

华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券 投资基金 2022 年中期报告

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：中国银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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 2022 年 8 月 29 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 2022 年 1 月 1 日起至 2022 年 6 月 30 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	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	20
§ 7 投资组合报告	52
7.1 期末基金资产组合情况	52
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	53
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	54
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	68
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	69
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	69

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	69
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	69
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	69
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	69
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	69
7.12 投资组合报告附注	70
§ 8 基金份额持有人信息	71
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	71
8.2 期末上市基金前十名持有人	71
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	71
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情况	71
§ 9 开放式基金份额变动	71
§ 10 重大事件揭示	72
10.1 基金份额持有人大会决议	72
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	72
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	72
10.4 基金投资策略的改变	72
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	72
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	72
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	72
10.8 其他重大事件	76
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	76
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	76
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	77
§ 12 备查文件目录	77
12.1 备查文件目录	77
12.2 存放地点	77
12.3 查阅方式	77

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华泰柏瑞中证 500ETF
场内简称	ETF500（扩位证券简称：中证 500 指数 ETF）
基金主代码	512510
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2015 年 5 月 13 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	320,929,801.00 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	2015 年 6 月 12 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。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。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。本基金将根据投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。
业绩比较基准	中证 500 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：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。

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	刘万方
	联系电话	021-38601777
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.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 弄证	北京市西城区复兴门内大街 1 号

	大五道口广场 1 号 17 层	
办公地址	上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 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	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.huatai-pb.com
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	北京市西城区太平桥大街 17 号
	华泰柏瑞基金管理有限公司	上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022 年 1 月 1 日-2022 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-10,699,507.24
本期利润	-63,092,047.63
加权平均基金份额本期利润	-0.1903
本期加权平均净值利润率	-11.69%
本期基金份额净值增长率	-10.52%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-107,570,372.83
期末可供分配基金份额利润	-0.3352
期末基金资产净值	537,953,708.97
期末基金份额净值	1.6762
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-15.04%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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。

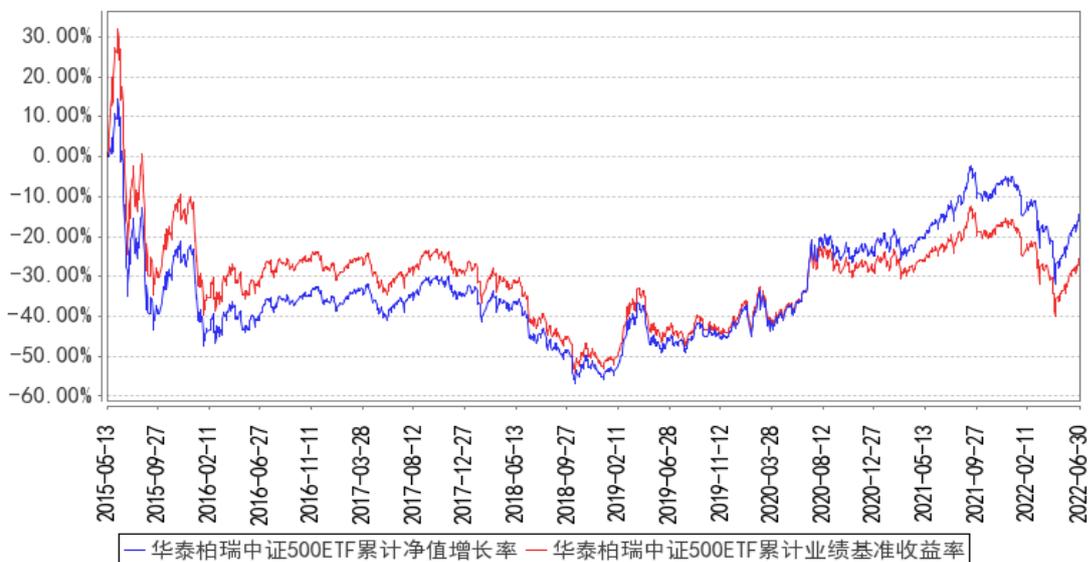
3.2 基金净值表现

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	8.23%	1.10%	7.10%	1.10%	1.13%	0.00%
过去三个月	3.65%	1.74%	2.04%	1.75%	1.61%	-0.01%
过去六个月	-10.52%	1.62%	-12.30%	1.63%	1.78%	-0.01%
过去一年	-0.62%	1.32%	-5.20%	1.33%	4.58%	-0.01%
过去三年	57.92%	1.34%	30.37%	1.35%	27.55%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-15.04%	1.68%	-26.20%	1.70%	11.16%	-0.02%

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

华泰柏瑞中证500ETF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 2015 年 5 月 13 日至 2022 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、华泰柏瑞质量精选混合型证券投资基金、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、华泰柏瑞港股通时代机遇混合型证券投资基金、华泰柏瑞南方东英恒生科技指数交易型开放式指数证券投资基金、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、华泰柏瑞中证沪港深创新药产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞远见智选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金、华泰柏瑞景气成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞创业板科技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发起式联接基金、华泰柏瑞锦元债券型证券投资基金、华泰柏瑞上证红利交易型开放式指

数证券投资基金联接基金、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、华泰柏瑞中证 500 增强策略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发起式联接基金、华泰柏瑞景气汇选三年持有期混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证沪港深云计算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科技交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞聚优智选一年持有期混合型证券投资基金、华泰柏瑞匠心汇选混合型证券投资基金、华泰柏瑞鸿益 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金 (QDII)、华泰柏瑞恒悦混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证全指电力公用事业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 指数增强型证券投资基金、华泰柏瑞鸿裕 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金、华泰柏瑞恒泽混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、华泰柏瑞匠心臻选混合型证券投资基金。截至 2022 年 6 月 30 日, 公司基金管理规模为 2750.48 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	2015 年 5 月 13 日	-	21 年	21 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 月起任上证红利交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2010 年 10 月起担任指数投资部副总监。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 月起任华泰柏瑞沪深 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的基金经理。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 500 交易型开放式指数证券投资基金及华泰柏瑞中证 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

				<p>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 月至 2021 年 4 月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 月至 2021 年 4 月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的基金经理。2021 年 5 月起任华泰柏瑞南方东英恒生科技指数交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2021 年 7 月起任华泰柏瑞中证沪港深创新药产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 8 月起任华泰柏瑞中证全指医疗保健设备与服务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 500 增强策略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。任职日期和离任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

2022 年上半年 A 股市场波动较大，先抑后扬，多数行业表现一般，未录得正收益。煤炭、交通运输、综合板块的表现较好，涨跌幅分别为 31.38%、-0.71%、-1.46%。整体来看，沪深 300、中证 500、中证 1000 和创业板的涨跌幅分别为-9.22%、-12.30%、-12.67%和-15.41%。从市场风格来看，价值风格表现优于成长风格，期间沪深 300 价值指数和沪深 300 成长指数的涨跌幅分别为-6.52%和-13.14%，中证 500 价值相对中证 500 成长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 0.024%，期间日跟踪误差为 0.033%，较好地实现了本基金的投资目标。

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。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.6762 元；本报告期基金份额净值增长率为-10.52%，业绩比较基准收益率为-12.30%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定，基金管理人每季度定期对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，方可对超额收益进行分配；基于本基金的性质和特点，本基金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，即基金收益分配基准日（即收益评价日）的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后可能低于面值；基金收益分配比例为收益评价日符合上述基金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。截止本报告期末，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

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在华泰柏瑞中证 500 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”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	11,172,607.51	9,552,388.44
结算备付金		9,163,500.48	11,216,199.20
存出保证金		2,919,227.60	3,118,943.07
交易性金融资产	6.4.7.2	515,508,208.23	535,476,995.19
其中：股票投资		515,508,208.23	535,387,927.79
基金投资		-	-
债券投资		-	89,067.40

资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		23,898.13	-
应收股利		1,040.00	161.00
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	1,282.61	15,258.10
资产总计		538,789,764.56	559,379,945.00
负债和净资产	附注号	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		6,411.40	602.40
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		119,987.81	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		64,249.51	70,524.90
应付托管费		21,416.48	23,508.30
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	0.66
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	623,990.39	259,848.21
负债合计		836,055.59	354,484.47
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	645,524,081.80	600,267,169.58
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-107,570,372.83	-41,241,709.05
净资产合计		537,953,708.97	559,025,460.53
负债和净资产总计		538,789,764.56	559,379,945.00

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.6762 元，基金份额总额 320,929,801.00 份。

6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-62,385,807.39	55,917,574.88
1. 利息收入		142,898.02	233,336.02
其中：存款利息收入	6.4.7.13	86,919.81	75,257.93
债券利息收入		-	59.48
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		55,978.21	158,018.61
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-10,669,834.86	52,841,736.85
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-13,848,210.14	46,685,505.57
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	91,590.83	29,736.73
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-2,663,706.04	1,932,233.01
股利收益	6.4.7.19	5,750,490.49	4,194,261.54
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-52,392,540.39	2,408,030.15
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	533,669.84	434,471.86
减：二、营业总支出		706,240.24	1,019,521.27
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	400,794.76	384,387.76
2. 托管费	6.4.10.2.2	133,598.19	128,129.25
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支		-	-

出			
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		0.47	6,956.27
8. 其他费用	6.4.7.23	171,846.82	500,047.99
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-63,092,047.63	54,898,053.61
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-63,092,047.63	54,898,053.61
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-63,092,047.63	54,898,053.61

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	600,267,169.58	-	-41,241,709.05	559,025,460.53
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	600,267,169.58	-	-41,241,709.05	559,025,460.53
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	45,256,912.22	-	-66,328,663.78	-21,071,751.56
(一)、综合收益总额	-	-	-63,092,047.63	-63,092,047.63

(二)、 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)	45,256,912.22	-	-3,236,616.15	42,020,296.07
其中:1. 基金申购款	236,341,652.79	-	-41,927,328.02	194,414,324.77
2. 基金赎回款	-191,084,740.57	-	38,690,711.87	-152,394,028.70
(三)、 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)	-	-	-	-
(四)、 其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	645,524,081.80	-	-107,570,372.83	537,953,708.97
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	720,952,268.88	-	-174,193,282.15	546,758,986.73

