

华泰柏瑞中证科技 100 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：中信证券股份有限公司

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。

基金托管人中信证券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	11
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
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	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	45
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46
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	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52
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	52

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	52
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	52
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	52
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
7.12 投资组合报告附注	53
§ 8 基金份额持有人信息	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
8.2 期末上市基金前十名持有人	54
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
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	55
§ 9 开放式基金份额变动	55
§ 10 重大事件揭示	55
10.1 基金份额持有人大会决议	55
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	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	55
10.4 基金投资策略的改变	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	56
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	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	56
10.8 其他重大事件	57
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	58
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	58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	59
§ 12 备查文件目录	59
12.1 备查文件目录	59
12.2 存放地点	59
12.3 查阅方式	59

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华泰柏瑞中证科技 100ETF
场内简称	中证科技（扩位证券简称：科技 100ETF）
基金主代码	515580
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 9 月 27 日
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	中信证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	714,031,444.00 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	2019 年 10 月 28 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。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	1、股票的投资策略；2、存托凭证投资策略；3、债券投资策略；4、股指期货的投资策略；5、资产支持证券的投资策略；6、融资及转融通证券出借业务
业绩比较基准	中证科技 100 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	中信证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	刘万方	杨军智
	联系电话	021-38601777	010-60834299
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	yjz@citics.com
客户服务电话		400-888-0001	010-60836588
传真		021-38601799	010-60834004
注册地址		上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号 17 层	广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座
办公地址		上海市浦东新区民生路 1199 弄证	北京市朝阳区亮马桥路 48 号中

	大五道口广场 1 号 17 层	信证券大厦 5 层
邮政编码	200135	100125
法定代表人	贾波	张佑君

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	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

§ 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	-26,682,429.98
本期利润	-78,111,942.10
加权平均基金份额本期利润	-0.1406
本期加权平均净值利润率	-17.29%
本期基金份额净值增长率	-14.79%
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	235,837,796.86
期末可供分配基金份额利润	0.3303
期末基金资产净值	592,853,518.94
期末基金份额净值	0.8303
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	66.06%

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。

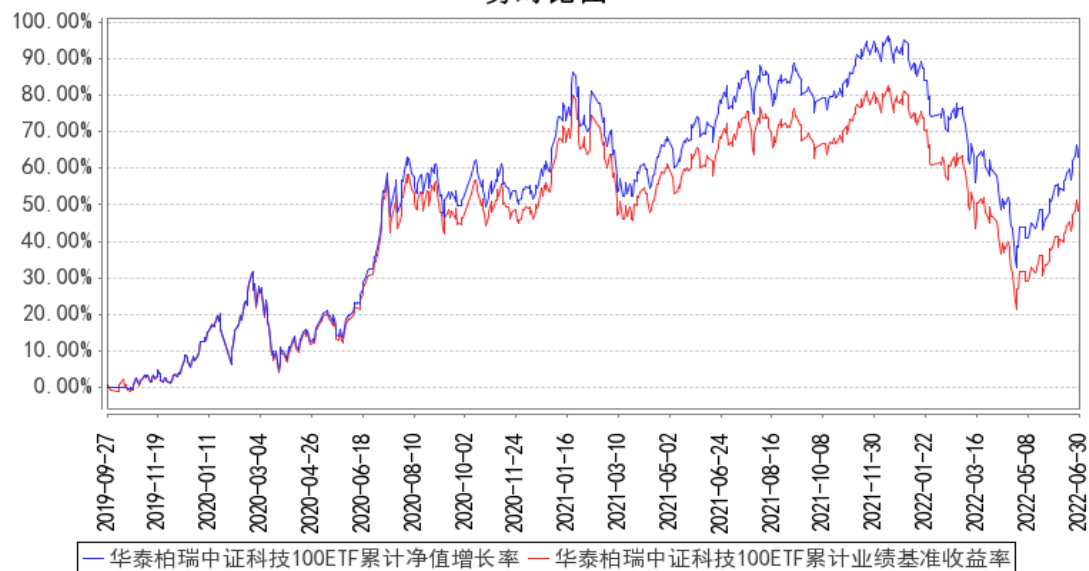
3.2 基金净值表现

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	9.55%	1.26%	9.32%	1.29%	0.23%	-0.03%
过去三个月	3.96%	1.78%	2.70%	1.83%	1.26%	-0.05%
过去六个月	-14.79%	1.68%	-16.57%	1.72%	1.78%	-0.04%
过去一年	-9.02%	1.40%	-12.36%	1.44%	3.34%	-0.04%
自基金合同生效起至今	66.06%	1.56%	51.00%	1.60%	15.06%	-0.04%

