

上证红利交易型开放式指数证券投资基金 2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 2022 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

| | |
|---|-----------|
| § 1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示 | 2 |
| 1.2 目录 | 3 |
| § 2 基金简介 | 5 |
| 2.1 基金基本情况 | 5 |
| 2.2 基金产品说明 | 5 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人 | 5 |
| 2.4 信息披露方式 | 6 |
| 2.5 其他相关资料 | 6 |
| § 3 主要财务指标和基金净值表现 | 6 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 | 6 |
| 3.2 基金净值表现 | 6 |
| § 4 管理人报告 | 7 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 7 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 | 12 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 12 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 | 13 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 | 13 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 14 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 14 |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 | 14 |
| § 5 托管人报告 | 14 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 | 14 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 14 |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 | 14 |
| § 6 半年度财务会计报告（未经审计） | 15 |
| 6.1 资产负债表 | 15 |
| 6.2 利润表 | 16 |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表 | 17 |
| 6.4 报表附注 | 21 |
| § 7 投资组合报告 | 42 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 42 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 43 |
| 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 | 44 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 46 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 47 |
| 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 | 48 |

| | |
|---|-----------|
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 | 48 |
| 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 | 48 |
| 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 | 48 |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策 | 48 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 48 |
| 7.12 投资组合报告附注 | 48 |
| § 8 基金份额持有人信息 | 49 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 49 |
| 8.2 期末上市基金前十名持有人 | 49 |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 50 |
| 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 | 50 |
| § 9 开放式基金份额变动 | 50 |
| § 10 重大事件揭示 | 51 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 | 51 |
| 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 | 51 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 51 |
| 10.4 基金投资策略的改变 | 51 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 51 |
| 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 | 51 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 51 |
| 10.8 其他重大事件 | 52 |
| § 11 影响投资者决策的其他重要信息 | 53 |
| 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 | 53 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 | 53 |
| § 12 备查文件目录 | 53 |
| 12.1 备查文件目录 | 53 |
| 12.2 存放地点 | 53 |
| 12.3 查阅方式 | 53 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|--------------|-----------------------|
| 基金名称 | 上证红利交易型开放式指数证券投资基金 |
| 基金简称 | 华泰柏瑞上证红利 ETF |
| 场内简称 | 红利 ETF（扩位证券简称：红利 ETF） |
| 基金主代码 | 510880 |
| 基金运作方式 | 交易型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2006 年 11 月 17 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 |
| 报告期末基金份额总额 | 6,024,175,703.00 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 | 2007 年 1 月 18 日 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。 |
| 投资策略 | 本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。 |
| 业绩比较基准 | 上证红利指数 |
| 风险收益特征 | 本基金属股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，采用完全复制策略，跟踪上证红利指数，是股票基金中风险较低、收益中等的产品。 |

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 | 招商银行股份有限公司 |
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 刘万方 |
| | 联系电话 | 021-38601777 |
| | 电子邮箱 | cs4008880001@huatai-pb.com |
| 客户服务电话 | 400-888-0001 | 95555 |
| 传真 | 021-38601799 | 0755-83195201 |
| 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 | 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 |
| 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 | 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 |
| 邮政编码 | 200135 | 518040 |
| 法定代表人 | 贾波 | 缪建民 |

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|----------------|------------------|
| 注册登记机构 | 中国证券登记结算有限责任公司 | 北京市西城区太平桥大街 17 号 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2022 年 1 月 1 日-2022 年 6 月 30 日) |
|---------------|-------------------------------------|
| 本期已实现收益 | 842,062,423.64 |
| 本期利润 | 1,323,431,698.44 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.2092 |
| 本期加权平均净值利润率 | 7.23% |
| 本期基金份额净值增长率 | 6.16% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2022 年 6 月 30 日) |
| 期末可供分配利润 | 8,676,162,566.68 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 1.4402 |
| 期末基金资产净值 | 17,869,459,857.54 |
| 期末基金份额净值 | 2.9663 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2022 年 6 月 30 日) |
| 基金份额累计净值增长率 | 192.82% |

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

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

3、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

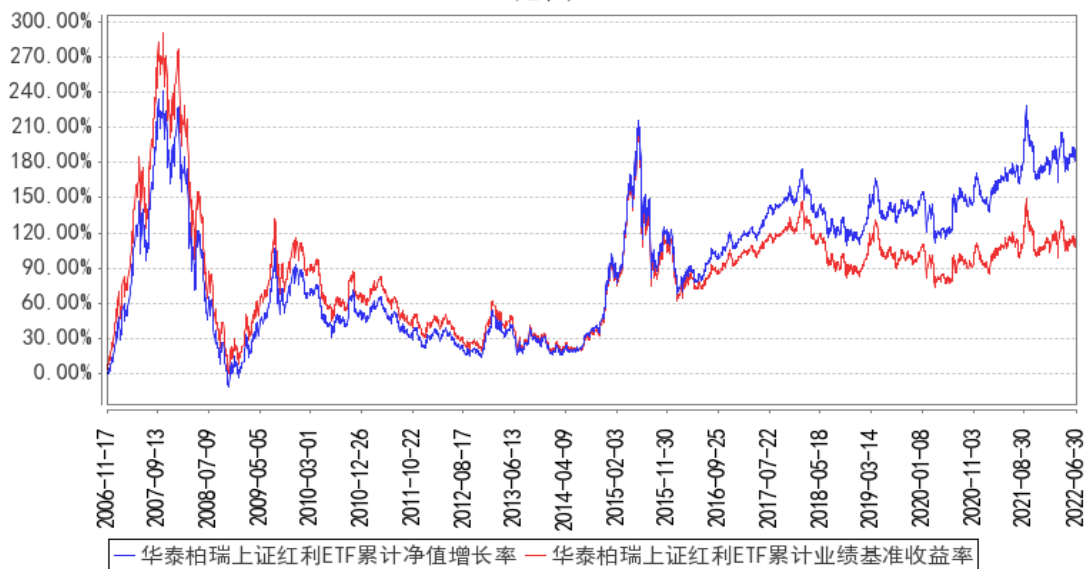
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|----|----------|-------------|------------|---------------|-----|-----|
|----|----------|-------------|------------|---------------|-----|-----|

| | | | | | | |
|------------|---------|-------|---------|-------|--------|--------|
| 过去一个月 | 2.46% | 0.94% | 1.27% | 0.95% | 1.19% | -0.01% |
| 过去三个月 | -1.71% | 1.37% | -4.13% | 1.40% | 2.42% | -0.03% |
| 过去六个月 | 6.16% | 1.40% | 3.09% | 1.44% | 3.07% | -0.04% |
| 过去一年 | 7.02% | 1.33% | 0.16% | 1.36% | 6.86% | -0.03% |
| 过去三年 | 21.51% | 1.16% | 5.54% | 1.19% | 15.97% | -0.03% |
| 自基金合同生效起至今 | 192.82% | 1.71% | 115.72% | 1.73% | 77.10% | -0.02% |

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

华泰柏瑞上证红利ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：图示日期为2006年11月17日至2022年6月30日。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司。华泰柏瑞基金管理有限公司是经中国证监会批

