

上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金

2020 年年度报告

2020 年 12 月 31 日

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2021 年 3 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 3 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 2020 年 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§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	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	17
§5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	18
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	18
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	18
§6 审计报告	19
6.1 审计报告基本信息	19

6.2 审计报告的基本内容.....	19
§7 年度财务报表.....	22
7.1 资产负债表.....	22
7.2 利润表.....	23
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	24
7.4 报表附注.....	25
§8 投资组合报告.....	53
8.1 期末基金资产组合情况.....	53
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	53
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	54
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	65
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	67
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	67
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	68
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	68
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	68
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	68
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	68
8.12 投资组合报告附注.....	68
§9 基金份额持有人信息.....	70
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	70
9.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	70
9.3 期末上市基金前十名持有人.....	70
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	70
9.5 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	70
§10 开放式基金份额变动.....	72
§ 11 重大事件揭示.....	73
11.1 基金份额持有人大会决议.....	73
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	73
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	73

11.4 基金投资策略的改变	73
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	73
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	73
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	74
11.8 其他重大事件	75
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	77
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况	77
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	78
§13 备查文件目录.....	79
13.1 备查文件目录	79
13.2 存放地点	79
13.3 查阅方式	79

§ 2 基金简介

2.1 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
基金简称	华泰柏瑞上证中小盘 ETF
场内简称	中小 ETF
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	4,229,161.00 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	2011 年 3 月 28 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。
投资策略	本基金采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。
业绩比较基准	上证中小盘指数
风险收益特征	本基金属于股票型基金中的指数型基金，股票最低仓位为 95%，并采用完全复制的被动式投资策略：一方面，相对于混合基金、债券基金与货币市场基金而言，其风险和收益较高，属于股票型基金中高风险、高收益的产品；另一方面，相对于采用抽样复制的指数型基金而言，其风险和收益特征将更能与标的指数保持一致。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华泰柏瑞基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈晖	许俊
	联系电话	021-38601777	010-66594319
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	fcid@bankofchina.com

客户服务电话	400-888-0001	95566
传真	021-38601799	010-66594942
注册地址	上海市浦东新区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址	上海市浦东新区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	200135	100818
法定代表人	贾波	刘连舸

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.huatai-pb.com
基金年度报告备置地点	上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京西城区金融大街 27 号投资广场 22-23 层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2020 年	2019 年	2018 年
本期已实现收益	7,865,985.45	-524,019.92	882,428.21
本期利润	9,356,510.16	20,335,902.90	-18,388,334.49
加权平均基金份额本期利润	0.8153	1.0643	-1.0449
本期加权平均净值利润率	18.38%	27.20%	-27.47%
本期基金份额净值增长率	28.94%	32.32%	-24.63%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
期末可供分配利润	7,730,554.86	11,513,288.42	-8,298,175.36
期末可供分配基金份额利润	1.8279	0.5987	-0.4431
期末基金资产净值	23,204,342.06	81,869,546.98	60,228,667.48
期末基金份额净值	5.4867	4.2576	3.2158
3.1.3 累计期末指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
基金份额累计净值增长率	51.50%	17.50%	-11.20%

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

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

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

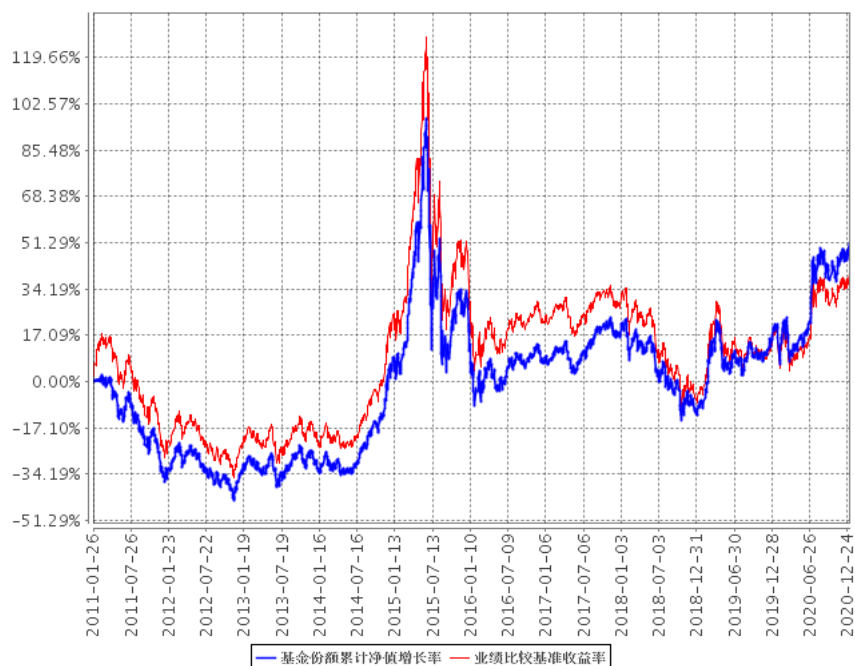
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	9.94%	1.03%	9.00%	1.02%	0.94%	0.01%
过去六个月	22.47%	1.35%	19.12%	1.35%	3.35%	0.00%
过去一年	28.94%	1.43%	20.88%	1.44%	8.06%	-0.01%
过去三年	28.61%	1.36%	8.79%	1.37%	19.82%	-0.01%
过去五年	17.44%	1.34%	-4.48%	1.35%	21.92%	-0.01%
自基金合同生效起至今	51.50%	1.55%	40.10%	1.56%	11.40%	-0.01%

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

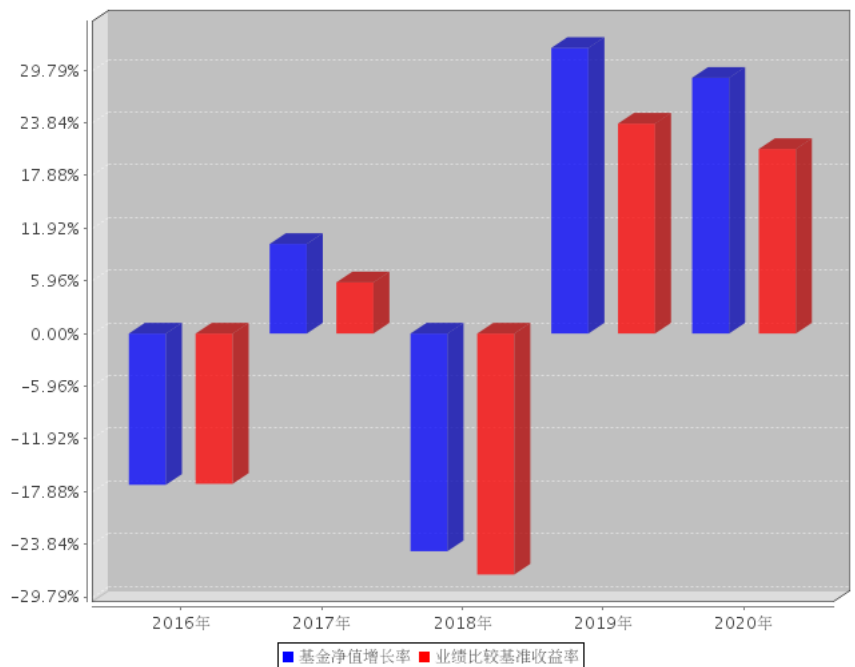
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：图示日期为 2011 年 1 月 26 日至 2020 年 12 月 31 日。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司。华泰柏瑞基金管理有限公司是经中国证监会批准，于 2004 年 11 月 18 日成立的合资基金管理公司，注册资本为 2 亿元人民币。目前的股东构成为华泰证券股份有限公司、柏瑞投资有限责任公司（原 AIGGIC）和苏州新区高新技术产业股份有限公司，出资比例分别为 49%、49% 和 2%。目前公司旗下管理华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金、华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金、上证红利交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金、华泰柏瑞货币市场证券投资基金、华泰柏瑞行业领先混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化先行混合型证券投资基金、华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金、上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金、华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金、华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金、华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金、华泰柏瑞丰汇债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金、华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金、华泰柏瑞交易型货币市场基金、华泰柏瑞激励动力灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化对冲稳健收益定期开放混合型发起式证券投资基金、华泰柏瑞天添宝货币市场基金、华泰柏瑞多策略灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞新经济沪港深灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞享利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化创优灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞生物医药灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞富利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞港股通量化灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞战略新

