

# 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 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的法律责任。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，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本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

<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	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	8
<b>§4 管理人报告</b>	<b>10</b>
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	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	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	15
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
<b>§5 托管人报告</b>	<b>16</b>
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
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>17</b>
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
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>42</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	42
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	42
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.....	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	45
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.....	45
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.....	45
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.....	45
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.....	45
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.....	45
7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	46
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	46
7.13 投资组合报告附注.....	46
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>48</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	48
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.....	48
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>49</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>50</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	50
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.....	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	50
10.4 基金投资策略的改变.....	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	50
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.....	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	50
10.8 其他重大事件.....	52
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>54</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 .....	54
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	54
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>55</b>
12.1 备查文件目录.....	55
12.2 存放地点.....	55
12.3 查阅方式.....	55

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金
基金简称	华泰柏瑞上证中小盘 ETF 联接
基金主代码	460220
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 1 月 26 日
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	16,470,243.99 份
基金合同存续期	不定期

#### 2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	510220
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2011 年 1 月 26 日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2011 年 3 月 28 日
基金管理人名称	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人名称	中国银行股份有限公司

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为华泰柏瑞上证中小盘 ETF 的联接基金。华泰柏瑞上证中小盘 ETF 是采用完全复制法实现对上证中小盘指数紧密跟踪的全被动指数基金，本基金主要通过投资于华泰柏瑞上证中小盘 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪。在投资运作过程中，本基金将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，决定采用一级市场申购赎回的方式或二级市场买卖的方式对华泰柏瑞上证中小盘 ETF 进行投资。
业绩比较基准	上证中小盘指数 $\times$ 95% + 银行活期存款税后收益率 $\times$ 5%
风险收益特征	本基金为华泰柏瑞上证中小盘 ETF 的联接基金，采用主要投资于上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金实现对业绩比较基准的紧密跟踪。因此，本基金的业绩表现与上证中小盘指数的表现密切相关。本基金

	的风险与收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。
--	-------------------------------

## 2.2.1 目标基金产品说明

## 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	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

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	3,034,295.54
本期利润	2,380,425.71
加权平均基金份额本期利润	0.0407
本期加权平均净值利润率	3.70%
本期基金份额净值增长率	4.77%
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	2,724,163.27
期末可供分配基金份额利润	0.1654
期末基金资产净值	19,194,407.26
期末基金份额净值	1.1654
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	16.54%

