

上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金

2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

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。

基金托管人中国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	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	20
§ 7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	54
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	55

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	55
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	55
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	55
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55
7.12 投资组合报告附注	55
§ 8 基金份额持有人信息	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
8.2 期末上市基金前十名持有人	56
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	57
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	57
§ 9 开放式基金份额变动	57
§ 10 重大事件揭示	57
10.1 基金份额持有人大会决议	57
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	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	57
10.4 基金投资策略的改变	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	58
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	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	58
10.8 其他重大事件	59
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	59
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	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	60
§ 12 备查文件目录	60
12.1 备查文件目录	60
12.2 存放地点	60
12.3 查阅方式	60

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华泰柏瑞上证中小盘 ETF
场内简称	中小 ETF (扩位证券简称: 中小盘 ETF)
基金主代码	510220
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2011 年 1 月 26 日
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	4,729,161.00 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	2011 年 3 月 28 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数表现, 追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金采取完全复制法, 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	上证中小盘指数
风险收益特征	本基金属于股票型基金中的指数型基金, 股票最低仓位为 95%, 并采用完全复制的被动式投资策略: 一方面, 相对于混合基金、债券基金与货币市场基金而言, 其风险和收益较高, 属于股票型基金中高风险、高收益的产品; 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。

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	中国银行股份有限公司
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	95566
传真	021-38601799	010-66594942
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	北京市西城区复兴门内大街 1 号
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	北京市西城区复兴门内大街 1 号

邮政编码	200135	100818
法定代表人	贾波	刘连舸

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022 年 1 月 1 日-2022 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-166,656.15
本期利润	-2,087,768.61
加权平均基金份额本期利润	-0.4407
本期加权平均净值利润率	-7.93%
本期基金份额净值增长率	-7.18%
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	9,952,435.45
期末可供分配基金份额利润	2.1045
期末基金资产净值	27,255,638.33
期末基金份额净值	5.7633
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	59.10%

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

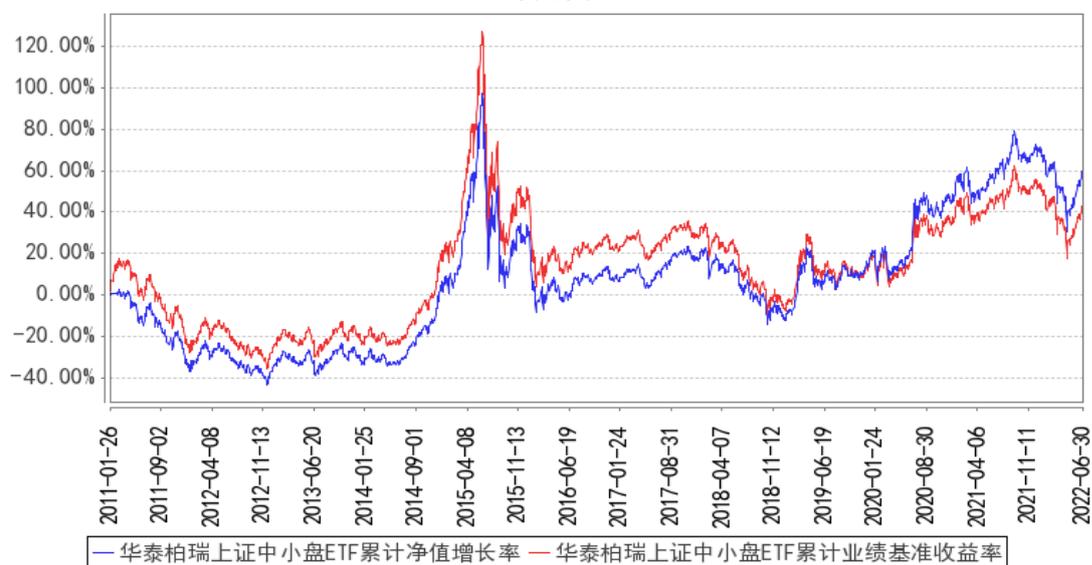
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净	份额净值	业绩比较基	业绩比较基准	①—③	②—④
----	-----	------	-------	--------	-----	-----

	值增长率①	增长率标准差②	准收益率③	收益率标准差④		
过去一个月	7.35%	0.96%	6.77%	0.98%	0.58%	-0.02%
过去三个月	5.50%	1.48%	4.45%	1.50%	1.05%	-0.02%
过去六个月	-7.18%	1.43%	-7.72%	1.45%	0.54%	-0.02%
过去一年	-1.30%	1.20%	-4.00%	1.21%	2.70%	-0.01%
过去三年	45.83%	1.22%	24.86%	1.22%	20.97%	0.00%
自基金合同生效起至今	59.10%	1.51%	41.85%	1.51%	17.25%	0.00%

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

华泰柏瑞上证中小盘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2011年1月26日至2022年6月30日。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

泰柏瑞医疗健康混合型证券投资基金、华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通指数基金联接基金、华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞量化明选混合型证券投资基金、华泰柏瑞基本面智选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞锦泰一年定期开放债券型证券投资基金、华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞益通三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、华泰柏瑞研究精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞景气回报一年持有期混合型证券投资基金、华泰柏瑞锦兴 39 个月定期开放债券型证券投资基金、华泰柏瑞锦瑞债券型证券投资基金、华泰柏瑞益商一年定期开放债券型发起式证券投资基金、华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞质量成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞行业精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞鸿利中短债债券型证券投资基金、华泰柏瑞景气优选混合型证券投资基金、华泰柏瑞品质优选混合型证券投资基金、华泰柏瑞景利混合型证券投资基金、华泰柏瑞优势领航混合型证券投资基金、华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞锦乾债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化创盈混合型证券投资基金、华泰柏瑞成长智选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞量化创享混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞质量领先混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证稀土产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞品质成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞质量精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证物联网主题交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞港股通时代机遇混合型证券投资基金、华泰柏瑞南方东英恒生科技指数交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞行业严选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证企业核心竞争力 50 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证沪港深创新药产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞远见智选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金、华泰柏瑞景气成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞创业板科技交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、华泰柏瑞锦元债券型证券投资基金、华泰柏瑞上证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞中证沪港深品牌消费 50 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证稀土产业交易型开放式

指数证券投资基金发起式联接基金、华泰柏瑞景气汇选三年持有期混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞聚优智选一年持有期混合型证券投资基金、华泰柏瑞匠心汇选混合型证券投资基金、华泰柏瑞鸿益 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金 (QDII)、华泰柏瑞恒悦混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证全指电力公用事业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 指数增强型证券投资基金、华泰柏瑞鸿裕 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金、华泰柏瑞恒泽混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、华泰柏瑞匠心臻选混合型证券投资基金。截至 2022 年 6 月 30 日，公司基金管理规模为 2750.48 亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
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。
--	--	--	--	--	---

