

华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数 证券投资基金 2021 年中期报告

2021 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：2021 年 8 月 28 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 2021 年 8 月 27 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，投资者在做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 2021 年 1 月 1 日起至 2021 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	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	14
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.....	15
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.....	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
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.....	16
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.....	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
6.4 报表附注.....	20
§7 投资组合报告.....	58
7.1 期末基金资产组合情况.....	58
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	58
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.....	59
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	62
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	63
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.....	64
7.7 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.....	64
7.8 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.....	64
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.....	64
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	64
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	64
7.12 投资组合报告附注.....	64
§8 基金份额持有人信息.....	66
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	66
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	66
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	66
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的情况.....	67
§9 开放式基金份额变动.....	68
§10 重大事件揭示.....	69
10.1 基金份额持有人大会决议.....	69
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.....	69
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	69
10.4 基金投资策略的改变.....	69
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	69
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.....	69
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	69
10.8 其他重大事件.....	72

§11 影响投资者决策的其他重要信息	74
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	74
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	74
§12 备查文件目录	75
12.1 备查文件目录.....	75
12.2 存放地点	75
12.3 查阅方式.....	75

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	光伏 ETF
场内简称	光伏 ETF
扩位证券简称	光伏 ETF
基金主代码	515790
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020 年 12 月 7 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	5,424,494,000.00 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	2020 年 12 月 18 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。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	中证光伏产业指数收益率
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。

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	许俊
	联系电话	021-38601777	010-66594319
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	fcid@bankofchina.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	证券日报
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 弄上海证大五道口广场 1 号 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(2021年1月1日 - 2021年6月30日)
本期已实现收益	729,327,474.75
本期利润	1,513,886,138.04
加权平均基金份额本期利润	0.1730
本期加权平均净值利润率	15.36%
本期基金份额净值增长率	19.09%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)
期末可供分配利润	615,023,499.88
期末可供分配基金份额利润	0.1134
期末基金资产净值	7,342,419,067.24
期末基金份额净值	1.3536
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)
基金份额累计净值增长率	35.36%

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、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。

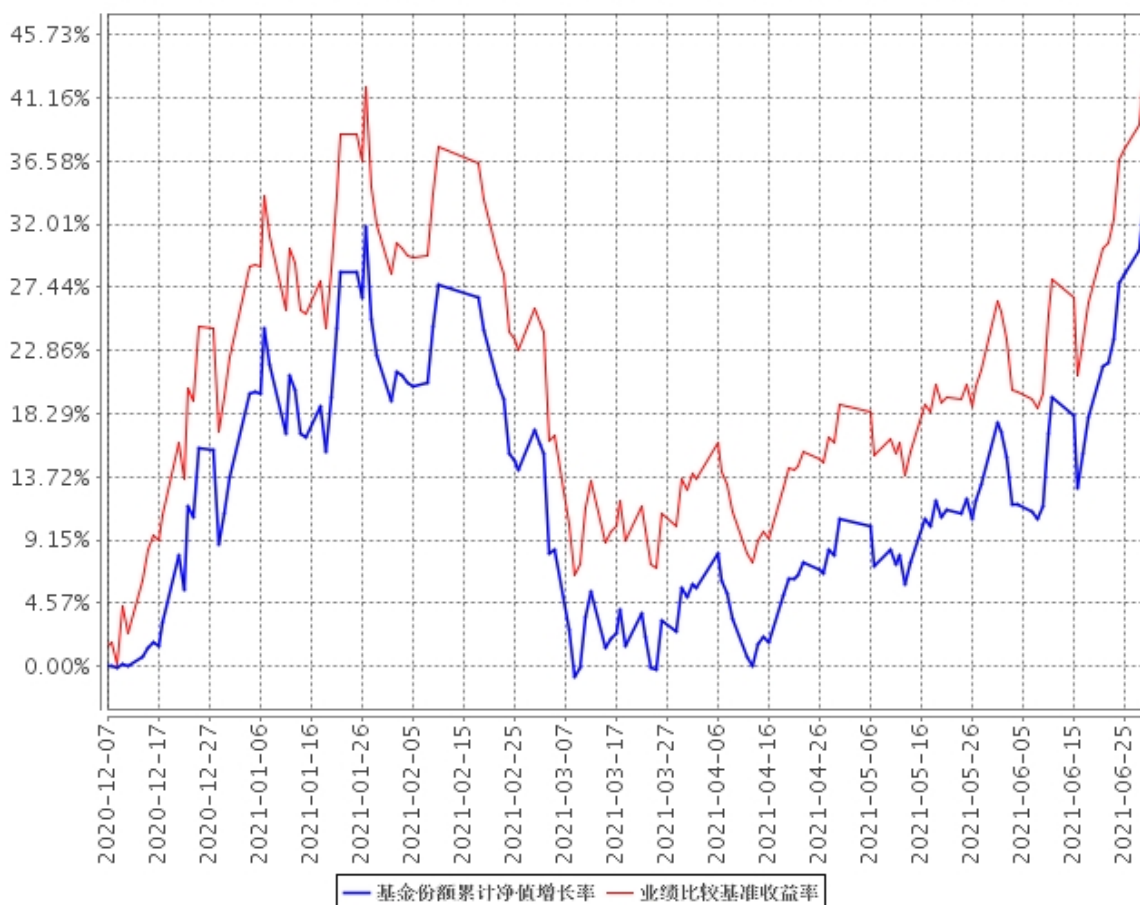
3.2 基金净值表现

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	15.04%	2.16%	14.66%	2.16%	0.38%	0.00%
过去三个月	28.94%	1.78%	28.43%	1.78%	0.51%	0.00%
过去六个月	19.09%	2.26%	18.48%	2.28%	0.61%	-0.02%
自基金合同生效起至今	35.36%	2.31%	44.90%	2.38%	-9.54%	-0.07%

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、图示日期为 2020 年 12 月 7 日至 2021 年 6 月 30 日。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期，截至报告期末本基金的各项投资比例已达到基金合同投资范围中规定的比例。

3、自基金合同生效起至本报告期末不满一年。

§4 管理人报告

4.1 基金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、华泰柏瑞质量精选混合型证券投资基金、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。截至 2021 年 6 月 30 日，公司基金管理规模为 2174.24 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	2020 年 12 月 7 日	-	6 年	曾任职于上海市虹口区金融服务局。2015 年 3 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任指数投资部助理研究员、研究员。

