

华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券 投资基金 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。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
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
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
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.....	16
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.....	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
6.4 报表附注.....	20
§7 投资组合报告.....	45
7.1 期末基金资产组合情况.....	45
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	45
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.....	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	59
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	61
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.....	61
7.7 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.....	61
7.8 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.....	61
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.....	61
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	61
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	62
7.12 投资组合报告附注.....	62
§8 基金份额持有人信息.....	64
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	64
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	64
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	64
8.4 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.....	64
§9 开放式基金份额变动.....	66
§10 重大事件揭示.....	67
10.1 基金份额持有人大会决议.....	67
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.....	67
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	67
10.4 基金投资策略的改变.....	67
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	67
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.....	67
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	67
10.8 其他重大事件.....	70

§11 影响投资者决策的其他重要信息	71
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	72
§12 备查文件目录	73
12.1 备查文件目录.....	73
12.2 存放地点.....	73
12.3 查阅方式.....	73

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞中证 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
扩位证券简称	华泰中证 500ETF
基金主代码	512510
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2015 年 5 月 13 日
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	426,429,801.00 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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.huatai-pb.com
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	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

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)
本期已实现收益	64,081,965.98
本期利润	90,587,628.28
加权平均基金份额本期利润	0.1636
本期加权平均净值利润率	13.52%
本期基金份额净值增长率	13.96%
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	-291,908,445.88
期末可供分配基金份额利润	-0.6845
期末基金资产净值	565,820,268.75
期末基金份额净值	1.3269
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	-32.74%

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。

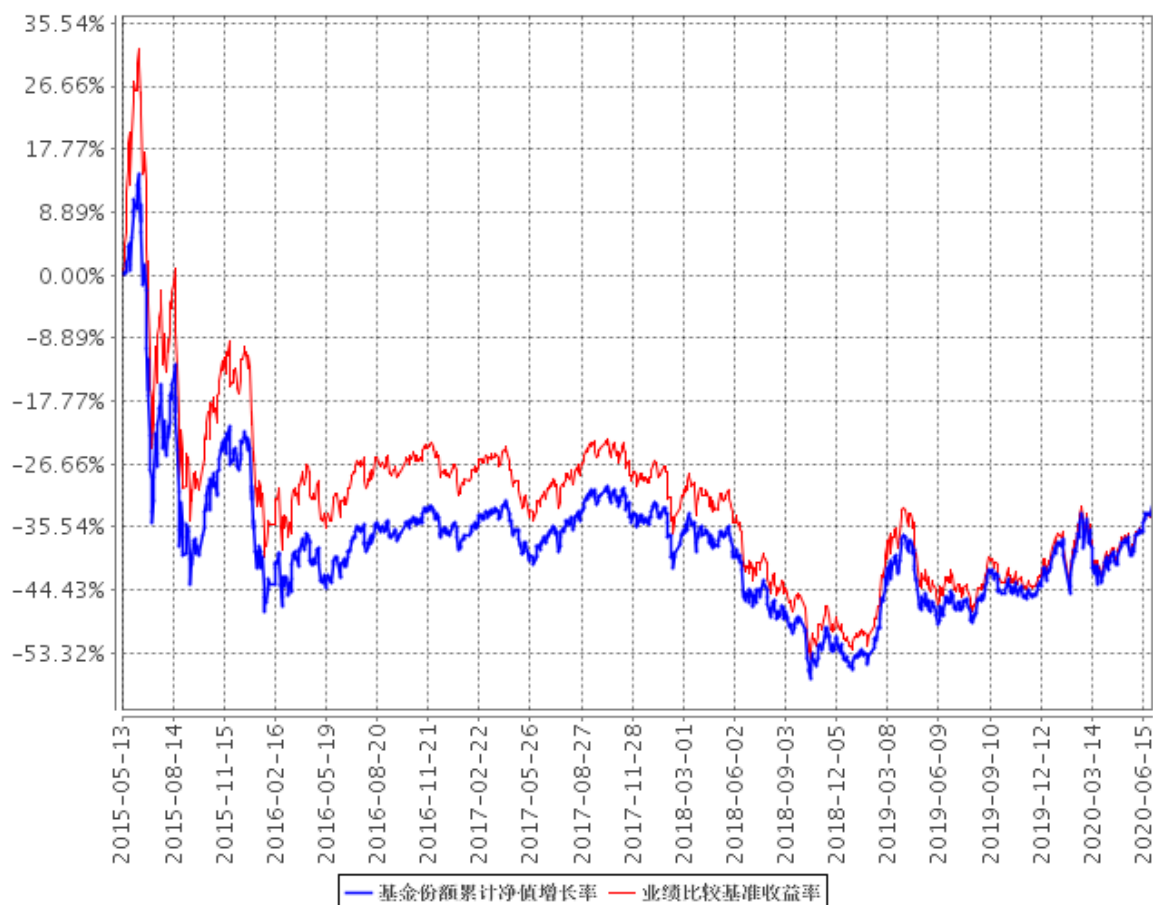
3.2 基金净值表现

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
过去一个月	9.41%	0.90%	8.47%	0.88%	0.94%	0.02%
过去三个月	18.16%	1.45%	16.70%	1.13%	1.46%	0.32%
过去六个月	13.96%	1.79%	11.33%	1.79%	2.63%	0.00%
过去一年	25.01%	1.45%	18.46%	1.46%	6.55%	-0.01%
过去三年	5.63%	1.46%	-4.46%	1.47%	10.09%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-32.74%	1.81%	-32.94%	1.83%	0.20%	-0.02%

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：图示日期为 2015 年 5 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 300ETF 联接基金基金经理。2015 年 2 月起

				<p>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。

本报告期内，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 1 次，系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

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 2.627%，日均绝对跟踪偏离度为 0.03%，期间日跟踪误差为 0.041%，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 1.3269 元；本报告期基金份额净值增长率为 13.96%，业绩比较基准收益率为 11.33%。

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标的指数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，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，方可进行收益分配；基金收益分配比例为收益评价日符合上述基金分红条件的基金超额收益的 100%。本报告期内，本基金未进行利润分配。

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（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

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
资产：			
银行存款	6.4.7.1	5,676,278.50	4,351,633.92
结算备付金		17,696,999.90	25,678,431.10
存出保证金		3,050,015.71	3,858,720.95
交易性金融资产	6.4.7.2	540,481,594.16	679,951,478.60
其中：股票投资		540,481,594.16	679,951,478.60
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		123,476.25	189,387.56
应收利息	6.4.7.5	8,131.08	15,508.24
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		567,036,495.60	714,045,160.37
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		4,189.60	382.00
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		-	193,736.09
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		71,469.23	87,461.15
应付托管费		23,823.06	29,153.73
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	76,838.91	31,933.39
应交税费		33,055.25	38,340.53

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	1,006,850.80	570,555.06
负债合计		1,216,226.85	951,561.95
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	857,728,714.63	1,231,852,522.38
未分配利润	6.4.7.10	-291,908,445.88	-518,758,923.96
所有者权益合计		565,820,268.75	713,093,598.42
负债和所有者权益总计		567,036,495.60	714,045,160.37