加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期末期初净资产(基金净值)	720,952,268.88	-	-174,193,282.15	546,758,986.73
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-76,433,896.26	-	70,134,967.21	-6,298,929.05
(一)、综合收益总额	-	-	54,898,053.61	54,898,053.61
(二)、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)	-76,433,896.26	-	15,236,913.60	-61,196,982.66
其中:1.基金申购款	205,164,668.77	-	-46,721,288.13	158,443,380.64
2.基金赎回款	-281,598,565.03	-	61,958,201.73	-219,640,363.30
(三)、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)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	644,518,372.62	-	-104,058,314.94	540,460,057.68

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：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞中证 500 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”)证监许可[2015]508 号《关于准予华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及联接基金注册的批复》核准,由华泰柏瑞基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞中证 500 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 873,771,921.00 元(含募集股票市值),业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第 460 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2015 年 5 月 13 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 873,820,061.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 48,140.00 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《华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《华泰柏瑞中证 500 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 2015 年 6 月 3 日进行了基金份额折算,折算比例为 0.49716235,并于 2015 年 6 月 4 日进行了变更登记。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2015]236 号文审核同意, 本基金 434,429,801.00 份基金份额于 2015 年 6 月 12 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《华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定, 本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。此外, 为更好地实现投资目标, 本基金可少量投资于部分非成份股(包括中小板、创业板以及其他经中国证监会核准发行的股票)、存托凭证、债券(包括国债、金融债、企业/公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、权证、股指期货、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资标的指数成份股、备选成份股的比例不低于基金资产净值的 95%, 且不低于基金非现金资产的 80%。在正常市场情况下, 本基金日均跟踪偏离度(剔除成份股分红因素)的绝对值不超过 0.2%, 年跟踪误差不超过 2%。本基金的业绩比较基准为中证 500 指数。根据《华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下 4 只证券投资基金修改基金合同和托管协议的公告》, 本基金自 2019 年 10 月 16 日起, 新增投资范围: 本基金可根据法律法规的规定, 参与转融通证券出借业务。

华泰柏瑞基金管理有限公司以本基金为目标 ETF, 于 2015 年 5 月 13 日募集成立了华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“华泰柏瑞中证 500ETF 联接基金”)。华泰柏瑞中证 500ETF 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 2022 年 8 月 30 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》、《华泰柏瑞中证 500 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 6.4.4 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。

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 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 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日至 2022 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

除 6.4.5 的会计政策变更外，其他项目与上年度一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（以下合称“新金融工具准则”），财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《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〉》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

(a) 金融工具

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，将金融工具分类为以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

新金融工具准则要求对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。金融资产减值计量方式的变更对于本基金的影响不重大。

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。

(i) 于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息和应收股利，金额分别为 9,552,388.44 元、11,216,199.20 元、3,118,943.07 元、15,258.10 元和 161.00 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息和应收股利，金额分别为 9,553,367.64 元、11,221,256.76 元、3,118,968.15 元、9,183.89 元和 161.00 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 535,476,995.19 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 535,477,007.56 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付管理人报酬、应付托管费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 70,524.90 元、23,508.30 元、37,129.83 元和 42,718.38 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付管理人报酬、应付托管费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 70,524.90 元、23,508.30 元、37,129.83 元和 42,718.38 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融负债为交易性金融负债，金额为 602.40 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融负债为交易性金融负债，金额为 602.40 元。

i) 于 2021 年 12 月 31 日，“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，本基金无期初留存收益影响。

(b) 修订后的《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>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《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>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的

补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	11,172,607.51

等于：本金	11,171,656.85
加：应计利息	950.66
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	11,172,607.51

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	534,040,878.04	-	515,508,208.23	-18,532,669.81
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	534,040,878.04	-	515,508,208.23	-18,532,669.81

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生 工具	-	-	-	
货币衍生 工具	-	-	-	
权益衍生	19,573,160.00	-	-	

工具				
其中：股指期货投资	19,573,160.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	19,573,160.00	-	-	

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2209	中证 500 期货 2209 合约	16.00	20,364,800.00	791,640.00
合计				791,640.00
减：可抵销期货暂收款				791,640.00
净额				-

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

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：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有债权。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末未持有债权。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他债权。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末未持有其他债权。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具。

6.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应收利息	-
其他应收款	1,282.61
待摊费用	-
合计	1,282.61

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022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	-
应付交易费用	94,265.62
其中：交易所市场	94,265.62
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	89,260.15
应付指数使用费	80,158.95
应退退补款	360,305.67
合计	623,990.39

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	298,429,801.00	600,267,169.58
本期申购	117,500,000.00	236,341,652.79
本期赎回（以“-”号填列）	-95,000,000.00	-191,084,740.57
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	320,929,801.00	645,524,081.80

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。

6.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期末无其他综合收益。

6.4.7.12 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
本期期初	89,015,112.76	-130,256,821.81	-41,241,709.05
本期利润	-10,699,507.24	-52,392,540.39	-63,092,047.63
本期基金份额交易产生的变动数	7,475,291.93	-10,711,908.08	-3,236,616.15
其中：基金申购款	34,815,980.57	-76,743,308.59	-41,927,328.02
基金赎回款	-27,340,688.64	66,031,400.51	38,690,711.87
本期已分配利润	-	-	-
本期末	85,790,897.45	-193,361,270.28	-107,570,372.83

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2022年1月1日至2022年6月30日	
活期存款利息收入	18,074.14	
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	68,295.46	
其他	550.21	
合计	86,919.81	

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2022年1月1日至2022年6月30日	
股票投资收益——买卖股票差价收入	-10,803,389.02	
股票投资收益——赎回差价收入	-3,044,821.12	
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	-13,848,210.14

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	167,142,858.96
减：卖出股票成本总额	177,615,620.50
减：交易费用	330,627.48
买卖股票差价收入	-10,803,389.02

6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
赎回基金份额对价总额	152,394,028.70
减：现金支付赎回款总额	78,634,650.70
减：赎回股票成本总额	76,804,199.12
减：交易费用	-
赎回差价收入	-3,044,821.12

6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益——申购差价收入。

6.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益——证券出借差价收入。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	125.15
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	91,465.68
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	91,590.83

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
----	----------------------------

卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	580,624.84
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	489,000.00
减：应计利息总额	141.40
减：交易费用	17.76
买卖债券差价收入	91,465.68

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 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。

6.4.7.17.2 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——买卖贵金属差价收入。

6.4.7.17.3 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——赎回差价收入。

6.4.7.17.4 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——申购差价收入。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 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——买卖权证差价收入。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	-2,663,706.04

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	5,750,490.49
其中：证券出借权益补偿收入	11,189.00
基金投资产生的股利收益	-
合计	5,750,490.49

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-52,881,420.39
股票投资	-52,871,352.99
债券投资	-10,067.40
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	488,880.00
权证投资	-
期货投资	488,880.00
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	-52,392,540.39

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	533,669.84
合计	533,669.84

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。

6.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
指数使用费	80,158.95
银行划款手续费	2,412.64
存托服务费	15.08
合计	171,846.82

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

截至资产负债表日，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

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。

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（“华泰柏瑞基金”）	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（“中国银行”）	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
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（“中证 500ETF 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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例(%)
华泰证券	1,454,461.83	0.41	90,251,878.27	22.74

6.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期与上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
华泰证券	190.97	0.17	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
华泰证券	11,850.44	22.74	10,926.14	34.93

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

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 2022年1月1日至2022年6 月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	400,794.76	384,387.76
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 0.15% 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 × 0.15% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	133,598.19	128,129.25

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 0.05% 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 × 0.05% / 当年天数。

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：本基金本期与上年度可比期间未发生与关联方进行的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

单位：人民币元

本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
华泰证券	41,530,647.00	48,124.30	192,400.00	1,040.00
上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
华泰证券	-	-	-	-

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

单位：人民币元

本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日										
关联方名称	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量（单位：股）	出借期限（单）	费率（%）	利息收入	期末证券出借业务余	期末应收利息余额

						位： 天)			额	
华泰证券	202201 040001 8903	迈克生 物	2022年 1月18 日	177,780. 00	6,000.00	14	3.40	235.06		
华泰证券	202201 040002 3065	利亚德	2022年 1月18 日	126,260. 00	11,800.0 0	14	3.40	166.94		
华泰证券	202201 040002 3071	东方国 信	2022年 1月18 日	133,800. 00	12,000.0 0	14	3.40	176.91		
华泰证券	202201 040002 3099	易华录	2022年 1月18 日	79,580.0 0	2,300.00	14	3.40	105.22		
华泰证券	202201 040002 3101	三聚环 保	2022年 1月18 日	65,440.0 0	8,000.00	14	3.40	86.53		
华泰证券	202201 040002 3109	普利制 药	2022年 1月18 日	218,000. 00	4,000.00	14	3.40	288.24		
华泰证券	202201 040002 3113	昆仑万 维	2022年 1月18 日	306,020. 00	13,000.0 0	14	3.40	404.63		
华泰证券	202201 050000 9089	捷成股 份	2022年 1月19 日	81,500.0 0	12,500.0 0	14	3.40	107.76		
华泰证券	202201 050000 9091	长信科 技	2022年 1月19 日	379,431. 00	29,900.0 0	14	3.40	501.69		
华泰证券	202201 050000 9093	蓝色光 标	2022年 1月19 日	397,120. 00	32,000.0 0	14	3.40	525.08		
华泰证券	202201 060001 0075	昆仑万 维	2022年 1月20 日	26,530.0 0	1,000.00	14	3.40	35.08		
华泰证券	202201 140002 4104	利亚德	2022年 1月28 日	32,730.0 0	3,000.00	14	3.40	43.28		
华泰证券	202201 040002 3067	光威复 材	2022年 2月7日	423,750. 00	5,000.00	28	3.40	1,360. 71		
华泰证券	202201 040002 3093	景嘉微	2022年 2月7日	302,880. 00	2,000.00	28	3.40	972.58		

