

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
2022 年第 3 季度报告

2022 年 9 月 30 日

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：中信建投证券股份有限公司

报告送出日期：2022 年 10 月 26 日

§ 1 重要提示

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

基金托管人中信建投证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 10 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。

投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 7 月 1 日起至 2022 年 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	互联网 50
场内简称	互联网 50 (扩位证券简称: 互联网 50ETF)
基金主代码	517050
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 1 月 25 日
报告期末基金份额总额	1,051,605,000.00 份
投资目标	紧密跟踪标的指数表现,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金力争将日均跟踪偏离度控制在 0.2% 以内,年化跟踪误差控制在 2% 以内。
投资策略	本基金主要采取完全复制法,即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整;当标的指数进行定期调整、指数样本空间或者编制规则变更时,本基金将根据标的指数的编制规则及调整公告,及时进行投资组合的优化调整,尽量降低跟踪误差,力争将日均跟踪偏离度控制在 0.2% 以内,年化跟踪误差控制在 2% 以内。
业绩比较基准	中证沪港深互联网指数
风险收益特征	本基金属于股票型基金中的指数型基金,采用完全复制的被动式投资策略,具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征:一方面,相对于混合型基金、债券型基金与货币市场基金而言,其风险和收益较高;另一方面,相对于采用抽样复制的指数型基金而言,其风险和收益特征将更能与标的指数保持基本一致。 本基金可投资港股通标的股票,除需承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险,还需承担汇率风险以及香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	中信建投证券股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2022 年 7 月 1 日-2022 年 9 月 30 日）
1. 本期已实现收益	-11,720,870.08
2. 本期利润	-128,306,251.31
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.1265
4. 期末基金资产净值	522,290,700.28
5. 期末基金份额净值	0.4967

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

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

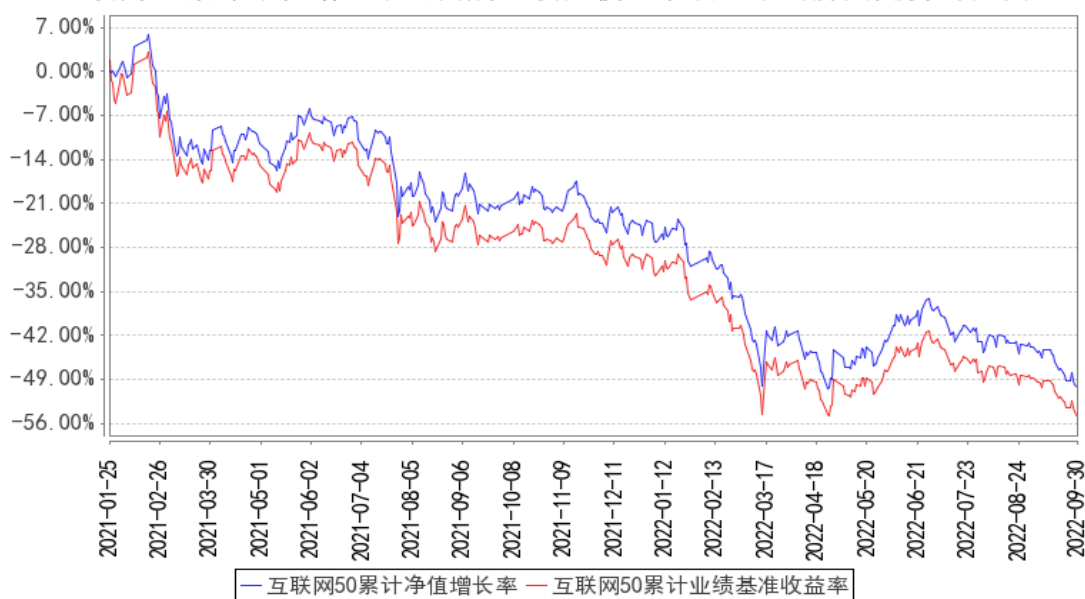
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	-20.25%	1.46%	-21.11%	1.47%	0.86%	-0.01%
过去六个月	-14.15%	1.97%	-15.14%	1.95%	0.99%	0.02%
过去一年	-36.85%	2.01%	-38.80%	2.04%	1.95%	-0.03%
自基金合同 生效起至今	-50.33%	1.91%	-54.97%	1.97%	4.64%	-0.06%

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

互联网 50 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 2021 年 1 月 25 日至 2022 年 9 月 30 日。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李茜	本基金的基金经理	2021年1月25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。
李沐阳	本基金的基金经理	2021 年 3 月 10 日	-	4 年	美国哥伦比亚大学应用统计学硕士。2017 年 8 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司, 历任指数投资部助理研究员、研究员、基金经理助理。2021 年 1 月起任华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月起任华泰柏瑞中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 8 月起任华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022 年 4 月起任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的基金经理。
何琦	本基金的基金经理	2021 年 1 月 25 日	-	14 年	上海交通大学经济学学士。曾任汇丰银行证券服务部证券结算师, 2008 年 11 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司, 曾任交易部高级交易员, 海外投资部基金经理助理。2017 年 7 月起任华泰柏瑞新经济沪港深灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 8 月起任华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 12 月起任华泰柏瑞中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 1 月起任华泰柏瑞中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 5 月起任华泰柏瑞港股通时代机遇混合型证券投资基金和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 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。2022 年 1 月起任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。
--	--	--	--	--	---