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.3269 元，基金份额总额 426,429,801.00 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

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
一、收入		92,299,119.08	67,845,955.43
1.利息收入		252,649.63	36,750.28
其中：存款利息收入	6.4.7.11	230,494.20	36,750.28
债券利息收入		234.22	-
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		21,921.21	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		66,329,308.73	-25,036,304.91
其中：股票投资收益	6.4.7.12	58,029,812.33	-30,186,631.17
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	239,861.31	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	4,125,941.75	818,097.09
股利收益	6.4.7.16	3,933,693.34	4,332,229.17
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	26,505,662.30	92,137,311.35
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-788,501.58	708,198.71

减：二、费用		1,711,490.80	1,893,614.38
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	498,411.23	959,651.64
2. 托管费	6.4.10.2.2	166,137.08	198,008.68
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	833,449.23	421,459.63
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		14,854.26	2,699.72
7. 其他费用	6.4.7.20	198,639.00	311,794.71
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		90,587,628.28	65,952,341.05
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		90,587,628.28	65,952,341.05

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

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）	1,231,852,522.38	-518,758,923.96	713,093,598.42
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	90,587,628.28	90,587,628.28
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）	-374,123,807.75	136,262,849.80	-237,860,957.95
其中：1. 基金申购款	1,029,846,180.44	-414,331,682.78	615,514,497.66
2. 基金赎回款	-1,403,969,988.19	550,594,532.58	-853,375,455.61
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基	857,728,714.63	-291,908,445.88	565,820,268.75

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
	金净值)		
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）	-	65,952,341.05	65,952,341.05
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）	486,763,233.91	-227,938,504.79	258,824,729.12
其中：1. 基金申购款	840,772,858.42	-388,624,403.69	452,148,454.73
2. 基金赎回款	-354,009,624.51	160,685,898.90	-193,323,725.61
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,264,035,215.58	-597,036,583.61	666,998,631.97

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 _____

基金管理人负责人

_____ 房伟力 _____

主管会计工作负责人

_____ 赵景云 _____

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(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基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式，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 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有限公司普华永道中天验字(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、债券、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%。在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度(剔除成份股分红因素)的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。本基金的业绩比较基准为中证 500 指数。

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

本财务报表由本基金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	5,676,278.50
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：	5,676,278.50

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	496,436,642.33	540,481,594.16	44,044,951.83
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	496,436,642.33	540,481,594.16	44,044,951.83

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日			备注
	合同/名义金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	24,357,480.00	-	-	
IC2007	24,357,480.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	24,357,480.00	-	-	

注：按照股指期货每日无负债结算的结算规则、《基金股指期货投资会计业务核算细则(试行)》及《企业会计准则-金融工具列报》的相关规定，“其他衍生工具-股指期货投资”与“证券清算款-股指期货每日无负债结算暂收暂付款”，符合金融资产与金融负债相抵销的条件，故将“其他衍生工具-股指期货投资”的期末公允价值以抵销后的净额列报，净额为零。

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	707.20
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	7,264.53
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	102.15

其他	57.20
合计	8,131.08

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
交易所市场应付交易费用	76,838.91
银行间市场应付交易费用	-
合计	76,838.91

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	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	93,982.98
应付指数使用费	48,823.69
应付替代款	864,044.13
合计	1,006,850.80

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	612,429,801.00	1,231,852,522.38
本期申购	512,000,000.00	1,029,846,180.44
本期赎回(以“-”号填列)	-698,000,000.00	-1,403,969,988.19
- 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	426,429,801.00	857,728,714.63

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。

6.4.7.10 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	-295,972,875.89	-222,786,048.07	-518,758,923.96
本期利润	64,081,965.98	26,505,662.30	90,587,628.28
本期基金份额交易产生的变动数	80,627,594.82	55,635,254.98	136,262,849.80
其中：基金申购款	-220,732,554.31	-193,599,128.47	-414,331,682.78
基金赎回款	301,360,149.13	249,234,383.45	550,594,532.58
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-151,263,315.09	-140,645,130.79	-291,908,445.88

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	26,123.81
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	203,573.64
其他	796.75
合计	230,494.20

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	49,886,885.79
股票投资收益——赎回差价收入	8,142,926.54
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	58,029,812.33

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	566,578,378.16
减：卖出股票成本总额	516,691,492.37
买卖股票差价收入	49,886,885.79

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
赎回基金份额对价总额	853,375,455.61
减：现金支付赎回款总额	466,712,811.61
减：赎回股票成本总额	378,519,717.46
赎回差价收入	8,142,926.54

6.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无股票申购差价收入。

6.4.7.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内无证券出借差价收入。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 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	239,861.31
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	239,861.31

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 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	1,567,702.73
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,327,600.00
减：应收利息总额	241.42
买卖债券差价收入	239,861.31

6.4.7.13.3 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。

6.4.7.13.4 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。

6.4.7.13.5 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。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 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。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属赎回差价收入。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属申购差价收入。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内无买卖权证差价收入。

6.4.7.15.2 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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
国债期货投资收益	-
股指期货-投资收益	4,125,941.75

6.4.7.16 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	3,933,693.34
其中：证券出借权益补偿收入	11,401.50
基金投资产生的股利收益	-
合计	3,933,693.34

6.4.7.17 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	26,172,422.30
——股票投资	26,172,422.30
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	333,240.00
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	26,505,662.30

6.4.7.18 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	-
替代损益	-788,501.58
合计	-788,501.58

6.4.7.19 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	833,449.23
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	833,449.23

6.4.7.20 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	34,310.64
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行划款手续费	4,222.10
指数使用费	100,433.92
合计	198,639.00

6.4.7.21 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（“华泰证券”）	基金管理人的股东、一级交易商
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（“中证 500ETF 联接基金”）	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

金额单位：人民币元

关联方名称	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	
	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	135,847,927.24	12.59%	139,565,405.29	25.73%

6.4.10.1.2 债券回购交易

注：本基金本期与上年度可比期间未发生与关联方进行的债券回购交易。

6.4.10.1.3 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。

6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30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	17,837.60	12.59%	16,739.08	21.78%
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 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	18,325.27	9.98%	18,325.27	18.78%

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 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
	当期发生的基金应支付的管理费	498,411.23
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：于 2019 年 6 月 10 日前，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。

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	166,137.08	198,008.68

注：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 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$

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 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.05\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.3 销售服务费

注：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

单位：人民币元

本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 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	2,451,080.00	292.55	2,199,690.00	102.15
上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 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	-	-	-	-
------	---	---	---	---

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无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。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2020年6月30日		上年度末 2019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
华泰证券股份 有限公司	27,830,432.00	6.5264%	3,745,200.00	0.6115%
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	225,572,324.00	52.8979%	359,037,644.00	58.6251%

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 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	
	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	5,676,278.50	26,123.81	15,884,042.45	24,796.43

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：本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1

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
688528	秦川物联	2020年6月19日	2020年7月1日	新股未上市	11.33	11.33	8,337	94,458.21	94,458.21	-
688600	皖仪科技	2020年6月23日	2020年7月3日	新股未上市	15.50	15.50	5,468	84,754.00	84,754.00	-
300847	中船汉光	2020年6月29日	2020年7月9日	新股未上市	6.94	6.94	1,421	9,861.74	9,861.74	-
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	-
688004	博汇科技	2020年6月5日	2020年12月	新股锁定期内	28.77	71.90	2,500	71,925.00	179,750.00	-