兴产业混合型证券投资基金、华泰柏瑞新金融地产灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数基金、华泰柏瑞医疗健康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债券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、华泰柏瑞品质优选混合型证券投资基金、华泰柏瑞景利混合型证券投资基金、华泰柏瑞优势领航混合型证券投资基金、华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞锦乾债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化创盈混合型证券投资基金、华泰柏瑞成长智选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞量化创享混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金。截至 2020 年 12 月 31 日，公司基金管理规模为 1622.89 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， 2000-2001 年任上海汽车集团 财务有限公司财务， 2001-2004 年任华安基金管理 有限公司高级基金核算 员，2004 年 7 月加入华泰柏 瑞基金管理有限公司，历任 基金事务部总监、上证红利 ETF 基金经理助理。2009 年 6 月起任华泰柏瑞（原友邦 华泰）上证红利交易型开放 式指数基金基金经理。2010 年 10 月起担任指数投资部

				<p>副总监。2011年1月至2020年2月任华泰柏瑞上证中小盘ETF基金、华泰柏瑞上证中小盘ETF联接基金基金经理。2012年5月起兼任华泰柏瑞沪深300ETF基金、华泰柏瑞沪深300ETF联接基金基金经理。2015年2月起任指数投资部总监。2015年5月起任华泰柏瑞中证500ETF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。2020年9月起任华泰柏瑞上证科创板50成份交</p>
--	--	--	--	---

					易型开放式指数证券投资基金的基金经理。
李茜	本基金的基金经理	2019年11月5日	-	5年	曾任职于上海市虹口区金融服务局。2015年3月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任指数投资部助理研究员、研究员。2019年11月起任上证红利交易型开放式指数证券投资基金、上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2020年12月起任华泰柏瑞中证港股通50交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。

注：证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。任职日期和离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 公平交易制度和控制方法

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

5 日) 下进行分析, 综合判断各基金之间是否存在不公平交易或利益输送的可能, 确保公平交易的实施。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内, 公司将投资管理职能和交易执行职能完全隔离, 实行集中交易制度, 由交易部为公募基金、专户理财和海外投资等业务统一交易服务, 为公平交易的实施提供了较好的保障。

目前公司公募基金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。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内, 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 年市场以结构性机会为主。其中休闲服务、电气设备、食品饮料、国防军工、医药生物等行业录得正收益, 期间休闲服务行业指数上涨达 99.38%, 电气设备行业指数上涨达 94.71%, 食品饮料行业上涨 84.97%。整体来看, 沪深 300、中证 500、中证 1000 和创业板涨跌幅分别为 27.21%、20.87%、19.39% 和 64.96%。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 成长指数分别涨幅为 0.19% 和 43.96%, 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 7.989%，日均绝对跟踪偏离度为 0.045%，期间日跟踪误差为 0.065%，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 5.4867 元；本报告期基金份额净值增长率为 28.94%，业绩比较基准收益率为 20.88%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2021 年，经济随着疫苗逐步落地继续复苏，全球开始进入后疫情时代。货币政策方面，货币政策会回归常态化，边际上有所收紧。但是鉴于通胀、房价等指标尚处于温和回升状态，货币政策仍可能属于稳健偏宽松的水平。企业盈利方面，中国增长率先恢复至疫情前水平。由于低基数效应，受企业资本开支增长、消费继续恢复等驱动，盈利同比的高增速可能进一步提振风险偏好。企业盈利将是核心驱动力，对股价形成有力支撑。2020 年刺激政策的滞后效应，供给企稳、疫情影响消退后引致的需求回暖以及海外经济的共振复苏是宏观层面驱动中国股票盈利增长的重要因素。

2020 年初，突如其来的疫情中断了“再库存”交易，风险资产波动率骤升，全球主要市场股指、部分商品价格都有所调整，特别是原油价格大幅下跌，黄金受益于避险情绪持续上涨。债券利率则在趋势下行，信用利差有所扩大。面对突如其来的新冠疫情，全球进一步进入量化宽松阶段，中国央行也加大了逆周期调节政策力度，存款准备金率、OMO、MLF、LPR 利率都有明显下降，货币政策的宽松也成为稳定资产价格的重要因素。随着疫情对经济活动的影响逐渐减弱，总需求企稳回升、增长复苏力度增强，货币政策会向正常化回归，大类资产配置由流动性和增长预期双驱动过渡到以增长为主导。

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

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2020 年度，本基金管理人在为基金份额持有人谋求最大利益的同时，始终将合规运作、防范风险工作放在各项工作的首位。依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。公司监察部门按照规定的权限和程序，通过实时监控、现场检查、重点抽查和人员询问等方法，独立地开展基金运作和公司管理的合规性稽核，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向董事长和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

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

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

(2) 开展定期和专项监察稽核工作，确保各项业务活动的合法合规

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

(3) 促进公司各项内部管理制度的完善

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

(4) 通过各种合规培训提高员工合规意识

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

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，基金管理人严格执行基金估值控制流程，定期评估估值技术的合理性，每日将估值结果报托管银行复核后对外披露。参与估值流程的人员包括负责运营的副总经理以及投资研究、风险控制、金融工程和基金事务部门负责人，基金经理不参与估值流程。参与人员的相关工作经历均在五年以上。参与各方之间不存在任何重大利益冲突。已采用的估值技术相关参数或定价服务均来自独立第三方。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定，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。本报告期内，本基金未进行利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

截止本报告期末，因赎回等原因，本基金存在连续 60 个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形，但无基金份额持有人数量低于 200 人的情形。

本基金管理人已于 2020 年 9 月 9 日将《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基金资产净值低于五千万元的报告》上报中国证监会。

§ 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”）在上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2021)第 22554 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“华泰柏瑞上证中小盘 ETF 基金”)的财务报表,包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表,2020 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了华泰柏瑞上证中小盘 ETF 基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于华泰柏瑞上证中小盘 ETF 基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
管理层和治理层对财务报表的	华泰柏瑞上证中小盘 ETF 基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有

<p>责任</p>	<p>限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估华泰柏瑞上证中小盘 ETF 基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算华泰柏瑞上证中小盘 ETF 基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督华泰柏瑞上证中小盘 ETF 基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p>

	<p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对华泰柏瑞上证中小盘 ETF 基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致华泰柏瑞上证中小盘 ETF 基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	张炯 朱宏宇
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2021 年 3 月 29 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	602,425.68	1,656,768.67
结算备付金		838.21	17,631.38
存出保证金		76.92	2,682.49
交易性金融资产	7.4.7.2	22,743,755.12	80,440,760.22
其中：股票投资		22,699,755.12	80,440,760.22
基金投资		-	-
债券投资		44,000.00	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		3,822.29	-
应收利息	7.4.7.5	53.99	379.47
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		23,350,972.21	82,118,222.23
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		10,324.31	33,474.84
应付托管费		2,064.87	6,694.97
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	7,247.66	18,505.44
应交税费		0.20	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	126,993.11	190,000.00
负债合计		146,630.15	248,675.25
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	15,473,787.20	70,356,258.56
未分配利润	7.4.7.10	7,730,554.86	11,513,288.42
所有者权益合计		23,204,342.06	81,869,546.98
负债和所有者权益总计		23,350,972.21	82,118,222.23

注：报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额净值 5.4867 元，基金份额总额 4,229,161.00 份。

7.2 利润表

会计主体：上证中小盘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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
一、收入		9,924,686.44	21,271,645.77
1.利息收入		5,627.49	9,672.46
其中：存款利息收入	7.4.7.11	5,602.52	9,664.33
债券利息收入		24.97	8.13
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）		8,417,927.12	409,237.00
其中：股票投资收益	7.4.7.12	7,636,491.27	-845,816.23
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	26,816.74	4,326.07
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	754,619.11	1,250,727.16
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	1,490,524.71	20,859,922.82
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	10,607.12	-7,186.51