准，于 2004 年 11 月 18 日成立的合资基金管理公司，注册资本为 2 亿元人民币。目前的股东构成为华泰证券股份有限公司、柏瑞投资有限责任公司（原 AIGGIC）和苏州新区高新技术产业股份有限公司，出资比例分别为 49%、49%和 2%。目前公司旗下管理华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金、华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金、上证红利交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金、华泰柏瑞货币市场证券投资基金、华泰柏瑞行业领先混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化先行混合型证券投资基金、华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金、上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金、华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金、华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金、华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金、华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金、华泰柏瑞交易型货币市场基金、华泰柏瑞激励动力灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化对冲稳健收益定期开放混合型发起式证券投资基金、华泰柏瑞天添宝货币市场基金、华泰柏瑞多策略灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞新经济沪港深灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞享利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化创优灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞生物医药灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞富利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞港股通量化灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞战略新兴产业混合型证券投资基金、华泰柏瑞新金融地产灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数基金、华泰柏瑞医疗健康混合型证券投资基金、华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通指数基金联接基金、华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞量化明选混合型证券投资基金、华泰柏瑞基本面智选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞锦泰一年定期开放债券型证券投资基金、华泰柏瑞中证科技 100 交易型开

放式指数证券投资基金、华泰柏瑞益通三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、华泰柏瑞研究精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞景气回报一年持有期混合型证券投资基金、华泰柏瑞锦兴 39 个月定期开放债券型证券投资基金、华泰柏瑞锦瑞债券型证券投资基金、华泰柏瑞益商一年定期开放债券型发起式证券投资基金、华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞质量成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞行业精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞瑞鸿利中短债债券型证券投资基金、华泰柏瑞景气优选混合型证券投资基金、华泰柏瑞品质优选混合型证券投资基金、华泰柏瑞景利混合型证券投资基金、华泰柏瑞优势领航混合型证券投资基金、华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞锦乾债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化创盈混合型证券投资基金、华泰柏瑞成长智选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞量化创享混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞质量领先混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证稀土产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞品质成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞质量精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证物联网主题交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞港股通时代机遇混合型证券投资基金、华泰柏瑞南方东英恒生科技指数交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞行业严选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证企业核心竞争力 50 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证沪港深创新药产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞远见智选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金、华泰柏瑞景气成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞创业板科技交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、华泰柏瑞锦元债券型证券投资基金、华泰柏瑞上证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞中证沪港深品牌消费 50 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证稀土产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、华泰柏瑞景气汇选三年持有期混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞聚优智选一年持有期混合型证券投资基金、华泰柏瑞匠心汇选混合型证券投资基金、华泰柏瑞鸿益 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通

高股息投资交易型开放式指数证券投资基金（QDII）、华泰柏瑞恒悦混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证全指电力公用事业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 指数增强型证券投资基金、华泰柏瑞鸿裕 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金、华泰柏瑞恒泽混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、华泰柏瑞匠心臻选混合型证券投资基金。截至 2022 年 6 月 30 日，公司基金管理规模为 2750.48 亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理（助理）期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|----|----------|-----------------|------|--------|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 李茜 | 本基金的基金经理 | 2019 年 11 月 5 日 | - | 7 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。2022 年 1 月起任华泰柏瑞中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 4 月起任华泰柏瑞中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。 |
| 柳军 | 指数投资部总监、 | 2009 年 6 月 4 日 | - | 21 年 | 21 年证券（基金）从业经历，复旦大学财务管理硕士，2000-2001 年任上海汽车集 |

| | | | | |
|----------------------|--|--|--|--|
| <p>本基金的 基金经理</p> | | | | <p>团财务有限公司财务，2001-2004 年任华安基金管理有限公司高级基金核算员，2004 年 7 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任基金事务部总监、上证红利 ETF 基金经理助理。2009 年 6 月起任上证红利交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2010 年 10 月起担任指数投资部副总监。2011 年 1 月至 2020 年 2 月任华泰柏瑞上证中小盘 ETF 基金、华泰柏瑞上证中小盘 ETF 联接基金基金经理。2012 年 5 月起任华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2015 年 2 月起任指数投资部总监。2015 年 5 月起任华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2018 年 3 月至 2018 年 11 月任华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 3 月至 2018 年 10 月任华泰柏瑞泰利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 4 月起任华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2018 年 10 月起任华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2018 年 12 月起任华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 7 月起任华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019 年 9 月至 2021 年 4 月任华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2020 年 2 月至 2021 年 4 月任华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2020 年 9 月起任华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月起任华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2021 年 5 月起任华泰柏瑞南方东英恒生科技指数交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2021 年 7 月起任华泰柏瑞中证沪港</p> |
|----------------------|--|--|--|--|

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|---|
| | | | | | 深创新药产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 8 月起任华泰柏瑞中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 12 月起任华泰柏瑞中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。 |
|--|--|--|--|--|---|

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。任职日期指基金管理公司作出决定之日。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及其他相关法律、法规的规定以及本基金的《基金合同》的约定，在严格控制风险的基础上，忠实履行基金管理职责，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金投资管理符合有关法律、法规的规定及基金合同的约定，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司将投资管理职能和交易执行职能完全隔离，实行集中交易制度，由交易部为公募基金、专户理财和海外投资等业务统一交易服务，为公平交易的实施提供了较好的保障。

目前公司公募基金经理有兼任私募资产管理计划投资经理的情况，兼任业务遵照相关法律法规要求进行，同时遵守公司公平交易制度。公司机构设置合理，公平交易的相关管理制度健全，投资决策流程完善，各项制度执行情况良好。交易价差分析表明公司旗下各基金均得到了公平对待，不存在非公平交易和利益输送的行为。经过对不同基金之间交易相同证券时的同向交易价差进行分析发现，报告期内基金之间的买卖交易价差总体上处于正常的合理水平。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金管理人根据《异常交易监控与管理办法》对投资交易过程中可能发生的异常交易行为进行监督和管理。投资部负责对异常交易行为进行事前识别和检查，交易部负责对异常交易行为的事中监督和控制，风险管理部及异常交易评估小组负责异常交易行为的事后审查和评估。本报告期内，该制度执行情况良好，无论在二级市场还是在大宗交易或者一级市场申购等交易中，均没有发现影响证券价格或者严重误导其他投资者等异常交易行为。

本报告期本基金与公司所管理的其他投资组合没有参与交易所公开竞价单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的同日反向交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2022 年上半年 A 股市场波动较大，先抑后扬，多数行业表现一般，未录得正收益。煤炭、交通运输、综合板块的表现较好，涨跌幅分别为 31.38%、-0.71%、-1.46%。整体来看，沪深 300、中证 500、中证 1000 和创业板的涨跌幅分别为-9.22%、-12.30%、-12.67%、和-15.41%。从市场风格来看，价值风格表现优于成长风格，期间沪深 300 价值指数和沪深 300 成长指数的涨跌幅分别为-6.52%和-13.14%，中证 500 价值相对中证 500 成长亦同样获得了显著的超额收益。

同比港股市场，恒生能源业、恒生电讯业等行业录得正收益，恒生能源业的涨跌幅为 18.92%。恒生指数、恒生中国企业指数和恒生综指在上半年表现一般，涨跌幅分别为-6.57%、-6.91%和-8.84%。