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

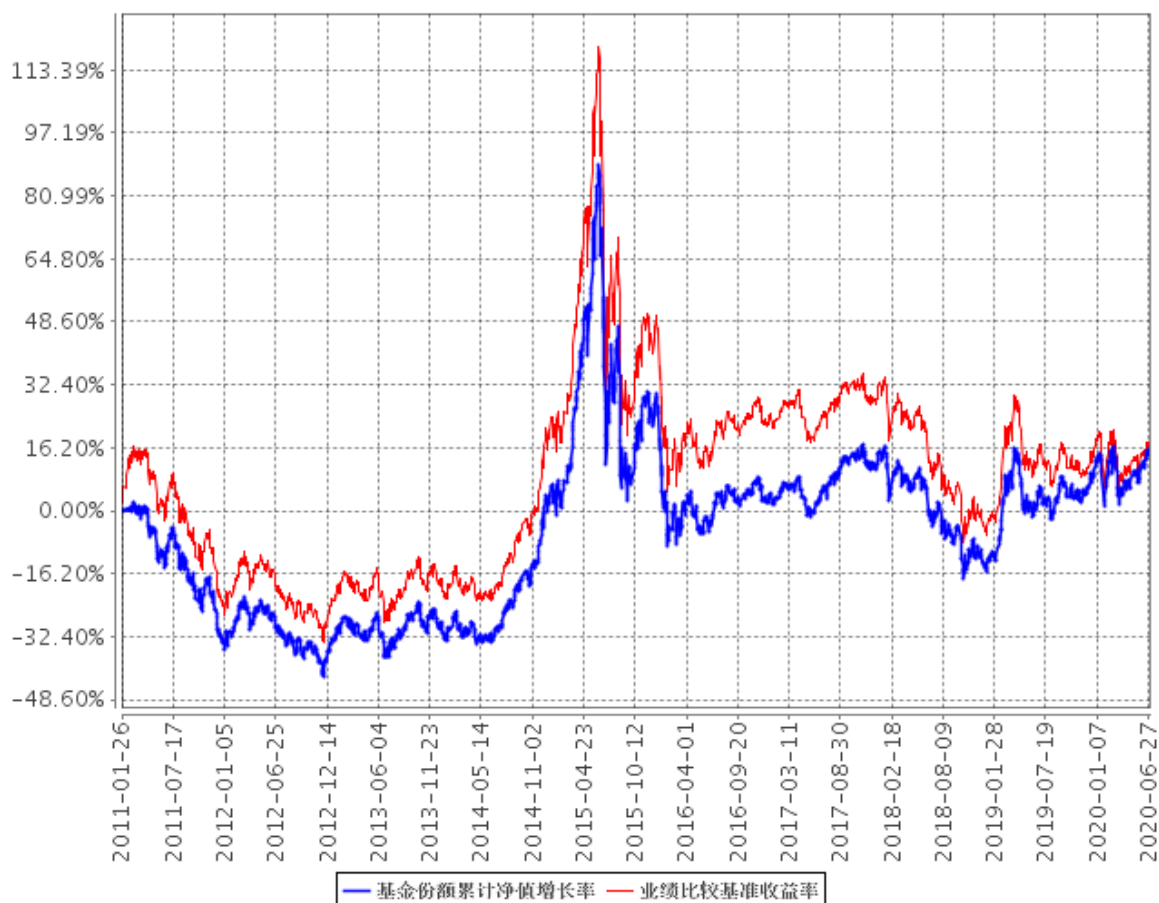
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	7.13%	0.81%	5.87%	0.77%	1.26%	0.04%
过去三个月	11.51%	0.88%	9.56%	0.87%	1.95%	0.01%
过去六个月	4.77%	1.44%	1.48%	1.45%	3.29%	-0.01%
过去一年	12.17%	1.17%	3.45%	1.18%	8.72%	-0.01%
过去三年	10.88%	1.21%	-4.68%	1.22%	15.56%	-0.01%
自合同生效日至今	16.54%	1.46%	18.47%	1.49%	-1.93%	-0.03%



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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：图示日期为 2011 年 1 月 26 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	2011 年 1 月 26 日	2020 年 2 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 月起任指数投资部总监。2015 年 5 月起任

					<p>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>
李茜	本基金的基金经理	2019 年 11 月 5 日	-	5 年	<p>曾任职于上海市虹口区金融服务局。2015 年 3 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任指数投资部助理研究员、研究员。2019 年 11 月起任上证红利交易型开放式指数证券投资基金、上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。</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 3.375%，日均绝对跟踪偏离度为 0.041%，期间日跟踪误差为 0.06%，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 1.1654 元；本报告期基金份额净值增长率为 4.77%，业绩比较基准收益率为 1.48%。

#### 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，基金每年收益分配次数最多为 12 次；每份基金份额每次分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 10%，若基金合同生效不满 3 个月，可不进行收益分配。截至本报告期末，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”）在华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

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

### 5.3 托管人对本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：华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金

报告截止日：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	26,328,757.61	3,422,559.87
结算备付金		-	-
存出保证金		1,701.49	2,715.77
交易性金融资产	6.4.7.2	18,175,915.00	63,685,933.90
其中：股票投资		372,395.00	1,515,599.50
基金投资		17,803,520.00	62,050,262.40
债券投资		-	120,072.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		2,828,269.64	-
应收利息	6.4.7.5	799.80	3,401.63
应收股利		-	-
应收申购款		24,315.56	104,002.79
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		47,359,759.10	67,218,613.96
<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		28,050,780.93	147,673.32
应付管理人报酬		2,440.17	2,059.80
应付托管费		488.07	411.94
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	41,999.52	516.38
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	69,643.15	110,145.96
负债合计		28,165,351.84	260,807.40
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	16,470,243.99	60,195,593.34
未分配利润	6.4.7.10	2,724,163.27	6,762,213.22
所有者权益合计		19,194,407.26	66,957,806.56
负债和所有者权益总计		47,359,759.10	67,218,613.96