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

华泰柏瑞中证科技100ETF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2019年9月27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		
谭弘翔	指数投资部总监助理、本基金的基金经理	2021 年 4 月 29 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。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。

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 0.047%，期间日跟踪误差为 0.061%，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 0.8303 元；本报告期基金份额净值增长率为-14.79%，业绩比较基准收益率为-16.57%。

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，本基金可分配收益为 235,837,796.86 元。

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，中信证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在对华泰柏瑞中证科技 100 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，华泰柏瑞基金管理有限公司在华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本报告期，由华泰柏瑞基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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：华泰柏瑞中证科技 100 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	13,569,735.75	12,472,812.27
结算备付金		142,631.55	199,242.81
存出保证金		138,943.93	152,788.89
交易性金融资产	6.4.7.2	583,533,028.06	535,390,165.56
其中：股票投资		583,533,028.06	535,390,165.56
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		58,527.76	561,642.21
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	6,051.13
资产总计		597,442,867.05	548,782,702.87
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		-	3,688.00
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		609.30	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		180,659.11	229,347.19
应付托管费		36,131.82	45,869.45
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	4,371,947.88	848,826.65
负债合计		4,589,348.11	1,127,731.29
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	357,015,722.08	281,015,722.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	235,837,796.86	266,639,249.58
净资产合计		592,853,518.94	547,654,971.58
负债和净资产总计		597,442,867.05	548,782,702.87

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.8303 元，基金份额总额 714,031,444.00 份。

6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞中证科技 100 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 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
一、营业总收入		-76,603,447.42	71,761,690.73
1. 利息收入		112,551.96	204,593.89
其中：存款利息收入	6.4.7.13	107,952.09	115,449.97
债券利息收入		-	71.49
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		4,599.87	89,072.43
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-24,975,193.61	161,727,491.72
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-29,651,363.43	158,241,106.61
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	66,605.11	3,209.64
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	-	-
股利收益	6.4.7.19	4,609,564.71	3,483,175.47
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	-51,429,512.12	-90,905,579.82
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	-311,293.65	735,184.94
减：二、营业总支出		1,508,494.68	3,192,804.02
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,121,190.84	1,825,692.83
2. 托管费	6.4.10.2.2	224,238.18	365,138.52
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		0.36	0.25
8. 其他费用	6.4.7.23	163,065.30	1,001,972.42
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-78,111,942.10	68,568,886.71
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-78,111,942.10	68,568,886.71
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-78,111,942.10	68,568,886.71

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华泰柏瑞中证科技 100 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)	281,015,722.00	-	266,639,249.58	547,654,971.58
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
二、本 期 初 净 资 产(基 金 净 值)	281,015,722.00	-	266,639,249.58	547,654,971.58
三、本 期 增 减 变 动 额(减 少以“-” 号填列)	76,000,000.08	-	-30,801,452.72	45,198,547.36
(一)、 综 合 收 益 总 额	-	-	-78,111,942.10	-78,111,942.10
(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)	76,000,000.08	-	47,310,489.38	123,310,489.46
其中:1. 基 金 申 购 款	150,000,000.10	-	90,984,858.38	240,984,858.48
2 .基 金 赎 回 款	-74,000,000.02	-	-43,674,369.00	-117,674,369.02
(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)	357,015,722.08	-	235,837,796.86	592,853,518.94
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)	542,015,722.00	-	354,328,604.30	896,344,326.30
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)	542,015,722.00	-	354,328,604.30	896,344,326.30
三、本期 增减变 动额(减 少以“-” 号填列)	-184,000,000.00	-	-58,894,522.61	-242,894,522.61
(一)、 综合收 益总额	-	-	68,568,886.71	68,568,886.71
(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)	-184,000,000.00	-	-127,463,409.32	-311,463,409.32

其中:1. 基金申购款	20,000,000.00	-	13,629,799.60	33,629,799.60
2. 基金赎回款	-204,000,000.00	-	-141,093,208.92	-345,093,208.92
(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)	358,015,722.00	-	295,434,081.69	653,449,803.69

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

韩勇

房伟力

赵景云

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞中证科技 100 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[2019]1469 号《关于准予华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》注册,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《华泰柏瑞中证科技 100 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 2,120,015,722.00 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(2019)第 0562 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2019 年 9 月 27 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,120,015,722.00 份基金份额，无认购资金利息折合基金份额。本基金的基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司，基金托管人为中信证券股份有限公司。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律管理决定书[2019]213 号文审核同意，本基金 2,120,015,722.00 份基金份额于 2019 年 10 月 28 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞中证科技 100 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或注册发行的股票)、存托凭证、债券(包括国债、金融债、企业债、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、货币市场工具、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金将根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。本基金投资标的指数成份股、备选成份股及存托凭证的比例不低于基金资产净值的 90%，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科技 100 指数收益率。