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 0.037%，期间日跟踪误差为 0.048%，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 5.7633 元；本报告期基金份额净值增长率为-7.18%，业绩比较基准收益率为-7.72%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上海新冠疫情的爆发使得国内经济短期内失速，中美利差开始倒挂，市场情绪恐慌，迎来短暂的股债汇三杀，上证指数最低收于 2863 点。4 月底至今的反弹，在稳增长措施不断发力以及国内疫情逐步得到控制的背景下，市场交易最差的时期已经过去，经济迎来修复。5 月，经济基本面有所恢复，工业增加值出现正增长，设备制造业受益于物流打通和供应链修复，改善幅度较大。复工复产推动企业加快赶工，出口大超预期。疫情对消费的负面影响约为 4 月的 70%，未来有望继续修复。4 月之前房地产由于政策预期的反转，如期看到基本面的大幅改善，地产成交数据降幅大幅收窄。汽车销售 5 月改善，新能源车 6 月同比继续高增长。猪肉周期底部回升以及成品油价格上升带来的输入性通胀压力下，预计下半年国内通胀中枢将小幅抬升，温和通胀的环境下利率中枢难以大幅下行。

从配置的角度，中国经济从衰退到复苏，美国经济从过热到衰退，中美经济周期持续错位，使得中国市场走出了相对独立的行情。从年初至今市场交易逻辑来看，房地产和消费的交易逻辑

是正相关的，受到“稳增长预期兑现”或者“复苏预期”的牵引；从投资主线来看，依然看好下半年稳增长政策的落地以及复苏逻辑两条主线。受此影响，大盘股或将更加受益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，基金管理人严格执行基金估值控制流程，定期评估估值技术的合理性，每日将估值结果报托管银行复核后对外披露。参与估值流程的人员包括负责运营的副总经理以及投资研究、风险控制、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。截至本报告期末，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

截止本报告期末，因赎回等原因，本基金存在连续 60 个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形，但无基金份额持有人数量低于 200 人的情形。

本基金管理人已于 2020 年 9 月 9 日将《关于华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金基金资产净值低于五千万元的报告》上报中国证监会。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在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的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金

融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：上证中小盘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	630,743.21	821,265.65
结算备付金		-	-
存出保证金		33.25	225.42
交易性金融资产	6.4.7.2	26,667,812.51	28,609,149.51
其中：股票投资		26,657,811.76	28,605,557.31
基金投资		-	-
债券投资		10,000.75	3,592.20
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	95.46
资产总计		27,298,588.97	29,430,736.04
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		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-

卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		0.02	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		10,795.37	12,356.94
应付托管费		2,159.07	2,471.38
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	29,996.18	50,465.30
负债合计		42,950.64	65,293.62
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	17,303,202.88	17,303,202.89
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	9,952,435.45	12,062,239.53
净资产合计		27,255,638.33	29,365,442.42
负债和净资产总计		27,298,588.97	29,430,736.04

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额净值 5.7633 元，基金份额总额 4,729,161.00 份。

6.2 利润表

会计主体：上证中小盘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		-1,985,361.31	1,423,422.36
1. 利息收入		1,070.84	921.12
其中：存款利息收入	6.4.7.13	1,070.84	912.18
债券利息收入		-	8.94
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）		-65,166.86	1,519,799.02
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-325,897.88	1,350,112.20
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	7,225.88	7,297.75
资产支持证券投资收	6.4.7.16	-	-

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	253,505.14	162,389.07
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	-1,921,112.46	-87,860.87
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	-152.83	-9,436.91
减：二、营业总支出		102,407.30	112,784.56
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	65,294.35	61,190.90
2. 托管费	6.4.10.2.2	13,058.88	12,238.19
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	0.01
8. 其他费用	6.4.7.23	24,054.07	39,355.46
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-2,087,768.61	1,310,637.80
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-2,087,768.61	1,310,637.80
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-2,087,768.61	1,310,637.80

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：上证中小盘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	17,303,202.89	-	12,062,239.53	29,365,442.42

金净值)				
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)	17,303,202.89	-	12,062,239.53	29,365,442.42
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-0.01	-	-2,109,804.08	-2,109,804.09
(一)、综合收益总额	-	-	-2,087,768.61	-2,087,768.61
(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)	-0.01	-	-22,035.47	-22,035.48
其中:1.基金申购款	1,829,415.71	-	819,787.77	2,649,203.48
2.基金赎回款	-1,829,415.72	-	-841,823.24	-2,671,238.96
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基	-	-	-	-

金净值变动(净值减少以“-”号填列)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	17,303,202.88	-	9,952,435.45	27,255,638.33
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)	15,473,787.20	-	7,730,554.86	23,204,342.06
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)	15,473,787.20	-	7,730,554.86	23,204,342.06
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-0.01	-	1,496,354.23	1,496,354.22
(一)、综合收益总额	-	-	1,310,637.80	1,310,637.80
(二)、本期基金份额	-0.01	-	185,716.43	185,716.42

交易产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	1,829,415.71	-	1,070,312.49	2,899,728.20
2. 基金赎回款	-1,829,415.72	-	-884,596.06	-2,714,011.78
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	15,473,787.19	-	9,226,909.09	24,700,696.28

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

基金管理人负责人

房伟力

主管会计工作负责人

赵景云

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

上证中小盘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[2010]第 1535 号《关于核准上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》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《上证中小盘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 348,418,327.00 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(2011)第 022 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2011 年 1 月 26 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 348,427,447.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 9,120.00 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,基金托管人为中国银行股份有限公司。根据《上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《上证中小盘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 2011 年 3 月 11 日进行了基金份额折算,折算比例为 0.27331199,并于 2011 年 3 月 14 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[2011]第 55 号文审核同意,本基金 95,229,161.00 份基金份额于 2011 年 3 月 28 日在上交所挂牌交易。根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《上证中小盘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中证指数有限公司编制并发布的上证中小盘指数,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、债券、非成份股、存托凭证、股指期货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%。本基金的业绩比较基准为上证中小盘指数。

