

# 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 2019 年年度报告

2019 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：2020 年 3 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 3 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 2019 年 1 月 1 日起至 2019 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	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 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.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
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.....	15
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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	17
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明.....	错误！未定义书签。
4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	18
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>19</b>
6.1 审计报告基本信息.....	19
6.2 审计报告的基本内容.....	19
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>22</b>
7.1 资产负债表.....	22
7.2 利润表.....	23
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	24
7.4 报表附注.....	25
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>53</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	53
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	53
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.....	54
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	62
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	64
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.....	64

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 .....	64
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	65
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	65
8.10 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 .....	65
8.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	65
8.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	65
8.13 投资组合报告附注 .....	65
<b>§9 基金份额持有人信息.....</b>	<b>67</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	67
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	67
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	67
<b>§ 10 开放式基金份额变动.....</b>	<b>68</b>
<b>§ 11 重大事件揭示.....</b>	<b>69</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	69
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 .....	69
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	69
11.4 基金投资策略的改变 .....	69
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	69
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	69
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	69
11.8 其他重大事件 .....	71
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>75</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 .....	75
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	75
<b>§13 备查文件目录.....</b>	<b>76</b>
13.1 备查文件目录 .....	76
13.2 存放地点 .....	76
13.3 查阅方式 .....	76

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金
基金简称	华泰柏瑞上证中小盘 ETF 联接
基金主代码	460220
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 1 月 26 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	60,195,593.34 份
基金合同存续期	不定期

#### 2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	510220
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2011年1月26日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2011年3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	本基金为华泰柏瑞上证中小盘 ETF 的联接基金。华泰柏瑞上证中小盘 ETF 是采用完全复制法实现对上证中小盘指数紧密跟踪的全被动指数基金，本基金主要通过投资于华泰柏瑞上证中小盘 ETF 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对华泰柏瑞上证中小盘 ETF 进行投资。
业绩比较基准	上证中小盘指数 × 95% + 银行活期存款税后收益率 × 5%
风险收益特征	本基金为华泰柏瑞上证中小盘 ETF 的联接基金，采用主要投资于上证中小盘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上证中小盘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	上证中小盘指数
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	许俊
	联系电话	021-38601777	010-66594319
	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	刘连舸

### 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
登载基金年度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	
基金年度报告备置地点	上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层及基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
注册登记机构	华泰柏瑞基金管理有限公司	上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 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	2019 年	2018 年	2017 年
本期已实现收益	-108,869.35	-271,375.48	26,414.90
本期利润	15,124,872.75	-15,010,045.91	3,528,302.16
加权平均基金份额本期利润	0.2591	-0.2627	0.0735
本期加权平均净值利润率	25.20%	-26.17%	6.79%
本期基金份额净值增长率	30.11%	-23.51%	9.26%
3.1.2 期末数据和指标	2019 年末	2018 年末	2017 年末
期末可供分配利润	6,762,213.22	-8,409,584.77	6,632,153.34
期末可供分配基金份额利润	0.1123	-0.1451	0.1177
期末基金资产净值	66,957,806.56	49,562,736.36	62,976,910.40
期末基金份额净值	1.1123	0.8549	1.1177
3.1.3 累计期末指标	2019 年末	2018 年末	2017 年末
基金份额累计净值增长率	11.23%	-14.51%	11.77%

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

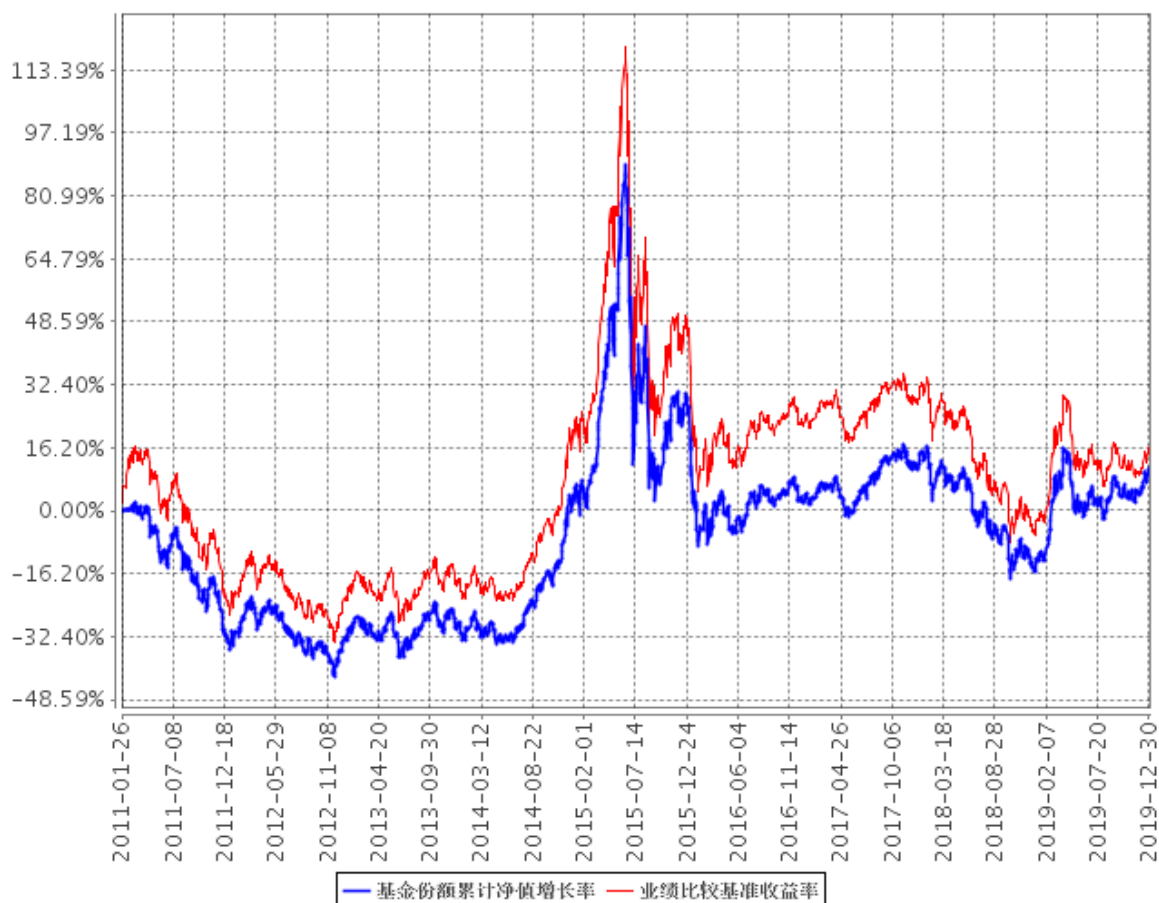
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	7.34%	0.76%	5.14%	0.73%	2.20%	0.03%
过去六个月	7.05%	0.86%	1.95%	0.85%	5.10%	0.01%
过去一年	30.11%	1.24%	22.58%	1.26%	7.53%	-0.02%
过去三年	8.73%	1.09%	-4.27%	1.11%	13.00%	-0.02%
过去五年	7.57%	1.62%	-2.89%	1.65%	10.46%	-0.03%
自基金合同生效起至今	11.23%	1.47%	16.74%	1.49%	-5.51%	-0.02%



