

# 上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金

## 2019 年年度报告

2019 年 12 月 31 日

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2020 年 3 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。本年度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 2020 年 3 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。

本年度报告财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 2019 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

|  |           |
|--|-----------|
| <b>§ 1 重要提示及目录</b> .....                     | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示.....                                | 2         |
| 1.2 目录.....                                  | 3         |
| <b>§2 基金简介</b> .....                         | <b>6</b>  |
| 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.....                         | 6         |
| 2.4 信息披露方式.....                              | 7         |
| 2.5 其他相关资料.....                              | 7         |
| <b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....        | <b>8</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                         | 8         |
| 3.2 基金净值表现.....                              | 8         |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况.....                       | 10        |
| <b>§4 管理人报告</b> .....                        | <b>11</b> |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况.....                        | 11        |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....              | 14        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....                 | 14        |
| 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.....             | 15        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....             | 16        |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....                 | 16        |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....                | 17        |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....                 | 17        |
| 4.9 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.....       | 17        |
| <b>§5 托管人报告</b> .....                        | <b>18</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....                  | 18        |
| 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..... | 18        |
| 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....      | 18        |
| <b>§6 审计报告</b> .....                         | <b>19</b> |
| 6.1 审计报告基本信息.....                            | 19        |

|  |           |
|--|-----------|
| 6.2 审计报告的基本内容.....                         | 19        |
| <b>§7 年度财务报表.....</b>                      | <b>22</b> |
| 7.1 资产负债表.....                             | 22        |
| 7.2 利润表.....                               | 23        |
| 7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....                    | 24        |
| 7.4 报表附注.....                              | 25        |
| <b>§8 投资组合报告.....</b>                      | <b>52</b> |
| 8.1 期末基金资产组合情况.....                        | 52        |
| 8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....                    | 52        |
| 8.3 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.....     | 53        |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                   | 65        |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                  | 66        |
| 8.6 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.....    | 66        |
| 8.7 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..... | 66        |
| 8.8 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..... | 66        |
| 8.9 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.....    | 67        |
| 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....             | 67        |
| 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....             | 67        |
| 8.12 投资组合报告附注.....                         | 67        |
| <b>§9 基金份额持有人信息.....</b>                   | <b>69</b> |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....                 | 69        |
| 9.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构.....            | 69        |
| 9.3 期末上市基金前十名持有人.....                      | 69        |
| 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....              | 69        |
| 9.5 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.....     | 69        |
| <b>§10 开放式基金份额变动.....</b>                  | <b>71</b> |
| <b>§ 11 重大事件揭示.....</b>                    | <b>72</b> |
| 11.1 基金份额持有人大会决议.....                      | 72        |
| 11.2 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.....      | 72        |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....           | 72        |

|   |           |
|---|-----------|
| 11.4 基金投资策略的改变 .....                      | 72        |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....               | 72        |
| 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....       | 72        |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....              | 72        |
| 11.8 其他重大事件 .....                         | 73        |
| <b>§12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>            | <b>75</b> |
| 12.1 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 ..... | 75        |
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                 | 76        |
| <b>§13 备查文件目录.....</b>                    | <b>77</b> |
| 13.1 备查文件目录 .....                         | 77        |
| 13.2 存放地点 .....                           | 77        |
| 13.3 查阅方式 .....                           | 77        |

## § 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              |
| 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   | 19,229,161.00 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   | 陈晖                         | 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      | 上海证券报   |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | <a href="http://www.huatai-pb.com">http://www.huatai-pb.com</a> |
| 基金年度报告备置地点          | 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                                   |
|--------|----------------------|--|
| 会计师事务所 | 普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙） | 中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼 |
| 注册登记机构 | 中国证券登记结算有限责任公司       | 北京西城区金融大街 27 号投资广场 22-23 层             |

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

|                      |                |                |                |
|----------------------|----------------|----------------|----------------|
| <b>3.1.1 期间数据和指标</b> | <b>2019 年</b>  | <b>2018 年</b>  | <b>2017 年</b>  |
| 本期已实现收益              | -524,019.92    | 882,428.21     | 1,300,568.06   |
| 本期利润                 | 20,335,902.90  | -18,388,334.49 | 4,881,888.06   |
| 加权平均基金份额本期利润         | 1.0643         | -1.0449        | 0.3231         |
| 本期加权平均净值利润率          | 27.20%         | -27.47%        | 7.84%          |
| 本期基金份额净值增长率          | 32.32%         | -24.63%        | 10.14%         |
| <b>3.1.2 期末数据和指标</b> | <b>2019 年末</b> | <b>2018 年末</b> | <b>2017 年末</b> |
| 期末可供分配利润             | 11,513,288.42  | -8,298,175.36  | 10,168,932.04  |
| 期末可供分配基金份额利润         | 0.5987         | -0.4431        | 0.6079         |
| 期末基金资产净值             | 81,869,546.98  | 60,228,667.48  | 71,378,112.01  |
| 期末基金份额净值             | 4.2576         | 3.2158         | 4.2667         |
| <b>3.1.3 累计期末指标</b>  | <b>2019 年末</b> | <b>2018 年末</b> | <b>2017 年末</b> |
| 基金份额累计净值增长率          | 17.50%         | -11.20%        | 17.76%         |

