

华泰柏瑞中证动漫游戏交易型开放式指数  
证券投资基金  
2021 年第 3 季度报告

2021 年 9 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：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 10 月 27 日

## § 1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 10 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 7 月 1 日起至 2021 年 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	游戏动漫
场内简称	游戏动漫
扩位证券简称	游戏动漫 ETF
基金主代码	516770
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 2 月 25 日
报告期末基金份额总额	244,648,000.00 份
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	中证动漫游戏指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期风险与收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金；本基金为指数型基金，主要采用完全复制策略，跟踪中证动漫游戏指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。 本基金法律文件中涉及的有关风险收益特征的表述是基于投资范围、投资比例、证券市场普遍规律等做出的概述性描述，代表了一般市场

	情况下本基金的长期风险收益特征。销售机构(包括基金管理人直销机构和其他销售机构)根据相关法律法规对本基金进行风险评价,不同的销售机构采用的评价方法也不同,因此销售机构的风险等级评价与基金法律文件中风险收益特征的表述可能存在不同。敬请投资者知悉,产品风险等级评估的结果仅供投资者参考,不表明对产品风险收益做出实质性判断或保证,不能取代您自身的投资判断。投资者在购买本基金时需按照销售机构的要求完成风险承受能力与产品风险之间的适当性匹配检验并及时关注销售机构对于本基金风险评级的调整情况,谨慎作出投资决策。
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2021年7月1日-2021年9月30日)
1. 本期已实现收益	-5,383,472.70
2. 本期利润	-22,777,823.91
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0819
4. 期末基金资产净值	215,771,637.90
5. 期末基金份额净值	0.8820

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

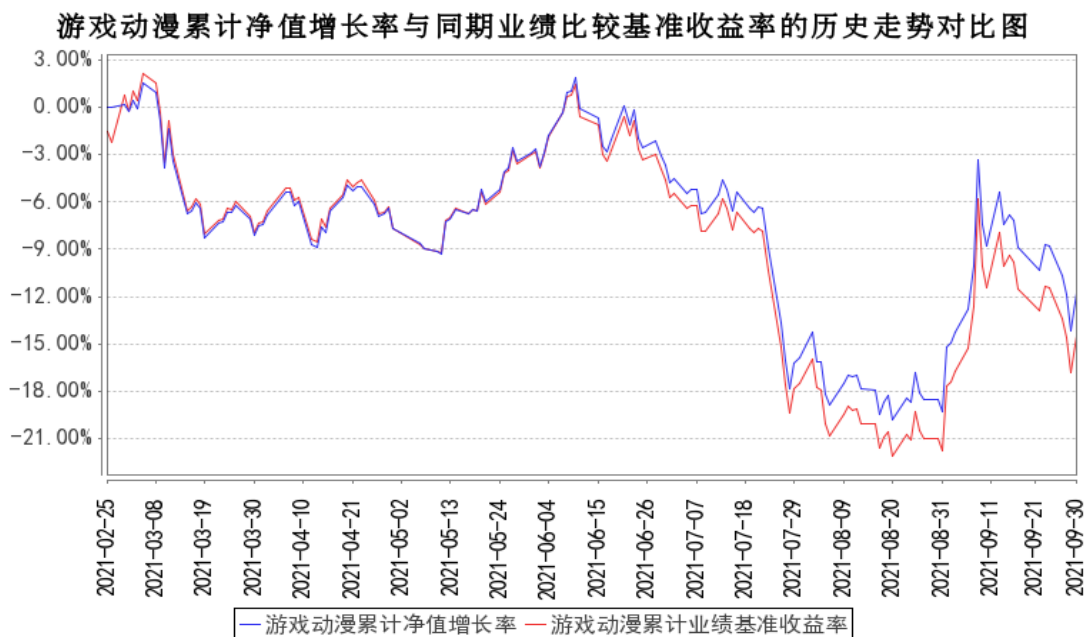
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

#### 3.2 基金净值表现

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

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	-8.45%	2.06%	-10.41%	2.12%	1.96%	-0.06%
过去六个月	-4.62%	1.65%	-7.78%	1.69%	3.16%	-0.04%
自基金合同 生效起至今	-11.80%	1.61%	-14.52%	1.68%	2.72%	-0.07%

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



注：1、图示日期为 2021 年 2 月 25 日至 2021 年 9 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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李茜	本基金的基金经理	2021 年 2 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。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。2021 年 9 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发起式联接基金的基金经理。
李沐阳	本基金的基金经理	2021 年 3 月 10 日	-	3 年	美国哥伦比亚大学应用统计学硕士。2017 年 8 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、基金经理助理。2021 年 1 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的基金经理。2021 年 3 月起任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 8 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联接基金的基金经理。

