

# 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 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：中信建投证券股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 28 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中信建投证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 25 日（基金合同生效日）起至 2021 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

|                                         |           |
|-----------------------------------------|-----------|
| <b>§1 重要提示及目录</b>                       | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| 1.2 目录                                  | 3         |
| <b>§2 基金简介</b>                          | <b>6</b>  |
| 2.1 基金基本情况                              | 6         |
| 2.2 基金产品说明                              | 6         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 7         |
| 2.4 信息披露方式                              | 7         |
| 2.5 其他相关资料                              | 7         |
| <b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b>                 | <b>8</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 8         |
| 3.2 基金净值表现                              | 8         |
| <b>§4 管理人报告</b>                         | <b>10</b> |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 10        |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 13        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 13        |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明             | 14        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 14        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 15        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 15        |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明       | 15        |
| <b>§5 托管人报告</b>                         | <b>16</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 16        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 16        |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见       | 16        |
| <b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>               | <b>17</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 17        |
| 6.2 利润表                                 | 18        |

|                                             |           |
|---------------------------------------------|-----------|
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....                    | 19        |
| 6.4 报表附注 .....                              | 20        |
| <b>§7 投资组合报告 .....</b>                      | <b>51</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况 .....                        | 51        |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合 .....                    | 51        |
| 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 .....     | 52        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....                   | 55        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....                  | 56        |
| 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....    | 56        |
| 7.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 ..... | 57        |
| 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 ..... | 57        |
| 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 .....    | 57        |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....             | 57        |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....             | 57        |
| 7.12 投资组合报告附注 .....                         | 57        |
| <b>§8 基金份额持有人信息 .....</b>                   | <b>59</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 59        |
| 8.2 期末上市基金前十名持有人 .....                      | 59        |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 59        |
| 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....     | 59        |
| <b>§9 开放式基金份额变动 .....</b>                   | <b>61</b> |
| <b>§10 重大事件揭示 .....</b>                     | <b>62</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 62        |
| 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....      | 62        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 62        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                        | 62        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 62        |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....         | 62        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                | 62        |
| 10.8 其他重大事件 .....                           | 63        |

---

|                                    |           |
|------------------------------------|-----------|
| <b>§11 影响投资者决策的其他重要信息</b>          | <b>67</b> |
| 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 | 67        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息                | 67        |
| <b>§12 备查文件目录</b>                  | <b>68</b> |
| 12.1 备查文件目录                        | 68        |
| 12.2 存放地点                          | 68        |
| 12.3 查阅方式                          | 68        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|              |                            |
|--------------|----------------------------|
| 基金名称         | 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 |
| 基金简称         | 互联网 50                     |
| 场内简称         | 互联网 50                     |
| 扩位证券简称       | 互联网 50ETF                  |
| 基金主代码        | 517050                     |
| 基金运作方式       | 交易型开放式                     |
| 基金合同生效日      | 2021 年 1 月 25 日            |
| 基金管理人        | 华泰柏瑞基金管理有限公司               |
| 基金托管人        | 中信建投证券股份有限公司               |
| 报告期末基金份额总额   | 1,045,605,000.00 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         | 2021 年 2 月 8 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；当标的指数进行定期调整、指数样本空间或者编制规则变更时，本基金将根据标的指数的编制规则及调整公告，及时进行投资组合的优化调整，尽量降低跟踪误差，力争将日均跟踪偏离度控制在 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 以内。                                                       |
| 业绩比较基准 | 中证沪港深互联网指数                                                                                                                                                                                                                              |
| 风险收益特征 | <p>本基金属于股票型基金中的指数型基金，采用完全复制的被动式投资策略，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征：一方面，相对于混合型基金、债券型基金与货币市场基金而言，其风险和收益较高；另一方面，相对于采用抽样复制的指数型基金而言，其风险和收益特征将更能与标的指数保持基本一致。</p> <p>本基金可投资港股通标的股票，除需承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险，还需承担汇率风险以及香港市场风险等境外证券市场投资</p> |

|  |             |
|--|-------------|
|  | 所面临的特别投资风险。 |
|--|-------------|

## 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                        | 中信建投证券股份有限公司                  |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 刘万方                                 | 朱志明                           |
|         | 联系电话 | 021-38601777                        | 4008-888-108                  |
|         | 电子邮箱 | cs4008880001@huatai-pb.com          | service@csc.com.cn            |
| 客户服务电话  |      | 400-888-0001                        | 4008-888-108                  |
| 传真      |      | 021-38601799                        | 010-85130975                  |
| 注册地址    |      | 上海市浦东新区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 | 北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼           |
| 办公地址    |      | 上海市浦东新区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 | 北京市东城区朝阳门内大街 2 号凯恒中心 B 座 10 层 |
| 邮政编码    |      | 200135                              | 100010                        |
| 法定代表人   |      | 贾波                                  | 王常青                           |

## 2.4 信息披露方式

|                     |                                                                 |
|---------------------|-----------------------------------------------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 上海证券报                                                           |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | <a href="http://www.huatai-pb.com">http://www.huatai-pb.com</a> |
| 基金中期报告备置地点          | 上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层                              |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称             | 办公地址                       |
|--------|----------------|----------------------------|
| 注册登记机构 | 中国证券登记结算有限责任公司 | 北京西城区金融大街 27 号投资广场 22-23 层 |

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2021 年 1 月 25 日 - 2021 年 6 月 30 日 ) |
|---------------|-----------------------------------------|
| 本期已实现收益       | -8,435,486.35                           |
| 本期利润          | -101,162,991.12                         |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.0832                                 |
| 本期加权平均净值利润率   | -9.03%                                  |
| 本期基金份额净值增长率   | -7.85%                                  |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末( 2021 年 6 月 30 日 )                 |
| 期末可供分配利润      | -82,117,392.02                          |
| 期末可供分配基金份额利润  | -0.0785                                 |
| 期末基金资产净值      | 963,487,607.98                          |
| 期末基金份额净值      | 0.9215                                  |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末( 2021 年 6 月 30 日 )                 |
| 基金份额累计净值增长率   | -7.85%                                  |

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、本基金成立日期为 2021 年 1 月 25 日。

#### 3.2 基金净值表现

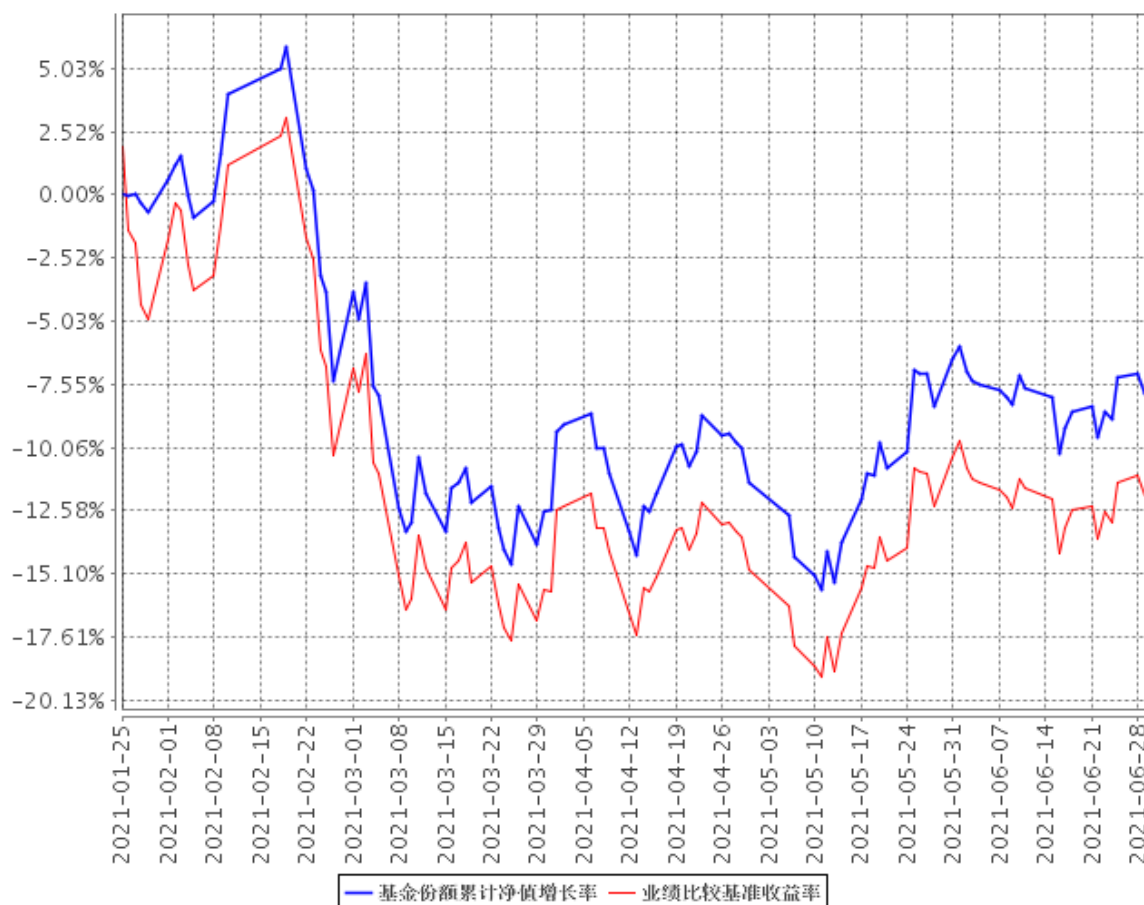
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段             | 份额净值<br>增长率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③   | ②—④    |
|----------------|--------------|---------------------|--------------------|-----------------------|-------|--------|
| 过去一个月          | -1.37%       | 0.98%               | -1.75%             | 1.03%                 | 0.38% | -0.05% |
| 过去三个月          | 5.37%        | 1.34%               | 4.50%              | 1.40%                 | 0.87% | -0.06% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | -7.85%       | 1.63%               | -12.02%            | 1.79%                 | 4.17% | -0.16% |



### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、图示日期为 2021 年 1 月 25 日至 2021 年 6 月 30 日。

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

3、自基金合同生效起至本报告期末不满一年。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司。华泰柏瑞基金管理有限公司是经中国证监会批准，于 2004 年 11 月 18 日成立的合资基金管理公司，注册资本为 2 亿元人民币。目前的股东构成为华泰证券股份有限公司、柏瑞投资有限责任公司（原 AIGGIC）和苏州新区高新技术产业股份有限公司，出资比例分别为 49%、49%和 2%。目前公司旗下管理华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金、华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金、上证红利交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金、华泰柏瑞货币市场证券投资基金、华泰柏瑞行业领先混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化先行混合型证券投资基金、华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金、上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金、华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金、华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金、华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金、华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金、华泰柏瑞交易型货币市场基金、华泰柏瑞激励动力灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化对冲稳健收益定期开放混合型发起式证券投资基金、华泰柏瑞天添宝货币市场基金、华泰柏瑞多策略灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞新经济沪港深灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞享利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化创优灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞生物医药灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞富利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞港股通量化灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞战略新兴产业混合型证券投资基金、华泰柏瑞新金

融地产灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数基金、华泰柏瑞医疗健康混合型证券投资基金、华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通指数基金联接基金、华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞量化明选混合型证券投资基金、华泰柏瑞基本面智选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞锦泰一年定期开放债券型证券投资基金、华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞益通三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、华泰柏瑞研究精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞景气回报一年持有期混合型证券投资基金、华泰柏瑞锦兴 39 个月定期开放债券型证券投资基金、华泰柏瑞锦瑞债券型证券投资基金、华泰柏瑞益商一年定期开放债券型发起式证券投资基金、华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞质量成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞行业精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞鸿利中短债债券型证券投资基金、华泰柏瑞景气优选混合型证券投资基金、华泰柏瑞品质优选混合型证券投资基金、华泰柏瑞景利混合型证券投资基金、华泰柏瑞优势领航混合型证券投资基金、华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞锦乾债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化创盈混合型证券投资基金、华泰柏瑞成长智选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞量化创享混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞质量领先混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证稀土产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞品质成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证物联网主题交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞质量精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞港股通时代机遇混合型证券投资基金、华泰柏瑞行业严选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证企业核心竞争力 50 交易型开放式指数证券投资基金。截至 2021 年 6 月 30 日，公司基金管理规模为 2174.24 亿元。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务       | 任本基金的基金经理（助理）期限 |      | 证券从业年限 | 说明                                                         |
|----|----------|-----------------|------|--------|------------------------------------------------------------|
|    |          | 任职日期            | 离任日期 |        |                                                            |
| 李茜 | 本基金的基金经理 | 2021 年 1 月 25 日 | -    | 6 年    | 曾任职于上海市虹口区金融服务局。2015 年 3 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任指数投资部助理研究员、研究员。 |

|    |          |                 |   |      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
|----|----------|-----------------|---|------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    |          |                 |   |      | <p>2019 年 11 月起任上证红利交易型开放式指数证券投资基金、上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2020 年 12 月起任华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 1 月起任华泰柏瑞中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 2 月起任华泰柏瑞中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证稀土产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月起任华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金和华泰柏瑞中证物联网主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> |
| 何琦 | 本基金的基金经理 | 2021 年 1 月 25 日 | - | 13 年 | <p>上海交通大学经济学学士。曾任汇丰银行证券服务部证券结算师，2008 年 11 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，曾任交易部高级交易员，海外投资部基金经理助理。2017 年 7 月起任华泰柏瑞新经济沪港深灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 8 月起任华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 12 月起任华泰柏瑞中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 1 月起任华泰柏瑞中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 5 月起任华泰柏瑞港股通时</p>                                                                                                   |

|     |              |                    |   |     |                                                                                                                                                                                                                                  |
|-----|--------------|--------------------|---|-----|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |              |                    |   |     | 代机遇混合型证券投资基金和<br>华泰柏瑞南方东英恒生科技指<br>数交易型开放式指数证券投资<br>基金（QDII）的基金经理。                                                                                                                                                                |
| 李沐阳 | 本基金的<br>基金经理 | 2021 年 3 月 10<br>日 | - | 3 年 | 美国哥伦比亚大学应用统计学<br>硕士。2017 年 8 月加入华泰柏<br>瑞基金管理有限公司，历任指<br>数投资部助理研究员、研究员、<br>基金经理助理。2021 年 1 月起<br>任华泰柏瑞中证光伏产业交易<br>型开放式指数证券投资基金的<br>基金经理。2021 年 3 月起任华<br>泰柏瑞中证动漫游戏交易型开<br>放式指数证券投资基金、华泰<br>柏瑞中证沪港深互联网交易型<br>开放式指数证券投资基金的基<br>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

2021 年上半年市场以结构性机会为主。其中电气设备、钢铁、化工等行业录得正收益，期间电气设备行业指数上涨达 23.83%，钢铁行业指数上涨达 23.62%。整体来看，沪深 300、中证 500、中证 1000 和创业板涨跌幅分别为 0.24%、6.93%、6.58%、和 17.22%。从市场风格来看，成长风格表现相对强势，优于价值风格，期间沪深 300 价值指数和沪深 300 成长指数分别涨幅为 0.28% 和 4.78%。

我们严格按照基金合同的规定，紧密跟踪标的指数、跟踪偏离最小化的投资策略进行被动投资。本报告期内，本基金的日均绝对跟踪偏离度为 0.056%，期间日跟踪误差为 0.069%，较好地实现了本基金的投资目标。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.9215 元；本报告期基金份额净值增长率为-7.85%，业绩比较基准收益率为-12.02%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

新冠疫情后中国经济增速或逐渐向新平台回归。外需层面上来看，全球复苏的主线逐渐从商

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

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

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

在本报告期内，本基金托管人在托管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过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 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

在本报告期内，本基金托管人按照相关法律法规、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作进行了监督，未发现基金管理人有关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真实、准确和完整发表意见

本报告中财务指标、净值收益表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告的数据真实、准确和完整（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分，以及涉及关联方和基金份额持有人信息等相关数据未在托管人复核范围内）。



## § 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：华泰柏瑞中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产             | 附注号        | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日         |
|-----------------|------------|--------------------------------|
| <b>资 产：</b>     |            |                                |
| 银行存款            | 6.4.7.1    | 30,903,938.01                  |
| 结算备付金           |            | 274,596.39                     |
| 存出保证金           |            | 598,248.83                     |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 936,414,869.37                 |
| 其中：股票投资         |            | 936,414,869.37                 |
| 基金投资            |            | —                              |
| 债券投资            |            | —                              |
| 资产支持证券投资        |            | —                              |
| 贵金属投资           |            | —                              |
| 衍生金融资产          | 6.4.7.3    | —                              |
| 买入返售金融资产        | 6.4.7.4    | —                              |
| 应收证券清算款         |            | 530,826.98                     |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 6,306.00                       |
| 应收股利            |            | 27,130.56                      |
| 应收申购款           |            | —                              |
| 递延所得税资产         |            | —                              |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | 80,938.84                      |
| 资产总计            |            | 968,836,854.98                 |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2021 年 6 月 30 日</b> |
| <b>负 债：</b>     |            |                                |
| 短期借款            |            | —                              |
| 交易性金融负债         |            | 10,122.00                      |
| 衍生金融负债          | 6.4.7.3    | —                              |
| 卖出回购金融资产款       |            | —                              |
| 应付证券清算款         |            | —                              |
| 应付赎回款           |            | —                              |
| 应付管理人报酬         |            | 407,171.71                     |
| 应付托管费           |            | 81,434.36                      |
| 应付销售服务费         |            | —                              |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | 1,867,775.37                   |
| 应交税费            |            | —                              |

|               |          |                  |
|---------------|----------|------------------|
| 应付利息          |          | -                |
| 应付利润          |          | -                |
| 递延所得税负债       |          | -                |
| 其他负债          | 6.4.7.8  | 2,982,743.56     |
| 负债合计          |          | 5,349,247.00     |
| <b>所有者权益：</b> |          |                  |
| 实收基金          | 6.4.7.9  | 1,045,605,000.00 |
| 未分配利润         | 6.4.7.10 | -82,117,392.02   |
| 所有者权益合计       |          | 963,487,607.98   |
| 负债和所有者权益总计    |          | 968,836,854.98   |

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.9215 元，基金份额总额 1,045,605,000.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：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