华泰证券	202201 040002 3121	北京君 正	2022 年 2 月 7 日	382,500. 00	3,000.00	28	3.40	1,228. 25		
华泰证券	202201 180002 3956	东方国 信	2022 年 2 月 7 日	155,160. 00	12,000.0 0	14	3.40	293.08		
华泰证券	202201 180002 3958	三聚环 保	2022 年 2 月 7 日	65,520.0 0	8,000.00	14	3.40	123.76		
华泰证券	202201 180002 3960	昆仑万 维	2022 年 2 月 7 日	293,150. 00	13,000.0 0	14	3.40	553.73		
华泰证券	202201 180002 3964	利亚德	2022 年 2 月 7 日	129,210. 00	11,800.0 0	14	3.40	244.06		
华泰证券	202201 180002 3978	普利制 药	2022 年 2 月 7 日	202,440. 00	4,000.00	14	3.40	382.39		
华泰证券	202201 180002 3984	易华录	2022 年 2 月 7 日	81,167.0 0	2,300.00	14	3.40	153.32		
华泰证券	202201 180002 3986	迈克生 物	2022 年 2 月 7 日	188,820. 00	6,000.00	14	3.40	356.66		
华泰证券	202201 190000 9903	蓝色光 标	2022 年 2 月 7 日	350,400. 00	32,000.0 0	14	3.40	628.77		
华泰证券	202201 190000 9913	捷成股 份	2022 年 2 月 7 日	102,000. 00	12,500.0 0	14	3.40	183.03		
华泰证券	202201 190000 9917	长信科 技	2022 年 2 月 7 日	348,036. 00	29,900.0 0	14	3.40	624.53		
华泰证券	202201 200000 8880	昆仑万 维	2022 年 2 月 7 日	21,710.0 0	1,000.00	14	3.40	36.91		
华泰证券	202201 280001 8814	利亚德	2022 年 2 月 11 日	27,210.0 0	3,000.00	14	3.40	35.98		
华泰证券	202201 180002 6128	华宇软 件	2022 年 2 月 15 日	169,780. 00	13,000.0 0	28	3.40	448.97		
华泰证券	202202 070004	三聚环 保	2022 年 2 月 21	64,800.0 0	8,000.00	14	3.40	85.68		

	3935		日							
华泰证券	202202 070004 3999	利亚德	2022年 2月21 日	107,734. 00	11,800.0 0	14	3.40	142.45		
华泰证券	202202 070004 9253	昆仑万 维	2022年 2月21 日	18,250.0 0	1,000.00	14	3.40	24.13		
华泰证券	202202 070004 9259	昆仑万 维	2022年 2月21 日	237,250. 00	13,000.0 0	14	3.40	313.70		
华泰证券	202202 070004 9269	长信科 技	2022年 2月21 日	295,711. 00	29,900.0 0	14	3.40	391.00		
华泰证券	202202 070004 9279	捷成股 份	2022年 2月21 日	77,500.0 0	12,500.0 0	14	3.40	102.47		
华泰证券	202202 070004 9283	迈克生 物	2022年 2月21 日	160,980. 00	6,000.00	14	3.40	212.85		
华泰证券	202202 070005 4843	蓝色光 标	2022年 2月21 日	273,600. 00	32,000.0 0	14	3.40	361.76		
华泰证券	202202 070005 4875	东方国 信	2022年 2月21 日	132,120. 00	12,000.0 0	14	3.40	174.69		
华泰证券	202202 070005 4885	易华录	2022年 2月21 日	60,375.0 0	2,300.00	14	3.40	79.83		
华泰证券	202202 070004 3911	景嘉微	2022年 3月7日	227,060. 00	2,000.00	28	3.40	600.45		
华泰证券	202202 070004 3915	北京君 正	2022年 3月7日	328,020. 00	3,000.00	28	3.40	867.43		
华泰证券	202202 070005 4825	光威复 材	2022年 3月7日	354,950. 00	5,000.00	28	3.40	938.65		
华泰证券	202202 210003 5697	蓝色光 标	2022年 3月7日	261,440. 00	32,000.0 0	14	3.40	345.68		
华泰证券	202202 210003 5723	三聚环 保	2022年 3月7日	69,520.0 0	8,000.00	14	3.40	91.92		
华泰证券	202202	长信科	2022年	296,608.	29,900.0	14	3.40	392.18		

	210003 5729	技	3月7日	00	0						
华泰证券	202202 210003 5741	迈克生物	2022年 3月7日	163,620. 00	6,000.00	14	3.40	216.34			
华泰证券	202202 210003 5763	易华录	2022年 3月7日	70,219.0 0	2,300.00	14	3.40	92.85			
华泰证券	202202 210004 7309	东方国信	2022年 3月7日	173,400. 00	12,000.0 0	14	3.40	229.27			
华泰证券	202202 210004 7327	利亚德	2022年 3月7日	107,144. 00	11,800.0 0	14	3.40	141.67			
华泰证券	202202 210004 7347	捷成股份	2022年 3月7日	82,625.0 0	12,500.0 0	14	3.40	109.25			
华泰证券	202202 150000 7003	华宇软件	2022年 3月15 日	150,280. 00	13,000.0 0	28	3.40	397.41			
华泰证券	202203 070003 7840	易华录	2022年 3月21 日	60,421.0 0	2,300.00	14	3.40	79.89			
华泰证券	202203 070003 7844	东方国信	2022年 3月21 日	151,560. 00	12,000.0 0	14	3.40	200.40			
华泰证券	202203 070003 7848	长信科技	2022年 3月21 日	264,914. 00	29,900.0 0	14	3.40	350.28			
华泰证券	202203 070004 4340	捷成股份	2022年 3月21 日	72,625.0 0	12,500.0 0	14	3.40	96.03			
华泰证券	202203 070004 4344	蓝色光标	2022年 3月21 日	244,160. 00	32,000.0 0	14	3.40	322.83			
华泰证券	202203 070003 7854	北京君正	2022年 4月6日	312,000. 00	3,000.00	28	3.40	884.00			
华泰证券	202203 210003 2913	蓝色光标	2022年 4月6日	261,120. 00	32,000.0 0	14	3.40	394.58			
上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日											
关联方	合约	证券	成交时	交易金额	交易	出借	费率	利息	期末证	期末应收	

名称	编号	名称	间	数量 (单 位: 股)	期限 (单 位: 天)	(%)	收入	券出借 业务余 额	利息余额
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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 2022年6月30日		上年度末 2021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 (%)
华泰柏瑞中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金	145,897,389.00	45.4608	119,591,289.00	40.0735
华泰证券股份有限公司	5,622,764.00	1.7520	24,102,690.00	8.0765

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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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	11,172,607.51	18,074.14	10,876,647.88	18,004.48

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

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: 张)	总金额
华泰联合证券	301298	东利机械	网下申购	6,340	80,391.20
华泰联合证券	301207	华兰疫苗	网下申购	3,261	185,485.68
华泰联合证券	301256	华融化学	网下申购	18,308	147,379.40

华泰联合证券	301160	翔楼新材	网下申购	3,918	123,652.08
华泰联合证券	600938	中国海油	网上申购	3,000	32,400.00
华泰联合证券	301153	中科江南	网下申购	3,973	133,810.64
上年度可比期间 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：张）	总金额
华泰联合证券	688656	浩欧博	网下申购	1,371	48,341.46
华泰联合证券	688350	富淼科技	网下申购	2,552	34,656.16
华泰联合证券	300952	恒辉安防	网下申购	3,398	39,824.56
华泰联合证券	688083	中望软件	网下申购	1,238	186,319.00
华泰联合证券	605389	长龄液压	网下申购	356	14,026.40
华泰联合证券	688097	博众精工	网下申购	3,983	44,888.41
华泰联合证券	688314	康拓医疗	网下申购	1,085	18,813.90
华泰联合证券	600905	三峡能源	网上申购	34,000	90,100.00
华泰联合证券	688613	奥精医疗	网下申购	2,617	42,997.31
华泰联合证券	605499	东鹏饮料	网下申购	632	29,242.64
华泰联合证券	688161	威高骨科	网下申购	3,069	111,159.18
华泰联合证券	600909	华安证券	配股	54,390	200,155.20

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

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

注：本报告期内本基金未实行利润分配。

6.4.12 期末(2022 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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300834	星辉环材	2022 年 1 月 6 日	6 个月	新股锁定期内	55.57	30.03	373	20,727.61	11,201.19	-
301102	兆讯传媒	2022 年 3 月 15 日	6 个月	新股锁定期内	39.88	31.09	527	21,016.76	16,384.43	-
301103	何氏眼科	2022 年 3 月 14 日	6 个月	新股锁定期内	42.5	32.02	507	16,575.00	16,234.14	-
301110	青木	2022 年	6 个月	新股锁	63.1	39.85	202	12,746.20	8,049.70	-

	股份	3月4日		定期内							
301112	信邦智能	2022年6月20日	6个月	新股锁定期内	27.53	45.04	399	10,984.47	17,970.96		-
301116	益客食品	2022年1月10日	6个月	新股锁定期内	11.4	20.46	577	6,577.80	11,805.42		-
301117	佳缘科技	2022年1月7日	6个月	新股锁定期内	46.8	54.44	262	12,261.60	14,263.28		-
301122	采纳股份	2022年1月19日	6个月	新股锁定期内	50.31	70.37	301	15,143.31	21,181.37		-
301125	腾亚精工	2022年5月27日	6个月	新股锁定期内	22.49	27.42	327	7,354.23	8,966.34		-
301130	西点药业	2022年2月16日	6个月	新股锁定期内	22.55	37.7	237	5,344.35	8,934.90		-
301137	哈焊华通	2022年3月14日	6个月	新股锁定期内	15.37	15.99	644	9,898.28	10,297.56		-
301139	元道通信	2022年6月30日	1个月内(含)	新股未上市	38.46	38.46	5,651	217,337.46	217,337.46		-
301153	中科江南	2022年5月10日	6个月	新股锁定期内	33.68	43.98	398	13,404.64	17,504.04		-
301158	德石股份	2022年1月7日	6个月	新股锁定期内	15.64	20.38	379	5,927.56	7,724.02		-
301160	翔楼新材	2022年5月25日	6个月	新股锁定期内	31.56	37.66	392	12,371.52	14,762.72		-
301175	中科环保	2022年6月30日	1个月内(含)	新股未上市	3.82	3.82	50,318	192,214.76	192,214.76		-
301181	标榜股份	2022年2月11日	6个月	新股锁定期内	40.25	30.59	257	10,344.25	7,861.63		-
301196	唯科科技	2022年1月4日	6个月	新股锁定期内	64.08	37.52	195	12,495.60	7,316.40		-