### 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

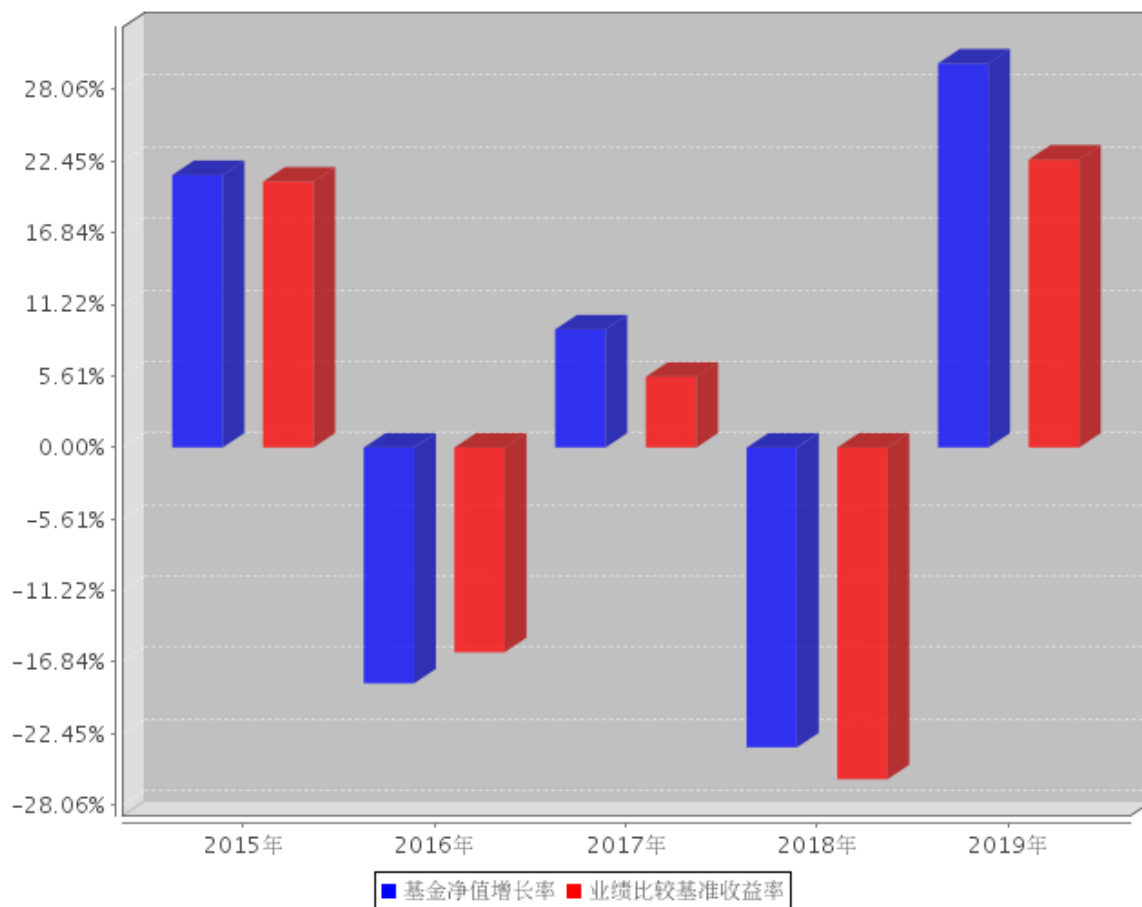
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：图示日期为 2011 年 1 月 26 日至 2019 年 12 月 31 日。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司。华泰柏瑞基金管理有限公司是经中国证监会批准，于 2004 年 11 月 18 日成立的合资基金管理公司，注册资本为 2 亿元人民币。目前的股东构成为华泰证券股份有限公司、柏瑞投资有限责任公司（原 AIGGIC）和苏州新区高新技术产业股份有限公司，出资比例分别为 49%、49% 和 2%。目前公司旗下管理华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金、华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金、上证红利交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金、华泰柏瑞货币市场证券投资基金、华泰柏瑞行业领先混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化先行混合型证券投资基金、华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金、上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金、华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金、华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金、华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金、华泰柏瑞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、华泰柏瑞核心优势混合型证券投资基金、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。截至 2019 年 12 月 31 日，公司基金管理规模为 1077.13 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	2011 年 1 月 26 日	-	18 年	18 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，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 月起担任指数投资部副总监。2011 年 1 月起兼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 月起兼任华泰柏瑞沪深 300ETF 基金、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

					<p>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 月起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。</p>
李孝华	本基金的基金经理助理	2017 年 11 月 9 日	2019 年 10 月 11 日	6 年	<p>南开大学金融学硕士。2013 年 7 月至 2014 年 4 月任金瑞期货有限公司贵金属研究员，2014 年 4 月至 2015 年 4 月任国泰君安信息技术有限公司量化产品设计师。2015 年 4 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，任指数投资部研究员。2017 年 11 月起任华泰柏瑞（原友邦华泰）上证红利交易型开放式指数证券投资基金、上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金及上证中小盘交易型开放式指数证券投资</p>

					基金联接基金的基金经理助理。
李茜	本基金的基金经理	2019年11月5日	-	4年	曾任职于上海市虹口区金融服务局。2015年3月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任指数投资部助理研究员、研究员。2019年11月起任上证红利交易型开放式指数证券投资基金、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。柳军 2020 年 2 月 13 日离任本基金基金经理。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

##### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司将投资管理职能和交易执行职能完全隔离，实行集中交易制度，由交易部

为公募基金、专户理财和海外投资等业务统一交易服务，为公平交易的实施提供了较好的保障。目前公司公募基金、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。

本报告期公司旗下基金所管理的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

今年全年市场呈现出普涨行情，以电子、食品饮料、家用电器等板块表现靓丽，期间申万电子材料行业指数上涨达 73.77%，申万食品饮料行业指数上涨 72.87%。整体来看，期间沪深 300、中证 500 和中证 1000 分别上涨 36.07%、26.38% 和 25.67%，创业板指受益于科技股结构性行情表现突出，期间上涨 43.79%。从市场风格来看，成长性风格依旧表现强势，表现显著优于价值风格，期间沪深 300 价值指数和沪深 300 成长指数分别录得 24.14% 和 53.94% 的收益，中证 500 成长相对中证 500 价值亦同样获得了显著的超额收益。

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，本基金的累计跟踪偏离为 7.548%，日均绝对跟踪偏离度为 0.042%，期间日跟踪误差为 0.116%，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 1.1123 元；本报告期基金份额净值增长率为 30.11%，业绩比较基准收益率为 22.58%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，年底全球主要经济体数据企稳缓升、中美经贸阶段协议文本接近签署等内外利好，全球风险偏好回升，风险资产普遍上涨，此前两月明显落后全球市场的 A 股发力领涨全球，主要指数周线录得四连阳。当前 A 股估值仍处于平均值之下，且靠近负一倍标准差。从估值上看，提升空间仍然较大。盈利方面，A 股当前的盈利增速是显著攀升的。如果按照前三季度线性推导第四季度盈利（隐含四季度盈利修复预期），整体来看市场的盈利修复可期。同时，ROE 处在回落企稳之中。2020 年是重整旗鼓再出发的一年。尽管我们面临着去杠杆到期的考验，但是经历 2018 年和 2019 年之后，市场的认知更为理性，定价中所隐含的风险预期较为充分。我们认为，2020 年宽松背景下的全球增长和中国环境将变得友好，风险偏好有望略微抬升。

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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2019 年度，本基金管理人在为基金份额持有人谋求最大利益的同时，始终将合规运作、防范风险工作放在各项工作的首位。依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。公司监察部门按照规定的权限和程序，通过实时监控、现场检查、重点抽查和人员询问等方法，独立地开展基金运作和公司管理的合规性稽核，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向董事长和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