本报告期：2021 年 1 月 25 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目                   | 附注号        | 本期<br>2021 年 1 月 25 日(基<br>金合同生效日)至<br>2021 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|------------|--------------------------------------------------------|
| <b>一、收入</b>           |            | -94,780,297.99                                         |
| 1.利息收入                |            | 517,594.67                                             |
| 其中：存款利息收入             | 6.4.7.11   | 454,886.24                                             |
| 债券利息收入                |            | 1,064.62                                               |
| 资产支持证券利息收入            |            | -                                                      |
| 买入返售金融资产收入            |            | 61,643.81                                              |
| 证券出借利息收入              |            | -                                                      |
| 其他利息收入                |            | -                                                      |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      |            | -2,015,009.24                                          |
| 其中：股票投资收益             | 6.4.7.12   | -6,461,137.98                                          |
| 基金投资收益                |            | -                                                      |
| 债券投资收益                | 6.4.7.13   | 2,099,513.15                                           |
| 资产支持证券投资收益            | 6.4.7.13.5 | -                                                      |
| 贵金属投资收益               | 6.4.7.14   | -                                                      |
| 衍生工具收益                | 6.4.7.15   | -                                                      |
| 股利收益                  | 6.4.7.16   | 2,346,615.59                                           |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17   | -92,727,504.77                                         |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）     |            | -                                                      |

|                            |            |                 |
|----------------------------|------------|-----------------|
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）          | 6.4.7.18   | -555,378.65     |
| <b>减：二、费用</b>              |            | 6,382,693.13    |
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2.1 | 2,410,637.58    |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 482,127.54      |
| 3. 销售服务费                   | 6.4.10.2.3 | -               |
| 4. 交易费用                    | 6.4.7.19   | 3,314,968.06    |
| 5. 利息支出                    |            | -               |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | -               |
| 6. 税金及附加                   |            | 3.86            |
| 7. 其他费用                    | 6.4.7.20   | 174,956.09      |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | -101,162,991.12 |
| 减：所得税费用                    |            | -               |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | -101,162,991.12 |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：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

本报告期：2021 年 1 月 25 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                | 本期<br>2021 年 1 月 25 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日 |                 |                  |
|-----------------------------------|-------------------------------------------------|-----------------|------------------|
|                                   | 实收基金                                            | 未分配利润           | 所有者权益合计          |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                   | 1,431,605,000.00                                | -               | 1,431,605,000.00 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）          | -                                               | -101,162,991.12 | -101,162,991.12  |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列） | -386,000,000.00                                 | 19,045,599.10   | -366,954,400.90  |
| 其中：1. 基金申购款                       | 10,000,000.00                                   | -765,707.66     | 9,234,292.34     |
| 2. 基金赎回款                          | -396,000,000.00                                 | 19,811,306.76   | -376,188,693.24  |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以   | -                                               | -               | -                |

|                 |                  |                |                |
|-----------------|------------------|----------------|----------------|
| “-”号填列)         |                  |                |                |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 1,045,605,000.00 | -82,117,392.02 | 963,487,607.98 |

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

华泰柏瑞中证沪港深互联网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[2021]39 号《关于核准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募集的批复》核准，由华泰柏瑞基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《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基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,431,605,000.00 元（含募集股票市值），业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2021)第 0097 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《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基金合同》于 2021 年 1 月 25 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,431,605,000.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 0 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，基金托管人为中信建投证券股份有限公司。

经上海证券交易所（以下简称“上交所”）自律监管决定书[2021]45 号审核同意，本基金 1,431,605,000.00 份基金份额于 2021 年 2 月 8 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《华泰柏瑞中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金以标的指数中证沪港深互联网指数成份股、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、港股通标的股票、存托凭证）、债券（包括国债、地方政府债、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）、可交换债券、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。如法律法规或监管机构以后

允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金投资标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。

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。

本基金的业绩比较基准为中证沪港深互联网指数。

本财务报表由本基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于 2021 年 8 月 28 日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定（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〈年度和中期报告〉》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华泰柏瑞沪深 300 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发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年 1 月 25 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 25 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2021 年 1 月 25 日（基金合同生效日）起至 2021 年 6 月 30 日止。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

## (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金在投资人申购、赎回过程中而待与投资人结算的可退替代款分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，在资产负债表中以交易性金融负债列示。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基

金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

本基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率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(以下简称“证金公司”)出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息确认为利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。



#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。当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，本基金的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。自基金合同生效日起不满 3 个月可不进行收益分配，基金收益分配每年至多 4 次。经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

（1）对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关

于发布《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”),按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(2) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### **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**

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期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[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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：

(1) 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。

(2) 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。

(3) 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。

(4) 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。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育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<br>2021 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 30,903,938.01          |
| 定期存款           | —                      |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | —                      |
| 存款期限 1-3 个月    | —                      |
| 存款期限 3 个月以上    | —                      |
| 其他存款           | —                      |
| 合计：            | 30,903,938.01          |

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            |       | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |                |                |
|---------------|-------|------------------------|----------------|----------------|
|               |       | 成本                     | 公允价值           | 公允价值变动         |
| 股票            |       | 1,029,142,374.14       | 936,414,869.37 | -92,727,504.77 |
| 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            |       | 1,029,142,374.14       | 936,414,869.37 | -92,727,504.77 |

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无。

### 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：无。

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

注：无。

**6.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |
|------------|------------------------|
| 应收活期存款利息   | 5,658.21               |
| 应收定期存款利息   | —                      |
| 应收其他存款利息   | —                      |
| 应收结算备付金利息  | 378.49                 |
| 应收债券利息     | —                      |
| 应收资产支持证券利息 | —                      |
| 应收买入返售证券利息 | —                      |
| 应收申购款利息    | —                      |
| 应收黄金合约拆借孳息 | —                      |
| 应收出借证券利息   | —                      |
| 其他         | 269.30                 |
| 合计         | 6,306.00               |

**6.4.7.6 其他资产**

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |
|-------|------------------------|
| 其他应收款 | —                      |
| 待摊费用  | 80,938.84              |
| 合计    | 80,938.84              |

**6.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 1,867,775.37           |
| 银行间市场应付交易费用 | —                      |
| 合计          | 1,867,775.37           |

## 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                      |
| 应付赎回费       | -                      |
| 应付证券出借违约金   | -                      |
| 预提费用        | 105,894.93             |
| 应付替代款       | 2,876,848.63           |
| 合计          | 2,982,743.56           |

## 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2021 年 1 月 25 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日 |                  |
|---------------|-------------------------------------------------|------------------|
|               | 基金份额(份)                                         | 账面金额             |
| 基金合同生效日       | 1,431,605,000.00                                | 1,431,605,000.00 |
| 本期申购          | 10,000,000.00                                   | 10,000,000.00    |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -396,000,000.00                                 | -396,000,000.00  |
| - 基金拆分/份额折算前  | -                                               | -                |
| 基金拆分/份额折算变动份额 | -                                               | -                |
| 本期申购          | -                                               | -                |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -                                               | -                |
| 本期末           | 1,045,605,000.00                                | 1,045,605,000.00 |

注：投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购赎回单位的整数倍。

## 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分         | 未实现部分          | 未分配利润合计         |
|----------------|---------------|----------------|-----------------|
| 基金合同生效日        | -             | -              | -               |
| 本期利润           | -8,435,486.35 | -92,727,504.77 | -101,162,991.12 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 1,177,146.43  | 17,868,452.67  | 19,045,599.10   |
| 其中：基金申购款       | -30,866.28    | -734,841.38    | -765,707.66     |
| 基金赎回款          | 1,208,012.71  | 18,603,294.05  | 19,811,306.76   |
| 本期已分配利润        | -             | -              | -               |
| 本期末            | -7,258,339.92 | -74,859,052.10 | -82,117,392.02  |

## 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2021 年 1 月 25 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日 |
|-----------|-------------------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 361,253.39                                      |
| 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 | 73,193.81                                       |
| 其他        | 20,439.04                                       |
| 合计        | 454,886.24                                      |

## 6.4.7.12 股票投资收益

## 6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目               | 本期<br>2021 年 1 月 25 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日 |
|------------------|-------------------------------------------------|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | -3,959,569.60                                   |
| 股票投资收益——赎回差价收入   | -2,501,568.38                                   |
| 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               | -6,461,137.98                                   |

## 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2021 年 1 月 25 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日 |
|------------|-------------------------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 457,143,658.39                                  |
| 减：卖出股票成本总额 | 461,103,227.99                                  |
| 买卖股票差价收入   | -3,959,569.60                                   |

## 6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----|----|
|----|----|

|             | 2021 年 1 月 25 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日 |
|-------------|-------------------------------------------|
| 赎回基金份额对价总额  | 376,188,693.24                            |
| 减：现金支付赎回款总额 | 338,456,612.24                            |
| 减：赎回股票成本总额  | 40,233,649.38                             |
| 赎回差价收入      | -2,501,568.38                             |

#### 6.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

注：无。

#### 6.4.7.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

### 6.4.7.13 债券投资收益

#### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                            | 本期<br>2021年1月25日(基金合同生效日)至2021年<br>6月30日 |
|-------------------------------|------------------------------------------|
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | 2,099,513.15                             |
| 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                            | 2,099,513.15                             |