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》、《华泰柏瑞中证科技 100 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、应收利息和应收证券清算款，金额分别为 12,472,812.27 元、199,242.81 元、152,788.89 元、6,051.13 元和 561,642.21 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-应收利息和应收清算款，金额分别为 12,478,454.64 元、199,341.48 元、

152,864.57 元、234.41 元和 561,642.21 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 535,390,165.56 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 535,390,165.56 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 229,347.19 元、45,869.45 元、79,673.62 元和 584,153.03 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 229,347.19 元、45,869.45 元、79,673.62 元和 584,153.03 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 3,688.00 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 3,688.00 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	13,569,735.75
等于：本金	13,563,497.41
加：应计利息	6,238.34
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	13,569,735.75

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	588,524,211.43	-	583,533,028.06	-4,991,183.37
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	588,524,211.43	-	583,533,028.06	-4,991,183.37

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

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末未持有期货合约。

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

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

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	64,342.04

其中：交易所市场	64,342.04
银行间市场	—
应付利息	—
预提费用	91,739.85
应付指数使用费	71,325.45
应退退补款	4,144,540.54
合计	4,371,947.88

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	562,031,444.00	281,015,722.00
本期申购	300,000,000.00	150,000,000.10
本期赎回（以“-”号填列）	-148,000,000.00	-74,000,000.02
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	714,031,444.00	357,015,722.08

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	331,977,412.46	-65,338,162.88	266,639,249.58
本期利润	-26,682,429.98	-51,429,512.12	-78,111,942.10
本期基金份额交易产生的变动数	80,588,781.26	-33,278,291.88	47,310,489.38
其中：基金申购款	166,414,985.91	-75,430,127.53	90,984,858.38
基金赎回款	-85,826,204.65	42,151,835.65	-43,674,369.00
本期已分配利润	—	—	—
本期末	385,883,763.74	-150,045,966.88	235,837,796.86

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	102,252.90
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	4,689.17
其他	1,010.02
合计	107,952.09

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	-25,008,449.05
股票投资收益——赎回差价收入	-4,642,914.38
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	-29,651,363.43

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	224,552,606.37
减：卖出股票成本总额	249,201,357.18
减：交易费用	359,698.24
买卖股票差价收入	-25,008,449.05

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	117,674,369.02
减：现金支付赎回款总额	83,903,552.02
减：赎回股票成本总额	38,413,731.38
减：交易费用	—
赎回差价收入	-4,642,914.38

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	98.49
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	66,506.62
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	66,605.11

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	375,323.14
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	308,700.00
减：应计利息总额	101.49
减：交易费用	15.03
买卖债券差价收入	66,506.62

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

注：本基金本报告期内无衍生工具收益——其他投资收益。

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	4,609,564.71
其中：证券出借权益补偿收入	8,230.67
基金投资产生的股利收益	—
合计	4,609,564.71

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	-51,429,512.12
股票投资	-51,429,512.12
债券投资	—
资产支持证券投资	—
基金投资	—
贵金属投资	—
其他	—
2. 衍生工具	—
权证投资	—
3. 其他	—
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	—
合计	-51,429,512.12

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	-311,293.65
合计	-311,293.65

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	32,232.48
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
指数使用费	71,325.45
合计	163,065.30

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
中信证券股份有限公司(“中信证券”)	基金托管人、基金销售机构
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、申购赎回代理券商、基金销售机构
华泰联合证券有限责任公司(“华泰联合”)	基金管理人的股东华泰证券的控股子公司

证券”)	
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	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 (%)
中信证券	534,019,418.87	100.00	917,515,654.35	100.00

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 (%)
中信证券	74,348.15	100.00	64,342.04	100.00
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 (%)
中信证券	120,462.14	100.00	95,252.75	100.00

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	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年
----	--------------------------------	-----------------------------------

	月 30 日	6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,121,190.84	1,825,692.83
其中：支付销售机构的客户维护费	1,322.97	3,894.11

注：支付基金管理人华泰柏瑞基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.50% / 当年天数。

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	224,238.18	365,138.52

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

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.10% / 当年天数。

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

注：本基金本报告期及上年度可比期间未发生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。

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

注：本基金本报告期及上年度可比期间未发生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。

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 (%)
华泰柏瑞中证科技100交易型开放式指数证券投资基金联接基金	478,462,980.00	67.0087	310,958,580.00	55.3276
华泰证券股份有限公司	7,800,004.00	1.0924	6,000,004.00	1.0676
中信证券股份有限公司	1,846,456.00	0.2586	2,448,456.00	0.4356