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

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

(2) 开展定期和专项监察稽核工作，确保各项业务活动的合法合规

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

(3) 促进公司各项内部管理制度的完善



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

#### (4) 通过各种合规培训提高员工合规意识

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

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

### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，基金管理人严格执行基金估值控制流程，定期评估估值技术的合理性，每日将估值结果报托管银行复核后对外披露。参与估值流程的人员包括负责运营的副总经理以及投资研究、风险控制、金融工程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，本基金未进行利润分配。

### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

注：无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在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（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(2020)第 22568 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	华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接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上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“华泰柏瑞上证中小盘 ETF 联接基金”)的财务报表,包括 2019 年 12 月 31 日的资产负债表,2019 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了华泰柏瑞上证中小盘 ETF 联接基金 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于华泰柏瑞上证中小盘 ETF 联接基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>华泰柏瑞上证中小盘 ETF 联接基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p>

	<p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估华泰柏瑞上证中小盘 ETF 联接基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算华泰柏瑞上证中小盘 ETF 联接基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督华泰柏瑞上证中小盘 ETF 联接基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p>

	<p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时, 根据获取的审计证据, 就可能导致对华泰柏瑞上证中小盘 ETF 联接基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性, 审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露; 如果披露不充分, 我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而, 未来的事项或情况可能导致华泰柏瑞上证中小盘 ETF 联接基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容, 并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通, 包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
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	张炯   朱宏宇
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	2020 年 3 月 27 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：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

报告截止日：2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	3,422,559.87	2,991,818.85
结算备付金		-	-
存出保证金		2,715.77	1,153.52
交易性金融资产	7.4.7.2	63,685,933.90	46,653,857.60
其中：股票投资		1,515,599.50	24,757.60
基金投资		62,050,262.40	46,629,100.00
债券投资		120,072.00	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	5,464.04
应收利息	7.4.7.5	3,401.63	654.26
应收股利		-	-
应收申购款		104,002.79	1,544.35
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		67,218,613.96	49,654,492.62
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2018 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		147,673.32	-
应付管理人报酬		2,059.80	1,453.93
应付托管费		411.94	290.78
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	516.38	11.55

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	110,145.96	90,000.00
负债合计		260,807.40	91,756.26
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	60,195,593.34	57,972,321.13
未分配利润	7.4.7.10	6,762,213.22	-8,409,584.77
所有者权益合计		66,957,806.56	49,562,736.36
负债和所有者权益总计		67,218,613.96	49,654,492.62

注：报告截止日 2019 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.1123 元，基金份额总额 60,195,593.34 份。

## 7.2 利润表

会计主体：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

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		15,269,178.15	-14,891,005.38
1.利息收入		24,478.03	23,765.09
其中：存款利息收入	7.4.7.11	24,371.59	22,967.28
债券利息收入		106.44	797.81
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）		4,860.60	-177,455.98
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-24,424.81	-175,354.02
基金投资收益	7.4.7.13	15,801.01	-13,304.03
债券投资收益	7.4.7.14	26.39	213.00
资产支持证券投资收益	7.4.7.14.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-	-
股利收益	7.4.7.17	13,458.01	10,989.07
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	15,233,742.10	-14,738,670.43
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	6,097.42	1,355.94
<b>减：二、费用</b>		144,305.40	119,040.53
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	21,044.34	20,751.22

2. 托管费	7.4.10.2.2	4,208.87	4,150.21
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.20	7,980.76	3,099.10
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	7.4.7.21	111,071.43	91,040.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		15,124,872.75	-15,010,045.91
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		15,124,872.75	-15,010,045.91

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：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

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 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）	57,972,321.13	-8,409,584.77	49,562,736.36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	15,124,872.75	15,124,872.75
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）	2,223,272.21	46,925.24	2,270,197.45
其中：1.基金申购款	7,709,941.53	412,994.83	8,122,936.36
2.基金赎回款	-5,486,669.32	-366,069.59	-5,852,738.91
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）	60,195,593.34	6,762,213.22	66,957,806.56
项目	上年度可比期间 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）	56,344,757.06	6,632,153.34	62,976,910.40
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-15,010,045.91	-15,010,045.91
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）	1,627,564.07	-31,692.20	1,595,871.87
其中：1.基金申购款	3,045,932.60	44,840.89	3,090,773.49
2.基金赎回款	-1,418,368.53	-76,533.09	-1,494,901.62
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	57,972,321.13	-8,409,584.77	49,562,736.36

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

华泰柏瑞上证中小盘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”)证监基金字[2010]第 1535 号《关于核准上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金及其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《华泰柏瑞上证中小盘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 482,542,072.50 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(2011)第 26 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《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基金合同》于 2011 年 1 月 26 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 482,562,901.50 份基金份额，其中认购资金利息折合 20,829.00 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。

本基金为上证中小盘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上证中小盘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《华泰柏瑞上证中小盘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,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括目标 ETF、上证中小盘指数成份股及备选成份股、非成份股、债券、新股(一级市场初次发行和增发)、股指期货、货币市场工具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上证中小盘指数  $\times$  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 2020 年 3 月 27 日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华泰柏瑞上证中小盘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 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 2019 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 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 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、基金投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

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

#### (2) 金融负债的分类

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

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、基金投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

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

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

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

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

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

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

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

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[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，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。

#### 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 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
活期存款	3,422,559.87	2,991,818.85
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：	3,422,559.87	2,991,818.85

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动



股票		1,500,202.66	1,515,599.50	15,396.84
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	119,976.00	120,072.00	96.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	119,976.00	120,072.00	96.00
资产支持证券		-	-	-
基金		59,957,465.40	62,050,262.40	2,092,797.00
其他		-	-	-
合计		61,577,644.06	63,685,933.90	2,108,289.84
项目	上年度末 2018年12月31日			
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		23,776.59	24,757.60	981.01
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		59,755,533.27	46,629,100.00	-13,126,433.27
其他		-	-	-
合计		59,779,309.86	46,653,857.60	-13,125,452.26

### 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，本基金买入返售金融资产余额为0。

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：截至本报告期末及上年度末，本基金未持有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 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
应收活期存款利息	749.82	653.71
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	-	-
应收债券利息	2,650.49	-
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	1.32	0.55
合计	3,401.63	654.26

#### 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 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
交易所市场应付交易费用	516.38	11.55
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	516.38	11.55

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	145.96	-
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	110,000.00	90,000.00
合计	110,145.96	90,000.00

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	57,972,321.13	57,972,321.13
本期申购	7,709,941.53	7,709,941.53

本期赎回(以“-”号填列)	-5,486,669.32	-5,486,669.32
- 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	60,195,593.34	60,195,593.34

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	25,409,560.84	-33,819,145.61	-8,409,584.77
本期利润	-108,869.35	15,233,742.10	15,124,872.75
本期基金份额交易产生的变动数	975,555.50	-928,630.26	46,925.24
其中：基金申购款	3,380,962.68	-2,967,967.85	412,994.83
基金赎回款	-2,405,407.18	2,039,337.59	-366,069.59
本期已分配利润	-	-	-
本期末	26,276,246.99	-19,514,033.77	6,762,213.22

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日
活期存款利息收入	24,295.16	22,901.24
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	47.74	34.49
其他	28.69	31.55
合计	24,371.59	22,967.28

#### 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 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	47,756.41	15,430.80

股票投资收益——赎回差价收入	-	-
股票投资收益——申购差价收入	-72,181.22	-190,784.82
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	-24,424.81	-175,354.02

#### 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 2019年1月1日至2019 年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年 12月31日
卖出股票成交总额	2,091,352.93	284,651.80
减：卖出股票成本总额	2,043,596.52	269,221.00
买卖股票差价收入	47,756.41	15,430.80

