

# 华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资 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 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>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 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>56</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	56
8.2 期末按行业分类的股票投资组合 .....	56
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 .....	57
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	70
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	72
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 .....	72
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 .....	72
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 .....	72
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 .....	72
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	72
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	72
8.12 投资组合报告附注 .....	73
<b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>74</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	74
9.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	74
9.3 期末上市基金前十名持有人 .....	74
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	74
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 .....	74
<b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>76</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>77</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	77
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 .....	77
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	77

11.4 基金投资策略的改变 .....	77
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	77
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.....	77
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	77
11.8 其他重大事件 .....	81
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>82</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 .....	82
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	83
<b>§13 备查文件目录 .....</b>	<b>84</b>
13.1 备查文件目录 .....	84
13.2 存放地点 .....	84
13.3 查阅方式 .....	84

## § 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
场内简称	ETF500
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	612,429,801.00 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	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	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	中国证券登记结算有限责任公司 华泰柏瑞基金管理有限公司	北京市西城区太平桥大街 17 号 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	-17,850,489.36	-33,476,829.45	-18,852,060.35
本期利润	133,258,978.97	-111,937,324.94	13,472,150.27
加权平均基金份额本期利润	0.2601	-0.3951	0.0576
本期加权平均净值利润率	24.11%	-36.24%	4.47%
本期基金份额净值增长率	31.48%	-31.70%	3.50%
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	-518,758,923.96	-435,050,419.87	-147,550,539.32
期末可供分配基金份额利润	-0.8471	-1.1258	-0.7148
期末基金资产净值	713,093,598.42	342,221,561.80	267,666,144.50
期末基金份额净值	1.1644	0.8856	1.2966
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	-40.98%	-55.11%	-34.28%

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

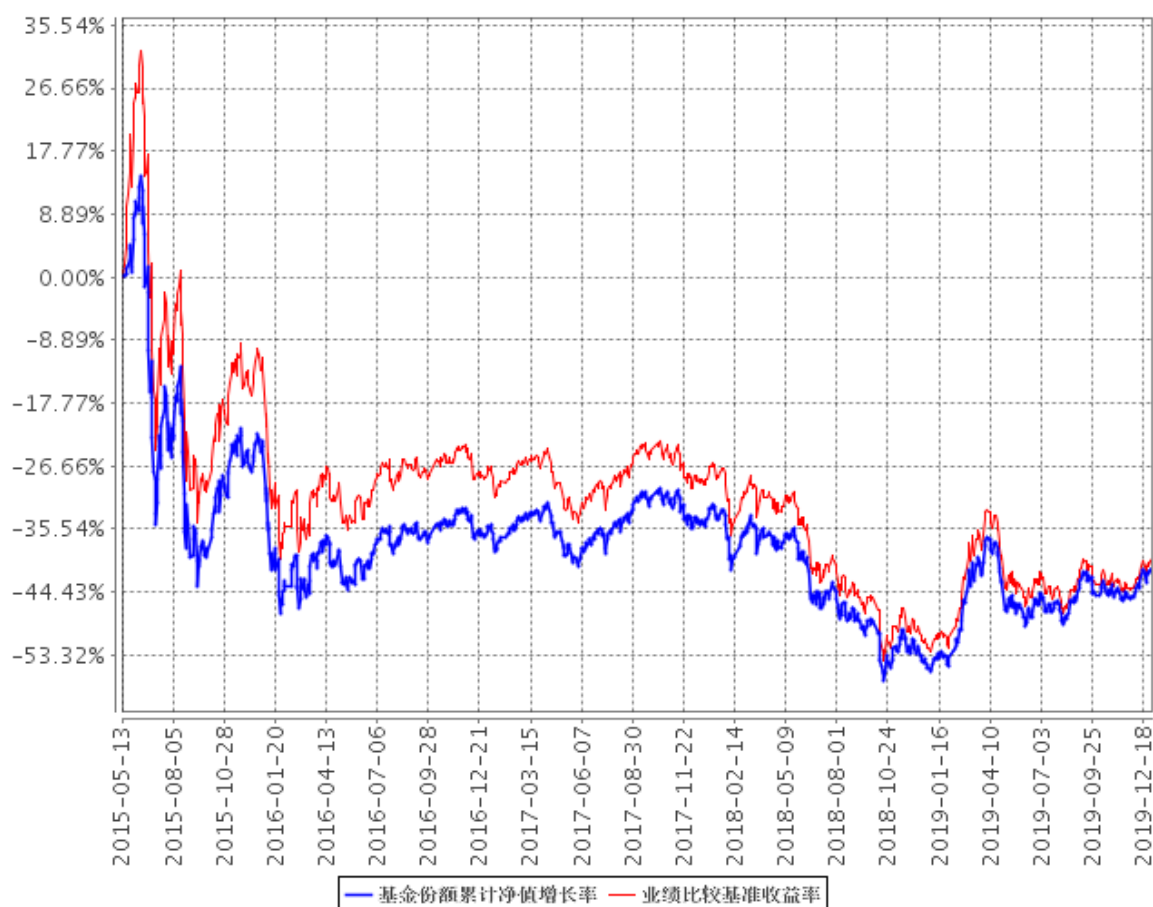
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	7.24%	0.92%	6.61%	0.92%	0.63%	0.00%
过去六个月	9.70%	1.06%	6.41%	1.08%	3.29%	-0.02%
过去一年	31.48%	1.45%	26.38%	1.47%	5.10%	-0.02%
过去三年	-7.05%	1.32%	-15.90%	1.33%	8.85%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-40.98%	1.81%	-39.77%	1.84%	-1.21%	-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

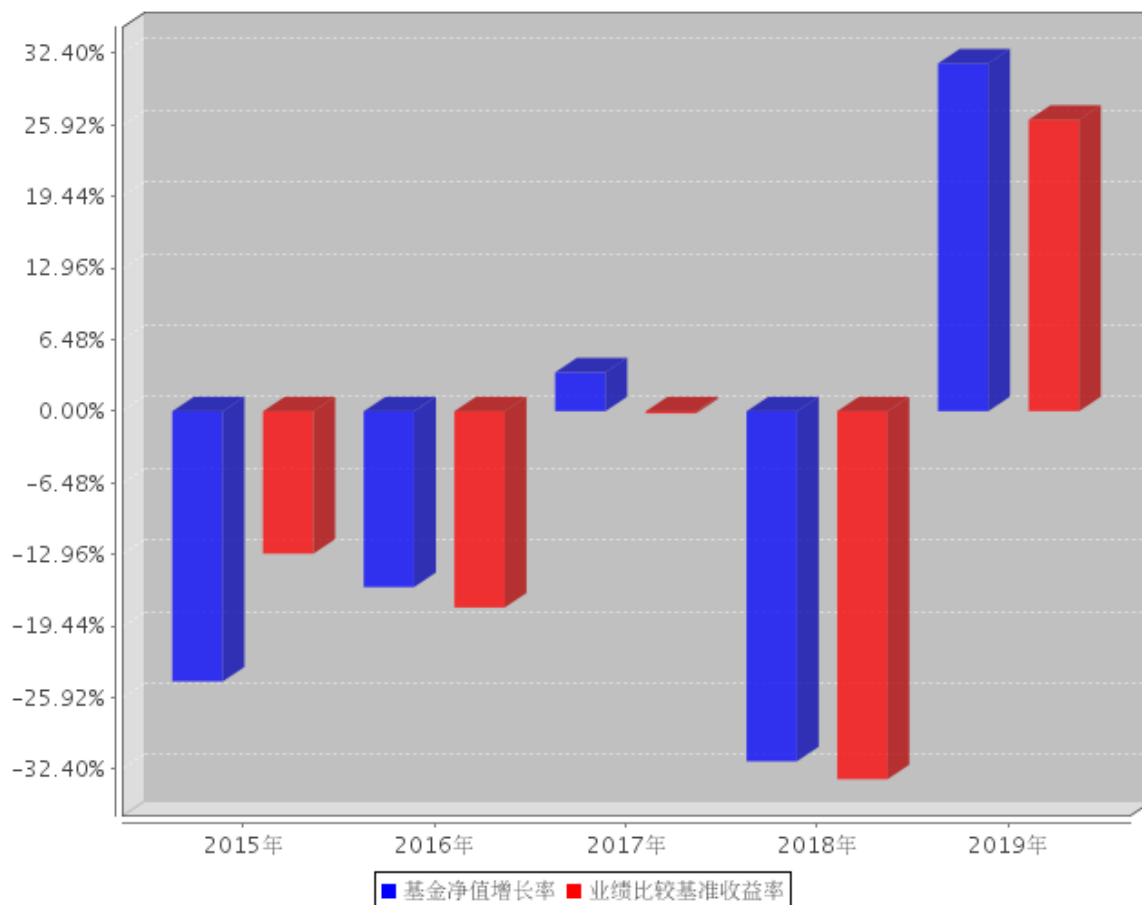
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：图示日期为 2015 年 5 月 13 日至 2019 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
2019	-	-	-	-	
2018	-	-	-	-	
2017	0.2400	6,394,315.13	-	6,394,315.13	
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、华泰柏瑞亨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 股国际通指数基金联接基金、华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞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	2015 年 5 月 13 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