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 0.090%，期间日跟踪误差为 0.118%，较好地实现了本基金的投资目标。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 2.9663 元；本报告期基金份额净值增长率为 6.16%，业绩比较基准收益率为 3.09%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上海新冠疫情的爆发使得国内经济短期内失速，中美利差开始倒挂，市场情绪恐慌，迎来短暂的股债汇三杀，上证指数最低收于 2863 点。4 月底至今的反弹，在稳增长措施不断发力以及国内疫情逐步得到控制的背景下，市场开始交易最差的时期已经过去，经济迎来修复。今年前 5 月基建（不含电力）投资同比增速 6.7%，远高于 2020、2021 年的 0.9%、0.4%，主要是靠财政支出前置发力，同期财政两大账本赤字实现的序时进度均为往年较高水平。稳增长政策力度较大，仍然具有持续性。

红利策略在股权风险溢价上行、银行理财收益率下行背景下，性价比突显，投资者更倾向于将资金配置于高股息、低风险的标的。同时，红利策略在“顺周期”的行业占比较高。从投资主线来看，依然看好下半年稳增长政策的落地以及通胀相关主题。随着俄乌冲突进一步发酵，引发

的逆全球化趋势进一步加深，我们预计通胀水平仍处于高位震荡。红利策略的“顺周期”在稳增长板块以及能源板块的综合占比较高，仍具有一定优势。

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、金融工程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。本基金已于 2022 年 1 月对 2021 年度可分配利润实施了分红，每 10 份基金份额派发现金红利 0.86 元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 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：上证红利交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2022 年 6 月 30 日 | 上年度末 2021 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 60,269,803.92 | 48,963,944.65 |
| 结算备付金 | | 416,376,973.87 | 743,389,880.66 |
| 存出保证金 | | 268,329.65 | 336,180.65 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 17,417,927,162.26 | 16,997,787,065.42 |
| 其中：股票投资 | | 17,417,927,162.26 | 16,997,787,065.42 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | - | - |
| 债权投资 | 6.4.7.5 | - | - |
| 其中：债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 其他债权投资 | 6.4.7.6 | - | - |
| 其他权益工具投资 | 6.4.7.7 | - | - |
| 应收清算款 | | - | 619,165.62 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | - | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.8 | - | 766,398.59 |
| 资产总计 | | 17,894,842,269.70 | 17,791,862,635.59 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2022 年 6 月 30 日 | 上年度末 2021 年 12 月 31 日 |
| 负债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | 146,942.80 |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付清算款 | | 9,417,155.74 | 3,596,866.70 |
| 应付赎回款 | | - | - |

| | | | |
|-------------|----------|-------------------|-------------------|
| 应付管理人报酬 | | 7,482,046.13 | 7,484,798.22 |
| 应付托管费 | | 1,496,409.23 | 1,496,959.61 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.9 | 6,986,801.06 | 5,494,186.93 |
| 负债合计 | | 25,382,412.16 | 18,219,754.26 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.10 | 9,193,297,290.86 | 9,419,918,278.47 |
| 其他综合收益 | 6.4.7.11 | - | - |
| 未分配利润 | 6.4.7.12 | 8,676,162,566.68 | 8,353,724,602.86 |
| 净资产合计 | | 17,869,459,857.54 | 17,773,642,881.33 |
| 负债和净资产总计 | | 17,894,842,269.70 | 17,791,862,635.59 |

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.9663 元，基金份额总额 6,024,175,703.00 份。

6.2 利润表

会计主体：上证红利交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 | 上年度可比期间 |
|-------------------|----------|---------------------------------|---------------------------------|
| | | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
| 一、营业总收入 | | 1,378,043,651.68 | 1,499,228,222.72 |
| 1. 利息收入 | | 4,346,569.22 | 2,295,459.07 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.13 | 4,346,569.22 | 2,287,732.31 |
| 债券利息收入 | | - | 7,726.76 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | - | - |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | 890,722,644.09 | 577,674,201.46 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.14 | 492,119,483.45 | 247,953,708.90 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.15 | - | 2,907,027.35 |
| 资产支持证券投资 | 6.4.7.16 | - | - |
| 收益 | | | |

| | | | |
|----------------------------|------------|------------------|------------------|
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.17 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.18 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.19 | 398,603,160.64 | 326,813,465.21 |
| 以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益 | | - | - |
| 其他投资收益 | | - | - |
| 3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列) | 6.4.7.20 | 481,369,274.80 | 919,756,381.07 |
| 4. 汇兑收益(损失以“-”号填列) | | - | - |
| 5. 其他收入(损失以“-”号填列) | 6.4.7.21 | 1,605,163.57 | -497,818.88 |
| 减：二、营业总支出 | | 54,611,953.24 | 42,398,412.91 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 45,400,154.37 | 34,632,866.44 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 9,080,030.89 | 6,926,573.31 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | - | - |
| 4. 投资顾问费 | | - | - |
| 5. 利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6. 信用减值损失 | 6.4.7.22 | - | - |
| 7. 税金及附加 | | - | 27.83 |
| 8. 其他费用 | 6.4.7.23 | 131,767.98 | 838,945.33 |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) | | 1,323,431,698.44 | 1,456,829,809.81 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列) | | 1,323,431,698.44 | 1,456,829,809.81 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | 1,323,431,698.44 | 1,456,829,809.81 |

6.3 净资产(基金净值)变动表

会计主体：上证红利交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022年1月1日至2022年6月30日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年1月1日至2022年6月30日 | | | |
|-----------------|----------------------------|--------|------------------|-------------------|
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产(基金净值) | 9,419,918,278.47 | - | 8,353,724,602.86 | 17,773,642,881.33 |

| | | | | |
|-------------------------------------|-------------------|---|-------------------|--------------------|
| 加:会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期末期初净资产(基金净值) | 9,419,918,278.47 | - | 8,353,724,602.86 | 17,773,642,881.33 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | -226,620,987.61 | - | 322,437,963.82 | 95,816,976.21 |
| (一)、综合收益总额 | - | - | 1,323,431,698.44 | 1,323,431,698.44 |
| (二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列) | -226,620,987.61 | - | -459,006,621.11 | -685,627,608.72 |
| 其中:1.基金申购款 | 5,529,704,705.72 | - | 4,800,440,586.55 | 10,330,145,292.27 |
| 2.基金赎回款 | -5,756,325,693.33 | - | -5,259,447,207.66 | -11,015,772,900.99 |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值 | - | - | -541,987,113.51 | -541,987,113.51 |

| | | | | |
|----------------------|---------------------------------|--------|------------------|-------------------|
| 变动(净值减少以“-”号填列) | | | | |
| (四)、其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | - |
| 四、本期末净资产(基金净值) | 9,193,297,290.86 | - | 8,676,162,566.68 | 17,869,459,857.54 |
| 项目 | 上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日 | | | |
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产(基金净值) | 5,090,465,469.85 | - | 4,038,926,029.44 | 9,129,391,499.29 |
| 加:会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产(基金净值) | 5,090,465,469.85 | - | 4,038,926,029.44 | 9,129,391,499.29 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | 3,286,385,837.92 | - | 3,262,819,925.48 | 6,549,205,763.40 |
| (一)、综合收益总额 | - | - | 1,456,829,809.81 | 1,456,829,809.81 |
| (二)、本期基金份额交易产 | 3,286,385,837.92 | - | 2,395,394,889.59 | 5,681,780,727.51 |

| | | | | |
|--|-------------------|---|-------------------|-------------------|
| 生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列） | | | | |
| 其中：1. 基金申购款 | 6,259,927,888.24 | - | 4,830,487,785.37 | 11,090,415,673.61 |
| 2. 基金赎回款 | -2,973,542,050.32 | - | -2,435,092,895.78 | -5,408,634,946.10 |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) | - | - | -589,404,773.92 | -589,404,773.92 |
| （四）、其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | - |
| 四、本期末净资产(基金净值) | 8,376,851,307.77 | - | 7,301,745,954.92 | 15,678,597,262.69 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

