

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 2022 年第 2 季度报告

2022 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：中国银河证券股份有限公司

报告送出日期：2022 年 7 月 21 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。

基金托管人中国银河证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 7 月 20 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 2022 年 4 月 1 日起至 2022 年 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	华泰柏瑞中证稀土产业 ETF 发起式联接
基金主代码	014331
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 12 月 14 日
报告期末基金份额总额	114,114,769.46 份
投资目标	紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资策略	在正常市场情况下，本基金与业绩比较基准的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。
业绩比较基准	中证稀土产业指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为华泰柏瑞中证稀土产业 ETF 的联接基金，主要投资于目标 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪。因此，本基金的业绩表现与中证稀土产业指数的表现密切相关。本基金的风险与收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	中国银河证券股份有限公司

下属分级基金的基金简称	华泰柏瑞中证稀土产业 ETF 发起式联接 A	华泰柏瑞中证稀土产业 ETF 发起式联接 C
下属分级基金的交易代码	014331	014332
报告期末下属分级基金的份额总额	22,294,076.33 份	91,820,693.13 份

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞中证稀土产业交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	516780
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 2 月 26 日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2021 年 3 月 8 日
基金管理人名称	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人名称	中国银河证券股份有限公司

2.1.2 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金力争将日均跟踪偏离度控制在 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 以内。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整；当标的指数进行定期调整、指数样本空间或者编制规则变更时，本基金将根据标的指数的编制规则及调整公告，及时进行投资组合的优化调整，尽量降低跟踪误差，力争将日均跟踪偏离度控制在 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 以内。
业绩比较基准	中证稀土产业指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期风险与收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金；本基金为指数型基金，主要采用完全复制策略，跟踪中证稀土产业指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

§ 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（2022 年 4 月 1 日-2022 年 6 月 30 日）	
	华泰柏瑞中证稀土产业 ETF 发起式联接 A	华泰柏瑞中证稀土产业 ETF 发起式联接 C
1. 本期已实现收益	-1,129,908.65	-4,771,957.89
2. 本期利润	2,129,529.79	8,990,539.52
3. 加权平均基金份额本期利润	0.1031	0.1036
4. 期末基金资产净值	20,371,553.42	83,788,939.04
5. 期末基金份额净值	0.9138	0.9125

注：1、所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

华泰柏瑞中证稀土产业 ETF 发起式联接 A

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	11.93%	2.48%	12.37%	2.58%	-0.44%	-0.10%
过去六个月	-7.57%	2.20%	-8.85%	2.31%	1.28%	-0.11%
自基金合同生效起至今	-8.62%	2.10%	-14.52%	2.23%	5.90%	-0.13%

华泰柏瑞中证稀土产业 ETF 发起式联接 C

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	11.85%	2.48%	12.37%	2.58%	-0.52%	-0.10%
过去六个月	-7.69%	2.20%	-8.85%	2.31%	1.16%	-0.11%
自基金合同生效起至今	-8.75%	2.10%	-14.52%	2.23%	5.77%	-0.13%

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

华泰柏瑞中证稀土产业ETF发起式联接A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



华泰柏瑞中证稀土产业ETF发起式联接C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2021年12月14日至2022年6月30日。

§ 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12月14日	-	6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，任指数投资部门总监助理。2021年3月起任

				<p>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。2022 年 1 月起任华泰柏瑞中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	--

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遵规守信情况的说明

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

上海新冠疫情的爆发使得国内经济短期内失速，中美利差开始倒挂，市场情绪恐慌，迎来短暂的股债汇三杀，上证指数最低收于 2863 点。4 月底至今的反弹，在稳增长措施不断发力以及国内疫情逐步得到控制的背景下，市场交易最差的时期已经过去，经济迎来修复。5 月，经济基本面有所恢复，工业增加值出现正增长，设备制造业受益于物流打通和供应链修复，改善幅度较大。复工复产推动企业加快赶工，出口大超预期。疫情对消费的负面影响约为 4 月的 70%，未来有望继续修复。4 月之前房地产由于政策预期的反转，如期看到基本面的大幅改善，地产成交数据降幅大幅收窄。汽车销售 5 月改善，新能源车 6 月同比继续高增长。猪肉周期底部回升以及成品油价格上升带来的输入性通胀压力下，预计下半年国内通胀中枢将小幅抬升，温和通胀的环境下利率中枢难以大幅下行。