					<p>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>
--	--	--	--	--	--

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）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。

本报告期本基金与公司所管理的其他投资组合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% 的同日反向交易共 3 次。因被动跟踪标的指数需要，与其他组合发生反向交易，不存在利益输送行为。

### 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抢眼，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 5.099%，日均绝对跟踪偏离度为 0.027%，期间日跟踪误差为 0.083%，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 1.1644 元；本报告期基金份额净值增长率为 31.48%，业绩比较基准收益率为 26.38%。

#### 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

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(2020)第 22543 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“华泰柏瑞中证 500ETF 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中证 500ETF 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中证 500ETF</p>

	<p>基金，并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>华泰柏瑞中证 500ETF 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中证 500ETF 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中证 500ETF 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中证 500ETF 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</p>

	<p>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中证 500ETF 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中证 500ETF 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：华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

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	4,351,633.92	2,649,435.24
结算备付金		25,678,431.10	197,032.02
存出保证金		3,858,720.95	27,120.54
交易性金融资产	7.4.7.2	679,951,478.60	339,793,784.98
其中：股票投资		679,951,478.60	339,793,784.98
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		189,387.56	261,798.79
应收利息	7.4.7.5	15,508.24	667.75
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		714,045,160.37	342,929,839.32
<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		382.00	1,220.60
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		193,736.09	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		87,461.15	146,850.18
应付托管费		29,153.73	29,370.05
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	31,933.39	120,836.69
应交税费		38,340.53	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	570,555.06	410,000.00
负债合计		951,561.95	708,277.52
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	1,231,852,522.38	777,271,981.67
未分配利润	7.4.7.10	-518,758,923.96	-435,050,419.87
所有者权益合计		713,093,598.42	342,221,561.80
负债和所有者权益总计		714,045,160.37	342,929,839.32

注：报告截止日 2019 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.1644 元，基金份额总额 612,429,801.00 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：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>		136,423,497.82	-109,013,277.97
1.利息收入		263,211.03	36,679.17
其中：存款利息收入	7.4.7.11	223,684.79	36,676.13
债券利息收入		-	3.04
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		39,526.24	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-16,008,726.42	-31,014,514.82
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-26,499,935.98	-34,544,037.33
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	591.46
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	3,741,359.23	-
股利收益	7.4.7.16	6,749,850.33	3,528,931.05
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	151,109,468.33	-78,460,495.49
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	1,059,544.88	425,053.17
<b>减：二、费用</b>		3,164,518.85	2,924,046.97
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,463,358.68	1,542,324.89

2. 托管费	7.4.10.2.2	365,911.03	308,465.01
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	876,183.99	449,445.57
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		13,223.46	-
7. 其他费用	7.4.7.20	445,841.69	623,811.50
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		133,258,978.97	-111,937,324.94
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		133,258,978.97	-111,937,324.94

### 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：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）	777,271,981.67	-435,050,419.87	342,221,561.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	133,258,978.97	133,258,978.97
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）	454,580,540.71	-216,967,483.06	237,613,057.65
其中：1.基金申购款	1,315,467,582.31	-609,085,526.71	706,382,055.60
2.基金赎回款	-860,887,041.60	392,118,043.65	-468,768,997.95
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）	1,231,852,522.38	-518,758,923.96	713,093,598.42
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）	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

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。根据《华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下 4 只证券投资基金修改基金合同和托管协议的公告》，本基金自 2019 年 10 月 16 日起，新增投资范围：本基金可根据法律法规的规定，参与转融通证券出借业务。

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 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 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、债券投资和衍生工具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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外, 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、债券投资和衍生工具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。

本基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司(以下简称“证金公司”)出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息确认为利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益。

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

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 日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

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

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

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

## 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	4,351,633.92	2,649,435.24
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：	4,351,633.92	2,649,435.24

### 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	662,078,949.07	679,951,478.60	17,872,529.53
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	662,078,949.07	679,951,478.60	17,872,529.53
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	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

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	31,239,960.00	-	-	
股指期货	31,239,960.00	-	-	-
指数期权	-	-	-	-
股票期权	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	
合计	31,239,960.00	-	-	
项目	上年度末 2018 年 12 月 31 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	-	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	-	-	-	

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

于 2019 年 12 月 31 日，本基金持有的股指期货合约情况如下：

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2003	中证 2003	30	31,389,600.00	149,640.00
总额合计		30	31,389,600.00	149,640.00
减：可抵销期货暂收款				-149,640.00
股指期货投资净额				-

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

#### 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 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	1,626.65	556.76
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	13,694.57	97.57
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	-	-
应收出借证券利息	141.48	-
其他	45.54	13.42
合计	15,508.24	667.75

#### 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	31,933.39	120,836.69
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	31,933.39	120,836.69

#### 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	-	-

应付证券出借违约金	-	-
应付替代款	340,555.06	-
预提费用	230,000.00	410,000.00
合计	570,555.06	410,000.00

#### 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	386,429,801.00	777,271,981.67
本期申购	654,000,000.00	1,315,467,582.31
本期赎回(以“-”号填列)	-428,000,000.00	-860,887,041.60
- 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	612,429,801.00	1,231,852,522.38

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	-167,687,276.36	-267,363,143.51	-435,050,419.87
本期利润	-17,850,489.36	151,109,468.33	133,258,978.97
本期基金份额交易产生的变动数	-110,435,110.17	-106,532,372.89	-216,967,483.06
其中：基金申购款	-314,480,477.25	-294,605,049.46	-609,085,526.71
基金赎回款	204,045,367.08	188,072,676.57	392,118,043.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-295,972,875.89	-222,786,048.07	-518,758,923.96

#### 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	93,686.00

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	128,694.31	2,832.14
其他	1,304.48	289.93
合计	223,684.79	36,676.13

#### 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	-14,456,582.97	-30,465,212.91
股票投资收益——赎回差价收入	-12,043,353.01	-4,078,824.42
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	-26,499,935.98	-34,544,037.33

##### 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	453,152,882.53	110,523,391.88
减：卖出股票成本总额	467,609,465.50	140,988,604.79
买卖股票差价收入	-14,456,582.97	-30,465,212.91

##### 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 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
赎回基金份额对价总额	468,768,997.95	33,814,811.79
减：现金支付赎回款总额	247,654,932.95	18,353,390.79
减：赎回股票成本总额	233,157,418.01	19,540,245.42

赎回差价收入	-12,043,353.01	-4,078,824.42
--------	----------------	---------------

#### 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。

#### 7.4.7.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间无证券出借差价收入。

#### 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 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	-	591.46
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

##### 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 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	-	21,594.50
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	-	21,000.00
减：应收利息总额	-	3.04
买卖债券差价收入	-	591.46

##### 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买卖权证差价收入。

##### 7.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额	上年度可比期间收益金额
	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
国债期货投资收益	-	-
股指期货-投资收益	3,741,359.23	-

#### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	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
股票投资产生的股利收益	6,749,850.33	3,528,931.05

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	6,749,850.33	3,528,931.05

#### 7.4.7.17 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	150,959,828.33	-78,460,495.49
——股票投资	150,959,828.33	-78,460,495.49
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	149,640.00	-
——权证投资	-	-
股指期货	149,640.00	-
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	151,109,468.33	-78,460,495.49

#### 7.4.7.18 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	-	-
替代损益	1,059,544.88	425,053.17
合计	1,059,544.88	425,053.17

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 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	866,425.54	449,445.57
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	-	-
期货交易费用	9,758.45	-
合计	876,183.99	449,445.57

#### 7.4.7.20 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	120,000.00	300,000.00
证券出借违约金	-	-
银行划款手续费	5,841.69	3,811.50
上市费	60,000.00	60,000.00
指数使用费	200,000.00	200,000.00
合计	445,841.69	623,811.50

#### 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

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
PineBridge Investment LLC	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
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 500ETF 联接基金”)	本基金的基金管理人管理的其他基金
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	406,512,427.75	38.02%	-	-

##### 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

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	53,378.16	21.12%	3,124.57	9.78%

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。权证交易不计佣金。

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 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
当期发生的基金应支付的管理费	1,463,358.68	1,542,324.89
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：自 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 9 日及上年度可比期间，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 × 0.50% / 当年天数。

根据《华泰柏瑞基金管理有限公司关于调低旗下华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金基金费率并修订基金合同和托管协议的公告》，自 2019 年 6 月 10 日起，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 0.15% 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 × 0.15% / 当年天数。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

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
当期发生的基金应支付的托管费	365,911.03	308,465.01

注：自 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 9 日及上年度可比期间，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 × 0.10% / 当年天数。

根据《华泰柏瑞基金管理有限公司关于调低旗下华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金基金费率并修订基金合同和托管协议的公告》，自 2019 年 6 月 10 日起，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 0.05% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.05% / 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 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

单位：人民币元

本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
华泰证券	2,200,160.00	1,454.55	-	-
上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
华泰证券	-	-	-	-

##### 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2019年12月31日		上年度末 2018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 500 交易型开 放式指数证券 投资基金联接 基金	359,037,644.00	58.6251%	179,361,728.00	46.4151%
华泰证券股份 有限公司	3,745,200.00	0.6115%	0.00	0.0000%

#### 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 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	4,351,633.92	93,686.00	2,649,435.24	33,554.06

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：本基金本报告期及上年度可比期间未参与关联方承销证券。

#### 7.4.10.8 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（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

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
688181	八亿时空	2019 年 12 月 27 日	2020 年 1 月 6 日	新股未上市	43.98	43.98	4,306	189,377.88	189,377.88	-
002973	侨银环保	2019 年 12 月 27 日	2020 年 1 月 6 日	新股未上市	5.74	5.74	1,146	6,578.04	6,578.04	-
688005	容百科技	2019 年 7 月 12 日	2020 年 1 月 22 日	新股锁定期内	26.62	31.84	17,937	477,482.94	571,114.08	-
688188	柏楚电子	2019 年 7 月 31 日	2020 年 2 月 10 日	新股锁定期内	68.58	152.09	7,847	538,147.26	1,193,450.23	-
688166	博瑞医药	2019 年 10 月 29 日	2020 年 5 月 8 日	新股锁定期内	12.71	25.64	8,041	102,201.11	206,171.24	-
688198	佰仁医疗	2019 年 11 月 29 日	2020 年 6 月 9 日	新股锁定期内	23.68	37.58	3,213	76,083.84	120,744.54	-
688029	南微医学	2019 年 7 月 15 日	2020 年 1 月 22 日	新股锁定期内	52.45	157.76	10,568	554,291.60	1,667,207.68	-
688389	普门科技	2019 年 10 月 29 日	2020 年 5 月 6 日	新股锁定期内	9.10	13.56	6,931	63,072.10	93,984.36	-

注：1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。

2、本基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限

内不得转让；本基金参与网上申购获得的新股，在新股上市之前不得转让。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：截至本报告期末，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 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。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

合约编号	证券代码	证券名称	成交时间	出借到期日	期末估值单价	数量（单位：张）	期末估值总额
2019123000000133	600094	大名城	2019-12-30	2020年1月13日	5.85	37,000	216,450.00
2019123000000107	601168	西部矿业	2019-12-30	2020年1月13日	6.62	44,000	291,280.00
2019122400000100	000727	华东科技	2019-12-24	2020年1月7日	2.09	60,000	125,400.00
2019122400000102	000932	华菱钢铁	2019-12-24	2020年1月7日	4.78	20,000	95,600.00
2019123000000269	002273	水晶光电	2019-12-30	2020年1月13日	16.16	26,000	420,160.00
2019123100000062	002385	大北农	2019-12-31	2020年1月14日	4.98	59,000	293,820.00
2019123000000271	002681	奋达科技	2019-12-30	2020年1月13日	5.58	19,000	106,020.00
2019123000000573	002797	第一创业	2019-12-30	2020年1月13日	8.28	49,000	405,720.00
合计						314,000	1,954,450.00

## 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，将风险控制在此可承受的范围内。

### 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，本基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿



付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近 1 年的分类结果为 A 类，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。

于 2019 年 12 月 31 日，本基金无债券投资 (2018 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 2019 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，

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 0.57%。

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、结算备付金和存出保证金等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	4,351,633.92	-	-	-	-	-	4,351,633.92
结算备付金	25,678,431.10	-	-	-	-	-	25,678,431.10
存出保证金	91,968.95	-	-	-	-	3,766,752.00	3,858,720.95
交易性金融资产	-	-	-	-	-	679,951,478.60	679,951,478.60
应收证券清算款	-	-	-	-	-	189,387.56	189,387.56
应收利息	-	-	-	-	-	15,508.24	15,508.24
资产总计	30,122,033.97	-	-	-	-	683,923,126.40	714,045,160.37
负债							
交易性金融负债	-	-	-	-	-	382.00	382.00
应付证券清算款	-	-	-	-	-	193,736.09	193,736.09
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	87,461.15	87,461.15
应付托管费	-	-	-	-	-	29,153.73	29,153.73
应付交易费用	-	-	-	-	-	31,933.39	31,933.39

应交税费	-	-	-	-	-	38,340.53	38,340.53
其他负债	-	-	-	-	-	570,555.06	570,555.06
负债总计	-	-	-	-	-	951,561.95	951,561.95
利率敏感度缺口	30,122,033.97	-	-	-	-	-682,971,564.45	713,093,598.42
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	2,649,435.24	-	-	-	-	-	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
资产总计	2,873,587.80	-	-	-	-	-340,056,251.52	342,929,839.32
负债							
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
负债总计	-	-	-	-	-	708,277.52	708,277.52
利率敏感度缺口	2,873,587.80	-	-	-	-	-339,347,974.00	342,221,561.80

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约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，本基金未持有交易性债券投资（2018 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（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 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	679,951,478.60	95.35	339,793,784.98	99.29
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	-382.00	0.00	-1,220.60	0.00
合计	679,951,096.60	95.35	339,792,564.38	99.29

注：其他包含：1. 可退替代款。2. 在期货交易所交易的期货投资(附注 7.4.7.3)。在当日无负债结算制度下，期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

#### 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：人民币元)	
		本期末(2019 年 12 月 31 日)	上年度末(2018 年 12 月 31 日)
	中证 500 指数上升 5%	35,746,157.69	17,772,881.00
中证 500 指数下降 5%	-35,746,157.69	-17,772,881.00	

#### 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 2019 年度，本基金申购基金份额的对价总额为 706,382,055.60 元(2018 年度：220,307,554.03 元)，其中包括以股票支付的申购款 256,979,082.23 元和以现金支付的申购款 449,402,973.37 元(2018 年度：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)。

##### (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 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 675,902,850.55 元，属于第二层次的余额为 4,048,628.05 元，无属于第三层次的余额(2018 年 12 月 31 日：第一层次 337,797,856.44 元，第二层次 1,995,928.54 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。