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 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《上证中小盘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、存出保证金和应收利息，金额分别为 821,265.65 元、225.42 元和 95.46 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、存出保证金和其他资产-应收利息，金额分别为 821,360.55 元、225.53 元和 0.00 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 28,609,149.51 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 28,609,149.96 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付管理人报酬、应付托管费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 12,356.94 元、2,471.38 元、8,345.95 元和 2,119.35 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付管理人报酬、应付托管费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 12,356.94 元、2,471.38 元、8,345.95 元和 2,119.35 元。

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

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

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

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的

补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(a) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(b) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(c) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(d) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(e) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
----	------------------------

活期存款	630,743.21
等于：本金	630,682.90
加：应计利息	60.31
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	630,743.21

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	26,444,973.93	-	26,657,811.76	212,837.83
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	10,000.00	10,000.75	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	10,000.00	10,000.75	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	26,454,973.93	0.75	26,667,812.51	212,837.83

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，本基金买入返售金融资产余额为 0。

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，本基金无其他资产。

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	6,242.68

其中：交易所市场	6,242.68
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	19,835.79
应付指数使用费	3,917.71
合计	29,996.18

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	4,729,161.00	17,303,202.89
本期申购	500,000.00	1,829,415.71
本期赎回（以“-”号填列）	-500,000.00	-1,829,415.72
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	4,729,161.00	17,303,202.88

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	16,888,644.87	-4,826,405.34	12,062,239.53
本期利润	-166,656.15	-1,921,112.46	-2,087,768.61
本期基金份额交易产生的变动数	139.48	-22,174.95	-22,035.47
其中：基金申购款	1,783,887.76	-964,099.99	819,787.77
基金赎回款	-1,783,748.28	941,925.04	-841,823.24
本期已分配利润	-	-	-
本期末	16,722,128.20	-6,769,692.75	9,952,435.45

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
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	58.00

其他	1.04
合计	1,070.84

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	-211,520.32
股票投资收益——赎回差价收入	-114,377.56
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	-325,897.88

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	3,425,939.40
减：卖出股票成本总额	3,626,870.76
减：交易费用	10,588.96
买卖股票差价收入	-211,520.32

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	2,671,238.96
减：现金支付赎回款总额	129,525.96
减：赎回股票成本总额	2,656,090.56
减：交易费用	-
赎回差价收入	-114,377.56

6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益-申购差价收入。

6.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益-证券出借差价收入。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

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

债券投资收益——利息收入	5.73
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	7,220.15
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	7,225.88

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	37,225.60
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	30,000.00
减：应计利息总额	5.43
减：交易费用	0.02
买卖债券差价收入	7,220.15

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：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属赎回差价收入。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属申购差价收入。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

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	253,505.14
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	253,505.14

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	-1,921,112.46
股票投资	-1,920,520.26
债券投资	-592.20
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	-1,921,112.46

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	-152.83
合计	-152.83

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	19,835.79
信息披露费	-
证券出借违约金	-
指数使用费	3,917.71
银行划款手续费	300.14
存托服务费	0.43
合计	24,054.07

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，不需要进行分部报告的披露。

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

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

本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华泰柏瑞基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记人、基金直销机构
中国银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
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
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（“上证中小盘 ETF 联接基金”）	本基金的基金管理人管理的其他基金
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

注：本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.10.1 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：本基金本期与上年度可比期间未发生与关联方进行的权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

注：本报告期本基金无应支付关联方的佣金。

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	65,294.35	61,190.90
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 3 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	13,058.88	12,238.19

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 3 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 (%)

华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金	1,878,100.00	39.7132	1,761,100.00	37.2392
华泰证券股份有限公司	454,722.00	9.6153	598,869.00	12.6633

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
中国银行股份有限公司	630,743.21	1,011.80	560,427.19	856.95

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

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
华泰联合	600938	中国海油	网上	3,000	32,400
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	600905	三峡能源	网上申购	31,000	82,150.00
华泰联合证券	605499	东鹏饮料	网下申购	158	7,310.66
华泰联合证券	600909	华安证券	配股	1,980	7,286.40

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

注：本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末(2022年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
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：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113060	浙 22 转债	2022 年 06 月 14 日	1 个月 内 (含)	配债未上市	100.00	100.00	100	10,000.00	10,000.75	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：截至本报告期末，本基金未持有暂时停牌的流通受限股票。

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，将风险控制可在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，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国银行，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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	10,000.75	-
AAA 以下	-	3,592.20
未评级	-	-
合计	10,000.75	3,592.20

注：债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

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 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 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 0.04%。

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、存出保证金和债券投资等。

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	630,743.21	-	-	-	-	-	630,743.21
存出保证金	33.25	-	-	-	-	-	33.25
交易性金融资产	-	-	10,000.75	-	-	-26,657,811.76	26,667,812.51
资产总计	630,776.46	-	10,000.75	-	-	-26,657,811.76	27,298,588.97
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	10,795.37	10,795.37
应付托管费	-	-	-	-	-	2,159.07	2,159.07
应付清算款	-	-	-	-	-	0.02	0.02
其他负债	-	-	-	-	-	29,996.18	29,996.18
负债总计	-	-	-	-	-	42,950.64	42,950.64
利率敏感度缺口	630,776.46	-	10,000.75	-	-	-26,614,861.12	27,255,638.33
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	821,265.65	-	-	-	-	-	821,265.65
存出保证金	225.42	-	-	-	-	-	225.42
交易性金融资产	-	-	-	-	-3,592.20	28,605,557.31	28,609,149.51
其他资产	-	-	-	-	-	95.46	95.46
资产总计	821,491.07	-	-	-	-3,592.20	28,605,652.77	29,430,736.04

负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	12,356.94	12,356.94
应付托管费	-	-	-	-	-	2,471.38	2,471.38
其他负债	-	-	-	-	-	50,465.30	50,465.30
负债总计	-	-	-	-	-	65,293.62	65,293.62
利率敏感度缺口	821,491.07	-	-	-	-3,592.20	28,540,359.15	29,365,442.42

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2022 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.04%(2021 年 12 月 31 日：0.01%)，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和债券，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 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	26,657,811.76	97.81	28,605,557.31	97.41
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	-	-	-	-
合计	26,657,811.76	97.81	28,605,557.31	97.41

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除上证中小盘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	上证中小盘指数上升 5%	1,311,625.06	1,430,590.27
	上证中小盘指数下降 5%	-1,311,625.06	-1,430,590.27

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	26,657,811.76	28,537,384.51
第二层次	10,000.75	71,765.00
第三层次	-	-
合计	26,667,812.51	28,609,149.51

