额净值	0.8856	1.2966	1.2772
3.1.3 累计期末指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
基金份额累计净值增长率	-55.11%	-34.28%	-36.50%

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

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

3、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

#### 3.2 基金净值表现

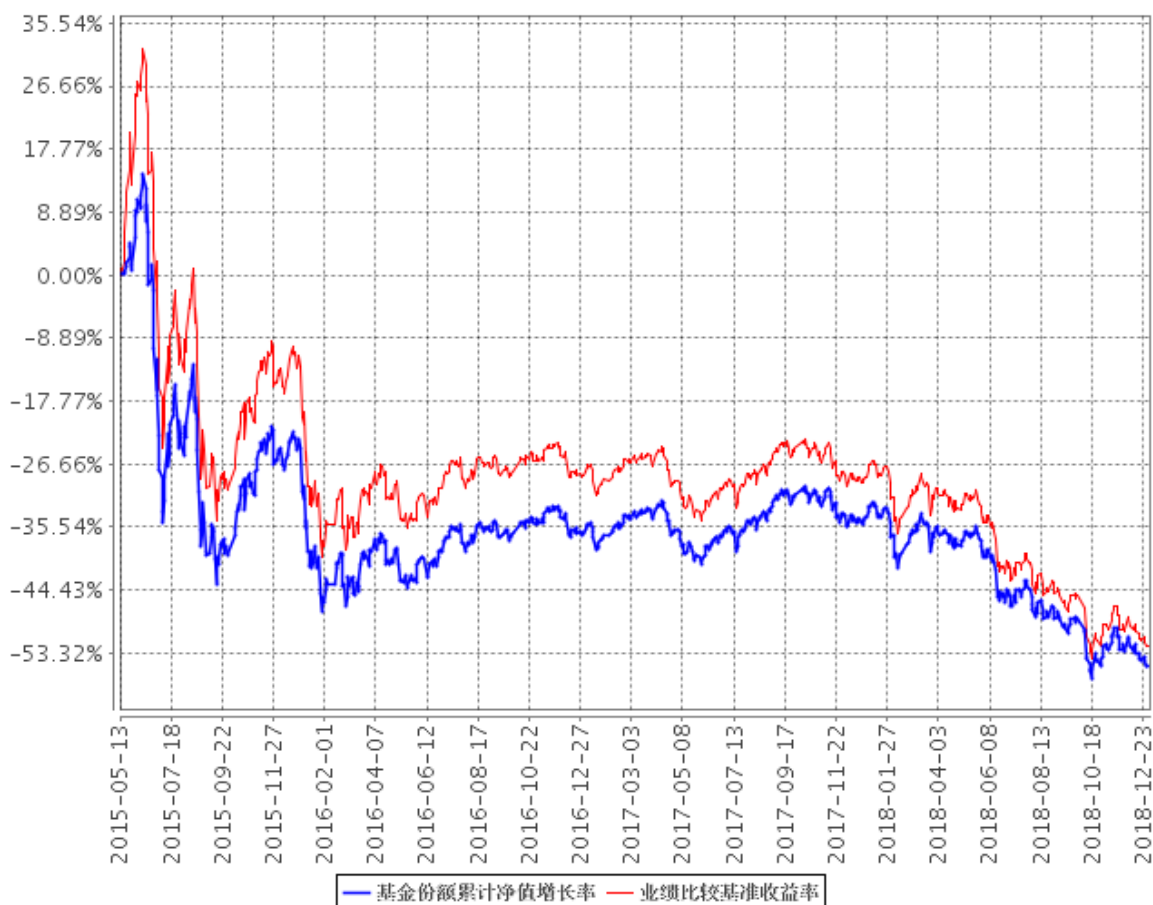
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-12.89%	1.84%	-13.18%	1.84%	0.29%	0.00%
过去六个月	-19.30%	1.58%	-20.12%	1.58%	0.82%	0.00%
过去一年	-31.70%	1.50%	-33.32%	1.51%	1.62%	-0.01%
过去三年	-40.57%	1.49%	-45.28%	1.50%	4.71%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-55.11%	1.90%	-52.34%	1.93%	-2.77%	-0.03%



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

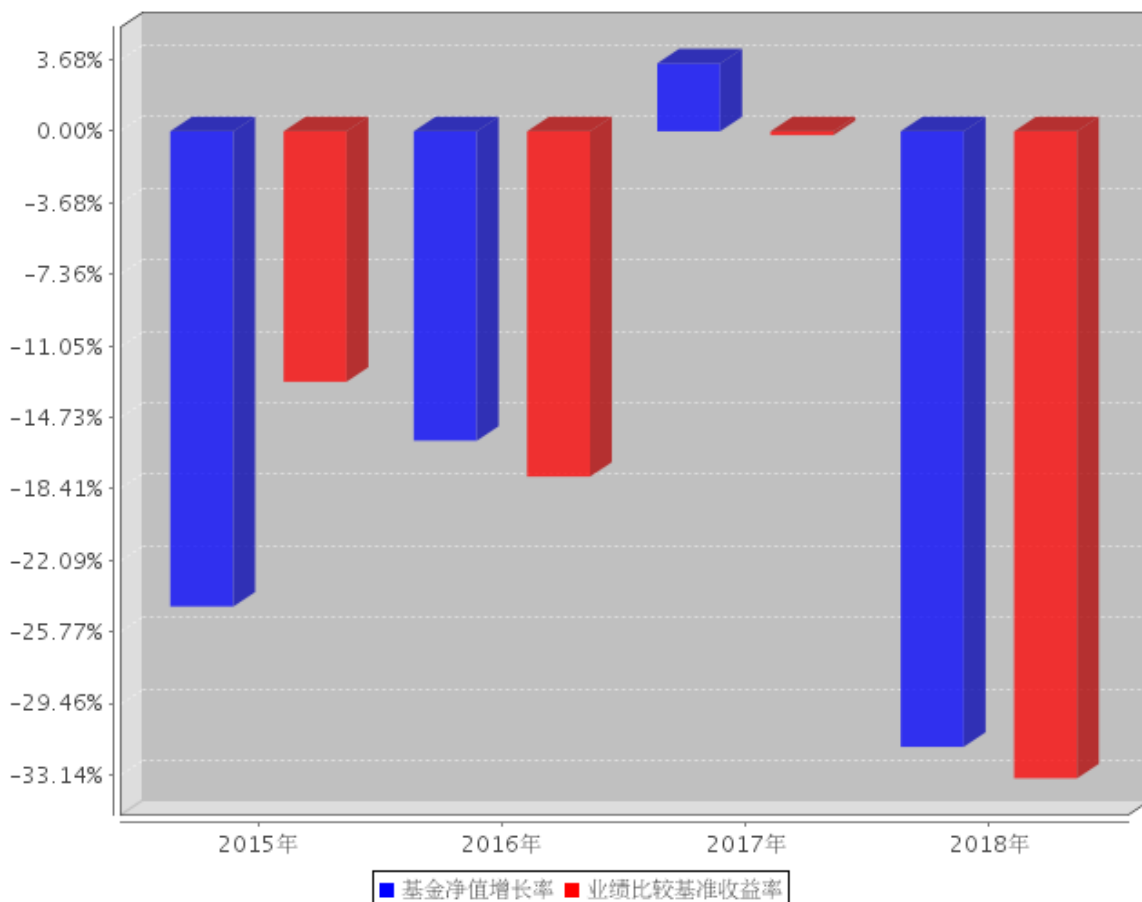
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、图示日期为 2015 年 5 月 13 日至 2018 年 12 月 31 日。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：基金合同生效日为 2015 年 5 月 13 日，2015 年度的相关数据根据当年的实际存续期计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额 分红数	现金形式发放 总额	再投资形式发 放总额	年度利润分配合 计	备注
2018	-	-	-	-	
2017	0.2400	6,394,315.13	-	6,394,315.13	
2016	-	-	-	-	
合计	0.2400	6,394,315.13	-	6,394,315.13	

## § 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、华泰柏瑞丰汇债券型证券投资基金、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、华泰柏瑞中国制造 2025 灵活配置混合型证券投资基金、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、华泰柏瑞睿利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、华泰柏瑞亨利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞兴利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞价值精选 30 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、华泰柏瑞国企整合精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞医疗健康混合型证券投资基金、华泰柏瑞现代服务业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。截至 2018 年 12 月 31 日，公司基金管理规模为 980.05 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、本基金的基金经理	2015 年 5 月 13 日	-	17 年	17 年证券(基金)从业经历, 复旦大学财务管理硕士, 2000 年至 2001 年在上海汽车集团财务有限公司从事财务工作, 2001 年至 2004 年任华安基金管理有限公司高级基金核算员, 2004 年 7 月起加入本公司, 历任基金事务部总监、基金经理助理。2009 年 6 月起任华泰柏瑞(原友邦华泰)上证红利交易型开放式指数基金基金经理。2010 年 10 月起任指数投资部副总监。2011 年 1 月起担任上证中小盘 ETF 及华泰柏瑞上证中小盘 ETF 联接基金基金经理。2012 年 5 月起担任华泰柏瑞沪深 300ETF 及华泰柏瑞沪深 300ETF 联接基金基金经理。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 ETF 及华泰柏瑞中证 500ETF 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

