

# 上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金

## 2021 年中期报告

2021 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：2021 年 8 月 28 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 2021 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在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 2021 年 1 月 1 日起至 2021 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.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</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.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	15
<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.....	54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	56
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.....	56
7.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	56
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	56
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.....	56
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	57
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	57
7.12 投资组合报告附注.....	57
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>59</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	59
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	59
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	59
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	59
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>61</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>62</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	62
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.....	62
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	62
10.4 基金投资策略的改变.....	62
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	62
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.....	62
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	62
10.8 其他重大事件.....	63

---

<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>64</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 .....	64
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	65
<b>§12 备查文件目录</b> .....	<b>66</b>
12.1 备查文件目录.....	66
12.2 存放地点.....	66
12.3 查阅方式.....	66

## § 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
扩位证券简称	中小盘 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基本一致。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华泰柏瑞基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责	姓名	刘万方	许俊

人	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
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(2021年1月1日 - 2021年6月30日)
本期已实现收益	1,398,498.67
本期利润	1,310,637.80
加权平均基金份额本期利润	0.2940
本期加权平均净值利润率	5.30%
本期基金份额净值增长率	6.40%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)
期末可供分配利润	9,226,909.09
期末可供分配基金份额利润	2.1817
期末基金资产净值	24,700,696.28
期末基金份额净值	5.8406
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)
基金份额累计净值增长率	61.20%

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

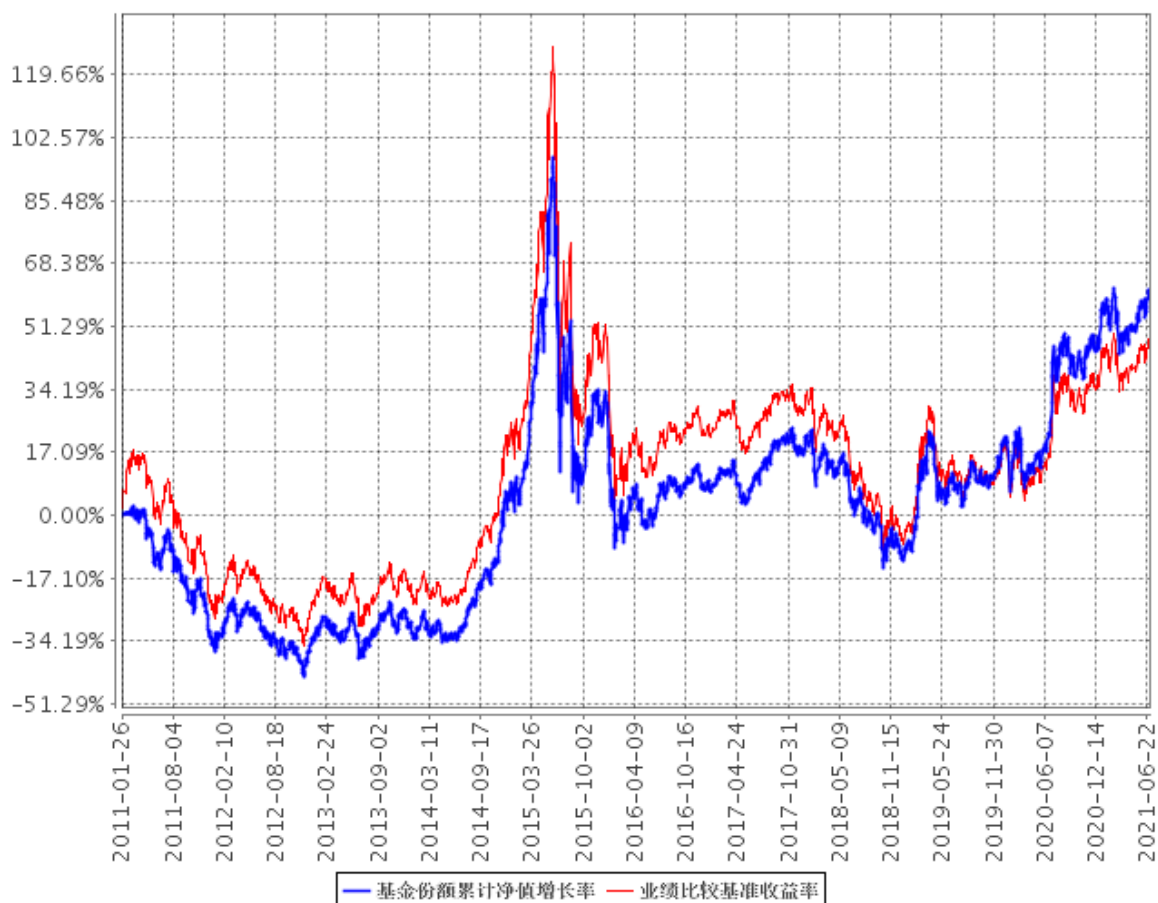
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去一个月	2.09%	0.74%	1.08%	0.72%	1.01%	0.02%
过去三个月	8.92%	0.73%	7.51%	0.72%	1.41%	0.01%
过去六个月	6.40%	1.07%	5.47%	1.06%	0.93%	0.01%
过去一年	30.32%	1.22%	25.64%	1.22%	4.68%	0.00%
过去三年	54.70%	1.34%	32.23%	1.35%	22.47%	-0.01%
自合同生效日至今	61.20%	1.53%	47.76%	1.54%	13.44%	-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 2021 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、华泰柏瑞质量领先混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证稀土产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞品质成长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联接基金、华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证物联网主题交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞质量精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞港股通时代机遇混合型证券投资基金、华泰柏瑞行业严选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证企业核心竞争力 50 交易型开放式指数证券投资基金。截至 2021 年 6 月 30 日，公司基金管理规模为 2174.24 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		
李茜	本基金的基金经理	2019 年 11 月 5 日	-	6 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。

				<p>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光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 1 月起任华泰柏瑞中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 2 月起任华泰柏瑞中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证稀土产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月起任华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金和华泰柏瑞中证物联网主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	---

注：证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。任职日期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

2021 年上半年市场以结构性机会为主。其中电气设备、钢铁、化工等行业录得正收益，期间电气设备行业指数上涨达 23.83%，钢铁行业指数上涨达 23.62%。整体来看，沪深 300、中证 500、中证 1000 和创业板涨跌幅分别为 0.24%、6.93%、6.58%、和 17.22%。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 0.28% 和 4.78%。