从配置的角度，中国经济从衰退到复苏，美国经济从过热到衰退，中美经济周期持续错位，使得中国市场走出了相对独立的行情。从年初至今市场交易逻辑来看，房地产和消费的交易逻辑是正相关的，受到“稳增长预期兑现”或者“复苏预期”的牵引；从投资主线来看，依然看好下半年稳增长政策的落地以及复苏逻辑两条主线。受此影响，大盘股或将更加受益。

2022 年二季度市场强势反弹，其中汽车、食品饮料、电气设备、商业贸易、家用电器等行业录得正收益，期间汽车指数上涨达 23.09%，食品饮料上涨达 20.19%。整体来看，沪深 300、中证 500、中证 1000 和创业板的涨跌幅分别为 6.21%、2.04%、3.30%、和 5.68%。从市场风格来看，成长风格表现优于价值风格，期间沪深 300 成长指数和沪深 300 价值指数的涨跌幅分别为 10.85%和 -1.72%，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，本基金的日均绝对跟踪偏离度为 0.065%，期间日跟踪误差为 0.082%，较好地实现了本基金的投资目标。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末华泰柏瑞中证稀土产业 ETF 发起式联接 A 的基金份额净值为 0.9138 元，本报告期基金份额净值增长率为 11.93%，同期业绩比较基准收益率为 12.37%，截至本报告期末华泰柏瑞中证稀土产业 ETF 发起式联接 C 的基金份额净值为 0.9125 元，本报告期基金份额净值增长率为 11.85%，同期业绩比较基准收益率为 12.37%。

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	16,155.12	0.02
	其中：股票	16,155.12	0.02
2	基金投资	96,008,211.04	89.47
3	固定收益投资	614,573.92	0.57
	其中：债券	614,573.92	0.57
	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	6,900,105.50	6.43
8	其他资产	3,763,885.90	3.51
9	合计	107,302,931.48	100.00

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	16,155.12	0.02
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	-	-
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	-	-
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	16,155.12	0.02

5.2.2 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	300811	铂科新材	166	16,155.12	0.02

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	614,573.92	0.59
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	614,573.92	0.59

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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	019641	20 国债 11	6,000	614,573.92	0.59

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。

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 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	华泰柏瑞中证稀土产业交易型开放式指数证券投资基金	指数型	交易型开放式(ETF)	华泰柏瑞基金管理有限公司	96,008,211.04	92.17

5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 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。

5.12 投资组合报告附注

5.12.1 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

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

5.12.2 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情形。

5.12.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	100,685.36

2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,663,200.54
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	3,763,885.90

5.12.4 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。

5.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：截至本报告期末，本基金前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华泰柏瑞中证稀土产业 ETF 发起式联接 A	华泰柏瑞中证稀土产业 ETF 发起式联接 C
报告期期初基金份额总额	19,874,101.73	86,121,059.22
报告期期间基金总申购份额	6,009,377.32	62,892,269.60
减：报告期期间基金总赎回份额	3,589,402.72	57,192,635.69
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	22,294,076.33	91,820,693.13

§ 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

单位：份

项目	华泰柏瑞中证稀土产业 ETF 发起式联接 A	华泰柏瑞中证稀土产业 ETF 发起式联接 C
报告期期初管理人持有的本基金份额	10,001,875.00	0.00
报告期期间买入/申购总份额	0.00	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,001,875.00	0.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总	8.76	0.00

份额比例 (%)		
----------	--	--

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 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总 份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总 份额比例(%)	发起份额承 诺持有期限
基金管理人固 有资金	10,001,875.00	8.76	10,001,875.00	8.76	3 年
基金管理人高 级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人 员	-	-	-	-	-
基金管理人股 东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,001,875.00	8.76	10,001,875.00	8.76	-

§ 9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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

注：本基金本报告期内未有单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无。

§ 10 备查文件目录

10.1 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

10.2 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

10.3 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） 021-38784638 公司网址：www.huatai-pb.com

华泰柏瑞基金管理有限公司
2022 年 7 月 21 日