#### 7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无股票赎回差价收入。

#### 7.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年 12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12 月31日
申购基金份额总额	1,982,650.00	3,764,450.00
减：现金支付申购款总额	-3,378.41	6,914.83
减：申购股票成本总额	2,058,209.63	3,948,319.99
申购差价收入	-72,181.22	-190,784.82

#### 7.4.7.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

#### 7.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12 月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12 月31日
卖出/赎回基金成交总额	2,114,662.60	187,005.72
减：卖出/赎回基金成本总额	2,098,861.59	200,309.75
基金投资收益	15,801.01	-13,304.03

#### 7.4.7.14 债券投资收益

##### 7.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年 12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018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	26.39	213.00
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	26.39	213.00

##### 7.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年 12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月 31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,026.50	252,780.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,000.00	248,485.00
减：应收利息总额	0.11	4,082.00
买卖债券差价收入	26.39	213.00

##### 7.4.7.14.3 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。

##### 7.4.7.14.4 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。

##### 7.4.7.14.5 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。

### 7.4.7.15 贵金属投资收益

#### 7.4.7.15.1 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。

#### 7.4.7.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

#### 7.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

#### 7.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

### 7.4.7.16 衍生工具收益

#### 7.4.7.16.1 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。

#### 7.4.7.16.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

### 7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日
股票投资产生的股利收益	13,458.01	10,989.07
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	13,458.01	10,989.07

### 7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日
1. 交易性金融资产	15,233,742.10	-14,738,670.43
——股票投资	14,415.83	-1,136.49

——债券投资	96.00	20.00
——基金投资	15,219,230.27	-14,737,553.94
——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	15,233,742.10	-14,738,670.43

#### 7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年 12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12 月31日
基金赎回费收入	6,002.63	1,317.96
转换费收入	94.79	37.98
合计	6,097.42	1,355.94

注：

- 1、本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金财产。
- 2、本基金的转换费由转出基金赎回费用及基金申购补差费用构成，其中不低于转出基金赎回费用的 25% 的部分归入转出基金的基金财产。

#### 7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12 月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月 31日
交易所市场交易费用	7,723.72	2,863.23
银行间市场交易费用	-	-
交易基金产生的费用	257.04	235.87
其中：申购费	121.54	223.35
赎回费	119.44	-
交易费	16.06	12.52
合计	7,980.76	3,099.10

### 7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年 12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12 月31日
审计费用	60,000.00	60,000.00
信息披露费	50,000.00	30,000.00
证券出借违约金	-	-
银行划款手续费	1,071.43	1,040.00
合计	111,071.43	91,040.00

### 7.4.7.22 分部报告

注：本基金本报告期无分部报告。

### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 7.4.8.1 或有事项

注：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

注：本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华泰柏瑞基金管理有限公司（“华泰柏瑞基金”）	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金销售机构
PineBridge Investment LLC	基金管理人的股东
华泰证券股份有限公司（“华泰证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
苏州新区高新技术产业股份有限公司	基金管理人的股东
上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金（“目标ETF”）	本基金的基金管理人管理的其他基金
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
柏瑞爱建资产管理（上海）有限公司	基金管理人的控股子公司



注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年12月31日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
华泰证券	5,109,899.57	92.55%	-	-

##### 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与关联方未进行权证交易。

##### 7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
华泰证券	4,759.28	92.55%	425.40	82.38%
关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
华泰证券	-	-	-	-

注：

1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。
2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	21,044.34	20,751.22
其中：支付销售机构的客户维护费	25,055.58	22,191.40

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扣除所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产后的余额(若为负数，则取零)的 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 - 前一日所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产) × 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	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	4,208.87	4,150.21

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 0.10%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 - 基金财产中目标 ETF 份额所对应的资产净值) × 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：本基金本期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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

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

注：无。

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

注：无。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

注：本报告期及上年度，基金管理人未投资本基金。

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

注：本报告期末及上年度末，除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2019年1月1日至2019年12月31日		2018年1月1日至2018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	3,422,559.87	24,295.16	2,991,818.85	22,901.24

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。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

于2019年12月31日，本基金持有14,574,000份目标ETF基金份额，占其总份额的比例为75.79%(2018年12月31日：本基金持有14,500,000份目标ETF基金份额，占其总份额的比例为77.42%)。

#### 7.4.11 利润分配情况

##### 7.4.11.1 按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2019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

注：无。

##### 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	停牌日	停牌	期末	复牌日	复牌	数量(股)	期末	期末估值	备注
------	-----	-----	----	----	-----	----	-------	----	------	----

码	称	期	原因	估值单价	期	开盘单价		成本总额	总额	
603799	华友钴业	2019 年 12 月 31 日	重大事项	39.39	2020 年 1 月 2 日	40.43	300	8,256.00	11,817.00	-

注：本基金截至 2019 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

注：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，本基金从事交易所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。

### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

## 7.4.13 金融工具风险及管理

### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于 ETF 联接基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，紧密跟踪标的指数，具有和标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。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，将风险控制可在可承受的范围内。

#### 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；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末	上年度末
--------	-----	------

	2019 年 12 月 31 日	2018 年 12 月 31 日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	120,072.00	0.00
合计	120,072.00	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。

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

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

于 2019 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2019 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 0.02%。

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

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的

流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或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、存出保证金和债券投资等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019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	3,422,559.87	-	-	-	-	-	3,422,559.87
存出保证金	2,715.77	-	-	-	-	-	2,715.77
交易性金融资产	120,072.00	-	-	-	-	63,565,861.90	63,685,933.90



应收利息	-	-	-	-	-	3,401.63	3,401.63
应收申购款	-	-	-	-	-	104,002.79	104,002.79
资产总计	3,545,347.64	-	-	-	-	63,673,266.32	67,218,613.96
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	147,673.32	147,673.32
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,059.80	2,059.80
应付托管费	-	-	-	-	-	411.94	411.94
应付交易费用	-	-	-	-	-	516.38	516.38
其他负债	-	-	-	-	-	110,145.96	110,145.96
负债总计	-	-	-	-	-	260,807.40	260,807.40
利率敏感度缺口	3,545,347.64	-	-	-	-	63,412,458.92	66,957,806.56
上年度末 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
资产							
银行存款	2,991,818.85	-	-	-	-	-	2,991,818.85
存出保证金	1,153.52	-	-	-	-	-	1,153.52
交易性金融资产	-	-	-	-	-	46,653,857.60	46,653,857.60
应收证券清算款	-	-	-	-	-	5,464.04	5,464.04
应收利息	-	-	-	-	-	654.26	654.26
应收申购款	-	-	-	-	-	1,544.35	1,544.35
资产总计	2,992,972.37	-	-	-	-	46,661,520.25	49,654,492.62
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,453.93	1,453.93
应付托管费	-	-	-	-	-	290.78	290.78
应付交易费用	-	-	-	-	-	11.55	11.55
其他负债	-	-	-	-	-	90,000.00	90,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	91,756.26	91,756.26
利率敏感度缺口	2,992,972.37	-	-	-	-	46,569,763.99	49,562,736.36

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 2019 年 12 月 31 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 0.18% (2018 年 12 月 31 日：无)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2018 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。本基金主要投资于目标 ETF，所面临的其他价格风险主要来源于上证中小盘指数波动的影响。

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。本基金投资组合中目标 ETF 资产占基金资产净值的比例不低于 90%，基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日		上年度末 2018 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	1,515,599.50	2.26	24,757.60	0.05
交易性金融资产-基金投资	62,050,262.40	92.67	46,629,100.00	94.08
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	63,565,861.90	94.93	46,653,857.60	94.13

