

# 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 2020 年中期报告

2020 年 6 月 30 日

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2020 年 8 月 29 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 28 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 2020 年 6 月 30 日止。

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于 2018 年 6 月 13 日根据收费方式分不同，新增 C 类份额，C 类相关指标从 2018 年 6 月 13 日开始计算。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	8
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>9</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	9
3.2 基金净值表现.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>12</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	15
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	17
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>18</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	18
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	18
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	18
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>19</b>
6.1 资产负债表.....	19
6.2 利润表.....	20
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	21

6.4 报表附注.....	22
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>47</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	47
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	47
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	57
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	59
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	59
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	59
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	59
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	59
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细.....	59
7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	60
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	60
7.13 投资组合报告附注.....	60
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>62</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	62
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	62
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	62
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>64</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>65</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	65
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	65
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	65
10.4 基金投资策略的改变.....	65
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	65
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	65
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	65
10.8 其他重大事件.....	70
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>71</b>

---

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	71
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	71
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>72</b>
12.1 备查文件目录.....	72
12.2 存放地点.....	72
12.3 查阅方式.....	72

## § 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联接基金	
基金简称	华泰柏瑞中证 500ETF 联接	
基金主代码	001214	
基金运作方式	契约型开放式	
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	498,053,272.50 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	华泰柏瑞中证 500ETF 联接 A	华泰柏瑞中证 500ETF 联接 C
下属分级基金的交易代码:	001214	006087
报告期末下属分级基金的份额总额	228,293,440.67 份	269,759,831.83 份

#### 2.1.1 目标基金基本情况

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
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	本基金为华泰柏瑞中证 500ETF 的联接基金。华泰柏瑞中证 500ETF 是采用完全复制法实现对中证 500 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中证 500ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪。
业绩比较基准	95%*中证 500 指数收益率+5%*银行活期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为华泰柏瑞中证 500ETF 的联接基金，采用主要投资于目标 ETF 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中证 500 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。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	中国证券报
登载基金中期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>
基金中期报告备置地点	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
注册登记机构	华泰柏瑞基金管理有限公司	上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层



### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	华泰柏瑞中证 500ETF 联接 A	华泰柏瑞中证 500ETF 联接 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020 年 1 月 1 日 - 2020 年 6 月 30 日)	报告期(2020 年 1 月 1 日 - 2020 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	5,307,844.94	7,089,328.37
本期利润	21,211,077.02	30,413,982.09
加权平均基金份额本期利润	0.0742	0.0677
本期加权平均净值利润率	12.33%	11.19%
本期基金份额净值增长率	13.44%	13.29%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	-80,719,722.42	-115,004,576.27
期末可供分配基金份额利润	-0.3536	-0.4263
期末基金资产净值	149,870,960.57	178,226,948.84
期末基金份额净值	0.6565	0.6607
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	-34.35%	11.19%

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

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

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

#### 3.2 基金净值表现

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

华泰柏瑞中证 500ETF 联接 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	8.93%	0.85%	8.04%	0.84%	0.89%	0.01%
过去三个月	17.25%	1.08%	15.47%	1.08%	1.78%	0.00%
过去六个月	13.44%	1.69%	10.84%	1.70%	2.60%	-0.01%
过去一年	23.84%	1.37%	17.63%	1.39%	6.21%	-0.02%
过去三年	4.97%	1.37%	-3.82%	1.39%	8.79%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-34.35%	1.67%	-30.82%	1.74%	-3.53%	-0.07%

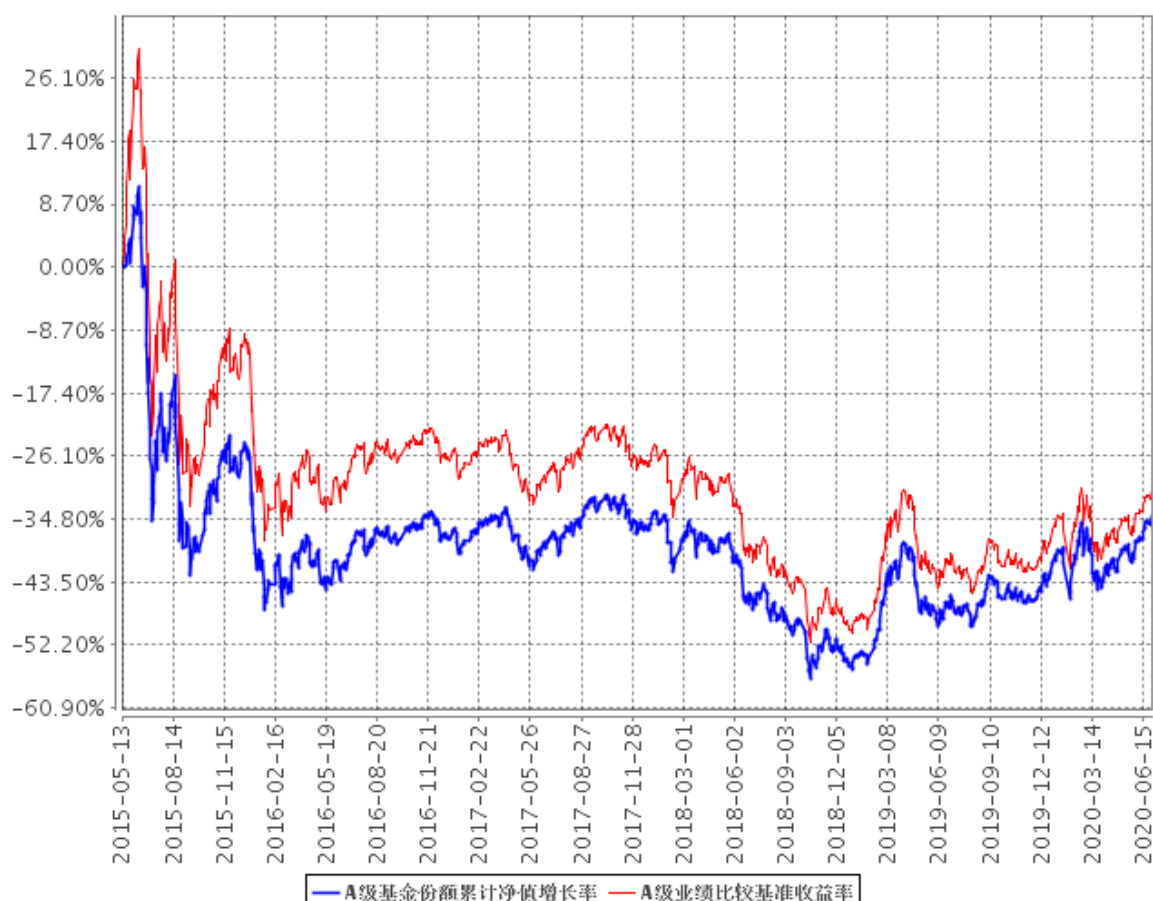
华泰柏瑞中证 500ETF 联接 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	8.90%	0.85%	8.04%	0.84%	0.86%	0.01%
过去三个月	17.19%	1.07%	15.47%	1.08%	1.72%	-0.01%
过去六个月	13.29%	1.69%	10.84%	1.70%	2.45%	-0.01%
过去一年	23.52%	1.37%	17.63%	1.39%	5.89%	-0.02%
自基金合同生效起至今	11.19%	1.50%	3.21%	1.52%	7.98%	-0.02%