减：二、费用		568,176.28	935,742.87
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	257,444.93	378,624.63
2. 托管费	7.4.10.2.2	51,488.95	75,724.91
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	58,409.79	79,691.87
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.06	-
7. 其他费用	7.4.7.20	200,832.55	401,701.46
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		9,356,510.16	20,335,902.90
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		9,356,510.16	20,335,902.90

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：上证中小盘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12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	70,356,258.56	11,513,288.42	81,869,546.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	9,356,510.16	9,356,510.16
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）	-54,882,471.36	-13,139,243.72	-68,021,715.08
其中：1.基金申购款	18,294,157.13	5,566,115.65	23,860,272.78
2.基金赎回款	-73,176,628.49	-18,705,359.37	-91,881,987.86
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）	15,473,787.20	7,730,554.86	23,204,342.06

项目	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	68,526,842.84	-8,298,175.36	60,228,667.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	20,335,902.90	20,335,902.90
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	1,829,415.72	-524,439.12	1,304,976.60
其中：1. 基金申购款	82,323,707.06	6,901,816.94	89,225,524.00
2. 基金赎回款	-80,494,291.34	-7,426,256.06	-87,920,547.40
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)	70,356,258.56	11,513,288.42	81,869,546.98

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 韩勇 _____	_____ 房伟力 _____	_____ 赵景云 _____
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

上证中小盘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《上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币348,418,327.00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(2011)第022号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金基金合同》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 348,427,447.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 9,120.00 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《上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《上证中小盘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 2011 年 3 月 11 日进行了基金份额折算，折算比例为 0.27331199，并于 2011 年 3 月 14 日进行了变更登记。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)上证债字[2011]第 55 号文审核同意，本基金 95,229,161.00 份基金份额于 2011 年 3 月 28 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《上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的标的指数为中证指数有限公司编制并发布的上证中小盘指数，主要投资范围为标的指数成份股和备选成份股，该部分资产比例不低于基金资产净值的 95%；同时为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于新股、债券、非成份股、存托凭证、股指期货及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，该部分资产比例不高于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为上证中小盘指数。

华泰柏瑞基金管理有限公司以本基金为目标 ETF，于 2011 年 1 月 26 日募集成立了华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“上证中小盘 ETF 联接基金”)。上证中小盘 ETF 联接基金为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

本财务报表由本基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于 2021 年 3 月 29 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，开放式基金在基金合同生效后，连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5,000 万元情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。于 2020 年 12 月 31 日，本基金出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5,000 万元的情形，本基金的基金管理人已向中国证监会报告并在评估后续处理方案，故本财务报表仍以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

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

(2) 金融负债的分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资

产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。基金管理人每季度定期对本基金相对标的指数的超额收益率进行一次评估，基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率达到 1%以上，方可进行收益分配。本基金的收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使还原后基金份额净值低于面值。基金收益分配比例为收益评价日符合上述分红条件的基金超额收益的 100%，基金收益分配每年至多 4 次。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

性折扣后的价值进行估值。

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

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。资管

产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

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

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

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
活期存款	602,425.68	1,656,768.67
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:	602,425.68	1,656,768.67

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	20,239,774.17	22,699,755.12	2,459,980.95
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	44,000.00	44,000.00
	银行间市场	-	-
	合计	44,000.00	44,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	20,283,774.17	22,743,755.12	2,459,980.95
项目	上年度末 2019 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	79,471,303.98	80,440,760.22	969,456.24
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	79,471,303.98	80,440,760.22	969,456.24

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
应收活期存款利息	50.06	369.46
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	0.44	8.69
应收债券利息	3.49	-
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	-	1.32
合计	53.99	379.47

7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
交易所市场应付交易费用	7,247.66	18,505.44
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	7,247.66	18,505.44

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	125,000.00	140,000.00
应付指数使用费	1,993.11	50,000.00
合计	126,993.11	190,000.00

7.4.7.9 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12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	19,229,161.00	70,356,258.56
本期申购	5,000,000.00	18,294,157.13
本期赎回(以“-”号填列)	-20,000,000.00	-73,176,628.49
- 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	4,229,161.00	15,473,787.20

注：投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购赎回单位的整数倍。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	32,836,721.93	-21,323,433.51	11,513,288.42
本期利润	7,865,985.45	1,490,524.71	9,356,510.16
本期基金份额交易产生的变动数	-28,863,844.84	15,724,601.12	-13,139,243.72
其中：基金申购款	10,762,025.90	-5,195,910.25	5,566,115.65
基金赎回款	-39,625,870.74	20,920,511.37	-18,705,359.37
本期已分配利润	-	-	-
本期末	11,838,862.54	-4,108,307.68	7,730,554.86

7.4.7.11 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12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
活期存款利息收入	5,331.83	9,377.58
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	249.06	267.34
其他	21.63	19.41
合计	5,602.52	9,664.33

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	4,007,030.82	3,185,875.27
股票投资收益——赎回差价收入	3,629,460.45	-4,031,691.50
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	7,636,491.27	-845,816.23

7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
卖出股票成交总额	18,124,347.34	22,223,626.96
减：卖出股票成本总额	14,117,316.52	19,037,751.69
买卖股票差价收入	4,007,030.82	3,185,875.27

7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至 2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019 年12月31日
赎回基金份额对价总额	91,881,987.86	87,920,547.40
减：现金支付赎回款总额	2,394,602.86	-2,320,278.60
减：赎回股票成本总额	85,857,924.55	94,272,517.50
赎回差价收入	3,629,460.45	-4,031,691.50

7.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无股票申购差价收入。

7.4.7.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月 31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	26,816.74	4,326.07
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	26,816.74	4,326.07

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月 31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	169,838.70	62,334.20
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	143,000.00	58,000.00

减：应收利息总额	21.96	8.13
买卖债券差价收入	26,816.74	4,326.07

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期无债券赎回差价收入。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无债券申购差价收入。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期末无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

7.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12 月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12 月31日
----	---------------------------------	--------------------------------------

股票投资产生的股利收益	754,619.11	1,250,727.16
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	754,619.11	1,250,727.16

7.4.7.17 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12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31日
1. 交易性金融资产	1,490,524.71	20,859,922.82
——股票投资	1,490,524.71	20,859,922.82
——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	-	-
减：应税金融商品公允价值 变动产生的预估增值税	-	-
合计	1,490,524.71	20,859,922.82

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12 月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	10,607.12	-7,186.51
合计	10,607.12	-7,186.51

注：替代损益是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申购(赎回)本基金时，补入(卖出)被替代股票的实际买入成本(实际卖出金额)与申购(赎回)确认日估值的差额或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购(赎回)确认日估值的差额。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
交易所市场交易费用	58,409.79	79,691.87
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	58,409.79	79,691.87

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
审计费用	45,000.00	60,000.00
信息披露费	80,000.00	80,000.00
证券出借违约金	-	-
银行划款手续费	1,710.00	1,701.46
指数使用费	74,122.55	200,000.00
上市费	-	60,000.00
合计	200,832.55	401,701.46

7.4.7.21 分部报告

注：本基金本报告期无分部报告。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

注：截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

注：截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华泰柏瑞基金管理有限公司（“华泰柏瑞基金”）	基金管理人、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人
华泰证券股份有限公司（“华泰证券”）	基金管理人的股东、申购赎回代理券商、基金销售机构
PineBridgeInvestmentLLC	基金管理人的股东
苏州新区高新技术产业股份有限公司	基金管理人的股东
华泰联合证券有限责任公司（“华泰联合证券”）	基金管理人的股东华泰证券的控股子公司
柏瑞爱建资产管理(上海)有限公司	基金管理人的控股子公司
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（“华泰柏瑞上证中小盘 ETF 联接基金”）	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

注：本报告期及上一年度可比期间本基金与关联方未进行股票交易。

7.4.10.1.2 权证交易

注：本报告期及上一年度可比期间本基金与关联方未进行权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

注：本报告期本基金无应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	257,444.93	378,624.63
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：支付基金管理人华泰柏瑞基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	51,488.95	75,724.91