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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 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
中信证券	603215	比依股份	网下申购	575	7,187.50
中信证券	301200	大族数控	网下申购	3,426	262,294.56
华泰联合证券	301298	东利机械	网下申购	6,340	80,391.20
中信证券	001266	宏英智能	网下申购	247	9,536.67
华泰联合证券	301207	华兰疫苗	网下申购	3,136	178,375.68
华泰联合证券	301256	华融化学	网下申购	18,308	147,379.40
中信证券	301302	华如科技	网下申购	3,646	189,701.38
中信证券	301117	佳缘科技	网下申购	2,616	122,428.80
中信证券	603132	金徽股份	网下申购	1,342	14,493.60
中信证券	688223	晶科能源	网下申购	50,907	254,535.00
中信证券	688150	莱特光电	网下申购	5,626	124,053.30
中信证券	688047	龙芯中科	网下申购	3,029	181,921.74
中信证券	603051	鹿山新材	网下申购	272	7,014.88
中信证券	688171	纬德信息	网下申购	2,821	80,906.28
华泰联合证券	301160	翔楼新材	网下申购	3,918	123,652.08
中信证券	301112	信邦智能	网下申购	3,984	109,679.52
中信证券	603209	兴通股份	网下申购	595	12,804.40
中信证券	301116	益客食品	网下申购	5,764	65,709.60
中信证券	600938	中国海油	网上申购	4,000	43,200.00

中信证券	301175	中科环保	网下申购	40,339	154,094.98
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
中信证券	300930	屹通新材	网下申购	3,220	42,214.20
华泰联合证券	688350	富淼科技	网下申购	2,552	34,656.16
中信证券	688607	康众医疗	网下申购	1,890	43,866.90
中信证券	600916	中国黄金	网下申购	3,371	16,821.29
中信证券	605060	联德股份	网下申购	883	13,765.97
中信证券	688079	美迪凯	网下申购	10,622	108,238.18
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	1,837	276,468.50
中信证券	003040	楚天龙	网下申购	1,101	5,086.62
华泰联合证券	605389	长龄液压	网下申购	356	14,026.40
中信证券	688468	科美诊断	网下申购	3,919	28,020.85
中信证券	300966	共同药业	网下申购	2,858	23,549.92
中信证券	688315	诺禾致源	网下申购	3,711	47,352.36
中信证券	601279	英利汽车	网下申购	2,004	4,148.28
中信证券	300978	东箭科技	网下申购	5,930	49,930.60
中信证券	300982	苏文电能	网下申购	3,170	50,181.10
华泰联合证券	688097	博众精工	网下申购	3,983	44,888.41
中信证券	605488	福莱新材	网下申购	416	8,498.88
中信证券	688565	力源科技	网下申购	2,464	23,136.96
中信证券	688575	亚辉龙	网下申购	3,435	50,838.00
华泰联合证券	688314	康拓医疗	网下申购	1,085	18,813.90
中信证券、华泰联合证券	600905	三峡能源	网上申购	32,000	84,800.00
中信证券	688660	电气风电	网下申购	37,233	202,547.52
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
中信证券	300997	欢乐家	网下申购	9,279	45,838.26
中信证券	603529	爱玛科技	网下申购	1,019	28,389.34
中信证券	688226	威腾电气	网下申购	2,693	17,289.06
华泰联合证券	688161	威高骨科	网下申购	3,069	111,159.18
中信证券	001208	华菱线缆	网下申购	1,754	6,437.18
中信证券	688425	铁建重工	网下申购	72,279	207,440.73
中信证券	688690	纳微科技	网下申购	3,477	28,059.39
中信证券	688276	百克生物	网下申购	3,486	126,716.10
华泰联合证券	605208	永茂泰	网下申购	801	10,733.40

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	360	20,005.20	10,810.80	-
301102	兆讯传媒	2022 年 3 月 15 日	6 个月	新股锁定期内	39.88	31.09	367	14,635.96	11,410.03	-
301103	何氏眼科	2022 年 3 月 14 日	6 个月	新股锁定期内	42.5	32.02	467	15,257.50	14,953.34	-
301110	青木股份	2022 年 3 月 4 日	6 个月	新股锁定期内	63.1	39.85	202	12,746.20	8,049.70	-
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	5,029	193,415.34	193,415.34	-
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	40,339	154,094.98	154,094.98	-
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	190	12,175.20	7,128.80	-
301200	大族 数控	2022 年 2 月 18 日	6 个月	新股锁 定期内	76.56	51.92	343	26,260.08	17,808.56	-
301201	诚达 药业	2022 年 1 月 12 日	6 个月	新股锁 定期内	72.69	71.54	328	23,842.32	23,465.12	-
301206	三元 生物	2022 年 1 月 26 日	6 个月	新股锁 定期内	109.3	45.69	347	25,248.30	15,854.43	-
301207	华兰 疫苗	2022 年 2 月 10 日	6 个月	新股锁 定期内	56.88	56.42	314	17,860.32	17,715.88	-
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	6 个月	新股锁 定期内	173.98	87.82	130	12,526.56	11,416.60	-