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

注：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	26,657,811.76	97.65
	其中：股票	26,657,811.76	97.65
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	10,000.75	0.04
	其中：债券	10,000.75	0.04
	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	630,743.21	2.31
8	其他各项资产	33.25	0.00
9	合计	27,298,588.97	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	52,380.00	0.19
B	采矿业	1,555,969.95	5.71
C	制造业	13,813,378.97	50.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,105,730.76	4.06
E	建筑业	1,110,072.77	4.07
F	批发和零售业	698,884.98	2.56
G	交通运输、仓储和邮政业	1,183,056.92	4.34
H	住宿和餐饮业	101,250.00	0.37
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,428,083.38	5.24
J	金融业	4,592,184.96	16.85
K	房地产业	356,213.68	1.31
L	租赁和商务服务业	104,024.11	0.38
M	科学研究和技术服务业	109,248.00	0.40
N	水利、环境和公共设施管理业	95,048.69	0.35
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	231,291.00	0.85
R	文化、体育和娱乐业	34,992.88	0.13
S	综合	40,940.46	0.15
	合计	26,612,751.51	97.64

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	45,060.25	0.17
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	45,060.25	0.17

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：本基金本报告期没有通过港股通投资的股票。

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	601328	交通银行	80,100	398,898.00	1.46
2	600089	特变电工	10,873	297,811.47	1.09
3	601816	京沪高铁	56,700	284,634.00	1.04
4	600000	浦发银行	34,200	273,942.00	1.01
5	600016	民生银行	72,000	267,840.00	0.98
6	600406	国电南瑞	9,816	265,032.00	0.97
7	601225	陕西煤业	11,700	247,806.00	0.91
8	688981	中芯国际	5,400	243,918.00	0.89
9	600919	江苏银行	34,200	243,504.00	0.89

10	688599	天合光能	3,630	236,857.50	0.87
11	601988	中国银行	61,200	199,512.00	0.73
12	601169	北京银行	43,200	196,128.00	0.72
13	600660	福耀玻璃	4,500	188,145.00	0.69
14	600522	XD 中天科	8,130	187,803.00	0.69
15	600050	中国联通	54,000	186,840.00	0.69
16	601985	中国核电	27,000	185,220.00	0.68
17	601766	中国中车	35,100	182,520.00	0.67
18	601390	中国中铁	29,700	182,358.00	0.67
19	601669	中国电建	22,500	177,075.00	0.65
20	601658	邮储银行	31,500	169,785.00	0.62
21	600760	中航沈飞	2,720	164,424.00	0.60
22	601009	南京银行	15,329	159,728.18	0.59
23	688111	金山办公	800	157,696.00	0.58
24	600019	宝钢股份	26,100	157,122.00	0.58
25	600763	通策医疗	900	156,996.00	0.58
26	600958	东方证券	15,328	156,498.88	0.57
27	600999	招商证券	10,860	156,492.60	0.57
28	600009	上海机场	2,700	153,090.00	0.56
29	688116	天奈科技	900	152,532.00	0.56
30	601615	明阳智能	4,500	152,100.00	0.56
31	603659	璞泰来	1,800	151,920.00	0.56
32	603392	万泰生物	935	145,205.50	0.53
33	601818	光大银行	47,700	143,577.00	0.53
34	600256	广汇能源	13,507	142,363.78	0.52
35	600460	士兰微	2,700	140,400.00	0.52
36	603185	上机数控	900	140,391.00	0.52
37	600926	杭州银行	9,060	135,718.80	0.50
38	603833	欧派家居	900	135,612.00	0.50
39	600486	扬农化工	993	132,347.04	0.49
40	600426	华鲁恒升	4,520	131,984.00	0.48
41	600132	重庆啤酒	900	131,940.00	0.48
42	600176	中国巨石	7,207	125,473.87	0.46
43	601989	中国重工	33,300	123,543.00	0.45
44	603806	福斯特	1,872	122,653.44	0.45
45	600584	长电科技	4,511	121,797.00	0.45
46	601939	建设银行	19,800	119,988.00	0.44
47	600141	兴发集团	2,700	118,773.00	0.44
48	603993	洛阳钼业	20,700	118,611.00	0.44
49	603290	斯达半导	300	115,770.00	0.42
50	601138	XD 工业富	11,700	115,128.00	0.42
51	600096	云天化	3,600	113,328.00	0.42

52	601006	大秦铁路	17,100	112,689.00	0.41
53	601100	恒立液压	1,820	112,330.40	0.41
54	600383	金地集团	8,191	110,087.04	0.40
55	603486	科沃斯	900	109,701.00	0.40
56	600188	兖矿能源	2,776	109,596.48	0.40
57	603127	昭衍新药	960	109,248.00	0.40
58	603260	合盛硅业	920	108,523.20	0.40
59	601377	兴业证券	15,300	107,865.00	0.40
60	600885	宏发股份	2,576	107,805.60	0.40
61	601600	中国铝业	22,560	107,160.00	0.39
62	601186	中国铁建	13,500	106,650.00	0.39
63	688396	华润微	1,800	106,326.00	0.39
64	688012	中微公司	910	106,242.50	0.39
65	688005	容百科技	810	104,846.40	0.38
66	601838	成都银行	6,322	104,818.76	0.38
67	601111	中国国航	9,000	104,490.00	0.38
68	603019	中科曙光	3,600	104,472.00	0.38
69	600741	华域汽车	4,517	103,891.00	0.38
70	600157	永泰能源	64,800	103,032.00	0.38
71	600563	法拉电子	500	102,580.00	0.38
72	600150	中国船舶	5,400	102,492.00	0.38
73	600392	盛和资源	4,535	102,491.00	0.38
74	600600	青岛啤酒	985	102,361.20	0.38
75	600795	国电电力	26,100	102,051.00	0.37
76	601117	中国化学	10,836	101,966.76	0.37
77	600085	同仁堂	1,898	100,366.24	0.37
78	600547	山东黄金	5,400	100,224.00	0.37
79	601877	正泰电器	2,773	99,217.94	0.36
80	601238	广汽集团	6,320	96,316.80	0.35
81	601689	拓普集团	1,400	95,802.00	0.35
82	600886	国投电力	9,081	95,350.50	0.35
83	603369	今世缘	1,850	94,350.00	0.35
84	600015	华夏银行	18,060	94,092.60	0.35
85	688063	派能科技	300	93,660.00	0.34
86	603456	九洲药业	1,800	93,060.00	0.34
87	600418	江淮汽车	5,400	92,664.00	0.34
88	600989	宝丰能源	6,300	92,295.00	0.34
89	601800	中国交建	9,900	91,872.00	0.34
90	601868	中国能建	37,882	89,780.34	0.33
91	600732	爱旭股份	2,700	89,154.00	0.33
92	688099	晶晨股份	882	89,082.00	0.33
93	600011	华能国际	12,600	88,704.00	0.33