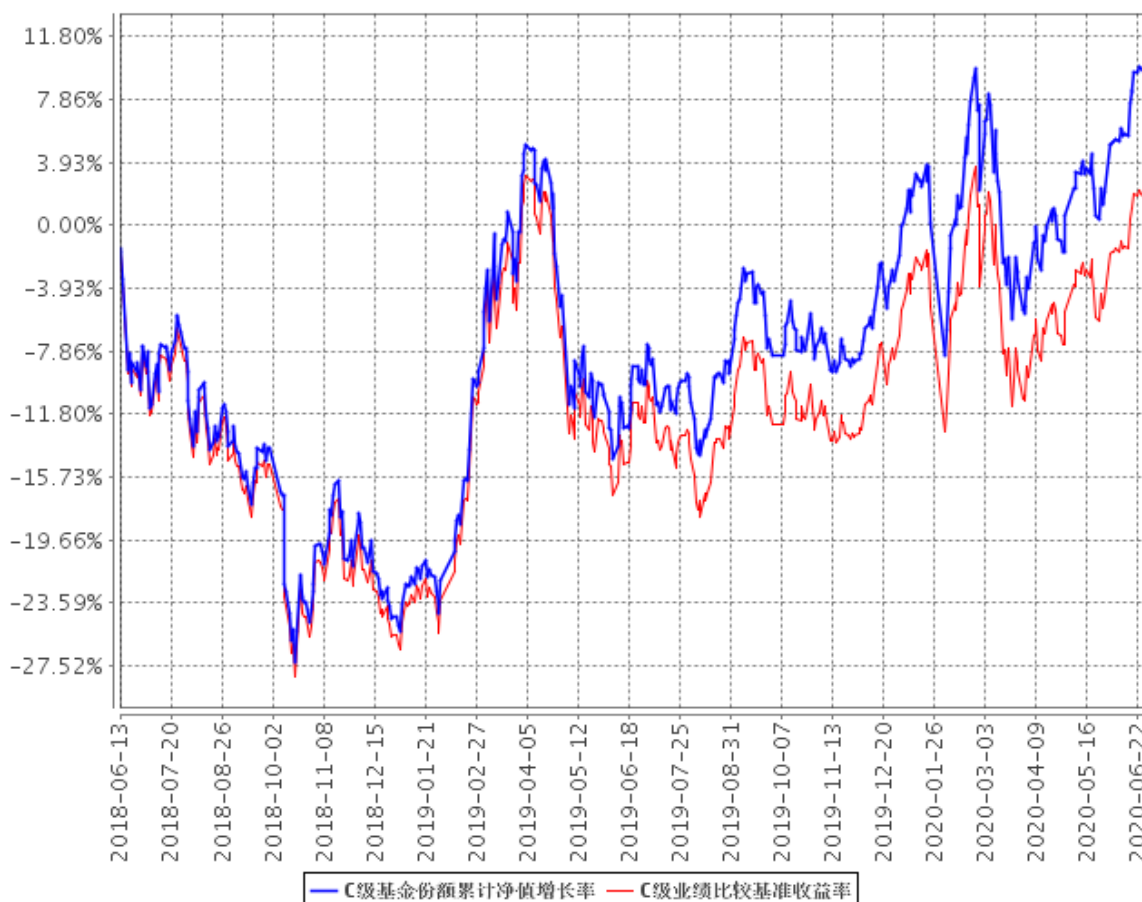
注：C类份额业绩计算期间为2018年6月13日至2020年6月30日。

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

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：A类图示日期为2015年5月13日至2020年6月30日。C类图示日期为2018年6月13日至2020年6月30日。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司。华泰柏瑞基金管理有限公司是经中国证监会批准，于 2004 年 11 月 18 日成立的合资基金管理公司，注册资本为 2 亿元人民币。目前的股东构成为华泰证券股份有限公司、柏瑞投资有限责任公司（原 AIGGIC）和苏州新区高新技术产业股份有限公司，出资比例分别为 49%、49% 和 2%。目前公司旗下管理华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金、华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金、上证红利交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金、华泰柏瑞货币市场证券投资基金、华泰柏瑞行业领先混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化先行混合型证券投资基金、华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金、上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金、华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金、华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金、华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金、华泰柏瑞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、华泰柏瑞锦兴 39 个月定期开放债券型证券投资基金、华泰柏瑞锦瑞债券型证券投资基金、华泰柏瑞益商一年定期开放华泰柏瑞益商型发起式证券投资基金、华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞质量成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞行业精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞鸿利中短债债券型证券投资基金、华泰柏瑞景气优选混合型证券投资基金。截至 2020 年 6 月 30 日，公司基金管理规模为 1317.21 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	-	19 年	19 年证券（基金）从业经历，复旦大学财务管理硕士，2000 年至 2001 年在上海汽车集团财务有限公司从事财务工作，2001 年至 2004 年任华安基金管理有限公司高级基金核算员，2004 年 7 月起加入本公司，历任基金事务部总监、基金经理助理。2009 年 6 月起任华泰柏瑞（原友邦华泰）上证红利交易型开放式指数基金基金经理。2010 年 10 月起任指数投资部副总监。2011 年 1 月至 2020 年 2 月任上证中小盘 ETF 及华泰柏瑞上证中小盘 ETF 联接基金基金经理。2012 年 5 月起担任华泰柏瑞沪深 300ETF 及华泰柏瑞沪深

					<p>300ETF 联接基金基金经理。2015 年 2 月起任指数投资部总监。2015 年 5 月起任华泰柏瑞中证 500 ETF 及华泰柏瑞中证 500ETF 联接基金的基金经理。2018 年 3 月至 2018 年 11 月任华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证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。2020 年 2 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联接基金的基金经理。</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。任职日期和离任日期指基金管理公司作出决定之日。

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

注：无。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及其他相关法律、法规的规定以及本基金的《基

金合同》的约定，在严格控制风险的基础上，忠实履行基金管理职责，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金投资管理符合有关法律、法规的规定及基金合同的约定，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司将投资管理职能和交易执行职能完全隔离，实行集中交易制度，由交易部为公募基金、专户理财和海外投资等业务统一交易服务，为公平交易的实施提供了较好的保障。目前公司公募基金经理有兼任私募资产管理计划投资经理的情况，兼任业务遵照相关法律法规要求进行，同时遵守公司公平交易制度。公司机构设置合理，公平交易的相关管理制度健全，投资决策流程完善，各项制度执行情况良好。交易价差分析表明公司旗下各基金均得到了公平对待，不存在非公平交易和利益输送的行为。经过对不同基金之间交易相同证券时的同向交易价差进行分析发现，报告期内基金之间的买卖交易价差总体上处于正常的合理水平。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

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

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2020 年上半年市场以结构性机会为主。其中医药生物、休闲服务、电子、食品饮料等行业录得正收益，期间医药生物行业指数上涨达 40.28%，休闲服务行业指数上涨达 30.07%。整体来看，沪深 300、中证 500、中证 1000 和创业板涨跌幅分别为 1.64%、11.33%、13.52%、和 35.60%。从市场风格来看，成长风格表现相对强势，优于价值风格，期间沪深 300 价值指数和沪深 300 成长指数涨跌幅分别为-13.18%和 11.39%，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 2.682%，日均绝对跟踪偏离度为 0.031%，期间日跟踪误差为 0.043%，较好地实现了本基金的投资目标。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末华泰柏瑞中证 500ETF 联接 A 基金份额净值为 0.6565 元，本报告期基金份额净值增长率为 13.44%；截至本报告期末华泰柏瑞中证 500ETF 联接 C 基金份额净值为 0.6607 元，本报告期基金份额净值增长率为 13.29%；同期业绩比较基准收益率为 10.84%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