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。

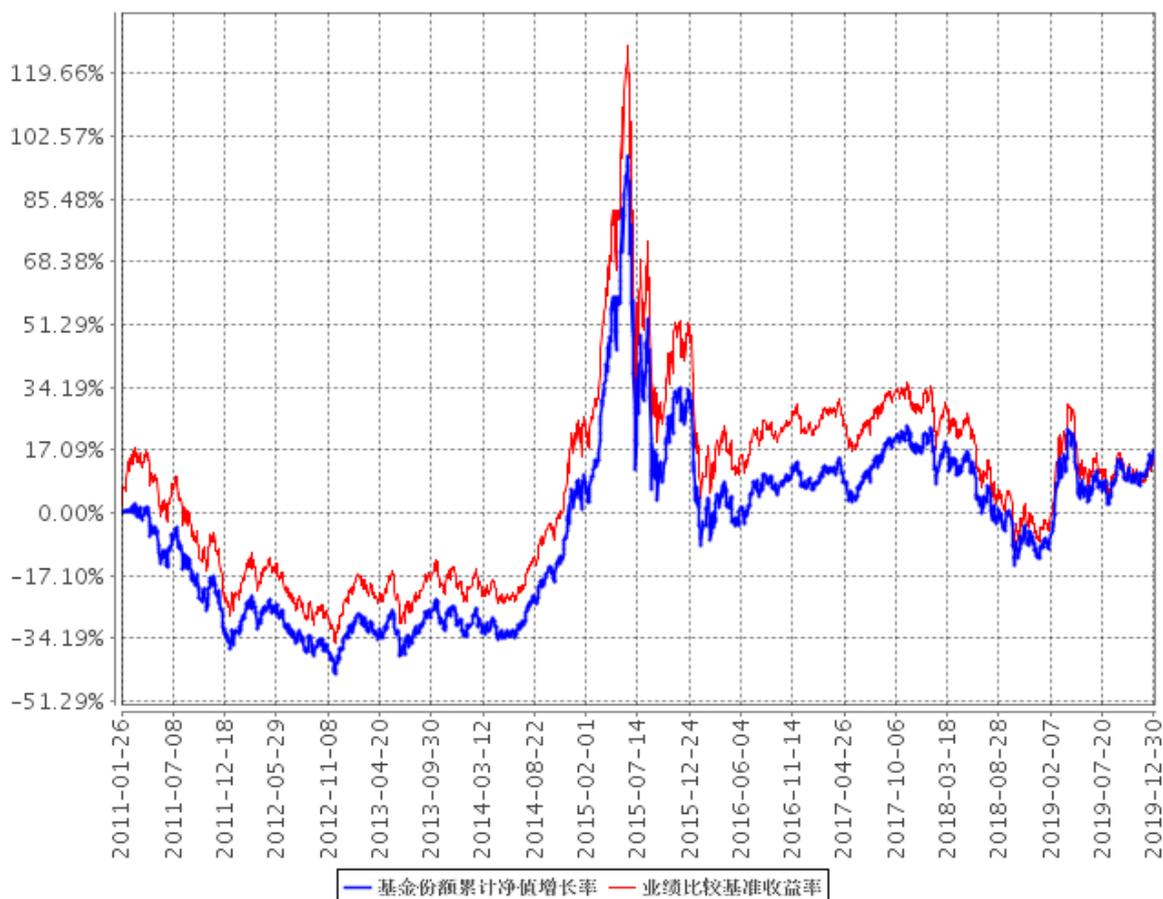
### 3.2 基金净值表现

#### 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    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月      | 7.89%    | 0.80%       | 5.40%      | 0.77%         | 2.49%  | 0.03%  |
| 过去六个月      | 7.70%    | 0.91%       | 2.02%      | 0.90%         | 5.68%  | 0.01%  |
| 过去一年       | 32.32%   | 1.31%       | 23.75%     | 1.32%         | 8.57%  | -0.01% |
| 过去三年       | 9.92%    | 1.15%       | -4.79%     | 1.17%         | 14.71% | -0.02% |
| 过去五年       | 11.48%   | 1.74%       | -4.04%     | 1.73%         | 15.52% | 0.01%  |
| 自基金合同生效起至今 | 17.50%   | 1.57%       | 15.90%     | 1.57%         | 1.60%  | 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

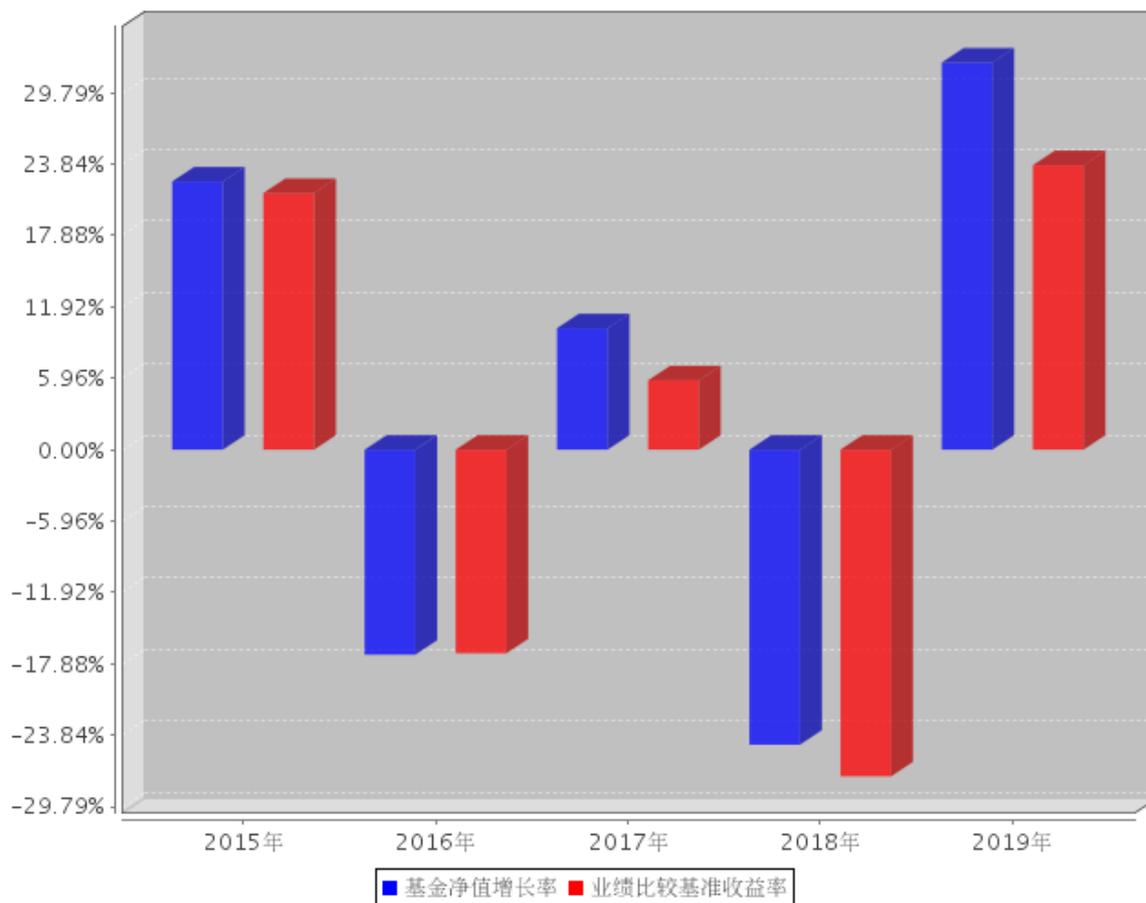
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：图示日期为 2011 年 1 月 26 日至 2019 年 12 月 31 日。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：无。

## § 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、华泰柏瑞丰汇债券型证券投资基金、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、华泰柏瑞国企整合精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞医疗健康混合型证券投资基金、华泰柏瑞现代服务业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、华泰柏瑞核心优势混合型证券投资基金、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。截至 2019 年 12 月 31 日，公司基金管理规模为 1077.13 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）<br>期限 |      | 证券从业<br>年限 | 说明  |
|----|------------------|---------------------|------|------------|---|
|    |                  | 任职日期                | 离任日期 |            |   |
| 柳军 | 指数投资部总监、本基金的基金经理 | 2011 年 1 月 26 日     | -    | 18 年       | 18 年证券(基金)从业经历, 复旦大学财务管理硕士, 2000-2001 年任上海汽车集团财务有限公司财务, 2001-2004 年任华安基金管理有限公司高级基金核算员, 2004 年 7 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司, 历任基金事务部总监、上证红利 ETF 基金经理助理。2009 年 6 月起任华泰柏瑞(原友邦华泰)上证红利交易型开放式指数基金基金经理。2010 年 10 月起担任指数投资部副总监。2011 年 1 月起兼任华泰柏瑞上证中小盘 ETF 基金、华泰柏瑞上证中小盘 ETF 联接基金基金经理。2012 年 5 月起兼任华泰柏瑞沪深 300ETF 基金、华泰柏瑞沪深 300ETF 联接基金基金经理。2015 年 2 月起任指数投资部总监。2015 年 5 月起任华泰柏瑞中证 500 ETF 及华泰柏瑞中证 500ETF |

|     |            |            |             |    |   |
|-----|------------|------------|-------------|----|---|
|     |            |            |             |    | <p>联接基金的基金经理。2018年3月至2018年11月任华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018年3月至2018年10月任华泰柏瑞泰利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018年4月起任华泰柏瑞MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2018年10月起任华泰柏瑞MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2018年12月起任华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019年7月起任华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019年9月起任华泰柏瑞中证科技100交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> |
| 李孝华 | 本基金的基金经理助理 | 2017年11月9日 | 2019年10月11日 | 6年 | <p>南开大学金融学硕士。2013年7月至2014年4月任金瑞期货有限公司贵金属研究员，2014年4月至2015年4月任国泰君安信息技术有限公司量化产品设计师。2015年4月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，任指数投资部研究员。2017年11月起任华泰柏瑞（原友邦华泰）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及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</p>   |

|    |          |            |   |    |   |
|----|----------|------------|---|----|---|
|    |          |            |   |    | 理助理。  |
| 李茜 | 本基金的基金经理 | 2019年11月5日 | - | 4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。 |

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。任职日期和离职日期指基金管理公司作出决定之日。柳军 2020 年 2 月 13 日离任本基金基金经理。

#### 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 公平交易制度和控制方法

报告期内，本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求，建立了科学完善的公平交易管理制度，从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能发生的利益输送。投资部和研究部通过规范的决策流程公平对待不同投资组合。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，对于场内交易的非组合指令启用投资管理系统中的公平交易模块；对于场外交易按照时间优先价格优先的原则公平对待不同帐户。风险管理部对报告期内的交易进行日常监控和分析评估，同时对投资组合的交易价差在不同时间窗（如日内、3 日、5 日）下进行分析，综合判断各基金之间是否存在不公平交易或利益输送的可能，确保公平交易的实施。