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，本基金的日均绝对跟踪偏离度为 0.031%，期间日跟踪误差为 0.042%，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 5.8406 元；本报告期基金份额净值增长率为 6.40%，业绩比较基准收益率为 5.47%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

二季度的全球股票市场摆脱了之前两个季度的高一一致性，即周期股持续跑赢成长风格。期间各类市场风格此起彼伏，驱动市场风格在成长和价值间反复徘徊。年初以来以宏观流动性边际收紧，很多投资者担心高估值板块承压，然而我们发现，上半年 A 股表现分化加剧，高估值板块涨幅反而更大，无论是从细分行业还是概念指数，年初以来涨幅较高的板块大都处于相对较高的估值水平。原因还是在于投资者风险偏好高，愿意为高景气板块给予更高估值。

新冠疫情后中国经济增速或逐渐向新平台回归。外需层面上来看，全球复苏的主线逐渐从商品转向服务，可能意味着对全球、中国商品贸易的溢出效应下降。内需层面上来看，基建的支撑作用消退，政策严控下地产可能也面临逐渐降温，而消费虽然仍有缺口，受限于居民消费意愿回升较慢。随着经济波动的下降，政策的关注重点也转向中长期问题。而从长期来看，在存量债务压力下，政策重心从控制新增债务转向存量债务的维系问题，从这个角度来看，央行的货币政策或“易松难紧”。展望下半年，A 股市场或将伴随国内货币政策防范化解金融风险、保供稳价和碳中和等政策的方向不断小幅微调。结构上看，A 股分化趋势还将继续延续，建议成长和价值均衡配置。

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

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定，基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率达到 1%以上，方可进行收益分配。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**

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”、“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 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 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：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	560,427.19	602,425.68
结算备付金		3,224.49	838.21
存出保证金		333.86	76.92
交易性金融资产	6.4.7.2	24,182,572.43	22,743,755.12
其中：股票投资		24,173,572.43	22,699,755.12
基金投资		-	-
债券投资		9,000.00	44,000.00
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		-	3,822.29
应收利息	6.4.7.5	61.74	53.99
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		24,746,619.71	23,350,972.21
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2020 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		2,000.00	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		9,913.92	10,324.31
应付托管费		1,982.79	2,064.87
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	8,519.53	7,247.66
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	6.4.7.8	23,507.19	126,993.11
负债合计		45,923.43	146,630.15
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	15,473,787.19	15,473,787.20
未分配利润	6.4.7.10	9,226,909.09	7,730,554.86
所有者权益合计		24,700,696.28	23,204,342.06
负债和所有者权益总计		24,746,619.71	23,350,972.21

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 5.8406 元，基金份额总额 4,229,161.00 份。

## 6.2 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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		1,423,422.36	4,025,021.47
1.利息收入		921.12	4,632.63
其中：存款利息收入	6.4.7.11	912.18	4,619.45
债券利息收入		8.94	13.18
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）		1,519,799.02	3,919,303.81
其中：股票投资收益	6.4.7.12	1,350,112.20	3,425,685.90
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	7,297.75	11,058.92
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	162,389.07	482,558.99
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-87,860.87	101,050.47
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-9,436.91	34.56

<b>减：二、费用</b>		112,784.56	409,502.61
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	61,190.90	188,736.58
2. 托管费	6.4.10.2.2	12,238.19	37,747.29
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	15,348.24	42,521.88
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.01	0.04
7. 其他费用	6.4.7.20	24,007.22	140,496.82
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		1,310,637.80	3,615,518.86
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		1,310,637.80	3,615,518.86

### 6.3 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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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）	15,473,787.20	7,730,554.86	23,204,342.06
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,310,637.80	1,310,637.80
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）	-0.01	185,716.43	185,716.42
其中：1. 基金申购款	1,829,415.71	1,070,312.49	2,899,728.20
2. 基金赎回款	-1,829,415.72	-884,596.06	-2,714,011.78
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	15,473,787.19	9,226,909.09	24,700,696.28

项目	上年度可比期间 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
	金净值)		
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）	-	3,615,518.86	3,615,518.86
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-42,076,561.39	-8,781,831.96	-50,858,393.35
其中：1. 基金申购款	5,488,247.14	599,091.11	6,087,338.25
2. 基金赎回款	-47,564,808.53	-9,380,923.07	-56,945,731.60
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）	28,279,697.17	6,346,975.32	34,626,672.49

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

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。本基金为交易型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币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。

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 2021 年 8 月 28 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 2021 年 1 月 1 日至 2021 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 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无重大会计差错。

### 6.4.6 税项

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

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、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 2021 年 6 月 30 日
活期存款	560,427.19
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：	560,427.19

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	21,801,452.35	24,173,572.43	2,372,120.08
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	9,000.00	-
	银行间市场	-	-
	合计	9,000.00	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	21,810,452.35	24,182,572.43	2,372,120.08

### 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 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	59.61
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	1.50
应收债券利息	0.43
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	0.20
合计	61.74

#### 6.4.7.6 其他资产

注：截至本报告期末，本基金无其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	8,519.53
银行间市场应付交易费用	-
合计	8,519.53

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元



项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	19,835.79
应付指数使用费	3,671.40
合计	23,507.19

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,229,161.00	15,473,787.20
本期申购	500,000.00	1,829,415.71
本期赎回(以“-”号填列)	-500,000.00	-1,829,415.72
- 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	15,473,787.19

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。

#### 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	11,838,862.54	-4,108,307.68	7,730,554.86
本期利润	1,398,498.67	-87,860.87	1,310,637.80
本期基金份额交易产生的变动数	-3,174.87	188,891.30	185,716.43
其中：基金申购款	1,397,007.91	-326,695.42	1,070,312.49
基金赎回款	-1,400,182.78	515,586.72	-884,596.06
本期已分配利润	-	-	-
本期末	13,234,186.34	-4,007,277.25	9,226,909.09

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	856.95
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	53.28
其他	1.95
合计	912.18

### 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 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	1,149,067.47
股票投资收益——赎回差价收入	201,044.73
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	1,350,112.20

#### 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 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	5,084,783.73
减：卖出股票成本总额	3,935,716.26
买卖股票差价收入	1,149,067.47