301200	大族数控	2022年 2月18日	6个月	新股锁定期内	76.56	51.92	360	27,561.60	18,691.20	-
301201	诚达药业	2022年 1月12日	6个月	新股锁定期内	72.69	71.54	338	24,569.22	24,180.52	-
301206	三元生物	2022年 1月26日	6个月	新股锁定期内	109.3	45.69	363	26,450.60	16,585.47	-
301207	华兰疫苗	2022年 2月10日	6个月	新股锁定期内	56.88	56.42	327	18,599.76	18,449.34	-
301212	联盛化学	2022年 4月7日	6个月	新股锁定期内	29.67	33.28	416	12,342.72	13,844.48	-
301215	中汽股份	2022年 2月28日	6个月	新股锁定期内	3.8	6.39	4,743	18,023.40	30,307.77	-
301219	腾远钴业	2022年 3月10日	6个月	新股锁定期内	173.98	87.82	166	16,006.16	14,578.12	-
301220	亚香股份	2022年 6月15日	6个月	新股锁定期内	35.98	39.15	285	10,254.30	11,157.75	-
301222	浙江恒威	2022年 3月2日	6个月	新股锁定期内	33.98	28.96	332	11,281.36	9,614.72	-
301233	盛帮股份	2022年 6月24日	1个月内(含)	新股未上市	41.52	41.52	1,418	58,875.36	58,875.36	-
301233	盛帮股份	2022年 6月24日	6个月	新股锁定期内	41.52	41.52	158	6,560.16	6,560.16	-
301235	华康医疗	2022年 1月21日	6个月	新股锁定期内	39.3	37.93	418	16,427.40	15,854.74	-
301237	和顺科技	2022年 3月16日	6个月	新股锁定期内	56.69	41.86	261	14,796.09	10,925.46	-
301239	普瑞眼科	2022年 6月22日	1个月内(含)	新股未上市	33.65	33.65	5,172	174,037.80	174,037.80	-
301239	普瑞眼科	2022年 6月22日	6个月	新股锁定期内	33.65	33.65	575	19,348.75	19,348.75	-

		日									
301256	华融化学	2022年3月14日	6个月	新股锁定期内	8.05	10.08	1,831	14,739.55	18,456.48		-
301258	富士莱	2022年3月21日	6个月	新股锁定期内	48.3	41.68	295	14,248.50	12,295.60		-
301259	艾布鲁	2022年4月18日	6个月	新股锁定期内	18.39	24.94	483	8,882.37	12,046.02		-
301266	宇邦新材	2022年5月30日	6个月	新股锁定期内	26.86	47.07	517	13,886.62	24,335.19		-
301279	金道科技	2022年4月6日	6个月	新股锁定期内	31.2	22.81	296	9,235.20	6,751.76		-
301288	清研环境	2022年4月14日	6个月	新股锁定期内	19.09	19.98	452	8,628.68	9,030.96		-
301298	东利机械	2022年5月27日	6个月	新股锁定期内	12.68	20.83	634	8,039.12	13,206.22		-
301302	华如科技	2022年6月16日	6个月	新股锁定期内	52.03	56.42	466	24,245.98	26,291.72		-
688102	斯瑞新材	2022年3月9日	6个月	新股锁定期内	10.48	12.23	6,030	63,194.40	73,746.90		-
688119	中钢洛耐	2022年5月27日	6个月	新股锁定期内	5.06	7.01	33,327	168,634.62	233,622.27		-
688237	超卓航科	2022年6月24日	1个月内(含)	新股未上市	41.27	41.27	2,891	119,311.57	119,311.57		-
688259	创耀科技	2022年1月5日	6个月	新股锁定期内	66.6	79.22	1,595	106,227.00	126,355.90		-
688282	理工导航	2022年3月10日	6个月	新股锁定期内	65.21	45.37	3,185	207,693.85	144,503.45		-
688320	禾川科技	2022年4月21日	6个月	新股锁定期内	23.66	46.21	6,048	143,095.68	279,478.08		-
688322	奥比	2022年	1个月	新股未	30.99	30.99	8,529	264,313.71	264,313.71		-

	中光	6 月 30 日	内(含)	上市						
688400	凌云光	2022 年 6 月 27 日	6 个月	新股锁定期内	21.93	21.93	9,132	200,264.76	200,264.76	-

注：1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

2、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

3、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

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
002670	国盛金控	2022 年 6 月 1 日	重大事项停牌	9.60	-	-	97,676	951,178.06	937,689.60	-

注：本基金截至 2022 年 6 月 30 日止持有以上因拟披露重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在该事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值单价	数量(单位：股)	期末估值总额
----	------	------	-------	--------	----------	--------

1	000932	华菱钢铁	2022 年 7 月 11 日	5.09	18,200	92,638.00
2	002183	怡亚通	2022 年 7 月 4 日	7.21	26,000	187,460.00
3	002465	海格通信	2022 年 7 月 4 日	9.09	30,000	272,700.00
4	300012	华测检测	2022 年 7 月 21 日	23.21	9,000	208,890.00
5	300017	网宿科技	2022 年 7 月 11 日	5.36	16,700	89,512.00
6	300037	新宙邦	2022 年 7 月 21 日	52.56	6,000	315,360.00
7	300115	长盈精密	2022 年 7 月 12 日	10.31	8,800	90,728.00
8	300146	汤臣倍健	2022 年 7 月 11 日	21.65	4,300	93,095.00
9	300166	东方国信	2022 年 7 月 12 日	9.22	2,000	18,440.00
10	300253	卫宁健康	2022 年 7 月 12 日	8.78	17,600	154,528.00
11	300285	国瓷材料	2022 年 7 月 21 日	35.92	4,000	143,680.00
12	300482	万孚生物	2022 年 7 月 12 日	40.71	2,200	89,562.00
13	600499	科达制造	2022 年 7 月 21 日	20.64	10,000	206,400.00
14	601058	赛轮轮胎	2022 年 7 月 21 日	11.27	20,000	225,400.00
合计	-	-	-	-	174,800	2,188,393.00

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，将风险控制可在承受的范围之内。

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，本基金以非约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司出借证券，本基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近 1 年的分类结果为 A 类，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 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	89,067.40
未评级	-	-
合计	-	89,067.40

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 2022 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 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间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 2022 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 0.95%。

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未来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、结算备付金和存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 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	11,172,607.51	-	-	-	-	-	11,172,607.51
结算备付金	9,163,500.48	-	-	-	-	-	9,163,500.48
存出保证金	2,919,227.60	-	-	-	-	-	2,919,227.60
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-515,508,208.23	515,508,208.23
应收股利	-	-	-	-	-	1,040.00	1,040.00
应收清算款	-	-	-	-	-	23,898.13	23,898.13
其他资产	-	-	-	-	-	1,282.61	1,282.61
资产总计	23,255,335.59	-	-	-	-	-515,534,428.97	538,789,764.56
负债							
交易性金融负债	-	-	-	-	-	6411.4	6411.4
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	64,249.51	64,249.51
应付托管费	-	-	-	-	-	21,416.48	21,416.48
应付清算款	-	-	-	-	-	119,987.81	119,987.81
其他负债	-	-	-	-	-	623,990.39	623,990.39
负债总计	-	-	-	-	-	836,055.59	836,055.59
利率敏感度缺口	23,255,335.59	-	-	-	-	-514,698,373.38	537,953,708.97
上年度末 2021 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	9,552,388.44	-	-	-	-	-	9,552,388.44
结算备付金	11,216,199.20	-	-	-	-	-	11,216,199.20
存出保证金	50,507.07	-	-	-	-	3,068,436.00	3,118,943.07
交易性金融资产	-	-	-	-89,067.40	535,387,927.79	535,476,995.19	
应收利息	-	-	-	-	-	15,258.10	15,258.10
应收股利	-	-	-	-	-	161.00	161.00
资产总计	20,819,094.71	-	-	-89,067.40	538,471,782.89	559,379,945.00	
负债							
交易性金融负债	-	-	-	-	-	602.40	602.40
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	70,524.90	70,524.90
应付托管费	-	-	-	-	-	23,508.30	23,508.30
应付交易费用	-	-	-	-	-	37,129.83	37,129.83
应交税费	-	-	-	-	-	0.66	0.66
其他负债	-	-	-	-	-	222,718.38	222,718.38
负债总计	-	-	-	-	-	354,484.47	354,484.47
利率敏感度缺口	20,819,094.71	-	-	-89,067.40	538,117,298.42	559,025,460.53	

□							
---	--	--	--	--	--	--	--

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 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2021 年 12 月 31 日：0.02%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2021 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%，且不低于基金非现金资产的 80%。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 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 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	515,508,208.23	95.83	535,387,927.79	95.77
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-

交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-6,411.40	-0.00	-602.40	-
合计	515,501,796.83	95.83	535,387,325.39	95.77

注：其他包含：1. 可退替代款。2. 在期货交易所交易的期货投资。在当日无负债结算制度下，期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证 500 指数以外的其他市场变量保持不变		
	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（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
分析	中证 500 指数上升 5%	26,720,123.94	27,743,742.05
	中证 500 指数下降 5%	-26,720,123.94	-27,743,742.05

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	511,953,486.08	532,014,730.09

第二层次	2,189,953.93	3,462,265.10
第三层次	1,364,768.22	-
合计	515,508,208.23	535,476,995.19

6.4.14.2.2 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)、或属于非公开发行等情况，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。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	515,508,208.23	95.68
	其中：股票	515,508,208.23	95.68
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	20,336,107.99	3.77

8	其他各项资产	2,945,448.34	0.55
9	合计	538,789,764.56	100.00

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

报告期末，本基金参与转融通证券出借业务出借股票的公允价值为 2,188,393.00 元，占本基金期末资产净值的 0.41%。其中，报告期内本基金与关联方进行转融通证券出借业务的证券 29,208 手，报告期末本基金与关联方进行转融通证券出借业务的余额为 192,400.00 元。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	4,692,671.50	0.87
B	采矿业	22,717,718.71	4.22
C	制造业	304,722,054.89	56.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	15,776,002.31	2.93
E	建筑业	6,588,625.23	1.22
F	批发和零售业	20,019,720.68	3.72
G	交通运输、仓储和邮政业	13,644,674.36	2.54
H	住宿和餐饮业	1,081,280.00	0.20
I	信息传输、软件和信息技术服务业	38,039,452.32	7.07
J	金融业	45,324,872.29	8.43
K	房地产业	12,075,821.96	2.24
L	租赁和商务服务业	6,213,967.06	1.16
M	科学研究和技术服务业	6,351,612.00	1.18
N	水利、环境和公共设施管理业	3,718,745.24	0.69
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,191,036.70	0.22
R	文化、体育和娱乐业	6,843,544.65	1.27
S	综合	3,752,028.97	0.70
	合计	512,753,828.87	95.32