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                      | 本期<br>2021年1月25日(基金合同生效日)至2021年<br>6月30日 |
|-------------------------|------------------------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额   | 7,492,209.89                             |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 5,391,600.00                             |
| 减：应收利息总额                | 1,096.74                                 |
| 买卖债券差价收入                | 2,099,513.15                             |



**6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入**

注：无。

**6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入**

注：无。

**6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益**

注：无。

**6.4.7.14 贵金属投资收益****6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

注：无。

**6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

注：无。

**6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

注：无。

**6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

注：无。

**6.4.7.15 衍生工具收益****6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：无。

**6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

注：无。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2021 年 1 月 25 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日 |
|---------------|-------------------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 2,346,615.59                                    |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | -                                               |
| 基金投资产生的股利收益   | -                                               |
| 合计            | 2,346,615.59                                    |

## 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                       | 本期<br>2021 年 1 月 25 日(基金合同生效日)至 2021<br>年 6 月 30 日 |
|----------------------------|----------------------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产                 | -92,727,504.77                                     |
| ——股票投资                     | -92,727,504.77                                     |
| ——债券投资                     | -                                                  |
| ——资产支持证券投资                 | -                                                  |
| ——贵金属投资                    | -                                                  |
| ——其他                       | -                                                  |
| 2. 衍生工具                    | -                                                  |
| ——权证投资                     | -                                                  |
| 3. 其他                      | -                                                  |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值<br>税 | -                                                  |
| 合计                         | -92,727,504.77                                     |

## 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2021 年 1 月 25 日(基金合同生效日)至 2021<br>年 6 月 30 日 |
|---------|----------------------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | -                                                  |
| 其他收入    | 322,111.13                                         |
| 替代损益    | -877,489.78                                        |
| 合计      | -555,378.65                                        |

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。

## 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2021 年 1 月 25 日(基金合同生效日)至 2021<br>年 6 月 30 日 |
|-----------|----------------------------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 3,314,968.06                                       |

|           |              |
|-----------|--------------|
| 银行间市场交易费用 | -            |
| 交易基金产生的费用 | -            |
| 其中：申购费    | -            |
| 赎回费       | -            |
| 合计        | 3,314,968.06 |

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期<br>2021年1月25日(基金合同生效日)至2021<br>年6月30日 |
|-------------|------------------------------------------|
| 审计费用        | 46,041.82                                |
| 信息披露费       | 50,645.06                                |
| 证券出借违约金     | -                                        |
| 注册登记费（中登上海） | 69,061.16                                |
| IOPV 计算发布费  | 9,208.05                                 |
| 合计          | 174,956.09                               |

#### 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

截至本财务报表批准报出日，本基金无其它需作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称                  | 与本基金的关系            |
|------------------------|--------------------|
| 华泰柏瑞基金管理有限公司           | 基金管理人              |
| 中信建投证券股份有限公司（“中信建投证券”） | 基金托管人              |
| 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 |
|--------------------|----------------|

注：关联方与基金进行的关联交易均在正常业务范围内按照一般商业条款而订立的。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

注：本报告期本基金与关联方未进行股票交易。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

注：本报告期本基金与关联方未进行权证交易。

###### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

注：本报告期本基金与关联方未进行产生佣金的交易。

##### 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<br>2021 年 1 月 25 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日 |
|-----------------|-------------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 2,410,637.58                                    |
| 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 0.50%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<br>2021 年 1 月 25 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日 |
|----------------|-------------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 482,127.54                                      |

注：支付基金托管人中国工商银行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 X 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：本基金本期未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本期未与关联方进行证券出借业务。

##### 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：本基金本期未与关联方进行证券出借业务。

#### 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

注：本报告期及上年度可比期间内，除基金管理人之外的其它关联方未投资本基金。

#### 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：本基金无由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<br>2021 年 1 月 25 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日 |        |      |      |           |            |
|-------------------------------------------------|--------|------|------|-----------|------------|
| 关联方名称                                           | 证券代码   | 证券名称 | 发行方式 | 基金在承销期内买入 |            |
|                                                 |        |      |      | 数量（单位：份）  | 总金额        |
| 华泰联合证券                                          | 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 |
| 中信建投证券                                          | 688456 | 有研粉材 | 网下申购 | 3,396     | 36,065.52  |

|            |        |      |      |        |            |
|------------|--------|------|------|--------|------------|
| 华泰联合证<br>券 | 605389 | 长龄液压 | 网下申购 | 356    | 14,026.40  |
| 中信建投证<br>券 | 300962 | 中金辐照 | 网下申购 | 5,757  | 19,573.80  |
| 中信建投证<br>券 | 688636 | 智明达  | 网下申购 | 918    | 31,671.00  |
| 中信建投证<br>券 | 300973 | 立高食品 | 网下申购 | 3,593  | 101,610.04 |
| 中信建投证<br>券 | 600906 | 财达证券 | 网下申购 | 7,597  | 28,564.72  |
| 中信建投证<br>券 | 688323 | 瑞华泰  | 网下申购 | 4,513  | 26,942.61  |
| 中信建投证<br>券 | 605305 | 中际联合 | 网下申购 | 368    | 13,961.92  |
| 中信建投证<br>券 | 603511 | 爱慕股份 | 网下申购 | 553    | 11,607.47  |
| 中信建投证<br>券 | 300987 | 川网传媒 | 网下申购 | 3,004  | 20,397.16  |
| 华泰联合证<br>券 | 688097 | 博众精工 | 网下申购 | 3,983  | 44,888.41  |
| 华泰联合证<br>券 | 688314 | 康拓医疗 | 网下申购 | 1,085  | 18,813.90  |
| 华泰联合证<br>券 | 600905 | 三峡能源 | 网上申购 | 33,000 | 87,450.00  |
| 华泰联合证<br>券 | 688613 | 奥精医疗 | 网下申购 | 2,617  | 42,997.31  |
| 中信建投证<br>券 | 601665 | 齐鲁银行 | 网下申购 | 6,731  | 36,078.16  |
| 华泰联合证<br>券 | 605499 | 东鹏饮料 | 网下申购 | 632    | 29,242.64  |
| 中信建投证<br>券 | 601528 | 瑞丰银行 | 网下申购 | 2,230  | 18,107.60  |
| 中信建投证<br>券 | 688625 | 呈和科技 | 网下申购 | 2,672  | 44,034.56  |
| 中信建投证<br>券 | 688269 | 凯立新材 | 网下申购 | 1,941  | 36,762.54  |
| 中信建投证<br>券 | 301018 | 申菱环境 | 网下申购 | 7,811  | 64,753.19  |
| 华泰联合证<br>券 | 688161 | 威高骨科 | 网下申购 | 3,069  | 111,159.18 |

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

##### 6.4.11.1

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2021 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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           | 可流通日           | 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 |
| 301018               | 申菱环境 | 2021 年 6 月 28 日 | 2021 年 7 月 7 日 | 新股未上市  | 8.29  | 8.29   | 7,811    | 64,753.19 | 64,753.19 | -  |
| 688239               | 航宇科技 | 2021 年 6 月 25 日 | 2021 年 7 月 5 日 | 新股未上市  | 11.48 | 11.48  | 4,926    | 56,550.48 | 56,550.48 | -  |
| 688087               | 英科再生 | 2021 年 6 月 30 日 | 2021 年 7 月 9 日 | 新股未上市  | 21.96 | 21.96  | 2,469    | 54,219.24 | 54,219.24 | -  |
| 301017               | 漱玉平民 | 2021 年 6 月 23 日 | 2021 年 7 月 5 日 | 新股未上市  | 8.86  | 8.86   | 5,550    | 49,173.00 | 49,173.00 | -  |
| 301020               | 密封科技 | 2021 年 6 月 28 日 | 2021 年 7 月 6 日 | 新股未上市  | 10.64 | 10.64  | 4,210    | 44,794.40 | 44,794.40 | -  |
| 301021               | 英诺激光 | 2021 年 6 月 28 日 | 2021 年 7 月 6 日 | 新股未上市  | 9.46  | 9.46   | 2,899    | 27,424.54 | 27,424.54 | -  |
| 688226               | 威腾电气 | 2021 年 6 月 28 日 | 2021 年 7 月 7 日 | 新股未上市  | 6.42  | 6.42   | 2,693    | 17,289.06 | 17,289.06 | -  |
| 605287               | 德才股份 | 2021 年 6 月 28 日 | 2021 年 7 月 6 日 | 新股未上市  | 31.56 | 31.56  | 349      | 11,014.44 | 11,014.44 | -  |
| 605162               | 新中港  | 2021 年 6 月 29 日 | 2021 年 7 月 7 日 | 新股未上市  | 6.07  | 6.07   | 1,377    | 8,358.39  | 8,358.39  | -  |