随着疫情逐步控制和国内复工复产逐步完成，国内经济数据持续改善。二季度以来国内经济表现略超市场预期，实体经济各方面都在逐步恢复正轨，并且部分领域有明显的亮点。第一，工业生产持续恢复。工业增加值增速在 4 月已经转正（3.9%），且高频的耗煤量增速、发电量、高炉开工率等指标均在持续好转；工业品出厂价格环比也开始出现改善，预计后续通缩压力将逐渐减小。第二，国内需求有显著改善，尤其地产和汽车表现亮眼。30 个大中城市商品房成交 5 月同比已转正；乘联会公布的乘用车日均销售增速已恢复到疫情之前的水平，其中批发增速已创出两位数的阶段性新高。第三，出口表现好于预期。5 月份单月货物贸易顺差已创历史同期新高，再加上疫情导致的服务贸易逆差收窄，二季度净出口对 GDP 的贡献将显著增加。下半年，财政政策将成为主要的发力端。两会政策定调，首次不设 GDP 增长目标，财政政策力度明显加大，财政赤字率 3.6%以上、地方专项债 3.75 万亿、抗疫特别国债 1 万亿，且增加的财政赤字与特别国债共 2 万亿全部转给地方，直达市县基层，直接惠企利民。宏观流动性角度，宽信用是三季度主旋律，充裕的货币将依然贯穿下半年，在流动性仍处于宽松状态下，我们认为指数震荡上行，继续看好下半年结构性机会。

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

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定，在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至多 12 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。

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

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 托管人对本中期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 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	17,975,556.94	24,733,878.55
结算备付金		16,989.38	85,032.92
存出保证金		10,808.93	58,644.11
交易性金融资产	6.4.7.2	310,843,632.37	439,458,224.06
其中：股票投资		11,531,715.65	21,394,791.39
基金投资		299,311,916.72	418,063,432.67
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		25,981.53	232,189.55
应收利息	6.4.7.5	2,715.33	5,872.19
应收股利		-	-
应收申购款		2,107,684.35	741,788.35
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	578,401.20	288.00
资产总计		331,561,770.03	465,315,917.73
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2019 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		3,304,125.54	2,631,422.37
应付管理人报酬		5,203.76	5,473.34
应付托管费		1,734.60	1,824.46
应付销售服务费		44,713.63	55,217.19
应付交易费用	6.4.7.7	16,956.75	20,516.24
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	91,126.34	181,624.23
负债合计		3,463,860.62	2,896,077.83
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	498,053,272.50	795,300,636.51
未分配利润	6.4.7.10	-169,955,363.09	-332,880,796.61
所有者权益合计		328,097,909.41	462,419,839.90
负债和所有者权益总计		331,561,770.03	465,315,917.73

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额总额为 498,053,272.50 份，其中 A 类基金份额净值 0.6565 元，A 类基金份额总额 22,829,3440.67 份；C 类基金份额净值 0.6607 元，C 类基金份额总额 26,975,9831.83 份。

## 6.2 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联接基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		52,155,409.82	26,816,907.16
1.利息收入		76,755.02	76,801.07
其中：存款利息收入	6.4.7.11	76,747.16	76,801.07
债券利息收入		7.86	-
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）		12,749,250.67	-11,519,428.26
其中：股票投资收益	6.4.7.12	3,399,748.13	-787,000.70
基金投资收益	6.4.7.13	9,211,303.78	-10,280,551.66
债券投资收益	6.4.7.14	7,581.57	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.14.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-544,829.51
股利收益	6.4.7.17	130,617.19	92,953.61
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	39,227,885.80	37,799,191.69
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	101,518.33	460,342.66

<b>减：二、费用</b>		530,350.71	331,474.30
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	33,176.82	43,302.53
2. 托管费	6.4.10.2.2	11,058.98	8,984.55
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	335,227.86	48,097.10
4. 交易费用	6.4.7.20	56,442.25	121,529.34
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	883.26
7. 其他费用	6.4.7.21	94,444.80	108,677.52
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		51,625,059.11	26,485,432.86
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		51,625,059.11	26,485,432.86

### 6.3 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联接基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	795,300,636.51	-332,880,796.61	462,419,839.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	51,625,059.11	51,625,059.11
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）	-297,247,364.01	111,300,374.41	-185,946,989.60
其中：1. 基金申购款	334,817,524.31	-131,722,272.77	203,095,251.54
2. 基金赎回款	-632,064,888.32	243,022,647.18	-389,042,241.14
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）	498,053,272.50	-169,955,363.09	328,097,909.41

项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	377,441,413.19	-207,929,202.19	169,512,211.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	26,485,432.86	26,485,432.86
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）	393,347,662.87	-178,549,015.19	214,798,647.68
其中：1. 基金申购款	802,966,824.14	-356,407,323.23	446,559,500.91
2. 基金赎回款	-409,619,161.27	177,858,308.04	-231,760,853.23
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）	770,789,076.06	-359,992,784.52	410,796,291.54

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

_____	_____	_____
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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 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联接基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2015]508 号《关于核准华泰柏瑞中证 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 661,756,456.44 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(2015)第 455 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联接基金基金合同》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 661,930,408.74 份基金份额，其中认购资金利息折合 173,952.30 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。

根据基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于 2018 年 6 月 12 日发布的《关于华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金增加 C 类份额并修改基金合同的公告》，经与基金托管人协商一致并报中国证监会备案，自 2018 年 6 月 13 日起对本基金增加 C 类基金份额并相应修改法律文件。在投资者申购时收取申购费用而不计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资者申购时不收取申购费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码，分别计算基金份额净值并分别公告。投资者可自行选择申购的基金份额类别，但不同基金份额类别之间不得互相转换。

本基金为华泰柏瑞中证 500 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中证 500 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《华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》的有关规定，本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具，包括目标 ETF、标的指数成份股及备选成份股、非成份股、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。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%；扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，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：中证 500 指数收益率  $\times$  95% + 银行活期存款利率(税后)  $\times$  5%。

本财务报表由本基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于 2020 年 8 月 29 日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投

资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错。

### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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:

(a) 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的转让收入免征增值税,对金融同业往来利息收入



亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

(c)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。

(d)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。

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

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
活期存款	17,975,556.94
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	17,975,556.94

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	10,602,778.59	11,531,715.65	928,937.06

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	271,757,463.32	299,311,916.72	27,554,453.40
其他	-	-	-
合计	282,360,241.91	310,843,632.37	28,483,390.46

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应收活期存款利息	2,701.93
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	8.50
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	-
其他	4.90
合计	2,715.33

### 6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
其他应收款	-
待摊费用	-
可收替代款	1,296.00
应收替代款	577,105.20
合计	578,401.20

### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	16,956.75
银行间市场应付交易费用	-
合计	16,956.75

### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,618.74
应付证券出借违约金	-
预提费用	89,507.60
合计	91,126.34

### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

华泰柏瑞中证 500ETF 联接 A		
项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	308,996,748.25	308,996,748.25
本期申购	106,287,921.76	106,287,921.76

本期赎回(以“-”号填列)	-186,991,229.34	-186,991,229.34
- 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	228,293,440.67	228,293,440.67

金额单位：人民币元

华泰柏瑞中证 500ETF 联接 C		
项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	486,303,888.26	486,303,888.26
本期申购	228,529,602.55	228,529,602.55
本期赎回(以“-”号填列)	-445,073,658.98	-445,073,658.98
- 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	269,759,831.83	269,759,831.83

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

华泰柏瑞中证 500ETF 联接 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-115,503,326.87	-14,664,602.35	-130,167,929.22
本期利润	5,307,844.94	15,903,232.08	21,211,077.02
本期基金份额交易产生的变动数	29,475,759.51	1,058,612.59	30,534,372.10
其中：基金申购款	-39,436,856.72	-3,152,396.29	-42,589,253.01
基金赎回款	68,912,616.23	4,211,008.88	73,123,625.11
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-80,719,722.42	2,297,242.32	-78,422,480.10

单位：人民币元

华泰柏瑞中证 500ETF 联接 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-216,861,458.27	14,148,590.88	-202,712,867.39
本期利润	7,089,328.37	23,324,653.72	30,413,982.09

本期基金份额交易产生的变动数	94,767,553.63	-14,001,551.32	80,766,002.31
其中：基金申购款	-100,932,895.89	11,799,876.13	-89,133,019.76
基金赎回款	195,700,449.52	-25,801,427.45	169,899,022.07
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-115,004,576.27	23,471,693.28	-91,532,882.99

### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
活期存款利息收入	75,675.85
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	931.20
其他	140.11
合计	76,747.16

### 6.4.7.12 股票投资收益

#### 6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	3,043,973.27
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	355,774.86
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	3,399,748.13

#### 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出股票成交总额	16,547,928.95
减：卖出股票成本总额	13,503,955.68
买卖股票差价收入	3,043,973.27

### 6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期无股票赎回差价收入。

### 6.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
申购基金份额总额	17,816,000.00
减：现金支付申购款总额	10,007,108.00
减：申购股票成本总额	7,453,117.14
申购差价收入	355,774.86

### 6.4.7.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期无证券出借差价收入。

### 6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出/赎回基金成交总额	233,441,903.08
减：卖出/赎回基金成本总额	224,230,599.30
基金投资收益	9,211,303.78

### 6.4.7.14 债券投资收益

#### 6.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	7,581.57
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	7,581.57

#### 6.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	50,889.43
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	43,300.00
减：应收利息总额	7.86
买卖债券差价收入	7,581.57

#### 6.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

#### 6.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券申购差价收入。

#### 6.4.7.14.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.15 贵金属投资收益

##### 6.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

##### 6.4.7.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

##### 6.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属赎回差价收入。

##### 6.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属申购差价收入。

#### 6.4.7.16 衍生工具收益

##### 6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内无买卖权证差价收入。

##### 6.4.7.16.2 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。

### 6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	130,617.19
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	130,617.19

### 6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	39,227,885.80
——股票投资	-87,925.25
——债券投资	-
——基金投资	39,315,811.05
——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	39,227,885.80

### 6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	91,173.03
转换费收入 001214	10,345.30
合计	101,518.33

### 6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元



项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	43,505.78
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	12,936.47
其中：申购费	256.05
赎回费	-
合计	56,442.25

#### 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
审计费用	29,835.26
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行划款手续费	4,937.20
合计	94,444.80

#### 6.4.7.22 分部报告

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

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至报告日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华泰柏瑞基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记人、基金直销机构
中国银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
华泰证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：关联方与基金进行的关联交易均在正常业务范围内按照一般商业条款而订立的。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本报告期与上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

#### 6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期与上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期与上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

#### 6.4.10.1.4 基金交易

注：本基金本报告期与上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的基金交易。

#### 6.4.10.1.5 权证交易

注：本基金本报告期与上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	33,176.82	43,302.53
其中：支付销售机构的客户维护费	133,764.16	160,191.44

注：本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费，于 2019 年 6 月 10 日前，支付基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分（若为负数，则取 0）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：

$$\text{日管理人报酬} = (\text{前一日基金资产净值} - \text{基金财产中目标 ETF 份额所对应的资产净值}) \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

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管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分（若为负数，则取 0）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：

$$\text{日管理人报酬} = (\text{前一日基金资产净值} - \text{基金财产中目标 ETF 份额所对应的资产净值}) \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	11,058.98	8,984.55

注：本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费，于 2019 年 6 月 10 日前，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）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：

$$\text{日托管费} = (\text{前一日基金资产净值} - \text{基金财产中目标 ETF 份额所对应的资产净值}) \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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)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 - 基金财产中目标 ETF 份额所对应的资产净值) × 0.05% ÷ 当年天数。

### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰柏瑞中证 500ETF 联接 A	华泰柏瑞中证 500ETF 联接 C	合计
华泰柏瑞基金管理有限 公司	0.00	259,692.90	259,692.90
合计	0.00	259,692.90	259,692.90
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰柏瑞中证 500ETF 联接 A	华泰柏瑞中证 500ETF 联接 C	合计
华泰柏瑞基金管理有限 公司	0.00	10,862.66	10,862.66
合计	0.00	10,862.66	10,862.66

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

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

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

本基金本期与上年度可比期间无发生关联方销售服务费。

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本期与上年度可比期间未发生与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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

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

注：本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行证券出借业务。

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

注：本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行证券出借业务。

### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

注：本报告期内与上年度可比期间，基金管理人未投资本基金。

#### 6.4.10.5.2 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：本报告期及上年度可比期间内，除基金管理人之外的其它关联方未投资本基金。

### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2020年1月1日至2020年6月30日		2019年1月1日至2019年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	17,975,556.94	75,675.85	21,924,600.95	59,977.18

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。

### 6.4.10.7 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无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

注：于本报告期末，本基金持有 166,892,670 份目标 ETF 基金份额，占其份额的比例为 55.18%。

### 6.4.11 利润分配情况

注：本报告期内本基金未实行利润分配。

### 6.4.12 期末（2020 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

#### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	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
300845	捷安高科	2020 年 6 月 24 日	2020 年 7 月 3 日	新股未上市	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-
300843	胜蓝股份	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 2 日	新股未上市	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-
300840	酷特智能	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 8 日	新股未上市	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-
300846	首都在线	2020 年 6 月 22 日	2020 年 7 月 1 日	新股未上市	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-

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。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601880	大连港	2020 年 6 月	拟筹划重	1.72	2020 年 7 月	1.87	10,200	20,324.09	17,544.00	-

		月 22 日	大资产重组		月 8 日					
002470	*ST 金正	2020 年 6 月 30 日	实行退市风险警示公告	2.27	2020 年 7 月 1 日	2.16	100	356.38	227.00	-

注：本基金截至 2020 年 6 月 30 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。

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：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。

#### 6.4.12.3.2 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。

### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为目标 ETF 的联接基金，采用主要投资于目标 ETF 基金实现对业绩比较基准的紧密跟踪。因此，本基金的业绩表现与中证 500 指数的表现密切相关。本基金的风险与收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金投资的金融工具主要包括基金投资、股票投资及债券投资。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人建立的风险管理体系由“组织、制度、流程和报告”等四个方面构成。

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

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

#### **6.4.13.2 信用风险**

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

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

于 2020 年 6 月 30 日，本基金无债券投资 (2019 年 12 月 31 日：同)。

##### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

注：无。



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

注：无。

#### **6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

注：无。

#### **6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

注：无。

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

注：无。

#### **6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

注：无。

### **6.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。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 2020 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### **6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析**

注：无。

#### **6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析**

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家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 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 0.01%。

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

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

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020年6月30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	17,975,556.94	-	-	-	-	-	17,975,556.94
结算备付金	16,989.38	-	-	-	-	-	16,989.38
存出保证金	10,808.93	-	-	-	-	-	10,808.93
交易性金融资产	-	-	-	-	-	310,843,632.37	310,843,632.37
应收证券清算款	-	-	-	-	-	25,981.53	25,981.53
应收利息	-	-	-	-	-	2,715.33	2,715.33
应收申购款	-	-	-	-	-	2,107,684.35	2,107,684.35
其他资产	-	-	-	-	-	578,401.20	578,401.20
资产总计	18,003,355.25	-	-	-	-	313,558,414.78	331,561,770.03
负债							

应付赎回款	-	-	-	-	-	3,304,125.54	3,304,125.54
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	5,203.76	5,203.76
应付托管费	-	-	-	-	-	1,734.60	1,734.60
应付销售服务费	-	-	-	-	-	44,713.63	44,713.63
应付交易费用	-	-	-	-	-	16,956.75	16,956.75
其他负债	-	-	-	-	-	91,126.34	91,126.34
负债总计	-	-	-	-	-	3,463,860.62	3,463,860.62
利率敏感度缺口	18,003,355.25	-	-	-	-	-310,094,554.16	328,097,909.41
上年度末 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	24,733,878.55	-	-	-	-	-	24,733,878.55
结算备付金	85,032.92	-	-	-	-	-	85,032.92
存出保证金	58,644.11	-	-	-	-	-	58,644.11
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-439,458,224.06	439,458,224.06
应收证券清算款	-	-	-	-	-	232,189.55	232,189.55
应收利息	-	-	-	-	-	5,872.19	5,872.19
应收申购款	-	-	-	-	-	741,788.35	741,788.35
其他资产	-	-	-	-	-	288.00	288.00
资产总计	24,877,555.58	-	-	-	-	-440,438,362.15	465,315,917.73
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,631,422.37	2,631,422.37
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	5,473.34	5,473.34
应付托管费	-	-	-	-	-	1,824.46	1,824.46
应付销售服务费	-	-	-	-	-	55,217.19	55,217.19
应付交易费用	-	-	-	-	-	20,516.24	20,516.24
其他负债	-	-	-	-	-	181,624.23	181,624.23
负债总计	-	-	-	-	-	2,896,077.83	2,896,077.83
利率敏感度缺口	24,877,555.58	-	-	-	-	-437,542,284.32	462,419,839.90