					<p>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。</p>
--	--	--	--	--	--

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司将投资管理职能和交易执行职能完全隔离，实行集中交易制度，由交易部为公募基金、专户理财和海外投资等业务统一交易服务，为公平交易的实施提供了较好的保障。目前公司公募基金、专户理财和海外投资业务的基金经理不存在兼任其它投资管理部门业务的情况，不同业务类别的投资经理之间互不干扰，独立做出投资决策。公司机构设置合理，公平交易的相关管理制度健全，投资决策流程完善，各项制度执行情况良好。交易价差分析表明公司旗下各基金均得到了公平对待，不存在非公平交易和利益输送的行为。经过对不同基金之间交易相同证券时的同向交易价差进行分析发现，报告期内基金之间的买卖交易价差总体上处于正常的合理水平。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

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

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2018 年全年市场整体不佳，除年初市场有所表现外，其余时间市场整体呈现出单边下跌走势，在国内金融去杠杆以及中美贸易战阴影的笼罩下，全年上证红利、沪深 300、中证 500、中证 1000 和创业板指分别下跌 16.96%、25.31%、33.32%、36.87% 和 28.65%。从市场整体风格来看，具有高分红的低估值股票表现较为抗跌，大盘风格优于小盘。分各行业来看，28 个申万一级行业无一录得正收益，其中休闲服务和银行板块表现相对较优。

我们严格按照基金合同的规定，紧密跟踪标的指数、跟踪偏离最小化的投资策略进行被动投资。本报告期内，本基金的累计跟踪偏离为 1.630%，日均绝对跟踪偏离度为 0.019%，期间日跟踪误差为 0.023%，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

截至本报告期末本基金份额净值为 0.8856 元；本报告期基金份额净值增长率为-31.70%，业绩比较基准收益率为-33.32%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2019 年，A 股市场在经历 2018 年的大幅调整以后，PE 和 PB 等估值指标已处于多年以来的历史低位，市场已经处于底部区域，我们认为当下市场已充分计入外部贸易环境恶化、国内经济下行导致的上市公司业绩下滑等不利因素，投资者可以对当前股票市场保持适当乐观，可择机加大对权益类资产的配置。目前 A 股市场国际化进程仍在持续，MSCI 即将公布是否将 A 股纳入因子从 5%提高到 20%的决定，不论结果如何，我们认为 A 股市场国际化的趋势不会改变。根据以往经验，外资更为偏好业绩良好且具有高分红的大盘蓝筹，这一偏好有望继续影响着市场的风格选择，在目前市场风险偏好仍相对较低的背景下，这类具有高分红的大盘蓝筹股或将继续获得超越市场的收益。

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标的指数基本一致的投资回报。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2018 年度，本基金管理人在为基金份额持有人谋求最大利益的同时，始终将合规运作、防范风险工作放在各项工作的首位。依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。公司监察部门按照规定的权限和程序，通过实时监控、现场检查、重点抽查和人员询问等方法，独立地开展基金运作和公司管理的合规性稽核，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向董事长和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

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

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

(2) 开展定期和专项监察稽核工作，确保各项业务活动的合法合规

本年度公司监察稽核部门开展了对公司基金投资、研究、销售、后台运营、反洗钱等方面的

专项监察稽核活动。对稽核中发现问题及时发出合规提示函，要求相关部门限期整改，并对改进情况安排后续跟踪检查，确保各项业务开展合法合规。

### （3）促进公司各项内部管理制度的完善

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

### （4）通过各种合规培训提高员工合规意识

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

通过以上工作的开展，在本报告期内本基金运作过程中未发生违规情形，基金运作整体合法合规。在今后的工作中，本基金管理人承诺将一如既往的本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，为基金持有人谋求最大利益。

## 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

## 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定，在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至多 4 次；每次分配比例不低于基金期末可分配利润的 10%；基金收益分配后每份基金份额的净值不能低于面值。报告期内基金未实施收益分配。

## 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

注：无。



## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2019)第 21806 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“中证 500 ETF”)的财务报表，包括 2018 年 12 月 31 日的资产负债表，2018 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了中证 500 ETF2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于中证 500 ETF，并</p>

	<p>履行了职业道德方面的其他责任。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>中证 500 ETF 的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估中证 500 ETF 的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算中证 500 ETF、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督中证 500 ETF 的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致</p>

	<p>的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对中证 500 ETF 持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致中证 500 ETF 不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	单峰   曹阳
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2019 年 3 月 26 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	2,649,435.24	3,519,943.15
结算备付金		197,032.02	9,048.65
存出保证金		27,120.54	15,012.80
交易性金融资产	7.4.7.2	339,793,784.98	264,585,100.33
其中：股票投资		339,793,784.98	264,585,100.33
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		261,798.79	168,934.31
应收利息	7.4.7.5	667.75	528.59
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		342,929,839.32	268,298,567.83
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2017 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		1,220.60	10,658.70
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		146,850.18	113,442.18
应付托管费		29,370.05	22,688.46
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	120,836.69	75,395.49
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	410,000.00	410,238.50
负债合计		708,277.52	632,423.33
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	777,271,981.67	415,216,683.82
未分配利润	7.4.7.10	-435,050,419.87	-147,550,539.32
所有者权益合计		342,221,561.80	267,666,144.50
负债和所有者权益总计		342,929,839.32	268,298,567.83

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.8856 元，基金份额总额 386,429,801.00 份。

## 7.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		-109,013,277.97	16,306,468.22
1.利息收入		36,679.17	24,732.56
其中：存款利息收入	7.4.7.11	36,676.13	24,664.70
债券利息收入		3.04	67.86
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-31,014,514.82	-16,215,396.51
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-34,544,037.33	-18,642,782.54
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	591.46	46,861.99
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	3,528,931.05	2,380,524.04
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-78,460,495.49	32,324,210.62
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	425,053.17	172,921.55
<b>减：二、费用</b>		2,924,046.97	2,834,317.95

1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,542,324.89	1,510,707.38
2. 托管费	7.4.10.2.2	308,465.01	302,141.56
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	449,445.57	379,439.50
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	7.4.7.20	623,811.50	642,029.51
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-111,937,324.94	13,472,150.27
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-111,937,324.94	13,472,150.27

### 7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	415,216,683.82	-147,550,539.32	267,666,144.50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-111,937,324.94	-111,937,324.94
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)	362,055,297.85	-175,562,555.61	186,492,742.24
其中：1.基金申购款	422,397,847.50	-202,090,293.47	220,307,554.03
2.基金赎回款	-60,342,549.65	26,527,737.86	-33,814,811.79
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	777,271,981.67	-435,050,419.87	342,221,561.80
项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	535,901,783.09	-195,610,327.72	340,291,455.37
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	13,472,150.27	13,472,150.27
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）	-120,685,099.27	40,981,953.26	-79,703,146.01
其中：1. 基金申购款	44,251,203.08	-16,568,255.48	27,682,947.60
2. 基金赎回款	-164,936,302.35	57,550,208.74	-107,386,093.61
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）	-	-6,394,315.13	-6,394,315.13
五、期末所有者权益（基金净值）	415,216,683.82	-147,550,539.32	267,666,144.50

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]508 号《关于准予华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及联接基金注册的批复》核准，由华泰柏瑞基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金，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 873,771,921.00 元(含募集股票市值)，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第 460 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2015 年 5 月 13 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 873,820,061.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 48,140.00



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，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金于 2015 年 6 月 3 日进行了基金份额折算，折算比例为 0.49716235，并于 2015 年 6 月 4 日进行了变更登记。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2015]236 号文审核同意，本基金 434,429,801.00 份基金份额于 2015 年 6 月 12 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股(包括中小板、创业板以及其他经中国证监会核准发行的股票)、债券(包括国债、金融债、企业/公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、权证、股指期货、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 95%，且不低于基金非现金资产的 80%。在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度(剔除成份股分红因素)的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。本基金的业绩比较基准为中证 500 指数。

华泰柏瑞基金管理有限公司以本基金为目标 ETF，于 2015 年 5 月 13 日募集成立了华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“华泰柏瑞中证 500ETF 联接基金”)。华泰柏瑞中证 500ETF 联接基金为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

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 2019 年 3 月 26 日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、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》、《华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

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

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

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

##### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金在投资人申购、赎回过程中而待与投资人结算的可退替代款分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，在资产负债表中以交易性金融负债列示。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

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

#### **7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

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

#### **7.4.4.7 实收基金**

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

#### **7.4.4.8 损益平准金**

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

#### **7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量**

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### **7.4.4.10 费用的确认和计量**

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### **7.4.4.11 基金的收益分配政策**

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配；基金管理人每季度定期对基金相对标的指数的超额收益率进行一次评估，基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率达到 1%以上，方可对超额收益进行分配；本基金的收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使还原后基金份额净值低于面值。基金收益分配比例为收益评价日符合上述分红条件的基金超额收益的 100%，基金收益分配每年至多 4 次。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### **7.4.4.12 分部报告**