(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	679,951,478.60	95.23
	其中：股票	679,951,478.60	95.23
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	30,030,065.02	4.21
8	其他各项资产	4,063,616.75	0.57
9	合计	714,045,160.37	100.00

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增。

报告期末，本基金参与转融通证券出借业务出借股票的公允价值为 1,954,450.00 元，占本基金期末资产净值的 0.27%。

### 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	4,571,912.40	0.64
B	采矿业	21,574,483.59	3.03
C	制造业	387,029,145.26	54.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	18,808,547.29	2.64
E	建筑业	8,857,542.30	1.24
F	批发和零售业	31,222,272.45	4.38
G	交通运输、仓储和邮政业	23,570,682.13	3.31
H	住宿和餐饮业	3,068,326.44	0.43
I	信息传输、软件和信息技术服务业	70,021,356.58	9.82
J	金融业	39,715,934.20	5.57
K	房地产业	26,964,463.65	3.78
L	租赁和商务服务业	9,417,259.66	1.32



M	科学研究和技术服务业	3,721,088.62	0.52
N	水利、环境和公共设施管理业	4,760,483.30	0.67
O	居民服务、修理和其他服务业	-	0.00
P	教育	664,664.00	0.09
Q	卫生和社会工作	5,790,062.61	0.81
R	文化、体育和娱乐业	13,207,016.92	1.85
S	综合	6,986,237.20	0.98
	合计	679,951,478.60	95.35

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	600745	闻泰科技	65,100	6,021,750.00	0.84
2	000066	中国长城	278,334	4,330,877.04	0.61
3	002463	沪电股份	191,318	4,249,172.78	0.60
4	601099	太平洋	1,078,600	4,087,894.00	0.57
5	002384	东山精密	176,007	4,074,562.05	0.57
6	601128	常熟银行	433,105	3,945,586.55	0.55
7	600584	长电科技	175,499	3,857,468.02	0.54
8	300014	亿纬锂能	72,800	3,651,648.00	0.51
9	600426	华鲁恒升	180,398	3,584,508.26	0.50
10	300383	光环新网	170,740	3,426,751.80	0.48
11	002049	紫光国微	66,978	3,405,161.52	0.48
12	600536	中国软件	47,091	3,375,953.79	0.47
13	002439	启明星辰	99,437	3,360,970.60	0.47
14	300207	欣旺达	171,400	3,345,728.00	0.47
15	600201	生物股份	178,452	3,340,621.44	0.47
16	002371	北方华创	37,826	3,328,688.00	0.47
17	601872	招商轮船	384,381	3,174,987.06	0.45
18	002465	海格通信	291,177	3,153,446.91	0.44
19	002340	格林美	647,314	3,152,419.18	0.44
20	002129	中环股份	264,743	3,126,614.83	0.44
21	300253	卫宁健康	207,973	3,115,435.54	0.44
22	600763	通策医疗	30,100	3,086,153.00	0.43
23	002812	恩捷股份	60,930	3,076,965.00	0.43

24	002065	东华软件	293,000	3,023,760.00	0.42
25	300088	长信科技	292,935	3,008,442.45	0.42
26	600739	辽宁成大	193,900	2,953,097.00	0.41
27	002127	南极电商	268,808	2,932,695.28	0.41
28	002821	凯莱英	22,100	2,861,950.00	0.40
29	600801	华新水泥	107,925	2,852,457.75	0.40
30	300012	华测检测	190,600	2,841,846.00	0.40
31	002353	杰瑞股份	75,916	2,805,855.36	0.39
32	002180	纳思达	84,100	2,768,572.00	0.39
33	300315	掌趣科技	436,800	2,695,056.00	0.38
34	000050	深天马 A	159,800	2,603,142.00	0.37
35	000988	华工科技	127,455	2,586,061.95	0.36
36	000401	冀东水泥	149,433	2,541,855.33	0.36
37	000009	中国宝安	408,483	2,528,509.77	0.35
38	000750	国海证券	467,417	2,496,006.78	0.35
39	002273	水晶光电	178,378	2,882,588.48	0.40
40	600673	东阳光	238,670	2,443,980.80	0.34
41	600885	宏发股份	70,760	2,437,682.00	0.34
42	000623	吉林敖东	147,400	2,436,522.00	0.34
43	002078	太阳纸业	246,274	2,423,336.16	0.34
44	600298	安琪酵母	78,350	2,402,994.50	0.34
45	002268	卫士通	92,949	2,397,154.71	0.34
46	601233	桐昆股份	158,200	2,371,418.00	0.33
47	002195	二三四五	731,120	2,361,517.60	0.33
48	002797	第一创业	332,800	2,755,584.00	0.39
49	002507	涪陵榨菜	87,600	2,341,548.00	0.33
50	300285	国瓷材料	101,600	2,321,560.00	0.33
51	600161	天坛生物	82,889	2,315,918.66	0.32
52	002926	华西证券	207,900	2,288,979.00	0.32
53	600642	申能股份	388,963	2,259,875.03	0.32
54	600150	中国船舶	103,000	2,241,280.00	0.31
55	603517	绝味食品	48,000	2,229,600.00	0.31
56	002500	山西证券	268,790	2,228,269.10	0.31
57	600699	均胜电子	123,540	2,211,366.00	0.31
58	002131	利欧股份	737,384	2,190,030.48	0.31
59	300168	万达信息	139,400	2,150,942.00	0.30
60	300529	健帆生物	29,800	2,140,832.00	0.30
61	000998	隆平高科	145,500	2,140,305.00	0.30
62	000975	银泰黄金	157,043	2,137,355.23	0.30

63	002373	千方科技	117,765	2,124,480.60	0.30
64	300296	利亚德	276,400	2,119,988.00	0.30
65	002572	索菲亚	101,100	2,118,045.00	0.30
66	600325	华发股份	268,302	2,100,804.66	0.29
67	600704	物产中大	400,100	2,100,525.00	0.29
68	600909	华安证券	286,800	2,093,640.00	0.29
69	601100	恒立液压	41,900	2,084,525.00	0.29
70	600143	金发科技	285,369	2,077,486.32	0.29
71	000686	东北证券	222,497	2,069,222.10	0.29
72	002387	维信诺	130,000	2,067,000.00	0.29
73	600879	航天电子	344,554	2,060,432.92	0.29
74	603444	吉比特	6,877	2,052,715.73	0.29
75	600079	人福医药	150,156	2,028,607.56	0.28
76	600486	扬农化工	29,500	2,024,585.00	0.28
77	600528	中铁工业	176,000	2,024,000.00	0.28
78	002250	联化科技	117,087	2,005,700.31	0.28
79	601231	环旭电子	103,500	1,990,305.00	0.28
80	000513	丽珠集团	58,506	1,971,652.20	0.28
81	002174	游族网络	84,500	1,966,315.00	0.28
82	000999	华润三九	62,062	1,966,124.16	0.28
83	600446	金证股份	95,000	1,955,100.00	0.27
84	601799	星宇股份	20,400	1,937,592.00	0.27
85	600728	佳都科技	206,500	1,936,970.00	0.27
86	002670	国盛金控	152,376	1,936,698.96	0.27
87	002223	鱼跃医疗	95,255	1,935,581.60	0.27
88	600256	广汇能源	583,500	1,931,385.00	0.27
89	600460	士兰微	124,684	1,928,861.48	0.27
90	600567	山鹰纸业	508,290	1,916,253.30	0.27
91	002281	光迅科技	64,345	1,916,194.10	0.27
92	002019	亿帆医药	116,983	1,900,973.75	0.27
93	600895	张江高科	122,683	1,878,276.73	0.26
94	000778	新兴铸管	442,489	1,845,179.13	0.26
95	000878	云南铜业	134,714	1,840,193.24	0.26
96	000997	新大陆	115,822	1,839,253.36	0.26
97	002152	广电运通	190,869	1,834,251.09	0.26
98	002074	国轩高科	126,000	1,833,300.00	0.26
99	002092	中泰化学	269,724	1,831,425.96	0.26
100	000547	航天发展	178,025	1,819,415.50	0.26
101	600572	康恩贝	295,729	1,818,733.35	0.26