|        |      |                 |                  |        |       |        |       |            |            |   |
|--------|------|-----------------|------------------|--------|-------|--------|-------|------------|------------|---|
| 688276 | 百克生物 | 2021 年 6 月 17 日 | 2021 年 12 月 27 日 | 新股锁定期内 | 36.35 | 79.48  | 3,486 | 126,716.10 | 277,067.28 | - |
| 300957 | 贝泰妮  | 2021 年 3 月 18 日 | 2021 年 9 月 27 日  | 新股锁定期内 | 47.33 | 251.96 | 814   | 38,526.62  | 205,095.44 | - |
| 688323 | 瑞华泰  | 2021 年 4 月 21 日 | 2021 年 10 月 28 日 | 新股锁定期内 | 5.97  | 22.78  | 4,513 | 26,942.61  | 102,806.14 | - |
| 688319 | 欧林生物 | 2021 年 5 月 31 日 | 2021 年 12 月 8 日  | 新股锁定期内 | 9.88  | 27.34  | 3,412 | 33,710.56  | 93,284.08  | - |
| 300979 | 华利集团 | 2021 年 4 月 15 日 | 2021 年 10 月 26 日 | 新股锁定期内 | 33.22 | 87.50  | 925   | 30,728.50  | 80,937.50  | - |
| 688113 | 联测科技 | 2021 年 4 月 26 日 | 2021 年 11 月 8 日  | 新股锁定期内 | 19.14 | 49.29  | 1,415 | 27,083.10  | 69,745.35  | - |
| 300981 | 中红医疗 | 2021 年 4 月 19 日 | 2021 年 10 月 27 日 | 新股锁定期内 | 48.59 | 90.39  | 554   | 26,918.86  | 50,076.06  | - |
| 300973 | 立高食品 | 2021 年 4 月 8 日  | 2021 年 10 月 15 日 | 新股锁定期内 | 28.28 | 115.71 | 360   | 10,180.80  | 41,655.60  | - |
| 688067 | 爱威科技 | 2021 年 6 月 7 日  | 2021 年 12 月 16 日 | 新股锁定期内 | 14.71 | 24.83  | 1,259 | 18,519.89  | 31,260.97  | - |
| 301009 | 可靠股份 | 2021 年 6 月 8 日  | 2021 年 12 月 17 日 | 新股锁定期内 | 12.54 | 27.89  | 801   | 10,044.54  | 22,339.89  | - |
| 301015 | 百洋医药 | 2021 年 6 月 22 日 | 2021 年 12 月 30 日 | 新股锁定期内 | 7.64  | 38.83  | 462   | 3,529.68   | 17,939.46  | - |
| 300982 | 苏文电能 | 2021 年 4 月 19 日 | 2021 年 10 月 27 日 | 新股锁定期内 | 15.83 | 45.29  | 317   | 5,018.11   | 14,356.93  | - |



|        |      |                 |                  |        |       |       |       |          |           |   |
|--------|------|-----------------|------------------|--------|-------|-------|-------|----------|-----------|---|
|        |      |                 | 日                |        |       |       |       |          |           |   |
| 300968 | 格林精密 | 2021 年 4 月 6 日  | 2021 年 10 月 15 日 | 新股锁定期内 | 6.87  | 12.07 | 1,162 | 7,982.94 | 14,025.34 | - |
| 300614 | 百川畅银 | 2021 年 5 月 18 日 | 2021 年 11 月 25 日 | 新股锁定期内 | 9.19  | 40.38 | 329   | 3,023.51 | 13,285.02 | - |
| 301013 | 利和兴  | 2021 年 6 月 21 日 | 2021 年 12 月 29 日 | 新股锁定期内 | 8.72  | 27.11 | 471   | 4,107.12 | 12,768.81 | - |
| 300997 | 欢乐家  | 2021 年 5 月 26 日 | 2021 年 12 月 2 日  | 新股锁定期内 | 4.94  | 13.05 | 928   | 4,584.32 | 12,110.40 | - |
| 301002 | 崧盛股份 | 2021 年 5 月 27 日 | 2021 年 12 月 7 日  | 新股锁定期内 | 18.71 | 57.62 | 201   | 3,760.71 | 11,581.62 | - |
| 300956 | 英力股份 | 2021 年 3 月 16 日 | 2021 年 9 月 27 日  | 新股锁定期内 | 12.85 | 25.80 | 371   | 4,767.35 | 9,571.80  | - |
| 300962 | 中金辐照 | 2021 年 3 月 29 日 | 2021 年 10 月 11 日 | 新股锁定期内 | 3.40  | 16.37 | 576   | 1,958.40 | 9,429.12  | - |
| 300952 | 恒辉安防 | 2021 年 3 月 3 日  | 2021 年 9 月 13 日  | 新股锁定期内 | 11.72 | 27.08 | 340   | 3,984.80 | 9,207.20  | - |
| 300966 | 共同药业 | 2021 年 3 月 31 日 | 2021 年 10 月 11 日 | 新股锁定期内 | 8.24  | 31.54 | 286   | 2,356.64 | 9,020.44  | - |
| 300961 | 深水海纳 | 2021 年 3 月 23 日 | 2021 年 9 月 30 日  | 新股锁定期内 | 8.48  | 22.07 | 394   | 3,341.12 | 8,695.58  | - |
| 300950 | 德固特  | 2021 年 2 月 24 日 | 2021 年 9 月 3 日   | 新股锁定期内 | 8.41  | 39.13 | 219   | 1,841.79 | 8,569.47  | - |
| 300986 | 志特新材 | 2021 年 4 月 21 日 | 2021 年 11 月 1 日  | 新股锁定期内 | 14.79 | 30.57 | 264   | 3,904.56 | 8,070.48  | - |
| 300987 | 川网   | 2021 年          | 2021             | 新股锁    | 6.79  | 26.81 | 301   | 2,043.79 | 8,069.81  | - |

|        |      |            |             |        |       |       |     |          |          |   |
|--------|------|------------|-------------|--------|-------|-------|-----|----------|----------|---|
|        | 传媒   | 4月28日      | 年11月11日     | 定期内    |       |       |     |          |          |   |
| 300978 | 东箭科技 | 2021年4月15日 | 2021年10月26日 | 新股锁定期内 | 8.42  | 13.60 | 593 | 4,993.06 | 8,064.80 | - |
| 300985 | 致远新能 | 2021年4月21日 | 2021年10月29日 | 新股锁定期内 | 24.90 | 24.81 | 295 | 7,345.50 | 7,318.95 | - |
| 300991 | 创益通  | 2021年5月12日 | 2021年11月22日 | 新股锁定期内 | 13.06 | 26.51 | 254 | 3,317.24 | 6,733.54 | - |
| 300963 | 中洲特材 | 2021年3月30日 | 2021年10月11日 | 新股锁定期内 | 12.13 | 22.49 | 283 | 3,432.79 | 6,364.67 | - |
| 301011 | 华立科技 | 2021年6月9日  | 2021年12月17日 | 新股锁定期内 | 14.20 | 33.84 | 175 | 2,485.00 | 5,922.00 | - |
| 300995 | 奇德新材 | 2021年5月17日 | 2021年11月26日 | 新股锁定期内 | 14.72 | 23.32 | 191 | 2,811.52 | 4,454.12 | - |
| 301007 | 德迈仕  | 2021年6月4日  | 2021年12月16日 | 新股锁定期内 | 5.29  | 14.44 | 303 | 1,602.87 | 4,375.32 | - |
| 300998 | 宁波方正 | 2021年5月25日 | 2021年12月2日  | 新股锁定期内 | 6.02  | 21.32 | 201 | 1,210.02 | 4,285.32 | - |
| 300992 | 泰福泵业 | 2021年5月17日 | 2021年11月25日 | 新股锁定期内 | 9.36  | 20.32 | 200 | 1,872.00 | 4,064.00 | - |

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 |
|--------|------|------------|------|--------|-----------|--------|-----------|---------------|--------------|----|
| 002024 | 苏宁易购 | 2021年6月16日 | 临时停牌 | 5.59   | 2021年7月6日 | 6.15   | 1,656,469 | 11,261,499.52 | 9,259,661.71 | -  |

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券余额 0 元，无债券作为质押。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券余额 0 元，无债券作为质押。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履约责任，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信建投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，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 2021 年 6 月 30 日，本基金无债券投资。

#### **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 2021 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合

约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

#### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 1.12%。

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

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动

而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2021 年 6 月 30<br>日 | 1 个月以内        | 1-3 个月 | 3 个月-1<br>年 | 1-5 年 | 5 年以<br>上 | 不计息            | 合计             |
|---------------------------|---------------|--------|-------------|-------|-----------|----------------|----------------|
| 资产                        |               |        |             |       |           |                |                |
| 银行存款                      | 30,903,938.01 | -      | -           | -     | -         | -              | 30,903,938.01  |
| 结算备付金                     | 274,596.39    | -      | -           | -     | -         | -              | 274,596.39     |
| 存出保证金                     | 598,248.83    | -      | -           | -     | -         | -              | 598,248.83     |
| 交易性金融资产                   | -             | -      | -           | -     | -         | 936,414,869.37 | 936,414,869.37 |
| 应收证券清算款                   | -             | -      | -           | -     | -         | 530,926.52     | 530,926.52     |
| 应收利息                      | -             | -      | -           | -     | -         | 6,306.00       | 6,306.00       |
| 应收股利                      | -             | -      | -           | -     | -         | 27,130.56      | 27,130.56      |
| 其他资产                      | -             | -      | -           | -     | -         | 80,938.84      | 80,938.84      |
| 资产总计                      | 31,776,783.23 | -      | -           | -     | -         | 937,060,171.29 | 968,836,954.52 |
| 负债                        |               |        |             |       |           |                |                |
| 应付证券清算款                   | -             | -      | -           | -     | -         | 99.54          | 99.54          |
| 应付管理人报酬                   | -             | -      | -           | -     | -         | 407,171.71     | 407,171.71     |
| 应付托管费                     | -             | -      | -           | -     | -         | 81,434.36      | 81,434.36      |

|         |               |   |   |   |   |                 |                |
|---------|---------------|---|---|---|---|-----------------|----------------|
| 应付交易费用  | -             | - | - | - | - | 1,867,775.37    | 1,867,775.37   |
| 其他负债    | -             | - | - | - | - | 2,992,865.56    | 2,992,865.56   |
| 负债总计    | -             | - | - | - | - | 5,349,346.54    | 5,349,346.54   |
| 利率敏感度缺口 | 31,776,783.23 | - | - | - | - | -931,710,824.75 | 963,487,607.98 |