94	600765	中航重机	2,752	88,559.36	0.32
95	600298	安琪酵母	1,800	87,750.00	0.32
96	601336	新华保险	2,700	86,913.00	0.32
97	603605	珀莱雅	520	85,893.60	0.32
98	601799	星宇股份	500	85,500.00	0.31
99	601788	XD 光大证	5,400	85,104.00	0.31
100	688008	XD 澜起科	1,400	84,812.00	0.31
101	600941	中国移动	1,400	84,700.00	0.31
102	603345	安井食品	500	83,935.00	0.31
103	603613	国联股份	941	83,372.60	0.31
104	600779	水井坊	900	83,286.00	0.31
105	688126	沪硅产业	3,600	82,728.00	0.30
106	603893	瑞芯微	900	81,846.00	0.30
107	601555	东吴证券	11,734	81,316.62	0.30
108	601058	赛轮轮胎	7,200	81,144.00	0.30
109	600884	杉杉股份	2,730	81,135.60	0.30
110	600399	抚顺特钢	4,500	80,550.00	0.30
111	600487	亨通光电	5,420	78,806.80	0.29
112	601901	方正证券	11,700	78,507.00	0.29
113	603444	吉比特	200	77,600.00	0.28
114	603077	和邦生物	18,059	76,931.34	0.28
115	600219	南山铝业	20,745	76,549.05	0.28
116	600862	中航高科	2,700	75,870.00	0.28
117	600499	科达制造	3,600	74,304.00	0.27
118	603882	金域医学	900	74,295.00	0.27
119	688036	传音控股	831	74,150.13	0.27
120	688122	西部超导	800	73,760.00	0.27
121	600352	浙江龙盛	7,217	73,469.06	0.27
122	600233	圆通速递	3,600	73,404.00	0.27
123	601618	中国中冶	20,785	72,747.50	0.27
124	601233	桐昆股份	4,580	72,730.40	0.27
125	603026	石大胜华	500	72,675.00	0.27
126	603596	伯特利	900	72,162.00	0.26
127	601108	财通证券	9,060	71,302.20	0.26
128	603816	顾家家居	1,248	70,674.24	0.26
129	603236	移远通信	520	69,503.20	0.26
130	601360	三六零	8,100	69,012.00	0.25
131	603606	东方电缆	900	68,940.00	0.25
132	688388	嘉元科技	810	68,744.70	0.25
133	601155	新城控股	2,700	68,661.00	0.25
134	601865	福莱特	1,800	68,580.00	0.25
135	603267	鸿远电子	500	67,165.00	0.25

136	601607	上海医药	3,685	66,624.80	0.24
137	601077	渝农商行	18,000	66,600.00	0.24
138	600872	中炬高新	1,876	64,928.36	0.24
139	600674	川投能源	5,443	64,880.56	0.24
140	601677	明泰铝业	2,700	64,260.00	0.24
141	601168	西部矿业	5,428	64,213.24	0.24
142	600521	华海药业	2,788	63,287.60	0.23
143	600771	广誉远	1,800	63,270.00	0.23
144	601162	天风证券	19,800	62,964.00	0.23
145	605111	新洁能	500	62,905.00	0.23
146	605358	立昂微	932	62,798.16	0.23
147	600183	生益科技	3,668	62,319.32	0.23
148	600918	中泰证券	8,100	61,965.00	0.23
149	601128	常熟银行	8,100	61,884.00	0.23
150	601878	浙商证券	5,400	61,452.00	0.23
151	688180	君实生物	810	61,025.40	0.22
152	600489	中金黄金	8,162	60,317.18	0.22
153	600596	新安股份	2,775	60,078.75	0.22
154	601696	中银证券	4,500	59,850.00	0.22
155	603737	三棵树	460	59,537.80	0.22
156	600549	厦门钨业	2,740	59,238.80	0.22
157	600875	东方电气	3,600	59,220.00	0.22
158	601099	太平洋	19,800	59,202.00	0.22
159	601727	上海电气	14,400	59,184.00	0.22
160	600153	建发股份	4,500	58,815.00	0.22
161	603198	迎驾贡酒	900	58,626.00	0.22
162	601021	春秋航空	992	57,883.20	0.21
163	600018	上港集团	9,900	57,717.00	0.21
164	600988	赤峰黄金	3,600	57,420.00	0.21
165	601636	旗滨集团	4,500	57,375.00	0.21
166	600332	白云山	1,813	57,272.67	0.21
167	600348	华阳股份	3,698	57,171.08	0.21
168	600039	四川路桥	5,404	56,904.12	0.21
169	601898	中煤能源	5,466	56,737.08	0.21
170	600109	国金证券	6,300	56,700.00	0.21
171	600754	锦江酒店	900	56,610.00	0.21
172	600497	驰宏锌锗	10,836	56,238.84	0.21
173	603160	汇顶科技	900	55,737.00	0.20
174	600845	宝信软件	992	54,163.20	0.20
175	600559	老白干酒	1,880	53,937.20	0.20
176	601699	潞安环能	3,661	53,523.82	0.20
177	600456	宝钛股份	900	53,460.00	0.20