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.10% / 当年天数

7.4.10.2.3 销售服务费

注：本期和上年可比期间均无数据。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本期未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：无。

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

注：无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期及上年度，基金管理人未投资本基金。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2020年12月31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	1,673,000.00	39.5587%	14,574,000.00	75.7911%

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	602,425.68	5,331.83	1,656,768.67	9,377.58

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2020年1月1日至2020年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：份）	总金额
华泰证券	600008	首创股份	网上配售	3,924	8,985.96
上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：份）	总金额
华泰证券	-	-	-	-	-

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

注：本基金本报告期无其他需要说明的关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2020 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
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：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113044	大秦转债	2020 年 12 月 14 日	2021 年 1 月 15 日	配债未上市	100.00	100.00	430	43,000.00	43,000.00	-
113614	健 20 转债	2020 年 12 月 17 日	2021 年 1 月 18 日	配债未上市	100.00	100.00	10	1,000.00	1,000.00	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为被动式指数基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基

金，主要投资于标的指数成份股和备选成份股。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，力争实现保持基金净值增长率与标的指数增长率间的高度正相关，并保持跟踪误差在合同约定的范围内。

本基金的基金管理人建立的风险管理体系由“组织、制度、流程和报告”等四个方面构成。组织是指公司的风险管理组织架构包括董事会下设的风险管理与审计委员会、公司管理层的风险控制委员会、风险管理部和合规法律部以及公司各业务部门，董事会对建立基金风险管理内部控制系统和维持其有效性承担最终责任；制度是指风险管理相关的规章制度，是对组织职能及其工作流程等的具体规定；流程是风险管理的工作流程，它详细规定了各部门之间风险管理工作的内容和程序；报告是对流程的必要反映和记录，既是风险管理工作的重要环节，也是对风险管理工作的总结和披露。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现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。

7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

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

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
AAA	43,000.00	0.00
AAA 以下	1,000.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	44,000.00	0.00

注：债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

于 2020 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 0.19%。

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

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

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020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	602,425.68	-	-	-	-	-	602,425.68
结算备付金	838.21	-	-	-	-	-	838.21
存出保证金	76.92	-	-	-	-	-	76.92
交易性金融资产	-	-	-	-	44,000.00	22,699,755.12	22,743,755.12
应收证券清算款	-	-	-	-	-	3,822.29	3,822.29
应收利息	-	-	-	-	-	53.99	53.99
资产总计	603,340.81	-	-	-	44,000.00	22,703,631.40	23,350,972.21
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	10,324.31	10,324.31
应付托管费	-	-	-	-	-	2,064.87	2,064.87
应付交易费用	-	-	-	-	-	7,247.66	7,247.66
应交税费	-	-	-	-	-	0.20	0.20

其他负债	-	-	-	-	-	126,993.11	126,993.11
负债总计	-	-	-	-	-	146,630.15	146,630.15
利率敏感度缺口	603,340.81	-	-	-	44,000.00	22,557,001.25	23,204,342.06
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	1,656,768.67	-	-	-	-	-	1,656,768.67
结算备付金	17,631.38	-	-	-	-	-	17,631.38
存出保证金	2,682.49	-	-	-	-	-	2,682.49
交易性金融资产	-	-	-	-	-	80,440,760.22	80,440,760.22
应收利息	-	-	-	-	-	379.47	379.47
资产总计	1,677,082.54	-	-	-	-	80,441,139.69	82,118,222.23
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	33,474.84	33,474.84
应付托管费	-	-	-	-	-	6,694.97	6,694.97
应付交易费用	-	-	-	-	-	18,505.44	18,505.44
其他负债	-	-	-	-	-	190,000.00	190,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	248,675.25	248,675.25
利率敏感度缺口	1,677,082.54	-	-	-	-	80,192,464.44	81,869,546.98

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.19% (2019 年 12 月 31 日：无)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2019 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金为被动式指数基金，原则上采用完全复制的方法，按照个股在标的指数中的基准权重构建投资组合。基金所构建的指数化投资组合将根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。同时，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况、新股增发等变化，对基金投资组合进行相应调整，以保证基金份额净值增长率与标的指数间的高度正相关和跟踪误差最小化。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金主要投资于指数的成份股及其备选成份股，其投资比例不低于基金资产净值的 95%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 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	22,699,755.12	97.83	80,440,760.22	98.25
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	-	-	-	-
合计	22,699,755.12	97.83	80,440,760.22	98.25

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除上证中小盘指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2020 年 12 月 31 日）	上年度末（2019 年 12 月 31 日）
	上证中小盘指数上升 5%	1,154,597.17	3,282,215.25

	上证中小盘指数下降 5%	-1,154,597.17	-3,282,215.25
--	--------------	---------------	---------------

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 基金申购款

于 2020 年度，本基金申购基金份额的对价总额为 23,860,272.78 元(2019 年度：89,225,524.00 元)，其中包括以股票支付的申购款 22,533,576.00 元和以现金支付的申购款 1,326,696.78 元(2019 年度：其中包括以股票支付的申购款 91,041,386.00 元和以现金支付的申购款-1,815,862.00 元)。

(2) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 22,699,755.12 元，属于第二层次的余额为 44,000.00 元，无属于第三层次的余额(2019 年 12 月 31 日：第一层次 79,629,473.77 元，第二层次 811,286.45 元，无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易

不活跃)、或属于非公开发售等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2020 年 12 月 31 日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2019 年 12 月 31 日:同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(3) 除基金申购款和公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	22,699,755.12	97.21
	其中：股票	22,699,755.12	97.21
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	44,000.00	0.19
	其中：债券	44,000.00	0.19
	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	603,263.89	2.58
8	其他各项资产	3,953.20	0.02
9	合计	23,350,972.21	100.00

注：股票投资包含可退替代款估值增（减）值

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	89,988.70	0.39
B	采矿业	1,190,730.24	5.13
C	制造业	11,669,016.24	50.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,098,730.17	4.74
E	建筑业	663,305.18	2.86
F	批发和零售业	858,534.29	3.70
G	交通运输、仓储和邮政业	1,032,773.47	4.45
H	住宿和餐饮业	85,482.00	0.37
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,021,257.73	4.40
J	金融业	3,679,931.82	15.86
K	房地产业	645,823.92	2.78
L	租赁和商务服务业	115,286.13	0.50
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	84,903.28	0.37

0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	17,036.80	0.07
Q	卫生和社会工作	323,712.00	1.40
R	文化、体育和娱乐业	87,359.06	0.38
S	综合	35,884.09	0.15
	合计	22,699,755.12	97.83

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600900	长江电力	26,942	516,208.72	2.22
2	601899	紫金矿业	40,832	379,329.28	1.63
3	601328	交通银行	81,300	364,224.00	1.57
4	600438	通威股份	8,600	330,584.00	1.42
5	600809	山西汾酒	840	315,243.60	1.36
6	600436	片仔癀	994	265,904.94	1.15
7	600999	招商证券	11,060	258,140.40	1.11
8	601229	上海银行	29,500	231,280.00	1.00
9	600763	通策医疗	800	221,216.00	0.95
10	601169	北京银行	43,900	212,476.00	0.92
11	600893	航发动力	3,500	207,725.00	0.90
12	600660	福耀玻璃	4,200	201,810.00	0.87
13	600346	恒力石化	7,060	197,468.20	0.85
14	601766	中国中车	36,000	191,160.00	0.82
15	600406	国电南瑞	6,900	183,333.00	0.79
16	601919	中远海控	14,400	175,824.00	0.76
17	603799	华友钴业	2,156	170,970.80	0.74
18	600019	宝钢股份	26,400	157,080.00	0.68
19	600741	华域汽车	5,317	153,235.94	0.66
20	601390	中国中铁	28,800	151,776.00	0.65
21	600958	东方证券	12,600	146,538.00	0.63
22	600584	长电科技	3,411	145,206.27	0.63
23	601377	兴业证券	16,600	144,088.00	0.62
24	601009	南京银行	17,829	144,058.32	0.62
25	601633	长城汽车	3,633	137,363.73	0.59