			月 14 日							
688558	国盛智科	2020 年 6 月 19 日	2020 年 12 月 30 日	新股锁定期内	17.37	35.26	8,488	147,436.56	299,286.88	-

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 22 日	拟筹划重大资产重组	1.72	2020 年 7 月 8 日	1.87	314,436	606,780.25	540,829.92	-
002470	*ST 金正	2020 年 6 月 30 日	实行退市风险警示	2.27	2020 年 7 月 1 日	2.16	180,416	590,145.55	409,544.32	-

			示 公 告						
--	--	--	-------------	--	--	--	--	--	--

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

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

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

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
2020062900000313	000959	首 钢 股份	2020-06-29	2020 年 7 月 13 日	4.30	25,000	107,500.00
2020062900000371	002074	国 轩 高科	2020-06-29	2020 年 7 月 13 日	26.84	12,000	322,080.00
2020062900000582	300002	神 州 泰岳	2020-06-29	2020 年 7 月 13 日	6.19	31,000	191,890.00
2020062900000606	300026	红 日 药业	2020-06-29	2020 年 7 月 13 日	5.52	29,000	160,080.00
2020062900000616	300058	蓝 色 光标	2020-06-29	2020 年 7 月 13 日	7.80	31,000	241,800.00
2020062900000832	600418	江 淮 汽车	2020-06-29	2020 年 7 月 13 日	8.83	21,000	185,430.00
2020062900000837	600827	百 联 股份	2020-06-29	2020 年 7 月 13 日	14.45	12,000	173,400.00

2020062900000899	600895	张江高科	2020-06-29	2020年7月13日	20.37	12,000	244,440.00
2020062900000919	600282	南钢股份	2020-06-29	2020年7月13日	3.23	42,000	135,660.00
2020062900000938	600415	小商品城	2020-06-29	2020年7月13日	4.87	43,000	209,410.00
2020062900001184	600037	歌华有线	2020-06-29	2020年7月13日	15.20	15,000	228,000.00
合计						273,000	2,199,690.00

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，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 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 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 0.29%。

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	5,676,278.50	-	-	-	-	-	5,676,278.50
结算备付金	17,696,999.90	-	-	-	-	-	17,696,999.90
存出保证金	127,118.11	-	-	-	-	2,922,897.60	3,050,015.71
交易性金融资产	-	-	-	-	-	540,481,594.16	540,481,594.16
应收证券清算款	-	-	-	-	-	123,476.25	123,476.25
应收利息	-	-	-	-	-	8,131.08	8,131.08
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	23,500,396.51	-	-	-	-	543,536,099.09	567,036,495.60
负债							
交易性金融负债	-	-	-	-	-	4,189.60	4,189.60
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	71,469.23	71,469.23
应付托管费	-	-	-	-	-	23,823.06	23,823.06
应付交易费用	-	-	-	-	-	76,838.91	76,838.91
应交税费	-	-	-	-	-	33,055.25	33,055.25
其他负债	-	-	-	-	-	1,006,850.80	1,006,850.80
负债总计	-	-	-	-	-	1,216,226.85	1,216,226.85
利率敏感度缺口	23,500,396.51	-	-	-	-	542,319,872.24	565,820,268.75
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	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

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 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。

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	540,481,594.16	95.52	679,951,478.60	95.35
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	-4,189.60	0.00	-382.00	0.00
合计	540,477,404.56	95.52	679,951,096.60	95.35

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。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。

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%	27,143,329.62	35,746,157.69
中证 500 指数下降 5%	-27,143,329.62	-35,746,157.69	

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	540,481,594.16	95.32
	其中：股票	540,481,594.16	95.32
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	23,373,278.40	4.12
8	其他各项资产	3,181,623.04	0.56
9	合计	567,036,495.60	100.00

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

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 2,199,690.00 元，占本基金期末资产净值的 0.39%。其中，报告期内本基金与关联方进行转融通证券出借业务的证券 2850 手，报告期末本基金与关联方进行转融通证券出借业务的余额为 2,199,690.00 元。

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	4,824,203.58	0.85
B	采矿业	12,524,367.47	2.21
C	制造业	316,082,817.68	55.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,296,956.69	2.17
E	建筑业	6,960,716.53	1.23
F	批发和零售业	30,027,623.72	5.31
G	交通运输、仓储和邮政业	11,218,160.53	1.98
H	住宿和餐饮业	1,826,342.00	0.32
I	信息传输、软件和信息技术服务业	61,159,163.24	10.81
J	金融业	27,490,688.31	4.86
K	房地产业	18,863,017.22	3.33

L	租赁和商务服务业	10,929,775.89	1.93
M	科学研究和技术服务业	3,893,889.50	0.69
N	水利、环境和公共设施管理业	5,299,086.20	0.94
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	541,512.00	0.10
Q	卫生和社会工作	3,558,920.60	0.63
R	文化、体育和娱乐业	8,341,656.37	1.47
S	综合	4,642,696.63	0.82
	合计	540,481,594.16	95.52

注：上述股票投资组合不包括可退替代款估值增值。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未通过港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300253	卫宁健康	186,885	4,287,141.90	0.76
2	002127	南极电商	184,408	3,903,917.36	0.69
3	002821	凯莱英	15,600	3,790,800.00	0.67
4	600201	生物股份	123,252	3,431,335.68	0.61
5	002185	华天科技	241,600	3,268,848.00	0.58
6	600739	辽宁成大	167,000	3,161,310.00	0.56
7	600529	山东药玻	53,000	3,074,000.00	0.54
8	002439	启明星辰	72,337	3,043,217.59	0.54
9	300088	长信科技	266,635	2,986,312.00	0.53
10	300558	贝达药业	21,100	2,953,578.00	0.52
11	603444	吉比特	5,377	2,952,026.77	0.52
12	002385	大北农	323,500	2,947,085.00	0.52
13	300012	华测检测	145,400	2,873,104.00	0.51
14	002131	利欧股份	743,584	2,870,234.24	0.51
15	300285	国瓷材料	84,400	2,828,244.00	0.50
16	600079	人福医药	103,356	2,813,350.32	0.50
17	600298	安琪酵母	54,750	2,709,030.00	0.48
18	600521	华海药业	79,740	2,705,578.20	0.48
19	002465	海格通信	202,977	2,626,522.38	0.46
20	600143	金发科技	198,769	2,617,787.73	0.46
21	600161	天坛生物	57,412	2,602,485.96	0.46