		日								
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	4,180	140,657.00	140,657.00	-
301239	普瑞眼科	2022 年 6 月 22 日	6 个月	新股锁定期内	33.65	33.65	465	15,647.25	15,647.25	-
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	287	13,862.10	11,962.16	-
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	2022 年	6 个月	新股锁	12.68	20.83	634	8,039.12	13,206.22	-

	机械	5 月 27 日		定期内							
301302	华如科技	2022 年 6 月 16 日	6 个月	新股锁定期内	52.03	56.42	365	18,990.95	20,593.30		-
688115	思林杰	2022 年 3 月 7 日	6 个月	新股锁定期内	65.65	38.46	2,153	141,344.45	82,804.38		-
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		-
688322	奥比中光	2022 年 6 月 30 日	1 个月内(含)	新股未上市	30.99	30.99	8,070	250,089.30	250,089.30		-
688400	凌云光	2022 年 6 月 27 日	1 个月内(含)	新股未上市	21.93	21.93	7,233	158,619.69	158,619.69		-

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

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，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信证券开立于交通银行的托管账户，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。

于 2022 年 6 月 30 日，本基金无债券投资 (2021 年 12 月 31 日：同)。

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

注：无。

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 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 0.28%。

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	13,569,735.75	-	-	-	-	-	13,569,735.75
结算备付金	142,631.55	-	-	-	-	-	142,631.55
存出保证金	138,943.93	-	-	-	-	-	138,943.93
交易性金融资产	-	-	-	-	-	583,533,028.06	583,533,028.06
应收清算款	-	-	-	-	-	58,527.76	58,527.76
资产总计	13,851,311.23	-	-	-	-	583,591,555.82	597,442,867.05
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	180,659.11	180,659.11
应付托管费	-	-	-	-	-	36,131.82	36,131.82
应付清算款	-	-	-	-	-	609.30	609.30
其他负债	-	-	-	-	-	4,371,947.88	4,371,947.88
负债总计	-	-	-	-	-	4,589,348.11	4,589,348.11
利率敏感度缺口	13,851,311.23	-	-	-	-	579,002,207.71	592,853,518.94
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	12,472,812.27	-	-	-	-	-	12,472,812.27
结算备付金	199,242.81	-	-	-	-	-	199,242.81
存出保证金	152,788.89	-	-	-	-	-	152,788.89
交易性金融资产	-	-	-	-	-	535,390,165.56	535,390,165.56
应收利息	-	-	-	-	-	6,051.13	6,051.13
应收证券清算款	-	-	-	-	-	561,642.21	561,642.21
资产总计	12,824,843.97	-	-	-	-	535,957,858.90	548,782,702.87
负债							
交易性金融负债	-	-	-	-	-	3,688.00	3,688.00
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	229,347.19	229,347.19
应付托管费	-	-	-	-	-	45,869.45	45,869.45
应付交易费用	-	-	-	-	-	79,673.62	79,673.62
其他负债	-	-	-	-	-	769,153.03	769,153.03
负债总计	-	-	-	-	-	1,127,731.29	1,127,731.29
利率敏感度缺口	12,824,843.97	-	-	-	-	534,830,127.61	547,654,971.58

注：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：同)，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，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 90%，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	583,533,028.06	98.43	535,390,165.56	97.76
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	-	-	-3,688.00	-
合计	583,533,028.06	98.43	535,386,477.56	97.76

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证科技 100 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	中证科技 100 指数 上升 5%	28,371,203.34	26,284,574.22
	中证科技 100 指数 下降 5%	-28,371,203.34	-26,284,574.22

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	581,864,980.52	532,405,599.50
第二层次	1,097,270.65	2,984,566.06
第三层次	570,776.89	-
合计	583,533,028.06	535,390,165.56

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	583,533,028.06	97.67
	其中：股票	583,533,028.06	97.67
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	13,712,367.30	2.30
8	其他各项资产	197,471.69	0.03
9	合计	597,442,867.05	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 0.00 元，占本基金期末资产净值的 0.00%。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 0 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 0.00 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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	505,579,132.14	85.28
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	67,296,362.45	11.35
J	金融业	2,374,712.00	0.40
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	6,566,620.00	1.11
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	581,816,826.59	98.14

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	1,067,404.68	0.18
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	253,825.66	0.04
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	11,410.03	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	166,141.00	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	171,257.59	0.03
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,716,201.47	0.29