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

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会

计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### **7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计**

无。

#### **7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **7.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### **7.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### **7.4.5.3 差错更正的说明**

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### **7.4.6 税项**

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

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

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

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

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

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
活期存款	2,649,435.24	3,519,943.15
定期存款	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计：	2,649,435.24	3,519,943.15

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2018 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		472,881,083.78	339,793,784.98	-133,087,298.80
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		472,881,083.78	339,793,784.98	-133,087,298.80
项目		上年度末 2017 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		319,211,903.64	264,585,100.33	-54,626,803.31
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		319,211,903.64	264,585,100.33	-54,626,803.31

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：截至本报告期末及上年度末，本基金未持有衍生金融资产/负债。

### 7.4.7.4 买入返售金融资产

#### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：截至本报告期末及上年度末本基金未持有买入返售金融资产。

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。



### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	556.76	516.82
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	97.57	4.40
应收债券利息	-	-
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	13.42	7.37
合计	667.75	528.59

### 7.4.7.6 其他资产

注：截至本报告期末及上年度末，本基金未持有其他资产。

### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	120,836.69	75,395.49
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	120,836.69	75,395.49

### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
预提费用	410,000.00	410,000.00
应付替代款	-	238.50
合计	410,000.00	410,238.50

### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	206,429,801.00	415,216,683.82
本期申购	210,000,000.00	422,397,847.50
本期赎回(以“-”号填列)	-30,000,000.00	-60,342,549.65
- 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	386,429,801.00	777,271,981.67

注：投资者申购和赎回的基金份额需为最小申购赎回单位的整数倍。

### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-68,918,848.33	-78,631,690.99	-147,550,539.32
本期利润	-33,476,829.45	-78,460,495.49	-111,937,324.94
本期基金份额交易产生的变动数	-65,291,598.58	-110,270,957.03	-175,562,555.61
其中：基金申购款	-75,929,693.17	-126,160,600.30	-202,090,293.47
基金赎回款	10,638,094.59	15,889,643.27	26,527,737.86
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-167,687,276.36	-267,363,143.51	-435,050,419.87

### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
	活期存款利息收入	33,554.06
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	2,832.14	1,258.91
其他	289.93	335.45
合计	36,676.13	24,664.70

### 7.4.7.12 股票投资收益

#### 7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年 12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12 月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-30,465,212.91	-8,604,805.75
股票投资收益——赎回差价收入	-4,078,824.42	-10,037,976.79
股票投资收益——申购差价收入	-	-
合计	-34,544,037.33	-18,642,782.54

#### 7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018 年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年 12月31日
卖出股票成交总额	110,523,391.88	145,027,185.12
减：卖出股票成本总额	140,988,604.79	153,631,990.87
买卖股票差价收入	-30,465,212.91	-8,604,805.75

#### 7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至 2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017 年12月31日
赎回基金份额对价总额	33,814,811.79	107,386,093.61
减：现金支付赎回款总额	18,353,390.79	57,882,505.61
减：赎回股票成本总额	19,540,245.42	59,541,564.79
赎回差价收入	-4,078,824.42	-10,037,976.79

#### 7.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间无股票申购差价收入。

### 7.4.7.13 债券投资收益

#### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年 12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月 31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	591.46	46,861.99
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	591.46	46,861.99

#### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年 12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月 31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	21,594.50	396,829.85
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	21,000.00	349,900.00
减：应收利息总额	3.04	67.86
买卖债券差价收入	591.46	46,861.99

#### 7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间无债券赎回差价收入。

#### 7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间无债券申购差价收入。

#### 7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

##### 7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

##### 7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

##### 7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

##### 7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

##### 7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益。

##### 7.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益。

#### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
股票投资产生的股利收益	3,528,931.05	2,380,524.04
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	3,528,931.05	2,380,524.04

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
1. 交易性金融资产	-78,460,495.49	32,324,210.62
——股票投资	-78,460,495.49	32,324,210.62
——债券投资	-	-

——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 变动产生的预估增值税	-	-
合计	-78,460,495.49	32,324,210.62

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年 12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12 月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	425,053.17	172,921.55
合计	425,053.17	172,921.55

注：替代损益是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申购(赎回)本基金时，补入(卖出)被替代股票的实际买入成本(实际卖出金额)与申购(赎回)确认日估值的差额或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购(赎回)确认日估值的差额。

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31 日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月 31日
交易所市场交易费用	449,445.57	379,439.50
银行间市场交易费用	-	-
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	449,445.57	379,439.50

### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
审计费用	60,000.00	60,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
银行划款手续费	3,811.50	2,846.56
上市费	60,000.00	60,000.00
指数使用费	200,000.00	200,000.00
分红手续费	-	19,182.95
合计	623,811.50	642,029.51

### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

#### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华泰柏瑞基金管理有限公司（“华泰柏瑞基金”）	基金管理人、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人
华泰证券股份有限公司（“华泰证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
PineBridgeInvestmentLLC	基金管理人的股东
苏州新区高新技术产业股份有限公司	基金管理人的股东
华泰联合证券有限责任公司（“华泰联合证券”）	基金管理人的股东华泰证券的控股子公司
柏瑞爱建资产管理(上海)有限公司	基金管理人的控股子公司
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（“华泰柏瑞中证	本基金的基金管理人管理的其他基金

500ETF 联接基金” )	
----------------	--

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

注：本报告期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元未进行股票交易。

###### 7.4.10.1.2 权证交易

注：本报告期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元未进行权证交易。

###### 7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

注：本报告期及上年度可比期间本基金无应支付关联方的佣金。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,542,324.89	1,510,707.38
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：支付基金管理人华泰柏瑞基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 0.50% / 当年天数。

###### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	308,465.01	302,141.56

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：



日托管费=前一日基金资产净值 X 0.10% / 当年天数。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

注：本期和上年可比期间均无数据。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

注：本报告期及上年度，基金管理人未投资本基金。

##### 7.4.10.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2018年12月31日		上年度末 2017年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金 份额 占基金总份 额的比例	持有的 基金份额	持有的基金 份额 占基金总份 额的比例
华泰柏瑞中证 500ETF 联接基 金	179,361,728.00	46.4151%	102,805,231.00	49.8015%

##### 7.4.10.5 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 2018年1月1日至2018年12月31日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	2,649,435.24	33,554.06	3,519,943.15	23,070.34

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

##### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间未参与关联方承销证券。

##### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

注：本基金本报告期无其他需要说明的关联交易事项。

### 7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

### 7.4.12 期末（2018 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

#### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601860	紫金银行	2018 年 12 月 20 日	2019 年 1 月 3 日	新股流通受限	3.14	3.14	15,970	50,145.80	50,145.80	-

注：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。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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
600270	外运发展	2018 年 12 月 13 日	重大事项	20.99	-	-	40,058	945,044.08	840,817.42	-
002183	怡亚通	2018 年 12 月 25 日	拟披露重大事项	5.01	2019 年 1 月 2 日	4.96	167,250	1,117,365.44	837,922.50	-
000987	越秀金控	2018 年 12 月 25 日	重大资产重组	7.97	2019 年 1 月 10 日	8.77	33,506	306,675.17	267,042.82	-

注：1. 根据中外运空运发展股份有限公司（以下简称“外运发展”）于 2018 年 11 月 3 日公布的《中

国外运股份有限公司换股吸收合并中外运空运发展股份有限公司暨关联交易报告书》和中国外运股份有限公司(以下简称“中国外运”)于 2019 年 1 月 15 日公布的《中国外运发行 A 股股份换股吸收合并中外运空运发展股份有限公司上市公告书暨 2018 年第三季度财务报表》，中国外运向外运发展除中国外运以外的股东发行 A 股股票，以换股比例 1:3.8225 取得外运发展股东持有的外运发展全部股票，吸收合并外运发展；外运发展自 2018 年 12 月 13 日起连续停牌。换股合并后新增的中国外运股票于 2019 年 1 月 18 日上市流通，当日开盘单价为 5.30 元。外运发展自 2018 年 12 月 28 日起终止上市并摘牌。

2 本基金截至 2018 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

### **7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

#### **7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券余额 0 元，无债券作为质押。

#### **7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

注：截至本报告期末，本基金未持有交易所债券正回购。

### **7.4.13 金融工具风险及管理**

#### **7.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

本基金为被动式指数基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金，主要投资于标的指数成份股和备选成份股。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，力争实现保持基金净值增长率与标的指数增长率间的高度正相关，并保持跟踪误差在合同约定的范围内。

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、风险管理部和法律监察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风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 7.4.13.2 信用风险

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

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

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。

于 2018 年 12 月 31 日，本基金无债券投资(2017 年 12 月 31 日：同)。

#### **7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

注：无。

#### **7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

注：无。

#### **7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

注：无。

#### **7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

注：无。

#### **7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

注：无。

#### **7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

注：无。

### **7.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

于 2018 年 12 月 31 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。本基金赎回基金份额采用一篮子股票形式，流动性风险相对较低。

#### **7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析**

注：无。

#### **7.4.13.3.2 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》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）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。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2018 年 12 月 31 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 0.58%。

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。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