22	688029	南微医学	10,568	2,563,162.72	0.45
23	300496	中科创达	31,900	2,478,630.00	0.44
24	002075	沙钢股份	194,900	2,436,250.00	0.43
25	000009	中国宝安	283,683	2,414,142.33	0.43
26	603517	绝味食品	34,000	2,405,160.00	0.43
27	002223	鱼跃医疗	65,755	2,393,482.00	0.42
28	601099	太平洋	750,800	2,380,036.00	0.42
29	300595	欧普康视	33,900	2,350,626.00	0.42
30	002273	水晶光电	134,578	2,306,666.92	0.41
31	000636	风华高科	78,974	2,305,251.06	0.41
32	300207	欣旺达	121,900	2,303,910.00	0.41
33	002074	国轩高科	85,300	2,289,452.00	0.40
34	601128	常熟银行	302,505	2,271,812.55	0.40
35	300482	万孚生物	21,700	2,256,800.00	0.40
36	300315	掌趣科技	303,700	2,226,121.00	0.39
37	300418	昆仑万维	89,107	2,224,110.72	0.39
38	002507	涪陵榨菜	60,800	2,189,408.00	0.39
39	600426	华鲁恒升	123,598	2,185,212.64	0.39
40	300357	我武生物	35,000	2,178,750.00	0.39
41	002212	南洋股份	81,765	2,173,313.70	0.38
42	000988	华工科技	87,055	2,126,753.65	0.38
43	002340	格林美	424,114	2,107,846.58	0.37
44	603939	益丰药房	22,860	2,080,260.00	0.37
45	002603	以岭药业	65,424	2,040,574.56	0.36
46	300271	华宇软件	72,200	2,036,762.00	0.36
47	603882	金城医学	22,727	2,034,066.50	0.36
48	000975	银泰黄金	129,543	2,031,234.24	0.36
49	300168	万达信息	91,700	2,023,819.00	0.36
50	300212	易华录	36,000	2,016,000.00	0.36
51	601799	星宇股份	15,600	1,981,200.00	0.35
52	600699	均胜电子	82,940	1,974,801.40	0.35
53	002373	千方科技	81,765	1,961,542.35	0.35
54	000513	丽珠集团	40,806	1,959,096.06	0.35
55	600885	宏发股份	48,760	1,956,251.20	0.35
56	002353	杰瑞股份	62,616	1,941,096.00	0.34
57	000547	航天发展	141,425	1,933,279.75	0.34
58	002156	通富微电	76,600	1,918,830.00	0.34
59	600859	王府井	42,029	1,914,420.95	0.34
60	002414	高德红外	64,381	1,885,075.68	0.33

61	300024	机器人	137,700	1,882,359.00	0.33
62	002019	亿帆医药	81,583	1,873,961.51	0.33
63	300009	安科生物	104,450	1,869,655.00	0.33
64	002557	洽洽食品	34,100	1,847,879.00	0.33
65	002797	第一创业	266,200	1,842,104.00	0.33
66	300017	网宿科技	215,200	1,827,048.00	0.32
67	000750	国海证券	420,242	1,823,850.28	0.32
68	002030	达安基因	65,845	1,796,251.60	0.32
69	603858	步长制药	62,198	1,794,412.30	0.32
70	600801	华新水泥	75,425	1,788,326.75	0.32
71	002250	联化科技	81,387	1,774,236.60	0.31
72	600315	上海家化	36,998	1,772,204.20	0.31
73	002195	二三四五	630,020	1,770,356.20	0.31
74	000021	深科技	80,965	1,767,465.95	0.31
75	600132	重庆啤酒	24,200	1,766,600.00	0.31
76	000050	深天马 A	113,300	1,740,288.00	0.31
77	603233	大参林	21,380	1,736,483.60	0.31
78	002152	广电运通	133,369	1,725,794.86	0.31
79	300058	蓝色光标	219,752	1,714,065.60	0.30
80	002174	游族网络	65,400	1,705,632.00	0.30
81	002138	顺络电子	68,300	1,704,085.00	0.30
82	600380	健康元	104,652	1,699,548.48	0.30
83	600895	张江高科	83,383	1,698,511.71	0.30
84	600845	宝信软件	28,650	1,692,642.00	0.30
85	600486	扬农化工	20,500	1,691,250.00	0.30
86	000998	隆平高科	101,500	1,689,975.00	0.30
87	300070	碧水源	207,600	1,685,712.00	0.30
88	000401	冀东水泥	103,133	1,654,253.32	0.29
89	600410	华胜天成	121,072	1,646,579.20	0.29
90	600667	太极实业	139,100	1,644,162.00	0.29
91	300274	阳光电源	113,205	1,629,019.95	0.29
92	600535	天士力	100,000	1,622,000.00	0.29
93	002511	中顺洁柔	72,700	1,621,210.00	0.29
94	600155	华创阳安	135,174	1,620,736.26	0.29
95	300316	晶盛机电	65,400	1,617,996.00	0.29
96	002382	蓝帆医疗	53,600	1,613,896.00	0.29
97	000623	吉林敖东	102,300	1,609,179.00	0.28
98	002078	太阳纸业	168,374	1,602,920.48	0.28
99	603338	浙江鼎力	21,100	1,598,747.00	0.28

100	600037	歌华有线	104,708	1,591,561.60	0.28
101	600642	中能股份	266,963	1,577,751.33	0.28
102	002572	索菲亚	65,000	1,571,050.00	0.28
103	002013	中航机电	198,500	1,568,150.00	0.28
104	000630	铜陵有色	809,700	1,562,721.00	0.28
105	601233	桐昆股份	122,200	1,559,272.00	0.28
106	600879	航天电子	239,854	1,544,659.76	0.27
107	002690	美亚光电	29,350	1,543,810.00	0.27
108	002926	华西证券	144,400	1,534,972.00	0.27
109	600126	杭钢股份	147,238	1,531,275.20	0.27
110	002396	星网锐捷	43,300	1,529,789.00	0.27
111	300244	迪安诊断	43,197	1,524,854.10	0.27
112	603659	璞泰来	14,800	1,524,696.00	0.27
113	600153	建发股份	185,800	1,504,980.00	0.27
114	300010	立思辰	76,900	1,504,933.00	0.27
115	002500	山西证券	228,297	1,493,062.38	0.26
116	600884	杉杉股份	125,207	1,476,190.53	0.26
117	600415	小商品城	300,100	1,461,487.00	0.26
118	000739	普洛药业	62,700	1,460,283.00	0.26
119	600811	东方集团	327,076	1,445,675.92	0.26
120	600167	联美控股	100,730	1,444,468.20	0.26
121	600216	浙江医药	74,957	1,443,671.82	0.26
122	002281	光迅科技	43,745	1,437,460.70	0.25
123	600804	鹏博士	158,100	1,419,738.00	0.25
124	600728	佳都科技	155,600	1,417,516.00	0.25
125	300251	光线传媒	128,000	1,396,480.00	0.25
126	603707	健友股份	21,500	1,388,255.00	0.25
127	001914	招商积余	45,000	1,382,850.00	0.24
128	300115	长盈精密	59,979	1,370,520.15	0.24
129	600511	国药股份	33,695	1,370,375.65	0.24
130	600909	华安证券	200,300	1,368,049.00	0.24
131	300001	特锐德	65,250	1,366,335.00	0.24
132	002268	卫士通	63,349	1,351,867.66	0.24
133	603883	老百姓	13,425	1,343,037.00	0.24
134	002028	思源电气	65,516	1,340,457.36	0.24
135	300002	神州泰岳	216,302	1,338,909.38	0.24
136	000581	威孚高科	63,713	1,317,584.84	0.23
137	002294	信立泰	44,400	1,316,904.00	0.23
138	600779	水井坊	21,000	1,310,820.00	0.23