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除上证中小盘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：人民币元）	
		本期末（2019年12月31日）	上年度末（2018年12月31日）
	上证中小盘指数上升5%	2,593,773.22	1,890,001.00
	上证中小盘指数下降5%	-2,593,773.22	-1,890,001.00

#### 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) 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2019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 63,554,044.90 元，属于第二层次的余额为 131,889.00 元，无属于第三层次的余额(2018 年 12 月 31 日：第一层次 46,650,717.60 元，第二层次 3,140.00 元，无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2019 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(2018 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2)除公允价值外，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	1,515,599.50	2.25
	其中：股票	1,515,599.50	2.25
2	基金投资	62,050,262.40	92.31
3	固定收益投资	120,072.00	0.18
	其中：债券	120,072.00	0.18
	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	3,422,559.87	5.09
8	其他各项资产	110,120.19	0.16
9	合计	67,218,613.96	100.00

### 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	6,366.00	0.01
B	采矿业	95,427.20	0.14
C	制造业	636,513.80	0.95
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	116,558.00	0.17
E	建筑业	40,659.00	0.06
F	批发和零售业	81,987.00	0.12
G	交通运输、仓储和邮政业	82,425.00	0.12
H	住宿和餐饮业	6,993.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	90,053.00	0.13
J	金融业	254,067.50	0.38
K	房地产业	57,035.00	0.09
L	租赁和商务服务业	2,266.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	7,709.00	0.01

0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,826.00	0.00
Q	卫生和社会工作	10,253.00	0.02
R	文化、体育和娱乐业	15,013.00	0.02
S	综合	10,448.00	0.02
	合计	1,515,599.50	2.26

### 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	600900	长江电力	2,600	47,788.00	0.07
2	601169	北京银行	5,800	32,944.00	0.05
3	603288	海天味业	300	32,253.00	0.05
4	600570	恒生电子	300	23,319.00	0.03
5	601899	紫金矿业	4,800	22,032.00	0.03
6	601009	南京银行	2,300	20,171.00	0.03
7	600999	招商证券	1,100	20,119.00	0.03
8	601006	大秦铁路	2,300	18,883.00	0.03
9	600745	闻泰科技	200	18,500.00	0.03
10	600741	华域汽车	600	15,594.00	0.02
11	601155	新城控股	400	15,488.00	0.02
12	600958	东方证券	1,400	15,064.00	0.02
13	600352	浙江龙盛	1,000	14,470.00	0.02
14	600660	福耀玻璃	600	14,394.00	0.02
15	601225	陕西煤业	1,600	14,384.00	0.02
16	601901	方正证券	1,600	13,872.00	0.02
17	601377	兴业证券	1,900	13,452.00	0.02
18	601669	中国电建	3,000	13,020.00	0.02
19	600886	国投电力	1,300	11,934.00	0.02
20	600588	用友网络	420	11,928.00	0.02
21	603799	华友钴业	300	11,817.00	0.02
22	601108	财通证券	1,000	11,340.00	0.02
23	601933	永辉超市	1,500	11,310.00	0.02
24	600795	国电电力	4,700	10,998.00	0.02
25	601788	光大证券	800	10,480.00	0.02

26	600183	生益科技	500	10,460.00	0.02
27	600763	通策医疗	100	10,253.00	0.02
28	601099	太平洋	2,700	10,233.00	0.02
29	600705	中航资本	2,100	10,185.00	0.02
30	600177	雅戈尔	1,400	9,758.00	0.01
31	600606	绿地控股	1,400	9,730.00	0.01
32	600201	生物股份	500	9,360.00	0.01
33	600271	航天信息	400	9,268.00	0.01
34	601600	中国铝业	2,600	9,204.00	0.01
35	601607	上海医药	500	9,185.00	0.01
36	601985	中国核电	1,800	9,000.00	0.01
37	601555	东吴证券	900	8,991.00	0.01
38	600809	山西汾酒	100	8,970.00	0.01
39	600584	长电科技	400	8,792.00	0.01
40	600176	中国巨石	800	8,720.00	0.01
41	600893	航发动力	400	8,672.00	0.01
42	603659	璞泰来	100	8,515.00	0.01
43	600522	中天科技	1,000	8,300.00	0.01
44	600498	烽火通信	300	8,235.00	0.01
45	601877	正泰电器	300	8,040.00	0.01
46	600801	华新水泥	300	7,929.00	0.01
47	601919	中远海控	1,500	7,905.00	0.01
48	600872	中炬高新	200	7,870.00	0.01
49	601618	中国中冶	2,800	7,840.00	0.01
50	600221	海航控股	4,500	7,785.00	0.01
51	601997	贵阳银行	800	7,648.00	0.01
52	600739	辽宁成大	500	7,615.00	0.01
53	600637	东方明珠	800	7,488.00	0.01
54	601998	中信银行	1,200	7,404.00	0.01
55	600926	杭州银行	800	7,328.00	0.01
56	603939	益丰药房	100	7,322.00	0.01
57	600516	方大炭素	600	7,296.00	0.01
58	600332	白云山	200	7,122.00	0.01
59	601727	上海电气	1,400	6,972.00	0.01
60	603019	中科曙光	200	6,916.00	0.01
61	600674	川投能源	700	6,895.00	0.01
62	600885	宏发股份	200	6,890.00	0.01
63	600583	海油工程	900	6,642.00	0.01
64	601198	东兴证券	500	6,570.00	0.01

65	603369	今世缘	200	6,544.00	0.01
66	600208	新潮中宝	1,700	6,426.00	0.01
67	603883	老百姓	100	6,408.00	0.01
68	601128	常熟银行	700	6,377.00	0.01
69	601838	成都银行	700	6,349.00	0.01
70	600867	通化东宝	500	6,325.00	0.01
71	600760	中航沈飞	200	6,320.00	0.01
72	600219	南山铝业	2,800	6,272.00	0.01
73	600535	天士力	400	6,168.00	0.01
74	600673	东阳光	600	6,144.00	0.01
75	600298	安琪酵母	200	6,134.00	0.01
76	601018	宁波港	1,600	6,080.00	0.01
77	601233	桐昆股份	400	5,996.00	0.01
78	600642	申能股份	1,000	5,810.00	0.01
79	603156	养元饮品	200	5,806.00	0.01
80	601881	中国银河	500	5,805.00	0.01
81	601231	环旭电子	300	5,769.00	0.01
82	601878	浙商证券	500	5,565.00	0.01
83	603589	口子窖	100	5,491.00	0.01
84	600325	华发股份	700	5,481.00	0.01
85	600879	航天电子	900	5,382.00	0.01
86	600699	均胜电子	300	5,370.00	0.01
87	600256	广汇能源	1,600	5,296.00	0.01
87	601168	西部矿业	800	5,296.00	0.01
88	600521	华海药业	300	5,178.00	0.01
89	600779	水井坊	100	5,175.00	0.01
90	601117	中国化学	800	5,152.00	0.01
91	600346	恒力石化	320	5,145.60	0.01
92	600909	华安证券	700	5,110.00	0.01
93	600600	青岛啤酒	100	5,100.00	0.01
94	601100	恒立液压	100	4,975.00	0.01
95	600563	法拉电子	100	4,945.00	0.01
96	600567	山鹰纸业	1,300	4,901.00	0.01
97	603899	晨光文具	100	4,874.00	0.01
98	601992	金隅集团	1,300	4,849.00	0.01
99	600038	中直股份	100	4,771.00	0.01
100	601360	三六零	200	4,702.00	0.01
101	600728	佳都科技	500	4,690.00	0.01
102	601238	广汽集团	400	4,676.00	0.01