26	603993	洛阳钼业	20,900	130,625.00	0.56
27	600426	华鲁恒升	3,477	129,692.10	0.56
28	600176	中国巨石	6,393	127,604.28	0.55
29	601901	方正证券	12,200	126,514.00	0.55
30	601939	建设银行	19,900	124,972.00	0.54
31	688008	澜起科技	1,500	124,320.00	0.54
32	601877	正泰电器	3,173	124,254.68	0.54
33	600926	杭州银行	8,160	121,747.20	0.52
34	601799	星宇股份	600	120,300.00	0.52
35	600109	国金证券	7,200	117,144.00	0.50
36	603019	中科曙光	3,400	116,382.00	0.50
37	601100	恒立液压	1,020	115,260.00	0.50
38	601006	大秦铁路	17,700	114,342.00	0.49
39	600015	华夏银行	18,260	114,125.00	0.49
40	601989	中国重工	26,900	112,711.00	0.49
41	600089	特变电工	11,073	112,390.95	0.48
42	688012	中微公司	710	111,888.90	0.48
43	600872	中炬高新	1,676	111,705.40	0.48
44	601225	陕西煤业	11,900	111,146.00	0.48
45	600079	人福医药	3,200	108,416.00	0.47
46	600600	青岛啤酒	1,085	107,849.00	0.46
47	601788	光大证券	5,800	107,416.00	0.46
48	600352	浙江龙盛	7,817	106,467.54	0.46
49	603899	晨光文具	1,200	106,272.00	0.46
50	603369	今世缘	1,850	106,153.00	0.46
51	603882	金域医学	800	102,496.00	0.44
52	600183	生益科技	3,468	97,658.88	0.42
53	600132	重庆啤酒	800	95,192.00	0.41
54	601108	财通证券	7,500	94,875.00	0.41
55	601360	三六零	6,000	94,260.00	0.41
56	601155	新城控股	2,700	94,041.00	0.41
57	600760	中航沈飞	1,200	93,816.00	0.40
58	601878	浙商证券	6,100	93,330.00	0.40
59	600143	金发科技	5,400	92,556.00	0.40
60	600383	金地集团	6,791	91,678.50	0.40
61	600486	扬农化工	693	91,476.00	0.39
62	601985	中国核电	18,500	91,020.00	0.39
63	601555	东吴证券	9,226	90,968.36	0.39
64	600739	辽宁成大	3,733	90,786.56	0.39

65	600885	宏发股份	1,640	88,920.80	0.38
66	601669	中国电建	22,600	87,688.00	0.38
67	600316	洪都航空	1,516	86,214.92	0.37
68	601233	桐昆股份	4,180	86,066.20	0.37
69	600111	北方稀土	6,500	85,085.00	0.37
70	600521	华海药业	2,488	84,119.28	0.36
71	601099	太平洋	20,112	82,056.96	0.35
72	688002	睿创微纳	738	81,918.00	0.35
73	600298	安琪酵母	1,600	81,712.00	0.35
74	601933	永辉超市	11,302	81,148.36	0.35
75	688036	传音控股	531	80,786.34	0.35
76	600529	山东药玻	1,600	80,240.00	0.35
77	600522	中天科技	7,330	79,457.20	0.34
78	600161	天坛生物	1,904	79,396.80	0.34
79	600010	包钢股份	67,580	79,068.60	0.34
80	600029	南方航空	13,100	78,076.00	0.34
81	603517	绝味食品	1,000	77,540.00	0.33
82	603345	安井食品	400	77,148.00	0.33
83	603806	福斯特	900	76,860.00	0.33
84	601800	中国交建	10,500	76,230.00	0.33
85	603589	口子窖	1,100	75,790.00	0.33
86	600201	生物股份	3,427	71,590.03	0.31
87	600886	国投电力	8,281	71,547.84	0.31
88	600536	中国软件	902	71,041.52	0.31
89	601168	西部矿业	5,728	70,912.64	0.31
90	603338	浙江鼎力	700	70,833.00	0.31
91	600061	国投资本	5,100	70,533.00	0.30
92	600362	江西铜业	3,517	70,164.15	0.30
93	601600	中国铝业	19,260	69,913.80	0.30
94	600705	中航资本	15,924	69,747.12	0.30
95	601838	成都银行	6,422	68,522.74	0.30
96	600066	宇通客车	4,000	67,680.00	0.29
97	603833	欧派家居	500	67,250.00	0.29
98	600340	华夏幸福	5,200	67,236.00	0.29
99	600219	南山铝业	21,245	67,134.20	0.29
100	601607	上海医药	3,485	66,912.00	0.29
101	603939	益丰药房	740	66,740.60	0.29
102	601111	中国国航	8,900	66,661.00	0.29
103	600862	中航高科	2,200	66,220.00	0.29

104	603267	鸿远电子	500	64,380.00	0.28
105	603613	国联股份	500	64,040.00	0.28
106	600606	绿地控股	10,900	63,547.00	0.27
107	601997	贵阳银行	7,980	63,441.00	0.27
108	600699	均胜电子	2,480	62,892.80	0.27
109	600559	老白干酒	1,980	62,330.40	0.27
110	600115	东方航空	13,291	62,201.88	0.27
111	600884	杉杉股份	3,430	61,842.90	0.27
112	601636	旗滨集团	4,800	61,440.00	0.26
113	603816	顾家家居	860	60,638.60	0.26
114	601021	春秋航空	1,092	60,529.56	0.26
115	601128	常熟银行	8,200	60,516.00	0.26
116	601162	天风证券	9,900	60,390.00	0.26
117	600038	中直股份	961	60,264.31	0.26
118	600460	士兰微	2,400	60,000.00	0.26
119	600988	赤峰黄金	3,300	59,103.00	0.25
120	600563	法拉电子	546	58,722.30	0.25
121	600011	华能国际	13,100	58,688.00	0.25
122	601727	上海电气	10,800	58,320.00	0.25
123	600779	水井坊	700	58,114.00	0.25
124	603658	安图生物	400	58,072.00	0.25
125	600845	宝信软件	840	57,943.20	0.25
126	603678	火炬电子	800	57,840.00	0.25
127	601618	中国中冶	21,185	57,835.05	0.25
128	601689	拓普集团	1,500	57,645.00	0.25
129	600487	亨通光电	4,120	57,638.80	0.25
130	600867	通化东宝	4,304	57,587.52	0.25
131	600498	烽火通信	2,388	57,503.04	0.25
132	600118	中国卫星	1,786	57,473.48	0.25
133	601966	玲珑轮胎	1,600	56,272.00	0.24
134	600369	西南证券	10,400	55,952.00	0.24
135	600637	东方明珠	6,160	55,070.40	0.24
136	601990	南京证券	4,480	54,969.60	0.24
137	603233	大参林	700	54,845.00	0.24
138	601198	东兴证券	4,100	54,612.00	0.24
139	600068	葛洲坝	8,193	53,909.94	0.23
140	600418	江淮汽车	4,400	53,812.00	0.23
141	601881	中国银河	4,300	53,793.00	0.23
142	688099	晶晨股份	682	53,693.86	0.23