					<p>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。</p>
李沐阳	本基金的基金经理	2021 年 1 月 5 日	-	3 年	<p>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。</p>

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。任职日期和离任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% 的同日反向交易共 4 次。系被动跟踪标的指数需要，不存在利益输送行为。

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

2021 年上半年市场以结构性机会为主。其中电气设备、钢铁、化工等行业录得正收益，期间电气设备行业指数上涨达 23.83%，钢铁行业指数上涨达 23.62%。整体来看，沪深 300、中证 500、中证 1000 和创业板涨跌幅分别为 0.24%、6.93%、6.58%、和 17.22%。从市场风格来看，成长风格

表现相对强势，优于价值风格，期间沪深 300 价值指数和沪深 300 成长指数分别涨幅为 0.28% 和 4.78%。

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 0.019%，期间日跟踪误差为 0.027%，较好地实现了本基金的投资目标。

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 1.3536 元；本报告期基金份额净值增长率为 19.09%，业绩比较基准收益率为 18.48%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

二季度的全球股票市场摆脱了之前两个季度的高一致性，即周期股持续跑赢成长风格。期间各类市场风格此起彼伏，驱动市场风格在成长和价值间反复徘徊。年初以来以宏观流动性边际收紧，很多投资者担心高估值板块承压，然而我们发现，上半年 A 股表现分化加剧，高估值板块涨幅反而更大，无论是从细分行业还是概念指数，年初以来涨幅较高的板块大都处于相对较高的估值水平。原因还是在于投资者风险偏好高，愿意为高景气板块给予更高估值。

新冠疫情后中国经济增速或逐渐向新平台回归。外需层面上来看，全球复苏的主线逐渐从商品转向服务，可能意味着对全球、中国商品贸易的溢出效应下降。内需层面上来看，基建的支撑作用消退，政策严控下地产可能也面临逐渐降温，而消费虽然仍有缺口，受限于居民消费意愿回升较慢。随着经济波动的下降，政策的关注重点也转向中长期问题。而从长期来看，在存量债务压力下，政策重心从控制新增债务转向存量债务的维系问题，从这个角度来看，央行的货币政策或“易松难紧”。展望下半年，A 股市场或将伴随国内货币政策防范化解金融风险、保供稳价和碳中和等政策的方向不断小幅微调。结构上看，A 股分化趋势还将继续延续，建议成长和价值均衡配置。

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。

4.6 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，当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，可进行收益分配；在符合有关基金收益分配条件的前提下，本基金收益每年最多分配 4 次，每次基金收益分配数额由基金管理人根据实际情况确定。本报告期内，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

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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在华泰柏瑞中证光伏产业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”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：华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2021年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	96,985,984.75	376,987,827.10
结算备付金		7,315,410.88	158,333.33
存出保证金		6,897,886.03	-
交易性金融资产	6.4.7.2	7,306,957,089.18	9,599,281,253.05
其中：股票投资		7,306,957,089.18	9,599,281,253.05
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		21,855,458.35	33,567,837.22
应收利息	6.4.7.5	60,334.18	20,005.77
应收股利		41,528.00	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	75,616.24	-
资产总计		7,440,189,307.61	10,010,015,256.47
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		878.34	7,705.29
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		5,269,477.52	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		3,454,396.90	1,242,504.94
应付托管费		690,879.39	248,500.97
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	6,171,018.96	6,187,977.53
应交税费		36.35	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	82,183,552.91	326,715,199.56
负债合计		97,770,240.37	334,401,888.29
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	5,424,494,000.00	8,512,494,000.00
未分配利润	6.4.7.10	1,917,925,067.24	1,163,119,368.18
所有者权益合计		7,342,419,067.24	9,675,613,368.18
负债和所有者权益总计		7,440,189,307.61	10,010,015,256.47

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.3536 元，基金份额总额 5,424,494,000.00 份。

6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、收入		1,577,434,766.61
1.利息收入		532,794.42
其中：存款利息收入	6.4.7.11	481,577.34
债券利息收入		5,342.94
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		45,874.14
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		746,774,967.52
其中：股票投资收益	6.4.7.12	713,628,165.93
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	787,571.17
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	32,359,230.42
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	784,558,663.29
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	45,568,341.38

列)		
减：二、费用		63,548,628.57
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	24,459,262.96
2. 托管费	6.4.10.2.2	4,891,852.59
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
4. 交易费用	6.4.7.19	32,477,360.57
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		19.20
7. 其他费用	6.4.7.20	1,720,133.25
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,513,886,138.04
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,513,886,138.04

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021年1月1日至2021年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	8,512,494,000.00	1,163,119,368.18	9,675,613,368.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,513,886,138.04	1,513,886,138.04
三、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）	-3,088,000,000.00	-759,080,438.98	-3,847,080,438.98
其中：1. 基金申购款	14,664,000,000.00	2,378,196,958.92	17,042,196,958.92
2. 基金赎回款	-17,752,000,000.00	-3,137,277,397.90	-20,889,277,397.90
四、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）	-	-	-

五、期末所有者权益（基金净值）	5,424,494,000.00	1,917,925,067.24	7,342,419,067.24
-----------------	------------------	------------------	------------------

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

华泰柏瑞中证光伏产业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”)证监许可[2020]3012号《关于准予华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》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《华泰柏瑞中证光伏产业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1,718,494,000.00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(2020)第1048号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于2020年12月7日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,718,494,000.00份基金份额,无认购资金利息折合基金份额。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。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2020]409号文审核同意,本基金1,718,494,000.00份基金份额于2020年12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《华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。此外,为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于部分非成份股(包括中小板、创业板以及其他经中国证监会核准发行的股票)、存托凭证、债券(包括国债、金融债、企业/公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、权证、股指期货、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金将根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。本基金投资标的指数成份股、备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%,且不低于基金非现金资产的80%。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0.2%,年跟踪误差不超过

2%。本基金的业绩比较基准为中证光伏产业指数。

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 2021 年 8 月 28 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》、《华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 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 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 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 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变

动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金在投资人申购、赎回过程中而待与投资人结算的可退替代款分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，在资产负债表中以交易性金融负债列示。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基