#### 6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
赎回基金份额对价总额	2,714,011.78
减：现金支付赎回款总额	187,266.78
减：赎回股票成本总额	2,325,700.27
赎回差价收入	201,044.73

#### 6.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

注：无。

#### 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 债券投资收益

#### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	7,297.75
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	7,297.75

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	90,309.90
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	83,000.00
减：应收利息总额	12.15
买卖债券差价收入	7,297.75

#### 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

#### 6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券申购差价收入。

#### 6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

##### 6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

##### 6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

##### 6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属赎回差价收入。

##### 6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属申购差价收入。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

##### 6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

##### 6.4.7.15.2 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。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	162,389.07
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	162,389.07

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	-87,860.87
——股票投资	-87,860.87
——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	-87,860.87

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	-9,436.91
合计	-9,436.91

注：替代损益是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购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确认日估值的差额。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	15,348.24
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	15,348.24

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	19,835.79
信息披露费	-

证券出借违约金	-
银行划款手续费	500.00
指数使用费	3,671.43
合计	24,007.22

#### 6.4.7.21 分部报告

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

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

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
华泰证券股份有限公司（“华泰证券”）	基金管理人的股东、一级交易商
华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“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
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

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

注：本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

注：本报告期本基金与关联方未进行股票交易。

#### 6.4.10.1.2 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。

#### 6.4.10.1.3 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。

### 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 2021年1月1日至2021年6 月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	61,190.90	188,736.58
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

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 3 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 2021年1月1日至2021年6 月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30 日
当期发生的基金应支付的托管费	12,238.19	37,747.29

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 3 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。

##### 6.4.10.5.2 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 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	1,698,200.00	40.1545%	1,673,000.00	39.5587%

##### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元



关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2021年1月1日至2021年6月30日		2020年1月1日至2020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	560,427.19	856.95	1,042,274.59	4,507.69

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

金额单位：人民币元

本期					
2021年1月1日至2021年6月30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
华泰联合证券	600905	三峡能源	网上申购	31,000	82,150.00
华泰联合证券	605499	东鹏饮料	网下申购	158	7,310.66
华泰联合证券	600909	华安证券	配股	1,980	7,286.40
上年度可比期间					
2020年1月1日至2020年6月30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
-	-	-	-	-	-

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

注：本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

##### 6.4.11.1

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2021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

6.4.12.1.2 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

113049	长汽转债	2021年6月10日	2021年7月8日	新债未上市	100.00	100.00	20	2,000.00	2,000.00	-
113051	节能转债	2021年6月21日	2021年7月22日	新债未上市	100.00	100.00	50	5,000.00	5,000.00	-
113626	伯特转债	2021年6月29日	2021年7月21日	新债未上市	100.00	100.00	20	2,000.00	2,000.00	-

#### 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
600460	士兰微	2021年6月30日	临时停牌	56.35	2021年7月1日	59.49	2,400	40,042.43	135,240.00	-
600811	东方集团	2021年6月30日	临时停牌	3.05	2021年7月14日	3.36	8,040	32,338.30	24,522.00	-
600093	易见股份	2021年5月6日	临时停牌	5.93	2021年7月7日	5.63	1,700	18,551.23	10,081.00	-

#### 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。

##### 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。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	2,000.00	43,000.00
AAA 以下	7,000.00	1,000.00
未评级	0.00	0.00
合计	9,000.00	44,000.00

注：债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性

风险来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

于 2021 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、流通受限的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2021 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 0.72%。

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

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

交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021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	560,427.19	-	-	-	-	-	560,427.19
结算备付金	3,224.49	-	-	-	-	-	3,224.49
存出保证金	333.86	-	-	-	-	-	333.86
交易性金融资产	-	-	9,000.00	-	-	-24,173,572.43	24,182,572.43
应收利息	-	-	-	-	-	61.74	61.74
资产总计	563,985.54	-	9,000.00	-	-	-24,173,634.17	24,746,619.71
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	2,000.00	2,000.00
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	9,913.92	9,913.92
应付托管费	-	-	-	-	-	1,982.79	1,982.79
应付交易费用	-	-	-	-	-	8,519.53	8,519.53

其他负债	-	-	-	-	-	23,507.19	23,507.19
负债总计	-	-	-	-	-	45,923.43	45,923.43
利率敏感度缺口	563,985.54	-	9,000.00	-	-	-24,127,710.74	24,700,696.28
上年度末 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

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2021 年 6 月 30 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 0.04% (2020 年 12 月 31 日：0.19%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2020 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

券市场整体波动的影响。

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金主要投资于指数的成份股及其备选成份股，其投资比例不低于基金资产净值的 95%。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 2021年6月30日		上年度末 2020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	24,173,572.43	97.87	22,699,755.12	97.83
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	24,173,572.43	97.87	22,699,755.12	97.83

#### 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（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）



	上证中小盘指数上升 5%	1,218,530.61	1,154,597.17
	上证中小盘指数下降 5%	-1,218,530.61	-1,154,597.17

#### 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	24,173,572.43	97.68
	其中：股票	24,173,572.43	97.68
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	9,000.00	0.04
	其中：债券	9,000.00	0.04
	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	563,651.68	2.28
8	其他各项资产	395.60	0.00
9	合计	24,746,619.71	100.00

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

### 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	59,945.53	0.24
B	采矿业	840,603.67	3.40
C	制造业	12,314,960.77	49.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,256,732.04	5.09
E	建筑业	734,741.95	2.97
F	批发和零售业	735,834.00	2.98
G	交通运输、仓储和邮政业	1,406,331.61	5.69
H	住宿和餐饮业	83,736.00	0.34
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,344,291.83	5.44
J	金融业	4,131,491.15	16.73
K	房地产业	458,181.12	1.85
L	租赁和商务服务业	108,302.85	0.44
M	科学研究和技术服务业	73,500.00	0.30
N	水利、环境和公共设施管理业	82,088.34	0.33
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	11,288.64	0.05
Q	卫生和社会工作	456,616.00	1.85
R	文化、体育和娱乐业	47,121.64	0.19
S	综合	27,805.29	0.11
	合计	24,173,572.43	97.87

