

华泰柏瑞创业板科技交易型开放式指数证  
券投资基金  
2021 年第 4 季度报告

2021 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：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2022 年 1 月 24 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 1 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 10 月 1 日起至 2021 年 12 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	创科技 ETF
场内简称	创科技 ETF
基金主代码	159773
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 9 月 23 日
报告期末基金份额总额	87,503,120.00 份
投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	1、股票的投资策略；2、债券投资策略；3、股指期货的投资策略；4、资产支持证券的投资策略；5、融资及转融通证券出借业务；6、存托凭证的投资策略；
业绩比较基准	创业板科技指数收益率。
风险收益特征	本基金属于股票型基金中的指数型基金，采用完全复制的被动式投资策略，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征：一方面，相对于混合型基金、债券型基金与货币市场基金而言，其风险和收益较高；另一方面，相对于采用抽样复制的指数型基金而言，其风险和收益特征将更能与标的指数保持基本一致。
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2021 年 10 月 1 日-2021 年 12 月 31 日）
1. 本期已实现收益	7,439,838.89
2. 本期利润	8,066,557.40
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0624
4. 期末基金资产净值	91,133,411.65
5. 期末基金份额净值	1.0415

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。

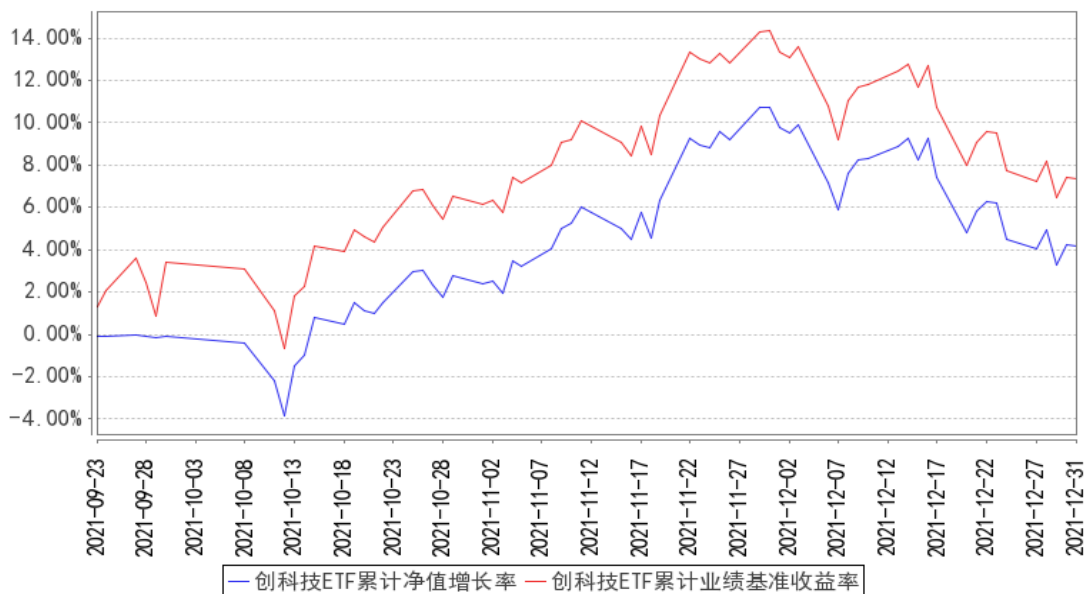
### 3.2 基金净值表现

#### 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	净值增长率 ①	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	4.23%	1.10%	3.81%	1.12%	0.42%	-0.02%
自基金合同 生效起至今	4.15%	1.05%	7.35%	1.16%	-3.20%	-0.11%

#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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

创科技ETF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：1. 图示日期为 2021 年 9 月 23 日至 2021 年 12 月 31 日。

2. 按基金合同规定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期，截至报告期末本基金的各项投资比例已达到基金合同投资范围中规定的比例。

3. 自基金合同生效起至本报告期末不满一年。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
谭弘翔	指数投资部总监助理、本基金的基金经理	2021 年 9 月 23 日	-	5 年	美国伊利诺伊大学厄巴纳香槟分校金融工程专业硕士。曾任上海证券交易所产品创新中心基金业务部经理。2020 年 7 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，任指数投资部部门总监助理。2021 年 3 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 4 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、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。2021 年 6 月起任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的基金经理。2021 年 9 月起任华泰柏瑞创业板科技交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 11 月起任华泰柏瑞中证沪港深品牌消费 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 12 月起任华泰柏瑞中证稀土产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。

#### 4.1.1 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

报告期内本基金的运作符合相关法律、法规以及基金合同的约定，不存在损害基金持有人利益的行为。

### 4.3 公平交易专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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，通过科学完善的制度及流程，从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能的利益输送。首先投资部和研究部通过规范的决策流程来确保公平对待不同投资组合。其次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，在交易过程中启用投资交易系统内的公平交易模块，确保公平交易的实施。同时，风险管理部对报告期内的交易进行日常监控和分析评估。本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本报告期内无下列情况：所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%。

### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2021 年四季度市场以结构性机会为主。其中传媒、国防军工、通信、电气设备、汽车等行业录得正收益，期间传媒行业指数上涨达 20.61%，国防军工行业指数上涨达 16.39%。整体来看，沪深 300、中证 500、中证 1000 和创业板涨跌幅分别为 1.52%、3.60%、8.17%、和 2.40%。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 0.10%和 2.30%，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。期间，创业板科技指数上涨 3.81%，相比沪深 300 指数和中证 500 指数的超额收益分别为 2.29%和 0.21%。