143	600221	海航控股	34,200	51,984.00	0.22
144	600754	锦江酒店	1,000	51,530.00	0.22
145	600511	国药股份	1,042	51,381.02	0.22
146	600372	中航电子	2,600	51,090.00	0.22
147	600489	中金黄金	5,762	50,763.22	0.22
148	600332	白云山	1,713	50,105.25	0.22
149	601216	君正集团	10,088	49,935.60	0.22
150	600100	同方股份	8,000	49,600.00	0.21
151	600004	白云机场	3,510	49,596.30	0.21
152	600909	华安证券	6,100	48,800.00	0.21
153	600415	小商品城	8,829	48,647.79	0.21
154	600879	航天电子	6,500	48,620.00	0.21
155	600233	圆通速递	4,200	48,300.00	0.21
156	600516	方大炭素	6,831	48,295.17	0.21
157	600166	福田汽车	15,292	48,169.80	0.21
158	600155	华创阳安	3,600	47,484.00	0.20
159	601658	邮储银行	9,900	47,322.00	0.20
160	603866	桃李面包	800	47,280.00	0.20
161	600390	五矿资本	6,760	47,184.80	0.20
162	688088	虹软科技	674	47,126.08	0.20
163	600711	盛屯矿业	5,131	46,999.96	0.20
164	600655	豫园股份	5,253	46,699.17	0.20
165	600598	北大荒	2,400	46,200.00	0.20
166	600380	健康元	3,288	45,736.08	0.20
167	601615	明阳智能	2,400	45,552.00	0.20
168	603005	晶方科技	700	45,052.00	0.19
169	688009	中国通号	7,688	45,051.68	0.19
170	600674	川投能源	4,443	44,652.15	0.19
171	600895	张江高科	2,600	44,304.00	0.19
172	600801	华新水泥	2,120	43,735.60	0.19
173	600998	九州通	2,400	43,584.00	0.19
174	601117	中国化学	7,336	43,062.32	0.19
175	603456	九洲药业	1,200	42,960.00	0.19
176	600549	厦门钨业	2,540	42,799.00	0.18
177	600153	建发股份	5,200	42,692.00	0.18
178	600765	中航重机	1,694	42,350.00	0.18
179	600271	航天信息	3,306	41,655.60	0.18
180	603156	养元饮品	1,604	41,447.36	0.18
181	600535	天士力	2,800	41,412.00	0.18

182	603195	公牛集团	200	41,058.00	0.18
183	600580	卧龙电驱	2,608	40,684.80	0.18
184	600085	同仁堂	1,698	40,582.20	0.17
185	603858	步长制药	1,753	40,441.71	0.17
186	600305	恒顺醋业	1,820	40,294.80	0.17
187	600170	上海建工	13,211	39,765.11	0.17
188	600667	太极实业	4,200	39,690.00	0.17
189	600208	新湖中宝	12,789	39,645.90	0.17
190	601231	环旭电子	2,042	39,492.28	0.17
191	600323	瀚蓝环境	1,557	38,629.17	0.17
192	600297	广汇汽车	13,400	38,324.00	0.17
193	601717	郑煤机	3,500	38,255.00	0.16
194	600642	申能股份	7,281	38,006.82	0.16
195	600827	百联股份	2,600	37,960.00	0.16
196	601238	广汽集团	2,820	37,477.80	0.16
197	603236	移远通信	200	37,388.00	0.16
198	603027	千禾味业	1,000	37,380.00	0.16
199	600409	三友化工	3,634	37,248.50	0.16
200	600150	中国船舶	2,100	37,149.00	0.16
201	600008	首创股份	13,104	37,084.32	0.16
202	601018	宁波港	9,447	37,032.24	0.16
203	600497	驰宏锌锗	7,636	36,652.80	0.16
204	600621	华鑫股份	1,600	36,432.00	0.16
205	600641	万业企业	1,800	36,306.00	0.16
206	600482	中国动力	2,024	36,270.08	0.16
207	601456	国联证券	1,700	36,261.00	0.16
208	600392	盛和资源	4,035	35,871.15	0.15
209	603605	珀莱雅	200	35,600.00	0.15
210	601866	中远海发	11,833	35,144.01	0.15
211	600515	海航基础	5,200	35,100.00	0.15
212	600315	上海家化	1,000	34,730.00	0.15
213	600737	中粮糖业	3,581	34,664.08	0.15
214	603087	甘李药业	261	34,509.42	0.15
215	601992	金隅集团	11,618	34,505.46	0.15
216	600859	王府井	1,056	34,404.48	0.15
217	600820	隧道股份	6,284	33,996.44	0.15
218	600256	广汇能源	12,007	33,979.81	0.15
219	600258	首旅酒店	1,600	33,952.00	0.15
220	601872	招商轮船	6,000	33,900.00	0.15

221	603712	七一二	800	33,320.00	0.14
222	601519	大智慧	3,200	33,216.00	0.14
223	600160	巨化股份	4,077	33,064.47	0.14
224	600875	东方电气	3,300	32,901.00	0.14
225	600027	华电国际	9,628	32,735.20	0.14
226	600567	山鹰国际	10,767	32,516.34	0.14
227	600811	东方集团	8,840	32,266.00	0.14
228	600236	桂冠电力	7,217	32,187.82	0.14
229	600728	佳都科技	4,228	32,090.52	0.14
230	600839	四川长虹	11,036	32,004.40	0.14
231	603707	健友股份	900	31,617.00	0.14
232	600325	华发股份	5,072	31,497.12	0.14
233	601916	浙商银行	7,700	31,416.00	0.14
234	603883	老百姓	500	31,415.00	0.14
235	600435	北方导航	3,474	31,266.00	0.13
236	600967	内蒙一机	2,540	30,886.40	0.13
237	600110	诺德股份	3,339	30,885.75	0.13
238	600273	嘉化能源	3,300	30,492.00	0.13
239	600597	光明乳业	1,869	30,389.94	0.13
240	600060	海信视像	2,627	30,157.96	0.13
241	600864	哈投股份	3,546	30,105.54	0.13
242	600446	金证股份	1,853	30,037.13	0.13
243	600260	凯乐科技	2,749	29,964.10	0.13
244	600282	南钢股份	9,600	29,952.00	0.13
245	600881	亚泰集团	9,655	29,930.50	0.13
246	600977	中国电影	2,400	29,904.00	0.13
247	600583	海油工程	6,569	29,494.81	0.13
248	600572	康恩贝	6,212	29,258.52	0.13
249	600989	宝丰能源	2,500	29,250.00	0.13
250	600755	厦门国贸	4,373	29,211.64	0.13
251	600410	华胜天成	3,280	29,060.80	0.13
252	600267	海正药业	1,753	28,977.09	0.12
253	601375	中原证券	4,124	28,950.48	0.12
254	603000	人民网	1,700	28,730.00	0.12
255	600804	鹏博士	4,262	28,640.64	0.12
256	601179	中国西电	6,200	28,582.00	0.12
257	600151	航天机电	3,300	28,545.00	0.12
258	600216	浙江医药	2,089	28,410.40	0.12
259	601222	林洋能源	3,575	28,314.00	0.12

260	603927	中科软	700	28,063.00	0.12
261	603198	迎驾贡酒	800	27,920.00	0.12
262	600026	中远海能	4,145	27,688.60	0.12
263	601898	中煤能源	6,166	27,438.70	0.12
264	601698	中国卫通	1,500	27,210.00	0.12
265	600718	东软集团	2,600	27,066.00	0.12
266	600188	兖州煤业	2,676	26,947.32	0.12
267	600211	西藏药业	400	26,912.00	0.12
268	600908	无锡银行	4,400	26,752.00	0.12
269	600064	南京高科	2,600	26,702.00	0.12
270	603228	景旺电子	872	26,290.80	0.11
271	601975	招商南油	10,300	25,853.00	0.11
272	600039	四川路桥	5,704	25,725.04	0.11
273	600812	华北制药	2,500	25,725.00	0.11
274	600685	中船防务	941	25,011.78	0.11
275	600025	华能水电	5,600	24,976.00	0.11
276	600507	方大特钢	3,598	24,970.12	0.11
277	601696	中银证券	900	24,912.00	0.11
278	600490	鹏欣资源	5,348	24,707.76	0.11
279	603317	天味食品	300	24,672.00	0.11
280	600330	天通股份	2,437	24,662.44	0.11
281	601118	海南橡胶	5,100	24,582.00	0.11
282	601106	中国一重	8,200	24,518.00	0.11
283	601000	唐山港	9,869	24,475.12	0.11
284	600206	有研新材	1,822	24,341.92	0.10
285	600782	新钢股份	5,300	24,327.00	0.10
286	600120	浙江东方	4,070	24,297.90	0.10
287	600803	新奥股份	1,775	24,122.25	0.10
288	600797	浙大网新	3,462	24,095.52	0.10
289	603290	斯达半导	100	24,090.00	0.10
290	603596	伯特利	700	23,954.00	0.10
291	601865	福莱特	600	23,940.00	0.10
292	600970	中材国际	3,476	23,914.88	0.10
293	600185	格力地产	3,700	23,902.00	0.10
294	600635	大众公用	5,761	23,850.54	0.10
295	600171	上海贝岭	1,700	23,834.00	0.10
296	601699	潞安环能	3,661	23,796.50	0.10
297	600195	中牧股份	1,857	23,788.17	0.10
298	601952	苏垦农发	1,690	23,761.40	0.10