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2020 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2019 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(2019 年 12 月 31 日: 同)。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于目标 ETF, 所面临的其他价格风险主要来源于中证 500 指数波动的影响。

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金资产中投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%; 扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后, 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%。此外, 本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控, 定期运用多种定量方法对基金进行风险度量, 及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位: 人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 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	11,531,715.65	3.51	21,394,791.39	4.63
交易性金融资产-基金投资	299,311,916.72	91.23	418,063,432.67	90.41
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	310,843,632.37	94.74	439,458,224.06	95.03

#### 6.4.13.4.3.2 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（2020年6月30日）	上年度末（2019年12月31日）
	中证 500 指数上升 5%	14,887,965.10	22,071,113.59
	中证 500 指数下降 5%	-14,887,965.10	-22,071,113.59

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

注：无。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	11,531,715.65	3.48
	其中：股票	11,531,715.65	3.48
2	基金投资	299,311,916.72	90.27
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	17,992,546.32	5.43
8	其他各项资产	2,725,591.34	0.82
9	合计	331,561,770.03	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	108,140.00	0.03
B	采矿业	382,676.00	0.12
C	制造业	6,280,164.35	1.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	356,732.12	0.11
E	建筑业	185,580.00	0.06
F	批发和零售业	1,001,141.56	0.31
G	交通运输、仓储和邮政业	426,435.00	0.13
H	住宿和餐饮业	96,999.00	0.03
I	信息传输、软件和信息技术服务业	902,738.65	0.28
J	金融业	557,664.93	0.17
K	房地产业	598,540.96	0.18
L	租赁和商务服务业	106,787.00	0.03
M	科学研究和技术服务业	58,476.00	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	78,058.80	0.02

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	16,560.00	0.01
Q	卫生和社会工作	89,500.00	0.03
R	文化、体育和娱乐业	184,897.28	0.06
S	综合	100,624.00	0.03
	合计	11,531,715.65	3.51

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末持有通过港股通投资的股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600201	生物股份	5,910	164,534.40	0.05
2	600739	辽宁成大	8,000	151,440.00	0.05
3	603517	绝味食品	2,000	141,480.00	0.04
4	600521	华海药业	3,960	134,362.80	0.04
5	600298	安琪酵母	2,700	133,596.00	0.04
6	603939	益丰药房	1,400	127,400.00	0.04
7	601799	星宇股份	1,000	127,000.00	0.04
8	600161	天坛生物	2,780	126,017.40	0.04
9	600079	人福医药	4,500	122,490.00	0.04
10	600143	金发科技	9,000	118,530.00	0.04
11	600845	宝信软件	1,930	114,024.40	0.03
12	601128	常熟银行	15,000	112,650.00	0.03
13	603659	璞泰来	1,000	103,020.00	0.03
14	603233	大参林	1,248	101,362.56	0.03
15	603883	老百姓	1,000	100,040.00	0.03
16	600801	华新水泥	4,060	96,262.60	0.03
17	600426	华鲁恒升	5,400	95,472.00	0.03
18	600699	均胜电子	4,000	95,240.00	0.03
19	600859	王府井	2,000	91,100.00	0.03
20	603882	金域医学	1,000	89,500.00	0.03
21	603858	步长制药	3,000	86,550.00	0.03
22	600315	上海家化	1,800	86,220.00	0.03
23	603087	甘李药业	839	84,151.70	0.03
24	600155	华创阳安	7,000	83,930.00	0.03



25	600885	宏发股份	2,080	83,449.60	0.03
26	600486	扬农化工	1,000	82,500.00	0.03
27	600895	张江高科	4,000	81,480.00	0.02
28	600380	健康元	5,000	81,200.00	0.02
29	600879	航天电子	12,000	77,280.00	0.02
30	600216	浙江医药	4,000	77,040.00	0.02
31	601233	桐昆股份	6,000	76,560.00	0.02
32	600410	华胜天成	5,400	73,440.00	0.02
33	600415	小商品城	15,000	73,050.00	0.02
34	600132	重庆啤酒	1,000	73,000.00	0.02
35	002821	凯莱英	300	72,900.00	0.02
36	600804	鹏博士	8,000	71,840.00	0.02
37	603338	浙江鼎力	940	71,223.80	0.02
38	600167	联美控股	4,940	70,839.60	0.02
39	600811	东方集团	16,000	70,720.00	0.02
40	600642	申能股份	11,700	69,147.00	0.02
41	600037	歌华有线	4,500	68,400.00	0.02
42	600884	杉杉股份	5,800	68,382.00	0.02
43	600909	华安证券	10,000	68,300.00	0.02
44	600820	隧道股份	11,600	65,540.00	0.02
45	603707	健友股份	1,000	64,570.00	0.02
46	600598	北大荒	4,000	64,400.00	0.02
47	600728	佳都科技	7,000	63,770.00	0.02
48	603806	福斯特	1,260	62,886.60	0.02
49	600779	水井坊	1,000	62,420.00	0.02
50	600839	四川长虹	21,600	61,992.00	0.02
51	600418	江淮汽车	7,000	61,810.00	0.02
52	600563	法拉电子	1,000	61,800.00	0.02
53	601966	玲珑轮胎	3,000	60,600.00	0.02
54	600704	物产中大	14,000	58,940.00	0.02
55	601689	拓普集团	2,080	58,032.00	0.02
56	601168	西部矿业	10,000	58,000.00	0.02
57	600827	百联股份	4,000	57,800.00	0.02
58	600718	东软集团	5,000	57,500.00	0.02
59	600325	华发股份	8,100	57,186.00	0.02
60	600645	中源协和	2,000	56,500.00	0.02
61	600754	锦江酒店	2,000	55,500.00	0.02
62	600673	东阳光	8,000	55,280.00	0.02
63	600572	康恩贝	10,000	55,000.00	0.02

64	600881	亚泰集团	18,600	54,126.00	0.02
65	603000	人民网	2,700	53,541.00	0.02
66	600256	广汇能源	19,800	53,460.00	0.02
67	600549	厦门钨业	4,500	53,280.00	0.02
68	600875	东方电气	6,000	53,100.00	0.02
69	600460	士兰微	3,600	52,848.00	0.02
70	600959	江苏有线	14,000	52,640.00	0.02
71	600446	金证股份	2,700	52,380.00	0.02
72	600967	内蒙一机	5,000	51,950.00	0.02
73	600126	杭钢股份	4,900	50,960.00	0.02
74	601005	重庆钢铁	34,200	50,958.00	0.02
75	600566	济川药业	2,000	50,920.00	0.02
76	603866	桃李面包	1,000	50,890.00	0.02
77	600862	中航高科	3,000	50,760.00	0.02
78	002439	启明星辰	1,200	50,484.00	0.02
79	601179	中国西电	10,400	50,336.00	0.02
80	603228	景旺电子	1,428	50,251.32	0.02
81	600260	凯乐科技	3,620	48,942.40	0.01
82	600511	国药股份	1,200	48,804.00	0.01
83	600195	中牧股份	2,980	48,365.40	0.01
84	600094	大名城	8,100	48,195.00	0.01
85	600567	山鹰纸业	16,200	47,790.00	0.01
86	600528	中铁工业	5,400	47,628.00	0.01
87	600171	上海贝岭	2,700	46,926.00	0.01
88	600373	中文传媒	3,976	46,837.28	0.01
89	600737	中粮糖业	6,000	46,680.00	0.01
90	601106	中国一重	16,600	46,646.00	0.01
91	600021	上海电力	6,300	46,620.00	0.01
92	600026	中远海能	7,200	46,512.00	0.01
93	600466	蓝光发展	8,600	46,354.00	0.01
94	600755	厦门国贸	7,000	46,200.00	0.01
95	002500	山西证券	7,020	45,910.80	0.01
96	603816	顾家家居	1,020	45,910.20	0.01
97	600039	四川路桥	12,000	45,840.00	0.01
98	600808	马钢股份	17,600	45,408.00	0.01
99	600776	东方通信	3,000	45,270.00	0.01
100	600166	福田汽车	25,000	45,000.00	0.01
101	600060	海信视像	3,600	43,740.00	0.01
101	600064	南京高科	4,500	43,740.00	0.01