基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

本基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司(以下简称“证金公司”)出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息确认为利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配；基金管理人每季度定期对基金相对标的指数的超额收益率进行一次评估，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，方可对超额收益进行分配；本基金的收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使还原后基金份额净值低于面值。基金收益分配比例为收益评价日符合上述分红条件的基金超额收益的 100%，基金收益分配每年至多 4 次。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 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。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(2) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

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

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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。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非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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 2021年6月30日
活期存款	96,985,984.75
定期存款	-
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	-
合计：	96,985,984.75

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	6,094,369,425.82	7,306,957,089.18	1,212,587,663.36
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	6,094,369,425.82	7,306,957,089.18	1,212,587,663.36

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

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：本基金本报告期末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：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应收活期存款利息	8,069.36
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	3,286.58
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	45,874.14
其他	3,104.10
合计	60,334.18

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
其他应收款	-
待摊费用	75,616.24
合计	75,616.24

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	6,171,018.96

银行间市场应付交易费用	-
合计	6,171,018.96

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021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	-
预提费用	144,299.92
应付指数使用费	1,467,555.86
应付替代款	80,571,697.13
合计	82,183,552.91

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	8,512,494,000.00	8,512,494,000.00
本期申购	14,664,000,000.00	14,664,000,000.00
本期赎回(以“-”号填列)	-17,752,000,000.00	-17,752,000,000.00
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	5,424,494,000.00	5,424,494,000.00

注：投资者申购和赎回的基金份额需为最小申购赎回单位的整数倍。

6.4.7.10 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
上年度末	108,228,062.01	1,054,891,306.17	1,163,119,368.18
本期利润	729,327,474.75	784,558,663.29	1,513,886,138.04
本期基金份额交易产生的变动数	-222,532,036.88	-536,548,402.10	-759,080,438.98
其中：基金申购款	1,007,422,970.44	1,370,773,988.48	2,378,196,958.92

基金赎回款	-1,229,955,007.32	-1,907,322,390.58	-3,137,277,397.90
本期已分配利润	-	-	-
本期末	615,023,499.88	1,302,901,567.36	1,917,925,067.24

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	180,486.94
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	255,288.83
其他	45,801.57
合计	481,577.34

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	439,212,937.85
股票投资收益——赎回差价收入	274,415,228.08
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	713,628,165.93

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	11,450,525,389.57
减：卖出股票成本总额	11,011,312,451.72
买卖股票差价收入	439,212,937.85

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
赎回基金份额对价总额	20,889,277,397.90
减：现金支付赎回款总额	10,405,842,799.90
减：赎回股票成本总额	10,209,019,369.92
赎回差价收入	274,415,228.08

6.4.7.12.4 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。

6.4.7.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内无证券出借差价收入。

6.4.7.13 债券投资收益**6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	787,571.17
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	787,571.17

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	11,771,502.70
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	10,980,000.00
减：应收利息总额	3,931.53
买卖债券差价收入	787,571.17

6.4.7.13.3 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。

6.4.7.13.4 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。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益**6.4.7.14.1 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。

6.4.7.14.2 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。

6.4.7.14.3 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。

6.4.7.14.4 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。

6.4.7.15 衍生工具收益**6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期内无买卖权证差价收入。

6.4.7.15.2 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。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	32,359,230.42
其中：证券出借权益补偿收入	41,528.00
基金投资产生的股利收益	-
合计	32,359,230.42

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	784,558,663.29
——股票投资	784,558,663.29
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——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	784,558,663.29

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	-
其他收入	1,913.92
替代损益	45,566,427.46
合计	45,568,341.38

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	32,477,360.57
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-

合计	32,477,360.57
----	---------------

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	74,383.76
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
注册登记费（中登上海）	74,383.76
银行划款手续费	34,385.51
IOPV 计算发布费	9,916.99
指数使用费	1,467,555.86
合计	1,720,133.25

6.4.7.21 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

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

截至报告日，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
中国银行股份有限公司	基金托管人
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：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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 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
华泰证券	132,979,629.09	0.63%

6.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

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 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
华泰证券	121,183.73	0.63%	121,183.73	1.96%

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 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	24,459,262.96
其中：支付销售机构的客户维护费	424,851.09

注：支付基金管理人华泰柏瑞基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.50% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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	4,891,852.59

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.10% / 当年天数。

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：本基金本期未发生与关联方进行的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**

单位：人民币元

本期 2021年1月1日至2021年6月30日

关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
华泰证券	112,143,388.00	24,198.09	115,568,093.00	24,198.09

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

单位：人民币元

本期 2021年1月1日至2021年6月30日										
关联方名称	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量 (单位:张)	出借期限 (单位:天)	费率	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
华泰证券	2021062300000992	先导智能	2021-06-23	1,005,651.00	17,100	14	3.40%	666.89	1,028,394.00	666.89
华泰证券	2021062300001052	晶盛机电	2021-06-23	496,080.00	10,400	14	3.40%	330.05	525,200.00	330.05
华泰证券	2021062300001088	东方日升	2021-06-23	185,400.00	12,000	14	3.40%	124.25	232,800.00	124.25
华泰证券	2021062300001090	阳光电源	2021-06-23	1,958,985.00	18,900	14	3.40%	1,280.72	2,174,634.00	1,280.72
华泰证券	2021062400000686	先导智能	2021-06-24	13,509,600.00	240,000	14	3.40%	7,615.98	14,433,600.00	7,615.98
华泰证券	2021062400000688	阳光电源	2021-06-24	9,615,600.00	90,000	14	3.40%	5,452.44	10,355,400.00	5,452.44

华泰 证 券 券	20210625000 00482	东 方 日 升	2021-06 -25	11,017,26 0.00	631, 000	14	3.4 0%	5,229 .40	12,241,40 0.00	5,229 .40
-------------------	----------------------	------------------	----------------	-------------------	-------------	----	-----------	--------------	-------------------	--------------

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，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 2021年6月30日		上年度末 2020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
华泰证券股份 有限公司	357,200.00	0.0066%	0.00	0.0000%

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 2021年1月1日至2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	96,985,984.75	180,486.94