7.2.2 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	1,778,955.97	0.33
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	498,994.98	0.09
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	16,384.43	0.00
M	科学研究和技术服务业	46,162.51	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	204,260.78	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	209,620.69	0.04
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,754,379.36	0.51

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票。

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

7.3.1 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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600522	中天科技	212,100	4,899,510.00	0.91
2	601615	明阳智能	130,600	4,414,280.00	0.82
3	600256	广汇能源	357,000	3,762,780.00	0.70
4	300769	德方纳米	8,400	3,432,912.00	0.64
5	600096	云天化	100,100	3,151,148.00	0.59
6	300012	华测检测	130,700	3,033,547.00	0.56
7	002497	雅化集团	89,700	2,928,705.00	0.54
8	002407	多氟多	59,600	2,915,036.00	0.54
9	002240	盛新锂能	47,100	2,842,956.00	0.53

10	300390	天华超净	32,200	2,814,280.00	0.52
11	002180	纳思达	54,900	2,779,038.00	0.52
12	600157	永泰能源	1,724,800	2,742,432.00	0.51
13	000009	中国宝安	200,183	2,700,468.67	0.50
14	600885	宏发股份	64,484	2,698,655.40	0.50
15	600141	兴发集团	60,411	2,657,479.89	0.49
16	300073	当升科技	27,600	2,493,384.00	0.46
17	600392	盛和资源	108,961	2,462,518.60	0.46
18	002384	东山精密	106,300	2,437,459.00	0.45
19	603613	国联股份	27,220	2,411,692.00	0.45
20	002756	永兴材料	15,800	2,404,918.00	0.45
21	600418	江淮汽车	134,612	2,309,941.92	0.43
22	300285	国瓷材料	62,400	2,241,408.00	0.42
23	600765	中航重机	68,686	2,210,315.48	0.41
24	600399	抚顺特钢	122,500	2,192,750.00	0.41
25	600233	圆通速递	106,800	2,177,652.00	0.40
26	601555	东吴证券	311,030	2,155,437.90	0.40
27	600563	法拉电子	10,478	2,149,666.48	0.40
28	601058	赛轮轮胎	190,700	2,149,189.00	0.40
29	600487	亨通光电	146,800	2,134,472.00	0.40
30	000983	山西焦煤	158,980	2,128,742.20	0.40
31	600499	科达制造	102,900	2,123,856.00	0.39
32	300037	新宙邦	40,340	2,120,270.40	0.39
33	600732	爱旭股份	63,300	2,090,166.00	0.39
34	603077	和邦生物	480,085	2,045,162.10	0.38
35	688180	君实生物	26,965	2,031,543.10	0.38
36	603456	九洲药业	38,900	2,011,130.00	0.37
37	002385	大北农	257,100	2,007,951.00	0.37
38	601108	财通证券	253,800	1,997,406.00	0.37
39	300363	博腾股份	25,400	1,980,946.00	0.37
40	688122	西部超导	21,435	1,976,307.00	0.37
41	002268	卫士通	46,049	1,975,962.59	0.37
42	688099	晶晨股份	19,334	1,952,734.00	0.36
43	600486	扬农化工	14,400	1,919,232.00	0.36
44	603345	安井食品	11,400	1,913,718.00	0.36
45	000519	中兵红箭	64,986	1,894,341.90	0.35
46	600298	安琪酵母	38,800	1,891,500.00	0.35
47	300144	宋城演艺	122,500	1,880,375.00	0.35
48	000630	铜陵有色	572,000	1,864,720.00	0.35
49	600862	中航高科	64,989	1,826,190.90	0.34
50	000988	华工科技	78,055	1,808,534.35	0.34
51	603605	珀莱雅	10,920	1,803,765.60	0.34

52	002353	杰瑞股份	44,716	1,802,054.80	0.33
53	000783	长江证券	302,300	1,792,639.00	0.33
54	601077	渝农商行	480,700	1,778,590.00	0.33
55	601168	西部矿业	148,103	1,752,058.49	0.33
56	002625	光启技术	101,000	1,744,270.00	0.32
57	601162	天风证券	541,200	1,721,016.00	0.32
58	601696	中银证券	129,100	1,717,030.00	0.32
59	300146	汤臣倍健	78,700	1,703,855.00	0.32
60	002028	思源电气	47,516	1,694,420.56	0.31
61	002056	横店东磁	63,243	1,683,528.66	0.31
62	300724	捷佳伟创	18,800	1,679,780.00	0.31
63	002797	第一创业	261,000	1,673,010.00	0.31
64	688777	中控技术	22,890	1,665,476.40	0.31
65	002507	涪陵榨菜	48,100	1,660,412.00	0.31
66	600988	赤峰黄金	103,400	1,649,230.00	0.31
67	603589	口子窖	28,100	1,646,941.00	0.31
68	000932	华菱钢铁	321,760	1,637,758.40	0.30
69	002185	华天科技	174,300	1,634,934.00	0.30
70	603026	石大胜华	11,200	1,627,920.00	0.30
71	601128	常熟银行	212,905	1,626,594.20	0.30
72	603517	绝味食品	28,100	1,624,742.00	0.30
73	601636	旗滨集团	125,200	1,596,300.00	0.30
74	600521	华海药业	69,800	1,584,460.00	0.29
75	002603	以岭药业	64,913	1,577,385.90	0.29
76	002326	永太科技	47,734	1,571,880.62	0.29
77	600109	国金证券	174,600	1,571,400.00	0.29
78	601607	上海医药	86,700	1,567,536.00	0.29
79	600039	四川路桥	147,711	1,555,396.83	0.29
80	000830	鲁西化工	89,533	1,548,025.57	0.29
81	002078	太阳纸业	125,174	1,540,891.94	0.29
82	002624	完美世界	105,900	1,521,783.00	0.28
83	600153	建发股份	115,600	1,510,892.00	0.28
84	600546	山煤国际	76,900	1,496,474.00	0.28
85	603939	益丰药房	28,100	1,484,523.00	0.28
86	605117	德业股份	5,300	1,483,417.00	0.28
87	603267	鸿远电子	10,800	1,450,764.00	0.27
88	601872	招商轮船	251,800	1,450,368.00	0.27
89	002422	科伦药业	77,100	1,441,770.00	0.27
90	600348	华阳股份	93,254	1,441,706.84	0.27
91	601990	南京证券	172,700	1,440,318.00	0.27
92	000738	航发控制	51,200	1,438,720.00	0.27
93	600705	中航产融	415,500	1,437,630.00	0.27

94	600497	驰宏锌锗	276,746	1,436,311.74	0.27
95	000831	五矿稀土	45,800	1,431,250.00	0.27
96	600549	厦门钨业	66,119	1,429,492.78	0.27
97	600177	雅戈尔	215,500	1,428,765.00	0.27
98	300699	光威复材	24,200	1,424,654.00	0.26
99	600875	东方电气	86,359	1,420,605.55	0.26
100	000970	中科三环	75,438	1,416,725.64	0.26
101	300088	长信科技	190,635	1,414,511.70	0.26
102	603127	昭衍新药	12,400	1,411,120.00	0.26
103	600536	中国软件	34,310	1,392,642.90	0.26
104	688390	固德威	4,410	1,380,374.10	0.26
105	600160	巨化股份	104,892	1,379,329.80	0.26
106	000999	华润三九	30,562	1,375,290.00	0.26
107	002138	顺络电子	50,200	1,367,950.00	0.25
108	002572	索菲亚	49,700	1,366,750.00	0.25
109	000998	隆平高科	81,800	1,362,788.00	0.25
110	600859	王府井	52,429	1,362,105.42	0.25
111	002673	西部证券	208,200	1,361,628.00	0.25
112	601699	潞安环能	92,800	1,356,736.00	0.25
113	300676	华大基因	18,900	1,355,130.00	0.25
114	002557	洽洽食品	23,700	1,349,241.00	0.25
115	600516	方大炭素	177,200	1,346,720.00	0.25
116	600143	金发科技	140,700	1,339,464.00	0.25
117	000807	云铝股份	134,511	1,328,968.68	0.25
118	002508	老板电器	36,800	1,325,904.00	0.25
119	000039	中集集团	95,351	1,320,611.35	0.25
120	600482	中国动力	83,900	1,318,069.00	0.25
121	601997	贵阳银行	226,200	1,314,222.00	0.24
122	603444	吉比特	3,377	1,310,276.00	0.24
123	002030	达安基因	76,212	1,310,084.28	0.24
124	000960	锡业股份	77,700	1,303,029.00	0.24
125	002465	海格通信	143,177	1,301,478.93	0.24
126	002273	水晶光电	107,278	1,299,136.58	0.24
127	300357	我武生物	24,500	1,274,735.00	0.24
128	000629	攀钢钒钛	334,000	1,269,200.00	0.24
129	300136	信维通信	75,100	1,265,435.00	0.24
130	000728	国元证券	203,300	1,264,526.00	0.24
131	300058	蓝色光标	193,452	1,263,241.56	0.23
132	000975	银泰黄金	129,440	1,260,745.60	0.23
133	600170	上海建工	412,400	1,249,572.00	0.23
134	601577	长沙银行	157,100	1,245,803.00	0.23
135	600704	物产中大	242,000	1,241,460.00	0.23