139	000686	东北证券	154,797	1,308,034.65	0.23
140	600325	华发股份	184,902	1,305,408.12	0.23
141	000997	新大陆	80,822	1,291,535.56	0.23
142	601689	拓普集团	46,080	1,285,632.00	0.23
143	600528	中铁工业	145,700	1,285,074.00	0.23
144	600418	江淮汽车	144,612	1,276,923.96	0.23
145	002242	九阳股份	34,212	1,275,081.24	0.23
146	600446	金证股份	65,200	1,264,880.00	0.22
147	600598	北大荒	78,510	1,264,011.00	0.22
148	600827	百联股份	86,500	1,249,925.00	0.22
149	002387	维信诺	87,500	1,249,500.00	0.22
150	600460	士兰微	84,884	1,246,097.12	0.22
151	002317	众生药业	72,165	1,238,351.40	0.22
152	600959	江苏有线	328,138	1,233,798.88	0.22
153	000999	华润三九	42,262	1,233,627.78	0.22
154	600733	北汽蓝谷	189,000	1,215,270.00	0.21
155	603000	人民网	61,170	1,213,001.10	0.21
156	600256	广汇能源	448,700	1,211,490.00	0.21
157	601168	西部矿业	208,078	1,206,852.40	0.21
158	000878	云南铜业	112,914	1,198,017.54	0.21
159	300296	利亚德	196,200	1,190,934.00	0.21
160	000564	供销大集	264,399	1,187,151.51	0.21
161	603806	福斯特	23,771	1,186,410.61	0.21
162	002368	太极股份	27,019	1,180,460.11	0.21
163	300630	普利制药	15,900	1,175,805.00	0.21
164	600704	物产中大	279,200	1,175,432.00	0.21
165	300166	东方国信	94,399	1,171,491.59	0.21
166	600260	凯乐科技	86,569	1,170,412.88	0.21
167	600839	四川长虹	406,480	1,166,597.60	0.21
168	600820	隧道股份	206,000	1,163,900.00	0.21
169	603568	伟明环保	50,121	1,162,807.20	0.21
170	600497	驰宏锌锗	336,300	1,156,872.00	0.20
171	300113	顺网科技	45,459	1,154,658.60	0.20
172	002080	中材科技	74,400	1,153,200.00	0.20
173	002670	国盛金控	125,776	1,150,850.40	0.20
174	600673	东阳光	164,770	1,138,560.70	0.20
175	002081	金螳螂	144,600	1,136,556.00	0.20
176	600008	首创股份	375,400	1,129,954.00	0.20
177	600572	康恩贝	204,429	1,124,359.50	0.20

178	002920	德赛西威	18,300	1,122,339.00	0.20
179	300618	寒锐钴业	18,000	1,116,360.00	0.20
180	300026	红日药业	200,741	1,108,090.32	0.20
181	600718	东软集团	96,286	1,107,289.00	0.20
182	002124	天邦股份	86,000	1,105,100.00	0.20
183	600549	厦门钨业	93,119	1,102,528.96	0.19
184	002221	东华能源	125,044	1,099,136.76	0.19
185	000800	一汽轿车	101,200	1,086,888.00	0.19
186	601179	中国西电	224,351	1,085,858.84	0.19
187	000158	常山北明	103,980	1,085,551.20	0.19
188	002831	裕同科技	39,441	1,085,021.91	0.19
189	603866	桃李面包	21,280	1,082,939.20	0.19
190	600875	东方电气	122,359	1,082,877.15	0.19
191	601966	玲珑轮胎	53,492	1,080,538.40	0.19
192	603605	珀莱雅	6,000	1,080,120.00	0.19
193	002217	合力泰	204,300	1,072,575.00	0.19
194	600171	上海贝岭	61,503	1,068,922.14	0.19
195	000729	燕京啤酒	155,610	1,065,928.50	0.19
196	600021	上海电力	143,145	1,059,273.00	0.19
197	600094	大名城	175,100	1,041,845.00	0.18
198	600881	亚泰集团	356,452	1,037,275.32	0.18
199	600567	山鹰纸业	351,290	1,036,305.50	0.18
200	600862	中航高科	60,989	1,031,933.88	0.18
201	000877	天山股份	68,286	1,031,118.60	0.18
202	600060	海信视像	84,582	1,027,671.30	0.18
203	002399	海普瑞	40,800	1,021,632.00	0.18
204	000060	中金岭南	274,600	1,021,512.00	0.18
205	600645	中源协和	36,134	1,020,785.50	0.18
206	600160	巨化股份	147,192	1,014,152.88	0.18
207	600597	光明乳业	67,030	996,065.80	0.18
208	000090	天健集团	143,155	989,201.05	0.17
209	600754	锦江酒店	35,628	988,677.00	0.17
210	002429	兆驰股份	199,200	986,040.00	0.17
211	002056	横店东磁	87,643	985,983.75	0.17
212	300133	华策影视	135,071	979,264.75	0.17
213	603228	景旺电子	27,740	976,170.60	0.17
214	600026	中远海能	151,007	975,505.22	0.17
215	600967	内蒙一机	93,664	973,168.96	0.17
216	002458	益生股份	63,500	969,645.00	0.17

217	601005	重庆钢铁	645,900	962,391.00	0.17
218	603712	七一二	24,900	955,662.00	0.17
219	002648	卫星石化	58,600	953,422.00	0.17
220	600392	盛和资源	135,081	952,321.05	0.17
221	002233	塔牌集团	78,721	947,013.63	0.17
222	600563	法拉电子	15,278	944,180.40	0.17
223	000629	*ST 钒钛	469,400	943,494.00	0.17
224	002807	江阴银行	239,289	940,405.77	0.17
225	600580	卧龙电驱	83,625	939,945.00	0.17
226	600282	南钢股份	290,254	937,520.42	0.17
227	002004	华邦健康	173,990	936,066.20	0.17
228	600755	厦门国贸	141,815	935,979.00	0.17
229	300474	景嘉微	13,900	935,470.00	0.17
230	600039	四川路桥	244,711	934,796.02	0.17
231	600273	嘉化能源	106,800	933,432.00	0.16
232	600064	南京高科	95,794	931,117.68	0.16
233	002085	万丰奥威	143,400	929,232.00	0.16
234	002203	海亮股份	105,900	926,625.00	0.16
235	000970	中科三环	94,468	923,897.04	0.16
236	600566	济川药业	36,200	921,652.00	0.16
237	600737	中粮糖业	118,093	918,763.54	0.16
238	000960	锡业股份	107,200	917,632.00	0.16
239	000778	新兴铸管	266,989	915,772.27	0.16
240	600195	中牧股份	56,363	914,771.49	0.16
241	000598	兴蓉环境	197,572	908,831.20	0.16
242	600166	福田汽车	504,202	907,563.60	0.16
243	601975	招商南油	379,300	906,527.00	0.16
244	002110	三钢闽光	135,359	901,490.94	0.16
245	601118	海南橡胶	185,303	900,572.58	0.16
246	300182	捷成股份	225,293	898,919.07	0.16
247	002925	盈趣科技	15,500	898,070.00	0.16
248	300324	旋极信息	134,844	898,061.04	0.16
249	000690	宝新能源	189,895	896,304.40	0.16
250	603816	顾家家居	19,820	892,098.20	0.16
251	002709	天赐材料	26,293	888,440.47	0.16
252	600466	蓝光发展	164,580	887,086.20	0.16
253	600515	海航基础	170,200	885,040.00	0.16
254	002635	安洁科技	35,397	881,385.30	0.16
255	600373	中文传媒	74,600	878,788.00	0.16