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

关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
				基金在承销期内买入	
				数量（单位：份）	总金额
华泰联合证 券有限责任 公司	688656	浩欧博	网下申购	1,371	48,341.46

华泰联合证 券有限责任 公司	688350	富淼科技	网下申购	2,552	34,656.16
华泰联合证 券有限责任 公司	300952	恒辉安防	网下申购	3,398	39,824.56
华泰联合证 券有限责任 公司	688083	中望软件	网下申购	1,837	276,468.50
华泰联合证 券有限责任 公司	605389	长龄液压	网下申购	356	14,026.40
华泰联合证 券有限责任 公司	688097	博众精工	网下申购	3,983	44,888.41
华泰联合证 券有限责任 公司	688314	康拓医疗	网下申购	1,085	18,813.90
华泰联合证 券有限责任 公司	600905	三峡能源	网上申购	33,000	87,450.00
华泰联合证 券有限责任 公司	688613	奥精医疗	网下申购	2,617	42,997.31
华泰联合证 券有限责任 公司	605499	东鹏饮料	网下申购	632	29,242.64
华泰联合证 券有限责任 公司	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

注：本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本报告期内本基金未实行利润分配。

6.4.12 期末（2021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	可流通日	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
301018	申菱环境	2021年6月28日	2021年7月7日	新股未上市	8.29	8.29	7,811	64,753.19	64,753.19	-
688239	航宇科技	2021年6月25日	2021年7月5日	新股未上市	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48	-
688087	英科再生	2021年6月30日	2021年7月9日	新股未上市	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
301017	漱玉平民	2021年6月23日	2021年7月5日	新股未上市	8.86	8.86	5,550	49,173.00	49,173.00	-
301020	密封科技	2021年6月28日	2021年7月6日	新股未上市	10.64	10.64	4,210	44,794.40	44,794.40	-
301021	英诺激光	2021年6月28日	2021年7月6日	新股未上市	9.46	9.46	2,899	27,424.54	27,424.54	-
688226	威腾电气	2021年6月28日	2021年7月7日	新股未上市	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
605287	德才股份	2021年6月28日	2021年7月6日	新股未上市	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
605162	新中港	2021年6月29日	2021年7月7日	新股未上市	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
688161	威高骨科	2021年6月23日	2021年12月30日	新股锁定期内	36.22	82.27	3,069	111,159.18	252,486.63	-
688076	诺泰生物	2021年5月	2021年11	新股锁定期内	15.57	48.55	4,984	77,600.88	241,973.20	-

		12 日	月 22 日								
300957	贝泰妮	2021 年 3 月 18 日	2021 年 9 月 27 日	新股锁定期内	47.33	251.96	853	40,372.49	214,921.88		-
688613	奥精医疗	2021 年 5 月 13 日	2021 年 11 月 22 日	新股锁定期内	16.43	63.50	2,617	42,997.31	166,179.50		-
688609	九联科技	2021 年 3 月 15 日	2021 年 9 月 23 日	新股锁定期内	3.99	15.29	10,372	41,384.28	158,587.88		-
300979	华利集团	2021 年 4 月 15 日	2021 年 10 月 26 日	新股锁定期内	33.22	87.50	925	30,728.50	80,937.50		-
300981	中红医疗	2021 年 4 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	新股锁定期内	48.59	90.39	601	29,202.59	54,324.39		-
300973	立高食品	2021 年 4 月 8 日	2021 年 10 月 15 日	新股锁定期内	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60		-
688565	力源科技	2021 年 5 月 6 日	2021 年 11 月 15 日	新股锁定期内	9.39	14.00	2,464	23,136.96	34,496.00		-
301009	可靠股份	2021 年 6 月 8 日	2021 年 12 月 17 日	新股锁定期内	12.54	27.89	801	10,044.54	22,339.89		-
300941	创识科技	2021 年 2 月 2 日	2021 年 8 月 9 日	新股锁定期内	21.31	49.94	399	8,502.69	19,926.06		-
301015	百洋医药	2021 年 6 月 22 日	2021 年 12 月 30 日	新股锁定期内	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46		-
300932	三友联众	2021 年 1 月	2021 年 7	新股锁定期内	24.69	31.71	492	12,147.48	15,601.32		-

		15 日	月 22 日							
300982	苏文电能	2021 年 4 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	新股锁定期内	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300968	格林精密	2021 年 4 月 6 日	2021 年 10 月 15 日	新股锁定期内	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-
300940	南极光	2021 年 1 月 27 日	2021 年 8 月 3 日	新股锁定期内	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-
300614	百川畅银	2021 年 5 月 18 日	2021 年 11 月 25 日	新股锁定期内	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300937	药易购	2021 年 1 月 20 日	2021 年 7 月 27 日	新股锁定期内	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
301013	利和兴	2021 年 6 月 21 日	2021 年 12 月 29 日	新股锁定期内	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81	-
300942	易瑞生物	2021 年 2 月 2 日	2021 年 8 月 9 日	新股锁定期内	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300997	欢乐家	2021 年 5 月 26 日	2021 年 12 月 2 日	新股锁定期内	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
300933	中辰股份	2021 年 1 月 15 日	2021 年 7 月 22 日	新股锁定期内	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
301002	崧盛股份	2021 年 5 月 27 日	2021 年 12 月 7 日	新股锁定期内	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
300956	英力股份	2021 年 3 月	2021 年 9	新股锁定期内	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-

		16日	月27日							
300962	中金辐照	2021年3月29日	2021年10月11日	新股锁定期内	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300952	恒辉安防	2021年3月3日	2021年9月13日	新股锁定期内	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-
300966	共同药业	2021年3月31日	2021年10月11日	新股锁定期内	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300945	曼卡龙	2021年2月3日	2021年8月10日	新股锁定期内	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中生态	2021年2月18日	2021年8月25日	新股锁定期内	13.00	27.42	324	2,808.00	8,884.08	-
300931	通用电梯	2021年1月13日	2021年7月21日	新股锁定期内	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300961	深水海纳	2021年3月23日	2021年9月30日	新股锁定期内	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300950	德固特	2021年2月24日	2021年9月3日	新股锁定期内	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
300986	志特新材	2021年4月21日	2021年11月1日	新股锁定期内	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300987	川网传媒	2021年4月28日	2021年11月11日	新股锁定期内	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300978	东箭科技	2021年4月	2021年10	新股锁定期内	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-