##### 4.3.2 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、专户理财和海外投资业务的基金经理不存在兼任其它投资管理部门业务的情况，不同业务类别的投资经理之间互不干扰，独立做出投资决策。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。

### 4.3.3 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。

本报告期公司旗下基金所管理的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

今年全年市场呈现出普涨行情，以电子、食品饮料、家用电器等板块表现靓丽，期间申万电子材料行业指数上涨达 73.77%，申万食品饮料行业指数上涨 72.87%。整体来看，期间沪深 300、中证 500 和中证 1000 分别上涨 36.07%、26.38% 和 25.67%，创业板指受益于科技股结构性行情表现突出，期间上涨 43.79%。从市场风格来看，成长性风格依旧表现强势，表现显著优于价值风格，期间沪深 300 价值指数和沪深 300 成长指数分别录得 24.14% 和 53.94% 的收益，中证 500 成长相对中证 500 价值亦同样获得了显著的超额收益。

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，本基金的累计跟踪偏离为 8.648%，日均绝对跟踪偏离度为 0.042%，期间日跟踪误差为 0.124%，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 4.2576 元；本报告期基金份额净值增长率为 32.32%，业绩比较基准收益率为 23.75%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，年底全球主要经济体数据企稳缓升、中美经贸阶段协议文本接近签署等内外利好，全球风险偏好回升，风险资产普遍上涨，此前两月明显落后全球市场的 A 股发力领涨全球，主要指数周线录得四连阳。当前 A 股估值仍处于平均值之下，且靠近负一倍标准差。从估值上看，提升空间仍然较大。盈利方面，A 股当前的盈利增速是显著攀升的。如果按照前三季度线性推导第四季度盈利（隐含四季度盈利修复预期），整体来看市场的盈利修复可期。同时，ROE 处在回落企稳之中。2020 年是重整旗鼓再出发的一年。尽管我们面临着去杠杆到期的考验，但是经历 2018 年和 2019 年之后，市场的认知更为理性，定价中所隐含的风险预期较为充分。我们认为，2020 年宽松背景下的全球增长和中国环境将变得友好，风险偏好有望略微抬升。

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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2019 年度，本基金管理人在为基金份额持有人谋求最大利益的同时，始终将合规运作、防范风险工作放在各项工作的首位。依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。公司监察部门按照规定的权限和程序，通过实时监控、现场检查、重点抽查和人员询问等方法，独立地开展基金运作和公司管理的合规性稽核，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向董事长和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

(1) 全面开展基金运作合规监察工作，确保基金投资的独立性、公平性及合法合规

主要措施有：严格执行集中交易制度，各基金相互独立，交易指令由中央交易室统一执行完成；对基金投资交易系统进行事先合规性设置，并由风险控制部门进行实时监控，杜绝出现违规行为；严格检查基金的投资决策、研究支持、交易过程是否符合规定的程序；通过以上措施，保证了投资运作遵循投资决策程序与业务流程，保证了基金投资组合符合相关法规及基金合同规定，确保了基金投资行为的独立、公平及合法合规。

(2) 开展定期和专项监察稽核工作，确保各项业务活动的合法合规

本年度公司监察稽核部门开展了对公司基金投资、研究、销售、后台运营、反洗钱等方面的专项监察稽核活动。对稽核中发现问题及时发出合规提示函，要求相关部门限期整改，并对改进情况安排后续跟踪检查，确保各项业务开展合法合规。

(3) 促进公司各项内部管理制度的完善

按照相关法规、证监会等监管机关的相关规定和公司业务的发展的要求，公司法律监察部门及时要求各部门制订或修改相应制度，促进公司各项内部管理制度的进一步完善。

#### (4) 通过各种合规培训提高员工合规意识

本年度公司监察稽核部门通过对公司所有新入职员工进行入职前合规培训、对全体人员开展行为规范培训、对基金投资管理人员进行专项合规培训、对员工进行反洗钱培训等，有效提高了公司员工的合规意识。

通过以上工作的开展，在本报告期内本基金运作过程中未发生违规情形，基金运作整体合法合规。在今后的工作中，本基金管理人承诺将一如既往的本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，为基金持有人谋求最大利益。

### 4.7 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。

### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定，基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率达到 1%以上，方可进行收益分配。本报告期内，本基金未进行利润分配。

### 4.9 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

注：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 托管人对本年度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 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

|            |                         |
|------------|-------------------------|
| 财务报表是否经过审计 | 是                       |
| 审计意见类型     | 标准无保留意见                 |
| 审计报告编号     | 普华永道中天审字(2020)第 22580 号 |

### 6.2 审计报告的基本内容

|               |   |
|---------------|---|
| 审计报告标题        | 审计报告  |
| 审计报告收件人       | 上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人  |
| 审计意见          | <p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“华泰柏瑞上证中小盘 ETF 基金”)的财务报表,包括 2019 年 12 月 31 日的资产负债表,2019 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了华泰柏瑞上证中小盘 ETF 基金 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p> |
| 形成审计意见的基础     | <p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于华泰柏瑞上证中小盘 ETF 基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>  |
| 管理层和治理层对财务报表的 | 华泰柏瑞上证中小盘 ETF 基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有   |

|                        |   |
|------------------------|---|
| <p>责任</p>              | <p>限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估华泰柏瑞上证中小盘 ETF 基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算华泰柏瑞上证中小盘 ETF 基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督华泰柏瑞上证中小盘 ETF 基金的财务报告过程。</p>   |
| <p>注册会计师对财务报表审计的责任</p> | <p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> |

|           |  |
|-----------|--|
|           | <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对华泰柏瑞上证中小盘 ETF 基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致华泰柏瑞上证中小盘 ETF 基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p> |
| 会计师事务所的名称 | 普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）   |
| 注册会计师的姓名  | 张炯   朱宏宇   |
| 会计师事务所的地址 | 中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼   |
| 审计报告日期    | 2020 年 3 月 27 日  |

## § 7 年度财务报表

### 7.1 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：2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产              | 附注号        | 本期末<br>2019 年 12 月 31 日         | 上年度末<br>2018 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|---------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>      |            |                                 |                                  |
| 银行存款            | 7.4.7.1    | 1,656,768.67                    | 974,351.20                       |
| 结算备付金           |            | 17,631.38                       | 810.03                           |
| 存出保证金           |            | 2,682.49                        | 70.56                            |
| 交易性金融资产         | 7.4.7.2    | 80,440,760.22                   | 59,430,546.06                    |
| 其中：股票投资         |            | 80,440,760.22                   | 59,430,546.06                    |
| 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          | 7.4.7.3    | -                               | -                                |
| 买入返售金融资产        | 7.4.7.4    | -                               | -                                |
| 应收证券清算款         |            | -                               | 13,180.94                        |
| 应收利息            | 7.4.7.5    | 379.47                          | 182.84                           |
| 应收股利            |            | -                               | -                                |
| 应收申购款           |            | -                               | -                                |
| 递延所得税资产         |            | -                               | -                                |
| 其他资产            | 7.4.7.6    | -                               | -                                |
| 资产总计            |            | 82,118,222.23                   | 60,419,141.63                    |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2019 年 12 月 31 日</b> | <b>上年度末<br/>2018 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负 债：</b>     |            |                                 |                                  |
| 短期借款            |            | -                               | -                                |
| 交易性金融负债         |            | -                               | -                                |
| 衍生金融负债          | 7.4.7.3    | -                               | -                                |
| 卖出回购金融资产款       |            | -                               | -                                |
| 应付证券清算款         |            | -                               | -                                |
| 应付赎回款           |            | -                               | -                                |
| 应付管理人报酬         |            | 33,474.84                       | 26,082.56                        |
| 应付托管费           |            | 6,694.97                        | 5,216.51                         |
| 应付销售服务费         |            | -                               | -                                |
| 应付交易费用          | 7.4.7.7    | 18,505.44                       | 9,175.08                         |
| 应交税费            |            | -                               | -                                |

|               |          |               |               |
|---------------|----------|---------------|---------------|
| 应付利息          |          | -             | -             |
| 应付利润          |          | -             | -             |
| 递延所得税负债       |          | -             | -             |
| 其他负债          | 7.4.7.8  | 190,000.00    | 150,000.00    |
| 负债合计          |          | 248,675.25    | 190,474.15    |
| <b>所有者权益：</b> |          |               |               |
| 实收基金          | 7.4.7.9  | 70,356,258.56 | 68,526,842.84 |
| 未分配利润         | 7.4.7.10 | 11,513,288.42 | -8,298,175.36 |
| 所有者权益合计       |          | 81,869,546.98 | 60,228,667.48 |
| 负债和所有者权益总计    |          | 82,118,222.23 | 60,419,141.63 |