103	603517	绝味食品	100	4,645.00	0.01
104	600528	中铁工业	400	4,600.00	0.01
105	600895	张江高科	300	4,593.00	0.01
106	601966	玲珑轮胎	200	4,586.00	0.01
107	603816	顾家家居	100	4,573.00	0.01
108	600977	中国电影	300	4,566.00	0.01
109	601633	长城汽车	500	4,425.00	0.01
110	600236	桂冠电力	900	4,401.00	0.01
111	601021	春秋航空	100	4,389.00	0.01
112	600497	驰宏锌锗	1,000	4,380.00	0.01
113	600839	四川长虹	1,500	4,365.00	0.01
114	600572	康恩贝	700	4,305.00	0.01
115	600297	广汇汽车	1,300	4,238.00	0.01
116	600820	隧道股份	700	4,228.00	0.01
117	600188	兖州煤业	400	4,224.00	0.01
118	600776	东方通信	200	4,166.00	0.01
119	600881	亚泰集团	1,300	4,147.00	0.01
120	601866	中远海发	1,600	4,144.00	0.01
121	603858	步长制药	200	4,124.00	0.01
122	600258	首旅酒店	200	4,122.00	0.01
123	600260	凯乐科技	300	4,071.00	0.01
124	601216	君正集团	1,300	4,069.00	0.01
125	600811	东方集团	1,200	4,032.00	0.01
126	600797	浙大网新	400	4,028.00	0.01
127	600216	浙江医药	300	4,005.00	0.01
128	600816	安信信托	900	3,996.00	0.01
129	601333	广深铁路	1,300	3,978.00	0.01
130	603000	人民网	200	3,958.00	0.01
131	600635	大众公用	800	3,928.00	0.01
132	600655	豫园股份	500	3,920.00	0.01
133	600549	厦门钨业	300	3,912.00	0.01
134	600643	爱建集团	400	3,840.00	0.01
134	601808	中海油服	200	3,840.00	0.01
135	603881	数据港	100	3,795.00	0.01
136	600808	马钢股份	1,200	3,684.00	0.01
137	600875	东方电气	400	3,676.00	0.01
138	600804	鹏博士	600	3,672.00	0.01
139	600755	厦门国贸	500	3,670.00	0.01
140	601699	潞安环能	500	3,630.00	0.01

141	600580	卧龙电驱	300	3,606.00	0.01
142	601098	中南传媒	300	3,582.00	0.01
143	601898	中煤能源	700	3,514.00	0.01
144	600323	瀚蓝环境	200	3,508.00	0.01
145	601689	拓普集团	200	3,486.00	0.01
146	600259	广晟有色	100	3,477.00	0.01
147	600282	南钢股份	1,000	3,450.00	0.01
148	601118	海南橡胶	700	3,444.00	0.01
149	600718	东软集团	300	3,405.00	0.01
150	600737	中粮糖业	400	3,384.00	0.01
151	600273	嘉化能源	300	3,375.00	0.01
152	601869	长飞光纤	100	3,303.00	0.00
153	601636	旗滨集团	600	3,294.00	0.00
154	600845	宝信软件	100	3,290.00	0.00
155	601958	金钼股份	400	3,204.00	0.00
156	601106	中国一重	1,100	3,201.00	0.00
157	600967	内蒙一机	300	3,189.00	0.00
158	601000	唐山港	1,200	3,120.00	0.00
159	603077	和邦生物	2,100	3,108.00	0.00
160	600315	上海家化	100	3,094.00	0.00
161	600782	新钢股份	600	3,078.00	0.00
162	600621	华鑫股份	200	3,062.00	0.00
163	600682	南京新百	300	3,033.00	0.00
164	600863	内蒙华电	1,100	3,025.00	0.00
165	600507	方大特钢	300	3,018.00	0.00
166	600702	舍得酒业	100	3,001.00	0.00
167	603885	吉祥航空	200	3,000.00	0.00
168	600729	重庆百货	100	2,985.00	0.00
169	600557	康缘药业	200	2,948.00	0.00
170	600598	北大荒	300	2,922.00	0.00
171	600320	振华重工	800	2,904.00	0.00
172	600754	锦江酒店	100	2,871.00	0.00
173	600649	城投控股	500	2,860.00	0.00
174	603515	欧普照明	100	2,811.00	0.00
175	600859	王府井	200	2,798.00	0.00
176	600970	中材国际	400	2,788.00	0.00
177	600868	梅雁吉祥	800	2,760.00	0.00
178	600633	浙数文化	300	2,745.00	0.00
179	600694	大商股份	100	2,739.00	0.00

180	600777	新潮能源	1,300	2,730.00	0.00
181	600511	国药股份	100	2,729.00	0.00
182	600884	杉杉股份	200	2,702.00	0.00
183	600823	世茂股份	600	2,700.00	0.00
184	601228	广州港	700	2,681.00	0.00
185	600515	海航基础	600	2,676.00	0.00
186	600604	市北高新	300	2,658.00	0.00
187	600711	盛屯矿业	500	2,645.00	0.00
188	600316	洪都航空	200	2,606.00	0.00
189	601608	中信重工	700	2,604.00	0.00
190	601717	郑煤机	400	2,588.00	0.00
191	600640	号百控股	100	2,581.00	0.00
192	601598	中国外运	600	2,556.00	0.00
193	600597	光明乳业	200	2,538.00	0.00
193	603587	地素时尚	100	2,538.00	0.00
194	600901	江苏租赁	400	2,528.00	0.00
195	600717	天津港	400	2,512.00	0.00
196	600307	酒钢宏兴	1,200	2,472.00	0.00
196	600517	置信电气	300	2,472.00	0.00
197	600848	上海临港	100	2,455.00	0.00
198	601991	大唐发电	1,000	2,450.00	0.00
199	600206	有研新材	200	2,440.00	0.00
200	601880	大连港	1,200	2,436.00	0.00
201	603708	家家悦	100	2,434.00	0.00
202	600667	太极实业	300	2,433.00	0.00
203	601222	林洋能源	500	2,430.00	0.00
204	600566	济川药业	100	2,418.00	0.00
204	600864	哈投股份	300	2,418.00	0.00
204	603712	七一二	100	2,418.00	0.00
205	600330	天通股份	300	2,412.00	0.00
206	600525	长园集团	400	2,372.00	0.00
207	601519	大智慧	300	2,367.00	0.00
208	600390	五矿资本	280	2,312.80	0.00
209	600277	亿利洁能	500	2,280.00	0.00
210	600664	哈药股份	600	2,274.00	0.00
211	601828	美凯龙	200	2,266.00	0.00
212	600582	天地科技	700	2,233.00	0.00
213	600500	中化国际	420	2,226.00	0.00
214	600908	无锡银行	400	2,220.00	0.00