#### **7.4.13.4 市场风险**

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

### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或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、结算备付金及存出保证金等。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018 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
<b>资产</b>							
银行存款	2,649,435.24	-	-	-	-	-	2,649,435.24
结算备付金	197,032.02	-	-	-	-	-	197,032.02
存出保证金	27,120.54	-	-	-	-	-	27,120.54
交易性金融资产	-	-	-	-	-	339,793,784.98	339,793,784.98
应收证券清算款	-	-	-	-	-	261,798.79	261,798.79
应收利息	-	-	-	-	-	667.75	667.75
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
<b>资产总计</b>	<b>2,873,587.80</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>340,056,251.52</b>	<b>342,929,839.32</b>
<b>负债</b>							
交易性金融负债	-	-	-	-	-	1,220.60	1,220.60
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	146,850.18	146,850.18
应付托管费	-	-	-	-	-	29,370.05	29,370.05
应付交易费用	-	-	-	-	-	120,836.69	120,836.69
其他负债	-	-	-	-	-	410,000.00	410,000.00
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>708,277.52</b>	<b>708,277.52</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>2,873,587.80</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-339,347,974.00</b>	<b>342,221,561.80</b>
<b>上年度末</b>	<b>1 个月以内</b>	<b>1-3 个月</b>	<b>3 个月</b>	<b>1-5 年</b>	<b>5 年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>

2017 年 12 月 31 日			-1 年				
资产							
银行存款	3,519,943.15	-	-	-	-	-	3,519,943.15
结算备付金	9,048.65	-	-	-	-	-	9,048.65
存出保证金	15,012.80	-	-	-	-	-	15,012.80
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-264,585,100.33	264,585,100.33
应收证券清算款	-	-	-	-	-	168,934.31	168,934.31
应收利息	-	-	-	-	-	528.59	528.59
资产总计	3,544,004.60	-	-	-	-	-264,754,563.23	268,298,567.83
负债							
交易性金融负债	-	-	-	-	-	10,658.70	10,658.70
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	113,442.18	113,442.18
应付托管费	-	-	-	-	-	22,688.46	22,688.46
应付交易费用	-	-	-	-	-	75,395.49	75,395.49
其他负债	-	-	-	-	-	410,238.50	410,238.50
负债总计	-	-	-	-	-	632,423.33	632,423.33
利率敏感度缺口	3,544,004.60	-	-	-	-	-264,122,139.90	267,666,144.50

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2018 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资(2017 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2017 年 12 月 31 日：同)。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金为被动式指数基金，原则上采用完全复制的方法，按照个股在标的指数中的基准权重构建投资组合。基金所构建的指数化投资组合将根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应



调整。同时，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况、新股增发等变化，对基金投资组合进行相应调整，以保证基金份额净值增长率与标的指数间的高度正相关和跟踪误差最小化。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金主要投资于指数的成份股及其备选成份股，其投资比例不低于基金资产净值的 95%，且不低于基金非现金资产的 80%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日		上年度末 2017 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产—股票投资	339,793,784.98	99.29	264,585,100.33	98.85
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	339,793,784.98	99.29	264,585,100.33	98.85

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证 500 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影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末（2018 年 12 月 31 日）	上年度末（2017 年 12 月 31 日）
	中证 500 指数上升 5%		1,777.29
中证 500 指数下降 5%		-1,777.29	-1,377.00

#### 7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 基金申购款

于 2018 年度，本基金申购基金份额的对价总额为 220,307,554.03 元(2017 年度：27,682,947.60 元)，其中包括以股票支付的申购款 83,954,282.05 元和以现金支付的申购款 136,353,271.98 元(2017 年度：其中包括以股票支付的申购款 11,898,012.00 元和以现金支付的申购款 15,784,935.60 元)。

##### (2) 公允价值

###### (a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

###### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

###### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2018 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 337,797,856.44 元，属于第二层次的余额为 1,995,928.54 元，无属于第三层次的余额(2017 年 12 月 31 日：第一层次 244,081,493.03 元，第二层次 20,503,607.30 元，无第三层次)。于 2018 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债均属于第一层次(2017 年 12 月 31 日：同)

###### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易

不活跃)、或属于非公开发售等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2018 年 12 月 31 日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2017 年 12 月 31 日:同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(3)除基金申购款和公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	339,793,784.98	99.09
	其中：股票	339,793,784.98	99.09
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,846,467.26	0.83
8	其他各项资产	289,587.08	0.08
9	合计	342,929,839.32	100.00

注：上述股票投资包括可退替代款估值增。

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	3,587,809.23	1.05
B	采矿业	10,815,019.57	3.16
C	制造业	191,938,679.61	56.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,836,670.86	3.17
E	建筑业	6,259,593.60	1.83
F	批发和零售业	18,007,029.42	5.26
G	交通运输、仓储和邮政业	12,086,932.33	3.53
H	住宿和餐饮业	1,279,591.20	0.37
I	信息传输、软件和信息技术服务业	30,643,580.69	8.95
J	金融业	11,659,210.32	3.41
K	房地产业	19,065,358.54	5.57
L	租赁和商务服务业	5,489,929.95	1.60
M	科学研究和技术服务业	570,576.16	0.17

N	水利、环境和公共设施管理业	2,244,833.57	0.66
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	290,540.00	0.08
Q	卫生和社会工作	2,240,215.49	0.65
R	文化、体育和娱乐业	9,518,987.86	2.78
S	综合	3,259,226.58	0.95
	合计	339,793,784.98	99.29

注：上述股票投资组合不包括可退替代款估值增。

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600201	生物股份	133,119	2,209,775.40	0.65
2	000656	金科股份	303,963	1,881,530.97	0.55
3	600872	中炬高新	62,393	1,838,097.78	0.54
4	600256	广汇能源	460,138	1,730,118.88	0.51
5	300146	汤臣倍健	100,200	1,702,398.00	0.50
6	300347	泰格医药	39,700	1,697,175.00	0.50
7	300253	卫宁健康	128,673	1,603,265.58	0.47
8	002410	广联达	76,919	1,600,684.39	0.47
9	600426	华鲁恒升	128,998	1,557,005.86	0.45
10	000623	吉林敖东	105,500	1,522,365.00	0.44
11	600642	申能股份	310,763	1,516,523.44	0.44
12	600699	均胜电子	64,500	1,506,720.00	0.44
13	000998	隆平高科	99,900	1,478,520.00	0.43
14	601005	重庆钢铁	761,800	1,477,892.00	0.43
15	000750	国海证券	335,478	1,462,684.08	0.43
16	300450	先导智能	50,400	1,458,576.00	0.43
17	002465	海格通信	184,077	1,435,800.60	0.42
18	600298	安琪酵母	56,350	1,421,710.50	0.42
19	000860	顺鑫农业	44,400	1,415,916.00	0.41
20	002049	紫光国微	48,678	1,406,794.20	0.41
21	600600	青岛啤酒	39,522	1,377,736.92	0.40
22	002129	中环股份	190,243	1,375,456.89	0.40
23	002223	鱼跃医疗	68,755	1,348,285.55	0.39
24	600820	隧道股份	214,300	1,341,518.00	0.39

25	600879	航天电子	247,454	1,338,726.14	0.39
26	000401	冀东水泥	107,633	1,332,496.54	0.39
27	000690	宝新能源	197,877	1,331,712.21	0.39
28	600528	中铁工业	126,800	1,331,400.00	0.39
29	300383	光环新网	104,840	1,328,322.80	0.39
30	600895	张江高科	88,283	1,319,830.85	0.39
31	000778	新兴铸管	298,389	1,286,056.59	0.38
32	002340	格林美	330,614	1,269,557.76	0.37
33	601168	西部矿业	216,578	1,260,483.96	0.37
34	002439	启明星辰	61,137	1,256,976.72	0.37
35	300413	芒果超媒	33,900	1,254,639.00	0.37
36	600673	东阳光科	171,370	1,247,573.60	0.36
37	600811	东方集团	337,776	1,236,260.16	0.36
38	600779	水井坊	38,800	1,228,796.00	0.36
39	002195	二三四五	330,085	1,218,013.65	0.36
40	600885	宏发股份	53,660	1,210,569.60	0.35
41	600183	生益科技	120,312	1,210,338.72	0.35
42	300168	万达信息	99,900	1,197,801.00	0.35
43	600325	华发股份	192,802	1,195,372.40	0.35
44	002268	卫士通	66,449	1,186,779.14	0.35
45	002470	金正大	187,400	1,184,368.00	0.35
46	000997	新大陆	80,322	1,175,914.08	0.34
47	600808	马钢股份	339,835	1,175,829.10	0.34
48	600022	山东钢铁	747,580	1,173,700.60	0.34
49	000581	威孚高科	66,313	1,171,087.58	0.34
50	002281	光迅科技	43,545	1,169,618.70	0.34
51	002507	涪陵榨菜	54,000	1,166,400.00	0.34
52	002092	中泰化学	165,224	1,164,829.20	0.34
53	002384	东山精密	103,107	1,164,078.03	0.34
54	002038	双鹭药业	46,461	1,152,697.41	0.34
55	002506	协鑫集成	230,274	1,151,370.00	0.34
56	000975	银泰资源	112,943	1,150,889.17	0.34
57	002500	山西证券	193,100	1,143,152.00	0.33
58	000830	鲁西化工	116,633	1,143,003.40	0.33
59	600718	东软集团	98,786	1,140,978.30	0.33
60	600804	鹏博士	161,900	1,138,157.00	0.33
61	600567	山鹰纸业	363,800	1,135,056.00	0.33
62	000060	中金岭南	284,500	1,126,620.00	0.33
63	300315	掌趣科技	313,600	1,107,008.00	0.32