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2021 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 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。本基金持有不以记账本位币人民币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |                |               |                |
|---------------|------------------------|----------------|---------------|----------------|
|               | 美元<br>折合人民币            | 港币<br>折合人民币    | 其他币种<br>折合人民币 | 合计             |
| 以外币计价的资产      |                        |                |               |                |
| 交易性金融资产       | -                      | 448,783,736.66 | -             | 448,783,736.66 |
| 应收股利          |                        | 27,130.56      |               | 27,130.56      |
| 资产合计          | -                      | 448,810,867.22 | -             | 448,810,867.22 |
| 以外币计价的负债      |                        |                |               |                |
| 负债合计          | -                      | -              | -             | -              |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | -                      | 448,810,867.22 | -             | 448,810,867.22 |



#### 6.4.13.4.2 外汇风险的敏感性分析

|    |                    |                                 |
|----|--------------------|---------------------------------|
| 假设 | 除汇率以外的其他市场变量保持不变   |                                 |
| 分析 | 相关风险变量的变动          | 对资产负债表日基金资产净值的<br>影响金额（单位：人民币元） |
|    |                    | 本期末（2021年6月30日）                 |
|    | 所有外币相对人民币<br>升值 5% | 22,440,543.36                   |
|    | 所有外币相对人民币<br>贬值 5% | -22,440,543.36                  |

#### 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 |
|----|-----|
|----|-----|

|               | 2021 年 6 月 30 日 |                  |
|---------------|-----------------|------------------|
|               | 公允价值            | 占基金资产净值比例<br>(%) |
| 交易性金融资产—股票投资  | 936,414,869.37  | 97.19            |
| 交易性金融资产—基金投资  | —               | —                |
| 交易性金融资产—债券投资  | —               | —                |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | —               | —                |
| 衍生金融资产—权证投资   | —               | —                |
| 其他            | —               | —                |
| 合计            | 936,414,869.37  | 97.19            |

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除中证沪港深互联网指数以外的其他市场变量保持不变 |                                 |
|----|--------------------------|---------------------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动                | 对资产负债表日基金资产净值的<br>影响金额（单位：人民币元） |
|    |                          | 本期末（2021 年 6 月 30 日）            |
|    | 中证沪港深互联网指数上升<br>5%       | 45,027,273.65                   |
|    | 中证沪港深互联网指数下降<br>5%       | -45,027,273.65                  |

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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              | 936,414,869.37 | 96.65         |
|    | 其中：股票             | 936,414,869.37 | 96.65         |
| 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      | 31,178,534.40  | 3.22          |
| 8  | 其他各项资产            | 1,243,451.21   | 0.13          |
| 9  | 合计                | 968,836,854.98 | 100.00        |

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）        | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|----------------|---------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | —              | —             |
| B  | 采矿业              | —              | —             |
| C  | 制造业              | 30,691,191.56  | 3.19          |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 13,020.39      | 0.00          |
| E  | 建筑业              | 25,371.37      | 0.00          |
| F  | 批发和零售业           | 11,742,134.17  | 1.22          |
| 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  | 334,555,158.12 | 34.72         |
| J  | 金融业              | 81,788,435.30  | 8.49          |
| K  | 房地产业             | —              | —             |
| L  | 租赁和商务服务业         | 8,128,640.00   | 0.84          |
| M  | 科学研究和技术服务业       | —              | —             |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 21,980.60      | 0.00          |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | —              | —             |

|   |           |                |       |
|---|-----------|----------------|-------|
| P | 教育        | -              | -     |
| Q | 卫生和社会工作   | -              | -     |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 20,665,201.20  | 2.14  |
| S | 综合        | -              | -     |
|   | 合计        | 487,631,132.71 | 50.61 |

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别    | 公允价值（元）        | 占基金资产净值比例（%） |
|---------|----------------|--------------|
| 00 能源   | -              | -            |
| 01 原材料  | -              | -            |
| 02 工业   | -              | -            |
| 03 可选消费 | 117,961,976.29 | 12.24        |
| 04 主要消费 | -              | -            |
| 05 医药卫生 | 60,322,259.50  | 6.26         |
| 06 金融地产 | 5,101,503.28   | 0.53         |
| 07 信息技术 | 173,417,045.32 | 18.00        |
| 08 电信业务 | 91,980,952.27  | 9.55         |
| 09 公用事业 | -              | -            |
| 99 无    | -              | -            |
| 合计      | 448,783,736.66 | 46.58        |

注：以上分类采用中证行业分类标准。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称   | 数量（股）     | 公允价值           | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|--------|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 03690  | 美团-W   | 387,100   | 103,200,253.03 | 10.71        |
| 2  | 01810  | 小米集团-W | 4,094,200 | 91,980,952.27  | 9.55         |
| 3  | 00700  | 腾讯控股   | 188,900   | 91,793,068.61  | 9.53         |
| 4  | 300059 | 东方财富   | 2,181,980 | 71,547,124.20  | 7.43         |
| 5  | 002230 | 科大讯飞   | 469,650   | 31,738,947.00  | 3.29         |
| 6  | 688111 | 金山办公   | 76,300    | 30,123,240.00  | 3.13         |
| 7  | 600570 | 恒生电子   | 313,960   | 29,276,770.00  | 3.04         |
| 8  | 002410 | 广联达    | 396,335   | 27,030,047.00  | 2.81         |
| 9  | 00268  | 金蝶国际   | 1,185,014 | 25,981,796.93  | 2.70         |
| 10 | 600588 | 用友网络   | 693,527   | 23,066,708.02  | 2.39         |
| 11 | 300454 | 深信服    | 86,900    | 22,548,812.00  | 2.34         |
| 12 | 00241  | 阿里健康   | 1,500,000 | 21,492,626.40  | 2.23         |

|    |        |       |           |               |      |
|----|--------|-------|-----------|---------------|------|
| 13 | 300413 | 芒果超媒  | 301,242   | 20,665,201.20 | 2.14 |
| 14 | 01833  | 平安好医生 | 242,200   | 19,487,929.34 | 2.02 |
| 15 | 06618  | 京东健康  | 208,850   | 19,341,703.76 | 2.01 |
| 16 | 002236 | 大华股份  | 760,500   | 16,046,550.00 | 1.67 |
| 17 | 00909  | 明源云   | 489,000   | 15,685,498.48 | 1.63 |
| 18 | 03888  | 金山软件  | 404,000   | 15,648,262.90 | 1.62 |
| 19 | 00772  | 阅文集团  | 215,200   | 15,462,143.24 | 1.60 |
| 20 | 002555 | 三七互娱  | 563,356   | 13,531,811.12 | 1.40 |
| 21 | 000938 | 紫光股份  | 604,929   | 13,235,846.52 | 1.37 |
| 22 | 300253 | 卫宁健康  | 723,000   | 11,763,210.00 | 1.22 |
| 23 | 002624 | 完美世界  | 491,845   | 11,760,013.95 | 1.22 |
| 24 | 002405 | 四维图新  | 772,800   | 11,360,160.00 | 1.18 |
| 25 | 601360 | 三六零   | 909,327   | 11,102,882.67 | 1.15 |
| 26 | 300033 | 同花顺   | 90,500    | 10,206,590.00 | 1.06 |
| 27 | 603444 | 吉比特   | 19,201    | 10,176,530.00 | 1.06 |
| 28 | 002602 | 世纪华通  | 1,579,500 | 10,140,390.00 | 1.05 |
| 29 | 600845 | 宝信软件  | 188,160   | 9,577,344.00  | 0.99 |
| 30 | 002024 | 苏宁易购  | 1,656,469 | 9,259,661.71  | 0.96 |
| 31 | 002439 | 启明星辰  | 315,035   | 9,139,165.35  | 0.95 |
| 32 | 02013  | 微盟集团  | 621,000   | 8,846,275.16  | 0.92 |
| 33 | 603613 | 国联股份  | 86,545    | 8,651,903.65  | 0.90 |
| 34 | 00780  | 同程艺龙  | 510,000   | 8,249,573.95  | 0.86 |
| 35 | 002127 | 南极电商  | 832,000   | 8,128,640.00  | 0.84 |
| 36 | 300168 | 万达信息  | 502,300   | 7,333,580.00  | 0.76 |
| 37 | 600536 | 中国软件  | 126,800   | 7,218,724.00  | 0.75 |
| 38 | 002558 | 巨人网络  | 514,304   | 6,840,243.20  | 0.71 |
| 39 | 002373 | 千方科技  | 401,100   | 6,698,370.00  | 0.70 |
| 40 | 300383 | 光环新网  | 457,166   | 6,578,618.74  | 0.68 |
| 41 | 002065 | 东华软件  | 792,500   | 6,284,525.00  | 0.65 |
| 42 | 300418 | 昆仑万维  | 346,796   | 5,680,518.48  | 0.59 |
| 43 | 06060  | 众安在线  | 139,500   | 5,101,503.28  | 0.53 |
| 44 | 01060  | 阿里影业  | 5,670,000 | 5,095,325.09  | 0.53 |
| 45 | 300773 | 拉卡拉   | 170,146   | 4,803,221.58  | 0.50 |
| 46 | 300212 | 易华录   | 169,965   | 4,573,758.15  | 0.47 |
| 47 | 603000 | 人民网   | 235,600   | 4,049,964.00  | 0.42 |
| 48 | 688158 | 优刻得   | 88,800    | 3,485,400.00  | 0.36 |
| 49 | 300783 | 三只松鼠  | 51,000    | 2,415,360.00  | 0.25 |
| 50 | 01797  | 新东方在线 | 175,000   | 1,416,824.22  | 0.15 |
| 51 | 688276 | 百克生物  | 3,486     | 277,067.28    | 0.03 |