102	300418	昆仑万维	108,307	1,814,142.25	0.25
103	600521	华海药业	104,800	1,808,848.00	0.25
104	002110	三钢闽光	192,859	1,805,160.24	0.25
105	600820	隧道股份	298,800	1,804,752.00	0.25
106	600410	华胜天成	174,072	1,794,682.32	0.25
107	002013	中航机电	258,300	1,792,602.00	0.25
108	300058	蓝色光标	314,852	1,778,913.80	0.25
109	600132	重庆啤酒	34,200	1,777,032.00	0.25
110	603659	璞泰来	20,800	1,771,120.00	0.25
111	000581	威孚高科	92,813	1,768,087.65	0.25
112	600497	驰宏锌锗	403,200	1,766,016.00	0.25
113	603939	益丰药房	24,100	1,764,602.00	0.25
114	600845	宝信软件	53,430	1,757,847.00	0.25
115	600466	蓝光发展	238,380	1,756,860.60	0.25
116	601966	玲珑轮胎	76,092	1,744,789.56	0.24
117	600549	厦门钨业	133,719	1,743,695.76	0.24
118	002075	沙钢股份	279,700	1,742,531.00	0.24
119	300166	东方国信	133,699	1,738,087.00	0.24
120	603000	人民网	87,570	1,733,010.30	0.24
121	002212	南洋股份	90,565	1,721,640.65	0.24
122	601005	重庆钢铁	929,100	1,718,835.00	0.24
123	300308	中际旭创	32,840	1,712,606.00	0.24
124	000830	鲁西化工	162,533	1,708,221.83	0.24
125	601168	西部矿业	301,978	1,999,094.36	0.28
126	002385	大北农	401,900	2,001,462.00	0.28
127	600260	凯乐科技	125,569	1,703,971.33	0.24
128	600839	四川长虹	584,880	1,702,000.80	0.24
129	000060	中金岭南	395,800	1,701,940.00	0.24
130	300274	阳光电源	161,605	1,701,700.65	0.24
131	600273	嘉化能源	151,000	1,698,750.00	0.24
132	300113	顺网科技	65,959	1,694,486.71	0.24
133	000636	风华高科	113,474	1,689,627.86	0.24
134	603858	步长制药	81,379	1,678,034.98	0.24
135	002690	美亚光电	42,850	1,675,435.00	0.23
136	688029	南微医学	10,568	1,667,207.68	0.23
137	000039	中集集团	168,851	1,658,116.82	0.23
138	000960	锡业股份	158,600	1,655,784.00	0.23
139	600021	上海电力	205,445	1,653,832.25	0.23
140	600315	上海家化	53,198	1,645,946.12	0.23

141	002217	合力泰	296,200	1,643,910.00	0.23
142	601333	广深铁路	537,100	1,643,526.00	0.23
143	600881	亚泰集团	514,652	1,641,739.88	0.23
144	600884	杉杉股份	120,853	1,632,724.03	0.23
145	300251	光线传媒	138,300	1,631,940.00	0.23
146	600376	首开股份	204,300	1,628,271.00	0.23
147	601866	中远海发	628,251	1,627,170.09	0.23
148	600258	首旅酒店	78,300	1,613,763.00	0.23
149	600779	水井坊	31,000	1,604,250.00	0.22
150	300001	特锐德	93,350	1,603,753.00	0.22
151	600875	东方电气	174,359	1,602,359.21	0.22
152	002807	江阴银行	343,289	1,599,726.74	0.22
153	300316	晶盛机电	101,700	1,598,724.00	0.22
154	002191	劲嘉股份	139,271	1,589,082.11	0.22
155	600380	健康元	153,452	1,588,228.20	0.22
156	000089	深圳机场	162,448	1,587,116.96	0.22
157	600160	巨化股份	217,392	1,582,613.76	0.22
158	600811	东方集团	470,676	1,581,471.36	0.22
159	600959	江苏有线	396,050	1,576,279.00	0.22
160	600776	东方通信	75,500	1,572,665.00	0.22
161	603338	浙江鼎力	21,900	1,565,850.00	0.22
162	600718	东软集团	137,786	1,563,871.10	0.22
163	000690	宝新能源	275,695	1,557,676.75	0.22
164	600155	华创阳安	109,874	1,541,532.22	0.22
165	300115	长盈精密	86,479	1,538,461.41	0.22
166	000402	金融街	188,900	1,533,868.00	0.22
167	000983	西山煤电	249,600	1,530,048.00	0.21
168	600166	福田汽车	729,002	1,523,614.18	0.21
169	600392	盛和资源	166,881	1,513,610.67	0.21
170	600415	小商品城	389,500	1,507,365.00	0.21
171	300009	安科生物	99,800	1,505,982.00	0.21
172	600755	厦门国贸	205,115	1,505,544.10	0.21
173	002368	太极股份	38,519	1,499,159.48	0.21
174	600022	山东钢铁	1,040,280	1,487,600.40	0.21
175	600643	爱建集团	153,647	1,475,011.20	0.21
176	600580	卧龙电驱	122,325	1,470,346.50	0.21
177	002589	瑞康医药	190,699	1,466,475.31	0.21
178	600373	中文传媒	107,400	1,461,714.00	0.20
179	000729	燕京啤酒	223,310	1,455,981.20	0.20

180	002085	万丰奥威	207,800	1,454,600.00	0.20
181	600754	锦江酒店	50,664	1,454,563.44	0.20
182	000970	中科三环	135,068	1,451,981.00	0.20
183	600282	南钢股份	420,854	1,451,946.30	0.20
184	600808	马钢股份	472,635	1,450,989.45	0.20
185	600266	城建发展	178,682	1,447,324.20	0.20
186	300027	华谊兄弟	309,900	1,434,837.00	0.20
187	600737	中粮糖业	169,393	1,433,064.78	0.20
188	600167	联美控股	108,830	1,432,202.80	0.20
189	600216	浙江医药	107,057	1,429,210.95	0.20
190	002233	塔牌集团	113,321	1,427,844.60	0.20
191	600967	内蒙一机	133,864	1,422,974.32	0.20
192	300010	立思辰	110,100	1,421,391.00	0.20
193	000021	深科技	116,565	1,419,761.70	0.20
194	002221	东华能源	182,944	1,419,645.44	0.20
195	002407	多氟多	108,090	1,417,059.90	0.20
196	600171	上海贝岭	89,203	1,404,947.25	0.20
197	000825	太钢不锈	342,700	1,401,643.00	0.20
198	603882	金域医学	27,300	1,398,306.00	0.20
199	603885	吉祥航空	93,075	1,396,125.00	0.20
200	000563	陕国投 A	313,946	1,390,780.78	0.20
201	600037	歌华有线	154,308	1,390,315.08	0.19
202	600804	鹏博士	226,900	1,388,628.00	0.19
203	600026	中远海能	216,707	1,382,590.66	0.19
204	601699	潞安环能	190,000	1,379,400.00	0.19
205	600435	北方导航	165,145	1,374,006.40	0.19
206	601098	中南传媒	113,813	1,358,927.22	0.19
207	600060	海信视像	124,382	1,349,544.70	0.19
208	600777	新潮能源	641,900	1,347,990.00	0.19
209	000031	大悦城	186,530	1,339,285.40	0.19
210	600064	南京高科	137,094	1,336,666.50	0.19
211	601118	海南橡胶	271,100	1,333,812.00	0.19
212	000598	兴蓉环境	283,872	1,314,327.36	0.18
213	002372	伟星新材	99,620	1,311,995.40	0.18
214	002317	众生药业	103,265	1,311,465.50	0.18
215	002028	思源电气	95,116	1,309,747.32	0.18
216	603816	顾家家居	28,620	1,308,792.60	0.18
217	600511	国药股份	47,895	1,307,054.55	0.18
218	300244	迪安诊断	58,997	1,305,603.61	0.18