101	601118	海南橡胶	9,000	43,740.00	0.01
102	600160	巨化股份	6,310	43,475.90	0.01
103	600497	驰宏锌锗	12,600	43,344.00	0.01
104	601200	上海环境	3,600	43,200.00	0.01
105	600823	世茂股份	9,600	42,912.00	0.01
106	601699	潞安环能	7,700	42,889.00	0.01
107	601333	广深铁路	19,000	42,750.00	0.01
108	600056	中国医药	3,000	42,450.00	0.01
109	601098	中南传媒	4,000	42,320.00	0.01
110	600515	海航基础	8,100	42,120.00	0.01
111	600022	山东钢铁	32,400	41,796.00	0.01
112	600649	城投控股	7,000	41,580.00	0.01
113	600258	首旅酒店	2,700	41,499.00	0.01
114	600435	北方导航	5,400	40,824.00	0.01
115	600282	南钢股份	12,600	40,698.00	0.01
116	601866	中远海发	22,000	40,480.00	0.01
117	600580	卧龙电驱	3,600	40,464.00	0.01
118	600597	光明乳业	2,700	40,122.00	0.01
119	600640	号百控股	2,000	39,900.00	0.01
120	601718	际华集团	12,000	39,840.00	0.01
121	600643	爱建集团	5,000	39,750.00	0.01
122	600062	华润双鹤	3,000	39,660.00	0.01
123	600863	内蒙华电	16,000	39,360.00	0.01
124	600273	嘉化能源	4,500	39,330.00	0.01
125	603712	七一二	1,000	38,380.00	0.01
126	603077	和邦生物	29,000	38,280.00	0.01
127	600392	盛和资源	5,400	38,070.00	0.01
128	600073	上海梅林	4,000	37,960.00	0.01
129	600376	首开股份	6,300	36,918.00	0.01
130	600782	新钢股份	9,000	36,720.00	0.01
131	600291	西水股份	4,000	36,200.00	0.01
132	601000	唐山港	16,000	35,680.00	0.01
133	601717	郑煤机	6,000	35,340.00	0.01
134	600633	浙数文化	3,600	35,208.00	0.01
135	600120	浙江东方	5,099	35,030.13	0.01
136	601869	长飞光纤	1,100	33,891.00	0.01
137	600835	上海机电	2,000	33,860.00	0.01
138	600266	城建发展	6,528	33,096.96	0.01
139	300315	掌趣科技	4,500	32,985.00	0.01

140	603568	伟明环保	1,404	32,572.80	0.01
141	600008	首创股份	10,800	32,508.00	0.01
142	600500	中化国际	6,380	32,282.80	0.01
143	600388	龙净环保	3,600	31,680.00	0.01
143	600970	中材国际	6,000	31,680.00	0.01
144	600751	海航科技	10,000	31,300.00	0.01
145	600729	重庆百货	1,000	31,220.00	0.01
146	600329	中新药业	1,800	31,176.00	0.01
147	601958	金钼股份	5,000	30,900.00	0.01
148	601608	中信重工	9,000	30,780.00	0.01
149	600765	中航重机	3,000	30,660.00	0.01
150	603486	科沃斯	1,000	30,210.00	0.01
151	600259	广晟有色	1,000	30,000.00	0.01
152	600138	中青旅	3,000	29,610.00	0.01
153	600158	中体产业	3,600	29,448.00	0.01
154	600409	三友化工	6,300	29,358.00	0.01
155	601598	中国外运	9,000	29,070.00	0.01
156	600639	浦东金桥	1,800	28,764.00	0.01
157	000547	航天发展	2,100	28,707.00	0.01
158	600316	洪都航空	1,800	28,440.00	0.01
159	601611	中国核建	4,600	28,428.00	0.01
160	600507	方大特钢	5,460	28,337.40	0.01
161	600648	外高桥	2,000	28,280.00	0.01
162	000975	银泰黄金	1,800	28,224.00	0.01
163	002414	高德红外	960	28,108.80	0.01
164	600557	康缘药业	2,000	27,840.00	0.01
165	002019	亿帆医药	1,200	27,564.00	0.01
166	603515	欧普照明	1,000	27,370.00	0.01
167	603885	吉祥航空	3,000	27,300.00	0.01
168	601928	凤凰传媒	4,000	27,200.00	0.01
169	603056	德邦股份	2,000	27,060.00	0.01
170	600312	平高电气	3,600	26,712.00	0.01
171	600348	阳泉煤业	6,300	26,586.00	0.01
172	600717	天津港	6,000	26,520.00	0.01
173	002195	二三四五	9,328	26,211.68	0.01
174	002250	联化科技	1,200	26,160.00	0.01
175	600777	新潮能源	17,200	26,144.00	0.01
176	600901	江苏租赁	5,000	26,050.00	0.01
177	600748	上实发展	5,000	25,550.00	0.01

178	601678	滨化股份	6,000	25,440.00	0.01
179	600478	科力远	5,400	25,434.00	0.01
180	600125	铁龙物流	4,500	25,110.00	0.01
181	601615	明阳智能	2,000	24,900.00	0.01
182	600664	哈药股份	8,000	24,640.00	0.01
183	603888	新华网	1,100	24,596.00	0.01
184	600141	兴发集团	2,700	24,165.00	0.01
185	600694	大商股份	1,000	23,990.00	0.01
186	600053	九鼎投资	800	23,872.00	0.01
187	600582	天地科技	8,100	23,733.00	0.01
188	002013	中航机电	3,000	23,700.00	0.01
189	600307	酒钢宏兴	15,300	23,562.00	0.01
190	603650	彤程新材	1,000	23,270.00	0.01
191	603766	隆鑫通用	6,000	23,220.00	0.01
192	600017	日照港	9,000	22,410.00	0.01
193	600350	山东高速	3,600	22,104.00	0.01
194	600787	中储股份	5,000	21,950.00	0.01
195	603198	迎驾贡酒	1,000	21,770.00	0.01
196	002572	索菲亚	900	21,753.00	0.01
197	600869	智慧能源	5,400	21,600.00	0.01
198	600545	卓郎智能	4,500	21,285.00	0.01
199	603328	依顿电子	2,000	20,860.00	0.01
200	600657	信达地产	5,000	20,600.00	0.01
201	600733	北汽蓝谷	3,200	20,576.00	0.01
202	600277	亿利洁能	6,300	20,538.00	0.01
203	600565	迪马股份	7,200	20,088.00	0.01
204	601139	深圳燃气	3,000	19,500.00	0.01
205	002268	卫士通	900	19,206.00	0.01
206	600770	综艺股份	4,000	19,200.00	0.01
207	601016	节能风电	9,000	19,080.00	0.01
208	601865	福莱特	1,000	18,800.00	0.01
209	601019	山东出版	3,000	18,750.00	0.01
210	600908	无锡银行	3,800	18,658.00	0.01
211	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.01
212	600339	中油工程	8,100	18,387.00	0.01
213	600707	彩虹股份	4,000	18,240.00	0.01
214	601880	大连港	10,200	17,544.00	0.01
215	601860	紫金银行	4,000	16,920.00	0.01
216	601801	皖新传媒	3,000	16,680.00	0.01