256	002183	怡亚通	163,150	874,484.00	0.15
257	000400	许继电气	66,240	874,368.00	0.15
258	002506	协鑫集成	334,800	873,828.00	0.15
259	600435	北方导航	115,345	872,008.20	0.15
260	002745	木林森	56,514	870,880.74	0.15
261	000089	深圳机场	113,448	869,011.68	0.15
262	000967	盈峰环境	105,200	867,900.00	0.15
263	002191	劲嘉股份	97,071	864,902.61	0.15
264	002048	宁波华翔	55,501	856,935.44	0.15
265	002038	双鹭药业	66,641	853,671.21	0.15
266	000039	中集集团	117,751	851,339.73	0.15
267	000402	金融街	128,200	851,248.00	0.15
268	601860	紫金银行	200,900	849,807.00	0.15
269	000738	航发控制	62,200	849,030.00	0.15
270	000830	鲁西化工	113,633	847,702.18	0.15
271	600729	重庆百货	27,125	846,842.50	0.15
272	002092	中泰化学	186,924	846,765.72	0.15
273	000983	西山煤电	225,780	846,675.00	0.15
274	601106	中国一重	300,400	844,124.00	0.15
275	600808	马钢股份	326,535	842,460.30	0.15
276	000930	中粮科技	123,052	840,445.16	0.15
277	002595	豪迈科技	43,100	838,726.00	0.15
278	600643	爱建集团	105,447	838,303.65	0.15
279	600258	首旅酒店	54,500	837,665.00	0.15
280	600120	浙江东方	121,864	837,205.68	0.15
281	600056	中国医药	58,995	834,779.25	0.15
282	601333	广深铁路	370,600	833,850.00	0.15
283	601098	中南传媒	78,813	833,841.54	0.15
284	600388	龙净环保	94,147	828,493.60	0.15
285	600376	首开股份	141,200	827,432.00	0.15
286	000825	太钢不锈	248,500	825,020.00	0.15
287	600649	城投控股	138,700	823,878.00	0.15
288	000681	视觉中国	44,124	821,588.88	0.15
289	600675	中华企业	200,400	815,628.00	0.14
290	000563	陕国投 A	218,046	808,950.66	0.14
291	600633	浙数文化	82,624	808,062.72	0.14
292	300180	华峰超纤	94,300	807,208.00	0.14
293	000415	渤海金控	270,200	805,196.00	0.14
294	600776	东方通信	53,300	804,297.00	0.14

295	002839	张家港行	139,500	803,520.00	0.14
296	002407	多氟多	75,490	803,213.60	0.14
297	601718	际华集团	240,700	799,124.00	0.14
298	002372	伟星新材	68,620	798,050.60	0.14
299	601866	中远海发	433,351	797,365.84	0.14
300	000501	鄂武商 A	50,710	795,132.80	0.14
301	600022	山东钢铁	611,880	789,325.20	0.14
302	002815	崇达技术	38,844	785,814.12	0.14
303	002010	传化智联	143,300	779,552.00	0.14
304	002375	亚厦股份	76,109	777,833.98	0.14
305	000012	南玻 A	154,733	776,759.66	0.14
306	002064	华峰氨纶	152,505	773,200.35	0.14
307	002640	跨境通	119,012	772,387.88	0.14
308	603077	和邦生物	583,585	770,332.20	0.14
309	002583	海能达	101,230	768,335.70	0.14
310	000932	华菱钢铁	202,360	762,897.20	0.13
311	000078	海王生物	181,530	760,610.70	0.13
312	601615	明阳智能	61,000	759,450.00	0.13
313	600062	华润双鹤	57,349	758,153.78	0.13
314	000883	湖北能源	215,000	756,800.00	0.13
315	000959	首钢股份	175,400	754,220.00	0.13
316	000685	中山公用	97,751	752,682.70	0.13
317	600266	城建发展	148,038	750,552.66	0.13
318	000028	国药一致	16,671	750,361.71	0.13
319	600500	中化国际	148,229	750,038.74	0.13
320	600316	洪都航空	47,253	746,597.40	0.13
321	000301	东方盛虹	133,700	743,372.00	0.13
322	002936	郑州银行	213,950	735,988.00	0.13
323	002155	湖南黄金	93,372	735,771.36	0.13
324	000807	云铝股份	168,211	733,399.96	0.13
325	000027	深圳能源	157,076	728,832.64	0.13
326	601000	唐山港	325,943	726,852.89	0.13
327	002244	滨江集团	169,792	725,011.84	0.13
328	000519	中兵红箭	76,886	724,266.12	0.13
329	000528	柳工	114,293	721,188.83	0.13
330	000031	大悦城	141,630	720,896.70	0.13
331	000488	晨鸣纸业	145,591	719,219.54	0.13
332	600782	新钢股份	176,000	718,080.00	0.13
333	000559	万向钱潮	147,601	714,388.84	0.13

334	601699	潞安环能	127,400	709,618.00	0.13
335	000987	越秀金控	60,606	706,665.96	0.12
336	002444	巨星科技	59,233	703,688.04	0.12
337	600640	号百控股	35,221	702,658.95	0.12
338	002440	闰土股份	76,291	697,299.74	0.12
339	600908	无锡银行	141,577	695,143.07	0.12
340	002625	光启技术	95,096	689,446.00	0.12
341	600073	上海梅林	72,509	688,110.41	0.12
342	002266	浙富控股	176,481	682,981.47	0.12
343	601717	郑煤机	115,402	679,717.78	0.12
344	600777	新潮能源	446,100	678,072.00	0.12
345	603486	科沃斯	22,320	674,287.20	0.12
346	000156	华数传媒	62,119	672,748.77	0.12
347	300459	金科文化	194,396	670,666.20	0.12
348	002390	信邦制药	145,745	664,597.20	0.12
349	300072	三聚环保	154,900	662,972.00	0.12
350	600291	西水股份	72,900	659,745.00	0.12
351	600312	平高电气	88,637	657,686.54	0.12
352	002701	奥瑞金	155,727	652,496.13	0.12
353	601608	中信重工	189,400	647,748.00	0.11
354	002424	贵州百灵	77,886	646,453.80	0.11
355	601958	金钼股份	104,400	645,192.00	0.11
356	002589	瑞康医药	120,199	644,266.64	0.11
357	600863	内蒙华电	261,400	643,044.00	0.11
358	000898	鞍钢股份	262,100	642,145.00	0.11
359	002434	万里扬	73,900	641,452.00	0.11
360	000046	泛海控股	168,600	635,622.00	0.11
361	002505	大康农业	282,111	634,749.75	0.11
362	600409	三友化工	136,097	634,212.02	0.11
363	000887	中鼎股份	80,521	632,089.85	0.11
364	600765	中航重机	61,590	629,449.80	0.11
365	600557	康缘药业	45,179	628,891.68	0.11
366	000008	神州高铁	213,235	626,910.90	0.11
367	600751	海航科技	198,870	622,463.10	0.11
368	000758	中色股份	148,366	620,169.88	0.11
369	601228	广州港	203,300	618,032.00	0.11
370	600507	方大特钢	118,301	613,982.19	0.11
371	600138	中青旅	62,133	613,252.71	0.11
372	000712	锦龙股份	48,968	612,100.00	0.11