219	600640	号百控股	50,521	1,303,947.01	0.18
220	600782	新钢股份	252,600	1,295,838.00	0.18
221	002936	郑州银行	278,500	1,295,025.00	0.18
222	000883	湖北能源	309,300	1,289,781.00	0.18
223	603866	桃李面包	30,280	1,285,083.20	0.18
224	002038	双鹭药业	97,641	1,283,979.15	0.18
225	000807	云铝股份	248,311	1,276,318.54	0.18
226	600863	内蒙华电	460,000	1,265,000.00	0.18
227	601106	中国一重	434,500	1,264,395.00	0.18
228	600094	大名城	252,500	1,477,125.00	0.21
229	603228	景旺电子	28,686	1,257,020.52	0.18
230	603707	健友股份	30,300	1,256,844.00	0.18
231	002414	高德红外	59,324	1,245,804.00	0.17
232	603077	和邦生物	839,285	1,242,141.80	0.17
233	600409	三友化工	196,197	1,239,965.04	0.17
234	002004	华邦健康	250,990	1,239,890.60	0.17
235	300133	华策影视	166,871	1,234,845.40	0.17
236	600597	光明乳业	96,930	1,230,041.70	0.17
237	601958	金钼股份	153,300	1,227,933.00	0.17
238	002242	九阳股份	48,712	1,225,593.92	0.17
239	002583	海能达	145,730	1,225,589.30	0.17
240	002440	闰土股份	109,391	1,225,179.20	0.17
241	601000	唐山港	469,343	1,220,291.80	0.17
242	002064	华峰氨纶	195,205	1,220,031.25	0.17
243	002048	宁波华翔	78,301	1,210,533.46	0.17
244	603806	福斯特	24,651	1,198,038.60	0.17
245	688188	柏楚电子	7,847	1,193,450.23	0.17
246	000738	航发控制	90,800	1,186,756.00	0.17
247	000932	华菱钢铁	267,460	1,278,458.80	0.18
248	601179	中国西电	324,751	1,182,093.64	0.17
249	000877	天山股份	99,686	1,181,279.10	0.17
250	600008	首创股份	359,000	1,181,110.00	0.17
251	000559	万向钱潮	218,001	1,170,665.37	0.16
252	000027	深圳能源	188,413	1,170,044.73	0.16
253	603883	老百姓	18,225	1,167,858.00	0.16
254	601689	拓普集团	66,880	1,165,718.40	0.16
255	000930	中粮科技	175,652	1,159,303.20	0.16
256	002399	海普瑞	59,300	1,156,943.00	0.16
257	600138	中青旅	91,733	1,155,835.80	0.16

258	600388	龙净环保	118,547	1,155,833.25	0.16
259	000685	中山公用	140,251	1,155,668.24	0.16
260	300026	红日药业	329,041	1,154,933.91	0.16
261	600507	方大特钢	114,685	1,153,731.10	0.16
262	600039	四川路桥	343,111	1,152,852.96	0.16
263	600970	中材国际	165,360	1,152,559.20	0.16
264	600649	城投控股	200,400	1,146,288.00	0.16
265	600827	百联股份	127,100	1,141,358.00	0.16
266	600500	中化国际	214,478	1,136,733.40	0.16
267	000528	柳工	163,693	1,136,029.42	0.16
268	300180	华峰超纤	128,400	1,135,056.00	0.16
269	600908	无锡银行	204,477	1,134,847.35	0.16
270	601718	际华集团	347,800	1,133,828.00	0.16
271	600729	重庆百货	37,925	1,132,061.25	0.16
272	300072	三聚环保	178,700	1,129,384.00	0.16
273	300182	捷成股份	323,293	1,128,292.57	0.16
274	600633	浙数文化	123,024	1,125,669.60	0.16
275	601228	广州港	293,700	1,124,871.00	0.16
276	000008	神州高铁	308,335	1,119,256.05	0.16
277	000012	南玻 A	221,133	1,107,876.33	0.16
278	002831	裕同科技	41,700	1,107,135.00	0.16
279	600515	海航基础	247,900	1,105,634.00	0.16
280	600056	中国医药	84,695	1,105,269.75	0.15
281	600120	浙江东方	126,060	1,100,503.80	0.15
282	000090	天健集团	207,155	1,097,921.50	0.15
283	600598	北大荒	112,710	1,097,795.40	0.15
284	000712	锦龙股份	70,968	1,078,713.60	0.15
285	600062	华润双鹤	82,649	1,078,569.45	0.15
286	000488	晨鸣纸业	211,591	1,076,998.19	0.15
287	002665	首航节能	320,314	1,076,255.04	0.15
288	000028	国药一致	23,671	1,073,716.56	0.15
289	600158	中体产业	106,956	1,072,768.68	0.15
290	600823	世茂股份	237,656	1,069,452.00	0.15
291	601717	郑煤机	165,202	1,068,856.94	0.15
292	002056	横店东磁	130,143	1,067,172.60	0.15
293	600563	法拉电子	21,478	1,062,087.10	0.15
294	600348	阳泉煤业	190,554	1,053,763.62	0.15
295	600418	江淮汽车	209,912	1,053,758.24	0.15
296	002155	湖南黄金	133,372	1,052,305.08	0.15



297	000887	中鼎股份	116,021	1,049,990.05	0.15
298	000826	启迪环境	113,300	1,040,094.00	0.15
299	000158	常山北明	152,080	1,037,185.60	0.15
300	002266	浙富控股	250,781	1,033,217.72	0.14
301	000400	许继电气	95,840	1,032,196.80	0.14
302	600648	外高桥	59,300	1,030,041.00	0.14
303	002002	鸿达兴业	245,981	1,023,280.96	0.14
304	601608	中信重工	274,900	1,022,628.00	0.14
305	600307	酒钢宏兴	495,999	1,021,757.94	0.14
306	002030	达安基因	88,468	1,017,382.00	0.14
307	601598	中国外运	237,800	1,013,028.00	0.14
308	002408	齐翔腾达	140,667	1,005,769.05	0.14
309	300002	神州泰岳	308,202	1,004,738.52	0.14
310	600717	天津港	159,099	999,141.72	0.14
311	601880	大连港	490,136	994,976.08	0.14
312	000301	东方盛虹	191,500	991,970.00	0.14
313	002183	怡亚通	235,350	990,823.50	0.14
314	600277	亿利洁能	216,911	989,114.16	0.14
315	002701	奥瑞金	223,927	987,518.07	0.14
316	000078	海王生物	262,530	979,236.90	0.14
317	600862	中航高科	88,289	972,944.78	0.14
318	002244	滨江集团	197,192	970,184.64	0.14
319	000732	泰禾集团	157,672	969,682.80	0.14
320	600557	康缘药业	65,779	969,582.46	0.14
321	000501	鄂武商 A	72,810	966,916.80	0.14
322	002815	崇达技术	55,744	963,813.76	0.14
323	002390	信邦制药	182,845	959,936.25	0.13
324	000681	视觉中国	55,524	957,233.76	0.13
325	000758	中色股份	217,966	954,691.08	0.13
326	002640	跨境通	123,412	952,740.64	0.13
327	002603	以岭药业	76,324	948,707.32	0.13
328	000156	华数传媒	90,819	948,150.36	0.13
329	002925	盈趣科技	21,400	940,530.00	0.13
330	300134	大富科技	60,776	937,165.92	0.13
331	002280	联络互动	241,426	934,318.62	0.13
332	600291	西水股份	103,600	931,364.00	0.13
333	300324	旋极信息	166,144	930,406.40	0.13
334	600195	中牧股份	79,863	922,417.65	0.13
335	601928	凤凰传媒	120,900	920,049.00	0.13