136	002092	中泰化学	159,324	1,236,354.24	0.23
137	689009	九号公司	27,695	1,232,427.50	0.23
138	002409	雅克科技	22,200	1,232,322.00	0.23
139	600079	人福医药	76,600	1,225,600.00	0.23
140	600372	中航电子	62,900	1,219,631.00	0.23
141	603198	迎驾贡酒	18,700	1,218,118.00	0.23
142	600739	辽宁成大	83,200	1,213,056.00	0.23
143	300474	景嘉微	17,600	1,203,664.00	0.22
144	002294	信立泰	42,800	1,202,680.00	0.22
145	002223	鱼跃医疗	46,755	1,199,733.30	0.22
146	300244	迪安诊断	38,297	1,191,036.70	0.22
147	002372	伟星新材	49,520	1,190,460.80	0.22
148	000547	航天发展	99,625	1,189,522.50	0.22
149	300418	昆仑万维	74,307	1,188,912.00	0.22
150	600415	小商品城	213,300	1,188,081.00	0.22
151	300558	贝达药业	19,500	1,185,600.00	0.22
152	002739	万达电影	86,700	1,183,455.00	0.22
153	002506	协鑫集成	317,800	1,182,216.00	0.22
154	000636	风华高科	62,774	1,179,523.46	0.22
155	300253	卫宁健康	133,300	1,170,374.00	0.22
156	600699	均胜电子	74,340	1,167,881.40	0.22
157	300308	中际旭创	37,300	1,158,165.00	0.22
158	300296	利亚德	157,900	1,152,670.00	0.21
159	600637	东方明珠	159,000	1,136,850.00	0.21
160	600867	通化东宝	109,300	1,130,162.00	0.21
161	600315	上海家化	26,398	1,128,514.50	0.21
162	002683	广东宏大	40,400	1,124,332.00	0.21
163	601016	节能风电	233,600	1,121,280.00	0.21
164	600985	淮北矿业	77,000	1,121,120.00	0.21
165	000887	中鼎股份	61,321	1,118,495.04	0.21
166	600236	桂冠电力	183,600	1,118,124.00	0.21
167	601198	东兴证券	125,500	1,116,950.00	0.21
168	600026	中远海能	108,007	1,115,712.31	0.21
169	002156	通富微电	72,200	1,111,880.00	0.21
170	002299	圣农发展	57,942	1,111,327.56	0.21
171	600171	上海贝岭	44,303	1,108,904.09	0.21
172	600879	航天电子	168,954	1,096,511.46	0.20
173	002065	东华软件	173,100	1,093,992.00	0.20
174	600380	健康元	88,452	1,092,382.20	0.20
175	600642	申能股份	190,763	1,083,533.84	0.20
176	600258	首旅酒店	43,600	1,081,280.00	0.20
177	300026	红日药业	139,941	1,077,545.70	0.20

178	000750	国海证券	296,042	1,074,632.46	0.20
179	002936	郑州银行	399,405	1,074,399.45	0.20
180	002408	齐翔腾达	131,594	1,067,227.34	0.20
181	000623	吉林敖东	72,200	1,065,672.00	0.20
182	603233	大参林	34,040	1,065,452.00	0.20
183	300832	新产业	23,500	1,060,085.00	0.20
184	002203	海亮股份	91,700	1,059,135.00	0.20
185	000729	燕京啤酒	109,510	1,057,866.60	0.20
186	000513	丽珠集团	29,206	1,057,549.26	0.20
187	600673	东阳光	116,970	1,051,560.30	0.20
188	300677	英科医疗	41,360	1,048,889.60	0.19
189	000878	云南铜业	91,814	1,045,761.46	0.19
190	000400	许继电气	54,440	1,045,248.00	0.19
191	600820	隧道股份	170,200	1,041,624.00	0.19
192	600038	中直股份	23,000	1,039,600.00	0.19
193	600580	卧龙电驱	71,725	1,034,274.50	0.19
194	600529	山东药玻	37,000	1,034,150.00	0.19
195	601717	郑煤机	71,702	1,033,225.82	0.19
196	600801	华新水泥	52,825	1,030,615.75	0.19
197	002439	启明星辰	51,500	1,026,395.00	0.19
198	600369	西南证券	257,900	1,023,863.00	0.19
199	688185	康希诺	5,130	1,021,280.40	0.19
200	300017	网宿科技	190,000	1,018,400.00	0.19
201	300383	光环新网	97,700	1,018,034.00	0.19
202	002131	利欧股份	524,284	1,017,110.96	0.19
203	603568	伟明环保	30,421	1,015,148.77	0.19
204	002183	怡亚通	140,450	1,012,644.50	0.19
205	600166	福田汽车	357,502	1,011,730.66	0.19
206	600316	洪都航空	33,353	1,008,594.72	0.19
207	002444	巨星科技	53,233	1,002,909.72	0.19
208	002195	二三四五	444,320	999,720.00	0.19
209	600325	华发股份	131,602	996,227.14	0.19
210	600909	华安证券	218,790	995,494.50	0.19
211	600027	华电国际	253,300	995,469.00	0.19
212	601005	重庆钢铁	520,600	994,346.00	0.18
213	600008	首创环保	341,900	991,510.00	0.18
214	002958	青农商行	298,200	990,024.00	0.18
215	600848	上海临港	73,000	989,880.00	0.18
216	688256	寒武纪	15,250	986,675.00	0.18
217	300618	寒锐钴业	16,800	973,056.00	0.18
218	300001	特锐德	56,150	971,956.50	0.18
219	300024	机器人	96,300	970,704.00	0.18

220	000825	太钢不锈	176,800	963,560.00	0.18
221	002430	杭氧股份	30,800	962,808.00	0.18
222	002500	山西证券	167,297	960,284.78	0.18
223	688521	芯原股份	19,433	959,990.20	0.18
224	002926	华西证券	122,300	958,832.00	0.18
225	002373	千方科技	85,965	955,930.80	0.18
226	603218	日月股份	37,600	955,040.00	0.18
227	000050	深天马 A	95,400	951,138.00	0.18
228	000027	深圳能源	147,776	947,244.16	0.18
229	000739	普洛药业	45,800	945,312.00	0.18
230	600271	航天信息	86,400	945,216.00	0.18
231	002250	联化科技	57,387	939,425.19	0.17
232	002670	国盛金控	97,676	937,689.60	0.17
233	002212	天融信	92,165	935,474.75	0.17
234	600863	内蒙华电	253,400	924,910.00	0.17
235	600118	中国卫星	46,000	923,680.00	0.17
236	601866	中远海发	307,751	923,253.00	0.17
237	600208	新湖中宝	333,900	921,564.00	0.17
238	688009	中国通号	201,950	914,833.50	0.17
239	000060	中金岭南	203,100	905,826.00	0.17
240	002985	北摩高科	15,443	904,650.94	0.17
241	002249	大洋电机	146,931	902,156.34	0.17
242	300009	安科生物	89,160	901,407.60	0.17
243	601992	金隅集团	323,700	896,649.00	0.17
244	000778	新兴铸管	185,889	895,984.98	0.17
245	002152	广电运通	96,369	893,340.63	0.17
246	603156	养元饮品	39,300	892,896.00	0.17
247	600066	宇通客车	103,200	892,680.00	0.17
248	300070	碧水源	168,900	879,969.00	0.16
249	300182	捷成股份	159,893	879,411.50	0.16
250	603858	步长制药	44,398	875,084.58	0.16
251	300168	万达信息	92,300	871,312.00	0.16
252	000401	冀东水泥	82,633	869,299.16	0.16
253	002966	苏州银行	142,300	868,030.00	0.16
254	600998	九州通	72,700	865,857.00	0.16
255	603658	安图生物	17,700	865,353.00	0.16
256	600755	厦门国贸	115,215	864,112.50	0.16
257	300251	光线传媒	91,200	863,664.00	0.16
258	600056	中国医药	58,113	861,234.66	0.16
259	002831	裕同科技	29,041	858,161.55	0.16
260	002191	劲嘉股份	79,971	857,289.12	0.16
261	002128	电投能源	59,729	855,319.28	0.16

262	600390	五矿资本	174,500	853,305.00	0.16
263	600970	中材国际	88,060	853,301.40	0.16
264	000997	新大陆	64,122	847,051.62	0.16
265	000021	深科技	72,665	845,820.60	0.16
266	600667	太极实业	114,400	844,272.00	0.16
267	300482	万孚生物	20,720	843,511.20	0.16
268	002505	鹏都农牧	247,411	838,723.29	0.16
269	002244	滨江集团	96,592	835,520.80	0.16
270	002221	东华能源	89,744	835,516.64	0.16
271	600528	中铁工业	103,500	833,175.00	0.15
272	688002	睿创微纳	20,975	833,127.00	0.15
273	600062	华润双鹤	32,357	830,280.62	0.15
274	600839	四川长虹	286,680	825,638.40	0.15
275	000656	金科股份	288,600	825,396.00	0.15
276	603885	吉祥航空	45,875	825,291.25	0.15
277	600021	上海电力	80,445	824,561.25	0.15
278	600827	百联股份	62,300	822,983.00	0.15
279	000987	越秀金控	116,970	822,299.10	0.15
280	600297	广汇汽车	314,900	821,889.00	0.15
281	603707	健友股份	29,110	820,902.00	0.15
282	002396	星网锐捷	36,200	819,568.00	0.15
283	600598	北大荒	55,210	814,899.60	0.15
284	002127	南极电商	152,600	814,884.00	0.15
285	002019	亿帆医药	57,483	803,612.34	0.15
286	600201	生物股份	87,552	801,976.32	0.15
287	600155	华创阳安	94,474	801,139.52	0.15
288	600498	烽火通信	55,300	800,744.00	0.15
289	002266	浙富控股	166,781	798,880.99	0.15
290	002155	湖南黄金	65,372	793,616.08	0.15
291	600259	广晟有色	15,656	792,976.40	0.15
292	000012	南玻 A	106,633	791,216.86	0.15
293	600511	国药股份	29,395	787,198.10	0.15
294	600409	三友化工	96,100	787,059.00	0.15
295	000930	中粮科技	86,952	786,046.08	0.15
296	000883	湖北能源	153,100	782,341.00	0.15
297	002153	石基信息	49,040	778,264.80	0.14
298	600718	东软集团	67,586	777,914.86	0.14
299	002124	天邦食品	114,200	767,424.00	0.14
300	002511	中顺洁柔	61,200	766,224.00	0.14
301	000686	东北证券	109,097	762,588.03	0.14
302	600060	海信视像	60,982	762,275.00	0.14
303	603712	七一二	24,100	759,150.00	0.14