注：报告截止日 2019 年 12 月 31 日，基金份额净值 4.2576 元，基金份额总额 19,229,161.00 份。

## 7.2 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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                    | 附注号        | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至 2019<br>年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2018 年 1 月 1 日至<br>2018 年 12 月 31 日 |
|-----------------------|------------|---|--|
| <b>一、收入</b>           |            | 21,271,645.77                             | -17,576,589.47                                 |
| 1.利息收入                |            | 9,672.46                                  | 7,849.57                                       |
| 其中：存款利息收入             | 7.4.7.11   | 9,664.33                                  | 7,847.39                                       |
| 债券利息收入                |            | 8.13                                      | 2.18   |
| 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）      |            | 409,237.00                                | 1,684,401.76                                   |
| 其中：股票投资收益             | 7.4.7.12   | -845,816.23                               | 508,376.05                                     |
| 基金投资收益                |            | -   | -  |
| 债券投资收益                | 7.4.7.13   | 4,326.07                                  | 470.62   |
| 资产支持证券投资收益            | 7.4.7.13.5 | -   | -  |
| 贵金属投资收益               | 7.4.7.14   | -   | -  |
| 衍生工具收益                | 7.4.7.15   | -   | -  |
| 股利收益                  | 7.4.7.16   | 1,250,727.16                              | 1,175,555.09                                   |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.17   | 20,859,922.82                             | -19,270,762.70                                 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）     |            | -   | -  |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）     | 7.4.7.18   | -7,186.51                                 | 1,921.90                                       |

|                            |            |               |                |
|----------------------------|------------|---------------|----------------|
| <b>减：二、费用</b>              |            | 935,742.87    | 811,745.02     |
| 1. 管理人报酬                   | 7.4.10.2.1 | 378,624.63    | 334,701.50     |
| 2. 托管费                     | 7.4.10.2.2 | 75,724.91     | 66,940.29      |
| 3. 销售服务费                   | 7.4.10.2.3 | -             | -              |
| 4. 交易费用                    | 7.4.7.19   | 79,691.87     | 48,443.23      |
| 5. 利息支出                    |            | -             | -              |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | -             | -              |
| 6. 税金及附加                   |            | -             | -              |
| 7. 其他费用                    | 7.4.7.20   | 401,701.46    | 361,660.00     |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | 20,335,902.90 | -18,388,334.49 |
| 减：所得税费用                    |            | -             | -              |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | 20,335,902.90 | -18,388,334.49 |

### 7.3 所有者权益（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：2019年1月1日至2019年12月31日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2019年1月1日至2019年12月31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）                        | 68,526,842.84               | -8,298,175.36 | 60,228,667.48  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                           | 20,335,902.90 | 20,335,902.90  |
| 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）      | 1,829,415.72                | -524,439.12   | 1,304,976.60   |
| 其中：1.基金申购款                             | 82,323,707.06               | 6,901,816.94  | 89,225,524.00  |
| 2.基金赎回款                                | -80,494,291.34              | -7,426,256.06 | -87,920,547.40 |
| 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）                        | 70,356,258.56               | 11,513,288.42 | 81,869,546.98  |

| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 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）                        | 61,209,179.97                               | 10,168,932.04  | 71,378,112.01  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -   | -18,388,334.49 | -18,388,334.49 |
| 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）      | 7,317,662.87                                | -78,772.91     | 7,238,889.96   |
| 其中：1. 基金申购款                            | 12,805,910.00                               | -26,243.84     | 12,779,666.16  |
| 2. 基金赎回款                               | -5,488,247.13                               | -52,529.07     | -5,540,776.20  |
| 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）                        | 68,526,842.84                               | -8,298,175.36  | 60,228,667.48  |

注：报表附注为财务报表的组成部分。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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         |

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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。本基金为契约型的交易型开放式基金，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、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。

华泰柏瑞基金管理有限公司以本基金为目标 ETF，于 2011 年 1 月 26 日募集成立了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（以下简称“上证中小盘 ETF 联接基金”）。上证中小盘 ETF 联接基金为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

本财务报表由本基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于 2020 年 3 月 27 日批准报出。

#### 7.4.2 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》和在财务报表附注 7.4.4 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。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2019 年度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 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

## 7.4.4 重要会计政策和会计估计

### 7.4.4.1 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。

### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

### 7.4.4.3 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和债券投资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。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。本基金目前暂无金融负债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。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或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，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。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资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。

#### 7.4.4.6 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。

#### 7.4.4.7 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

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。

#### 7.4.4.8 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)。

#### 7.4.4.9 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。

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。

#### 7.4.4.10 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。

#### 7.4.4.11 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本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，方可进行收益分配。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。

#### **7.4.4.12 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。

#### **7.4.4.13 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的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

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。

### **7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

#### **7.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### **7.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### **7.4.5.3 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。

## 7.4.6 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。

(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。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目             | 本期末              | 上年度末             |
|----------------|------------------|------------------|
|                | 2019 年 12 月 31 日 | 2018 年 12 月 31 日 |
| 活期存款           | 1,656,768.67     | 974,351.20       |
| 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：            | 1,656,768.67     | 974,351.20       |

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末              |               |            |
|---------------|------------------|---------------|------------|
|               | 2019 年 12 月 31 日 |               |            |
|               | 成本               | 公允价值          | 公允价值变动     |
| 股票            | 79,471,303.98    | 80,440,760.22 | 969,456.24 |
| 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            | 79,471,303.98    | 80,440,760.22 | 969,456.24 |
| 项目            | 上年度末             |               |            |
|               | 2018 年 12 月 31 日 |               |            |

|               |       | 成本            | 公允价值          | 公允价值变动         |
|---------------|-------|---------------|---------------|----------------|
| 股票            |       | 79,321,012.64 | 59,430,546.06 | -19,890,466.58 |
| 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            |       | 79,321,012.64 | 59,430,546.06 | -19,890,466.58 |

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：截至本报告期末，本基金未持有衍生金融资产/负债。

### 7.4.7.4 买入返售金融资产

#### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：截至本报告期末本基金未持有买入返售金融资产。

#### 7.4.7.4.2 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。

### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2019年12月31日 | 上年度末<br>2018年12月31日 |
|------------|--------------------|---------------------|
| 应收活期存款利息   | 369.46             | 182.40              |
| 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  | 8.69               | 0.44                |
| 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   | -                  | -                   |
| 其他         | 1.32               | -                   |
| 合计         | 379.47             | 182.84              |

### 7.4.7.6 其他资产

注：截至本报告期末，本基金未持有其他资产。

### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2019年12月31日 | 上年度末<br>2018年12月31日 |
|-------------|--------------------|---------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 18,505.44          | 9,175.08            |
| 银行间市场应付交易费用 | -                  | -                   |
| 合计          | 18,505.44          | 9,175.08            |

### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2019年12月31日 | 上年度末<br>2018年12月31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        | 140,000.00         | 100,000.00          |
| 应付指数使用费     | 50,000.00          | 50,000.00           |
| 合计          | 190,000.00         | 150,000.00          |

### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2019年1月1日至2019年12月31日 |                |
|---------------|-----------------------------|----------------|
|               | 基金份额（份）                     | 账面金额           |
| 上年度末          | 18,729,161.00               | 68,526,842.84  |
| 本期申购          | 22,500,000.00               | 82,323,707.06  |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -22,000,000.00              | -80,494,291.34 |
| - 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           | 19,229,161.00               | 70,356,258.56  |

### 7.4.7.10 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           | 32,216,317.67  | -40,514,493.03 | -8,298,175.36 |
| 本期利润           | -524,019.92    | 20,859,922.82  | 20,335,902.90 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 1,144,424.18   | -1,668,863.30  | -524,439.12   |
| 其中：基金申购款       | 38,829,140.02  | -31,927,323.08 | 6,901,816.94  |
| 基金赎回款          | -37,684,715.84 | 30,258,459.78  | -7,426,256.06 |
| 本期已分配利润        | -              | -              | -             |
| 本期末            | 32,836,721.93  | -21,323,433.51 | 11,513,288.42 |

### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期                    | 上年度可比期间               |
|-----------|-----------------------|-----------------------|
|           | 2019年1月1日至2019年12月31日 | 2018年1月1日至2018年12月31日 |
| 活期存款利息收入  | 9,377.58              | 7,606.86              |
| 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 | 267.34                | 228.30                |
| 其他        | 19.41                 | 12.23                 |
| 合计        | 9,664.33              | 7,847.39              |

### 7.4.7.12 股票投资收益

#### 7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目               | 本期                    | 上年度可比期间               |
|------------------|-----------------------|-----------------------|
|                  | 2019年1月1日至2019年12月31日 | 2018年1月1日至2018年12月31日 |
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | 3,185,875.27          | 1,530,210.89          |
| 股票投资收益——赎回差价收入   | -4,031,691.50         | -1,021,834.84         |
| 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               | -845,816.23           | 508,376.05            |

#### 7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2019年1月1日至2019<br>年12月31日 | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018年<br>12月31日 |
|------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 22,223,626.96                   | 15,607,155.66                        |
| 减：卖出股票成本总额 | 19,037,751.69                   | 14,076,944.77                        |
| 买卖股票差价收入   | 3,185,875.27                    | 1,530,210.89                         |

#### 7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

| 项目          | 本期<br>2019年1月1日至<br>2019年12月31日 | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018<br>年12月31日 |
|-------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 赎回基金份额对价总额  | 87,920,547.40                   | 5,540,776.20                         |
| 减：现金支付赎回款总额 | -2,320,278.60                   | -52,714.80                           |
| 减：赎回股票成本总额  | 94,272,517.50                   | 6,615,325.84                         |
| 赎回差价收入      | -4,031,691.50                   | -1,021,834.84                        |

#### 7.4.7.12.4 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。

#### 7.4.7.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                            | 本期<br>2019年1月1日至2019年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018年12月<br>31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 | 4,326.07                        | 470.62                               |
| 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  | 4,326.07 | 470.62 |

#### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                          | 本期<br>2019年1月1日至2019年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018年12月<br>31日 |
|-----------------------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券<br>到期兑付）成交总额   | 62,334.20                       | 13,472.80                            |
| 减：卖出债券（、债转股及<br>债券到期兑付）成本总额 | 58,000.00                       | 13,000.00                            |
| 减：应收利息总额                    | 8.13                            | 2.18                                 |
| 买卖债券差价收入                    | 4,326.07                        | 470.62                               |

#### 7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期无债券赎回差价收入。

#### 7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无债券申购差价收入。

#### 7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期末无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

##### 7.4.7.14.1 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。

##### 7.4.7.14.2 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贵金属投资收益。

##### 7.4.7.14.3 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投资收益。

##### 7.4.7.14.4 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投资收益。

### 7.4.7.15 衍生工具收益

#### 7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 7.4.7.15.2 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。

### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2019年1月1日至2019年12月31日 | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018年12月31日 |
|---------------|-----------------------------|----------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 1,250,727.16                | 1,175,555.09                     |
| 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            | 1,250,727.16                | 1,175,555.09                     |

### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期<br>2019年1月1日至2019年12月31日 | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018年12月31日 |
|------------------------|-----------------------------|----------------------------------|
| 1. 交易性金融资产             | 20,859,922.82               | -19,270,762.70                   |
| ——股票投资                 | 20,859,922.82               | -19,270,762.70                   |
| ——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                     | 20,859,922.82               | -19,270,762.70                   |

### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2019年1月1日至2019年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018年12<br>月31日 |
|---------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | -                               | -                                    |
| 替代损益    | -7,186.51                       | 1,921.90                             |
| 合计      | -7,186.51                       | 1,921.90                             |

注：替代损益是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申购(赎回)本基金时，补入(卖出)被替代股票的实际买入成本(实际卖出金额)与申购(赎回)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(赎回)确认日估值的差额。

### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2019年1月1日至2019年12月31<br>日 | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018年12月<br>31日 |
|-----------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 79,691.87                       | 48,443.23                            |
| 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        | 79,691.87                       | 48,443.23                            |

### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2019年1月1日至2019年12月<br>31日 | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018年12<br>月31日 |
|---------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 审计费用    | 60,000.00                       | 60,000.00                            |
| 信息披露费   | 80,000.00                       | 40,000.00                            |
| 证券出借违约金 | -                               | -                                    |
| 上市费     | 60,000.00                       | 60,000.00                            |
| 银行划款手续费 | 1,701.46                        | 1,660.00                             |
| 指数使用费   | 200,000.00                      | 200,000.00                           |
| 合计      | 401,701.46                      | 361,660.00                           |

### 7.4.7.21 分部报告

注：本基金本报告期无分部报告。

### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 7.4.8.1 或有事项

注：截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

#### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

注：截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

### 7.4.9 关联方关系

| 关联方名称                                       | 与本基金的关系                  |
|---|--------------------------|
| 华泰柏瑞基金管理有限公司（“华泰柏瑞基金”）                      | 基金管理人                    |
| 中国银行股份有限公司（“中国银行”）                          | 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、申购赎回代理券商、基金销售机构 |
| PineBridgeInvestmentLLC                     | 基金管理人的股东                 |
| 苏州新区高新技术产业股份有限公司                            | 基金管理人的股东                 |
| 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       |
| 柏瑞爱建资产管理(上海)有限公司                            | 基金管理人的控股子公司              |
| 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         |

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。

### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

注：本报告期及上一年度可比期间本基金与关联方未进行股票交易。

### 7.4.10.1.2 权证交易

注：本报告期及上一年度可比期间本基金与关联方未进行权证交易。

### 7.4.10.1.3 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。

## 7.4.10.2 关联方报酬

### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2019年1月1日至2019年12月31日 | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018年12月31日 |
|-----------------|-----------------------------|----------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 378,624.63                  | 334,701.50                       |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | -                           | -                                |

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。

### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2019年1月1日至2019年12月31日 | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018年12月31日 |
|----------------|-----------------------------|----------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 75,724.91                   | 66,940.29                        |

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

### 7.4.10.2.3 销售服务费

注：本期和上年可比期间均无数据。

## 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.4.10.4 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

##### 7.4.10.4.1 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：无。

##### 7.4.10.4.2 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：无。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期及上年度，基金管理人未投资本基金。

##### 7.4.10.5.2 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<br>2019年12月31日 |                              | 上年度末<br>2018年12月31日 |                              |
|---|--------------------|------------------------------|---------------------|------------------------------|
|   | 持有的<br>基金份额        | 持有的基金<br>份额<br>占基金总份<br>额的比例 | 持有的<br>基金份额         | 持有的基金<br>份额<br>占基金总份<br>额的比例 |
| 华泰柏瑞上证<br>中小盘交易型<br>开放式指数证<br>券投资基金联<br>接基金 | 14,574,000.00      | 75.7911%                     | 14,500,000.00       | 77.4194%                     |