178	601990	南京证券	6,380	53,209.20	0.20
179	600705	中航产融	15,324	53,021.04	0.19
180	603589	口子窖	900	52,749.00	0.19
181	600546	山煤国际	2,700	52,542.00	0.19
182	603939	益丰药房	992	52,407.36	0.19
183	600372	中航电子	2,700	52,353.00	0.19
184	600338	西藏珠峰	1,820	52,234.00	0.19
185	603005	晶方科技	1,836	52,124.04	0.19
186	601872	招商轮船	9,040	52,070.40	0.19
187	603517	绝味食品	900	52,038.00	0.19
188	600803	新奥股份	2,775	51,587.25	0.19
189	600143	金发科技	5,400	51,408.00	0.19
190	603899	晨光股份	900	50,472.00	0.19
191	600529	山东药玻	1,800	50,310.00	0.18
192	600711	盛屯矿业	6,331	49,128.56	0.18
193	601666	平煤股份	3,600	48,924.00	0.18
194	601216	君正集团	9,988	48,741.44	0.18
195	600362	江西铜业	2,717	48,444.11	0.18
196	600160	巨化股份	3,677	48,352.55	0.18
197	600859	王府井	1,856	48,218.88	0.18
198	600516	方大炭素	6,331	48,115.60	0.18
199	601001	晋控煤业	2,700	47,925.00	0.18
200	601997	贵阳银行	8,180	47,525.80	0.17
201	600536	中国软件	1,170	47,490.30	0.17
202	600061	国投资本	7,296	46,402.56	0.17
203	600170	上海建工	15,311	46,392.33	0.17
204	600704	物产中大	9,000	46,170.00	0.17
205	603195	公牛集团	300	45,873.00	0.17
206	603218	日月股份	1,800	45,720.00	0.17
207	601966	玲珑轮胎	1,800	45,666.00	0.17
208	603338	浙江鼎力	900	45,630.00	0.17
209	600259	广晟有色	900	45,585.00	0.17
210	600380	健康元	3,688	45,546.80	0.17
211	601319	中国人保	9,000	45,540.00	0.17
212	600415	小商品城	8,129	45,278.53	0.17
213	688561	奇安信	810	45,198.00	0.17
214	600171	上海贝岭	1,800	45,054.00	0.17
215	603658	安图生物	920	44,978.80	0.17
216	600258	首旅酒店	1,800	44,640.00	0.16
217	600236	桂冠电力	7,217	43,951.53	0.16
218	600161	天坛生物	1,804	43,801.12	0.16
219	600699	均胜电子	2,780	43,673.80	0.16

220	600038	中直股份	961	43,437.20	0.16
221	600777	新潮能源	16,200	43,254.00	0.16
222	600079	人福医药	2,700	43,200.00	0.16
223	601016	节能风电	9,000	43,200.00	0.16
224	603087	甘李药业	900	43,173.00	0.16
225	600655	豫园股份	4,553	42,980.32	0.16
226	600606	绿地控股	10,820	42,847.20	0.16
227	601577	长沙银行	5,400	42,822.00	0.16
228	600482	中国动力	2,724	42,794.04	0.16
229	601998	中信银行	9,000	42,750.00	0.16
230	688363	华熙生物	300	42,654.00	0.16
231	600328	中盐化工	1,800	42,390.00	0.16
232	600110	诺德股份	3,639	42,285.18	0.16
233	603678	火炬电子	900	42,129.00	0.15
234	600882	妙可蓝多	900	42,120.00	0.15
235	600642	申能股份	7,281	41,356.08	0.15
236	603156	养元饮品	1,804	40,986.88	0.15
237	600673	东阳光	4,554	40,940.46	0.15
238	600879	航天电子	6,300	40,887.00	0.15
239	689009	九号公司	900	40,050.00	0.15
240	601975	招商南油	9,900	39,897.00	0.15
241	600739	辽宁成大	2,733	39,847.14	0.15
242	603883	老百姓	1,170	39,639.60	0.15
243	600271	航天信息	3,606	39,449.64	0.14
244	600985	淮北矿业	2,700	39,312.00	0.14
245	600369	西南证券	9,900	39,303.00	0.14
246	603279	景津装备	1,260	39,072.60	0.14
247	600820	隧道股份	6,384	39,070.08	0.14
248	600580	卧龙电驱	2,708	39,049.36	0.14
249	600027	华电国际	9,928	39,017.04	0.14
250	601717	郑煤机	2,700	38,907.00	0.14
251	603027	千禾味业	2,232	38,613.60	0.14
252	600166	福田汽车	13,592	38,465.36	0.14
253	600056	中国医药	2,579	38,220.78	0.14
254	601222	林洋能源	4,575	38,201.25	0.14
255	600323	瀚蓝环境	1,857	38,068.50	0.14
256	600483	福能股份	2,700	37,989.00	0.14
257	600118	中国卫星	1,886	37,870.88	0.14
258	601005	重庆钢铁	19,800	37,818.00	0.14
259	600025	华能水电	5,400	37,746.00	0.14
260	600026	中远海能	3,645	37,652.85	0.14
261	688002	睿创微纳	938	37,257.36	0.14

262	600008	首创环保	12,604	36,551.60	0.13
263	603858	步长制药	1,853	36,522.63	0.13
264	600863	内蒙华电	9,927	36,233.55	0.13
265	601908	京运通	4,500	36,090.00	0.13
266	603233	大参林	1,152	36,057.60	0.13
267	600827	百联股份	2,700	35,667.00	0.13
268	600970	中材国际	3,676	35,620.44	0.13
269	600801	华新水泥	1,820	35,508.20	0.13
270	600773	西藏城投	1,800	35,460.00	0.13
271	600206	有研新材	1,822	35,237.48	0.13
272	601866	中远海发	11,733	35,199.00	0.13
273	600641	万业企业	1,800	35,100.00	0.13
274	601881	中国银河	3,600	34,812.00	0.13
275	600325	华发股份	4,572	34,610.04	0.13
276	600755	厦门国贸	4,573	34,297.50	0.13
277	600060	海信视像	2,727	34,087.50	0.13
278	601375	中原证券	8,124	33,877.08	0.12
279	603906	龙蟠科技	900	33,246.00	0.12
280	600201	生物股份	3,627	33,223.32	0.12
281	600667	太极实业	4,500	33,210.00	0.12
282	603885	吉祥航空	1,820	32,741.80	0.12
283	688009	中国通号	7,200	32,616.00	0.12
284	600330	天通股份	2,737	32,597.67	0.12
285	601992	金隅集团	11,718	32,458.86	0.12
286	600998	九州通	2,700	32,157.00	0.12
287	600100	同方股份	7,200	32,040.00	0.12
288	600277	亿利洁能	6,381	31,905.00	0.12
289	603650	彤程新材	963	31,374.54	0.12
290	600839	四川长虹	10,836	31,207.68	0.11
291	600066	宇通客车	3,600	31,140.00	0.11
292	600390	五矿资本	6,360	31,100.40	0.11
293	600718	东软集团	2,700	31,077.00	0.11
294	603568	伟明环保	927	30,933.99	0.11
295	603919	金徽酒	900	30,591.00	0.11
296	600478	科力远	3,696	30,565.92	0.11
297	600297	广汇汽车	11,700	30,537.00	0.11
298	600155	华创阳安	3,600	30,528.00	0.11
299	603866	桃李面包	1,844	30,518.20	0.11
300	600151	航天机电	2,700	29,997.00	0.11
301	600409	三友化工	3,634	29,762.46	0.11
302	600064	南京高科	2,700	29,700.00	0.11
303	601179	中国西电	6,300	29,484.00	0.11