64	600079	人福医药	108,156	1,096,701.84	0.32
65	002174	游族网络	58,400	1,085,656.00	0.32
66	000999	华润三九	43,062	1,070,521.32	0.31
67	600143	金发科技	216,069	1,069,541.55	0.31
68	002013	中航机电	163,981	1,067,516.31	0.31
69	000039	中集集团	100,859	1,067,088.22	0.31
70	600161	天坛生物	49,891	1,060,183.75	0.31
71	600376	首开股份	147,000	1,056,930.00	0.31
72	000009	中国宝安	244,786	1,055,027.66	0.31
73	002358	森源电气	58,951	1,049,327.80	0.31
74	002127	南极电商	139,385	1,048,175.20	0.31
75	300027	华谊兄弟	222,900	1,045,401.00	0.31
76	600315	上海家化	38,198	1,042,805.40	0.30
77	600160	巨化股份	156,192	1,035,552.96	0.30
78	600392	盛和资源	119,771	1,031,228.31	0.30
79	300274	阳光电源	115,505	1,030,304.60	0.30
80	601866	中远海发	450,900	1,028,052.00	0.30
81	601098	中南传媒	81,513	1,018,912.50	0.30
82	601872	招商轮船	275,681	1,017,262.89	0.30
83	002078	太阳纸业	176,874	1,008,181.80	0.29
84	600755	厦门国贸	144,315	1,007,318.70	0.29
85	000960	锡业股份	105,500	1,006,470.00	0.29
86	000418	小天鹅 A	23,228	1,004,611.00	0.29
87	600967	内蒙一机	96,064	999,065.60	0.29
88	000686	东北证券	159,585	999,002.10	0.29
89	000008	神州高铁	256,335	997,143.15	0.29
90	300001	特锐德	56,750	994,827.50	0.29
91	600875	东方电气	124,759	984,348.51	0.29
92	600655	豫园股份	132,471	980,285.40	0.29
93	002463	沪电股份	136,518	978,834.06	0.29
94	002399	海普瑞	42,400	977,320.00	0.29
95	603077	和邦生物	602,285	975,701.70	0.29
96	600839	四川长虹	420,380	971,077.80	0.28
97	002221	东华能源	120,144	968,360.64	0.28
98	600166	福田汽车	531,002	966,423.64	0.28
99	600021	上海电力	119,000	963,900.00	0.28
100	603899	晨光文具	31,640	957,110.00	0.28
101	600572	康恩贝	161,242	956,165.06	0.28
102	002110	三钢闽光	74,487	952,688.73	0.28

103	000066	中国长城	200,234	949,109.16	0.28
104	000681	视觉中国	40,524	945,019.68	0.28
105	600643	爱建集团	110,947	941,940.03	0.28
106	000547	航天发展	124,554	941,628.24	0.28
107	600260	凯乐科技	55,078	934,673.66	0.27
108	000813	德展健康	101,737	933,945.66	0.27
109	002299	圣农发展	56,404	932,922.16	0.27
110	600801	华新水泥	55,475	927,542.00	0.27
111	002373	千方科技	83,265	925,906.80	0.27
112	600282	南钢股份	270,068	923,632.56	0.27
113	002372	伟星新材	59,500	922,845.00	0.27
114	600881	亚泰集团	277,757	919,375.67	0.27
115	600959	江苏有线	221,200	911,344.00	0.27
116	002176	江特电机	155,163	910,806.81	0.27
117	000089	深圳机场	116,548	907,908.92	0.27
118	600584	长电科技	109,699	903,919.76	0.26
119	000729	燕京啤酒	160,010	902,456.40	0.26
120	002074	国轩高科	77,500	895,900.00	0.26
121	002670	国盛金控	88,376	890,830.08	0.26
122	600258	首旅酒店	55,800	890,568.00	0.26
123	600008	首创股份	258,400	886,312.00	0.26
124	600277	亿利洁能	155,811	881,890.26	0.26
125	300166	东方国信	83,999	870,229.64	0.25
126	000636	风华高科	80,974	869,660.76	0.25
127	300088	长信科技	209,435	869,155.25	0.25
128	000930	中粮生化	116,652	865,557.84	0.25
129	600388	龙净环保	84,947	862,212.05	0.25
130	600737	中粮糖业	116,593	858,124.48	0.25
131	600466	蓝光发展	158,880	854,774.40	0.25
132	000488	晨鸣纸业	152,091	853,230.51	0.25
133	600266	北京城建	107,368	850,354.56	0.25
134	600138	中青旅	65,633	846,009.37	0.25
135	000887	中鼎股份	83,121	841,184.52	0.25
136	600270	外运发展	40,058	840,817.42	0.25
137	300418	昆仑万维	65,207	838,562.02	0.25
138	002183	怡亚通	167,250	837,922.50	0.24
139	601718	际华集团	249,600	836,160.00	0.24
140	002589	瑞康医药	119,699	834,302.03	0.24
141	002019	亿帆医药	77,783	832,278.10	0.24



142	601106	中国一重	311,700	832,239.00	0.24
143	000932	华菱钢铁	137,100	830,826.00	0.24
144	603369	今世缘	57,080	827,089.20	0.24
145	600884	杉杉股份	63,753	823,688.76	0.24
146	000988	华工科技	68,955	823,322.70	0.24
147	000598	兴蓉环境	204,172	822,813.16	0.24
148	002583	海能达	104,230	822,374.70	0.24
149	600507	方大特钢	82,200	821,178.00	0.24
150	002353	杰瑞股份	54,616	819,240.00	0.24
151	000513	丽珠集团	32,520	817,878.00	0.24
152	600511	国药股份	34,995	813,633.75	0.24
153	600373	中文传媒	62,500	813,125.00	0.24
154	600500	中化国际	118,314	809,267.76	0.24
155	002916	深南电路	10,000	801,700.00	0.23
156	000559	万向钱潮	156,500	801,280.00	0.23
157	601000	唐山港	336,543	800,972.34	0.23
158	002191	劲嘉股份	101,771	794,831.51	0.23
159	000732	泰禾集团	56,586	793,335.72	0.23
160	600649	城投控股	143,600	785,492.00	0.23
161	601179	中国西电	233,051	783,051.36	0.23
162	002371	北方华创	20,726	782,613.76	0.23
163	600060	海信电器	89,682	778,439.76	0.23
164	601128	常熟银行	126,605	777,354.70	0.23
165	600729	重庆百货	27,425	776,127.50	0.23
166	002152	广电运通	138,069	774,567.09	0.23
167	600064	南京高科	98,294	774,556.72	0.23
168	600827	百联股份	91,500	773,175.00	0.23
169	002385	大北农	241,000	771,200.00	0.23
170	002640	跨境通	71,100	767,880.00	0.22
171	603885	吉祥航空	61,175	766,522.75	0.22
172	000878	云南铜业	96,614	766,149.02	0.22
173	600863	内蒙华电	330,400	763,224.00	0.22
174	600056	中国医药	60,595	761,679.15	0.22
175	600039	四川路桥	229,711	753,452.08	0.22
176	002250	联化科技	79,887	753,334.41	0.22
177	600435	北方导航	101,545	752,448.45	0.22
178	002155	湖南黄金	95,672	751,025.20	0.22
179	600312	平高电气	92,837	750,122.96	0.22
180	002273	水晶光电	78,429	749,781.24	0.22