		15 日	月 26 日							
300926	博俊科技	2021 年 1 月 7 日	2021 年 7 月 7 日	新股锁定期内	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
300930	屹通新材	2021 年 1 月 13 日	2021 年 7 月 21 日	新股锁定期内	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-
300985	致远新能	2021 年 4 月 21 日	2021 年 10 月 29 日	新股锁定期内	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	-
300991	创益通	2021 年 5 月 12 日	2021 年 11 月 22 日	新股锁定期内	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300963	中洲特材	2021 年 3 月 30 日	2021 年 10 月 11 日	新股锁定期内	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-
301011	华立科技	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 17 日	新股锁定期内	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
300929	华骐环保	2021 年 1 月 12 日	2021 年 7 月 20 日	新股锁定期内	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
300995	奇德新材	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 26 日	新股锁定期内	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
301007	德迈仕	2021 年 6 月 4 日	2021 年 12 月 16 日	新股锁定期内	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
300998	宁波方正	2021 年 5 月 25 日	2021 年 12 月 2 日	新股锁定期内	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
300992	泰福泵业	2021 年 5 月	2021 年 11 月	新股锁定期内	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-

		17 日	月 25 日							
--	--	------	-----------	--	--	--	--	--	--	--

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，锁定期限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：本基金本报告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

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。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

合约编号	证券代码	证券名称	成交时间	出借到期日	期末估值单价	数量(单位:张)	期末估值总额
2021062300000992	300450	先导智能	2021-06-23	2021年7月7日	60.14	17,100	1,028,394.00
2021062300001052	300316	晶盛机电	2021-06-23	2021年7月7日	50.50	10,400	525,200.00
2021062300001088	300118	东方日升	2021-06-23	2021年7月7日	19.40	12,000	232,800.00
2021062300001090	300274	阳光电源	2021-06-23	2021年7月7日	115.06	18,900	2,174,634.00
2021062300002735	000012	南玻A	2021-06-23	2021年7月7日	10.24	22,700	232,448.00
2021062300002823	000040	东旭蓝天	2021-06-23	2021年7月7日	2.81	16,700	46,927.00
2021062300003215	000591	太阳能	2021-06-23	2021年7月7日	6.23	36,700	228,641.00
2021062300003646	000875	吉电股份	2021-06-23	2021年7月7日	5.74	28,800	165,312.00
2021062300004101	002056	横店东磁	2021-06-23	2021年7月7日	13.00	13,800	179,400.00
2021062300004297	002129	中	2021-06-23	2021	38.60	29,800	1,150,280.00

		环股份		年 7 月 7 日			
2021062300005131	002506	协鑫集成	2021-06-23	2021 年 7 月 7 日	3.48	58,800	204,624.00
2021062300005159	002518	科士达	2021-06-23	2021 年 7 月 7 日	14.37	10,000	143,700.00
2021062300005265	002610	爱康科技	2021-06-23	2021 年 7 月 7 日	2.38	74,800	178,024.00
2021062300005271	002617	露笑科技	2021-06-23	2021 年 7 月 7 日	13.48	14,300	192,764.00
2021062300005812	601012	隆基股份	2021-06-23	2021 年 7 月 7 日	88.84	16,100	1,430,324.00
2021062300005917	600438	通威股份	2021-06-23	2021 年 7 月 7 日	43.27	43,100	1,864,937.00
2021062300005940	600151	航天机电	2021-06-23	2021 年 7 月 7 日	9.80	15,900	155,820.00
2021062300005981	603185	上机数控	2021-06-23	2021 年 7 月 7 日	178.95	10,000	1,789,500.00
2021062300006705	600537	亿晶光电	2021-06-23	2021 年 7 月 7 日	4.45	13,800	61,410.00
2021062300006828	601222	林洋能源	2021-06-23	2021 年 7 月 7 日	8.29	17,300	143,417.00
2021062300007547	600089	特	2021-06-23	2021	12.85	63,100	810,835.00

		变 电 工		年 7 月 7 日			
2021062300007828	601877	正 泰 电 器	2021-06-23	2021 年 7 月 7 日	33.38	18,500	617,530.00
2021062300007952	603806	福 斯 特	2021-06-23	2021 年 7 月 7 日	105.13	10,000	1,051,300.00
2021062300008119	601865	福 莱 特	2021-06-23	2021 年 7 月 7 日	39.53	10,000	395,300.00
2021062300008205	600770	综 艺 股 份	2021-06-23	2021 年 7 月 7 日	6.23	12,600	78,498.00
2021062400000686	300450	先 导 智 能	2021-06-24	2021 年 7 月 8 日	60.14	240,000	14,433,600.00
2021062400000688	300274	阳 光 电 源	2021-06-24	2021 年 7 月 8 日	115.06	90,000	10,355,400.00
2021062400001516	000875	吉 电 股 份	2021-06-24	2021 年 7 月 8 日	5.74	250,000	1,435,000.00
2021062400001675	002129	中 环 股 份	2021-06-24	2021 年 7 月 8 日	38.60	27,100	1,046,060.00
2021062400001924	002610	爱 康 科 技	2021-06-24	2021 年 7 月 8 日	2.38	840,000	1,999,200.00
2021062400002042	600438	通 威 股 份	2021-06-24	2021 年 7 月 8 日	43.27	220,000	9,519,400.00
2021062400002516	603806	福	2021-06-24	2021	105.13	82,000	8,620,660.00

		斯特		年 7 月 8 日			
202106250000482	300118	东方日升	2021-06-25	2021 年 7 月 9 日	19.40	631,000	12,241,400.00
2021062500001033	000012	南玻 A	2021-06-25	2021 年 7 月 9 日	10.24	1,000,000	10,240,000.00
2021062500001057	000012	南玻 A	2021-06-25	2021 年 7 月 9 日	10.24	183,300	1,876,992.00
2021062500001118	000591	太阳能	2021-06-25	2021 年 7 月 9 日	6.23	812,300	5,060,629.00
2021062500001121	000591	太阳能	2021-06-25	2021 年 7 月 9 日	6.23	1,000,000	6,230,000.00
2021062500001464	002617	露笑科技	2021-06-25	2021 年 7 月 9 日	13.48	826,700	11,143,916.00
2021062500001541	600438	通威股份	2021-06-25	2021 年 7 月 9 日	43.27	40,600	1,756,762.00
2021062500001578	603185	上机数控	2021-06-25	2021 年 7 月 9 日	178.95	61,600	11,023,320.00
2021062500001653	603806	福斯特	2021-06-25	2021 年 7 月 23 日	105.13	45,000	4,730,850.00
2021062500001930	601865	福莱特	2021-06-25	2021 年 7 月 9 日	39.53	202,000	7,985,060.00
2021062800001379	603806	福	2021-06-28	2021	105.13	20,000	2,102,600.00