214	601200	上海环境	200	2,220.00	0.00
215	600862	中航高科	200	2,204.00	0.00
216	600226	瀚叶股份	700	2,198.00	0.00
217	603220	中贝通信	100	2,149.00	0.00
218	601375	中原证券	400	2,144.00	0.00
219	601611	中国核建	300	2,139.00	0.00
220	600803	新奥股份	200	2,128.00	0.00
221	603888	新华网	100	2,110.00	0.00
222	600756	浪潮软件	100	2,068.00	0.00
223	600269	赣粤高速	500	2,065.00	0.00
224	600751	海航科技	700	2,051.00	0.00
225	600765	中航重机	200	2,046.00	0.00
226	600317	营口港	800	2,040.00	0.00
227	600988	赤峰黄金	400	2,012.00	0.00
228	601666	平煤股份	500	2,010.00	0.00
229	603198	迎驾贡酒	100	1,992.00	0.00
230	600267	海正药业	200	1,982.00	0.00
231	600596	新安股份	200	1,968.00	0.00
231	601588	北辰实业	600	1,968.00	0.00
232	600312	平高电气	300	1,938.00	0.00
233	601326	秦港股份	600	1,914.00	0.00
234	600210	紫江企业	500	1,885.00	0.00
235	603103	横店影视	100	1,881.00	0.00
236	601311	骆驼股份	200	1,876.00	0.00
237	600846	同济科技	200	1,862.00	0.00
238	603377	东方时尚	100	1,826.00	0.00
239	601011	宝泰隆	400	1,804.00	0.00
240	600993	马应龙	100	1,749.00	0.00
241	603323	苏农银行	330	1,745.70	0.00
242	603650	彤程新材	100	1,742.00	0.00
243	600648	外高桥	100	1,737.00	0.00
244	600771	广誉远	100	1,696.00	0.00
245	601016	节能风电	700	1,687.00	0.00
246	600759	洲际油气	600	1,662.00	0.00
247	600835	上海机电	100	1,657.00	0.00
248	600502	安徽建工	400	1,624.00	0.00
248	600611	大众交通	400	1,624.00	0.00
249	603876	鼎胜新材	100	1,586.00	0.00
250	600783	鲁信创投	100	1,574.00	0.00

251	601139	深圳燃气	200	1,566.00	0.00
252	600787	中储股份	300	1,563.00	0.00
253	601069	西部黄金	100	1,510.00	0.00
254	600740	山西焦化	200	1,492.00	0.00
254	603766	隆鑫通用	400	1,492.00	0.00
255	600903	贵州燃气	100	1,478.00	0.00
256	600685	中船防务	100	1,475.00	0.00
257	601162	天风证券	200	1,472.00	0.00
258	600559	老白干酒	130	1,461.20	0.00
259	601886	江河集团	200	1,452.00	0.00
260	600789	鲁抗医药	200	1,442.00	0.00
261	600874	创业环保	200	1,438.00	0.00
262	600562	国睿科技	100	1,434.00	0.00
263	603733	仙鹤股份	100	1,426.00	0.00
264	601952	苏垦农发	200	1,398.00	0.00
265	603619	中曼石油	100	1,394.00	0.00
266	601019	山东出版	200	1,390.00	0.00
267	600329	中新药业	100	1,386.00	0.00
268	601298	青岛港	200	1,374.00	0.00
269	600623	华谊集团	200	1,330.00	0.00
270	600963	岳阳林纸	300	1,329.00	0.00
271	601001	大同煤业	300	1,320.00	0.00
272	601990	南京证券	100	1,291.00	0.00
273	600569	安阳钢铁	500	1,275.00	0.00
274	601949	中国出版	200	1,266.00	0.00
275	600233	圆通速递	100	1,265.00	0.00
276	600750	江中药业	100	1,253.00	0.00
277	600338	西藏珠峰	100	1,250.00	0.00
278	603225	新凤鸣	100	1,235.00	0.00
279	600757	长江传媒	200	1,232.00	0.00
280	601615	明阳智能	100	1,230.00	0.00
281	600855	航天长峰	100	1,229.00	0.00
282	601908	京运通	400	1,200.00	0.00
283	601002	晋亿实业	200	1,176.00	0.00
284	600733	北汽蓝谷	200	1,168.00	0.00
285	600335	国机汽车	200	1,160.00	0.00
286	601890	亚星锚链	200	1,144.00	0.00
287	603328	依顿电子	100	1,132.00	0.00
288	601003	柳钢股份	200	1,130.00	0.00

289	601860	紫金银行	200	1,124.00	0.00
290	603056	德邦股份	100	1,111.00	0.00
291	600299	安迪苏	100	1,106.00	0.00
292	601212	白银有色	300	1,104.00	0.00
293	601858	中国科传	100	1,096.00	0.00
294	601606	长城军工	100	1,094.00	0.00
295	603113	金能科技	100	1,079.00	0.00
296	600581	八一钢铁	300	1,068.00	0.00
297	601330	绿色动力	100	1,063.00	0.00
298	600230	沧州大化	100	1,033.00	0.00
299	603693	江苏新能	100	1,018.00	0.00
300	600571	信雅达	100	953.00	0.00
301	601777	力帆股份	300	924.00	0.00
302	603603	博天环境	100	918.00	0.00
303	601577	长沙银行	100	907.00	0.00
304	600677	航天通信	100	872.00	0.00
305	600758	红阳能源	200	868.00	0.00
306	600971	恒源煤电	140	837.20	0.00
307	600231	凌钢股份	300	828.00	0.00
308	603980	吉华集团	100	825.00	0.00
309	600996	贵广网络	100	805.00	0.00
310	603105	芯能科技	100	715.00	0.00
311	600929	湖南盐业	100	656.00	0.00
312	601068	中铝国际	100	554.00	0.00
313	601619	嘉泽新能	100	382.00	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600900	长江电力	98,592.00	0.20
2	600009	上海机场	94,788.00	0.19
3	600570	恒生电子	69,054.00	0.14
4	603288	海天味业	66,627.00	0.13
5	601169	北京银行	62,060.00	0.13
6	600999	招商证券	37,246.00	0.08

7	601006	大秦铁路	35,190.00	0.07
8	600745	闻泰科技	32,714.00	0.07
9	600547	山东黄金	30,544.00	0.06
10	600352	浙江龙盛	30,000.00	0.06
11	600406	国电南瑞	29,793.00	0.06
12	600958	东方证券	29,416.00	0.06
13	600741	华域汽车	28,524.00	0.06
14	601669	中国电建	28,320.00	0.06
15	601933	永辉超市	26,790.00	0.05
16	601012	隆基股份	26,115.00	0.05
17	601377	兴业证券	24,483.00	0.05
18	600886	国投电力	24,388.00	0.05
19	600795	国电电力	22,824.00	0.05
20	603160	汇顶科技	22,606.00	0.05

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

#### 8.4.2 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	600009	上海机场	86,988.00	0.18
2	600837	海通证券	50,848.00	0.10
3	600900	长江电力	43,394.00	0.09
4	600570	恒生电子	43,197.00	0.09
5	603288	海天味业	33,300.00	0.07
6	600406	国电南瑞	29,100.00	0.06
7	600031	三一重工	27,615.00	0.06
8	600352	浙江龙盛	24,032.00	0.05
9	600383	金地集团	23,751.00	0.05
10	601012	隆基股份	23,692.80	0.05
11	600436	片仔癀	22,756.00	0.05
12	600089	特变电工	22,725.00	0.05
13	600115	东方航空	20,754.00	0.04
14	600999	招商证券	20,350.00	0.04
15	600111	北方稀土	19,737.00	0.04
16	600919	江苏银行	19,305.00	0.04

17	600109	国金证券	19,212.00	0.04
18	603160	汇顶科技	19,100.00	0.04
19	600015	华夏银行	17,808.00	0.04
20	600958	东方证券	17,716.00	0.04

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

### 8.4.3 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	3,442,973.22
卖出股票收入（成交）总额	2,091,352.93

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

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	120,072.00	0.18
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	120,072.00	0.18

### 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

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	019611	19 国债 01	1,200	120,072.00	0.18

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。



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

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

### 8.10 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	中小盘 ETF	指数型	交易型开放式	华泰柏瑞基金管理有限公司	62,050,262.40	92.67

### 8.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 8.11.1 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。

#### 8.11.2 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。

### 8.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.12.1 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。

#### 8.12.2 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。

#### 8.12.3 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。

### 8.13 投资组合报告附注

#### 8.13.1 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。

#### 8.13.2 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。

#### 8.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,715.77
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,401.63
5	应收申购款	104,002.79
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	110,120.19