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.1654 元，基金份额总额 16,470,243.99 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：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>		2,564,809.20	10,848,390.36
1.利息收入		12,934.75	11,923.96
其中：存款利息收入	6.4.7.11	10,075.99	11,923.85
债券利息收入		2,858.76	0.11
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）		3,186,779.33	109,410.86
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-7,858.27	86,344.56
基金投资收益	6.4.7.13	3,184,644.88	15,801.01
债券投资收益	6.4.7.14	-1,013.32	26.39
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	-	-
股利收益	6.4.7.17	11,006.04	7,238.90
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-653,869.83	10,722,916.01
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	18,964.95	4,139.53
<b>减：二、费用</b>		184,383.49	59,399.83
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	10,865.33	9,457.09

2. 托管费	6.4.10.2.2	2, 173. 14	1, 891. 35
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.20	100, 819. 97	2, 865. 41
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.21	70, 525. 05	45, 185. 98
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		2, 380, 425. 71	10, 788, 990. 53
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		2, 380, 425. 71	10, 788, 990. 53

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：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）	60, 195, 593. 34	6, 762, 213. 22	66, 957, 806. 56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2, 380, 425. 71	2, 380, 425. 71
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）	-43, 725, 349. 35	-6, 418, 475. 66	-50, 143, 825. 01
其中：1. 基金申购款	4, 877, 617. 93	368, 135. 76	5, 245, 753. 69
2. 基金赎回款	-48, 602, 967. 28	-6, 786, 611. 42	-55, 389, 578. 70
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）	16, 470, 243. 99	2, 724, 163. 27	19, 194, 407. 26
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）	57,972,321.13	-8,409,584.77	49,562,736.36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	10,788,990.53	10,788,990.53
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）	-358,523.67	-134,913.17	-493,436.84
其中：1. 基金申购款	2,698,295.87	108,955.31	2,807,251.18
2. 基金赎回款	-3,056,819.54	-243,868.48	-3,300,688.02
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	57,613,797.46	2,244,492.59	59,858,290.05

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

华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2010]第 1535 号《关于核准上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》核准，由华泰柏瑞基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 482,542,072.50 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第 26 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》于 2011 年 1 月 26 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 482,562,901.50 份基金份额，其中认购资金利息折合 20,829.00 份基金份

额。本基金的基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括华泰柏瑞上证中小盘 ETF、上证中小盘指数成份股及备选成份股、非成份股、债券、新股（一级市场初次发行和增发）、股指期货、货币市场工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。正常情况下，本基金资产中投资于华泰柏瑞上证中小盘 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%；现金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%。本基金的业绩比较基准为上证中小盘指数  $\times$  95% + 银行活期存款税后收益率  $\times$  5%。

本财务报表由本基金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》、《上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注 6.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

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

本年度采用的会计政策和会计估计与上年度相一致。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

## 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、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、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、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(c) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%

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

(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	26,328,757.61
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	26,328,757.61

### 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	376,969.73	372,395.00	-4,574.73
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	16,344,525.26	17,803,520.00	1,458,994.74

其他	-	-	-
合计	16,721,494.99	18,175,915.00	1,454,420.01

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：截至本报告期末，本基金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：截至本报告期末，本基金买入返售金融资产余额为 0。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：截至本报告期末，本基金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	799.00
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	-
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	0.80
合计	799.80