		斯特		年 7 月 26 日			
2021062800001520	603806	福斯特	2021-06-28	2021 年 7 月 12 日	105.13	20,000	2,102,600.00
2021062900001803	002079	苏州固锔	2021-06-29	2021 年 7 月 13 日	12.60	500,000	6,300,000.00
2021062900002429	600438	通威股份	2021-06-29	2021 年 7 月 13 日	43.27	30,300	1,311,081.00
2021062900003149	603806	福斯特	2021-06-29	2021 年 7 月 13 日	105.13	55,000	5,782,150.00
2021062900003229	601908	京运通	2021-06-29	2021 年 7 月 13 日	9.60	1,000,000	9,600,000.00
2021062900003250	601908	京运通	2021-06-29	2021 年 7 月 13 日	9.60	500,000	4,800,000.00
2021063000001046	000012	南玻 A	2021-06-30	2021 年 7 月 14 日	10.24	800,000	8,192,000.00
2021063000001333	600438	通威股份	2021-06-30	2021 年 7 月 14 日	43.27	28,600	1,237,522.00
2021063000001612	603806	福斯特	2021-06-30	2021 年 7 月 14 日	105.13	10,000	1,051,300.00
合计						10,110,700	177,259,521.00

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，本基金以非约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限

公司出借证券，本基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近 1 年的分类结果为 A 类，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 2021 年 6 月 30 日，本基金无债券投资(2020 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 2021 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 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

6.4.13.3.2 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 2021 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 0.12%。

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 2021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	96,985,984.75	-	-	-	-	-	96,985,984.75
结算备付金	7,315,410.88	-	-	-	-	-	7,315,410.88
存出保证金	6,897,886.03	-	-	-	-	-	6,897,886.03
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-7,306,957,089.18	7,306,957,089.18
应收证券清算款	-	-	-	-	-	21,855,458.35	21,855,458.35
应收利息	-	-	-	-	-	60,334.18	60,334.18
应收股利	-	-	-	-	-	41,528.00	41,528.00
其他资产	-	-	-	-	-	75,616.24	75,616.24
资产总计	111,199,281.66	-	-	-	-	-7,328,990,025.95	7,440,189,307.61
负债							
交易性金融负债	-	-	-	-	-	878.34	878.34
应付证券清算款	-	-	-	-	-	5,269,477.52	5,269,477.52
应付管理人报	-	-	-	-	-	3,454,396.90	3,454,396.90

酬							
应付托管费	-	-	-	-	-	690,879.39	690,879.39
应付交易费用	-	-	-	-	-	6,171,018.96	6,171,018.96
应交税费	-	-	-	-	-	36.35	36.35
其他负债	-	-	-	-	-	82,183,552.91	82,183,552.91
负债总计	-	-	-	-	-	97,770,240.37	97,770,240.37
利率敏感度缺口	111,199,281.66	-	-	-	-	-7,231,219,785.58	7,342,419,067.24
上年度末 2020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	376,987,827.10	-	-	-	-	-	376,987,827.10
结算备付金	158,333.33	-	-	-	-	-	158,333.33
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-9,599,281,253.05	9,599,281,253.05
应收证券清算款	-	-	-	-	-	33,567,837.22	33,567,837.22
应收利息	-	-	-	-	-	20,005.77	20,005.77
资产总计	377,146,160.43	-	-	-	-	-9,632,869,096.04	10,010,015,256.47
负债							
交易性金融负债	-	-	-	-	-	7,705.29	7,705.29
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,242,504.94	1,242,504.94
应付托管费	-	-	-	-	-	248,500.97	248,500.97
应付交易费用	-	-	-	-	-	6,187,977.53	6,187,977.53
其他负债	-	-	-	-	-	326,715,199.56	326,715,199.56
负债总计	-	-	-	-	-	334,401,888.29	334,401,888.29
利率敏感度缺口	377,146,160.43	-	-	-	-	-9,298,467,207.75	9,675,613,368.18

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2021年6月30日，本基金未持有交易性债券投资（2020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（2020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 90%，且不低于基金非现金资产的 80%。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 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	7,306,957,089.18	99.52	9,599,281,253.05	99.21
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
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	7,306,957,089.18	99.52	9,599,281,253.05	99.21

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证光伏产业指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	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（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
	中证光伏产业指数上升 5%	363,291,501.11	480,703,741.20
中证光伏产业指数下降 5%	-363,291,501.11	-480,703,741.20	

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无。

6.4.14 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	7,306,957,089.18	98.21
	其中：股票	7,306,957,089.18	98.21
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	104,301,395.63	1.40
8	其他各项资产	28,930,822.80	0.39
9	合计	7,440,189,307.61	100.00

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

报告期末，本基金参与转融通证券出借业务出借股票的公允价值为 177,259,521.00 元，占本基金期末资产净值的 2.41%。其中，报告期内本基金与关联方进行转融通证券出借业务的证券 81107 手，报告期末本基金与关联方进行转融通证券出借业务的余额为 156,559,521.00 元。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	6,955,198,038.98	94.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	255,332,887.59	3.48
E	建筑业	25,371.37	0.00
F	批发和零售业	89,166.82	0.00
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	40,226.27	0.00
J	金融业	34,721.10	0.00
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	58,388,434.72	0.80
N	水利、环境和公共设施管理业	70,768.33	0.00
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	37,777,474.00	0.51
	合计	7,306,957,089.18	99.52

注：上述股票投资组合不包括可退替代款估值增值。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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