373	000813	德展健康	98,437	610,309.40	0.11
374	600158	中体产业	74,356	608,232.08	0.11
375	002002	鸿达兴业	168,381	607,855.41	0.11
376	002563	森马服饰	86,100	607,005.00	0.11
377	600970	中材国际	114,860	606,460.80	0.11
378	600639	浦东金桥	37,665	601,886.70	0.11
379	600835	上海机电	35,530	601,522.90	0.11
380	600259	广晟有色	19,856	595,680.00	0.11
381	300134	大富科技	42,176	589,620.48	0.10
382	600478	科力远	125,011	588,801.81	0.10
383	600717	天津港	132,739	586,706.38	0.10
384	600545	卓郎智能	123,945	586,259.85	0.10
385	000826	启迪环境	78,900	585,438.00	0.10
386	603885	吉祥航空	63,475	577,622.50	0.10
387	600648	外高桥	40,800	576,912.00	0.10
388	600823	世茂股份	127,856	571,516.32	0.10
389	002503	搜于特	203,184	570,947.04	0.10
390	603198	迎驾贡酒	26,100	568,197.00	0.10
391	601928	凤凰传媒	83,200	565,760.00	0.10
392	002249	大洋电机	156,631	565,437.91	0.10
393	601598	中国外运	173,000	558,790.00	0.10
394	600348	阳泉煤业	132,354	558,533.88	0.10
395	600125	铁龙物流	99,863	557,235.54	0.10
396	000061	农产品	74,742	553,838.22	0.10
397	600329	中新药业	31,900	552,508.00	0.10
398	000732	泰禾集团	107,672	548,050.48	0.10
399	002665	首航节能	222,414	542,690.16	0.10
400	603377	东方时尚	32,700	541,512.00	0.10
401	601880	大连港	314,436	540,829.92	0.10
402	601200	上海环境	45,013	540,156.00	0.10
403	002302	西部建设	56,000	537,600.00	0.10
404	600582	天地科技	180,824	529,814.32	0.09
405	601611	中国核建	85,500	528,390.00	0.09
406	002867	周大生	23,800	527,646.00	0.09
407	300376	易事特	101,354	527,040.80	0.09
408	600307	酒钢宏兴	342,099	526,832.46	0.09
409	000869	张裕A	15,300	522,495.00	0.09
410	000990	诚志股份	41,057	521,013.33	0.09
411	600748	上实发展	100,624	514,188.64	0.09

412	600901	江苏租赁	98,300	512,143.00	0.09
413	000718	苏宁环球	164,548	508,453.32	0.09
414	000717	韶钢松山	133,800	508,440.00	0.09
415	000062	深圳华强	34,907	507,547.78	0.09
416	002419	天虹股份	53,100	507,105.00	0.09
417	600664	哈药股份	164,505	506,675.40	0.09
418	600141	兴发集团	56,611	506,668.45	0.09
419	600017	日照港	201,394	501,471.06	0.09
420	601678	滨化股份	118,220	501,252.80	0.09
421	002544	杰赛科技	38,100	501,015.00	0.09
422	002408	齐翔腾达	80,167	497,837.07	0.09
423	000543	皖能电力	123,601	496,876.02	0.09
424	300257	开山股份	38,003	496,699.21	0.09
425	002093	国脉科技	55,780	493,653.00	0.09
426	603888	新华网	21,950	490,802.00	0.09
427	603317	天味食品	8,795	488,826.10	0.09
428	600277	亿利洁能	149,011	485,775.86	0.09
429	002128	露天煤业	62,629	485,374.75	0.09
430	600869	智慧能源	121,211	484,844.00	0.09
431	002653	海思科	17,800	473,658.00	0.08
432	002416	爱施德	65,120	467,561.60	0.08
433	000848	承德露露	66,760	467,320.00	0.08
434	603515	欧普照明	16,811	460,117.07	0.08
435	300197	铁汉生态	179,950	457,073.00	0.08
436	603983	丸美股份	5,300	455,959.00	0.08
437	603650	彤程新材	19,276	448,552.52	0.08
438	600565	迪马股份	159,762	445,735.98	0.08
439	000537	广宇发展	61,000	445,300.00	0.08
440	603328	依顿电子	42,531	443,598.33	0.08
441	002948	青岛银行	87,100	443,339.00	0.08
442	600053	九鼎投资	14,800	441,632.00	0.08
443	002901	大博医疗	3,700	441,373.00	0.08
444	603056	德邦股份	32,470	439,319.10	0.08
445	603766	隆鑫通用	112,801	436,539.87	0.08
446	601869	长飞光纤	13,942	429,553.02	0.08
447	601019	山东出版	67,700	423,125.00	0.07
448	002491	通鼎互联	82,501	422,405.12	0.07
449	600787	中储股份	96,217	422,392.63	0.07
450	600350	山东高速	67,800	416,292.00	0.07

451	600339	中油工程	182,800	414,956.00	0.07
452	600770	综艺股份	85,817	411,921.60	0.07
453	002470	*ST 金正	180,416	409,544.32	0.07
454	000553	安道麦 A	45,400	409,508.00	0.07
455	601139	深圳燃气	62,200	404,300.00	0.07
456	002051	中工国际	54,956	400,079.68	0.07
457	600338	西藏珠峰	39,922	399,220.00	0.07
458	000600	建投能源	78,390	399,005.10	0.07
459	600694	大商股份	16,325	391,636.75	0.07
460	600657	信达地产	94,841	390,744.92	0.07
461	601016	节能风电	181,500	384,780.00	0.07
462	002285	世联行	134,553	375,402.87	0.07
463	002118	紫鑫药业	81,823	363,294.12	0.06
464	600428	中远海特	117,780	362,762.40	0.06
465	601801	皖新传媒	64,700	359,732.00	0.06
466	600707	彩虹股份	78,300	357,048.00	0.06
467	600575	淮河能源	169,593	354,449.37	0.06
468	000937	冀中能源	115,648	349,256.96	0.06
469	600006	东风汽车	86,131	347,107.93	0.06
470	600985	淮北矿业	44,500	346,655.00	0.06
471	601865	福莱特	18,200	342,160.00	0.06
472	603786	科博达	4,500	339,075.00	0.06
473	600757	长江传媒	66,053	336,209.77	0.06
474	600623	华谊集团	61,709	318,418.44	0.06
475	600874	创业环保	47,449	315,061.36	0.06
476	600996	贵广网络	43,947	313,342.11	0.06
477	603556	海兴电力	21,020	303,528.80	0.05
478	688558	国盛智科	8,488	299,286.88	0.05
479	603868	飞科电器	6,066	299,235.78	0.05
480	002941	新疆交建	20,700	292,905.00	0.05
481	600058	五矿发展	47,132	284,677.28	0.05
482	000785	武汉中商	33,200	262,944.00	0.05
483	603355	莱克电气	10,103	251,463.67	0.04
484	002946	新乳业	14,400	249,840.00	0.04
485	601003	柳钢股份	56,100	248,523.00	0.04
486	000025	特力 A	13,496	247,381.68	0.04
487	603379	三美股份	11,380	244,328.60	0.04
488	600903	贵州燃气	24,700	243,048.00	0.04
489	601127	小康股份	28,300	235,173.00	0.04