### 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	41,999.52
银行间市场应付交易费用	-
合计	41,999.52

#### 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	26.33
应付证券出借违约金	-
预提费用	69,616.82
合计	69,643.15

#### 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	60,195,593.34	60,195,593.34
本期申购	4,877,617.93	4,877,617.93
本期赎回(以“-”号填列)	-48,602,967.28	-48,602,967.28
- 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	16,470,243.99	16,470,243.99

#### 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	26,276,246.99	-19,514,033.77	6,762,213.22
本期利润	3,034,295.54	-653,869.83	2,380,425.71
本期基金份额交易产生的变动数	-20,766,167.88	14,347,692.22	-6,418,475.66
其中：基金申购款	2,136,193.35	-1,768,057.59	368,135.76
基金赎回款	-22,902,361.23	16,115,749.81	-6,786,611.42

本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,544,374.65	-5,820,211.38	2,724,163.27

#### 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	10,034.88
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	25.88
其他	15.23
合计	10,075.99

#### 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	-5,921.65
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-1,936.62
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-7,858.27

##### 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	48,333,259.19
减：卖出股票成本总额	48,339,180.84
买卖股票差价收入	-5,921.65

##### 6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

注：无。

#### 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	2,034,950.00
减：现金支付申购款总额	184,197.53
减：申购股票成本总额	1,852,689.09
申购差价收入	-1,936.62

#### 6.4.7.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

#### 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	48,837,445.68
减：卖出/赎回基金成本总额	45,652,800.80
基金投资收益	3,184,644.88

#### 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	-1,013.32
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	-1,013.32

##### 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	534,504.80

减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	522,146.00
减：应收利息总额	13,372.12
买卖债券差价收入	-1,013.32

#### 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：无。

##### 6.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

##### 6.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

#### 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衍生工具收益。

##### 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	11,006.04
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	11,006.04

#### 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	-653,869.83
——股票投资	-19,971.57
——债券投资	-96.00
——基金投资	-633,802.26
——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	-653,869.83

#### 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	18,478.37
转换费收入	486.58
合计	18,964.95

#### 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	99,323.08

银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	1,496.89
其中：申购费	58.46
赎回费	1,418.63
合计	100,819.97

#### 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	39,781.56
证券出借违约金	-
银行划款手续费	908.23
合计	70,525.05

#### 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

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

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

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	24,112,486.52	48.24%	1,041,964.00	77.11%

#### 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：本基金本期与上年度可比期间未发生与关联方进行的权证交易。

#### 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	22,456.88	48.24%	17,901.87	42.62%
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	970.40	77.11%	-	-

## 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	10,865.33	9,457.09
其中：支付销售机构的客户维护费	10,977.41	11,683.79

注：本基金应支付基金管理人报酬，按前一日基金资产净值的 0.50% 的年费率计提，计算方法如下： $H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$  H 为每日应支付的管理人报酬 E 为前一日的基金资产净值 基金管理人报酬每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

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托管费	2,173.14	1,891.35

注：本基金应支付基金托管人托管费，按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提，计算方法如下： $H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$  H 为每日应支付的托管费 E 为前一日的基金资产净值 基金托管费每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取。

### 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：本基金本期未与关联方进行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：无。



#### 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：无。

#### 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。

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

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 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	26,328,757.61	10,034.88	3,442,270.52	11,913.23

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

于本报告期末，本基金持有 3,974,000 份目标 ETF 基金份额，占目标 ETF 基金总份额的比例为 51.42%。（2019 年 6 月 30 日：本基金持有 14,074,000 份目标 ETF 基金份额，占目标 ETF 基金总份额的比例为 75.14%。）

#### 6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 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

注：截至本报告期末，本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券

##### 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
600226	瀚叶股份	2020年4月30日	临时停牌	2.35	-	-	14,700	34,545.00	34,545.00	-
601880	大连港	2020年6月22日	临时停牌	1.72	-	-	13,300	22,876.00	22,876.00	-

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

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

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

本基金属于 ETF 联接基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，紧密跟踪标的指数，具有和标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。本基金投资的金融工具主要包括基金投资、股票投资及债券投资。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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