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	300750	宁德时代	58,900	31,452,600.00	5.31
2	600276	恒瑞医药	838,817	31,111,722.53	5.25
3	300760	迈瑞医疗	95,600	29,941,920.00	5.05
4	600438	通威股份	476,700	28,535,262.00	4.81
5	002415	海康威视	785,031	28,418,122.20	4.79
6	000725	京东方 A	7,083,000	27,907,020.00	4.71
7	002475	立讯精密	777,060	26,256,857.40	4.43
8	002129	TCL 中环	429,100	25,269,699.00	4.26
9	600089	特变电工	717,800	19,660,542.00	3.32
10	688981	中芯国际	341,792	15,438,744.64	2.60
11	000063	中兴通讯	604,720	15,438,501.60	2.60
12	002241	歌尔股份	456,500	15,338,400.00	2.59
13	002230	科大讯飞	353,899	14,587,716.78	2.46
14	000661	长春高新	60,200	14,051,884.00	2.37
15	000100	TCL 科技	2,656,600	12,725,114.00	2.15
16	600745	闻泰科技	133,100	11,328,141.00	1.91
17	600196	复星医药	224,440	9,895,559.60	1.67

18	002410	广联达	180,177	9,808,835.88	1.65
19	600570	恒生电子	219,686	9,565,128.44	1.61
20	601877	正泰电器	206,700	7,395,726.00	1.25
21	600584	长电科技	273,500	7,384,500.00	1.25
22	002180	纳思达	136,700	6,919,754.00	1.17
23	300207	欣旺达	210,100	6,639,160.00	1.12
24	002405	四维图新	425,321	6,409,587.47	1.08
25	300601	康泰生物	131,700	5,950,206.00	1.00
26	002236	大华股份	345,300	5,669,826.00	0.96
27	600487	亨通光电	358,200	5,208,228.00	0.88
28	002013	中航机电	406,600	5,021,510.00	0.85
29	300037	新宙邦	94,520	4,967,971.20	0.84
30	300003	乐普医疗	242,400	4,501,368.00	0.76
31	600845	宝信软件	76,612	4,183,015.20	0.71
32	002432	九安医疗	68,000	4,084,080.00	0.69
33	000988	华工科技	175,500	4,066,335.00	0.69
34	603236	移远通信	29,120	3,892,179.20	0.66
35	002938	鹏鼎控股	126,600	3,824,586.00	0.65
36	002056	横店东磁	141,496	3,766,623.52	0.64
37	603882	金域医学	45,000	3,714,750.00	0.63
38	600521	华海药业	161,200	3,659,240.00	0.62
39	688099	晶晨股份	31,486	3,180,086.00	0.54
40	002030	达安基因	184,312	3,168,323.28	0.53
41	002294	信立泰	105,300	2,958,930.00	0.50
42	300418	昆仑万维	180,900	2,894,400.00	0.49
43	002223	鱼跃医疗	112,300	2,881,618.00	0.49
44	300244	迪安诊断	91,700	2,851,870.00	0.48
45	300308	中际旭创	89,514	2,779,409.70	0.47
46	002156	通富微电	177,100	2,727,340.00	0.46
47	300558	贝达药业	44,200	2,687,360.00	0.45
48	300253	卫宁健康	304,200	2,670,876.00	0.45
49	600380	健康元	215,526	2,661,746.10	0.45
50	002439	启明星辰	130,400	2,598,872.00	0.44
51	000513	丽珠集团	71,300	2,581,773.00	0.44
52	002600	领益智造	502,300	2,521,546.00	0.43
53	300803	指南针	40,400	2,374,712.00	0.40
54	000050	深天马 A	237,600	2,368,872.00	0.40
55	600271	航天信息	211,800	2,317,092.00	0.39
56	002152	广电运通	239,400	2,219,238.00	0.37
57	002643	万润股份	106,200	2,215,332.00	0.37
58	002139	拓邦股份	175,500	2,153,385.00	0.36
59	002212	天融信	207,800	2,109,170.00	0.36