韩勇

房伟力

赵景云

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

上证红利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”)证监基金字[2006]第 196 号《关于同意上证红利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《上证红利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 2,222,962,819.00 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(2006)第 170 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《上证红利交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2006 年 11 月 17 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 2,222,985,094.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 22,275.00 份基金份额。本基金的基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。根据《上证红利交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《上证红利交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金于 2007 年 1 月 10 日进行了基金份额折算,折算比例为 0.65527799,并于 2007 年 1 月 11 日进行了变更登记。经上海证券交易所(以下简称“上交所”)上证债字[2007]第 4 号文审核同意,本基金 1,456,675,703 份基金份额于 2007 年 1 月 18 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《上证红利交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的标的指数为上交所编制并发布的上证红利指数,主要投资范围为标的指数成份股和备选成份股,该部分资产比例不低于基金资产净值的 95%;同时为更好地实现投资目标,本基金也可少量投资于新股、存托凭证、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具,该部分资产比例不高于基金资产净值的 5%。在正常市场情况下,本基金日均跟踪偏离度(剔除成份股分红因素)的绝对值不超过 0.1%,年跟踪误差不超过 2%。本基金的业绩基准为上证红利指数。

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 2022 年 8 月 30 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《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<年度报告和中期报告>》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《上证红利交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注 6.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

除 6.4.5 的会计政策变更外，其他项目与上年度一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（以下合称“新金融工具准则”），财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

(a) 金融工具

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

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

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

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

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息和应收证券清算款，金额分别为 48,963,944.65 元、743,389,880.66 元、336,180.65 元、766,398.59 元和 619,165.62 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息和应收清算款，金额分别为 48,979,880.37 元、744,140,177.10 元、336,347.08 元、0.00 元和 619,165.62 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 16,997,787,065.42 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 16,997,787,065.42 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、应付管理人报酬、应付托管费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 3,596,866.70 元、7,484,798.22 元、1,496,959.61 元、4,892,120.16 元和 62,066.77 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、应付管理人报酬、应付托管费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 3,596,866.70 元、7,484,798.22 元、1,496,959.61 元、4,892,120.16 元和 62,066.77 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融负债为交易性金融负债，金额为 146,942.80 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融负债为交易性金融负债，金额为 146,942.80 元。

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

(b) 修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(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。

(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费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022年6月30日 |
|--------------|-------------------|
| 活期存款 | 60,269,803.92 |
| 等于：本金 | 60,265,233.09 |
| 加：应计利息 | 4,570.83 |
| 减：坏账准备 | - |
| 定期存款 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |
| 减：坏账准备 | - |
| 其中：存款期限1个月以内 | - |
| 存款期限1-3个月 | - |
| 存款期限3个月以上 | - |
| 其他存款 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |
| 减：坏账准备 | - |
| 合计 | 60,269,803.92 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022年6月30日 | | | |
|---------------|-------------------|------|-------------------|----------------|
| | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 16,865,703,725.99 | - | 17,417,927,162.26 | 552,223,436.27 |
| 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 | 16,865,703,725.99 | - | 17,417,927,162.26 | 552,223,436.27 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：截至本报告期末，本基金未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：截至本报告期末，本基金未持有期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：截至本报告期末，本基金未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：截至本报告期末，本基金未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：截至本报告期末，本基金未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

注：无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：截至本报告期末，本基金未持有债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：截至本报告期末，本基金未持有债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：截至本报告期末，本基金未持有其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：截至本报告期末，本基金未持有其他债权投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：截至本报告期末，本基金未持有其他权益工具。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：截至本报告期末，本基金未持有其他权益工具。

6.4.7.8 其他资产

注：截至本报告期末，本基金未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 |
|----|-----|
|----|-----|

| | 2022 年 6 月 30 日 |
|-------------|-----------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | - |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付交易费用 | 6,567,786.32 |
| 其中：交易所市场 | 6,567,786.32 |
| 银行间市场 | - |
| 应付利息 | - |
| 预提费用 | 419,014.74 |
| 合计 | 6,986,801.06 |

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | |
|---------------|---------------------------------------|-------------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 6,172,675,703.00 | 9,419,918,278.47 |
| 本期申购 | 3,623,500,000.00 | 5,529,704,705.72 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -3,772,000,000.00 | -5,756,325,693.33 |
| 基金拆分/份额折算前 | - | - |
| 基金拆分/份额折算调整 | - | - |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回（以“-”号填列） | - | - |
| 本期末 | 6,024,175,703.00 | 9,193,297,290.86 |

注：投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购赎回单位的整数倍。

6.4.7.11 其他综合收益

注：截至本报告期末，本基金无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| 本期期初 | 13,463,957,185.82 | -5,110,232,582.96 | 8,353,724,602.86 |
| 本期利润 | 842,062,423.64 | 481,369,274.80 | 1,323,431,698.44 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -325,259,399.96 | -133,747,221.15 | -459,006,621.11 |
| 其中：基金申购款 | 7,758,632,123.04 | -2,958,191,536.49 | 4,800,440,586.55 |
| 基金赎回款 | -8,083,891,523.00 | 2,824,444,315.34 | -5,259,447,207.66 |
| 本期已分配利润 | -541,987,113.51 | - | -541,987,113.51 |
| 本期末 | 13,438,773,095.99 | -4,762,610,529.31 | 8,676,162,566.68 |

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

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

| | |
|-----------|--------------|
| 活期存款利息收入 | 181,204.55 |
| 定期存款利息收入 | - |
| 其他存款利息收入 | - |
| 结算备付金利息收入 | 4,163,094.91 |
| 其他 | 2,269.76 |
| 合计 | 4,346,569.22 |

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年1月1日至2022年6月30日 |
|------------------|----------------------------|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | 77,083,548.04 |
| 股票投资收益——赎回差价收入 | 415,035,935.41 |
| 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 | 492,119,483.45 |

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年1月1日至2022年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 卖出股票成交总额 | 4,396,102,347.08 |
| 减：卖出股票成本总额 | 4,306,618,157.41 |
| 减：交易费用 | 12,400,641.63 |
| 买卖股票差价收入 | 77,083,548.04 |

6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年1月1日至2022年6月30日 |
|-------------|----------------------------|
| 赎回基金份额对价总额 | 11,015,772,900.99 |
| 减：现金支付赎回款总额 | 1,138,936,182.99 |
| 减：赎回股票成本总额 | 9,461,800,782.59 |
| 减：交易费用 | - |
| 赎回差价收入 | 415,035,935.41 |

6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无股票申购差价收入。

6.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益-证券出借差价收入。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益-买卖债券差价收入。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内未持有贵金属。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内未持有贵金属。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内未持有贵金属。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内未持有贵金属。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年1月1日至2022年6月30日 |
|---------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 398,603,160.64 |
| 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 | 398,603,160.64 |