#### 7.4.10.6 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<br>名称 | 本期<br>2019年1月1日至2019年12月31日 |          | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018年12月31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      | 1,656,768.67                | 9,377.58 | 974,351.20                       | 7,606.86 |

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。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

注：本基金本报告期无其他需要说明的关联交易事项。

### 7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

### 7.4.12 期末（2019 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

#### 7.4.12.1 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

| 7.4.12.1.1 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 |
| 688181               | 八亿时空 | 2019 年 12 月 27 日 | 2020 年 1 月 6 日  | 新股未上市  | 43.98 | 43.98  | 956      | 42,044.88  | 42,044.88  | 2  |
| 688058               | 宝兰德  | 2019 年 10 月 25 日 | 2020 年 5 月 6 日  | 新股锁定期内 | 79.30 | 90.65  | 1,003    | 79,537.90  | 90,921.95  | 1  |
| 688128               | 中国电研 | 2019 年 10 月 29 日 | 2020 年 5 月 6 日  | 新股锁定期内 | 18.79 | 17.52  | 9,027    | 169,617.33 | 158,153.04 | 1  |
| 688138               | 清溢光电 | 2019 年 11 月 13 日 | 2020 年 5 月 20 日 | 新股锁定期内 | 8.78  | 13.89  | 10,066   | 88,379.48  | 139,816.74 | 1  |

注：1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期为自发行人股票上市之日起 6 个月。

2、本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得转让；本基金参与网上申购获得的新股，在新股上市之前不得转让。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

| 股票代码 | 股票名称 | 停牌日期 | 停牌原因 | 期末估值单价 | 复牌日期 | 复牌开盘单价 | 数量（股） | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
|------|------|------|------|--------|------|--------|-------|--------|--------|----|
|------|------|------|------|--------|------|--------|-------|--------|--------|----|

|        |      |                  |      |       |                |       |       |            |            |   |
|--------|------|------------------|------|-------|----------------|-------|-------|------------|------------|---|
| 603799 | 华友钴业 | 2019 年 12 月 31 日 | 重大事项 | 39.39 | 2020 年 1 月 2 日 | 40.43 | 9,656 | 283,249.51 | 380,349.84 | - |
|--------|------|------------------|------|-------|----------------|-------|-------|------------|------------|---|

注：本基金截至 2019 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 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。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告及上年度期末交易所市场债券正回购余额为零。

### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

## 7.4.13 金融工具风险及管理

### 7.4.13.1 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。

#### **7.4.13.2 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。

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 2019 年 12 月 31 日，本基金无债券投资(2018 年 12 月 31 日：同)。

##### **7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

注：无。

##### **7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

注：无。

##### **7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

注：无。

##### **7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

注：无。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

#### 7.4.13.3 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 2019 年 12 月 31 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。

##### 7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

##### 7.4.13.3.2 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 7.4.12。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 2019 年 12 月 31 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 0.99%。

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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

|     |        |       |      |       |       |     |    |
|-----|--------|-------|------|-------|-------|-----|----|
| 本期末 | 1 个月以内 | 1-3 个 | 3 个月 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|-----|--------|-------|------|-------|-------|-----|----|

| 2019年12月31日         |              | 月     | -1年    |      |      |                |               |
|---------------------|--------------|-------|--------|------|------|----------------|---------------|
| 资产                  |              |       |        |      |      |                |               |
| 银行存款                | 1,656,768.67 | -     | -      | -    | -    | -              | 1,656,768.67  |
| 结算备付金               | 17,631.38    | -     | -      | -    | -    | -              | 17,631.38     |
| 存出保证金               | 2,682.49     | -     | -      | -    | -    | -              | 2,682.49      |
| 交易性金融资产             | -            | -     | -      | -    | -    | -80,440,760.22 | 80,440,760.22 |
| 应收利息                | -            | -     | -      | -    | -    | 379.47         | 379.47        |
| 资产总计                | 1,677,082.54 | -     | -      | -    | -    | -80,441,139.69 | 82,118,222.23 |
| 负债                  |              |       |        |      |      |                |               |
| 应付管理人报酬             | -            | -     | -      | -    | -    | 33,474.84      | 33,474.84     |
| 应付托管费               | -            | -     | -      | -    | -    | 6,694.97       | 6,694.97      |
| 应付交易费用              | -            | -     | -      | -    | -    | 18,505.44      | 18,505.44     |
| 其他负债                | -            | -     | -      | -    | -    | 190,000.00     | 190,000.00    |
| 负债总计                | -            | -     | -      | -    | -    | 248,675.25     | 248,675.25    |
| 利率敏感度缺口             | 1,677,082.54 | -     | -      | -    | -    | -80,192,464.44 | 81,869,546.98 |
| 上年度末<br>2018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                | 974,351.20   | -     | -      | -    | -    | -              | 974,351.20    |
| 结算备付金               | 810.03       | -     | -      | -    | -    | -              | 810.03        |
| 存出保证金               | 70.56        | -     | -      | -    | -    | -              | 70.56         |
| 交易性金融资产             | -            | -     | -      | -    | -    | -59,430,546.06 | 59,430,546.06 |
| 应收证券清算款             | -            | -     | -      | -    | -    | 13,180.94      | 13,180.94     |
| 应收利息                | -            | -     | -      | -    | -    | 182.84         | 182.84        |
| 资产总计                | 975,231.79   | -     | -      | -    | -    | -59,443,909.84 | 60,419,141.63 |
| 负债                  |              |       |        |      |      |                |               |
| 应付管理人报酬             | -            | -     | -      | -    | -    | 26,082.56      | 26,082.56     |
| 应付托管费               | -            | -     | -      | -    | -    | 5,216.51       | 5,216.51      |
| 应付交易费用              | -            | -     | -      | -    | -    | 9,175.08       | 9,175.08      |
| 其他负债                | -            | -     | -      | -    | -    | 150,000.00     | 150,000.00    |
| 负债总计                | -            | -     | -      | -    | -    | 190,474.15     | 190,474.15    |
| 利率敏感度缺口             | 975,231.79   | -     | -      | -    | -    | -59,253,435.69 | 60,228,667.48 |

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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2019 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资（2018 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（2018 年 12 月 31 日：同）。

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目           | 本期末<br>2019年12月31日 |                          | 上年度末<br>2018年12月31日 |                       |
|--------------|--------------------|--------------------------|---------------------|-----------------------|
|              | 公允价值               | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) | 公允价值                | 占基金资<br>产净值比<br>例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资 | 80,440,760.22      | 98.25                    | 59,430,546.06       | 98.67                 |
| 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          | 80,440,760.22 | 98.25 | 59,430,546.06 | 98.67 |

#### 7.4.13.4.3.2 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 |                             |                   |
|----|-----------------------|-----------------------------|-------------------|
| 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（2019年12月31日）            | 上年度末（2018年12月31日） |
|    | 上证中小盘指数上升5%           | 3,282,215.25                | 2,407,320.00      |
|    | 上证中小盘指数下降5%           | -3,282,215.25               | -2,407,320.00     |

#### 7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 基金申购款

于 2019 年度，本基金申购基金份额的对价总额为 89,225,524.00 元（2018 年度：12,779,666.16 元），其中包括以股票支付的申购款 91,041,386.00 元和以现金支付的申购款 -1,815,862.00 元（2018 年度：其中包括以股票支付的申购款 11,792,833.54 元和以现金支付的申购款 986,832.62 元）。

##### (2) 公允价值

##### (a) 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。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2019 年 12 月 31 日, 本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 79,629,473.77 元, 属于第二层次的余额为 811,286.45 元, 无属于第三层次的余额(2018 年 12 月 31 日: 第一层次 59,284,039.02 元, 第二层次 146,507.04 元, 无第三层次)。

(ii) 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。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2019 年 12 月 31 日, 本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2018 年 12 月 31 日: 同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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。