336	000718	苏宁环球	240,348	918,129.36	0.13
337	002444	巨星科技	85,233	915,402.42	0.13
338	002635	安洁科技	54,597	910,131.99	0.13
339	600141	兴发集团	88,411	908,865.08	0.13
340	000717	韶钢松山	191,700	908,658.00	0.13
341	600545	卓郎智能	149,645	908,345.15	0.13
342	002302	西部建设	80,000	903,200.00	0.13
343	600664	哈药股份	238,305	903,175.95	0.13
344	002203	海亮股份	88,000	902,000.00	0.13
345	002426	胜利精密	381,593	900,559.48	0.13
346	002709	天赐材料	43,393	898,235.10	0.13
347	600901	江苏租赁	142,000	897,440.00	0.13
348	600339	中油工程	264,600	896,994.00	0.13
349	600765	中航重机	87,490	895,022.70	0.13
350	000813	德展健康	142,037	893,412.73	0.13
351	601975	招商南油	317,500	892,175.00	0.13
352	601611	中国核建	124,700	889,111.00	0.12
353	600316	洪都航空	68,153	888,033.59	0.12
354	000959	首钢股份	251,400	887,442.00	0.12
355	000967	盈峰环境	142,800	881,076.00	0.12
356	600645	中源协和	51,934	879,242.62	0.12
357	601678	滨化股份	171,320	875,445.20	0.12
358	600748	上实发展	146,124	867,976.56	0.12
359	603233	大参林	16,600	867,350.00	0.12
360	000761	本钢板材	219,720	865,696.80	0.12
361	600125	铁龙物流	144,763	865,682.74	0.12
362	603712	七一二	35,800	865,644.00	0.12
363	600499	科达洁能	199,872	865,445.76	0.12
364	002249	大洋电机	223,931	864,373.66	0.12
365	600869	智慧能源	175,311	859,023.90	0.12
366	600859	王府井	60,929	852,396.71	0.12
367	002839	张家港行	143,200	850,608.00	0.12
368	600017	日照港	292,294	850,575.54	0.12
369	600835	上海机电	51,130	847,224.10	0.12
370	000519	中兵红箭	110,386	841,141.32	0.12
371	000987	越秀金控	86,906	840,381.02	0.12
372	600582	天地科技	262,224	836,494.56	0.12
373	600751	海航科技	285,370	836,134.10	0.12
374	600259	广晟有色	23,956	832,950.12	0.12

375	600312	平高电气	128,937	832,933.02	0.12
376	000543	皖能电力	179,501	832,884.64	0.12
377	600565	迪马股份	231,562	828,991.96	0.12
378	600073	上海梅林	104,009	828,951.73	0.12
379	002745	木林森	60,714	826,317.54	0.12
380	600478	科力远	183,311	806,568.40	0.11
381	002434	万里扬	84,900	804,852.00	0.11
382	002419	天虹股份	76,100	802,855.00	0.11
383	601200	上海环境	72,313	802,674.30	0.11
384	000006	深振业 A	149,677	802,268.72	0.11
385	002920	德赛西威	26,200	794,646.00	0.11
386	002491	通鼎互联	119,901	792,545.61	0.11
387	002128	露天煤业	91,329	790,909.14	0.11
388	600317	营口港	307,600	784,380.00	0.11
389	600126	杭钢股份	158,438	774,761.82	0.11
390	000727	华东科技	430,522	899,790.98	0.13
391	002051	中工国际	78,456	762,592.32	0.11
392	002285	世联行	202,753	760,323.75	0.11
393	002505	大康农业	434,411	760,219.25	0.11
394	603198	迎驾贡酒	37,500	747,000.00	0.10
395	002544	杰赛科技	54,300	739,566.00	0.10
396	002118	紫鑫药业	117,723	734,591.52	0.10
397	000848	承德露露	92,982	731,768.34	0.10
398	002375	亚厦股份	125,709	729,112.20	0.10
399	600787	中储股份	139,417	726,362.57	0.10
400	600639	浦东金桥	53,765	725,827.50	0.10
401	300159	新研股份	184,885	724,749.20	0.10
402	002382	蓝帆医疗	59,500	722,330.00	0.10
403	601326	秦港股份	226,100	721,259.00	0.10
404	002176	江特电机	189,163	711,252.88	0.10
405	300459	金科文化	222,496	709,762.24	0.10
406	601139	深圳燃气	90,600	709,398.00	0.10
407	000062	深圳华强	49,807	709,251.68	0.10
408	603328	依顿电子	61,631	697,662.92	0.10
409	600759	洲际油气	251,071	695,466.67	0.10
410	002470	金正大	260,316	692,440.56	0.10
411	603888	新华网	32,750	691,025.00	0.10
412	601019	山东出版	99,200	689,440.00	0.10
413	000537	广宇发展	88,500	687,645.00	0.10

414	603568	伟明环保	29,839	684,506.66	0.10
415	300197	铁汉生态	223,050	682,533.00	0.10
416	000564	供销大集	285,499	682,342.61	0.10
417	603515	欧普照明	24,015	675,061.65	0.09
418	300376	易事特	147,054	673,507.32	0.09
419	300297	蓝盾股份	118,800	670,032.00	0.09
420	600770	综艺股份	123,517	665,756.63	0.09
421	603377	东方时尚	36,400	664,664.00	0.09
422	002573	清新环境	102,794	663,021.30	0.09
423	000553	安道麦 A	65,100	651,000.00	0.09
424	600985	淮北矿业	64,600	645,354.00	0.09
425	002093	国脉科技	79,880	643,832.80	0.09
426	600694	大商股份	23,325	638,871.75	0.09
427	600428	中远海特	169,580	634,229.20	0.09
428	600575	淮河能源	246,193	632,716.01	0.09
429	601016	节能风电	262,400	632,384.00	0.09
430	600329	中新药业	45,100	625,086.00	0.09
431	000869	张裕 A	21,600	619,920.00	0.09
432	002358	森源电气	88,351	617,573.49	0.09
433	000937	冀中能源	167,948	614,689.68	0.09
434	002681	奋达科技	128,817	718,798.86	0.10
435	603766	隆鑫通用	162,701	606,874.73	0.09
436	000061	农产品	107,542	601,159.78	0.08
437	002416	爱施德	78,320	596,015.20	0.08
438	600757	长江传媒	96,153	592,302.48	0.08
439	002867	周大生	31,100	592,144.00	0.08
440	300257	开山股份	54,403	591,904.64	0.08
441	000536	华映科技	219,220	591,894.00	0.08
442	000766	通化金马	90,486	591,778.44	0.08
443	600623	华谊集团	88,509	588,584.85	0.08
444	002503	搜于特	244,884	585,272.76	0.08
445	002424	贵州百灵	67,086	584,319.06	0.08
446	601001	大同煤业	132,591	583,400.40	0.08
447	000990	诚志股份	39,357	583,270.74	0.08
448	002672	东江环保	64,596	581,364.00	0.08
449	600006	东风汽车	126,731	580,427.98	0.08
450	000426	兴业矿业	116,393	578,473.21	0.08
451	002366	台海核电	82,496	574,172.16	0.08
452	688005	容百科技	17,937	571,114.08	0.08

453	600098	广州发展	86,445	565,350.30	0.08
454	000980	众泰汽车	192,800	564,904.00	0.08
455	002625	光启技术	61,300	560,895.00	0.08
456	000600	建投能源	113,590	555,455.10	0.08
457	600338	西藏珠峰	43,622	545,275.00	0.08
458	600058	五矿发展	67,632	542,408.64	0.08
459	603486	科沃斯	26,720	542,148.80	0.08
460	600657	信达地产	135,541	540,808.59	0.08
461	601615	明阳智能	43,400	533,820.00	0.07
462	600903	贵州燃气	35,500	524,690.00	0.07
463	600350	山东高速	106,800	524,388.00	0.07
464	002482	广田集团	119,624	523,953.12	0.07
465	002437	誉衡药业	172,236	521,875.08	0.07
466	600053	九鼎投资	20,500	521,315.00	0.07
467	601801	皖新传媒	94,500	517,860.00	0.07
468	002948	青岛银行	87,100	517,374.00	0.07
469	601127	小康股份	44,800	510,720.00	0.07
470	603056	德邦股份	45,670	507,393.70	0.07
471	603556	海兴电力	31,120	507,256.00	0.07
472	600874	创业环保	68,649	493,586.31	0.07
473	600707	彩虹股份	113,700	477,540.00	0.07
474	002653	海思科	23,400	476,424.00	0.07
475	601003	柳钢股份	81,200	458,780.00	0.06
476	002818	富森美	35,610	450,466.50	0.06
477	601869	长飞光纤	12,964	428,200.92	0.06
478	300199	翰宇药业	72,818	422,344.40	0.06
479	603983	丸美股份	6,800	408,204.00	0.06
480	600996	贵广网络	50,047	402,878.35	0.06
481	600335	国机汽车	69,218	401,464.40	0.06
482	000025	特力 A	18,796	398,475.20	0.06
483	601969	海南矿业	62,000	358,980.00	0.05
484	601860	紫金银行	63,500	356,870.00	0.05
485	603379	三美股份	9,200	343,620.00	0.05
486	601811	新华文轩	25,127	331,425.13	0.05
487	603225	新凤鸣	26,646	329,078.10	0.05
488	603650	彤程新材	18,476	321,851.92	0.05
489	603317	天味食品	7,100	318,790.00	0.04
490	603355	莱克电气	12,803	303,047.01	0.04
491	603868	飞科电器	7,566	285,086.88	0.04