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2022年1月1日至2022年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | 481,369,274.80 |
| 股票投资 | 481,369,274.80 |
| 债券投资 | - |
| 资产支持证券投资 | - |
| 基金投资 | - |
| 贵金属投资 | - |
| 其他 | - |
| 2. 衍生工具 | - |
| 权证投资 | - |
| 3. 其他 | - |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | - |
| 合计 | 481,369,274.80 |

注：股票投资包含可退替代款估值增（减）值。

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年1月1日至2022年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | - |
| 替代损益 | 1,605,163.57 |
| 合计 | 1,605,163.57 |

注：替代损益是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购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确认日估值的差额。

6.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---------|---------------------------------|
| | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
| 审计费用 | 59,507.37 |
| 信息披露费 | 59,507.37 |
| 证券出借违约金 | - |
| 银行划款手续费 | 12,753.24 |
| 合计 | 131,767.98 |

6.4.7.24 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。

6.4.8 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，本基金无其他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、基金销售机构 |
| 招商银行股份有限公司 | 基金托管人 |
| 华泰证券股份有限公司 | 基金管理人的股东、申购赎回代理券商、基金销售机构 |
| 华泰联合证券有限责任公司（“华泰联合证券”） | 基金管理人的股东华泰证券的控股子公司 |

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

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2022年1月1日至2022年6月30日 | | 上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日 | |
|-------|----------------------------|-------------------------|---------------------------------|---------------------|
| | 成交金额 | 占当期股票 成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期股票 成交总额的比例(%) |
| 华泰证券 | 1,045,627,890.72 | 11.68 | - | - |

6.4.10.1.2 权证交易

注：本报告期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2022年1月1日至2022年6月30日 | | | |
|-------|---------------------------------|--------------------|--------------|----------------------|
| | 当期 佣金 | 占当期佣金总量 的比例 (%) | 期末应付佣金余 额 | 占期末应付佣金 总额的比例 (%) |
| 华泰证券 | 144,058.53 | 2.00 | 136,149.54 | 2.07 |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日 | | | |
| | 当期 佣金 | 占当期佣金总量 的比例 (%) | 期末应付佣金余 额 | 占期末应付佣金 总额的比例 (%) |
| - | - | - | - | - |

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年1月1日至2022年6 月30日 | 上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 6月30日 |
|-----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| | 当期发生的基金应支付的管理费 | 45,400,154.37 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | - | - |

注：本基金应支付基金管理人报酬，按前一日基金资产净值的 0.50% 的年费率计提，计算方法如下： $H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$ H 为每日应支付的管理人报酬 E 为前一日的基金资产净值 基金管理人报酬每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------|---------------------------------|---------------------------------|
| | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 9,080,030.89 | 6,926,573.31 |

注：本基金应支付基金托管人托管费，按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提，计算方法如下： $H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$ H 为每日应支付的托管费 E 为前一日的基金资产净值 基金托管费每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取。

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：本基金本报告期内以及上年度可比期间内均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：本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

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

注：本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期内与上年度可比期间，基金管理人未投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

| 关联方名称 | 本期末 2022 年 6 月 30 日 | | 上年度末 2021 年 12 月 31 日 | |
|-------|------------------------|------------------------------|--------------------------|------------------------------|
| | 持有的 基金份额 | 持有的基金份额 占基金总份额的比 例 (%) | 持有的 基金份额 | 持有的基金份额 占基金总份额的比 例 (%) |

| | | | | |
|----------------------------|---------------|--------|---------------|--------|
| 华泰柏瑞上证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金 | 58,056,400.00 | 0.9637 | 18,417,900.00 | 0.2984 |
| 华泰证券股份有限公司 | 2,191,802.00 | 0.0364 | 1,340,876.00 | 0.0217 |

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2022年1月1日至2022年6月30日 | | 上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日 | |
|------------|----------------------------|------------|---------------------------------|------------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 招商银行股份有限公司 | 60,269,803.92 | 181,204.55 | 240,573,379.42 | 235,895.27 |

注：本报告期，基金托管人招商银行股份有限公司保管的银行存款按银行间同业存款利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

| 本期 2022年1月1日至2022年6月30日 | | | | | |
|---------------------------------|--------|------|------|-----------|------------|
| 关联方名称 | 证券代码 | 证券名称 | 发行方式 | 基金在承销期内买入 | |
| | | | | 数量（单位：张） | 总金额 |
| - | - | - | - | - | - |
| 上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日 | | | | | |
| 关联方名称 | 证券代码 | 证券名称 | 发行方式 | 基金在承销期内买入 | |
| | | | | 数量（单位：张） | 总金额 |
| 华泰联合证券 | 688656 | 浩欧博 | 网下申购 | 1,371 | 48,341.46 |
| 华泰联合证券 | 688350 | 富淼科技 | 网下申购 | 2,552 | 34,656.16 |
| 华泰联合证券 | 688083 | 中望软件 | 网下申购 | 1,837 | 276,468.50 |
| 华泰联合证券 | 605389 | 长龄液压 | 网下申购 | 356 | 14,026.40 |
| 华泰联合证券 | 688097 | 博众精工 | 网下申购 | 3,983 | 44,888.41 |
| 华泰联合证券 | 688314 | 康拓医疗 | 网下申购 | 1,085 | 18,813.90 |
| 华泰联合证券 | 600905 | 三峡能源 | 网上申购 | 33,000 | 87,450.00 |
| 华泰联合证券 | 688613 | 奥精医疗 | 网下申购 | 2,617 | 42,997.31 |
| 华泰联合证券 | 605499 | 东鹏饮料 | 网下申购 | 632 | 29,242.64 |
| 华泰联合证券 | 688161 | 威高骨科 | 网下申购 | 3,069 | 111,159.18 |

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金在本报告期内及上年可比期间未有其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

| 序号 | 权益登记日 | 除息日 | | 每 10 份基金份额分红数 | 现金形式发放总额 | 再投资形式发放总额 | 本期利润分配合计 | 备注 |
|----|------------------|-----|-----------------|---------------|----------------|-----------|----------------|----|
| | | 场内 | 场外 | | | | | |
| 1 | 2022 年 01 月 14 日 | - | 2022 年 1 月 17 日 | 0.8600 | 541,987,113.51 | - | 541,987,113.51 | - |
| 合计 | - | - | - | 0.8600 | 541,987,113.51 | - | 541,987,113.51 | - |

6.4.12 期末(2022 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 | | | | | | | | | | |
|----------------------|------|-----------------|----------|--------|-------|--------|----------|--------------|--------------|----|
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 受限期 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量(单位：股) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 688115 | 思林杰 | 2022 年 3 月 7 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 65.65 | 38.46 | 2,153 | 141,344.45 | 82,804.38 | - |
| 688237 | 超卓航科 | 2022 年 6 月 24 日 | 1 个月内(含) | 新股未上市 | 41.27 | 41.27 | 2,891 | 119,311.57 | 119,311.57 | - |
| 688297 | 中无人机 | 2022 年 6 月 17 日 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 32.35 | 45.88 | 37,246 | 1,204,908.10 | 1,708,846.48 | - |
| 688322 | 奥比中光 | 2022 年 6 月 30 日 | 1 个月内(含) | 新股未上市 | 30.99 | 30.99 | 8,529 | 264,313.71 | 264,313.71 | - |
| 688400 | 凌云光 | 2022 年 6 月 27 日 | 1 个月内(含) | 新股未上市 | 21.93 | 21.93 | 13,111 | 287,524.23 | 287,524.23 | - |