(3)除基金申购款和公允价值外, 截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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              | 80,440,760.22 | 97.96         |
|    | 其中：股票             | 80,440,760.22 | 97.96         |
| 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      | 1,674,400.05  | 2.04          |
| 8  | 其他各项资产            | 3,061.96      | 0.00          |
| 9  | 合计                | 82,118,222.23 | 100.00        |

注：股票投资包含可退替代款估值增（减）值

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 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          | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|---------------|---------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | 294,824.81    | 0.36          |
| B  | 采矿业              | 4,088,682.12  | 4.99          |
| C  | 制造业              | 34,942,522.92 | 42.68         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 5,526,741.27  | 6.75          |
| E  | 建筑业              | 2,579,349.28  | 3.15          |
| F  | 批发和零售业           | 2,984,107.73  | 3.64          |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 5,518,243.22  | 6.74          |
| H  | 住宿和餐饮业           | 270,225.00    | 0.33          |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 4,922,618.87  | 6.01          |
| J  | 金融业              | 13,749,525.54 | 16.79         |
| K  | 房地产业             | 3,102,939.08  | 3.79          |
| L  | 租赁和商务服务业         | 489,241.44    | 0.60          |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 158,153.04    | 0.19          |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 317,960.76    | 0.39          |

|   |               |               |       |
|---|---------------|---------------|-------|
| 0 | 居民服务、修理和其他服务业 | -             | -     |
| P | 教育            | 63,544.80     | 0.08  |
| Q | 卫生和社会工作       | 297,337.00    | 0.36  |
| R | 文化、体育和娱乐业     | 660,014.64    | 0.81  |
| S | 综合            | 474,728.70    | 0.58  |
|   | 合计            | 80,440,760.22 | 98.25 |

### 8.2.2 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通过港股通投资的股票。

### 8.3 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  | 600900 | 长江电力 | 113,742 | 2,090,577.96 | 2.55         |
| 2  | 603288 | 海天味业 | 12,014  | 1,291,625.14 | 1.58         |
| 3  | 601169 | 北京银行 | 218,800 | 1,242,784.00 | 1.52         |
| 4  | 601229 | 上海银行 | 105,000 | 996,450.00   | 1.22         |
| 5  | 601899 | 紫金矿业 | 191,232 | 877,754.88   | 1.07         |
| 6  | 600919 | 江苏银行 | 119,400 | 864,456.00   | 1.06         |
| 7  | 600999 | 招商证券 | 42,300  | 773,667.00   | 0.94         |
| 8  | 601009 | 南京银行 | 87,829  | 770,260.33   | 0.94         |
| 9  | 600019 | 宝钢股份 | 131,700 | 755,958.00   | 0.92         |
| 10 | 600570 | 恒生电子 | 9,513   | 739,445.49   | 0.90         |
| 11 | 601006 | 大秦铁路 | 88,000  | 722,480.00   | 0.88         |
| 12 | 600015 | 华夏银行 | 91,060  | 698,430.20   | 0.85         |
| 13 | 600406 | 国电南瑞 | 30,800  | 652,344.00   | 0.80         |
| 14 | 600741 | 华域汽车 | 23,317  | 606,008.83   | 0.74         |
| 15 | 600745 | 闻泰科技 | 6,200   | 573,500.00   | 0.70         |
| 16 | 600958 | 东方证券 | 53,000  | 570,280.00   | 0.70         |
| 17 | 600352 | 浙江龙盛 | 38,517  | 557,340.99   | 0.68         |
| 18 | 601225 | 陕西煤业 | 59,200  | 532,208.00   | 0.65         |
| 19 | 600588 | 用友网络 | 18,602  | 528,296.80   | 0.65         |
| 20 | 601901 | 方正证券 | 60,900  | 528,003.00   | 0.64         |
| 21 | 601155 | 新城控股 | 13,400  | 518,848.00   | 0.63         |
| 22 | 603986 | 兆易创新 | 2,500   | 512,225.00   | 0.63         |
| 23 | 600660 | 福耀玻璃 | 20,800  | 498,992.00   | 0.61         |
| 24 | 601377 | 兴业证券 | 69,400  | 491,352.00   | 0.60         |
| 25 | 601669 | 中国电建 | 113,100 | 490,854.00   | 0.60         |

|    |        |      |         |            |      |
|----|--------|------|---------|------------|------|
| 26 | 600383 | 金地集团 | 33,391  | 484,169.50 | 0.59 |
| 27 | 600436 | 片仔癀  | 4,194   | 460,794.78 | 0.56 |
| 28 | 600886 | 国投电力 | 50,181  | 460,661.58 | 0.56 |
| 29 | 600029 | 南方航空 | 63,500  | 455,930.00 | 0.56 |
| 30 | 601933 | 永辉超市 | 56,602  | 426,779.08 | 0.52 |
| 31 | 601108 | 财通证券 | 37,200  | 421,848.00 | 0.52 |
| 32 | 600795 | 国电电力 | 174,400 | 408,096.00 | 0.50 |
| 33 | 600010 | 包钢股份 | 305,280 | 402,969.60 | 0.49 |
| 34 | 601985 | 中国核电 | 80,400  | 402,000.00 | 0.49 |
| 35 | 601877 | 正泰电器 | 14,873  | 398,596.40 | 0.49 |
| 36 | 600705 | 中航资本 | 79,624  | 386,176.40 | 0.47 |
| 37 | 600115 | 东方航空 | 66,291  | 385,150.71 | 0.47 |
| 38 | 600271 | 航天信息 | 16,606  | 384,761.02 | 0.47 |
| 39 | 601099 | 太平洋  | 100,812 | 382,077.48 | 0.47 |
| 40 | 603799 | 华友钴业 | 9,656   | 380,349.84 | 0.46 |
| 41 | 601788 | 光大证券 | 28,900  | 378,590.00 | 0.46 |
| 42 | 600061 | 国投资本 | 25,000  | 378,500.00 | 0.46 |
| 43 | 600438 | 通威股份 | 28,700  | 376,831.00 | 0.46 |
| 44 | 600606 | 绿地控股 | 54,000  | 375,300.00 | 0.46 |
| 45 | 603501 | 韦尔股份 | 2,600   | 372,840.00 | 0.46 |
| 46 | 600089 | 特变电工 | 54,973  | 365,570.45 | 0.45 |
| 47 | 600011 | 华能国际 | 65,100  | 363,258.00 | 0.44 |
| 48 | 600018 | 上港集团 | 62,800  | 362,356.00 | 0.44 |
| 49 | 600177 | 雅戈尔  | 51,914  | 361,840.58 | 0.44 |
| 50 | 601555 | 东吴证券 | 35,566  | 355,304.34 | 0.43 |
| 51 | 600809 | 山西汾酒 | 3,940   | 353,418.00 | 0.43 |
| 52 | 600183 | 生益科技 | 16,868  | 352,878.56 | 0.43 |
| 53 | 600584 | 长电科技 | 16,011  | 351,921.78 | 0.43 |
| 54 | 600346 | 恒力石化 | 21,860  | 351,508.80 | 0.43 |
| 55 | 603160 | 汇顶科技 | 1,700   | 350,710.00 | 0.43 |
| 56 | 600111 | 北方稀土 | 32,300  | 350,132.00 | 0.43 |
| 57 | 601600 | 中国铝业 | 96,760  | 342,530.40 | 0.42 |
| 58 | 601997 | 贵阳银行 | 35,580  | 340,144.80 | 0.42 |
| 59 | 600176 | 中国巨石 | 31,093  | 338,913.70 | 0.41 |
| 60 | 600426 | 华鲁恒升 | 16,877  | 335,345.99 | 0.41 |
| 61 | 600109 | 国金证券 | 35,800  | 332,940.00 | 0.41 |
| 62 | 600872 | 中炬高新 | 8,276   | 325,660.60 | 0.40 |
| 63 | 603019 | 中科曙光 | 9,400   | 325,052.00 | 0.40 |
| 64 | 601800 | 中国交建 | 34,700  | 317,852.00 | 0.39 |