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期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	600900	长江电力	32,042	661,346.88	2.68
2	601919	中远海控	13,600	415,344.00	1.68
3	600436	片仔癀	894	400,780.20	1.62
4	601328	交通银行	76,800	376,320.00	1.52
5	600763	通策医疗	800	328,800.00	1.33
6	688111	金山办公	800	315,840.00	1.28
7	601816	京沪高铁	55,900	295,711.00	1.20
8	603799	华友钴业	2,456	280,475.20	1.14
9	600919	江苏银行	32,800	232,880.00	0.94
10	601229	上海银行	28,000	229,600.00	0.93
11	600660	福耀玻璃	4,000	223,400.00	0.90
12	601766	中国中车	33,600	204,288.00	0.83
13	601169	北京银行	41,600	202,592.00	0.82
14	600999	招商证券	10,460	198,949.20	0.81
15	600019	宝钢股份	24,800	189,472.00	0.77
16	603486	科沃斯	800	182,464.00	0.74
17	601988	中国银行	58,400	179,872.00	0.73
18	600406	国电南瑞	7,680	178,483.20	0.72
19	688036	传音控股	831	174,094.50	0.70
20	600132	重庆啤酒	800	158,360.00	0.64
21	601658	邮储银行	30,400	152,608.00	0.62
22	603737	三棵树	860	151,360.00	0.61
23	688012	中微公司	910	150,987.20	0.61
24	600346	恒力石化	5,660	148,518.40	0.60
25	601377	兴业证券	15,200	146,832.00	0.59

26	601390	中国中铁	28,000	146,720.00	0.59
27	601009	南京银行	13,629	143,377.08	0.58
28	601633	长城汽车	3,233	140,926.47	0.57
29	601100	恒立液压	1,620	139,190.40	0.56
30	600460	士兰微	2,400	135,240.00	0.55
31	600089	特变电工	10,473	134,578.05	0.54
32	601225	陕西煤业	11,200	132,720.00	0.54
33	600111	北方稀土	6,400	132,480.00	0.54
34	603882	金域医学	800	127,816.00	0.52
35	688029	南微医学	400	124,676.00	0.50
36	600426	华鲁恒升	4,020	124,419.00	0.50
37	601939	建设银行	18,400	122,360.00	0.50
38	600584	长电科技	3,211	120,990.48	0.49
39	600958	东方证券	12,000	119,880.00	0.49
40	600926	杭州银行	8,060	118,885.00	0.48
41	601233	桐昆股份	4,880	117,559.20	0.48
42	603833	欧派家居	800	113,568.00	0.46
43	603893	瑞芯微	800	111,568.00	0.45
44	688363	华熙生物	400	111,144.00	0.45
45	601006	大秦铁路	16,800	110,544.00	0.45
46	603659	璞泰来	800	109,280.00	0.44
47	601877	正泰电器	3,273	109,252.74	0.44
48	688008	澜起科技	1,700	106,046.00	0.43
49	600741	华域汽车	4,017	105,526.59	0.43
50	601989	中国重工	25,600	105,472.00	0.43
51	601901	方正证券	11,200	104,832.00	0.42
52	600015	华夏银行	16,860	104,363.40	0.42
53	603160	汇顶科技	800	103,704.00	0.42
54	603993	洛阳钼业	20,000	103,200.00	0.42
55	600885	宏发股份	1,640	102,828.00	0.42
56	600600	青岛啤酒	885	102,350.25	0.41
57	603345	安井食品	400	101,608.00	0.41
58	600779	水井坊	800	101,080.00	0.41
59	601788	光大证券	5,600	100,184.00	0.41
60	600143	金发科技	4,800	100,128.00	0.41
61	601155	新城控股	2,400	99,840.00	0.40
62	600486	扬农化工	893	99,810.61	0.40
63	600176	中国巨石	6,407	99,372.57	0.40
64	600352	浙江龙盛	7,217	99,161.58	0.40

65	688099	晶晨股份	882	98,960.40	0.40
66	600010	包钢股份	63,280	98,084.00	0.40
67	601600	中国铝业	18,460	97,838.00	0.40
68	601186	中国铁建	12,800	95,104.00	0.39
69	688002	睿创微纳	938	93,640.54	0.38
70	603806	福斯特	880	92,514.40	0.37
71	601916	浙商银行	23,200	92,104.00	0.37
72	603369	今世缘	1,650	89,364.00	0.36
73	601636	旗滨集团	4,800	89,088.00	0.36
74	603019	中科曙光	3,200	88,352.00	0.36
75	600989	宝丰能源	6,400	87,552.00	0.35
76	600298	安琪酵母	1,600	87,008.00	0.35
77	600845	宝信软件	1,692	86,122.80	0.35
78	601669	中国电建	21,600	83,592.00	0.34
79	601238	广汽集团	6,420	83,139.00	0.34
80	603613	国联股份	825	82,475.25	0.33
81	600109	国金证券	6,400	81,216.00	0.33
82	601838	成都银行	6,422	81,174.08	0.33
83	600150	中国船舶	4,800	79,248.00	0.32
84	600886	国投电力	8,081	77,658.41	0.31
85	600183	生益科技	3,268	76,503.88	0.31
86	601108	财通证券	7,200	75,528.00	0.31
87	600884	杉杉股份	3,230	75,323.60	0.30
88	601555	东吴证券	8,826	73,608.84	0.30
89	603127	昭衍新药	400	73,500.00	0.30
90	601985	中国核电	14,400	72,864.00	0.29
91	688396	华润微	800	72,816.00	0.29
92	600522	中天科技	7,230	72,300.00	0.29
93	600029	南方航空	12,000	72,240.00	0.29
94	600219	南山铝业	20,045	72,162.00	0.29
95	600362	江西铜业	3,217	71,996.46	0.29
96	600872	中炬高新	1,676	70,425.52	0.29
97	601077	渝农商行	17,600	70,224.00	0.28
98	601966	玲珑轮胎	1,600	69,984.00	0.28
99	601607	上海医药	3,285	69,412.05	0.28
100	600085	同仁堂	1,698	69,363.30	0.28
101	601360	三六零	5,600	68,376.00	0.28
102	600079	人福医药	2,400	67,848.00	0.27
103	601799	星宇股份	300	67,716.00	0.27