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，锁定期为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

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

置不低于 6 个月的限售期。

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末，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，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：本基金本报告期末未参与转融通证券出借业务。

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，将风险控制在此可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，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招商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性

风险来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

于 2022 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2022 年 6 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 0.01%。

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

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

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具

还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2022年6月30 日 | 1个月以内 | 1-3个月 | 3个月-1年 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
|-------------------------|----------------|-------|--------|------|------|-------------------|-------------------|
| 资产 | | | | | | | |
| 银行存款 | 60,269,803.92 | - | - | - | - | - | 60,269,803.92 |
| 结算备付金 | 416,376,973.87 | - | - | - | - | - | 416,376,973.87 |
| 存出保证金 | 268,329.65 | - | - | - | - | - | 268,329.65 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | - | - | 17,417,927,162.26 | 17,417,927,162.26 |
| 资产总计 | 476,915,107.44 | - | - | - | - | 17,417,927,162.26 | 17,894,842,269.70 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 7,482,046.13 | 7,482,046.13 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 1,496,409.23 | 1,496,409.23 |
| 应付清算款 | - | - | - | - | - | 9,417,155.74 | 9,417,155.74 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 6,986,801.06 | 6,986,801.06 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 25,382,412.16 | 25,382,412.16 |
| 利率敏感度缺口 | 476,915,107.44 | - | - | - | - | 17,392,544,750.10 | 17,869,459,857.54 |
| 上年度末 2021年12月 31日 | 1个月以内 | 1-3个月 | 3个月-1年 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | | | |
| 银行存款 | 48,963,944.65 | - | - | - | - | - | 48,963,944.65 |
| 结算备付金 | 743,389,880.66 | - | - | - | - | - | 743,389,880.66 |
| 存出保证金 | 336,180.65 | - | - | - | - | - | 336,180.65 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | - | - | 16,997,787,065.42 | 16,997,787,065.42 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | - | 619,165.62 | 619,165.62 |
| 其他资产 | - | - | - | - | - | 766,398.59 | 766,398.59 |
| 资产总计 | 792,690,005.96 | - | - | - | - | 16,999,172,629.63 | 17,791,862,635.59 |
| 负债 | | | | | | | |

| | | | | | | | |
|---------|----------------|---|---|---|---|--------------------|-------------------|
| 交易性金融负债 | - | - | - | - | - | 146,942.80 | 146,942.80 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 7,484,798.22 | 7,484,798.22 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 1,496,959.61 | 1,496,959.61 |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | - | 3,596,866.70 | 3,596,866.70 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 5,494,186.93 | 5,494,186.93 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 18,219,754.26 | 18,219,754.26 |
| 利率敏感度缺口 | 792,690,005.96 | - | - | - | - | -16,980,952,875.37 | 17,773,642,881.33 |

注：各期限分类的标准按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2021 年 12 月 31 日：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2021 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金主要投资于指数的成份股及其备选成份股，其投资比例不低于基金资产净值的 95%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022年6月30日 | | 上年度末 2021年12月31日 | |
|---------------|-------------------|---------------|---------------------|---------------|
| | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资 | 17,417,927,162.26 | 97.47 | 16,997,787,065.42 | 95.63 |
| 交易性金融资产—基金投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | - | - | - | - |
| 衍生金融资产—权证投资 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | -146,942.80 | - |
| 合计 | 17,417,927,162.26 | 97.47 | 16,997,640,122.62 | 95.63 |

注：其他包含可退替代款。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除上证红利指数以外的其他市场变量保持不变 | | |
|-----------|-----------------------------|-------------------|-----------------|
| 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） | | |
| | 本期末（2022年6月30日） | 上年度末（2021年12月31日） | |
| 分析 | 上证红利指数上升5% | 846,732,555.14 | 817,134,700.88 |
| | 上证红利指数下降5% | -846,732,555.14 | -817,134,700.88 |

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末 2022 年 6 月 30 日 | 上年度末 2021 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|--------------------------|
| 第一层次 | 17,415,464,361.89 | 16,995,291,141.49 |
| 第二层次 | 671,149.51 | 2,495,923.93 |
| 第三层次 | 1,791,650.86 | - |
| 合计 | 17,417,927,162.26 | 16,997,787,065.42 |

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（2021 年 12 月 31 日：同）。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------|-------------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | 17,417,927,162.26 | 97.33 |
| | 其中：股票 | 17,417,927,162.26 | 97.33 |

| | | | |
|---|-------------------|-------------------|--------|
| 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 | 476,646,777.79 | 2.66 |
| 8 | 其他各项资产 | 268,329.65 | 0.00 |
| 9 | 合计 | 17,894,842,269.70 | 100.00 |

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|------------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | 4,113,661,600.46 | 23.02 |
| C | 制造业 | 4,899,350,513.63 | 27.42 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 672,130,985.19 | 3.76 |
| E | 建筑业 | 297,687,222.24 | 1.67 |
| F | 批发和零售业 | 704,970,416.51 | 3.95 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 1,463,720,524.64 | 8.19 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | - | - |
| J | 金融业 | 2,988,535,317.48 | 16.72 |
| K | 房地产业 | 1,927,543,158.25 | 10.79 |
| 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 | 347,827,807.04 | 1.95 |

| | | | |
|---|----|-------------------|-------|
| | 业 | | |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 17,415,427,545.44 | 97.46 |

注：上述股票投资组合不包括可退替代款估值增值。

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|--------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 2,499,616.82 | 0.01 |
| 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 | - | - |
| 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 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 2,499,616.82 | 0.01 |

注：上述股票投资组合不包括可退替代款估值增值。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------|------|-------|---------|--------------|
|----|------|------|-------|---------|--------------|