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

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

#### 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。

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

于 2020 年 6 月 30 日，本基金无债券投资（2019 年 12 月 31 日：未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券）。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	120,072.00
合计	0.00	120,072.00

#### 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，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 0.30%。

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	26,328,757.61	-	-	-	-	-	-	26,328,757.61
存出保证金	1,701.49	-	-	-	-	-	-	1,701.49
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-	-18,175,915.00	18,175,915.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-2,828,269.64	2,828,269.64
应收利息	-	-	-	-	-	-	799.80	799.80
应收申购款	-	-	-	-	-	-	24,315.56	24,315.56
其他资产	-	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	26,330,459.10	-	-	-	-	-	-21,029,300.00	47,359,759.10
负债								
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-28,050,780.93	28,050,780.93
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	2,440.17	2,440.17
应付托管费	-	-	-	-	-	-	488.07	488.07
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	41,999.52	41,999.52
其他负债	-	-	-	-	-	-	69,643.15	69,643.15
负债总计	-	-	-	-	-	-	-28,165,351.84	28,165,351.84
利率敏感度缺口	26,330,459.10	-	-	-	-	-	-7,136,051.84	19,194,407.26
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	3,422,559.87	-	-	-	-	-	-	3,422,559.87
存出保证金	2,715.77	-	-	-	-	-	-	2,715.77
交易性金融资产	120,072.00	-	-	-	-	-	-63,565,861.90	63,685,933.90
应收利息	-	-	-	-	-	-	3,401.63	3,401.63
应收申购款	-	-	-	-	-	-	104,002.79	104,002.79
资产总计	3,545,347.64	-	-	-	-	-	-63,673,266.32	67,218,613.96
负债								
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-147,673.32	147,673.32
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	2,059.80	2,059.80
应付托管费	-	-	-	-	-	-	411.94	411.94
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	516.38	516.38
其他负债	-	-	-	-	-	-	110,145.96	110,145.96
负债总计	-	-	-	-	-	-	-260,807.40	260,807.40
利率敏感度缺口	3,545,347.64	-	-	-	-	-	-63,412,458.92	66,957,806.56

注：各期限分类的标准按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

#### 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：0.18%)，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上证中小盘指数波动的影响。

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

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

##### 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	372,395.00	1.94	1,515,599.50	2.26
交易性金融资产-基金投资	17,803,520.00	92.75	62,050,262.40	92.67
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	18,175,915.00	94.69	63,565,861.90	94.93

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除上证中小盘指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2020年6月30日）	上年度末（2019年12月31日）
	上证中小盘指数上升 5%	883,394.51	2,593,773.22
	上证中小盘指数下降 5%	-883,394.51	-2,593,773.22

#### 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	372,395.00	0.79
	其中：股票	372,395.00	0.79
2	基金投资	17,803,520.00	37.59
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	26,328,757.61	55.59
8	其他各项资产	2,855,086.49	6.03
9	合计	47,359,759.10	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	288,157.00	1.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	49,292.00	0.26
G	交通运输、仓储和邮政业	22,876.00	0.12
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	3,120.00	0.02
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-

N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	8,950.00	0.05
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	372,395.00	1.94

## 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：本基金本报告期没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	603288	海天味业	1,860	231,384.00	1.21
2	600511	国药股份	1,100	44,737.00	0.23
3	600226	瀚叶股份	14,700	34,545.00	0.18
4	601880	大连港	13,300	22,876.00	0.12
5	601865	福莱特	1,100	20,680.00	0.11
6	603882	金域医学	100	8,950.00	0.05
7	600859	王府井	100	4,555.00	0.02
8	600515	海航基础	600	3,120.00	0.02
9	603766	隆鑫通用	400	1,548.00	0.01

## 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	600900	长江电力	58,786.00	0.09
2	603160	汇顶科技	31,898.00	0.05
3	603288	海天味业	30,952.00	0.05
4	601169	北京银行	29,583.00	0.04
5	603986	兆易创新	27,693.00	0.04
6	601229	上海银行	22,950.00	0.03