490	002818	富森美	18,210	223,983.00	0.04
491	600335	国机汽车	48,318	223,229.16	0.04
492	601969	海南矿业	43,200	210,816.00	0.04
493	601512	中新集团	18,000	207,000.00	0.04
494	603225	新凤鸣	18,178	181,416.44	0.03
495	688004	博汇科技	2,500	179,750.00	0.03
496	002423	中粮资本	20,300	176,610.00	0.03
497	601811	新华文轩	17,227	175,198.59	0.03
498	001872	招商港口	11,900	173,145.00	0.03
499	603025	大豪科技	20,106	146,170.62	0.03
500	600917	重庆燃气	20,053	143,178.42	0.03
501	601068	中铝国际	33,400	130,594.00	0.02
502	603256	宏和科技	11,200	128,128.00	0.02
503	002957	科瑞技术	4,700	112,330.00	0.02
504	603087	甘李药业	1,076	107,922.80	0.02
505	688528	秦川物联	8,337	94,458.21	0.02
506	688600	皖仪科技	5,468	84,754.00	0.01
507	300824	北鼎股份	1,954	26,789.34	0.00
508	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.00
509	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.00
510	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.00
511	300847	中船汉光	1,421	9,861.74	0.00
512	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
513	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
514	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
515	300846	首都在线	1,131	3,811.47	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	002821	凯莱英	5,277,742.57	0.74
2	300014	亿纬锂能	4,799,705.00	0.67
3	300088	长信科技	4,563,639.00	0.64
4	002463	沪电股份	4,281,623.00	0.60

5	300253	卫宁健康	4,217,891.80	0.59
6	002384	东山精密	3,626,665.00	0.51
7	002131	利欧股份	3,619,386.36	0.51
8	300383	光环新网	3,612,769.46	0.51
9	002185	华天科技	3,546,368.26	0.50
10	002129	中环股份	3,519,851.97	0.49
11	300012	华测检测	3,347,323.00	0.47
12	002065	东华软件	3,303,698.86	0.46
13	002465	海格通信	3,223,072.05	0.45
14	002439	启明星辰	3,209,242.61	0.45
15	002385	大北农	3,196,764.00	0.45
16	000066	中国长城	3,177,905.00	0.45
17	002371	北方华创	3,112,853.40	0.44
18	002273	水晶光电	3,088,976.17	0.43
19	002340	格林美	3,011,867.00	0.42
20	300285	国瓷材料	3,000,052.02	0.42

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	300014	亿纬锂能	10,718,001.20	1.50
2	002371	北方华创	8,871,921.20	1.24
3	002463	沪电股份	8,852,454.62	1.24
4	002384	东山精密	8,635,504.60	1.21
5	002129	中环股份	8,587,331.74	1.20
6	300383	光环新网	7,926,014.53	1.11
7	002049	紫光国微	7,082,424.38	0.99
8	000066	中国长城	6,964,070.26	0.98
9	002065	东华软件	6,739,586.00	0.95
10	002821	凯莱英	6,623,281.20	0.93
11	002812	恩捷股份	6,482,288.93	0.91
12	300529	健帆生物	5,987,439.20	0.84
13	300253	卫宁健康	5,626,483.60	0.79
14	600745	闻泰科技	5,436,169.51	0.76
15	002180	纳思达	5,143,806.46	0.72

16	300088	长信科技	4,875,166.00	0.68
17	002127	南极电商	4,539,337.46	0.64
18	002465	海格通信	4,385,469.00	0.61
19	002439	启明星辰	4,288,229.37	0.60
20	300012	华测检测	4,189,033.53	0.59

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	518,485,555.80
卖出股票收入（成交）总额	566,578,378.16

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。

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 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。

7.8 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。

7.9 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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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
IC2007	中证 500 期货 2007 合约	21	24,357,480.00	482,880.00	-
公允价值变动总额合计（元）					482,880.00
股指期货投资本期收益（元）					4,125,941.75
股指期货投资本期公允价值变动（元）					333,240.00

7.10.2 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.11.3 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

7.12.3 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	3,050,015.71
2	应收证券清算款	123,476.25
3	应收股利	-
4	应收利息	8,131.08
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,181,623.04

7.12.4 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处于转股期的可转换债券。

7.12.5 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。

§ 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

8.1.1 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
7,229	58,988.77	261,965,690.00	61.43%	164,464,111.00	38.57%

8.1.2 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	225,572,324.00	52.90%

8.2 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	8.97%
2	华泰证券股份有限公司	24,000,000.00	5.63%
3	广发证券股份有限公司	4,099,999.00	0.96%
4	华泰证券股份有限公司	3,830,432.00	0.90%
5	廖爱南	2,417,900.00	0.57%
6	喀什哲悦文化传媒有限公司	1,215,400.00	0.29%
7	方正证券股份有限公司	1,182,200.00	0.28%
8	夏建辉	1,000,000.00	0.23%
9	王一飞	976,400.00	0.23%
10	李天云	964,900.00	0.23%

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。

8.3 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%

8.4 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

§ 9 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	612,429,801.00
本报告期基金总申购份额	512,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	698,000,000.00
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	426,429,801.00

§ 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	
中信建投	4	942,752,388.62	87.41%	123,795.03	87.41%	-
华泰证券	2	135,847,927.24	12.59%	17,837.60	12.59%	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
财富证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	3	-	-	-	-	-

方正证券	2	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
申港证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	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	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	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-

民生证券	1	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---	---

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。

10.7.2 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	931,960.70	59.45%	-	-	-	-
华泰证券	635,742.03	40.55%	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-

国泰君安	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
北京高华	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金财富证 券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华泰柏瑞ETF申赎清单版本更新公告	证监会规定报刊和网站	2020年6月4日
2	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	证监会规定报刊和网站	2020年3月18日

	公司费率优惠活动的公告		
3	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下上海证券交易所上市基金增加扩位证券简称的公告	证监会规定报刊和网站	2020 年 3 月 13 日
4	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
5	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
6	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
7	关于华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金调整申赎结算模式并修改基金合同的公告	证监会规定报刊和网站	2020 年 1 月 15 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	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
联接基金	1	20200101-20200630	359,037,644.00	61,700,000.00	195,165,320.00	225,572,324.00	52.90%

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。

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

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

华泰柏瑞基金管理有限公司

2020 年 8 月 29 日