60	603658	安图生物	42,100	2,058,269.00	0.35
61	300409	道氏技术	77,900	2,023,842.00	0.34
62	000997	新大陆	153,000	2,021,130.00	0.34
63	002396	星网锐捷	84,000	1,901,760.00	0.32
64	300482	万孚生物	46,700	1,901,157.00	0.32
65	600062	华润双鹤	72,100	1,850,086.00	0.31
66	603087	甘李药业	38,000	1,822,860.00	0.31
67	600216	浙江医药	131,700	1,797,705.00	0.30
68	601231	环旭电子	122,400	1,757,664.00	0.30
69	601179	中国西电	364,300	1,704,924.00	0.29
70	000810	创维数字	101,900	1,651,799.00	0.28
71	300166	东方国信	175,500	1,618,110.00	0.27
72	300630	普利制药	46,000	1,616,900.00	0.27
73	300451	创业慧康	224,300	1,614,960.00	0.27
74	601126	四方股份	96,200	1,559,402.00	0.26
75	300772	运达股份	60,400	1,536,576.00	0.26
76	000915	华特达因	35,700	1,476,195.00	0.25
77	688298	东方生物	11,900	1,358,385.00	0.23
78	002262	恩华药业	98,700	1,342,320.00	0.23
79	002038	双鹭药业	138,100	1,340,951.00	0.23
80	300639	凯普生物	61,700	1,319,146.00	0.22
81	002281	光迅科技	72,395	1,272,704.10	0.21
82	002387	维信诺	182,448	1,226,050.56	0.21
83	300188	美亚柏科	90,016	1,213,415.68	0.20
84	002130	沃尔核材	187,900	1,153,706.00	0.19
85	600312	平高电气	141,200	1,126,776.00	0.19
86	002635	安洁科技	66,600	1,090,242.00	0.18
87	002020	京新药业	116,800	1,062,880.00	0.18
88	300369	绿盟科技	99,600	1,047,792.00	0.18
89	600420	国药现代	99,800	988,020.00	0.17
90	002773	康弘药业	65,800	983,052.00	0.17
91	300271	华宇软件	122,400	920,448.00	0.16
92	600756	浪潮软件	60,100	852,819.00	0.14
93	000823	超声电子	71,200	736,208.00	0.12
94	002932	明德生物	9,983	684,434.48	0.12
95	688317	之江生物	17,381	649,875.59	0.11
96	600268	国电南自	67,300	595,605.00	0.10
97	002533	金杯电工	80,100	567,909.00	0.10
98	688399	硕世生物	4,919	560,864.38	0.09
99	688819	天能股份	16,107	556,980.06	0.09
100	688606	奥泰生物	2,800	340,536.00	0.06

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	688322	奥比中光	8,070	250,089.30	0.04
2	301139	元道通信	5,029	193,415.34	0.03
3	688400	凌云光	7,233	158,619.69	0.03
4	301239	普瑞眼科	4,645	156,304.25	0.03
5	301175	中科环保	40,339	154,094.98	0.03
6	688237	超卓航科	2,891	119,311.57	0.02
7	688115	思林杰	2,153	82,804.38	0.01
8	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.01
9	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.01
10	301215	中汽股份	4,743	30,307.77	0.01
11	301266	宇邦新材	517	24,335.19	0.00
12	301201	诚达药业	328	23,465.12	0.00
13	301122	采纳股份	301	21,181.37	0.00
14	301302	华如科技	365	20,593.30	0.00
15	301256	华融化学	1,831	18,456.48	0.00
16	301112	信邦智能	399	17,970.96	0.00
17	301200	大族数控	343	17,808.56	0.00
18	301207	华兰疫苗	314	17,715.88	0.00
19	301153	中科江南	398	17,504.04	0.00
20	301235	华康医疗	418	15,854.74	0.00
21	301206	三元生物	347	15,854.43	0.00
22	301103	何氏眼科	467	14,953.34	0.00
23	301160	翔楼新材	392	14,762.72	0.00
24	301117	佳缘科技	262	14,263.28	0.00
25	301212	联盛化学	416	13,844.48	0.00
26	301298	东利机械	634	13,206.22	0.00
27	301259	艾布鲁	483	12,046.02	0.00
28	301258	富士莱	287	11,962.16	0.00
29	301116	益客食品	577	11,805.42	0.00
30	301219	腾远钴业	130	11,416.60	0.00
31	301102	兆讯传媒	367	11,410.03	0.00
32	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
33	301220	亚香股份	285	11,157.75	0.00
34	301237	和顺科技	261	10,925.46	0.00
35	300834	星辉环材	360	10,810.80	0.00
36	301137	哈焊华通	644	10,297.56	0.00
37	301222	浙江恒威	332	9,614.72	0.00
38	301288	清研环境	452	9,030.96	0.00