| | | | | | |
|----|--------|--------|-------------|----------------|------|
| 1 | 600188 | 兖矿能源 | 24,567,208 | 969,913,371.84 | 5.43 |
| 2 | 601088 | 中国神华 | 20,825,456 | 693,487,684.80 | 3.88 |
| 3 | 600873 | 梅花生物 | 58,825,509 | 663,551,741.52 | 3.71 |
| 4 | 601225 | 陕西煤业 | 24,371,677 | 516,192,118.86 | 2.89 |
| 5 | 600325 | 华发股份 | 63,807,885 | 483,025,689.45 | 2.70 |
| 6 | 600383 | 金地集团 | 35,684,546 | 479,600,298.24 | 2.68 |
| 7 | 600395 | 盘江股份 | 53,431,606 | 468,595,184.62 | 2.62 |
| 8 | 600153 | 建发股份 | 35,672,404 | 466,238,320.28 | 2.61 |
| 9 | 600985 | 淮北矿业 | 31,547,057 | 459,325,149.92 | 2.57 |
| 10 | 601006 | 大秦铁路 | 67,338,031 | 443,757,624.29 | 2.48 |
| 11 | 600282 | 南钢股份 | 134,924,602 | 425,012,496.30 | 2.38 |
| 12 | 600348 | 华阳股份 | 26,922,969 | 416,229,100.74 | 2.33 |
| 13 | 601328 | 交通银行 | 81,518,723 | 405,963,240.54 | 2.27 |
| 14 | 600028 | 中国石化 | 95,509,106 | 389,677,152.48 | 2.18 |
| 15 | 601988 | 中国银行 | 113,148,161 | 368,863,004.86 | 2.06 |
| 16 | 601169 | 北京银行 | 80,910,039 | 367,331,577.06 | 2.06 |
| 17 | 600350 | 山东高速 | 69,272,996 | 363,683,229.00 | 2.04 |
| 18 | 600548 | 深高速 | 37,947,746 | 362,021,496.84 | 2.03 |
| 19 | 601003 | 柳钢股份 | 89,316,888 | 361,733,396.40 | 2.02 |
| 20 | 600808 | XD 马钢股 | 92,954,869 | 352,298,953.51 | 1.97 |
| 21 | 601009 | 南京银行 | 33,423,039 | 348,268,066.38 | 1.95 |
| 22 | 601098 | 中南传媒 | 36,846,166 | 347,827,807.04 | 1.95 |
| 23 | 600048 | 保利发展 | 19,834,604 | 346,312,185.84 | 1.94 |
| 24 | 600801 | 华新水泥 | 17,619,078 | 343,748,211.78 | 1.92 |
| 25 | 601216 | 君正集团 | 70,378,342 | 343,446,308.96 | 1.92 |
| 26 | 600376 | 首开股份 | 67,954,710 | 333,657,626.10 | 1.87 |
| 27 | 600177 | 雅戈尔 | 49,208,023 | 326,249,192.49 | 1.83 |
| 28 | 603858 | 步长制药 | 16,511,067 | 325,433,130.57 | 1.82 |
| 29 | 601398 | 工商银行 | 65,871,547 | 314,207,279.19 | 1.76 |
| 30 | 601288 | 农业银行 | 102,945,534 | 310,895,512.68 | 1.74 |
| 31 | 601939 | 建设银行 | 50,261,931 | 304,587,301.86 | 1.70 |
| 32 | 600023 | 浙能电力 | 86,756,408 | 301,044,735.76 | 1.68 |
| 33 | 600019 | 宝钢股份 | 49,874,498 | 300,244,477.96 | 1.68 |
| 34 | 600170 | 上海建工 | 98,246,608 | 297,687,222.24 | 1.67 |
| 35 | 600377 | 宁沪高速 | 34,335,843 | 294,258,174.51 | 1.65 |
| 36 | 601998 | 中信银行 | 60,840,808 | 288,993,838.00 | 1.62 |
| 37 | 600823 | 世茂股份 | 95,619,919 | 284,947,358.62 | 1.59 |
| 38 | 603156 | 养元饮品 | 12,498,421 | 283,964,125.12 | 1.59 |
| 39 | 601818 | 光大银行 | 92,832,391 | 279,425,496.91 | 1.56 |
| 40 | 601158 | 重庆水务 | 47,592,158 | 254,618,045.30 | 1.42 |
| 41 | 600704 | 物产中大 | 46,536,471 | 238,732,096.23 | 1.34 |
| 42 | 600585 | 海螺水泥 | 6,632,344 | 233,989,096.32 | 1.31 |

| | | | | | |
|----|--------|------|------------|----------------|------|
| 43 | 601515 | 东风股份 | 49,467,266 | 228,044,096.26 | 1.28 |
| 44 | 601636 | 旗滨集团 | 16,138,734 | 205,768,858.50 | 1.15 |
| 45 | 600971 | 恒源煤电 | 25,347,068 | 200,241,837.20 | 1.12 |
| 46 | 603886 | 元祖股份 | 8,400,533 | 148,017,391.46 | 0.83 |
| 47 | 603587 | 地素时尚 | 8,723,996 | 138,275,336.60 | 0.77 |
| 48 | 600681 | 百川能源 | 26,290,791 | 116,468,204.13 | 0.65 |
| 49 | 600261 | 阳光照明 | 33,655,906 | 113,420,403.22 | 0.63 |
| 50 | 601566 | 九牧王 | 12,547,671 | 106,153,296.66 | 0.59 |

注：股票明细不包含可退替代款估值增（减）值。

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|--------|--------------|--------------|
| 1 | 688297 | 中无人机 | 37,246 | 1,708,846.48 | 0.01 |
| 2 | 688400 | 凌云光 | 13,111 | 287,524.23 | 0.00 |
| 3 | 688322 | 奥比中光 | 8,529 | 264,313.71 | 0.00 |
| 4 | 688237 | 超卓航科 | 2,891 | 119,311.57 | 0.00 |
| 5 | 688115 | 思林杰 | 2,153 | 82,804.38 | 0.00 |
| 6 | 601089 | 福元医药 | 1,749 | 36,816.45 | 0.00 |

注：股票明细不包含可退替代款估值增（减）值。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|--------|--------|----------------|----------------|
| 1 | 601225 | 陕西煤业 | 411,118,669.78 | 2.31 |
| 2 | 600808 | XD 马钢股 | 407,550,907.09 | 2.29 |
| 3 | 600801 | 华新水泥 | 363,738,273.67 | 2.05 |
| 4 | 600348 | 华阳股份 | 321,798,598.32 | 1.81 |
| 5 | 600170 | 上海建工 | 320,939,901.10 | 1.81 |
| 6 | 601158 | 重庆水务 | 279,511,548.08 | 1.57 |
| 7 | 601515 | 东风股份 | 278,109,456.83 | 1.56 |
| 8 | 600585 | 海螺水泥 | 264,857,285.21 | 1.49 |
| 9 | 601636 | 旗滨集团 | 198,589,459.36 | 1.12 |
| 10 | 600873 | 梅花生物 | 170,234,775.37 | 0.96 |
| 11 | 603587 | 地素时尚 | 142,992,856.49 | 0.80 |
| 12 | 600383 | 金地集团 | 121,714,005.29 | 0.68 |
| 13 | 601003 | 柳钢股份 | 111,418,982.65 | 0.63 |
| 14 | 600548 | 深高速 | 83,223,277.72 | 0.47 |
| 15 | 600282 | 南钢股份 | 80,237,105.64 | 0.45 |
| 16 | 600395 | 盘江股份 | 69,199,920.68 | 0.39 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 17 | 603858 | 步长制药 | 63,919,651.23 | 0.36 |
| 18 | 600177 | 雅戈尔 | 63,196,916.64 | 0.36 |
| 19 | 601009 | 南京银行 | 59,540,887.34 | 0.33 |
| 20 | 600028 | 中国石化 | 58,662,859.00 | 0.33 |