217	600428	中远海特	5,400	16,632.00	0.01
218	601127	小康股份	2,000	16,620.00	0.01
219	603377	东方时尚	1,000	16,560.00	0.01
220	600985	淮北矿业	2,000	15,580.00	0.00
221	600757	长江传媒	3,000	15,270.00	0.00
222	600575	淮河能源	7,200	15,048.00	0.00
223	300088	长信科技	1,300	14,560.00	0.00
224	600006	东风汽车	3,600	14,508.00	0.00
225	603556	海兴电力	1,000	14,440.00	0.00
226	600996	贵广网络	2,000	14,260.00	0.00
227	600623	华谊集团	2,700	13,932.00	0.00
228	002056	横店东磁	1,200	13,500.00	0.00
229	601003	柳钢股份	3,000	13,290.00	0.00
230	600874	创业环保	2,000	13,280.00	0.00
231	002273	水晶光电	750	12,855.00	0.00
232	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.00
233	002075	沙钢股份	1,000	12,500.00	0.00
234	000738	航发控制	900	12,285.00	0.00
235	002155	湖南黄金	1,500	11,820.00	0.00
236	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.00
237	601099	太平洋	3,700	11,729.00	0.00
238	000519	中兵红箭	1,200	11,304.00	0.00
239	600058	五矿发展	1,800	10,872.00	0.00
240	600338	西藏珠峰	1,080	10,800.00	0.00
241	002074	国轩高科	400	10,736.00	0.00
242	002212	南洋股份	400	10,632.00	0.00
243	000987	越秀金控	900	10,494.00	0.00
244	601811	新华文轩	1,000	10,170.00	0.00
245	603225	新凤鸣	1,000	9,980.00	0.00
246	600903	贵州燃气	1,000	9,840.00	0.00
247	000988	华工科技	400	9,772.00	0.00
248	601969	海南矿业	2,000	9,760.00	0.00
249	002373	千方科技	400	9,596.00	0.00
250	002353	杰瑞股份	300	9,300.00	0.00
251	300168	万达信息	400	8,828.00	0.00
252	002302	西部建设	900	8,640.00	0.00
253	600335	国机汽车	1,800	8,316.00	0.00
254	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
255	000401	冀东水泥	500	8,020.00	0.00

256	601068	中铝国际	2,000	7,820.00	0.00
257	300376	易事特	1,500	7,800.00	0.00
258	002078	太阳纸业	800	7,616.00	0.00
259	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
260	002242	九阳股份	200	7,454.00	0.00
261	300316	晶盛机电	300	7,422.00	0.00
262	603025	大豪科技	1,000	7,270.00	0.00
263	600917	重庆燃气	1,000	7,140.00	0.00
264	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
265	300115	长盈精密	300	6,855.00	0.00
266	300251	光线传媒	600	6,546.00	0.00
267	000878	云南铜业	600	6,366.00	0.00
268	000581	威孚高科	300	6,204.00	0.00
269	002028	思源电气	300	6,138.00	0.00
270	002920	德赛西威	100	6,133.00	0.00
271	002925	盈趣科技	100	5,794.00	0.00
272	002670	国盛金控	600	5,490.00	0.00
273	000729	燕京啤酒	800	5,480.00	0.00
274	000553	安道麦 A	600	5,412.00	0.00
275	002690	美亚光电	100	5,260.00	0.00
276	002217	合力泰	1,000	5,250.00	0.00
277	000158	常山北明	500	5,220.00	0.00
278	000970	中科三环	500	4,890.00	0.00
279	002807	江阴银行	1,200	4,716.00	0.00
280	002110	三钢闽光	700	4,662.00	0.00
280	300324	旋极信息	700	4,662.00	0.00
281	002048	宁波华翔	300	4,632.00	0.00
282	000089	深圳机场	600	4,596.00	0.00
283	002085	万丰奥威	700	4,536.00	0.00
284	000028	国药一致	100	4,501.00	0.00
285	000830	鲁西化工	600	4,476.00	0.00
286	002368	太极股份	100	4,369.00	0.00
287	000960	锡业股份	500	4,280.00	0.00
288	000690	宝新能源	900	4,248.00	0.00
289	000012	南玻 A	820	4,116.40	0.00
290	002375	亚厦股份	400	4,088.00	0.00
291	000027	深圳能源	880	4,083.20	0.00
292	000563	陕国投 A	1,100	4,081.00	0.00
293	002092	中泰化学	900	4,077.00	0.00

294	002815	崇达技术	200	4,046.00	0.00
295	002839	张家港行	700	4,032.00	0.00
296	000400	许继电气	300	3,960.00	0.00
297	000301	东方盛虹	700	3,892.00	0.00
298	000883	湖北能源	1,100	3,872.00	0.00
299	300846	首都在线	1,131	3,811.47	0.00
300	000528	柳工	600	3,786.00	0.00
301	002936	郑州银行	1,100	3,784.00	0.00
302	000932	华菱钢铁	1,000	3,770.00	0.00
303	002440	闰土股份	400	3,656.00	0.00
304	002507	涪陵榨菜	100	3,601.00	0.00
305	002444	巨星科技	300	3,564.00	0.00
306	002064	华峰氨纶	700	3,549.00	0.00
307	002372	伟星新材	300	3,489.00	0.00
308	000807	云铝股份	800	3,488.00	0.00
309	002266	浙富控股	900	3,483.00	0.00
310	002434	万里扬	400	3,472.00	0.00
311	000488	晨鸣纸业	700	3,458.00	0.00
312	000559	万向钱潮	700	3,388.00	0.00
313	002709	天赐材料	100	3,379.00	0.00
314	000008	神州高铁	1,100	3,234.00	0.00
315	601228	广州港	1,000	3,040.00	0.00
316	300253	卫宁健康	130	2,982.20	0.00
317	000758	中色股份	700	2,926.00	0.00
318	000062	深圳华强	200	2,908.00	0.00
319	002249	大洋电机	800	2,888.00	0.00
320	002831	裕同科技	100	2,751.00	0.00
321	002653	海思科	100	2,661.00	0.00
322	000717	韶钢松山	700	2,660.00	0.00
323	002093	国脉科技	300	2,655.00	0.00
324	601975	招商南油	1,100	2,629.00	0.00
325	000990	诚志股份	200	2,538.00	0.00
326	000712	锦龙股份	200	2,500.00	0.00
327	000543	皖能电力	600	2,412.00	0.00
328	300197	铁汉生态	900	2,286.00	0.00
329	002867	周大生	100	2,217.00	0.00
330	002051	中工国际	300	2,184.00	0.00
331	002127	南极电商	100	2,117.00	0.00
332	300001	特锐德	100	2,094.00	0.00



333	000600	建投能源	400	2,036.00	0.00
334	300012	华测检测	100	1,976.00	0.00
335	300009	安科生物	110	1,969.00	0.00
336	000025	特力 A	100	1,833.00	0.00
337	002946	新乳业	100	1,735.00	0.00
338	300166	东方国信	100	1,241.00	0.00
339	002818	富森美	100	1,230.00	0.00
340	603256	宏和科技	100	1,144.00	0.00
341	002926	华西证券	100	1,063.00	0.00
342	002419	天虹股份	100	955.00	0.00
343	002191	劲嘉股份	100	891.00	0.00
344	002203	海亮股份	100	875.00	0.00
345	002423	中粮资本	100	870.00	0.00
346	300180	华峰超纤	100	856.00	0.00
347	300058	蓝色光标	100	780.00	0.00
348	002583	海能达	100	759.00	0.00
349	300133	华策影视	100	725.00	0.00
350	002416	爱施德	100	718.00	0.00
351	002797	第一创业	100	692.00	0.00
352	300002	神州泰岳	100	619.00	0.00
353	000732	泰禾集团	100	509.00	0.00
353	002948	青岛银行	100	509.00	0.00
354	002340	格林美	100	497.00	0.00
355	000750	国海证券	100	434.00	0.00
356	300182	捷成股份	100	399.00	0.00
357	000848	承德露露	40	280.00	0.00
358	002470	*ST 金正	100	227.00	0.00
359	002505	大康农业	100	225.00	0.00
360	300459	金科文化	24	82.80	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601799	星宇股份	172,561.00	0.04
2	601128	常熟银行	145,800.00	0.03