104	603899	晨光文具	800	67,648.00	0.27
105	600760	中航沈飞	1,120	67,536.00	0.27
106	603517	绝味食品	800	67,432.00	0.27
107	600739	辽宁成大	3,233	67,278.73	0.27
108	601168	西部矿业	5,628	67,142.04	0.27
109	600383	金地集团	6,491	66,467.84	0.27
110	603816	顾家家居	860	66,460.80	0.27
111	601099	太平洋	19,212	65,128.68	0.26
112	603290	斯达半导	200	64,000.00	0.26
113	601117	中国化学	7,236	63,387.36	0.26
114	600563	法拉电子	400	63,344.00	0.26
115	600699	均胜电子	2,480	63,289.60	0.26
116	603260	合盛硅业	820	63,066.20	0.26
117	601111	中国国航	8,000	62,240.00	0.25
118	601800	中国交建	9,600	62,208.00	0.25
119	600316	洪都航空	1,616	62,183.68	0.25
120	603658	安图生物	820	62,131.40	0.25
121	600061	国投资本	7,296	61,943.04	0.25
122	603236	移远通信	360	61,419.60	0.25
123	601727	上海电气	14,400	61,056.00	0.25
124	600068	葛洲坝	8,093	60,616.57	0.25
125	601689	拓普集团	1,600	59,888.00	0.24
126	601618	中国中冶	20,085	59,853.30	0.24
127	600705	中航资本	15,224	58,916.88	0.24
128	601162	天风证券	12,000	58,320.00	0.24
129	603005	晶方科技	960	56,860.80	0.23
130	600606	绿地控股	10,400	56,680.00	0.23
131	600201	生物股份	3,227	56,311.15	0.23
132	600392	盛和资源	3,235	56,159.60	0.23
133	600882	妙可蓝多	800	55,840.00	0.23
134	600161	天坛生物	1,604	54,937.00	0.22
135	600332	白云山	1,613	54,600.05	0.22
136	600529	山东药玻	1,600	54,320.00	0.22
137	603589	口子窖	800	54,152.00	0.22
138	603678	火炬电子	800	54,000.00	0.22
139	603185	上机数控	300	53,685.00	0.22
140	603444	吉比特	100	53,000.00	0.21
141	601878	浙商证券	4,000	52,320.00	0.21
142	601997	贵阳银行	7,280	52,124.80	0.21

143	600521	华海药业	2,488	51,949.44	0.21
144	688122	西部超导	800	51,896.00	0.21
145	601990	南京证券	4,880	51,337.60	0.21
146	600549	厦门钨业	2,440	50,825.20	0.21
147	601021	春秋航空	892	50,754.80	0.21
148	600011	华能国际	12,000	50,640.00	0.21
149	603939	益丰药房	892	50,032.28	0.20
150	600066	宇通客车	4,000	49,960.00	0.20
151	600674	川投能源	4,043	49,850.19	0.20
152	600418	江淮汽车	4,000	49,720.00	0.20
153	601128	常熟银行	8,000	49,600.00	0.20
154	601696	中银证券	2,400	49,416.00	0.20
155	600118	中国卫星	1,686	49,332.36	0.20
156	601216	君正集团	9,688	49,311.92	0.20
157	600862	中航高科	1,600	49,248.00	0.20
158	601933	永辉超市	10,402	49,201.46	0.20
159	600489	中金黄金	5,662	48,806.44	0.20
160	688088	虹软科技	874	48,725.50	0.20
161	600171	上海贝岭	1,600	48,688.00	0.20
162	600827	百联股份	2,400	48,360.00	0.20
163	600879	航天电子	6,400	48,128.00	0.19
164	600315	上海家化	800	48,112.00	0.19
165	600988	赤峰黄金	3,200	47,968.00	0.19
166	600516	方大炭素	6,431	47,846.64	0.19
167	600867	通化东宝	4,004	47,807.76	0.19
168	600655	豫园股份	4,053	46,974.27	0.19
169	603338	浙江鼎力	800	46,952.00	0.19
170	600369	西南证券	9,600	46,752.00	0.19
171	688126	沪硅产业	1,600	46,688.00	0.19
172	603027	千禾味业	1,760	46,270.40	0.19
173	603156	养元饮品	1,604	45,842.32	0.19
174	600487	亨通光电	4,020	45,828.00	0.19
175	600018	上港集团	9,600	45,792.00	0.19
176	600536	中国软件	802	45,657.86	0.18
177	600754	锦江酒店	800	45,560.00	0.18
178	600038	中直股份	861	45,409.14	0.18
179	600380	健康元	3,288	45,144.24	0.18
180	600909	华安证券	8,080	45,005.60	0.18
181	601998	中信银行	8,800	44,880.00	0.18

182	600642	申能股份	7,281	44,705.34	0.18
183	600166	福田汽车	12,892	44,477.40	0.18
184	600559	老白干酒	1,680	44,184.00	0.18
185	603233	大参林	860	43,954.60	0.18
186	600895	张江高科	2,400	43,848.00	0.18
187	601198	东兴证券	4,000	43,720.00	0.18
188	601319	中国人保	7,200	42,696.00	0.17
189	603883	老百姓	800	42,144.00	0.17
190	601866	中远海发	11,233	42,123.75	0.17
191	600271	航天信息	3,206	41,774.18	0.17
192	603650	彤程新材	863	41,510.30	0.17
193	600415	小商品城	8,029	41,349.35	0.17
194	600060	海信视像	2,427	41,016.30	0.17
195	688009	中国通号	7,200	40,968.00	0.17
196	600711	盛屯矿业	5,631	40,149.03	0.16
197	601872	招商轮船	8,640	39,916.80	0.16
198	600236	桂冠电力	6,417	39,849.57	0.16
199	600372	中航电子	2,400	39,720.00	0.16
200	600110	诺德股份	3,239	39,451.02	0.16
201	603605	珀莱雅	200	39,342.00	0.16
202	600100	同方股份	6,400	39,104.00	0.16
203	600153	建发股份	4,800	38,880.00	0.16
204	603456	九洲药业	800	38,864.00	0.16
205	601615	明阳智能	2,400	38,856.00	0.16
206	600390	五矿资本	6,460	38,630.80	0.16
207	601699	潞安环能	3,261	38,512.41	0.16
208	603267	鸿远电子	300	38,376.00	0.16
209	600765	中航重机	1,694	38,369.10	0.16
210	600258	首旅酒店	1,600	38,176.00	0.15
211	600497	驰宏锌锗	8,836	38,083.16	0.15
212	600188	兖州煤业	2,476	38,031.36	0.15
213	600256	广汇能源	11,207	37,319.31	0.15
214	601717	郑煤机	3,200	37,216.00	0.15
215	603858	步长制药	1,653	37,175.97	0.15
216	600998	九州通	2,400	36,888.00	0.15
217	600667	太极实业	4,000	36,400.00	0.15
218	600008	首创环保	12,004	36,132.04	0.15
219	600323	瀚蓝环境	1,657	36,106.03	0.15
220	600160	巨化股份	4,077	36,040.68	0.15