注：本项买入金额均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑其他交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|----------------|----------------|
| 1 | 601666 | 平煤股份 | 558,587,792.62 | 3.14 |
| 2 | 600729 | 重庆百货 | 384,032,288.06 | 2.16 |
| 3 | 600188 | 兖矿能源 | 306,723,968.54 | 1.73 |
| 4 | 600016 | 民生银行 | 283,103,419.26 | 1.59 |
| 5 | 601166 | 兴业银行 | 255,717,797.55 | 1.44 |
| 6 | 600594 | 益佰制药 | 254,342,430.59 | 1.43 |
| 7 | 600603 | 广汇物流 | 245,799,663.45 | 1.38 |
| 8 | 600327 | 大东方 | 237,165,754.97 | 1.33 |
| 9 | 600971 | 恒源煤电 | 211,642,776.24 | 1.19 |
| 10 | 600479 | 千金药业 | 205,753,826.18 | 1.16 |
| 11 | 600066 | 宇通客车 | 204,877,718.62 | 1.15 |
| 12 | 600681 | 百川能源 | 177,300,708.03 | 1.00 |
| 13 | 601126 | 四方股份 | 163,095,639.50 | 0.92 |
| 14 | 600325 | 华发股份 | 124,997,586.81 | 0.70 |
| 15 | 600985 | 淮北矿业 | 118,562,887.58 | 0.67 |
| 16 | 600261 | 阳光照明 | 118,420,265.53 | 0.67 |
| 17 | 601566 | 九牧王 | 88,023,233.85 | 0.50 |
| 18 | 603886 | 元祖股份 | 76,982,359.62 | 0.43 |
| 19 | 600153 | 建发股份 | 68,758,249.02 | 0.39 |
| 20 | 600019 | 宝钢股份 | 39,448,080.00 | 0.22 |

注：本项卖出金额均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑其他交易费用。

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 | 4,563,819,043.81 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 4,396,102,347.08 |

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的。

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 | 268,329.65 |
| 2 | 应收清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 268,329.65 |

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：截至本报告期末，本基金指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|--------------|---------------|----------|
| 1 | 688297 | 中无人机 | 1,708,846.48 | 0.01 | 新股流通受限 |
| 2 | 688400 | 凌云光 | 287,524.23 | 0.00 | 新股流通受限 |
| 3 | 688322 | 奥比中光 | 264,313.71 | 0.00 | 新股流通受限 |
| 4 | 688237 | 超卓航科 | 119,311.57 | 0.00 | 新股流通受限 |
| 5 | 688115 | 思林杰 | 82,804.38 | 0.00 | 新股流通受限 |

7.12.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

8.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数 (户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 | | | |
|-----------|-----------|------------------|------------|------------------|------------|
| | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | 持有份额 | 占总份额比例 (%) | 持有份额 | 占总份额比例 (%) |
| 666,527 | 9,038.16 | 1,261,830,539.00 | 20.95 | 4,762,345,164.00 | 79.05 |

8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

| 项目 | 持有份额 (份) | 占总份额比例 (%) |
|------|---------------|------------|
| 联接基金 | 58,056,400.00 | 0.9637 |

8.2 期末上市基金前十名持有人

| 序号 | 持有人名称 | 持有份额 (份) | 占上市总份额比例 (%) |
|----|----------------------------|----------------|--------------|
| 1 | 中信证券—工行—中信证券贵宾定制7号集合资产管理计划 | 126,173,500.00 | 2.09 |
| 2 | 农银汇理资产—农业银行—农银汇理资产 | 116,424,700.00 | 1.93 |

| | | | |
|----|----------------------------------|---------------|------|
| | —复合策略 5 号集合资产管理计划 | | |
| 3 | 中国平安财产保险股份有限公司—传统—普通保险产品 | 87,737,710.00 | 1.46 |
| 4 | 中海信托股份有限公司—金海 1 号证券投资集合资金信托 | 84,700,000.00 | 1.41 |
| 5 | 申万宏源证券—工商银行—申万宏源万利增享 1 号集合资产管理计划 | 80,037,018.00 | 1.33 |
| 6 | 中国太平洋人寿保险股份有限公司—分红—个人分红 | 56,995,300.00 | 0.95 |
| 7 | 北京银行股份有限公司—心喜系列北京银行人民币理财管理计划 | 43,697,100.00 | 0.73 |
| 8 | 上海东证期货—工商银行—东证期货工银慧享二号集合资产管理计划 | 43,444,200.00 | 0.72 |
| 9 | 中信期货—工商银行—中信期货灵活配置 2 号集合资产管理计划 | 31,422,300.00 | 0.52 |
| 10 | 中信证券—中信银行—中信证券鸿鑫 1 号集合资产管理计划 | 26,161,900.00 | 0.43 |

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（2006 年 11 月 17 日） | |
| 基金份额总额 | 2,222,985,094.00 |

| | |
|---------------|------------------|
| 本报告期期初基金份额总额 | 6,172,675,703.00 |
| 本报告期基金总申购份额 | 3,623,500,000.00 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 3,772,000,000.00 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 6,024,175,703.00 |

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

上述人事变动已按相关规定备案、报告。

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(%) | |
| 光大证券 | 1 | 7,505,052,313.91 | 83.82 | 6,989,487.89 | 97.25 | - |
| 华泰证券 | 1 | 1,045,627,890.72 | 11.68 | 144,058.53 | 2.00 | - |
| 招商证券 | 1 | 402,963,046.69 | 4.50 | 53,667.32 | 0.75 | - |

| | | | | | | |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 银河证券 | 2 | - | - | - | - | - |
|------|---|---|---|---|---|---|

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为，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服务；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。

3、本报告期内，无变更租用证券公司交易单元的情况。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|------|------|------------------|--------|--------------------|------|------------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 (%) |
| 光大证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | - | - | - | - | - | - |

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管理的上海证券交易所上市 ETF 实施申赎业务多码合一的公告 | 证监会规定报刊和网站 | 2022 年 6 月 17 日 |
| 2 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资北交所上市股票的公告 | 证监会规定报刊和网站 | 2022 年 4 月 29 日 |
| 3 | 关于同意招商证券股份有限公司为上证红利交易型开放式指数证券投资基金提供主做市服务的公告 | 证监会规定报刊和网站 | 2022 年 4 月 20 日 |
| 4 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参与平安银行股份有限公司 | 证监会规定报刊和网站 | 2022 年 4 月 18 日 |

| | | | |
|---|---|------------|-----------------|
| | 行 E 通平台费率优惠活动的公告 | | |
| 5 | 关于上证红利交易型开放式指数证券投资基金标的指数修订指数编制方案的公告 | 证监会规定报刊和网站 | 2022 年 3 月 31 日 |
| 6 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于修订上证红利交易型开放式指数证券投资基金基金合同的公告 | 证监会规定报刊和网站 | 2022 年 3 月 29 日 |
| 7 | 关于同意中国国际金融股份有限公司为上证红利交易型开放式指数证券投资基金提供主做市服务的公告 | 证监会规定报刊和网站 | 2022 年 3 月 23 日 |
| 8 | 上证红利交易型开放式指数证券投资基金收益分配公告 | 证监会规定报刊和网站 | 2022 年 1 月 12 日 |
| 9 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于参加工商银行基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告 | 证监会规定报刊和网站 | 2022 年 1 月 4 日 |

§ 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、中国证监会批准上证红利交易型开放式指数证券投资基金募集的文件
- 2、《上证红利交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- 3、《上证红利交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》
- 4、《上证红利交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、上证红利交易型开放式指数证券投资基金的公告

12.2 存放地点

上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。投资者对本报告如有疑问，可咨询基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司。客户服务热线：400-888-0001（免长途

费) 021-3878 4638 公司网址: www.huatai-pb.com

华泰柏瑞基金管理有限公司

2022 年 8 月 30 日