#### 8.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
654	92,042.19	47,010,154.19	78.10%	13,185,439.15	21.90%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	0.00	0.0000%

注：本报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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（2011年1月26日）基金份额总额	482,562,901.50
本报告期期初基金份额总额	57,972,321.13
本报告期基金总申购份额	7,709,941.53
减:本报告期基金总赎回份额	5,486,669.32
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	60,195,593.34

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2019 年 3 月 11 日，公司股东批准 Anthony Gerard Fasso 先生担任公司董事。

2019 年 4 月 4 日，公司股东批准王永筠女士担任公司监事。

2019 年 4 月 15 日，经公司董事会批准刘万方先生担任公司副总经理。

2019 年 7 月 1 日，经公司董事会批准高山先生不再担任公司副总经理。

2019 年 11 月 25 日，公司股东批准陆春光先生担任公司董事，陆桢女士、李晗女士担任公司独立董事，翟军先生不再担任公司董事，沈志群先生、杨科先生不再担任公司独立董事。

上述人事变动已按相关规定备案、报告。

2019 年 5 月，陈四清先生因工作调动，辞去中国银行股份有限公司董事长职务。

2019 年 6 月，刘连舸先生任中国银行股份有限公司董事长职务。

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 60000 元人民币，该事务所已向本基金提供了 9 年的审计服务。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比	佣金	占当期佣金总量的比例	

			例			
华泰证券	1	5,109,899.57	92.55%	4,759.28	92.55%	-
西南证券	1	313,685.58	5.66%	292.19	5.68%	-
中信证券	1	97,705.00	1.76%	90.98	1.77%	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-

注：1、选择代理证券买卖的证券经营机构的标准

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

- 1) 具有相应的业务经营资格；
- 2) 诚信记录良好，最近两年无重大违法违规行，未受监管机构重大处罚；
- 3) 资金雄厚，信誉良好。内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求。
- 4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服务。
- 5) 具备研究实力，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、股票分析的研究报告及周到的信息服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告。

2、选择代理证券买卖的证券经营机构的程序

基金管理人根据以上标准进行考察后确定证券经营机构的选择。基金管理人与被选择的证券经营机构签订交易单元租用协议和证券研究服务协议。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		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
华泰证券	122,520.16	99.17%	-	-	-	-	259,186.75	72.66%
西南证券	1,026.50	0.83%	-	-	-	-	97,520.40	27.34%
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-	-	-

### 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参加交通银行手机银行渠道申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	证监会指定报刊和网站	2019年12月31日
2	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国工商银行费率优惠活动的公告	证监会指定报刊和网站	2019年12月31日
3	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下61只证券投资基金修改基金合同和托管协议的公告	证监会指定报刊和网站	2019年12月30日
4	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金参加华瑞保险销售有限公司费率优惠活动的公告	证监会指定报刊和网站	2019年12月25日

5	华泰柏瑞基金管理有限公司关于聘任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基金经理的公告	证监会指定报刊和网站	2019 年 11 月 7 日
6	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金参加喜鹊财富基金销售有限公司费率优惠活动的公告	证监会指定报刊和网站	2019 年 11 月 1 日
7	华泰柏瑞基金关于增加西部证券为旗下部分基金代销机构同时开通基金转换和定投等业务的公告	证监会指定报刊和网站	2019 年 8 月 29 日
8	华泰柏瑞基金关于增加玄元保险为旗下部分基金代销机构同时开通基金转换、定期定额投资及参加费率优惠等业务的公告	证监会指定报刊和网站	2019 年 8 月 13 日
9	华泰柏瑞基金关于增加和合期货有限公司为旗下部分基金代销机构同时开通基金转换业务的公告	证监会指定报刊和网站	2019 年 7 月 22 日
10	华泰柏瑞基金管理有限公司关于董事、监事、高级管理人员及其他从业人员子公司兼职情况公告	证监会指定报刊和网站	2019 年 7 月 3 日
11	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	证监会指定报刊和网站	2019 年 7 月 3 日
12	华泰柏瑞基金管理有限公司关于参加中国银行定期定额投资手续费率优惠活动的公告	证监会指定报刊和网站	2019 年 6 月 27 日
13	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票的公告	证监会指定报刊和网站	2019 年 6 月 25 日
14	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加世纪证券有限责任公司为旗下部分基金代销机构同时开通基金转换、定投业务的公告	证监会指定报刊和网站	2019 年 5 月 25 日
15	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金在徽商期货有限责任公司开通基金定投及定投手续费率优惠活动的公告	证监会指定报刊和网站	2019 年 5 月 7 日
16	华泰柏瑞基金管理有限公司关于聘任副总经理的公告	证监会指定报刊和网站	2019 年 4 月 16 日
17	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加大通证券股份有限公司为旗下部分基金代销机构同时开通基金转换的公告	证监会指定报刊和网站	2019 年 4 月 8 日
18	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加北京百度百盈基金销售有限	证监会指定报刊和网站	2019 年 4 月 4 日



	公司为旗下部分基金代销机构同时开通基金转换、定期定额投资及参加费率优惠等业务的公告		
19	华泰柏瑞基金管理有限公司继续参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	证监会指定报刊和网站	2019年3月30日
20	华泰柏瑞基金管理有限公司关于参加交通银行手机银行渠道申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	证监会指定报刊和网站	2019年3月29日
21	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加江苏汇林保大基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构同时开通基金转换及参加费率优惠等业务的公告	证监会指定报刊和网站	2019年3月28日
22	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加广发银行股份有限公司为旗下部分基金代销机构同时开通基金定投业务的公告	证监会指定报刊和网站	2019年3月27日
23	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加中银国际证券股份有限公司为旗下部分基金代销机构同时开通基金转换、定投业务的公告	证监会指定报刊和网站	2019年3月27日
24	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加国盛证券有限责任公司为旗下部分基金代销机构同时开通基金转换、定投、申购定投费率优惠业务的公告	证监会指定报刊和网站	2019年3月19日
25	华泰柏瑞基金管理有限公司关于暂停北京钱景基金销售有限公司办理旗下基金相关业务的公告	证监会指定报刊和网站	2019年3月9日
26	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金持有的信威集团(600485)估值调整的提示性公告	证监会指定报刊和网站	2019年3月2日
27	华泰柏瑞基金管理有限公司关于参加泉州银行股份有限公司费率优惠的公告	证监会指定报刊和网站	2019年2月27日
28	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	证监会指定报刊和网站	2019年2月27日
29	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加北京君德汇富基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构同时开通基金转换、定投及参加费率	证监会指定报刊和网站	2019年2月19日

	优惠等业务的公告		
30	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加泰信财富基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构同时开通基金转换、定投及参加费率优惠等业务的公告	证监会指定报刊和网站	2019 年 2 月 19 日
31	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金持有的信威集团(600485) 估值调整的提示性公告	证监会指定报刊和网站	2019 年 2 月 15 日
32	华泰柏瑞基金管理有限公司关于暂停大泰金石基金销售有限公司办理旗下基金相关业务的公告	证监会指定报刊和网站	2019 年 1 月 28 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20190101-20191231	47,010,154.19	0.00	0.00	47,010,154.19	78.10%
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-

#### 产品特有风险

本基金报告期内有单一机构持有基金份额超过 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、中国证监会批准上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金募集的文件
- 2、《上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》
- 3、《上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》
- 4、《上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金的公告

### 13.2 存放地点

上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

托管人住所

### 13.3 查阅方式

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

华泰柏瑞基金管理有限公司

2020 年 3 月 30 日