

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 4 季度报告

2021 年 12 月 31 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：2022 年 1 月 24 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 2022 年 1 月 21 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 10 月 1 日起至 2021 年 12 月 31 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	115,048,000.00 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10月1日-2021年12月31日)
1. 本期已实现收益	4,899,674.39
2. 本期利润	42,971,398.25
3. 加权平均基金份额本期利润	0.2435
4. 期末基金资产净值	126,280,467.15
5. 期末基金份额净值	1.0976

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。

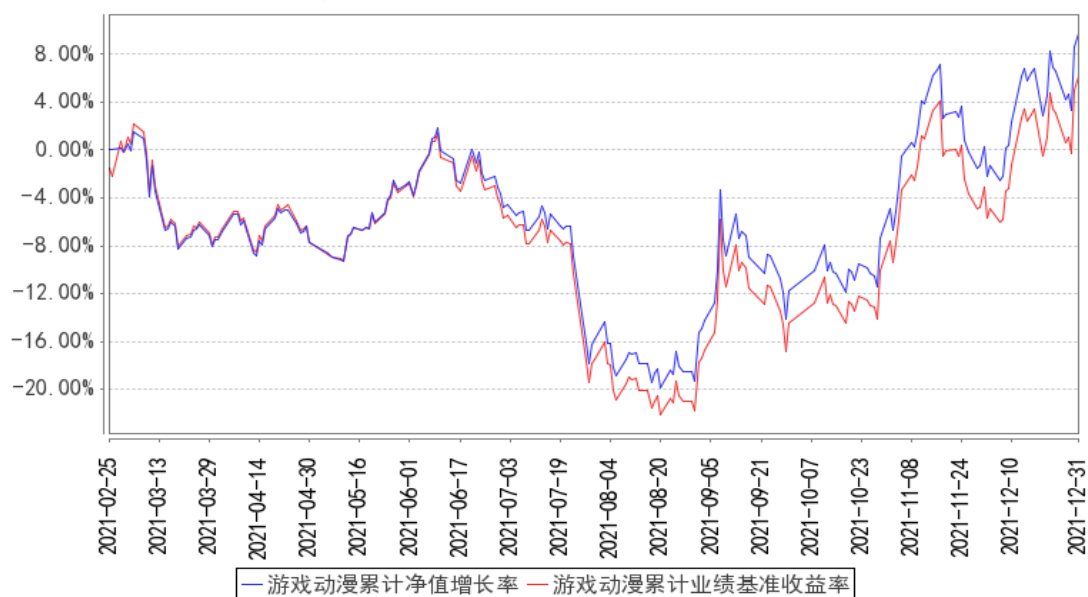
#### 3.2 基金净值表现

##### 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	24.44%	1.88%	24.14%	1.94%	0.30%	-0.06%
过去六个月	13.93%	1.98%	11.23%	2.04%	2.70%	-0.06%
自基金合同 生效起至今	9.76%	1.70%	6.12%	1.77%	3.64%	-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

游戏动漫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 2 月 25 日至 2021 年 12 月 31 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。2021 年 11 月起任华泰柏瑞上证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。
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

本期产品所跟踪的动漫游戏指数涨跌幅为 24.14%，本产品涨跌幅为 24.44%。尽管 2021 年三季度国家新闻出版署再次暂停游戏版号的发放，但是四季度“元宇宙”概念的横空出世，这让游戏动漫 ETF 在四季度中获得了亮眼的业绩表现。其实元宇宙共带来了两波资本市场热潮，第一波是 8 月底，市场炒作 NFT 主题并以中小公司上涨为主；10 月底开始的第二波启动以“Facebook”改名为起点，如微软、英伟达等公司纷纷进军元宇宙，而游戏和社交是产业界公认的元宇宙入口，A 股传媒公司就在第二次热潮中纷纷“元”化。报告期中，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。报告期内，本基金累计跟踪偏离为 0.30%，日均绝对跟踪偏离度为 0.059%，期间日跟踪误差为 0.079%，较好地实现了本基金的投资目标。

展望 2022 年，尽管市场对于元宇宙仍有较大争议，但在海外巨头纷纷加码、虚拟人业务推广持续带来事件催化，整个传媒板块的关注度和景气度仍在持续走高。此外，游戏板块调整时间也已足够深度，部分龙头企业 2022 年估值在 20 倍以内。一季度作为传统游戏行业旺季，春节假期有望推动游戏行业收入增长。此外，监管政策落地和元宇宙概念持续发酵或将继续推动行业估值回归。其一，版号暂停已经过去接近半年时间，随着游戏内容整改逐步进行，版号有望发放，新游戏将显著提升游戏行业增速，并且将带来行业估值回归。其二，元宇宙作为海外和国内的互联网发展大趋势，VR 硬件出货量和新品上线超预期，都将有助于推动内容产业的发展，为游戏行业带来崭新市场空间。综合来看，短期游戏行业有望实现业绩和估值双向提升。

## 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0976 元；本报告期基金份额净值增长率为 24.44%，业绩比较基准收益率为 24.14%。

## 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	122,115,473.19	93.03
	其中：股票	122,115,473.19	93.03
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	5,636,125.24	4.29
8	其他资产	3,506,181.78	2.67
9	合计	131,257,780.21	100.00

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

### 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	4,896,346.00	3.88
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	113,448,485.41	89.84
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	2,627,973.00	2.08
S	综合	-	-
	合计	120,972,804.41	95.80

### 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	840,777.17	0.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	11,519.99	0.01
F	批发和零售业	68,070.15	0.05
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	4,608.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,264.68	0.00
J	金融业	69,749.68	0.06
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	81,221.47	0.06
N	水利、环境和公共设施管理业	11,992.19	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	18,161.78	0.01
R	文化、体育和娱乐业	29,517.67	0.02
S	综合	-	-
	合计	1,139,882.78	0.90

### 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	002602	世纪华通	1,910,819	16,031,771.41	12.70
2	002555	三七互娱	581,825	15,720,911.50	12.45
3	002624	完美世界	509,172	10,341,283.32	8.19
4	300418	昆仑万维	408,481	9,456,335.15	7.49
5	603444	吉比特	18,794	7,928,248.90	6.28



6	002558	巨人网络	606,500	7,259,805.00	5.75
7	300315	掌趣科技	1,207,800	5,869,908.00	4.65
8	300002	神州泰岳	859,131	5,438,299.23	4.31
9	002174	游族网络	320,263	4,880,808.12	3.87
10	002517	恺英网络	658,500	3,832,470.00	3.03

### 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	262,653.51	0.21
2	688121	卓然股份	2,871	104,561.82	0.08
3	600927	永安期货	1,859	69,749.68	0.06
4	301136	招标股份	4,529	47,645.08	0.04
5	603230	内蒙新华	1,141	29,517.67	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	82,528.75
2	应收证券清算款	700,689.99
3	应收股利	-
4	应收利息	892.69
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	2,722,070.35
9	合计	3,506,181.78

### 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：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

**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	262,653.51	0.21	新股锁定
2	688121	卓然股份	104,561.82	0.08	新股锁定
3	301136	招标股份	47,645.08	0.04	新股锁定

**5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

**§6 开放式基金份额变动**

单位：份

报告期期初基金份额总额	244,648,000.00
报告期期间基金总申购份额	30,000,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	159,600,000.00
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	115,048,000.00

**§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

2022 年 1 月 24 日