181	600409	三友化工	130,597	747,014.84	0.22
182	601966	玲珑轮胎	54,692	746,545.80	0.22
183	002004	华邦健康	161,790	745,851.90	0.22
184	600782	新钢股份	145,100	738,559.00	0.22
185	600380	健康元	110,552	737,381.84	0.22
186	600410	华胜天成	125,172	733,507.92	0.21
187	300316	晶盛机电	73,200	733,464.00	0.21
188	002266	浙富控股	179,881	732,115.67	0.21
189	600460	士兰微	89,884	729,858.08	0.21
190	000667	美好置业	291,172	727,930.00	0.21
191	600125	铁龙物流	103,763	726,341.00	0.21
192	300182	捷成股份	169,293	726,266.97	0.21
193	600418	江淮汽车	150,811	725,400.91	0.21
194	600848	上海临港	35,000	723,800.00	0.21
195	002603	以岭药业	69,024	721,991.04	0.21
196	300133	华策影视	80,571	721,916.16	0.21
197	000596	古井贡酒	13,319	718,693.24	0.21
198	600062	华润双鹤	59,249	716,320.41	0.21
199	600536	中国软件	33,991	711,431.63	0.21
200	000970	中科三环	96,868	710,042.44	0.21
201	000027	深圳能源	135,213	709,868.25	0.21
202	000738	航发控制	58,700	707,922.00	0.21
203	000028	国药一致	17,071	707,422.24	0.21
204	000528	柳工	116,393	706,505.51	0.21
205	002440	闰土股份	78,391	705,519.00	0.21
206	002244	滨江集团	176,892	704,030.16	0.21
207	000685	中山公用	100,551	703,857.00	0.21
208	002051	中工国际	63,056	698,660.48	0.20
209	002407	多氟多	63,690	698,042.40	0.20
210	600026	中远海能	155,634	691,014.96	0.20
211	600598	北大荒	80,710	690,877.60	0.20
212	000807	云铝股份	177,811	689,906.68	0.20
213	002831	裕同科技	17,200	689,032.00	0.20
214	600348	阳泉煤业	136,654	688,736.16	0.20
215	601928	凤凰传媒	86,700	688,398.00	0.20
216	600664	哈药股份	173,605	685,739.75	0.20
217	600307	酒钢宏兴	355,899	679,767.09	0.20
218	600158	中体产业	76,356	678,804.84	0.20
219	600037	歌华有线	79,009	678,687.31	0.20

220	002701	奥瑞金	133,927	677,670.62	0.20
221	300113	顺网科技	53,259	676,921.89	0.20
222	002491	通鼎互联	85,801	676,111.88	0.20
223	600717	天津港	95,249	673,410.43	0.20
224	603816	顾家家居	14,900	670,500.00	0.20
225	601231	环旭电子	74,300	668,700.00	0.20
226	002408	齐翔腾达	97,067	663,938.28	0.19
227	600525	长园集团	150,918	661,020.84	0.19
228	600094	大名城	181,100	661,015.00	0.19
229	300459	金科文化	89,900	660,765.00	0.19
230	002690	美亚光电	31,050	660,744.00	0.19
231	002285	世联行	129,253	656,605.24	0.19
232	600563	法拉电子	15,578	656,456.92	0.19
233	601958	金钼股份	110,200	652,384.00	0.19
234	601880	大连港	351,636	650,526.60	0.19
235	002368	太极股份	28,019	650,040.80	0.19
236	600970	中材国际	118,560	648,523.20	0.19
237	300058	蓝色光标	149,052	646,885.68	0.19
238	000563	陕国投 A	240,750	645,210.00	0.19
239	600582	天地科技	188,324	644,068.08	0.19
240	002030	达安基因	63,268	642,802.88	0.19
241	600823	世茂股份	170,656	641,666.56	0.19
242	600291	西水股份	62,100	639,009.00	0.19
243	600216	浙江医药	73,457	637,606.76	0.19
244	603228	景旺电子	12,733	636,522.67	0.19
245	603658	安图生物	12,906	630,974.34	0.18
246	600120	浙江东方	50,018	628,226.08	0.18
247	300026	红日药业	205,647	627,223.35	0.18
248	300324	旋极信息	111,744	626,883.84	0.18
249	600167	联美控股	69,300	626,472.00	0.18
250	002672	东江环保	54,696	625,722.24	0.18
251	000717	韶钢松山	137,500	625,625.00	0.18
252	603883	老百姓	13,125	619,631.25	0.18
253	000400	许继电气	69,140	614,654.60	0.18
254	002414	高德红外	28,083	605,188.65	0.18
255	600633	浙数文化	74,124	604,110.60	0.18
256	000031	中粮地产	123,530	602,826.40	0.18
257	600901	江苏租赁	101,700	601,047.00	0.18
258	601100	恒立液压	30,300	600,243.00	0.18

259	002317	众生药业	70,565	589,217.75	0.17
260	002400	省广集团	198,012	586,115.52	0.17
261	000543	皖能电力	121,901	583,905.79	0.17
262	600597	光明乳业	69,830	583,778.80	0.17
263	002212	南洋股份	52,365	582,298.80	0.17
264	600017	日照港	209,894	579,307.44	0.17
265	600499	科达洁能	143,272	578,818.88	0.17
266	300055	万邦达	75,440	578,624.80	0.17
267	300010	立思辰	79,400	576,444.00	0.17
268	002280	联络互动	148,726	575,569.62	0.17
269	000758	中色股份	156,766	572,195.90	0.17
270	600171	上海贝岭	61,203	571,636.02	0.17
271	600645	中源协和	35,134	570,576.16	0.17
272	600648	外高桥	41,400	568,836.00	0.17
273	002444	巨星科技	59,833	567,216.84	0.17
274	600179	安通控股	84,420	561,393.00	0.16
275	601717	郑煤机	101,402	560,753.06	0.16
276	002242	九阳股份	35,012	560,542.12	0.16
277	002064	华峰氨纶	133,505	559,385.95	0.16
278	002131	利欧股份	379,884	558,429.48	0.16
279	000006	深振业 A	107,577	557,248.86	0.16
280	600073	上海梅林	74,721	556,671.45	0.16
281	300002	神州泰岳	168,502	556,056.60	0.16
282	600503	华丽家族	181,815	554,535.75	0.16
283	002366	台海核电	59,096	554,320.48	0.16
284	600978	宜华生活	134,879	553,003.90	0.16
285	600267	海正药业	65,653	550,828.67	0.16
286	002839	张家港行	102,700	549,445.00	0.16
287	600908	无锡银行	104,777	549,031.48	0.16
288	000718	苏宁环球	172,548	548,702.64	0.16
289	002563	森马服饰	61,300	546,796.00	0.16
290	002426	胜利精密	234,693	544,487.76	0.16
291	300244	迪安诊断	35,797	543,040.49	0.16
292	000926	福星股份	87,931	538,137.72	0.16
293	000078	海王生物	180,230	537,085.40	0.16
294	000848	承德露露	66,482	534,515.28	0.16
295	600835	上海机电	36,730	534,421.50	0.16
296	002128	露天煤业	74,429	532,911.64	0.16
297	002573	清新环境	73,794	532,792.68	0.16

298	002254	泰和新材	48,986	531,008.24	0.16
299	601200	上海环境	39,887	529,300.49	0.15
300	600098	广州发展	93,110	527,002.60	0.15
301	600751	海航科技	194,170	526,200.70	0.15
302	000564	供销大集	205,300	519,409.00	0.15
303	601678	滨化股份	122,650	517,583.00	0.15
304	002056	横店东磁	93,443	516,739.79	0.15
305	000156	华数传媒	64,919	514,807.67	0.15
306	600623	华谊集团	63,709	514,768.72	0.15
307	600141	兴发集团	50,011	514,613.19	0.15
308	603444	吉比特	3,477	514,596.00	0.15
309	002028	思源电气	52,116	514,384.92	0.15
310	601608	中信重工	197,200	512,720.00	0.15
311	002807	江阴银行	100,324	509,645.92	0.15
312	000877	天山股份	71,586	508,976.46	0.15
313	601326	秦港股份	161,900	508,366.00	0.15
314	600557	康缘药业	49,379	507,616.12	0.15
315	002359	北讯集团	61,669	506,302.49	0.15
316	000012	南玻A	126,766	505,796.34	0.15
317	002505	大康农业	311,711	504,971.82	0.15
318	000519	中兵红箭	79,686	501,224.94	0.15
319	600787	中储股份	100,017	500,085.00	0.15
320	000712	锦龙股份	54,668	496,385.44	0.15
321	600611	大众交通	124,101	495,162.99	0.14
322	300115	长盈精密	60,379	494,504.01	0.14
323	300199	翰宇药业	52,918	494,254.12	0.14
324	300287	飞利信	130,707	494,072.46	0.14
325	600993	马应龙	36,691	492,393.22	0.14
326	002745	木林森	43,414	490,144.06	0.14
327	600869	智慧能源	100,767	488,719.95	0.14
328	600316	洪都航空	49,353	488,101.17	0.14
329	601801	皖新传媒	72,700	485,636.00	0.14
330	603515	欧普照明	17,255	480,896.85	0.14
331	600750	江中药业	28,354	480,033.22	0.14
332	000021	深科技	83,465	479,923.75	0.14
333	600859	王府井	35,329	479,061.24	0.14
334	600545	卓郎智能	64,545	477,633.00	0.14
335	603766	隆鑫通用	116,685	477,241.65	0.14
336	000537	广宇发展	63,300	474,117.00	0.14