#### 4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求，通过科学完善的制度及流程，从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能的利益输送。首先投资部和研究部通过规范的决策流程来确保公平对待不同投资组合。其次交易部对投资指令的合规性、有效性及合理性进行独立审核，在交易过程中启用投资交易系统内的公平交易模块，确保公平交易的实施。同时，风险管理部对报告期内的交易进行日常监控和分析评估。本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2021 年三季度市场以结构性机会为主。其中采掘、公共事业、有色金属、钢铁等行业录得正收益,期间采掘行业指数上涨达 36.60%,公用事业行业指数上涨达 25.20%。整体来看,沪深 300、中证 500、中证 1000 和创业板涨跌幅分别为-6.85%、4.34%、4.54%、和-6.69%。从市场风格来看,价值风格表现相对强势,优于成长风格,期间沪深 300 价值指数和沪深 300 成长指数分别涨跌幅为-4.58%和-11.13%,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 0.059%,期间日跟踪误差为 0.074%,较好地实现了本基金的投资目标。

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

2021 年三季度,全球经济已经出现了较明显的从复苏走向“类滞胀”的格局。全球增长动能边际弱化,通胀水平继续飙升,多地物价创出阶段性新高。国内,在双控政策的推进下,短期价格高位的情况或难有明显改观。新旧动能转换阶段,高能耗行业的供给制约或将在较长时间内持续。上半年 A 股表现估值分化加剧,成交量持续维持在高位,风格切换频繁,指数上涨动能不足。

展望 2021 年四季度,全球经济复苏的态势将延续。其中,美国继续保持较强的增长,经济修复的重心从商品消费转向服务消费,就业市场也将有显著改善。中国则将率先重归疫情前的增长轨道,经济的主要动能由外需切换为内需,经济下行压力则可能进一步增大。流动性方面,通胀与货币政策取向仍然是影响下半年宏观流动性的最主要因素。这样的背景下,四季度内外货币政策方向将有所错位。美联储 Taper 落地开启货币政策正常化的进程,市场对此已有充分预期,需关注通胀超预期上行带来收紧力度加大,节奏加快的风险。国内货币政策则将在四季度侧重稳增长,开启“跨周期”中的“逆周期”调节,将在大力实施结构性支持政策的同时,维持宏观流动性的总体充裕,这使得国内资本市场面临相对友好的资金面环境。但在全球“滞胀”格局蔓延发展的背景下,无风险利率将有所上行,将造成全球金融市场的估值承压。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。

### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末的基金份额净值为 0.8820 元，本报告期基金份额净值增长率为-8.45%，同期业绩比较基准收益率为-10.41%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

## § 5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	211,989,639.43	97.74
	其中：股票	211,989,639.43	97.74
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	3,718,448.83	1.71
8	其他资产	1,192,642.87	0.55
9	合计	216,900,731.13	100.00

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.1 报告期末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	7,929,456.00	3.67
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	200,679,998.90	93.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-

L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	2,600,755.71	1.21
S	综合	-	-
	合计	211,210,210.61	97.89

### 5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	627,111.81	0.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	20,183.39	0.01
F	批发和零售业	69,946.39	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	3,345.12	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,864.45	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	16,492.08	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	33,485.58	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	779,428.82	0.36

### 5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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



序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601360	三六零	2,009,000	23,866,920.00	11.06
2	002555	三七互娱	1,125,725	23,628,967.75	10.95
3	002602	世纪华通	3,155,619	23,351,580.60	10.82
4	603444	吉比特	40,994	16,040,132.32	7.43
5	002624	完美世界	986,772	14,880,521.76	6.90
6	300418	昆仑万维	693,481	11,754,502.95	5.45
7	002558	巨人网络	996,700	10,365,680.00	4.80
8	300002	神州泰岳	1,660,431	9,597,291.18	4.45
9	300315	掌趣科技	2,335,400	8,804,458.00	4.08
10	002174	游族网络	619,663	7,262,450.36	3.37

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688800	瑞可达	1,967	94,258.64	0.04
2	688121	卓然股份	2,871	78,808.95	0.04
3	300973	立高食品	309	44,749.38	0.02
4	301078	C 孩子王	7,551	43,569.27	0.02
5	300979	华利集团	398	34,164.32	0.02

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

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

注：本基金本报告期末未持有权证。

### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

## 5.11 投资组合报告附注

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

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。

### 5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情形。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	295,110.55
2	应收证券清算款	856,141.91
3	应收股利	-
4	应收利息	584.31
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	40,806.10
8	其他	0.00
9	合计	1,192,642.87

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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

注：截至本报告期末，指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688800	瑞可达	94,258.64	0.04	新股锁定期内
2	688121	卓然股份	78,808.95	0.04	新股锁定期内
3	300973	立高食品	44,749.38	0.02	新股锁定期内
4	301078	孩子王	43,569.27	0.02	新股未上市
5	300979	华利集团	34,164.32	0.02	新股锁定期内

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	285,448,000.00
报告期期间基金总申购份额	37,200,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	78,000,000.00
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	244,648,000.00

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：无。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：无。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

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

### 9.2 存放地点

上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

### 9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。投资者对本报告如有疑问，可咨询基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司。客户服务热线：400-888-0001（免长途费） 021-3878 4638 公司网址：[www.huatai-pb.com](http://www.huatai-pb.com)

华泰柏瑞基金管理有限公司

2021 年 10 月 27 日