39	301125	腾亚精工	327	8,966.34	0.00
40	301130	西点药业	237	8,934.90	0.00
41	301110	青木股份	202	8,049.70	0.00
42	301181	标榜股份	257	7,861.63	0.00
43	301158	德石股份	379	7,724.02	0.00
44	301196	唯科科技	190	7,128.80	0.00
45	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	300750	宁德时代	29,120,842.00	5.32
2	600438	通威股份	18,419,130.00	3.36
3	002415	海康威视	14,853,737.09	2.71
4	300760	迈瑞医疗	14,788,259.05	2.70
5	000725	京东方 A	13,259,338.00	2.42
6	000661	长春高新	11,669,092.00	2.13
7	002475	立讯精密	11,572,332.40	2.11
8	688981	中芯国际	11,182,068.72	2.04
9	002129	TCL 中环	8,903,130.00	1.63
10	002241	歌尔股份	7,277,096.29	1.33
11	000063	中兴通讯	6,950,230.80	1.27
12	300207	欣旺达	6,725,024.07	1.23
13	002230	科大讯飞	6,662,225.81	1.22
14	600745	闻泰科技	6,452,160.00	1.18
15	002405	四维图新	6,243,436.78	1.14
16	000100	TCL 科技	5,564,950.00	1.02
17	600276	恒瑞医药	4,701,686.26	0.86
18	300037	新宙邦	4,525,527.60	0.83
19	002432	九安医疗	4,492,717.00	0.82
20	002410	广联达	4,413,772.00	0.81

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	600406	国电南瑞	14,741,032.40	2.69
2	603986	兆易创新	11,254,965.20	2.06
3	000733	振华科技	8,847,583.00	1.62
4	002001	新和成	8,611,466.32	1.57
5	002475	立讯精密	7,791,449.40	1.42

6	300760	迈瑞医疗	7,418,899.00	1.35
7	002202	金风科技	7,017,418.00	1.28
8	002129	TCL 中环	6,766,107.00	1.24
9	601615	明阳智能	6,441,108.00	1.18
10	002241	歌尔股份	6,235,656.00	1.14
11	000725	京东方 A	5,835,240.00	1.07
12	002415	海康威视	5,718,077.00	1.04
13	000063	中兴通讯	5,417,663.00	0.99
14	002230	科大讯飞	4,952,312.00	0.90
15	002252	上海莱士	4,530,953.00	0.83
16	000100	TCL 科技	4,418,535.00	0.81
17	000519	中兵红箭	4,243,018.00	0.77
18	002185	华天科技	4,037,903.00	0.74
19	002025	航天电器	3,824,668.00	0.70
20	002465	海格通信	3,476,387.00	0.63

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	318,562,733.97
卖出股票收入（成交）总额	224,552,606.37

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

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 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	138,943.93
2	应收清算款	58,527.76
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	197,471.69

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	688322	奥比中光	250,089.30	0.04	新股未上市

2	301139	元道通信	193,415.34	0.03	新股未上市
3	688400	凌云光	158,619.69	0.03	新股未上市
4	301239	普瑞眼科	156,304.25	0.03	新股未上市
5	301175	中科环保	154,094.98	0.03	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 (%)
4,559	156,620.19	512,410,868.00	71.76	201,620,576.00	28.24

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	478,462,980.00	67.0087

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	华泰证券股份有限公司	7,800,004.00	1.09
2	招商证券股份有限公司	7,797,539.00	1.09
3	方正证券股份有限公司	6,748,129.00	0.95
4	赵熹光	3,915,200.00	0.55
5	李从华	3,256,400.00	0.46
6	中国国际金融股份有限公司	2,596,100.00	0.36
7	浦银安盛基金—建设银行—浦银安盛盛卓 8 号 FOF 集合资产管理计划	2,319,000.00	0.32
8	申万宏源证券有限公司	2,240,100.00	0.31
9	李前	2,000,000.00	0.28
10	中信证券股份有限公司	1,846,456.00	0.26

	司		
--	---	--	--

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	65,600.00	0.0092

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（2019 年 9 月 27 日）	2,120,015,722.00
基金份额总额	
本报告期期初基金份额总额	562,031,444.00
本报告期基金总申购份额	300,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	148,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	714,031,444.00

§ 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 (%)	
中信证券	4	534,019,418.87	100.00	74,348.15	100.00	-

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，无变更租用证券公司交易单元的情况。

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 (%)

中信证券	375,323.14	100.00	-	-	-	-
------	------------	--------	---	---	---	---

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华泰柏瑞基金管理有限公司关于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 6 月 21 日
2	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 6 月 18 日
3	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
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 6 月 17 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 28 日
6	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2022 年 5 月 26 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 5 月 11 日
8	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
9	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
10	关于同意中国国际金融股份有限公司为华泰柏瑞中证科技 100 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 4 月 13 日
11	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 3 月 19 日
12	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 3 月 18 日
13	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 3 月 11 日
14	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下	证监会规定报刊和网站	2022 年 2 月 22 日

	基金投资关联方承销期内承销证券的公告		
15	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 2 月 19 日
16	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 2 月 16 日
17	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 2 月 12 日
18	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 21 日
19	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 20 日
20	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 11 日
21	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 8 日
22	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
23	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 (%)
联接基金	1	20220101-20220630;	310958580	193750000	26245600	478462980	67.0087
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、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

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

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