3	601233	桐昆股份	137,544.00	0.03
4	603517	绝味食品	120,700.00	0.03
5	600739	辽宁成大	117,910.00	0.03
6	600704	物产中大	116,214.00	0.03
7	600201	生物股份	114,909.00	0.02
8	600728	佳都科技	114,268.00	0.02
9	603858	步长制药	113,304.00	0.02
10	603338	浙江鼎力	108,323.00	0.02
11	603882	金域医学	106,461.00	0.02
12	600155	华创阳安	90,662.00	0.02
13	600776	东方通信	89,165.00	0.02
14	601099	太平洋	88,615.00	0.02
15	603707	健友股份	87,799.00	0.02
16	600161	天坛生物	84,786.00	0.02
17	600298	安琪酵母	83,439.00	0.02
18	603195	公牛集团	80,792.55	0.02
19	600143	金发科技	78,840.00	0.02
20	600521	华海药业	77,597.00	0.02

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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	603195	公牛集团	254,119.41	0.05
2	600918	中泰证券	203,687.22	0.04
3	002129	中环股份	179,283.00	0.04
4	600745	闻泰科技	176,450.00	0.04
5	002127	南极电商	174,783.00	0.04
6	601100	恒立液压	173,401.00	0.04
7	002371	北方华创	162,380.00	0.04
8	600584	长电科技	162,213.00	0.04
9	600536	中国软件	154,309.00	0.03
10	002463	沪电股份	149,066.00	0.03
11	002384	东山精密	148,557.00	0.03
12	300253	卫宁健康	148,427.00	0.03
13	000066	中国长城	146,380.00	0.03

14	600763	通策医疗	145,801.00	0.03
15	002049	紫光国微	139,730.00	0.03
16	002065	东华软件	136,050.00	0.03
17	002821	凯莱英	132,210.00	0.03
18	002465	海格通信	124,637.00	0.03
19	002075	沙钢股份	121,670.00	0.03
20	000009	中国宝安	119,256.00	0.03

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

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	11,181,922.33
卖出股票收入（成交）总额	16,547,928.95

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

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

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

注：本基金本报告期末未持有权证。

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

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	ETF500	指数型	交易型开放式	华泰柏瑞基金管理有限公司	299,311,916.72	91.23

## 7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.11.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

### 7.11.2 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。

## 7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.12.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.12.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.12.3 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。

## 7.13 投资组合报告附注

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

报告期内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、处罚的情形。

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

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的。

### 7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	10,808.93
2	应收证券清算款	25,981.53
3	应收股利	-
4	应收利息	2,715.33
5	应收申购款	2,107,684.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	578,401.20

9	合计	2,725,591.34
---	----	--------------

**7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

**7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

注：截至本报告期末，本基金前十名股票中不存在流通受限的情况。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
华泰柏瑞中证 500ETF 联接 A	15,781	14,466.35	1,514,566.28	0.66%	226,778,874.39	99.34%
华泰柏瑞中证 500ETF 联接 C	16,292	16,557.81	184,477,817.19	68.39%	85,282,014.64	31.61%
合计	31,292	15,916.31	185,992,383.47	37.34%	312,060,889.03	62.66%

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

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	华泰柏瑞中证 500ETF 联接 A	36,990.87	0.0162%
	华泰柏瑞中证 500ETF 联接 C	57.57	0.0000%
	合计	37,048.44	0.0074%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持	华泰柏瑞中证 500ETF 联接 A	0

有本开放式基金	华泰柏瑞中证 500ETF 联接 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开 放式基金	华泰柏瑞中证 500ETF 联接 A	0
	华泰柏瑞中证 500ETF 联接 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华泰柏瑞中证 500ETF 联接 A	华泰柏瑞中证 500ETF 联接 C
基金合同生效日（2015 年 5 月 13 日）基金份额总额	661,930,408.74	-
本报告期期初基金份额总额	308,996,748.25	486,303,888.26
本报告期基金总申购份额	106,287,921.76	228,529,602.55
减：本报告期基金总赎回份额	186,991,229.34	445,073,658.98
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	228,293,440.67	269,759,831.83



## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2020 年 2 月 10 日，经公司董事会批准程安至先生不再担任公司副总经理。  
上述人事变动已按相关规定备案、公告。

基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未改聘为其审计的会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

2020 年 3 月，公司收到上海证监局对公司采取责令改正措施的决定。公司高度重视，立即制定并实施相关整改措施，落实整改要求。2020 年 4 月公司完成整改事项并及时向监管机构提交整改报告。。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中金财富证券	1	14,366,469.29	53.79%	13,092.38	53.25%	-
东北证券	1	8,838,033.13	33.09%	8,231.11	33.48%	-
光大证券	2	3,504,297.55	13.12%	3,263.73	13.27%	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	3	-	-	-	-	-

方正证券	3	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
申港证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	3	-	-	-	-	-
西藏同信	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
长江证券	4	-	-	-	-	-
西藏东方财富	2	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
北京高华	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-

招商证券	1	-	-	-	-	-
华龙证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
中金财富证券	16,577.03	32.57%	-	-	-	-	-	-
东北证券	34,312.40	67.43%	-	-	-	-	211,444,220.99	75.04%
光大证券	-	-	-	-	-	-	70,333,626.39	24.96%
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
万联证	-	-	-	-	-	-	-	-

券								
海通证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君 安	-	-	-	-	-	-	-	-
恒泰证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
新时代 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国联证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
财通证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
国元证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
湘财证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
渤海证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
西藏同 信	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建 投	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
国海证 券	-	-	-	-	-	-	-	-

中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
北京高华	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华龙证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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。

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金参加鼎信汇金（北京）投资管理有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2020 年 4 月 21 日
2	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参加上海基煜基金销售有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2020 年 4 月 7 日
3	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国人寿保险股份有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2020 年 4 月 1 日
4	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金参加和合期货有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2020 年 4 月 1 日
5	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金参加中国国际期货有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2020 年 3 月 18 日
6	华泰柏瑞基金管理有限公司关于调整旗下基金最低申购金额、最低赎回份额和最低持有份额的公告	证监会规定报刊和网站	2020 年 3 月 9 日
7	华泰柏瑞基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证监会规定报刊和网站	2020 年 2 月 14 日
8	华泰柏瑞基金管理有限公司关于调整旗下基金 2020 年春节假期申购赎回等交易业务及清算交收安排的提示性公告	证监会规定报刊和网站	2020 年 1 月 30 日
9	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参加民生证券股份有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2020 年 1 月 23 日
10	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参加嘉实财富管理有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2020 年 1 月 9 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

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	20200101-20200630	184,569,952.01	0.00	63,724,709.00	120,845,243.01	24.26%
	2	20200114-20200228;20200306-20200306;20200609-20200610	147,655,961.61	0.00	147,655,961.61	0.00	0.00%
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。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 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联接基金募集的文件
- 2、《华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》
- 3、《华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》
- 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、华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的公告

### 12.2 存放地点

上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

托管人住所

### 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司。

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

公司网址：[www.huatai-pb.com](http://www.huatai-pb.com)

华泰柏瑞基金管理有限公司

2020 年 8 月 29 日