299	600682	南京新百	2,100	23,646.00	0.10
300	600056	中国医药	1,642	23,529.86	0.10
301	600126	杭钢股份	4,400	23,276.00	0.10
302	600022	山东钢铁	16,205	23,173.15	0.10
303	600006	东风汽车	2,453	23,156.32	0.10
304	601808	中海油服	1,798	22,960.46	0.10
305	601098	中南传媒	2,402	22,891.06	0.10
306	600649	城投控股	4,200	22,806.00	0.10
307	601333	广深铁路	10,154	22,541.88	0.10
308	600777	新潮能源	14,600	22,484.00	0.10
309	600673	东阳光	4,454	22,403.62	0.10
310	603077	和邦生物	15,759	22,377.78	0.10
311	600789	鲁抗医药	2,380	22,300.60	0.10
312	600388	龙净环保	2,504	22,235.52	0.10
313	600500	中化国际	4,174	21,996.98	0.09
314	600057	厦门象屿	3,582	21,563.64	0.09
315	600391	航发科技	831	21,481.35	0.09
316	600633	浙数文化	2,611	21,253.54	0.09
317	600373	中文传媒	2,100	21,189.00	0.09
318	600729	重庆百货	732	21,154.80	0.09
319	600808	马钢股份	7,940	21,120.40	0.09
320	600259	广晟有色	700	21,119.00	0.09
321	601666	平煤股份	3,500	20,755.00	0.09
322	600466	蓝光发展	4,480	20,742.40	0.09
323	603885	吉祥航空	1,820	20,693.40	0.09
324	601608	中信重工	5,209	20,627.64	0.09
325	600073	上海梅林	2,002	20,600.58	0.09
326	603650	彤程新材	663	20,553.00	0.09
327	603323	苏农银行	4,140	20,534.40	0.09
328	600072	中船科技	1,500	20,475.00	0.09
329	600546	山煤国际	2,400	20,424.00	0.09
330	601016	节能风电	5,900	20,237.00	0.09
331	600348	阳泉煤业	3,598	20,184.78	0.09
332	603392	万泰生物	100	20,153.00	0.09
333	600835	上海机电	1,017	19,790.82	0.09
334	600993	马应龙	981	19,757.34	0.09
335	601718	际华集团	6,500	19,695.00	0.08
336	600062	华润双鹤	1,627	19,507.73	0.08
337	600740	山西焦化	3,310	19,495.90	0.08

338	603568	伟明环保	1,027	19,441.11	0.08
339	600771	广誉远	1,300	19,409.00	0.08
340	601077	渝农商行	4,300	19,350.00	0.08
341	600108	亚盛集团	5,191	19,206.70	0.08
342	601311	骆驼股份	2,050	19,167.50	0.08
343	603489	八方股份	100	19,030.00	0.08
344	600776	东方通信	1,600	18,960.00	0.08
345	600094	大名城	4,700	18,894.00	0.08
346	600138	中青旅	1,800	18,468.00	0.08
347	601200	上海环境	1,670	18,203.00	0.08
348	600901	江苏租赁	3,300	18,183.00	0.08
349	601958	金钼股份	2,916	18,108.36	0.08
350	600562	国睿科技	1,050	17,871.00	0.08
351	601880	大连港	9,243	17,838.99	0.08
352	600863	内蒙华电	6,927	17,802.39	0.08
353	600596	新安股份	1,639	17,783.15	0.08
354	601991	大唐发电	7,333	17,525.87	0.08
355	603515	欧普照明	580	17,521.80	0.08
356	601611	中国核建	2,400	17,472.00	0.08
357	601778	晶科科技	2,400	17,424.00	0.08
358	603260	合盛硅业	520	17,388.80	0.07
359	600312	平高电气	2,427	17,328.78	0.07
360	600566	济川药业	851	17,215.73	0.07
361	600478	科力远	3,496	17,130.40	0.07
362	603068	博通集成	200	17,056.00	0.07
363	603377	东方时尚	880	17,036.80	0.07
364	600125	铁龙物流	2,762	16,627.24	0.07
365	603118	共进股份	1,600	16,576.00	0.07
366	603113	金能科技	1,000	16,350.00	0.07
367	600095	湘财股份	1,100	16,060.00	0.07
368	600756	浪潮软件	1,028	16,026.52	0.07
369	603708	家家悦	736	15,676.80	0.07
370	600823	世茂股份	3,400	15,674.00	0.07
371	600210	紫江企业	3,600	15,660.00	0.07
372	600307	酒钢宏兴	9,388	15,490.20	0.07
373	601298	青岛港	2,400	15,432.00	0.07
374	600422	昆药集团	1,782	15,414.30	0.07
375	600339	中油工程	5,000	15,400.00	0.07
376	600582	天地科技	4,964	15,289.12	0.07

377	600329	中新药业	857	15,014.64	0.06
378	600116	三峡水利	1,773	14,928.66	0.06
379	601212	白银有色	4,900	14,504.00	0.06
380	601011	宝泰隆	3,400	14,416.00	0.06
381	600664	哈药股份	4,494	14,335.86	0.06
382	600751	海航科技	5,400	14,256.00	0.06
383	600131	国网信通	1,000	14,230.00	0.06
384	600648	外高桥	1,016	14,193.52	0.06
385	600556	天下秀	1,100	13,915.00	0.06
386	600748	上实发展	2,800	13,748.00	0.06
387	600557	康缘药业	1,347	13,698.99	0.06
388	600846	同济科技	1,652	13,645.52	0.06
389	601890	亚星锚链	2,100	13,629.00	0.06
390	600093	易见股份	1,700	13,617.00	0.06
391	603786	科博达	200	13,524.00	0.06
392	600783	鲁信创投	909	13,480.47	0.06
393	603888	新华网	700	13,300.00	0.06
394	600502	安徽建工	3,496	13,214.88	0.06
395	601828	美凯龙	1,530	12,989.70	0.06
396	601139	深圳燃气	1,791	12,966.84	0.06
397	601228	广州港	3,800	12,768.00	0.06
398	600750	江中药业	1,177	12,487.97	0.05
399	600640	号百控股	1,000	12,250.00	0.05
400	600277	亿利洁能	4,062	12,145.38	0.05
401	600787	中储股份	2,625	12,101.25	0.05
402	603766	隆鑫通用	3,450	12,075.00	0.05
403	600517	国网英大	1,979	12,032.32	0.05
404	603881	数据港	200	12,022.00	0.05
405	603225	新风鸣	852	11,842.80	0.05
406	600350	山东高速	1,900	11,742.00	0.05
407	600338	西藏珠峰	1,120	11,737.60	0.05
408	603056	德邦股份	900	11,421.00	0.05
409	600855	航天长峰	734	11,208.18	0.05
410	603279	景津环保	600	11,028.00	0.05
411	601069	西部黄金	800	10,792.00	0.05
412	600299	安迪苏	900	10,359.00	0.04
413	600495	晋西车轴	2,516	10,340.76	0.04
414	603328	依顿电子	1,300	10,335.00	0.04
415	600096	云天化	1,700	10,319.00	0.04