492	002423	中粮资本	29,100	282,561.00	0.04
493	601865	福莱特	23,100	280,203.00	0.04
494	600939	重庆建工	57,500	276,575.00	0.04
495	603025	大豪科技	28,641	271,230.27	0.04
496	601068	中铝国际	48,700	269,798.00	0.04
497	001872	招商港口	15,600	267,696.00	0.04
498	603256	宏和科技	14,900	220,073.00	0.03
499	600917	重庆燃气	29,653	215,280.78	0.03
500	688166	博瑞医药	8,041	206,171.24	0.03
501	002941	新疆交建	11,300	198,315.00	0.03
502	002957	科瑞技术	6,000	196,620.00	0.03
503	688181	八亿时空	4,306	189,377.88	0.03
504	002946	新乳业	15,000	188,400.00	0.03
505	603877	太平鸟	9,094	138,865.38	0.02
506	688198	佰仁医疗	3,213	120,744.54	0.02
507	688389	普门科技	6,931	93,984.36	0.01
508	002972	科安达	1,075	21,532.25	0.00
509	603109	神驰机电	684	18,105.48	0.00
510	002973	侨银环保	1,146	6,578.04	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	002405	四维图新	9,760,274.74	2.85
2	002157	正邦科技	7,656,712.69	2.24
3	000066	中国长城	5,748,853.29	1.68
4	002797	第一创业	4,457,426.48	1.30
5	002129	中环股份	4,327,893.54	1.26
6	000860	顺鑫农业	4,082,144.60	1.19
7	002273	水晶光电	4,026,172.82	1.18
8	300014	亿纬锂能	3,913,215.36	1.14
9	601099	太平洋	3,899,761.00	1.14
10	002384	东山精密	3,682,414.81	1.08
11	002821	凯莱英	3,645,878.00	1.07
12	002127	南极电商	3,526,499.64	1.03

13	002075	沙钢股份	3,445,321.46	1.01
14	002049	紫光国微	3,443,713.00	1.01
15	000975	银泰黄金	3,442,056.58	1.01
16	002385	大北农	3,425,991.08	1.00
17	002916	深南电路	3,418,121.61	1.00
18	002506	协鑫集成	3,405,664.22	1.00
19	002439	启明星辰	3,372,446.27	0.99
20	300253	卫宁健康	3,342,735.68	0.98

注：不考虑相关交易费用。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002405	四维图新	7,224,390.92	2.11
2	000860	顺鑫农业	7,128,083.26	2.08
3	002916	深南电路	5,787,988.72	1.69
4	300450	先导智能	5,410,127.77	1.58
5	600183	生益科技	4,699,465.27	1.37
6	002157	正邦科技	4,313,127.00	1.26
7	603501	韦尔股份	4,309,645.00	1.26
8	002506	协鑫集成	4,195,250.00	1.23
9	300347	泰格医药	3,840,223.76	1.12
10	002299	圣农发展	3,733,825.47	1.09
11	600872	中炬高新	3,660,299.14	1.07
12	002410	广联达	3,454,273.87	1.01
13	000723	美锦能源	3,325,004.30	0.97
14	000656	金科股份	3,050,038.71	0.89
15	300146	汤臣倍健	2,927,516.00	0.86
16	002463	沪电股份	2,897,617.00	0.85
17	000066	中国长城	2,893,423.00	0.85
18	002607	中公教育	2,847,402.72	0.83
19	603369	今世缘	2,718,977.20	0.79
20	688008	澜起科技	2,647,313.51	0.77

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	632,986,134.57
卖出股票收入（成交）总额	453,152,882.53

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

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IC2003	中证 500 期货 2003 合约	30	31,389,600.00	149,640.00	-
公允价值变动总额合计（元）					149,640.00
股指期货投资本期收益（元）					3,741,359.23
股指期货投资本期公允价值变动（元）					149,640.00

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

#### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期内，基金投资股指期货的目的是为了提升基金的流动性水平，以及在期货贴水时作为现货的替代。

### 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	3,858,720.95
2	应收证券清算款	189,387.56
3	应收股利	-
4	应收利息	15,508.24
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,063,616.75

#### 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：本基金本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
7,743	79,094.64	381,038,224.00	62.22%	231,391,577.00	37.78%

### 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	359,037,644.00	58.63%

### 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	6.25%
2	李志鹤	22,916,793.00	3.74%
3	广发证券股份有限公司	6,194,720.00	1.01%
4	方正证券股份有限公司	4,960,325.00	0.81%
5	东方证券股份有限公司融券专用证券 账户	4,424,700.00	0.72%
6	华泰证券股份有限公司	3,705,500.00	0.61%
7	廖爱南	2,417,900.00	0.39%
8	夏建辉	1,500,000.00	0.24%
9	喀什哲悦文化传媒有限公司	1,215,400.00	0.20%
10	李天云	1,164,900.00	0.19%

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

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。

### 9.5 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	386,429,801.00
本报告期基金总申购份额	654,000,000.00
减:本报告期基金总赎回份额	428,000,000.00
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	612,429,801.00

## § 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，陆楨女士、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 60,000.00 元人民币，该事务所已向本基金提供了 5 年的审计服务。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信建投	4	519,313,762.48	48.56%	68,176.06	26.97%	-
华泰证券	2	406,512,427.75	38.02%	53,378.16	21.12%	-
华鑫证券	1	113,609,058.19	10.62%	103,532.51	40.96%	-
光大证券	2	27,792,050.41	2.60%	25,667.35	10.16%	-
中信证券	1	945,335.00	0.09%	861.51	0.34%	-
华融证券	1	853,113.14	0.08%	777.41	0.31%	-
中银国际	3	235,191.83	0.02%	219.05	0.09%	-
国元证券	1	134,154.50	0.01%	124.94	0.05%	-
民生证券	1	5,520.00	0.00%	5.03	0.00%	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
长江证券	3	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
北京高华	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-

中金财富证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
申港证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
财富证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	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
中信建投	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-

中信证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
西藏同信	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
北京高华	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金财富证 券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-



财富证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-

### 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 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
2	华泰柏瑞基金管理有限公司关于可对旗下在上海证券交易所上市的交易型开放式指数证券投资基金设置申购上限、赎回上限的公告	证监会指定报刊和网站	2019 年 12 月 18 日
3	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下 4 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 10 月 16 日
4	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下交易型开放式指数证券投资基金在首批科创板股票上市首日的风险提示性公告	证监会指定报刊和网站	2019 年 7 月 18 日
5	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
6	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
7	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
8	关于调低旗下华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金费率并修订基金合同和托管协议的公告	证监会指定报刊和网站	2019 年 6 月 10 日
9	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

## § 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	20190101-20191231	179,361,728.00	276,284,216.00	96,608,300.00	359,037,644.00	58.63%

#### 产品特有风险

本基金报告期内本基金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

注：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](http://www.huatai-pb.com)

华泰柏瑞基金管理有限公司

2020 年 3 月 30 日