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

回顾

本期产品所跟踪的 SHS 互联网指数报告期内涨跌幅为-21.11%，本产品报告期内涨跌幅为-20.25%。

三季度，海外环境、国内房地产和疫情反复使得经济复苏的难度更大，叠加流动性、中美博弈等多方面因素的持续影响，板块持续低位拉锯；尤其 8、9 月，海外流动性继续收紧，欧美加息、汇率波动等因素导致市场表现疲软，延续颓势。分行业来看：前三季度，中国网上零售额 9.2 万

亿，同比增长 18.5%，在线餐饮消费稳步恢复，农村电商、跨境电商发展态势良好；7-8 月，中国游戏行业仍未走出环比、同比双降的阴霾，实现实际销售收入 408.15 亿，虽然降幅有所收窄，但由于版号恢复发放时间尚短，供给侧恢复尚需时间；中国互联网广告受游戏、电商等广告主需求疲软影响大盘整体下行，内容媒体和社交社区等媒介广告收入下降，但电商广告因闭环交易转化等特点，在广告主经营承压下展现出相对优势。

展望

展望下半年，互联网基本面和股价可能构筑双底，若疫情缓和和业绩底确认则有望推动新一轮上涨。政策方面，3 月中下旬以来政策和监管利好频出，包括游戏版号重新核发、支持平台经济健康发展以及监管常态化等，从长期来看，以互联网为核心的数字经济仍然是国内稳增长的重要驱动力。经营方面，5 月中下旬以来，随着北京、上海疫情出现拐点，需求逐步复苏，下半年，游戏、电商、广告等行业都有望迎来同环比改善。此外，多家互联网公司选择“双重上市”，与二次上市不同，双重上市意味着股价与美股脱钩、具有更强的自主性，未来也有可能成为港股通标的。更多的优质中概股“双重上市”有望进一步推动国内资金的配置需求，下半年公司有望筑底回升。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.4967 元；本报告期基金份额净值增长率为-20.25%，业绩比较基准收益率为-21.11%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	503,228,204.85	96.21
	其中：股票	503,228,204.85	96.21
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	19,531,710.94	3.73
8	其他资产	282,577.75	0.05
9	合计	523,042,493.54	100.00

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币 233,588,577.72 元，占基金资产净值的比例为 44.72%。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	17,429,484.94	3.34
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	195,524,663.73	37.44
J	金融业	44,249,647.12	8.47
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	3,324,595.00	0.64
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	7,098,618.06	1.36
S	综合	-	-
	合计	267,627,008.85	51.24

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,665,295.58	0.32

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	266,652.81	0.05
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	9,039.75	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	40,076.80	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	26,086.34	0.00
R	文化、体育和娱乐业	5,467.00	0.00
S	综合	-	-
	合计	2,012,618.28	0.39

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
10 能源	-	-
15 原材料	-	-
20 工业	-	-
25 可选消费	62,859,077.08	12.04
30 主要消费	-	-
35 医药卫生	30,958,299.98	5.93
40 金融	4,387,040.49	0.84
45 信息技术	45,998,438.15	8.81
50 通信服务	89,385,722.02	17.11
55 公用事业	-	-
合计	233,588,577.72	44.72

注：以上分类采用中证行业分类标准。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	03690	美团-W	371,741	55,677,606.41	10.66
2	00700	腾讯控股	200,445	48,295,782.75	9.25
3	300059	东方财富	2,147,676	37,842,051.12	7.25

4	01810	小米集团-W	3,558,500	28,837,309.67	5.52
5	01024	快手-W	509,700	23,487,596.81	4.50
6	06618	京东健康	495,600	20,215,644.93	3.87
7	002230	科大讯飞	598,950	19,657,539.00	3.76
8	600570	恒生电子	554,210	18,782,176.90	3.60
9	002410	广联达	362,235	16,528,783.05	3.16
10	603613	国联股份	133,175	14,377,573.00	2.75

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688035	德邦科技	4,981	339,206.10	0.06
2	688275	C 万润	1,083	202,336.89	0.04
3	688322	奥比中光	8,529	187,893.87	0.04
4	688409	N 富创	2,576	180,294.24	0.03
5	301363	美好医疗	4,447	136,345.02	0.03

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期无股指期货投资。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期无股指期货投资。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

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

本基金本报告期末投资的前十名证券中，科大讯飞（00230）于 2021 年 11 月 17 日收到国家市场监督管理总局下发的行政处罚决定书（国市监处罚〔2021〕112 号），因科大讯飞与京东尚科未依法申报违法实施的经营者集中，违反《反垄断法》第二十一条的规定，故对公司处以 50 万元罚款的行政处罚。对该证券投资决策程序的说明：根据我司的基金投资管理相关制度，以相应的研究报告为基础，结合其未来增长前景，由基金经理决定具体投资行为。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	179,056.30
2	应收证券清算款	65,713.53
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	37,807.92
8	其他	-
9	合计	282,577.75

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：截至本报告期末，本基金指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688035	德邦科技	339,206.10	0.06	新股锁定期内
2	688275	C 万润	202,336.89	0.04	新股锁定期内
3	688322	奥比中光	187,893.87	0.04	新股锁定期内
4	688409	N 富创	180,294.24	0.03	新股未上市
5	301363	美好医疗	122,701.32	0.02	新股未上市
5	301363	美好医疗	13,643.70	0.00	新股锁定期内

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	1,003,605,000.00
报告期期间基金总申购份额	88,000,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	40,000,000.00
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	1,051,605,000.00

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：无。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

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

9.2 存放地点

上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

9.3 查阅方式

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

华泰柏瑞基金管理有限公司

2022 年 10 月 26 日