416	603587	地素时尚	540	10,297.80	0.04
417	600343	航天动力	1,052	10,267.52	0.04
418	600903	贵州燃气	800	10,160.00	0.04
419	603220	中贝通信	700	10,129.00	0.04
420	601949	中国出版	1,700	9,605.00	0.04
421	601606	长城军工	800	9,584.00	0.04
422	600581	八一钢铁	2,500	9,575.00	0.04
423	603379	三美股份	500	9,550.00	0.04
424	601003	柳钢股份	1,700	8,823.00	0.04
425	601330	绿色动力	1,000	8,630.00	0.04
426	601609	金田铜业	800	8,120.00	0.03
427	601869	长飞光纤	300	8,112.00	0.03
428	600996	贵广网络	1,400	7,644.00	0.03
429	600335	国机汽车	1,500	7,455.00	0.03
430	603105	芯能科技	800	7,392.00	0.03
431	603893	瑞芯微	100	7,235.00	0.03
432	603305	旭升股份	200	6,258.00	0.03
433	603719	良品铺子	100	5,867.00	0.03
434	603093	南华期货	300	5,517.00	0.02
435	603868	飞科电器	100	4,678.00	0.02
436	603876	鼎胜新材	300	4,587.00	0.02
437	603256	宏和科技	500	4,415.00	0.02
438	603327	福蓉科技	200	3,898.00	0.02
439	603103	横店影视	200	3,770.00	0.02
440	601068	中铝国际	1,000	3,560.00	0.02
441	603733	仙鹤股份	100	2,500.00	0.01
442	603053	成都燃气	200	2,498.00	0.01
443	603815	交建股份	100	1,035.00	0.00

注：股票明细不包含可退替代款估值增（减）值。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601766	中国中车	937,828.00	1.15
2	601390	中国中铁	579,429.00	0.71
3	601939	建设银行	576,018.00	0.70

4	601328	交通银行	416,784.00	0.51
5	600340	华夏幸福	368,666.00	0.45
6	600529	山东药玻	348,630.00	0.43
7	600143	金发科技	322,262.00	0.39
8	601229	上海银行	293,870.00	0.36
9	603882	金城医学	286,845.00	0.35
10	601111	中国国航	270,364.00	0.33
11	603005	晶方科技	260,933.00	0.32
12	603233	大参林	259,090.00	0.32
13	603501	韦尔股份	250,146.00	0.31
14	601162	天风证券	233,340.00	0.29
15	600900	长江电力	227,790.00	0.28
16	603707	健友股份	217,365.00	0.27
17	601360	三六零	206,286.00	0.25
18	600132	重庆啤酒	195,849.00	0.24
19	600998	九州通	194,052.00	0.24
20	600233	圆通速递	182,225.00	0.22

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

8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	600588	用友网络	819,305.78	1.00
2	603288	海天味业	662,534.37	0.81
3	600745	闻泰科技	647,908.00	0.79
4	600919	江苏银行	645,384.00	0.79
5	600570	恒生电子	378,036.93	0.46
6	603160	汇顶科技	372,040.00	0.45
7	688396	华润微	302,000.00	0.37
8	688138	清溢光电	271,782.00	0.33
9	603444	吉比特	271,663.00	0.33
10	603195	公牛集团	253,698.12	0.31
11	601727	上海电气	245,820.00	0.30
12	603658	安图生物	222,050.00	0.27
13	603833	欧派家居	219,155.00	0.27

14	603986	兆易创新	216,026.60	0.26
15	600918	中泰证券	207,904.62	0.25
16	688588	凌志软件	199,996.00	0.24
17	688128	中国电研	186,949.17	0.23
18	603501	韦尔股份	184,800.00	0.23
19	603659	璞泰来	181,110.00	0.22
20	688598	金博股份	180,763.80	0.22

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	18,210,135.26
卖出股票收入（成交）总额	18,124,347.34

注：不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	44,000.00	0.19
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	44,000.00	0.19

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113044	大秦转债	430	43,000.00	0.19
2	113614	健20转债	10	1,000.00	0.00

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

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

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	76.92
2	应收证券清算款	3,822.29

3	应收股利	-
4	应收利息	53.99
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,953.20

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票未存在流通受限的情况。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

9.1.1 本基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
585	7,229.34	1,677,973.00	39.68%	2,551,188.00	60.32%

9.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额（份）	占总份额比例
联接基金	1,673,000.00	39.56%

9.3 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额 比例
1	徐钧	106,000.00	2.51%
2	王水荣	93,300.00	2.21%
3	黄彦	79,200.00	1.87%
4	邝紫葡	64,351.00	1.52%
5	李克宇	61,000.00	1.44%
6	方蓉	55,640.00	1.32%
7	孙莉玫	50,964.00	1.21%
8	郝晋华	50,000.00	1.18%
9	王水荣	46,600.00	1.10%
10	徐绿军	44,700.00	1.06%

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

9.5 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
----	-------------------

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011年1月26日）基金份额总额	348,427,447.00
本报告期期初基金份额总额	19,229,161.00
本报告期基金总申购份额	5,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	20,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	4,229,161.00

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人的重大人事变动：

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。

2020 年 12 月 9 日，公司选举周俊梁先生担任公司监事，童辉先生不再担任公司监事。

2020 年 12 月 14 日，经公司董事会批准童辉先生担任公司首席信息官，房伟力先生不再担任公司首席信息官。

上述人事变动已按相关规定备案、报告。

基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未改聘为其审计的会计师事务所。本报告期基金应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 45,000.00 元人民币，该事务所已向本基金提供了 10 年的审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安	2	34,404,082.09	100.00%	32,041.56	100.00%	-

注：1、选择代理证券买卖的证券经营机构的标准

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

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

2、选择代理证券买卖的证券经营机构的程序

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

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	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
国泰君安	169,838.70	100.00%	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止北京电盈基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	证监会规定报刊和网站	2020年12月31日
2	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金参加泉州银行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12月30日
3	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金参加平安银行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12月24日
4	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止泰诚财富基金销售(大连)有限公司和深圳盈信基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	证监会规定报刊和网站	2020年12月18日
5	华泰柏瑞基金管理有限公司关于首席信息官变更的公告	证监会规定报刊和网站	2020年12月15日
6	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金投资范围增加存托凭证并相应修订基金合同及托管协议的公告	证监会规定报刊和网站	2020年11月20日
7	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2020年11月5日
8	华泰柏瑞基金管理有限公司关于调整旗下基金参加招商银行股份有限公司旗下招赢通平台费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2020年9月30日
9	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金参加招商银行股份有限公司旗下招赢通平台费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2020年9月28日
10	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7月27日
11	华泰柏瑞基金管理有限公司关于提醒客户及时更新身份证件及非自然人客户及时登记受益所有人信息的公告	证监会规定报刊和网站	2020年7月13日
12	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金参加徽商银行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7月2日

13	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
14	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
15	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
16	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
17	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
18	华泰柏瑞基金管理有限公司关于上证中小盘交易型开放式指数证券投资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
19	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

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
联接基金	1	20200101-20201231;	14,574,000.00	12,381,800.00	25,282,800.00	1,673,000.00	39.56%

产品特有风险

本基金报告期内本基金联接基金持有基金份额超过 20%的情形。如果这些份额持有比例较大的投资者赎回，可能导致巨额赎回，从而引发流动性风险，可能对基金产生如下影响：（1）延期办理赎回申请或暂停赎回的风险。当发生巨额赎回时，投资者可能面临赎回申请延期办理、延缓支付或暂停赎回的风险。（2）基金净值大幅波动的风险。基金管理人为了应对大额赎回可能短时间内进行资产变现，这将对基金资产净值产生不利影响，同时可能发生大额赎回费用归入基金资产、基金份额净值保留位数四舍五入等问题，这些都可能会造成基金资产净值的较大波动。（3）基金投资目标偏离的风险。单一投资者大额赎回后可能导致基金规模缩小，基金将面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形，从而使得实现基金投资目标存在一定的不确定性。（4）基金合同提前终止的风险。如果投资者大额赎回可能导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。本基金管理人将密切关注申赎动向，审慎评估大额申赎对基金持有集中度的影响，同时将完善流动性风险管控机制，最大限度的保护基金份额持有人的合法权益。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金募集的文件
- 2、《上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- 3、《上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》
- 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的公告

13.2 存放地点

上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

托管人住所

13.3 查阅方式

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

华泰柏瑞基金管理有限公司

2021 年 3 月 31 日