337	603659	璞泰来	10,000	474,000.00	0.14
338	600575	皖江物流	220,793	470,289.09	0.14
339	300159	新研股份	101,485	467,845.85	0.14
340	600777	新潮能源	244,000	466,040.00	0.14
341	600580	卧龙电气	73,625	463,837.50	0.14
342	002431	棕榈股份	128,749	459,633.93	0.13
343	000158	常山北明	87,780	458,211.60	0.13
344	600478	科力远	117,411	457,902.90	0.13
345	300308	中际旭创	11,200	455,728.00	0.13
346	600169	太原重工	204,347	455,693.81	0.13
347	000980	众泰汽车	105,200	455,516.00	0.13
348	000727	华东科技	308,922	454,115.34	0.13
349	000937	冀中能源	120,348	453,711.96	0.13
350	002517	恺英网络	122,122	453,072.62	0.13
351	600151	航天机电	114,202	452,239.92	0.13
352	603000	人民网	61,870	451,651.00	0.13
353	600757	长江传媒	69,153	450,877.56	0.13
354	600694	大商股份	18,625	450,538.75	0.13
355	002332	仙琚制药	73,035	447,704.55	0.13
356	000723	美锦能源	139,400	447,474.00	0.13
357	600155	华创阳安	59,279	446,370.87	0.13
358	300197	铁汉生态	117,350	444,756.50	0.13
359	002249	大洋电机	134,731	444,612.30	0.13
360	300376	易事特	105,554	444,382.34	0.13
361	600765	中航重机	59,072	439,495.68	0.13
362	002048	宁波华翔	42,101	439,113.43	0.13
363	601016	节能风电	189,100	438,712.00	0.13
364	600329	中新药业	35,100	436,644.00	0.13
365	600614	鹏起科技	120,126	431,252.34	0.13
366	000612	焦作万方	108,643	430,226.28	0.13
367	601127	小康股份	25,000	428,500.00	0.13
368	600565	迪马股份	163,962	426,301.20	0.12
369	600338	西藏珠峰	21,873	424,992.39	0.12
370	601311	骆驼股份	48,078	424,528.74	0.12
371	000426	兴业矿业	85,093	423,763.14	0.12
372	002424	贵州百灵	48,186	421,627.50	0.12
373	002544	杰赛科技	38,800	419,816.00	0.12
374	600770	综艺股份	88,817	418,328.07	0.12
375	002709	天赐材料	19,308	418,211.28	0.12

376	002093	国脉科技	57,294	417,673.26	0.12
377	600259	广晟有色	18,396	411,334.56	0.12
378	000600	建投能源	81,790	410,585.80	0.12
379	600874	创业环保	49,749	410,429.25	0.12
380	002635	安洁科技	36,197	410,112.01	0.12
381	002815	崇达技术	28,044	409,722.84	0.12
382	002233	塔牌集团	40,621	408,647.26	0.12
383	000049	德赛电池	14,203	407,342.04	0.12
384	601001	大同煤业	95,191	406,465.57	0.12
385	002482	广田集团	70,124	406,017.96	0.12
386	002434	万里扬	61,500	405,285.00	0.12
387	000501	鄂武商 A	42,610	403,942.80	0.12
388	002509	天广中茂	170,200	403,374.00	0.12
389	600594	益佰制药	72,070	397,826.40	0.12
390	600366	宁波韵升	79,246	397,022.46	0.12
391	601689	拓普集团	26,800	396,104.00	0.12
392	002276	万马股份	77,704	391,628.16	0.11
393	600053	九鼎投资	16,600	390,764.00	0.11
394	002002	鸿达兴业	135,408	389,975.04	0.11
395	300257	开山股份	39,003	389,639.97	0.11
396	600754	锦江股份	18,264	389,023.20	0.11
397	600416	湘电股份	75,268	388,382.88	0.11
398	002390	信邦制药	94,836	387,879.24	0.11
399	002375	亚厦股份	76,209	384,093.36	0.11
400	601003	柳钢股份	58,200	382,374.00	0.11
401	600657	信达地产	97,241	382,157.13	0.11
402	000541	佛山照明	73,588	381,185.84	0.11
403	000062	深圳华强	22,846	380,614.36	0.11
404	601869	长飞光纤	9,545	379,604.65	0.11
405	300134	大富科技	40,376	379,534.40	0.11
406	300266	兴源环境	106,980	377,639.40	0.11
407	002302	西部建设	42,700	377,468.00	0.11
408	002665	首航节能	133,914	376,298.34	0.11
409	000090	天健集团	81,542	375,093.20	0.11
410	603233	大参林	9,400	374,684.00	0.11
411	000061	农产品	77,172	374,284.20	0.11
412	600195	中牧股份	34,759	369,835.76	0.11
413	002512	达华智能	69,600	369,576.00	0.11
414	002707	众信旅游	58,069	366,996.08	0.11

415	603328	依顿电子	36,431	360,666.90	0.11
416	603568	伟明环保	15,770	360,344.50	0.11
417	002277	友阿股份	112,814	356,492.24	0.10
418	600640	号百控股	36,221	355,328.01	0.10
419	002818	富森美	16,900	351,351.00	0.10
420	002503	搜于特	149,384	351,052.40	0.10
421	600350	山东高速	76,600	349,296.00	0.10
422	000552	靖远煤电	136,198	348,666.88	0.10
423	603198	迎驾贡酒	24,600	347,106.00	0.10
424	600058	五矿发展	53,132	345,889.32	0.10
425	600759	洲际油气	143,571	338,827.56	0.10
426	000990	诚志股份	28,157	338,165.57	0.10
427	600240	华业资本	129,741	336,029.19	0.10
428	600773	西藏城投	55,984	335,904.00	0.10
429	600122	宏图高科	92,277	334,965.51	0.10
430	002354	天神娱乐	63,688	333,725.12	0.10
431	300297	蓝盾股份	66,500	332,500.00	0.10
432	002344	海宁皮城	73,038	332,322.90	0.10
433	600639	浦东金桥	29,465	331,775.90	0.10
434	600748	上实发展	62,124	331,742.16	0.10
435	000829	天音控股	58,914	330,507.54	0.10
436	600006	东风汽车	91,031	327,711.60	0.10
437	002663	普邦股份	132,297	326,773.59	0.10
438	002489	浙江永强	123,394	325,760.16	0.10
439	603806	福斯特	12,151	325,646.80	0.10
440	600086	东方金钰	69,792	321,741.12	0.09
441	600971	恒源煤电	56,900	320,347.00	0.09
442	000969	安泰科技	70,200	319,410.00	0.09
443	600428	中远海特	97,580	317,135.00	0.09
444	002642	荣之联	48,300	311,052.00	0.09
445	600458	时代新材	45,380	307,676.40	0.09
446	603866	桃李面包	6,700	302,572.00	0.09
447	000766	通化金马	43,786	300,371.96	0.09
448	601990	南京证券	34,500	300,150.00	0.09
449	000536	华映科技	157,120	293,814.40	0.09
450	603888	新华网	22,850	293,394.00	0.09
451	002251	步步高	39,230	291,086.60	0.09
452	603377	东方时尚	19,900	290,540.00	0.08
453	603556	海兴电力	22,120	287,560.00	0.08



454	600939	重庆建工	62,300	287,203.00	0.08
455	601777	力帆股份	74,839	285,136.59	0.08
456	000587	金洲慈航	120,551	283,294.85	0.08
457	603225	新凤鸣	15,047	282,131.25	0.08
458	000025	特力A	10,625	281,775.00	0.08
459	002437	誉衡药业	99,836	279,540.80	0.08
460	002308	威创股份	62,086	276,282.70	0.08
461	603355	莱克电气	12,703	273,114.50	0.08
462	601019	山东出版	34,200	267,444.00	0.08
463	002477	雏鹰农牧	178,047	267,070.50	0.08
464	000987	越秀金控	33,506	267,042.82	0.08
465	300156	神雾环保	73,400	266,442.00	0.08
466	600862	中航高科	47,189	264,258.40	0.08
467	600335	国机汽车	42,318	264,064.32	0.08
468	600126	杭钢股份	57,560	259,595.60	0.08
469	600743	华远地产	106,851	258,579.42	0.08
470	002681	奋达科技	70,617	258,458.22	0.08
471	002588	史丹利	65,537	254,938.93	0.07
472	002118	紫鑫药业	58,223	253,852.28	0.07
473	002345	潮宏基	55,100	246,297.00	0.07
474	600393	粤泰股份	115,355	244,552.60	0.07
475	002416	爱施德	40,920	240,609.60	0.07
476	600996	贵广网络	35,647	226,714.92	0.07
477	300202	聚龙股份	34,536	222,411.84	0.06
478	002920	德赛西威	12,800	222,080.00	0.06
479	600687	刚泰控股	53,458	221,850.70	0.06
480	603486	科沃斯	4,800	220,944.00	0.06
481	002041	登海种业	40,523	218,418.97	0.06
482	002699	美盛文化	39,090	214,213.20	0.06
483	600280	中央商场	65,009	211,279.25	0.06
484	603712	七一二	11,600	206,596.00	0.06
485	300291	华录百纳	45,955	204,499.75	0.06
486	603056	德邦股份	12,270	203,068.50	0.06
487	603169	兰石重装	47,500	202,825.00	0.06
488	600184	光电股份	20,700	202,239.00	0.06
489	601969	海南矿业	43,800	196,224.00	0.06
490	603868	飞科电器	4,866	185,783.88	0.05
491	601811	新华文轩	18,027	167,831.37	0.05
492	603025	大豪科技	14,341	159,902.15	0.05