221	600535	天士力	2,400	35,544.00	0.14
222	603198	迎驾贡酒	800	35,440.00	0.14
223	600170	上海建工	12,811	35,358.36	0.14
224	600875	东方电气	3,200	35,104.00	0.14
225	601898	中煤能源	4,866	34,791.90	0.14
226	601881	中国银河	3,200	34,496.00	0.14
227	603927	中科软	800	34,360.00	0.14
228	600155	华创阳安	3,200	34,240.00	0.14
229	600096	云天化	2,400	33,696.00	0.14
230	603225	新凤鸣	1,652	33,535.60	0.14
231	600732	爱旭股份	2,400	33,408.00	0.14
232	603707	健友股份	800	33,400.00	0.14
233	603919	金徽酒	800	32,896.00	0.13
234	600737	中粮糖业	3,281	32,842.81	0.13
235	600325	华发股份	4,872	32,837.28	0.13
236	600409	三友化工	3,234	32,695.74	0.13
237	601236	红塔证券	2,400	32,544.00	0.13
238	600151	航天机电	3,300	32,340.00	0.13
239	601992	金隅集团	12,018	32,328.42	0.13
240	600297	广汇汽车	11,200	32,256.00	0.13
241	600233	圆通速递	3,200	32,032.00	0.13
242	600580	卧龙电驱	2,408	32,026.40	0.13
243	600500	中化国际	4,074	32,021.64	0.13
244	603881	数据港	880	31,856.00	0.13
245	601865	福莱特	800	31,624.00	0.13
246	600498	烽火通信	1,688	31,447.44	0.13
247	600282	南钢股份	8,800	31,328.00	0.13
248	600966	博汇纸业	2,400	31,320.00	0.13
249	600771	广誉远	800	31,280.00	0.13
250	600305	恒顺醋业	1,620	30,974.40	0.13
251	600567	山鹰国际	8,867	30,591.15	0.12
252	603733	仙鹤股份	800	30,400.00	0.12
253	600839	四川长虹	10,436	30,368.76	0.12
254	600027	华电国际	8,828	30,368.32	0.12
255	603077	和邦生物	14,459	30,074.72	0.12
256	600820	隧道股份	5,684	30,068.36	0.12
257	600970	中材国际	3,276	30,040.92	0.12
258	601016	节能风电	8,000	29,920.00	0.12
259	600728	佳都科技	4,028	29,847.48	0.12

260	600340	华夏幸福	5,600	29,344.00	0.12
261	600641	万业企业	1,600	29,184.00	0.12
262	600583	海油工程	6,469	29,110.50	0.12
263	600596	新安股份	1,639	29,043.08	0.12
264	603712	七一二	800	28,880.00	0.12
265	601577	长沙银行	3,200	28,608.00	0.12
266	603596	伯特利	800	28,600.00	0.12
267	600801	华新水泥	1,620	28,463.40	0.12
268	600482	中国动力	1,624	28,290.08	0.11
269	600273	嘉化能源	3,200	27,840.00	0.11
270	600511	国药股份	842	27,836.52	0.11
271	600025	华能水电	4,800	27,792.00	0.11
272	600803	新奥股份	1,675	27,654.25	0.11
273	600808	马钢股份	6,440	27,627.60	0.11
274	601231	环旭电子	1,642	27,602.02	0.11
275	603000	人民网	1,600	27,504.00	0.11
276	601375	中原证券	5,624	27,388.88	0.11
277	601222	林洋能源	3,275	27,149.75	0.11
278	601106	中国一重	8,000	27,120.00	0.11
279	600259	广晟有色	800	27,048.00	0.11
280	600216	浙江医药	1,689	27,040.89	0.11
281	600755	厦门国贸	3,273	26,871.33	0.11
282	603866	桃李面包	860	26,832.00	0.11
283	600782	新钢股份	4,800	26,784.00	0.11
284	600022	山东钢铁	15,205	26,152.60	0.11
285	603392	万泰生物	100	25,918.00	0.10
286	601698	中国卫通	1,600	25,904.00	0.10
287	600812	华北制药	2,400	25,560.00	0.10
288	601018	宁波港	6,447	25,465.65	0.10
289	600410	华胜天成	3,280	25,452.80	0.10
290	600993	马应龙	881	25,443.28	0.10
291	600621	华鑫股份	1,600	25,408.00	0.10
292	603317	天味食品	860	25,309.80	0.10
293	600039	四川路桥	4,004	25,105.08	0.10
294	600572	康恩贝	5,612	24,917.28	0.10
295	600026	中远海能	4,045	24,917.20	0.10
296	600267	海正药业	1,653	24,877.65	0.10
297	600562	国睿科技	1,650	24,865.50	0.10
298	600859	王府井	856	24,721.28	0.10