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	占基金资产净值比例（%）
1	300274	阳光电源	7,212,352	829,853,221.12	11.30
2	601012	隆基股份	8,915,748	792,075,052.32	10.79
3	600438	通威股份	17,142,348	741,749,397.96	10.10
4	002129	中环股份	16,436,245	634,439,057.00	8.64
5	300450	先导智能	7,733,481	465,091,547.34	6.33
6	600089	特变电工	28,823,698	370,384,519.30	5.04
7	603806	福斯特	2,838,022	298,361,252.86	4.06
8	601877	正泰电器	8,347,504	278,639,683.52	3.79
9	300316	晶盛机电	5,004,177	252,710,938.50	3.44
10	300751	迈为股份	434,346	197,497,126.20	2.69
11	300724	捷佳伟创	1,609,778	186,750,345.78	2.54
12	002459	晶澳科技	2,475,194	121,284,506.00	1.65
13	603185	上机数控	668,049	119,547,368.55	1.63
14	000012	南玻A	10,666,037	109,220,218.88	1.49
15	300763	锦浪科技	600,860	108,515,316.00	1.48
16	300118	东方日升	5,571,457	108,086,265.80	1.47
17	601865	福莱特	2,612,205	103,260,463.65	1.41
18	000591	太阳能	16,352,540	101,876,324.20	1.39
19	002617	露笑科技	7,427,500	100,122,700.00	1.36
20	002506	协鑫集成	27,309,900	95,038,452.00	1.29
21	600732	爱旭股份	6,164,900	85,815,408.00	1.17

22	002610	爱康科技	34,848,000	82,938,240.00	1.13
23	002056	横店东磁	6,358,200	82,656,600.00	1.13
24	600151	航天机电	7,780,500	76,248,900.00	1.04
25	000875	吉电股份	13,007,000	74,660,180.00	1.02
26	601908	京运通	7,483,000	71,836,800.00	0.98
27	601222	林洋能源	8,132,400	67,417,596.00	0.92
28	300393	中来股份	5,106,660	63,118,317.60	0.86
29	003035	南网能源	5,874,088	58,388,434.72	0.80
30	300776	帝尔激光	366,565	54,750,148.40	0.75
31	002079	苏州固锔	4,173,221	52,582,584.60	0.72
32	002335	科华恒盛	2,144,300	48,825,711.00	0.66
33	600770	综艺股份	6,063,800	37,777,474.00	0.51
34	601137	博威合金	3,094,202	35,490,496.94	0.48
35	601778	晶科科技	6,436,600	35,143,836.00	0.48
36	002218	拓日新能	5,763,800	34,755,714.00	0.47
37	603063	禾望电气	2,038,500	33,716,790.00	0.46
38	002623	亚玛顿	718,100	30,368,449.00	0.41
39	300391	康跃科技	1,634,500	29,633,485.00	0.40
40	002309	中利集团	4,705,900	29,364,816.00	0.40
41	600537	亿晶光电	6,358,500	28,295,325.00	0.39
42	002518	科士达	1,771,500	25,456,455.00	0.35
43	300080	易成新能	4,810,774	25,208,455.76	0.34
44	000040	东旭蓝天	8,083,500	22,714,635.00	0.31
45	600207	安彩高科	2,672,400	20,924,892.00	0.28
46	300317	珈伟新能	2,574,200	19,306,500.00	0.26
47	600876	洛阳玻璃	958,520	18,298,146.80	0.25
48	603105	芯能科技	1,918,000	17,281,180.00	0.24
49	300842	帝科股份	223,800	15,818,184.00	0.22
50	603212	赛伍技术	360,500	11,640,545.00	0.16
51	688161	威高骨科	3,069	252,486.63	0.00
52	688076	诺泰生物	4,984	241,973.20	0.00
53	300957	贝泰妮	853	214,921.88	0.00
54	688613	奥精医疗	2,617	166,179.50	0.00
55	688609	九联科技	10,372	158,587.88	0.00
56	300979	华利集团	925	80,937.50	0.00
57	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.00
58	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.00
59	300981	中红医疗	601	54,324.39	0.00
60	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00

61	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.00
62	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.00
63	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
64	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
65	688565	力源科技	2,464	34,496.00	0.00
66	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
67	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00
68	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00
69	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
70	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
71	300932	三友联众	492	15,601.32	0.00
72	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
73	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
74	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
75	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
76	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
77	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
78	301013	利和兴	471	12,768.81	0.00
79	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
80	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
81	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
82	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
83	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
84	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
85	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
86	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
87	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
88	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
89	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
90	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
91	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
92	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
93	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
94	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
95	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
96	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
97	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
98	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
99	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00

100	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
101	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
102	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
103	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
104	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
105	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
106	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
107	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
108	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
109	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00

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	300274	阳光电源	1,830,134,669.22	18.91
2	002129	中环股份	1,170,843,980.99	12.10
3	300450	先导智能	1,147,518,323.62	11.86
4	300316	晶盛机电	504,338,152.98	5.21
5	300724	捷佳伟创	488,383,661.89	5.05
6	300751	迈为股份	419,689,928.27	4.34
7	000591	太阳能	306,539,759.39	3.17
8	300118	东方日升	303,231,614.47	3.13
9	002506	协鑫集成	283,889,560.67	2.93
10	002056	横店东磁	260,231,127.66	2.69
11	002610	爱康科技	247,323,879.42	2.56
12	000012	南玻A	204,275,985.87	2.11
13	002617	露笑科技	166,413,476.77	1.72
14	000875	吉电股份	157,092,225.26	1.62
15	300763	锦浪科技	140,923,300.80	1.46
16	002335	科华恒盛	122,175,360.79	1.26
17	002459	晶澳科技	121,643,997.39	1.26
18	300393	中来股份	95,731,812.13	0.99
19	300655	晶瑞股份	92,286,833.19	0.95