304	600273	嘉化能源	2,700	29,322.00	0.11
305	600728	佳都科技	4,528	29,250.88	0.11
306	601778	晶科科技	5,400	29,160.00	0.11
307	600517	国网英大	5,479	28,436.01	0.10
308	600535	天士力	2,700	28,377.00	0.10
309	600282	南钢股份	9,000	28,350.00	0.10
310	603712	七一二	900	28,350.00	0.10
311	601018	宁波港	7,247	28,263.30	0.10
312	600022	山东钢铁	16,205	28,196.70	0.10
313	600316	洪都航空	916	27,699.84	0.10
314	601880	辽港股份	16,243	27,613.10	0.10
315	688088	虹软科技	874	27,609.66	0.10
316	600562	国睿科技	1,850	27,472.50	0.10
317	600808	马钢股份	7,240	27,439.60	0.10
318	600498	烽火通信	1,888	27,338.24	0.10
319	603317	天味食品	960	27,331.20	0.10
320	600782	新钢股份	5,400	27,216.00	0.10
321	603305	旭升股份	900	27,198.00	0.10
322	600598	北大荒	1,800	26,568.00	0.10
323	603707	健友股份	940	26,508.00	0.10
324	601808	中海油服	1,898	26,477.10	0.10
325	601231	环旭电子	1,842	26,451.12	0.10
326	601952	苏垦农发	1,890	26,441.10	0.10
327	600583	海油工程	6,369	26,431.35	0.10
328	603881	数据港	980	26,313.00	0.10
329	600955	维远股份	900	25,956.00	0.10
330	600507	方大特钢	3,698	25,849.02	0.09
331	600566	济川药业	951	25,829.16	0.09
332	601118	海南橡胶	5,400	25,812.00	0.09
333	600216	浙江医药	1,889	25,784.85	0.09
334	600908	无锡银行	4,500	25,335.00	0.09
335	600567	山鹰国际	9,067	25,115.59	0.09
336	601718	际华集团	8,100	25,110.00	0.09
337	600967	内蒙一机	2,740	24,988.80	0.09
338	601106	中国一重	8,100	24,867.00	0.09
339	601212	白银有色	9,000	24,840.00	0.09
340	601236	红塔证券	2,720	24,833.60	0.09
341	600057	厦门象屿	2,782	24,453.78	0.09
342	600500	中化国际	3,674	24,432.10	0.09
343	600131	国网信通	1,800	24,210.00	0.09
344	601958	金铂股份	2,716	24,009.44	0.09
345	600572	康恩贝	5,412	23,975.16	0.09

346	603733	仙鹤股份	900	23,940.00	0.09
347	600435	北方导航	2,774	23,911.88	0.09
348	600062	华润双鹤	927	23,786.82	0.09
349	600267	海正药业	1,853	23,736.93	0.09
350	600597	光明乳业	1,869	23,605.47	0.09
351	600329	达仁堂	957	23,523.06	0.09
352	601000	唐山港	9,069	23,398.02	0.09
353	600138	中青旅	1,800	23,202.00	0.09
354	603323	苏农银行	4,540	23,154.00	0.08
355	600993	马应龙	981	22,857.30	0.08
356	600195	中牧股份	1,857	22,766.82	0.08
357	600295	鄂尔多斯	1,260	22,743.00	0.08
358	600185	格力地产	3,600	22,716.00	0.08
359	603228	景旺电子	972	22,676.76	0.08
360	601611	中国核建	2,700	22,653.00	0.08
361	600556	天下秀	2,700	22,221.00	0.08
362	601456	国联证券	1,800	22,086.00	0.08
363	600120	浙江东方	5,491	22,018.91	0.08
364	600582	天地科技	4,564	21,815.92	0.08
365	600312	平高电气	2,727	21,761.46	0.08
366	600410	华胜天成	3,680	21,491.20	0.08
367	603927	中科软	920	21,454.40	0.08
368	603225	新凤鸣	1,852	21,372.08	0.08
369	600707	彩虹股份	4,500	21,060.00	0.08
370	600916	中国黄金	1,800	21,060.00	0.08
371	600740	山西焦化	3,603	20,969.46	0.08
372	600737	中粮糖业	2,781	20,913.12	0.08
373	600966	博汇纸业	2,700	20,898.00	0.08
374	600006	东风汽车	2,753	20,785.15	0.08
375	600095	湘财股份	2,700	20,763.00	0.08
376	601311	骆驼股份	1,850	20,590.50	0.08
377	601608	中信重工	5,409	20,500.11	0.08
378	600811	东方集团	7,240	20,489.20	0.08
379	600776	东方通信	1,800	20,250.00	0.07
380	603000	人民网	1,800	20,160.00	0.07
381	603025	大豪科技	900	19,656.00	0.07
382	600446	金证股份	1,853	19,234.14	0.07
383	601200	上海环境	1,870	18,999.20	0.07
384	600116	三峡水利	1,873	18,804.92	0.07
385	600126	杭钢股份	3,600	18,432.00	0.07
386	600927	永安期货	900	18,153.00	0.07
387	600812	华北制药	2,700	18,144.00	0.07

388	600373	中文传媒	1,800	17,982.00	0.07
389	600391	航发科技	931	17,884.51	0.07
390	600307	酒钢宏兴	9,088	17,630.72	0.06
391	601991	大唐发电	7,233	17,576.19	0.06
392	600490	鹏欣资源	4,548	17,509.80	0.06
393	601519	大智慧	2,700	17,442.00	0.06
394	601098	中南传媒	1,802	17,010.88	0.06
395	600906	财达证券	1,800	16,182.00	0.06
396	601187	厦门银行	2,700	16,092.00	0.06
397	600685	中船防务	941	15,517.09	0.06
398	600787	中储股份	2,725	15,505.25	0.06
399	601969	海南矿业	1,800	15,462.00	0.06
400	603888	新华网	900	15,435.00	0.06
401	600377	XD 宁沪高	1,800	15,426.00	0.06
402	600984	建设机械	2,340	15,163.20	0.06
403	601011	宝泰隆	3,600	15,048.00	0.06
404	600751	海航科技	5,400	14,634.00	0.05
405	600750	江中药业	977	13,990.64	0.05
406	601890	亚星锚链	1,800	13,896.00	0.05
407	600864	哈投股份	2,746	13,812.38	0.05
408	601609	金田股份	1,800	13,518.00	0.05
409	600032	浙江新能	900	13,185.00	0.05
410	601139	深圳燃气	1,891	13,123.54	0.05
411	600339	中油工程	4,500	13,005.00	0.05
412	603056	德邦股份	900	12,087.00	0.04
413	600783	鲁信创投	909	12,053.34	0.04
414	601828	美凯龙	1,830	11,089.80	0.04
415	600072	中船科技	900	10,926.00	0.04
416	600823	世茂股份	3,600	10,728.00	0.04
417	601606	长城军工	900	10,449.00	0.04
418	600343	航天动力	952	10,129.28	0.04
419	600581	八一钢铁	1,800	10,116.00	0.04
420	603105	芯能科技	900	10,062.00	0.04
421	603113	金能科技	900	9,954.00	0.04
422	601298	青岛港	1,800	9,846.00	0.04
423	600350	山东高速	1,800	9,450.00	0.03
424	600640	新国脉	900	9,441.00	0.03
425	600466	蓝光发展	5,480	9,151.60	0.03
426	600335	国机汽车	900	9,009.00	0.03
427	601665	齐鲁银行	1,800	8,784.00	0.03
428	600299	安迪苏	900	8,622.00	0.03
429	601003	柳钢股份	1,800	7,290.00	0.03