299	603885	吉祥航空	1,620	24,721.20	0.10
300	601880	辽港股份	14,443	24,697.53	0.10
301	600967	内蒙一机	2,440	24,692.80	0.10
302	601456	国联证券	1,600	24,640.00	0.10
303	600126	杭钢股份	4,800	24,624.00	0.10
304	600811	东方集团	8,040	24,522.00	0.10
305	600348	华阳股份	3,298	24,471.16	0.10
306	601118	海南橡胶	4,800	24,432.00	0.10
307	601808	中海油服	1,698	24,383.28	0.10
308	600329	中新药业	857	24,073.13	0.10
309	600597	光明乳业	1,669	24,050.29	0.10
310	600598	北大荒	1,600	23,936.00	0.10
311	600330	天通股份	2,437	23,906.97	0.10
312	600446	金证股份	1,653	23,869.32	0.10
313	600777	新潮能源	15,200	23,864.00	0.10
314	600185	格力地产	3,200	23,584.00	0.10
315	600718	东软集团	2,400	23,472.00	0.10
316	600908	无锡银行	4,000	23,200.00	0.09
317	600206	有研新材	1,622	23,194.60	0.09
318	601179	中国西电	5,600	23,072.00	0.09
319	600338	西藏珠峰	1,620	22,955.40	0.09
320	603228	景旺电子	872	22,846.40	0.09
321	600729	重庆百货	832	22,838.40	0.09
322	601666	平煤股份	3,200	22,752.00	0.09
323	603515	欧普照明	880	22,589.60	0.09
324	600478	科力远	4,096	22,487.04	0.09
325	600507	方大特钢	3,298	22,360.44	0.09
326	600517	国网英大	3,279	22,329.99	0.09
327	600064	南京高科	2,400	22,296.00	0.09
328	600797	浙大网新	3,262	21,790.16	0.09
329	600260	凯乐科技	2,449	21,747.12	0.09
330	603218	日月股份	800	21,664.00	0.09
331	601098	中南传媒	2,402	21,185.64	0.09
332	600131	国网信通	1,600	21,184.00	0.09
333	600120	浙江东方	4,891	20,933.48	0.08
334	601519	大智慧	2,400	20,856.00	0.08
335	600307	酒钢宏兴	8,888	20,620.16	0.08
336	601975	招商南油	9,600	20,544.00	0.08
337	600057	厦门象屿	3,282	20,512.50	0.08

338	600388	龙净环保	2,404	20,482.08	0.08
339	601333	广深铁路	9,654	20,466.48	0.08
340	601718	际华集团	7,200	20,304.00	0.08
341	600635	大众公用	5,661	20,209.77	0.08
342	601200	上海环境	1,670	19,989.90	0.08
343	600056	中国医药	1,642	19,950.30	0.08
344	600776	东方通信	1,600	19,840.00	0.08
345	600195	中牧股份	1,657	19,817.72	0.08
346	600804	鹏博士	4,062	19,660.08	0.08
347	600435	北方导航	2,474	19,643.56	0.08
348	601828	美凯龙	1,630	19,560.00	0.08
349	600864	哈投股份	3,246	19,540.92	0.08
350	601000	唐山港	8,069	19,446.29	0.08
351	600062	华润双鹤	1,627	19,377.57	0.08
352	601991	大唐发电	7,233	19,095.12	0.08
353	601311	骆驼股份	1,650	19,090.50	0.08
354	600582	天地科技	4,864	18,969.60	0.08
355	603568	伟明环保	827	18,880.41	0.08
356	600095	湘财股份	1,600	18,736.00	0.08
357	600072	中船科技	1,600	18,400.00	0.07
358	600673	东阳光	4,054	18,202.46	0.07
359	600094	大名城	4,800	18,096.00	0.07
360	601608	中信重工	4,809	17,985.66	0.07
361	600391	航发科技	831	17,957.91	0.07
362	600006	东风汽车	2,453	17,906.90	0.07
363	603279	景津环保	800	17,728.00	0.07
364	601952	苏垦农发	1,690	17,542.20	0.07
365	600685	中船防务	841	17,492.80	0.07
366	601611	中国核建	2,400	17,328.00	0.07
367	600633	浙数文化	2,411	17,310.98	0.07
368	600546	山煤国际	2,400	17,232.00	0.07
369	600984	建设机械	1,600	17,136.00	0.07
370	603888	新华网	800	16,936.00	0.07
371	600556	天下秀	1,600	16,896.00	0.07
372	600138	中青旅	1,600	16,800.00	0.07
373	601212	白银有色	6,400	16,704.00	0.07
374	600901	江苏租赁	3,200	16,640.00	0.07
375	600422	昆药集团	1,682	16,315.40	0.07
376	600740	山西焦化	3,203	16,271.24	0.07

377	600682	南京新百	1,600	16,096.00	0.07
378	600373	中文传媒	1,600	15,776.00	0.06
379	601958	金钼股份	2,416	15,655.68	0.06
380	600377	宁沪高速	1,600	15,616.00	0.06
381	600490	鹏欣资源	4,048	15,584.80	0.06
382	600566	济川药业	851	15,232.90	0.06
383	600863	内蒙华电	6,427	14,974.91	0.06
384	600581	八一钢铁	2,400	14,832.00	0.06
385	603118	共进股份	1,600	14,768.00	0.06
386	603708	家家悦	836	14,521.32	0.06
387	603113	金能科技	800	14,448.00	0.06
388	603323	苏农银行	3,240	14,191.20	0.06
389	600312	平高电气	2,427	14,173.68	0.06
390	600116	三峡水利	1,673	13,986.28	0.06
391	600277	亿利洁能	4,062	13,688.94	0.06
392	600339	中油工程	4,800	13,632.00	0.06
393	600751	海航科技	4,800	13,344.00	0.05
394	600835	上海机电	817	13,276.25	0.05
395	601011	宝泰隆	3,200	13,152.00	0.05
396	600073	上海梅林	1,602	13,120.38	0.05
397	601778	晶科科技	2,400	13,104.00	0.05
398	600823	世茂股份	3,200	12,928.00	0.05
399	600787	中储股份	2,425	12,925.25	0.05
400	601528	瑞丰银行	824	12,829.68	0.05
401	600789	鲁抗医药	1,680	12,364.80	0.05
402	600125	铁龙物流	2,462	12,137.66	0.05
403	600648	外高桥	816	12,060.48	0.05
404	600466	蓝光发展	4,080	12,036.00	0.05
405	603766	隆鑫通用	3,250	11,797.50	0.05
406	600750	江中药业	877	11,620.25	0.05
407	600108	亚盛集团	4,091	11,577.53	0.05
408	603377	东方时尚	1,056	11,288.64	0.05
409	600855	航天长峰	834	11,108.88	0.04
410	601139	深圳燃气	1,691	11,092.96	0.04
411	600748	上实发展	2,400	11,040.00	0.04
412	601228	广州港	3,200	10,176.00	0.04
413	601949	中国出版	1,600	10,160.00	0.04
414	600093	易见股份	1,700	10,081.00	0.04
415	601069	西部黄金	800	10,008.00	0.04