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 0.048%，期间日跟踪误差为 0.069%，较好地实现了本基金的投资目标。

2021 年底召开的中央经济工作会议指出，2022 年我国经济发展面临需求收缩、供给冲击、预期转弱三重压力，叠加美联储预计加息时点不断提前，鹰声嘹亮，虽然我国凭借对于通货膨胀较为有力的控制和较为充足的货币政策空间，能够通过灵活适度的货币政策操作在一定程度上对冲经济下行压力，但流动性依然很难进入总量宽松区间，而有限的资源必将向最为紧要，最为关键的方向倾斜，因此市场仍将以结构性机会为主。

而在这之中，科技创新依然是重中之重。虽然 2022 年的政策主基调为“稳字当头，稳中求进”，大部分工作的出发点都将基于保障就业和扶持中小微企业，但我们同样强调发展是解决一切问题的根本途径，在做大高质量发展“蛋糕”，提高社会总体效益的过程中完善分配制度才能最大程

度上减小改革阻力,而通过科技创新提高全要素生产率是当前内外部环境多重约束下可行性最强,副作用最小的方式。因此可以看到,在近期发布的《要素市场化配置综合改革试点总体方案》等一系列政策文件中,对土地、劳动力、资本、数据等各类要素的改革方向均是以公平化为主,或者兼顾公平和效率,仅技术要素的改革重点是完全向提升效率,充分激励科技人才的积极性,释放科技创新创业潜力,可见科技创新在 2022 年乃至未来更长时期内都被赋予了经济增长主引擎的使命。因此,科技类上市公司一旦在关键核心技术方面能够实现突破,那么不断完善科技成果转化体制机制和扩大后的内需都将使其快速拥有稳定的现金流和基本面,为股价上涨提供强劲动力。

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

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末的基金份额净值为 1.0415 元,本报告期基金份额净值增长率为 4.23%,同期业绩比较基准收益率为 3.81%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

## § 5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	90,076,309.42	98.63
	其中:股票	90,076,309.42	98.63
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,117,016.14	1.22
8	其他资产	131,689.63	0.14
9	合计	91,325,015.19	100.00

注:上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	74,560,645.75	81.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,734,795.96	13.97
J	金融业	1,518,090.00	1.67
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,062,380.00	1.17
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	89,875,911.71	98.62

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

### 5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	126,055.54	0.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	6,806.19	0.01
F	批发和零售业	27,119.77	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,198.51	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-

L	租赁和商务服务业		
M	科学研究和技术服务业	37,217.70	0.04
N	水利、环境和公共设施管理业		
O	居民服务、修理和其他服务业		
P	教育		
Q	卫生和社会工作		
R	文化、体育和娱乐业		
S	综合		
	合计	200,397.71	0.22

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

### 5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期内未持有港股通股票。

### 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 5.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	14,500	8,526,000.00	9.36
2	300760	迈瑞医疗	19,786	7,534,508.80	8.27
3	300014	亿纬锂能	59,900	7,078,982.00	7.77
4	300274	阳光电源	47,100	6,867,180.00	7.54
5	300124	汇川技术	83,190	5,706,834.00	6.26
6	300122	智飞生物	38,200	4,759,720.00	5.22
7	300142	沃森生物	81,500	4,580,300.00	5.03
8	300782	卓胜微	10,400	3,398,720.00	3.73
9	300408	三环集团	59,400	2,649,240.00	2.91
10	300207	欣旺达	55,500	2,339,880.00	2.57

#### 5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	301136	C 招标	3,284	34,547.68	0.04
2	301099	雅创电子	293	20,908.48	0.02
3	001296	长江材料	310	18,376.80	0.02
4	301155	海力风电	117	11,319.75	0.01
5	301118	恒光股份	189	9,264.78	0.01

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合



注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 5.5 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债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 5.7 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。

#### 5.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 5.9.1 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。

##### 5.9.2 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。

#### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 5.10.1 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。

##### 5.10.2 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。

##### 5.10.3 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。

#### 5.11 投资组合报告附注

##### 5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金本报告期末投资的前十名证券中，沃森生物（300142）于 2021 年 7 月 3 日公告收到中

国证券监督管理委员会云南监管局出具的行政监管措施决定书，对横琴沃森的投资决策和投后管理过程中，投资决策程序执行不到位，并且投后跟踪管理不到位，导致违反了《企业内部控制应用指引第 6 号——资金活动》第十二条至第十五条的规定行为，采取责令改正的行政监管措施。对该证券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其他前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的情形，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	61,287.58
2	应收证券清算款	67,463.27
3	应收股利	-
4	应收利息	2,938.78
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	131,689.63

### 5.11.4 报告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。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	301136	C 招标	34,547.68	0.04	新股未上市
2	301099	雅创电子	20,908.48	0.02	新股锁定期内
3	301155	海力风电	11,319.75	0.01	新股锁定期内
4	301118	恒光股份	9,264.78	0.01	新股锁定期内

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	292,303,120.00
报告期期间基金总申购份额	84,800,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	289,600,000.00
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	87,503,120.00

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：无。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：无。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20211020-20211020;	40,000,000.00	0.00	30,400,000.00	9,600,000.00	10.97

#### 产品特有风险

本基金报告期内有单一持有人持有基金份额超过 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。

## 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、本基金的中国证监会批准募集文件
- 2、本基金的《基金合同》
- 3、本基金的《招募说明书》
- 4、本基金的《托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、本基金的公告

### 9.2 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

### 9.3 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

2022 年 1 月 24 日