304	688188	柏楚电子	3,438	756,497.52	0.14
305	600282	南钢股份	239,154	753,335.10	0.14
306	600566	济川药业	27,700	752,332.00	0.14
307	000581	威孚高科	39,013	751,000.25	0.14
308	600895	张江高科	60,176	749,191.20	0.14
309	600782	新钢股份	148,600	748,944.00	0.14
310	600959	江苏有线	229,238	747,315.88	0.14
311	601880	辽港股份	438,536	745,511.20	0.14
312	000709	河钢股份	329,800	745,348.00	0.14
313	601179	中国西电	159,151	744,826.68	0.14
314	600064	南京高科	67,294	740,234.00	0.14
315	000690	宝新能源	168,995	740,198.10	0.14
316	600022	山东钢铁	424,880	739,291.20	0.14
317	600535	天士力	70,000	735,700.00	0.14
318	002939	长城证券	72,200	733,552.00	0.14
319	300376	易事特	89,954	730,426.48	0.14
320	002701	奥瑞金	139,827	727,100.40	0.14
321	601778	晶科科技	133,800	722,520.00	0.13
322	002002	鸿达兴业	193,981	719,669.51	0.13
323	300630	普利制药	20,408	717,341.20	0.13
324	600216	浙江医药	52,357	714,673.05	0.13
325	600500	中化国际	107,425	714,376.25	0.13
326	600808	马钢股份	187,735	711,515.65	0.13
327	000598	兴蓉环境	139,072	710,657.92	0.13
328	600037	歌华有线	75,608	709,959.12	0.13
329	600663	陆家嘴	68,391	708,530.76	0.13
330	002532	天山铝业	108,400	707,852.00	0.13
331	600728	佳都科技	109,300	706,078.00	0.13
332	002468	申通快递	58,800	700,896.00	0.13
333	688208	道通科技	21,207	698,134.44	0.13
334	600567	山鹰国际	250,890	694,965.30	0.13
335	002595	豪迈科技	31,000	692,540.00	0.13
336	600517	国网英大	133,300	691,827.00	0.13
337	002004	华邦健康	122,990	686,284.20	0.13
338	603866	桃李面包	41,413	685,385.15	0.13
339	603225	新凤鸣	59,378	685,222.12	0.13
340	300463	迈克生物	33,300	682,317.00	0.13
341	601456	国联证券	55,600	682,212.00	0.13
342	002745	木林森	69,214	676,220.78	0.13
343	600597	光明乳业	53,430	674,820.90	0.13
344	688289	圣湘生物	22,766	674,101.26	0.13
345	300115	长盈精密	65,335	673,603.85	0.13

346	002429	兆驰股份	174,300	669,312.00	0.12
347	688006	杭可科技	9,516	666,690.96	0.12
348	601958	金钼股份	75,100	663,884.00	0.12
349	300166	东方国信	71,399	658,298.78	0.12
350	601106	中国一重	213,100	654,217.00	0.12
351	000785	居然之家	146,700	652,815.00	0.12
352	002390	信邦制药	94,345	651,923.95	0.12
353	603927	中科软	27,720	646,430.40	0.12
354	300072	海新能科	127,200	643,632.00	0.12
355	600572	康恩贝	145,029	642,478.47	0.12
356	601860	紫金银行	223,500	641,445.00	0.12
357	688029	南微医学	7,349	640,832.80	0.12
358	601118	海南橡胶	133,103	636,232.34	0.12
359	601718	际华集团	204,600	634,260.00	0.12
360	600507	方大特钢	90,601	633,300.99	0.12
361	300888	稳健医疗	9,500	631,750.00	0.12
362	600398	海澜之家	132,600	629,850.00	0.12
363	000540	中天金融	326,300	629,759.00	0.12
364	600737	中粮糖业	83,093	624,859.36	0.12
365	000089	深圳机场	79,648	614,882.56	0.11
366	600582	天地科技	128,600	614,708.00	0.11
367	603883	老百姓	18,141	614,617.08	0.11
368	000937	冀中能源	82,348	614,316.08	0.11
369	002010	传化智联	95,200	612,136.00	0.11
370	000559	万向钱潮	102,601	609,449.94	0.11
371	002048	宁波华翔	37,901	607,174.02	0.11
372	600967	内蒙一机	66,264	604,327.68	0.11
373	002368	太极股份	31,425	603,674.25	0.11
374	000898	鞍钢股份	186,200	599,564.00	0.11
375	600435	北方导航	69,445	598,615.90	0.11
376	002690	美亚光电	27,525	596,742.00	0.11
377	601000	唐山港	230,043	593,510.94	0.11
378	001914	招商积余	32,900	591,213.00	0.11
379	600871	石化油服	308,300	582,687.00	0.11
380	600195	中牧股份	47,394	581,050.44	0.11
381	002110	三钢闽光	95,159	579,518.31	0.11
382	000959	首钢股份	120,700	574,532.00	0.11
383	601333	广深铁路	263,300	573,994.00	0.11
384	002233	塔牌集团	64,821	573,665.85	0.11
385	002281	光迅科技	32,545	572,141.10	0.11
386	601568	北元集团	89,540	567,683.60	0.11
387	002705	新宝股份	25,800	567,342.00	0.11

388	600556	天下秀	68,900	567,047.00	0.11
389	688321	微芯生物	22,502	566,825.38	0.11
390	000537	广宇发展	43,400	563,766.00	0.10
391	600811	东方集团	198,776	562,536.08	0.10
392	000156	华数传媒	70,419	561,239.43	0.10
393	600764	中国海防	22,100	557,804.00	0.10
394	002174	游族网络	56,900	555,913.00	0.10
395	000402	金融街	92,800	552,160.00	0.10
396	003035	南网能源	86,900	551,815.00	0.10
397	600329	达仁堂	22,300	548,134.00	0.10
398	600120	浙江东方	134,823	540,640.23	0.10
399	603638	艾迪精密	26,260	538,330.00	0.10
400	300212	易华录	30,920	538,008.00	0.10
401	600126	杭钢股份	104,938	537,282.56	0.10
402	002416	爱施德	57,720	536,796.00	0.10
403	000488	晨鸣纸业	94,991	535,749.24	0.10
404	000990	诚志股份	48,757	533,889.15	0.10
405	600167	联美控股	71,230	533,512.70	0.10
406	600446	金证股份	51,300	532,494.00	0.10
407	601200	上海环境	52,253	530,890.48	0.10
408	000685	中山公用	68,851	528,775.68	0.10
409	002867	周大生	34,000	528,020.00	0.10
410	002081	金螳螂	103,700	526,796.00	0.10
411	601098	中南传媒	55,713	525,930.72	0.10
412	600373	中文传媒	52,600	525,474.00	0.10
413	002925	盈趣科技	24,400	525,088.00	0.10
414	002382	蓝帆医疗	54,700	522,385.00	0.10
415	600707	彩虹股份	111,600	522,288.00	0.10
416	000158	常山北明	86,980	521,880.00	0.10
417	601611	中国核建	61,700	517,663.00	0.10
418	002399	海普瑞	29,200	513,336.00	0.10
419	001965	招商公路	67,200	512,736.00	0.10
420	002146	荣盛发展	168,900	511,767.00	0.10
421	601608	中信重工	134,700	510,513.00	0.09
422	600095	湘财股份	65,500	503,695.00	0.09
423	688088	虹软科技	15,911	502,628.49	0.09
424	002387	维信诺	74,700	501,984.00	0.09
425	603317	天味食品	17,594	500,901.18	0.09
426	600131	国网信通	37,100	498,995.00	0.09
427	000528	柳工	75,893	494,063.43	0.09
428	000967	盈峰环境	97,600	493,856.00	0.09
429	600376	首开股份	100,094	491,461.54	0.09

430	002948	青岛银行	134,450	486,709.00	0.09
431	603000	人民网	42,970	481,264.00	0.09
432	600623	华谊集团	57,909	480,644.70	0.09
433	000563	陕国投 A	153,946	480,311.52	0.09
434	600901	江苏租赁	92,700	475,551.00	0.09
435	601598	中国外运	122,400	474,912.00	0.09
436	002423	中粮资本	70,600	473,726.00	0.09
437	600307	酒钢宏兴	243,099	471,612.06	0.09
438	601187	厦门银行	79,000	470,840.00	0.09
439	600006	东风汽车	62,031	468,334.05	0.09
440	601991	大唐发电	192,600	468,018.00	0.09
441	603228	景旺电子	19,840	462,867.20	0.09
442	300257	开山股份	30,803	460,812.88	0.09
443	600906	财达证券	50,500	453,995.00	0.08
444	000961	中南建设	148,600	453,230.00	0.08
445	603650	彤程新材	13,876	452,080.08	0.08
446	600717	天津港	112,327	450,431.27	0.08
447	002242	九阳股份	23,912	439,024.32	0.08
448	002434	万里扬	51,100	436,905.00	0.08
449	000718	苏宁环球	117,748	433,312.64	0.08
450	601928	凤凰传媒	59,300	423,995.00	0.08
451	000671	阳光城	193,000	422,670.00	0.08
452	000415	渤海租赁	192,100	416,857.00	0.08
453	000553	安道麦 A	33,800	409,318.00	0.08
454	600968	海油发展	157,800	407,124.00	0.08
455	601969	海南矿业	46,600	400,294.00	0.07
456	000031	大悦城	99,830	399,320.00	0.07
457	600648	外高桥	29,200	397,120.00	0.07
458	600787	中储股份	68,117	387,585.73	0.07
459	600928	西安银行	103,600	380,212.00	0.07
460	600339	中油工程	130,100	375,989.00	0.07
461	002563	森马服饰	62,800	371,776.00	0.07
462	601228	广州港	96,100	352,687.00	0.07
463	002815	崇达技术	27,344	350,276.64	0.07
464	600835	上海机电	25,130	345,034.90	0.06
465	300869	康泰医学	12,200	344,772.00	0.06
466	000028	国药一致	11,571	344,700.09	0.06
467	000717	韶钢松山	93,900	328,650.00	0.06
468	688819	天能股份	9,500	328,510.00	0.06
469	600377	宁沪高速	38,300	328,231.00	0.06
470	603056	德邦股份	23,970	321,917.10	0.06
471	002945	华林证券	21,000	320,250.00	0.06