493	002147	新光圆成	50,500	156,550.00	0.05
494	601020	华钰矿业	17,960	151,941.60	0.04
495	600618	氯碱化工	23,356	151,580.44	0.04
496	000761	本钢板材	43,320	145,555.20	0.04
497	600917	重庆燃气	19,853	141,353.36	0.04
498	603650	彤程新材	6,976	138,334.08	0.04
499	603877	太平鸟	5,894	110,748.26	0.03
500	603569	长久物流	9,290	99,867.50	0.03
501	603185	上机数控	1,345	66,039.50	0.02
502	601860	紫金银行	15,970	50,145.80	0.01
503	603629	利通电子	1,051	40,684.21	0.01

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300347	泰格医药	1,916,149.00	0.72
2	000998	隆平高科	1,879,991.82	0.70
3	000661	长春高新	1,841,370.37	0.69
4	002465	海格通信	1,812,211.20	0.68
5	002129	中环股份	1,757,398.00	0.66
6	000623	吉林敖东	1,608,722.18	0.60
7	300315	掌趣科技	1,591,041.00	0.59
8	600699	均胜电子	1,558,546.00	0.58
9	300450	先导智能	1,542,059.69	0.58
10	601005	重庆钢铁	1,530,407.00	0.57
11	000703	恒逸石化	1,479,896.00	0.55
12	000750	国海证券	1,421,780.24	0.53
13	300413	芒果超媒	1,380,032.47	0.52
14	300418	昆仑万维	1,363,556.00	0.51
15	600760	中航沈飞	1,317,900.00	0.49
16	002110	三钢闽光	1,309,582.00	0.49
17	002049	紫光国微	1,299,964.00	0.49
18	300168	万达信息	1,285,026.00	0.48
19	002507	涪陵榨菜	1,267,113.00	0.47

20	600820	隧道股份	1,256,173.00	0.47
----	--------	------	--------------	------

注：不考虑相关交易费用。

#### 8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	000661	长春高新	3,555,155.22	1.33
2	002422	科伦药业	2,398,028.63	0.90
3	600516	方大炭素	2,394,461.85	0.89
4	603019	中科曙光	2,094,501.81	0.78
5	600176	中国巨石	2,090,805.00	0.78
6	002405	四维图新	1,837,259.86	0.69
7	000977	浪潮信息	1,806,982.13	0.68
8	000703	恒逸石化	1,766,061.00	0.66
9	002179	中航光电	1,726,372.94	0.64
10	000786	北新建材	1,721,397.63	0.64
11	002271	东方雨虹	1,595,373.34	0.60
12	600760	中航沈飞	1,555,281.00	0.58
13	000998	隆平高科	1,432,757.96	0.54
14	002001	新 和 成	1,381,238.05	0.52
15	603589	口子窖	1,331,669.92	0.50
16	000825	太钢不锈	1,307,231.61	0.49
17	002311	海大集团	1,283,772.75	0.48
18	002050	三花智控	1,280,056.88	0.48
19	600004	白云机场	1,248,525.00	0.47
20	601233	桐昆股份	1,206,780.90	0.45

注：不考虑相关交易费用。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	230,243,748.30
卖出股票收入（成交）总额	110,629,141.68

注：不考虑相关交易费用。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

## 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

## 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

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

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

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

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情形。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	27,120.54
2	应收证券清算款	261,798.79
3	应收股利	-
4	应收利息	667.75
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	289,587.08

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有可转换债券。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

#### 9.1.1 本基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
6,162	62,711.75	186,389,270.00	48.23%	200,040,531.00	51.77%

### 9.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额（份）	占总份额比例
联接基金	179,361,728.00	46.42%

### 9.3 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额 比例
1	赵熙逸	38,260,678.00	9.90%
2	林银辉	2,421,400.00	0.63%
3	兰树华	2,200,000.00	0.57%
4	方正证券股份有限公司	1,781,264.00	0.46%
5	上海市邮政公司企业年金计划—中 国建设银行	1,580,600.00	0.41%
6	梁楚乔	1,095,500.00	0.28%
7	刘正周	1,084,900.00	0.28%
8	卢茵	1,064,700.00	0.28%
9	宗士才	1,050,000.00	0.27%
10	姚长平	1,036,100.00	0.27%
11	中国银行股份有限公司—华泰柏瑞 中证 500 交易型开放式指数证券	179,361,728.00	46.42%

注：前十名持有人为除华泰柏瑞中证 500ETF 联接基金之外的前十名持有人。

### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：本报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

### 9.5 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
----	-------------------

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015 年 5 月 13 日）基金份额总额	873,820,061.00
本报告期期初基金份额总额	206,429,801.00
本报告期期间基金总申购份额	210,000,000.00
减:本报告期期间基金总赎回份额	30,000,000.00
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	386,429,801.00



## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2018 年 8 月 20 日，公司任命李晓西先生为公司副总经理，李晓西先生已通过高级管理人员证券投资法律知识考试，其任命已在中国证券投资基金业协会备案。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

报告期内，2018 年 8 月，刘连舸先生担任中国银行股份有限公司行长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未改聘为其审计的会计师事务所。本报告期基金应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 60,000.00 元人民币，该事务所已向本基金提供了 4 年的审计服务。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内基金管理人、基金托管人的托管业务部门及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券	1	55,850,532.61	16.57%	50,897.36	16.47%	-
长城证券	1	55,264,786.00	16.40%	50,362.40	16.30%	-
华融证券	1	52,457,932.26	15.57%	47,805.26	15.47%	-
中投证券	1	49,473,202.49	14.68%	45,085.71	14.59%	-
齐鲁证券	2	43,298,721.36	12.85%	40,323.79	13.05%	-
国都证券	1	32,802,188.48	9.73%	30,549.12	9.89%	-
民生证券	1	25,306,666.44	7.51%	23,062.28	7.46%	-
国泰君安	1	11,562,541.96	3.43%	10,768.98	3.48%	-
国信证券	2	5,710,367.15	1.69%	5,318.38	1.72%	-
海通证券	2	2,608,881.40	0.77%	2,377.47	0.77%	-
国元证券	1	2,290,568.37	0.68%	2,133.25	0.69%	-
西南证券	1	369,459.90	0.11%	344.07	0.11%	-
国联证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
西藏同信	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	4	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
北京高华	1	-	-	-	-	-

华创证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	3	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
财富证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-

注：1、选择代理证券买卖的证券经营机构的标准：

- 1) 资金雄厚，信誉良好。
- 2) 财务状况良好，经营行为规范，最近一年未因重大违规行为而受到有关管理机关的处罚。
- 3) 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) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时、定期、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。

3、上述交易单元均系本报告期内租用。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信证券	-	-	-	-	-	-

长城证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	21,594.50	100.00%	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
西藏同信	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
北京高华	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-

东北证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下 54 只证券投资基金修改基金合同和托管协议的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 3 月 23 日
2	华泰柏瑞基金管理有限公司旗下基金投资资产支持证券的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 4 月 2 日
3	华泰柏瑞基金管理有限公司关于聘任副总经理的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 8 月 21 日
4	华泰柏瑞基金关于网上直销平台(含移动终端)开通中国建设银行基金快捷支付业务并实施交易费率优惠活动	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 9 月 19 日
5	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加基金直销账户的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 9 月 25 日
6	华泰柏瑞基金关于网上直销平台(含移动终端)开通中国银行基金快捷支付业务并实施交易费率优惠活动	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 10 月 9 日
7	华泰柏瑞基金关于网上直销平台(含移动终端)开通中国民生银行基金快捷支付业务并实施交易费率优惠活动	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 10 月 9 日
8	华泰柏瑞基金关于网上直销平台(含移动终端)开通招商银行直付通支付业务并实施交易费率优惠活动	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 12 月 25 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
联接基金	1	20180101-20181231	102,805,231.00	127,773,600.00	51,217,103.00	179,361,728.00	46.42%

#### 产品特有风险

本基金报告期内联接基金持有基金份额超过 20%的情形。如果这些份额持有比例较大的投资者赎回，可能导致巨额赎回，从而引发流动性风险，可能对基金产生如下影响：（1）延期办理赎回申请或暂停赎回的风险。当发生巨额赎回时，投资者可能面临赎回申请延期办理、延缓支付或暂停赎回的风险。（2）基金净值大幅波动的风险。基金管理人为了应对大额赎回可能短时间内进行资产变现，这将对基金资产净值产生不利影响，同时可能发生大额赎回费用归入基金资产、基金份额净值保留位数四舍五入等问题，这些都可能会造成基金资产净值的较大波动。（3）基金投资目标偏离的风险。单一投资者大额赎回后可能导致基金规模缩小，基金将面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形，从而使得实现基金投资目标存在一定的不确定性。（4）基金合同提前终止的风险。如果投资者大额赎回可能导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。本基金管理人将密切关注申赎动向，审慎评估大额申赎对基金持有集中度的影响，同时将完善流动性风险管控机制，最大限度的保护基金份额持有人的合法权益。

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金募集的文件
- 2、《华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- 3、《华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》
- 4、《华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的公告

### 13.2 存放地点

上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层  
托管人住所

### 13.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司。

客户服务热线：400-888-0001（免长途费） 021-3878 4638

公司网址：www.huatai-pb.com

华泰柏瑞基金管理有限公司

2019 年 3 月 27 日