416	601298	青岛港	1,600	9,888.00	0.04
417	600350	山东高速	1,600	9,840.00	0.04
418	600640	号百控股	800	9,752.00	0.04
419	600783	鲁信创投	809	9,602.83	0.04
420	600299	安迪苏	800	9,568.00	0.04
421	601890	亚星锚链	1,600	9,552.00	0.04
422	600335	国机汽车	1,600	9,488.00	0.04
423	601003	柳钢股份	1,600	9,440.00	0.04
424	603056	德邦股份	800	8,792.00	0.04
425	600343	航天动力	852	8,426.28	0.03
426	601606	长城军工	800	8,264.00	0.03
427	603053	成都燃气	800	8,128.00	0.03
428	601187	厦门银行	800	7,584.00	0.03
429	600903	贵州燃气	800	7,360.00	0.03
430	603256	宏和科技	800	7,312.00	0.03
431	603105	芯能科技	800	7,208.00	0.03
432	601330	绿色动力	800	7,112.00	0.03
433	603815	交建股份	800	6,960.00	0.03
434	601609	金田铜业	800	6,944.00	0.03

注：股票明细不包含可退替代款估值增（减）值。

## 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	688111	金山办公	345,072.00	1.49
2	601816	京沪高铁	325,555.00	1.40
3	600919	江苏银行	251,904.00	1.09
4	601988	中国银行	180,456.00	0.78
5	603486	科沃斯	155,032.00	0.67
6	603127	昭衍新药	122,838.00	0.53
7	603737	三棵树	118,220.00	0.51
8	601658	邮储银行	108,622.00	0.47
9	600900	长江电力	105,223.00	0.45
10	600809	山西汾酒	100,914.00	0.43

11	688029	南微医学	99,893.46	0.43
12	601186	中国铁建	96,522.00	0.42
13	603160	汇顶科技	96,200.00	0.41
14	603659	璞泰来	95,951.00	0.41
15	603345	安井食品	95,422.00	0.41
16	688363	华熙生物	94,996.00	0.41
17	600905	三峡能源	82,150.00	0.35
18	603893	瑞芯微	81,732.00	0.35
19	600763	通策医疗	64,132.00	0.28
20	601916	浙商银行	62,227.00	0.27

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	600809	山西汾酒	489,483.40	2.11
2	601899	紫金矿业	463,988.48	2.00
3	600438	通威股份	308,442.00	1.33
4	600893	航发动力	182,621.00	0.79
5	600905	三峡能源	140,430.00	0.61
6	601799	星宇股份	126,201.00	0.54
7	603345	安井食品	89,886.00	0.39
8	600563	法拉电子	72,117.26	0.31
9	603127	昭衍新药	71,430.00	0.31
10	600115	中国东航	68,591.56	0.30
11	600760	中航沈飞	60,416.00	0.26
12	603267	鸿远电子	57,356.00	0.25
13	600637	东方明珠	53,187.80	0.23
14	601963	重庆银行	48,568.00	0.21
15	600906	财达证券	46,668.05	0.20
16	600221	*ST 海航	46,170.00	0.20
17	601009	南京银行	44,555.00	0.19
18	600208	新湖中宝	42,801.03	0.18
19	600004	白云机场	40,930.70	0.18
20	600346	恒力石化	40,826.00	0.18

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	5,242,063.71
卖出股票收入（成交）总额	5,084,783.73

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

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）	9,000.00	0.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	9,000.00	0.04

### 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

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	113051	节能转债	50	5,000.00	0.02
2	113049	长汽转债	20	2,000.00	0.01
2	113626	伯特转债	20	2,000.00	0.01

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

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：本基金本报告期末未持有权证。



## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

### 7.10.2 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。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

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

本基金本报告期末投资的前十名证券中，江苏银行（600919）因费用管理、资金往来、理财非标融资项目重复融资等行为受到行政处罚。对该股票投资决策程序的说明：根据我司的基金投资管理相关制度，以相应的研究报告为基础，结合其未来增长前景，由基金经理决定具体投资行为。

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

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

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	333.86
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	61.74
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	395.60

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票未存在流通受限的情况。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

#### 8.1.1 本基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
705	5,998.81	1,702,573.00	40.26%	2,526,588.00	59.74%

#### 8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额（份）	占总份额比例
联接基金	1,698,200.00	40.15%

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额 比例
1	钱中明	409,963.00	9.69%
2	徐钧	106,000.00	2.51%
3	邝紫葡	64,351.00	1.52%
4	方蓉	55,640.00	1.32%
5	孙莉玫	50,964.00	1.21%
6	郝晋华	50,000.00	1.18%
7	黄文华	45,900.00	1.09%
8	徐绿军	44,700.00	1.06%
9	王秀芬	41,940.00	0.99%
10	周佩勇	32,282.00	0.76%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

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

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（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	4,229,161.00
本报告期基金总申购份额	500,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	500,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	4,229,161.00

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2021 年 5 月 19 日，经公司董事会批准陈晖女士不再担任公司督察长，刘万方先生担任公司督察长并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。

本报告期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

报告期内基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 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	
国泰君安	2	10,061,568.19	100.00%	9,370.54	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。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国泰君安	90,309.90	100.00%	-	-	-	-

### 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	2021年6月22日
2	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金参与华安证券股份有限公司配股的公告	证监会规定报刊和网站	2021年6月11日
3	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	2021年6月3日
4	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参与珠海盈米基金销售有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2021年6月2日

5	华泰柏瑞基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证监会规定报刊和网站	2021年5月21日
6	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	2021年5月20日
7	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参加浙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	2021年4月30日
8	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止上海尚善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	2021年4月27日
9	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参与蚂蚁（杭州）基金销售有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2021年4月20日
10	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第3号指数基金指引》修改基金合同和托管协议的公告	证监会规定报刊和网站	2021年3月27日
11	关于终止包商银行股份有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	证监会规定报刊和网站	2021年2月9日
12	华泰柏瑞基金管理有限公司关于网上直销直连招商银行升级签约方式的提示性公告	证监会规定报刊和网站	2021年1月14日
13	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金参加北京增财基金销售有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2021年1月7日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-



联接基金	1	20210101-20210630;	1,673,000.00	90,000.00	64,800.00	1,698,200.00	40.15%
产品特有风险							
<p>本基金报告期内有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。</p>							

### 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

### 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

2021 年 8 月 28 日