472	603379	三美股份	14,180	315,505.00	0.06
473	000869	张裕 A	10,500	312,270.00	0.06
474	601139	深圳燃气	44,700	310,218.00	0.06
475	000062	深圳华强	24,407	309,968.90	0.06
476	601869	长飞光纤	9,642	298,130.64	0.06
477	600299	安迪苏	31,100	297,938.00	0.06
478	601298	青岛港	54,400	297,568.00	0.06
479	603868	飞科电器	3,766	285,274.50	0.05
480	001872	招商港口	17,600	274,560.00	0.05
481	300741	华宝股份	9,700	269,854.00	0.05
482	002653	海思科	16,700	269,037.00	0.05
483	601156	东航物流	13,500	267,300.00	0.05
484	600823	世茂股份	87,456	260,618.88	0.05
485	600350	山东高速	48,700	255,675.00	0.05
486	601828	美凯龙	41,800	253,308.00	0.05
487	600927	永安期货	11,700	235,989.00	0.04
488	603355	莱克电气	9,024	227,675.52	0.04
489	001227	兰州银行	46,200	227,304.00	0.04
490	603786	科博达	3,500	215,495.00	0.04
491	603515	欧普照明	11,675	203,728.75	0.04
492	001203	大中矿业	17,500	197,750.00	0.04
493	601665	齐鲁银行	38,900	189,832.00	0.04
494	603719	良品铺子	6,200	177,506.00	0.03
495	002946	新乳业	13,400	174,066.00	0.03
496	601003	柳钢股份	39,800	161,190.00	0.03
497	002901	大博医疗	3,500	136,990.00	0.03
498	600956	新天绿能	10,900	134,288.00	0.02
499	603983	丸美股份	4,100	109,880.00	0.02
500	600917	重庆燃气	13,353	96,408.66	0.02

7.3.2 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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688320	禾川科技	6,048	279,478.08	0.05
2	688322	奥比中光	8,529	264,313.71	0.05
3	688119	中钢洛耐	33,327	233,622.27	0.04
4	301139	元道通信	5,651	217,337.46	0.04
5	688400	凌云光	9,132	200,264.76	0.04
6	301239	普瑞眼科	5,747	193,386.55	0.04
7	301175	中科环保	50,318	192,214.76	0.04
8	688282	理工导航	3,185	144,503.45	0.03
9	688259	创耀科技	1,595	126,355.90	0.02

10	688237	超卓航科	2,891	119,311.57	0.02
11	688227	品高股份	4,164	89,192.88	0.02
12	688102	斯瑞新材	6,030	73,746.90	0.01
13	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.01
14	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.01
15	301215	中汽股份	4,743	30,307.77	0.01
16	301302	华如科技	466	26,291.72	0.00
17	301266	宇邦新材	517	24,335.19	0.00
18	301201	诚达药业	338	24,180.52	0.00
19	301122	采纳股份	301	21,181.37	0.00
20	301200	大族数控	360	18,691.20	0.00
21	301256	华融化学	1,831	18,456.48	0.00
22	301207	华兰疫苗	327	18,449.34	0.00
23	301112	信邦智能	399	17,970.96	0.00
24	301153	中科江南	398	17,504.04	0.00
25	301206	三元生物	363	16,585.47	0.00
26	301102	兆讯传媒	527	16,384.43	0.00
27	301103	何氏眼科	507	16,234.14	0.00
28	301235	华康医疗	418	15,854.74	0.00
29	301160	翔楼新材	392	14,762.72	0.00
30	301219	腾远钴业	166	14,578.12	0.00
31	301117	佳缘科技	262	14,263.28	0.00
32	301212	联盛化学	416	13,844.48	0.00
33	301298	东利机械	634	13,206.22	0.00
34	301258	富士莱	295	12,295.60	0.00
35	301259	艾布鲁	483	12,046.02	0.00
36	301116	益客食品	577	11,805.42	0.00
37	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
38	300834	星辉环材	373	11,201.19	0.00
39	301220	亚香股份	285	11,157.75	0.00
40	301237	和顺科技	261	10,925.46	0.00
41	301137	哈焊华通	644	10,297.56	0.00
42	301222	浙江恒威	332	9,614.72	0.00
43	301288	清研环境	452	9,030.96	0.00
44	301125	腾亚精工	327	8,966.34	0.00
45	301130	西点药业	237	8,934.90	0.00
46	301110	青木股份	202	8,049.70	0.00
47	301181	标榜股份	257	7,861.63	0.00
48	301158	德石股份	379	7,724.02	0.00
49	301196	唯科科技	195	7,316.40	0.00
50	301279	金道科技	296	6,751.76	0.00

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	600096	云天化	3,105,088.12	0.56
2	300012	华测检测	2,955,123.00	0.53
3	002497	雅化集团	2,918,432.00	0.52
4	300769	德方纳米	2,916,586.96	0.52
5	002240	盛新锂能	2,830,895.00	0.51
6	300390	天华超净	2,496,034.00	0.45
7	002407	多氟多	2,426,668.83	0.43
8	688180	君实生物	2,337,223.27	0.42
9	002756	永兴材料	2,189,589.00	0.39
10	300073	当升科技	2,169,061.68	0.39
11	601058	赛轮轮胎	2,137,719.00	0.38
12	688122	西部超导	1,949,380.82	0.35
13	601108	财通证券	1,939,060.00	0.35
14	688777	中控技术	1,824,750.65	0.33
15	000783	长江证券	1,795,471.00	0.32
16	601162	天风证券	1,764,581.00	0.32
17	600499	科达制造	1,752,067.00	0.31
18	601696	中银证券	1,749,190.22	0.31
19	603345	安井食品	1,656,301.00	0.30
20	002625	光启技术	1,626,347.00	0.29

注：不考虑相关交易费用。

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	000733	振华科技	4,596,987.00	0.82
2	002340	格林美	4,159,447.60	0.74
3	000723	美锦能源	3,327,947.00	0.60
4	600188	兖矿能源	3,141,542.00	0.56
5	300763	锦浪科技	2,817,844.00	0.50
6	601117	中国化学	2,601,636.00	0.47
7	002013	中航机电	2,525,768.00	0.45
8	688005	容百科技	2,421,571.61	0.43
9	600884	杉杉股份	2,332,890.14	0.42
10	601689	拓普集团	2,130,438.88	0.38
11	300751	迈为股份	2,098,594.56	0.38
12	605358	立昂微	2,060,596.20	0.37
13	600754	锦江酒店	1,954,256.92	0.35

14	300223	北京君正	1,919,329.00	0.34
15	002080	中材科技	1,728,540.00	0.31
16	600733	北汽蓝谷	1,420,128.00	0.25
17	603290	斯达半导	1,365,519.00	0.24
18	600803	新奥股份	1,305,610.00	0.23
19	688536	思瑞浦	1,251,969.55	0.22
20	601975	招商南油	1,149,315.00	0.21

注：不考虑相关交易费用。

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	201,589,332.05
卖出股票收入（成交）总额	167,142,858.96

注：不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期内，基金投资股指期货的目的是为了提升基金的流动性水平，以及在期货贴水时作为现货的替代。

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 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 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。

7.12.2 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。

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	2,919,227.60
2	应收清算款	23,898.13
3	应收股利	1,040.00
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	1,282.61
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,945,448.34

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

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688320	禾川科技	279,478.08	0.05	新股锁定期内
2	688322	奥比中光	264,313.71	0.05	新股未上市
3	688119	中钢洛耐	233,622.27	0.04	新股锁定期内
4	301139	元道通信	217,337.46	0.04	新股未上市
5	688400	凌云光	200,264.76	0.04	新股未上市

7.12.6 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。

§ 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 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 (%)
9,705	33,068.50	160,346,270.00	49.96	160,583,531.00	50.04

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	145,897,389.00	45.4608

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	赵熙逸	37,115,378.00	11.56
2	华泰证券股份有限公司	5,622,764.00	1.75
3	方正证券股份有限公司	4,430,133.00	1.38
4	广发证券股份有限公司	2,800,435.00	0.87
5	王春燕	1,120,000.00	0.35
6	乔夏	1,000,000.00	0.31
7	熊杰	917,500.00	0.29
8	李焱	861,600.00	0.27
9	赵烨	856,500.00	0.27
10	李史扬	844,900.00	0.26

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	10,000.00	0.0031

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（2015 年 5 月 13 日） 基金份额总额	873,820,061.00
本报告期期初基金份额总额	298,429,801.00
本报告期基金总申购份额	117,500,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	95,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	320,929,801.00

§ 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

2022 年 3 月 15 日，公司股东批准 Kirk Chester SWEENEY 先生担任公司董事，Anthony Gerard Fasso 先生不再担任公司董事。

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。

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

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 (%)	
中信建投	2	273,197,634.	76.10	37,014.52	32.22	-

		53				
中金财富 证券	1	84,362,601.5 1	23.50	77,668.51	67.61	-
华泰证券	4	1,454,461.83	0.41	190.97	0.17	-
安信证券	3	-	-	-	-	-
北京高华	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	4	-	-	-	-	-
大同证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东方财富 证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	3	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
华龙证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
申港证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
新时代证 券	2	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	3	-	-	-	-	-

银河证券	5	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	3	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
中银国际	3	-	-	-	-	-

注：1、选择代理证券买卖的证券经营机构的标准：

- 1) 资金雄厚，信誉良好。
- 2) 财务状况良好，经营行为规范，最近一年未因重大违规行为而受到有关管理机关的处罚。
- 3) 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) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时、定期、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。

3、上述交易单元均系本报告期内租用。

4、本报告期内，基金租用券商交易单元新增东方财富证券、天风证券。

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 (%)
中信建投	140,402.40	24.18	-	-	-	-
中金财富证券	440,222.44	75.82	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
北京高华	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
大同证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-

东方财富 证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
华龙证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
新时代证 券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

中银国际	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---

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	关于同意海通证券股份有限公司为华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金提供主做市服务的公告	证监会规定报刊和网站	2022 年 6 月 20 日
2	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下管理的上海证券交易所上市 ETF 实施申赎业务多码合一的公告	证监会规定报刊和网站	2022 年 6 月 17 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	2022 年 5 月 28 日
4	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	2022 年 5 月 26 日
5	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	2022 年 5 月 11 日
6	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资北交所上市股票的公告	证监会规定报刊和网站	2022 年 4 月 29 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	2022 年 4 月 16 日
8	华泰柏瑞基金管理有限公司关于调整华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金最小申购赎回单位的公告	证监会规定报刊和网站	2022 年 3 月 8 日
9	华泰柏瑞基金管理有限公司关于参加工商银行基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2022 年 1 月 4 日
10	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	2022 年 1 月 1 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	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况
------	----------------	------------

别	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 (%)
联接基金	1	20220101-20220630;	119,591,289.00	149,806,100.00	123,500,000.00	145,897,389.00	45.4608

产品特有风险

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。

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、中国证监会批准华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金募集的文件
- 2、《华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- 3、《华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》
- 4、《华泰柏瑞中证 500 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、华泰柏瑞中证 500 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
 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

华泰柏瑞基金管理有限公司

2022 年 8 月 30 日