430	601330	绿色动力	900	7,047.00	0.03
431	600903	贵州燃气	900	7,011.00	0.03
432	600935	华塑股份	900	4,716.00	0.02

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	688235	百济神州	300	29,799.00	0.11
2	601089	福元医药	725	15,261.25	0.06

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	600000	XD 浦发银	270,785.00	0.92
2	600050	中国联通	188,441.00	0.64
3	600563	法拉电子	145,040.94	0.49
4	603605	珀莱雅	139,031.00	0.47
5	603290	斯达半导	137,673.00	0.47
6	603392	万泰生物	134,598.00	0.46
7	688116	天奈科技	129,663.38	0.44
8	601799	星宇股份	128,271.00	0.44
9	603444	吉比特	113,669.00	0.39
10	603185	上机数控	113,268.00	0.39
11	601138	工业富联	109,137.00	0.37
12	600547	山东黄金	98,943.00	0.34
13	600941	中国移动	92,141.00	0.31
14	601336	新华保险	76,950.00	0.26
15	603236	移远通信	71,522.00	0.24
16	603345	安井食品	69,726.00	0.24
17	688063	派能科技	64,179.00	0.22
18	603267	鸿远电子	63,533.00	0.22
19	601677	明泰铝业	61,890.00	0.21
20	603026	石大胜华	61,492.00	0.21

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	603799	华友钴业	285,274.50	0.97
2	600111	北方稀土	248,595.00	0.85

3	601229	上海银行	190,583.00	0.65
4	600905	三峡能源	159,753.00	0.54
5	600346	恒力石化	146,369.40	0.50
6	600010	包钢股份	145,749.60	0.50
7	603345	安井食品	143,315.00	0.49
8	603195	公牛集团	141,714.00	0.48
9	603267	鸿远电子	127,069.00	0.43
10	603026	石大胜华	106,540.00	0.36
11	600029	南方航空	97,417.00	0.33
12	603737	三棵树	86,226.00	0.29
13	603236	移远通信	70,296.00	0.24
14	688008	澜起科技	68,354.00	0.23
15	603605	珀莱雅	63,121.00	0.21
16	600941	中国移动	59,000.00	0.20
17	600563	法拉电子	53,091.00	0.18
18	600754	锦江酒店	46,631.00	0.16
19	601933	永辉超市	45,660.30	0.16
20	601799	星宇股份	45,395.00	0.15

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	3,781,793.03
卖出股票收入（成交）总额	3,425,939.40

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	10,000.75	0.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	10,000.75	0.04

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113060	浙 22 转债	100	10,000.75	0.04

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投资。

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。

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	33.25
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	33.25

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

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

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

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 (%)
724	6,531.99	2,446,895.00	51.74	2,282,266.00	48.26

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	1,878,100.00	39.7132

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	华泰证券股份有限公司	454,722.00	9.62
2	钱中明	300,914.00	6.36
3	中国国际金融股份有限公司	109,700.00	2.32
4	徐钧	106,000.00	2.24
5	方蓉	55,640.00	1.18
6	孙莉玫	50,964.00	1.08
7	陈伟明	50,200.00	1.06
8	郝晋华	45,000.00	0.95

9	王秀芬	43,940.00	0.93
10	卢瑞洪	36,700.00	0.78

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 (2011 年 1 月 26 日) 基金份额总额	348,427,447.00
本报告期期初基金份额总额	4,729,161.00
本报告期基金总申购份额	500,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	500,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	4,729,161.00

§ 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

为本基金审计的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所有限公司。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 (%)	
国泰君安	2	7,084,860.32	100.00	6,599.27	100.00	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	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，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，并能为基金提供全面的信息服。

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，新增天风证券和中泰证券的交易单元。

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 (%)
国泰君安	37,225.60	100.00	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-

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	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 E 通平台费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2022 年 4 月 18 日
4	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2022 年 4 月 16 日
5	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金参与财通证券股份有限公司配股的公告	证监会规定报刊和网站	2022 年 4 月 13 日
6	关于同意中国国际金融股份有限公司为上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金提供主做市服务的公告	证监会规定报刊和网站	2022 年 4 月 13 日
7	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

投资者类	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况

别	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比(%)
联接基金	1	20220101-20220630;	1,761,100.00	122,000.00	5,000.00	1,878,100.00	39.7132

产品特有风险

本基金报告期内有本基金联接基金持有基金份额超过 20% 的情形。如果这些份额持有比例较大的投资者赎回，可能导致巨额赎回，从而引发流动性风险，可能对基金产生如下影响：（1）延期办理赎回申请或暂停赎回的风险。当发生巨额赎回时，投资者可能面临赎回申请延期办理、延缓支付或暂停赎回的风险。（2）基金净值大幅波动的风险。基金管理人为了应对大额赎回可能短时间内进行资产变现，这将对基金资产净值产生不利影响，同时可能发生大额赎回费用归入基金资产、基金份额净值保留位数四舍五入等问题，这些都可能会造成基金资产净值的较大波动。（3）基金投资目标偏离的风险。单一投资者大额赎回后可能导致基金规模缩小，基金将面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形，从而使得实现基金投资目标存在一定的不确定性。（4）基金合同提前终止的风险。如果投资者大额赎回可能导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。本基金管理人将密切关注申赎动向，审慎评估大额申赎对基金持有集中度的影响，同时将完善流动性风险管控机制，最大限度的保护基金份额持有人的合法权益。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金募集的文件
- 2、《上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- 3、《上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》
- 4、《上证中小盘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、上证中小盘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 层及托管人住所

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