|    |        |      |       |            |      |
|----|--------|------|-------|------------|------|
| 52 | 300957 | 贝泰妮  | 814   | 205,095.44 | 0.02 |
| 53 | 688323 | 瑞华泰  | 4,513 | 102,806.14 | 0.01 |
| 54 | 688319 | 欧林生物 | 3,412 | 93,284.08  | 0.01 |
| 55 | 300979 | 华利集团 | 925   | 80,937.50  | 0.01 |
| 56 | 688113 | 联测科技 | 1,415 | 69,745.35  | 0.01 |
| 57 | 301018 | 申菱环境 | 7,811 | 64,753.19  | 0.01 |
| 58 | 688239 | 航宇科技 | 4,926 | 56,550.48  | 0.01 |
| 59 | 688087 | 英科再生 | 2,469 | 54,219.24  | 0.01 |
| 60 | 300981 | 中红医疗 | 554   | 50,076.06  | 0.01 |
| 61 | 301017 | 漱玉平民 | 5,550 | 49,173.00  | 0.01 |
| 62 | 301020 | 密封科技 | 4,210 | 44,794.40  | 0.00 |
| 63 | 300973 | 立高食品 | 360   | 41,655.60  | 0.00 |
| 64 | 601528 | 瑞丰银行 | 2,230 | 34,721.10  | 0.00 |
| 65 | 688067 | 爱威科技 | 1,259 | 31,260.97  | 0.00 |
| 66 | 301021 | 英诺激光 | 2,899 | 27,424.54  | 0.00 |
| 67 | 301009 | 可靠股份 | 801   | 22,339.89  | 0.00 |
| 68 | 301015 | 百洋医药 | 462   | 17,939.46  | 0.00 |
| 69 | 688226 | 威腾电气 | 2,693 | 17,289.06  | 0.00 |
| 70 | 300982 | 苏文电能 | 317   | 14,356.93  | 0.00 |
| 71 | 300968 | 格林精密 | 1,162 | 14,025.34  | 0.00 |
| 72 | 001208 | 华菱线缆 | 1,754 | 13,558.42  | 0.00 |
| 73 | 300614 | 百川畅银 | 329   | 13,285.02  | 0.00 |
| 74 | 301013 | 利和兴  | 471   | 12,768.81  | 0.00 |
| 75 | 603171 | 税友股份 | 637   | 12,230.40  | 0.00 |
| 76 | 300997 | 欢乐家  | 928   | 12,110.40  | 0.00 |
| 77 | 301002 | 崧盛股份 | 201   | 11,581.62  | 0.00 |
| 78 | 605287 | 德才股份 | 349   | 11,014.44  | 0.00 |
| 79 | 300956 | 英力股份 | 371   | 9,571.80   | 0.00 |
| 80 | 300962 | 中金辐照 | 576   | 9,429.12   | 0.00 |
| 81 | 300952 | 恒辉安防 | 340   | 9,207.20   | 0.00 |
| 82 | 300966 | 共同药业 | 286   | 9,020.44   | 0.00 |
| 83 | 300961 | 深水海纳 | 394   | 8,695.58   | 0.00 |
| 84 | 300950 | 德固特  | 219   | 8,569.47   | 0.00 |
| 85 | 605162 | 新中港  | 1,377 | 8,358.39   | 0.00 |
| 86 | 300986 | 志特新材 | 264   | 8,070.48   | 0.00 |
| 87 | 300987 | 川网传媒 | 301   | 8,069.81   | 0.00 |
| 88 | 300978 | 东箭科技 | 593   | 8,064.80   | 0.00 |
| 89 | 300985 | 致远新能 | 295   | 7,318.95   | 0.00 |
| 90 | 300991 | 创益通  | 254   | 6,733.54   | 0.00 |

|    |        |      |     |          |      |
|----|--------|------|-----|----------|------|
| 91 | 300963 | 中洲特材 | 283 | 6,364.67 | 0.00 |
| 92 | 301011 | 华立科技 | 175 | 5,922.00 | 0.00 |
| 93 | 605011 | 杭州热电 | 525 | 4,662.00 | 0.00 |
| 94 | 300995 | 奇德新材 | 191 | 4,454.12 | 0.00 |
| 95 | 301007 | 德迈仕  | 303 | 4,375.32 | 0.00 |
| 96 | 300998 | 宁波方正 | 201 | 4,285.32 | 0.00 |
| 97 | 300992 | 泰福泵业 | 200 | 4,064.00 | 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末基金资产净值 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       | 占期末基金资产净值比例（%） |
|----|--------|--------|----------------|----------------|
| 1  | H03690 | 美团－W   | 171,792,823.09 | 17.83          |
| 2  | H00700 | 腾讯控股   | 158,371,210.79 | 16.44          |
| 3  | H01810 | 小米集团－W | 158,178,295.36 | 16.42          |
| 4  | 300059 | 东方财富   | 112,823,009.87 | 11.71          |
| 5  | H00268 | 金蝶国际   | 46,691,784.90  | 4.85           |
| 6  | 002410 | 广联达    | 44,604,519.02  | 4.63           |
| 7  | 002230 | 科大讯飞   | 44,211,694.90  | 4.59           |
| 8  | 600570 | 恒生电子   | 43,614,111.79  | 4.53           |
| 9  | H00241 | 阿里健康   | 41,662,051.00  | 4.32           |
| 10 | 300454 | 深信服    | 38,394,676.00  | 3.98           |
| 11 | 600588 | 用友网络   | 37,201,715.19  | 3.86           |
| 12 | 300413 | 芒果超媒   | 36,034,156.96  | 3.74           |
| 13 | 688111 | 金山办公   | 33,053,761.49  | 3.43           |
| 14 | H03888 | 金山软件   | 31,201,762.76  | 3.24           |
| 15 | H00909 | 明源云    | 30,076,316.05  | 3.12           |
| 16 | H01833 | 平安好医生  | 29,509,396.78  | 3.06           |
| 17 | 002236 | 大华股份   | 26,482,350.97  | 2.75           |
| 18 | 002555 | 三七互娱   | 23,486,814.11  | 2.44           |
| 19 | 601360 | 三六零    | 20,747,754.96  | 2.15           |
| 20 | H00772 | 阅文集团   | 20,285,887.10  | 2.11           |
| 21 | H06618 | 京东健康   | 19,874,912.20  | 2.06           |

注：不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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      | 占期末基金资产净值比例（%） |
|----|--------|--------|---------------|----------------|
| 1  | 01810  | 小米集团—W | 52,432,166.06 | 5.44           |
| 2  | 300059 | 东方财富   | 48,112,465.26 | 4.99           |
| 3  | 03690  | 美团—W   | 47,275,620.52 | 4.91           |
| 4  | 00700  | 腾讯控股   | 44,035,964.07 | 4.57           |
| 5  | 002230 | 科大讯飞   | 26,385,704.31 | 2.74           |
| 6  | 00268  | 金蝶国际   | 12,979,827.73 | 1.35           |
| 7  | 002410 | 广联达    | 11,815,428.33 | 1.23           |
| 8  | 300454 | 深信服    | 11,520,782.97 | 1.20           |
| 9  | 01833  | 平安好医生  | 10,329,930.33 | 1.07           |
| 10 | 03888  | 金山软件   | 10,089,804.95 | 1.05           |
| 11 | 00241  | 阿里健康   | 9,342,273.64  | 0.97           |
| 12 | 300413 | 芒果超媒   | 9,165,243.04  | 0.95           |
| 13 | 00909  | 明源云    | 8,417,137.08  | 0.87           |
| 14 | 002236 | 大华股份   | 8,362,620.00  | 0.87           |
| 15 | 600637 | 东方明珠   | 8,339,444.83  | 0.87           |
| 16 | 300271 | 华宇软件   | 7,891,871.14  | 0.82           |
| 17 | 300017 | 网宿科技   | 7,504,571.00  | 0.78           |
| 18 | 600100 | 同方股份   | 7,203,047.96  | 0.75           |
| 19 | 00772  | 阅文集团   | 6,843,803.53  | 0.71           |
| 20 | 002405 | 四维图新   | 6,554,329.54  | 0.68           |