20	002623	亚玛顿	87,049,993.75	0.90
----	--------	-----	---------------	------

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	300274	阳光电源	2,377,498,113.06	24.57
2	300450	先导智能	1,429,293,988.33	14.77
3	002129	中环股份	1,380,578,554.98	14.27
4	300316	晶盛机电	638,768,311.50	6.60
5	300724	捷佳伟创	555,311,861.46	5.74
6	300751	迈为股份	488,859,536.67	5.05
7	000591	太阳能	359,933,403.97	3.72
8	300118	东方日升	347,052,447.41	3.59
9	002056	横店东磁	309,463,530.13	3.20
10	002506	协鑫集成	308,867,623.86	3.19
11	002610	爱康科技	288,020,660.20	2.98
12	600522	中天科技	270,527,276.76	2.80
13	000012	南玻A	262,630,158.88	2.71
14	002617	露笑科技	209,638,943.06	2.17
15	000875	吉电股份	196,359,647.54	2.03
16	601727	上海电气	172,955,568.51	1.79
17	300655	晶瑞股份	166,159,797.06	1.72
18	300763	锦浪科技	165,875,551.92	1.71
19	002335	科华恒盛	143,522,759.86	1.48
20	300393	中来股份	112,692,692.00	1.16

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	9,534,696,790.76
卖出股票收入（成交）总额	11,450,525,389.57

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 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。

7.8 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。

7.9 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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

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 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。

7.11.3 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。

7.12 投资组合报告附注**7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明**

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超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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	6,897,886.03
2	应收证券清算款	21,855,458.35
3	应收股利	41,528.00
4	应收利息	60,334.18
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	75,616.24
8	其他	-
9	合计	28,930,822.80

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

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	603806	福斯特	25,441,460.00	0.35	转融通证券出借
2	600438	通威股份	15,689,702.00	0.21	转融通证券出借
3	300450	先导智能	15,461,994.00	0.21	转融通证券出借
4	300274	阳光电源	12,530,034.00	0.17	转融通证券出借
5	2129	中环股份	2,196,340.00	0.03	转融通证券出借
6	601012	隆基股份	1,430,324.00	0.02	转融通证券出借
7	600089	特变电工	810,835.00	0.01	转融通证券出借
8	601877	正泰电器	617,530.00	0.01	转融通证券出借
9	300316	晶盛机电	525,200.00	0.01	转融通证券出借

§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 本基金的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
224,523	24,160.08	1,380,227,649.00	25.44%	4,044,266,351.00	74.56%

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

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	中国平安人寿保险股份有限公司— 万能—一个险万能	200,400,800.00	3.69%
2	中国平安人寿保险股份有限公司— 自有资金	96,525,100.00	1.78%
3	中国平安人寿保险股份有限公司— 分红—团险分红	94,339,600.00	1.74%
4	国信证券股份有限公司	47,107,000.00	0.87%
5	中国平安财产保险股份有限公司— 传统—普通保险产品	42,881,581.00	0.79%
6	南方东英资产管理有限公司—南方 东英华泰柏瑞中证光伏产业 ETF	41,892,300.00	0.77%
7	众安在线财产保险股份有限公司— 自有资金	37,653,600.00	0.69%
8	君龙人寿保险有限公司—自有资金	30,366,200.00	0.56%
9	陈荣枢	28,888,800.00	0.53%
10	中国人寿保险股份有限公司	26,639,000.00	0.49%

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的情况

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（2020 年 12 月 7 日）基金份额总额	1,718,494,000.00
本报告期期初基金份额总额	8,512,494,000.00
本报告期基金总申购份额	14,664,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	17,752,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	5,424,494,000.00

§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

2021年5月19日，经公司董事会批准陈晖女士不再担任公司督察长，刘万方先生担任公司督察长并不再担任公司副总经理。

上述人事变动已按相关规定备案、公告。

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	2	6,272,964,265.91	29.91%	5,716,568.89	29.87%	-
中信证券	2	5,663,160,040.10	27.00%	5,160,843.17	26.97%	-
长江证券	3	5,539,258,569.33	26.41%	5,071,612.98	26.50%	-
中信建投	4	2,997,049,336.30	14.29%	2,731,218.38	14.27%	-
兴业证券	2	354,803,638.10	1.69%	323,333.66	1.69%	-

华泰证券	4	132,979,629.09	0.63%	121,183.73	0.63%	-
东方证券	1	15,637,930.13	0.07%	14,251.09	0.07%	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
申港证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
西藏同信	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
北京高华	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中金财富证 券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	3	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
财富证券	1	-	-	-	-	-

华鑫证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-

注：1、选择代理证券买卖的证券经营机构的标准：

- 1) 资金雄厚，信誉良好。
- 2) 财务状况良好，经营行为规范，最近一年未因重大违规行为而受到有关管理机关的处罚。
- 3) 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) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时、定期、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、上述交易单元均系本报告期内租用。

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	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	11,771,502.70	100.00%	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-

海通证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
西藏同信	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
北京高华	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金财富证 券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-

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	证监会规定报刊和	2021年6月24日

	旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	网站	
2	华泰柏瑞基金管理有限公司关于提醒客户及时更新身份证件及非自然人客户及时登记受益所有人信息的公告	证监会规定报刊和网站	2021年6月22日
3	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	2021年6月3日
4	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参与珠海盈米基金销售有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2021年6月2日
5	华泰柏瑞基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证监会规定报刊和网站	2021年5月21日
6	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	2021年5月20日
7	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	2021年5月14日
8	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	2021年5月12日
9	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	2021年4月30日
10	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参加浙商银行股份有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2021年4月30日
11	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止上海尚善基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	证监会规定报刊和网站	2021年4月27日
12	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参与蚂蚁（杭州）基金销售有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2021年4月20日
13	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第3号指数基金指引》修改基金合同和托管协议的公告	证监会规定报刊和网站	2021年3月27日
14	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	证监会规定报刊和网站	2021年3月5日

	销证券的公告		
15	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	2021年3月4日
16	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	2021年2月27日
17	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金投资范围增加存托凭证并相应修订基金合同和托管协议的公告	证监会规定报刊和网站	2021年2月25日
18	关于终止包商银行股份有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	证监会规定报刊和网站	2021年2月9日
19	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	2021年1月22日
20	华泰柏瑞基金管理有限公司关于网上直销直连招商银行升级签约方式的提示性公告	证监会规定报刊和网站	2021年1月14日
21	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金参加北京增财基金销售有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2021年1月7日
22	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	2021年1月7日
23	华泰柏瑞基金管理有限公司关于聘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基金经理的公告	证监会规定报刊和网站	2021年1月7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

注：无。

§12 备查文件目录

12.1 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

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
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

2021 年 8 月 28 日