7	601899	紫金矿业	21,359.00	0.03
8	603501	韦尔股份	18,749.00	0.03
9	600999	招商证券	18,733.00	0.03
10	601009	南京银行	17,940.00	0.03
11	600019	宝钢股份	17,510.00	0.03
12	601006	大秦铁路	16,951.00	0.03
13	600015	华夏银行	16,944.00	0.03
14	600741	华域汽车	15,456.00	0.02
15	600406	国电南瑞	15,444.00	0.02
16	601816	京沪高铁	14,640.00	0.02
17	600436	片仔癀	13,433.00	0.02
18	603799	华友钴业	13,243.00	0.02
19	600958	东方证券	12,782.00	0.02
20	600352	浙江龙盛	12,170.00	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	600900	长江电力	1,402,951.00	2.10
2	603288	海天味业	870,466.00	1.30
3	600570	恒生电子	676,262.00	1.01
4	601229	上海银行	667,219.00	1.00
5	601169	北京银行	627,384.00	0.94
6	601766	中国中车	529,626.00	0.79
7	603986	兆易创新	518,823.60	0.77
8	601899	紫金矿业	500,262.00	0.75
9	600999	招商证券	479,808.00	0.72
10	603501	韦尔股份	430,237.00	0.64
11	600406	国电南瑞	403,047.00	0.60
12	601009	南京银行	377,471.00	0.56
13	601006	大秦铁路	361,056.00	0.54
14	600438	通威股份	357,333.00	0.53
15	600436	片仔癀	351,865.00	0.53
16	603019	中科曙光	349,600.80	0.52
17	600763	通策医疗	344,175.00	0.51

18	600019	宝钢股份	340,191.00	0.51
19	601939	建设银行	329,725.00	0.49
20	601390	中国中铁	319,380.00	0.48

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	1,668,511.00
卖出股票收入（成交）总额	48,333,259.19

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。

### 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	中小盘 ETF	指数型	交易型开放式	华泰柏瑞基金管理有限公司	17,803,520.00	92.75

## 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。

### 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	1,701.49
2	应收证券清算款	2,828,269.64
3	应收股利	-
4	应收利息	799.80
5	应收申购款	24,315.56
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,855,086.49

### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600226	瀚叶股份	34,545.00	0.18	停牌
2	601880	大连港	22,876.00	0.12	停牌

## § 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

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
600	27,450.41	8,315,000.00	50.48%	8,155,243.99	49.52%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

### 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	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（2011 年 1 月 26 日）基金份额总额	482,562,901.50
本报告期期初基金份额总额	60,195,593.34
本报告期基金总申购份额	4,877,617.93
减：本报告期基金总赎回份额	48,602,967.28
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	16,470,243.99

## § 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

为本基金审计的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所有限公司。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	
广发证券	1	25,874,643.67	51.76%	24,097.65	51.76%	-
华泰证券	1	24,112,486.52	48.24%	22,456.88	48.24%	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-

东方证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-

注：1、选择代理证券买卖的证券经营机构的标准

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

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

2、选择代理证券买卖的证券经营机构的程序

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

### 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
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	410,165.67	100.00%	-	-	-	-	439,008.00	100.00%

银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-

## 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	华泰柏瑞基金管理有限公司关于参加交通银行手机银行渠道申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2020年6月30日
2	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
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旗下基金参加万联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2月28日

8	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
9	华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理变更的公告	证监会规定报刊和网站	2020 年 2 月 14 日
10	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
11	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
12	华泰柏瑞基金管理有限公司关于参加中国农业银行费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2020 年 1 月 6 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	47,010,154.19	0.00	38,695,154.19	8,315,000.00	50.48%
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

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金募集的文件
- 2、《上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》
- 3、《上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》
- 4、《上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金的公告

### 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 层及托管人住所

### 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