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 | 1,529,804,479.51 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 457,143,658.39   |

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 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。

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：本基金本报告期末未持有权证。

**7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明****7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

注：本基金本报告期无股指期货投资。

**7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

注：本基金本报告期无股指期货投资。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****7.11.1 本期国债期货投资政策**

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

**7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

**7.11.3 本期国债期货投资评价**

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

**7.12 投资组合报告附注****7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明**

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况，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

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

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的。

**7.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

| 序号 | 名称    | 金额         |
|----|-------|------------|
| 1  | 存出保证金 | 598,248.83 |

|   |         |              |
|---|---------|--------------|
| 2 | 应收证券清算款 | 530,826.98   |
| 3 | 应收股利    | 27,130.56    |
| 4 | 应收利息    | 6,306.00     |
| 5 | 应收申购款   | -            |
| 6 | 其他应收款   | -            |
| 7 | 待摊费用    | 80,938.84    |
| 8 | 其他      | -            |
| 9 | 合计      | 1,243,451.21 |

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

#### 8.1.1 本基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>额比例 | 持有份额           | 占总份<br>额比例 |
| 28,717       | 36,410.66     | 72,378,700.00 | 6.92%      | 973,226,300.00 | 93.08%     |

#### 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

注：无。

### 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<br>比例 |
|----|-------------------------------------|---------------|--------------|
| 1  | 中融国际信托有限公司—中融—日进斗金 14 号证券投资集合资金信托计划 | 26,315,200.00 | 2.52%        |
| 2  | BARCLAYS BANK PLC                   | 21,889,400.00 | 2.09%        |
| 3  | 郑伟康                                 | 10,000,000.00 | 0.96%        |
| 4  | 招商证券股份有限公司                          | 6,408,200.00  | 0.61%        |
| 5  | 黄建华                                 | 5,000,000.00  | 0.48%        |
| 6  | 西安惠大实业有限公司                          | 4,000,000.00  | 0.38%        |
| 7  | 中信证券股份有限公司                          | 3,939,600.00  | 0.38%        |
| 8  | 曲刚                                  | 3,000,000.00  | 0.29%        |
| 9  | 叶子瑜                                 | 3,000,000.00  | 0.29%        |
| 10 | 高玫                                  | 3,000,000.00  | 0.29%        |

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

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

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                                    |                      |
|------------------------------------|----------------------|
| 基金合同生效日（2021 年 1 月 25 日）基金份额总额     | 1, 431, 605, 000. 00 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额              | 10, 000, 000. 00     |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额            | 396, 000, 000. 00    |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -                    |
| 本报告期期末基金份额总额                       | 1, 045, 605, 000. 00 |

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

上述人事变动已按相关规定备案、公告。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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 | 5      | 1,979,785,329.25 | 100.00%      | 1,867,775.37 | 100.00%    | -  |

注：1、选择代理证券买卖的证券经营机构的标准

公司应选择财务状况良好，经营行为规范，具备研究实力的证券公司及专业研究机构，向其或其合作券商租用基金专用交易席位。公司选择的提供交易单元的券商应当满足下列基本条件：

1. 具有相应的业务经营资格；
  2. 诚信记录良好，最近两年无重大违法违规行，未受监管机构重大处罚；
  3. 资金雄厚，信誉良好。内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求。
  4. 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息。
  5. 具备研究实力，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、股票分析的研究报告及周到的信息服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告。
- 2、选择代理证券买卖的证券经营机构的程序 基金管理人根据以上标准进行考察后确定证券经营机构的选择。基金管理人与被选择的证券经营机构签订交易单元租用协议和证券研究服务协议。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易         |              | 债券回购交易         |                | 权证交易 |              |
|------|--------------|--------------|----------------|----------------|------|--------------|
|      | 成交金额         | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额           | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 中信建投 | 7,492,209.89 | 100.00%      | 100,000,000.00 | 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 | 2021年6月29日 |
| 2  | 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暂停申购赎回的公告 | 证监会规定报刊和网站 | 2021年6月28日 |
| 3  | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于                      | 证监会规定报刊和   | 2021年6月25日 |

|    |                                                 |            |                 |
|----|-------------------------------------------------|------------|-----------------|
|    | 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因处于非港股通交易日暂停申购、赎回的公告  | 网站         |                 |
| 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 | 2021 年 6 月 24 日 |
| 5  | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于提醒客户及时更新身份证件及非自然人客户及时登记受益所有人信息的公告 | 证监会规定报刊和网站 | 2021 年 6 月 22 日 |
| 6  | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告              | 证监会规定报刊和网站 | 2021 年 6 月 16 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 | 2021 年 6 月 10 日 |
| 8  | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告              | 证监会规定报刊和网站 | 2021 年 6 月 3 日  |
| 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 | 2021 年 6 月 2 日  |
| 10 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参与珠海盈米基金销售有限公司费率优惠活动的公告     | 证监会规定报刊和网站 | 2021 年 6 月 2 日  |
| 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 | 2021 年 6 月 1 日  |
| 12 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告                       | 证监会规定报刊和网站 | 2021 年 5 月 21 日 |
| 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 | 2021 年 5 月 20 日 |
| 14 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告              | 证监会规定报刊和网站 | 2021 年 5 月 19 日 |
| 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 | 2021 年 5 月 14 日 |
| 16 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于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因处      | 证监会规定报刊和网站 | 2021 年 5 月 13 日 |



|    |                                                              |            |                 |
|----|--------------------------------------------------------------|------------|-----------------|
|    | 于非港股通交易日暂停申购、赎回的公告                                           |            |                 |
| 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 | 2021 年 5 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 | 2021 年 4 月 30 日 |
| 19 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参加浙商银行股份有限公司费率优惠活动的公告                    | 证监会规定报刊和网站 | 2021 年 4 月 30 日 |
| 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 | 2021 年 4 月 29 日 |
| 21 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止上海尚善基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告                     | 证监会规定报刊和网站 | 2021 年 4 月 27 日 |
| 22 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告                           | 证监会规定报刊和网站 | 2021 年 4 月 27 日 |
| 23 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于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因处于非港股通交易日暂停申购、赎回的公告 | 证监会规定报刊和网站 | 2021 年 4 月 23 日 |
| 24 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告                           | 证监会规定报刊和网站 | 2021 年 4 月 22 日 |
| 25 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参与蚂蚁（杭州）基金销售有限公司费率优惠活动的公告                | 证监会规定报刊和网站 | 2021 年 4 月 20 日 |
| 26 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告                           | 证监会规定报刊和网站 | 2021 年 4 月 9 日  |
| 27 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告                           | 证监会规定报刊和网站 | 2021 年 3 月 31 日 |
| 28 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告                           | 证监会规定报刊和网站 | 2021 年 3 月 31 日 |
| 29 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于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因处                   | 证监会规定报刊和网站 | 2021 年 3 月 29 日 |

|    |                                                               |            |            |
|----|---------------------------------------------------------------|------------|------------|
|    | 于非港股通交易日暂停申购、赎回的公告                                            |            |            |
| 30 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第3号指数基金指引》修改基金合同和托管协议的公告 | 证监会规定报刊和网站 | 2021年3月27日 |
| 31 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告                            | 证监会规定报刊和网站 | 2021年3月11日 |
| 32 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于聘任华泰柏瑞中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金基金经理的公告             | 证监会规定报刊和网站 | 2021年3月11日 |
| 33 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告                            | 证监会规定报刊和网站 | 2021年3月5日  |
| 34 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告                            | 证监会规定报刊和网站 | 2021年3月4日  |
| 35 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告                            | 证监会规定报刊和网站 | 2021年2月27日 |
| 36 | 关于终止包商银行股份有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告                                | 证监会规定报刊和网站 | 2021年2月9日  |
| 37 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于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因处于非港股通交易日暂停申购、赎回的公告  | 证监会规定报刊和网站 | 2021年2月5日  |
| 38 | 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上市交易公告书                             | 证监会规定报刊和网站 | 2021年2月3日  |
| 39 | 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上市交易公告书提示性公告                        | 证监会规定报刊和网站 | 2021年2月3日  |
| 40 | 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开放日常申购、赎回业务的公告                      | 证监会规定报刊和网站 | 2021年2月3日  |
| 41 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于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 2021 年非港股通交易日暂停申购赎回  | 证监会规定报刊和网站 | 2021年2月3日  |

|    |                                            |                |                 |
|----|--------------------------------------------|----------------|-----------------|
|    | 等业务安排的公告                                   |                |                 |
| 42 | 华泰柏瑞中证沪港深互联网交易<br>型开放式指数证券投资基金基金<br>合同生效公告 | 证监会规定报刊和<br>网站 | 2021 年 1 月 26 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

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

### 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](http://www.huatai-pb.com)

华泰柏瑞基金管理有限公司

2021 年 8 月 28 日