|     |        |      |         |            |      |
|-----|--------|------|---------|------------|------|
| 65  | 601607 | 上海医药 | 17,085  | 313,851.45 | 0.38 |
| 66  | 600201 | 生物股份 | 16,727  | 313,129.44 | 0.38 |
| 67  | 600487 | 亨通光电 | 19,220  | 312,517.20 | 0.38 |
| 68  | 600100 | 同方股份 | 35,000  | 306,950.00 | 0.37 |
| 69  | 601919 | 中远海控 | 57,300  | 301,971.00 | 0.37 |
| 70  | 600522 | 中天科技 | 36,330  | 301,539.00 | 0.37 |
| 71  | 600763 | 通策医疗 | 2,900   | 297,337.00 | 0.36 |
| 72  | 600332 | 白云山  | 8,313   | 296,025.93 | 0.36 |
| 73  | 601872 | 招商轮船 | 35,800  | 295,708.00 | 0.36 |
| 74  | 601618 | 中国中冶 | 105,585 | 295,638.00 | 0.36 |
| 75  | 600221 | 海航控股 | 170,100 | 294,273.00 | 0.36 |
| 76  | 600516 | 方大炭素 | 24,151  | 293,676.16 | 0.36 |
| 77  | 600893 | 航发动力 | 13,400  | 290,512.00 | 0.35 |
| 78  | 601128 | 常熟银行 | 31,500  | 286,965.00 | 0.35 |
| 79  | 600536 | 中国软件 | 4,002   | 286,903.38 | 0.35 |
| 80  | 600498 | 烽火通信 | 10,388  | 285,150.60 | 0.35 |
| 81  | 600637 | 东方明珠 | 30,460  | 285,105.60 | 0.35 |
| 82  | 601998 | 中信银行 | 45,400  | 280,118.00 | 0.34 |
| 83  | 603589 | 口子窖  | 5,100   | 280,041.00 | 0.34 |
| 84  | 600066 | 宇通客车 | 19,600  | 279,300.00 | 0.34 |
| 85  | 600926 | 杭州银行 | 30,360  | 278,097.60 | 0.34 |
| 86  | 600739 | 辽宁成大 | 18,133  | 276,165.59 | 0.34 |
| 87  | 600068 | 葛洲坝  | 40,893  | 273,165.24 | 0.33 |
| 88  | 601198 | 东兴证券 | 20,400  | 268,056.00 | 0.33 |
| 89  | 600801 | 华新水泥 | 10,120  | 267,471.60 | 0.33 |
| 90  | 600004 | 白云机场 | 15,310  | 267,159.50 | 0.33 |
| 91  | 601727 | 上海电气 | 53,500  | 266,430.00 | 0.33 |
| 92  | 600362 | 江西铜业 | 15,317  | 259,316.81 | 0.32 |
| 93  | 600674 | 川投能源 | 26,043  | 256,523.55 | 0.31 |
| 94  | 600867 | 通化东宝 | 19,804  | 250,520.60 | 0.31 |
| 95  | 603369 | 今世缘  | 7,450   | 243,764.00 | 0.30 |
| 96  | 600583 | 海油工程 | 32,769  | 241,835.22 | 0.30 |
| 97  | 601838 | 成都银行 | 26,622  | 241,461.54 | 0.29 |
| 98  | 600208 | 新湖中宝 | 63,589  | 240,366.42 | 0.29 |
| 99  | 601233 | 桐昆股份 | 15,980  | 239,540.20 | 0.29 |
| 100 | 600600 | 青岛啤酒 | 4,685   | 238,935.00 | 0.29 |
| 101 | 600219 | 南山铝业 | 106,045 | 237,540.80 | 0.29 |
| 102 | 601990 | 南京证券 | 18,180  | 234,703.80 | 0.29 |
| 103 | 600170 | 上海建工 | 65,911  | 233,324.94 | 0.28 |

|     |        |      |        |            |      |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 104 | 600673 | 东阳光  | 22,354 | 228,904.96 | 0.28 |
| 105 | 600885 | 宏发股份 | 6,640  | 228,748.00 | 0.28 |
| 106 | 600085 | 同仁堂  | 8,098  | 228,201.64 | 0.28 |
| 107 | 600298 | 安琪酵母 | 7,400  | 226,958.00 | 0.28 |
| 108 | 603833 | 欧派家居 | 1,900  | 222,300.00 | 0.27 |
| 109 | 601018 | 宁波港  | 58,447 | 222,098.60 | 0.27 |
| 110 | 601881 | 中国银河 | 19,100 | 221,751.00 | 0.27 |
| 111 | 600150 | 中国船舶 | 10,100 | 219,776.00 | 0.27 |
| 112 | 603899 | 晨光文具 | 4,500  | 219,330.00 | 0.27 |
| 113 | 601878 | 浙商证券 | 19,700 | 219,261.00 | 0.27 |
| 114 | 600369 | 西南证券 | 41,800 | 216,942.00 | 0.26 |
| 115 | 600489 | 中金黄金 | 25,562 | 216,765.76 | 0.26 |
| 116 | 600161 | 天坛生物 | 7,620  | 212,902.80 | 0.26 |
| 117 | 601117 | 中国化学 | 32,936 | 212,107.84 | 0.26 |
| 118 | 600642 | 申能股份 | 36,381 | 211,373.61 | 0.26 |
| 119 | 600535 | 天士力  | 13,500 | 208,170.00 | 0.25 |
| 120 | 600038 | 中直股份 | 4,361  | 208,063.31 | 0.25 |
| 121 | 600699 | 均胜电子 | 11,480 | 205,492.00 | 0.25 |
| 122 | 600482 | 中国动力 | 10,024 | 200,480.00 | 0.24 |
| 123 | 600256 | 广汇能源 | 60,307 | 199,616.17 | 0.24 |
| 124 | 600760 | 中航沈飞 | 6,300  | 199,080.00 | 0.24 |
| 125 | 601021 | 春秋航空 | 4,492  | 197,153.88 | 0.24 |
| 126 | 600325 | 华发股份 | 25,072 | 196,313.76 | 0.24 |
| 127 | 600909 | 华安证券 | 26,700 | 194,910.00 | 0.24 |
| 128 | 601100 | 恒立液压 | 3,900  | 194,025.00 | 0.24 |
| 129 | 600879 | 航天电子 | 32,200 | 192,556.00 | 0.24 |
| 130 | 600486 | 扬农化工 | 2,793  | 191,683.59 | 0.23 |
| 131 | 600528 | 中铁工业 | 16,450 | 189,175.00 | 0.23 |
| 132 | 600079 | 人福医药 | 14,000 | 189,140.00 | 0.23 |
| 133 | 600153 | 建发股份 | 21,000 | 188,790.00 | 0.23 |
| 134 | 601231 | 环旭电子 | 9,742  | 187,338.66 | 0.23 |
| 135 | 601168 | 西部矿业 | 28,228 | 186,869.36 | 0.23 |
| 136 | 600118 | 中国卫星 | 8,686  | 185,619.82 | 0.23 |
| 137 | 601992 | 金隅集团 | 49,318 | 183,956.14 | 0.22 |
| 138 | 603156 | 养元饮品 | 6,320  | 183,469.60 | 0.22 |
| 139 | 600728 | 佳都科技 | 19,428 | 182,234.64 | 0.22 |
| 140 | 600460 | 士兰微  | 11,600 | 179,452.00 | 0.22 |
| 141 | 603444 | 吉比特  | 600    | 179,094.00 | 0.22 |
| 142 | 600567 | 山鹰纸业 | 47,467 | 178,950.59 | 0.22 |

|     |        |      |        |            |      |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 143 | 600027 | 华电国际 | 48,228 | 176,996.76 | 0.22 |
| 144 | 603517 | 绝味食品 | 3,800  | 176,510.00 | 0.22 |
| 145 | 600895 | 张江高科 | 11,400 | 174,534.00 | 0.21 |
| 146 | 600236 | 桂冠电力 | 35,017 | 171,233.13 | 0.21 |
| 147 | 603659 | 璞泰来  | 2,000  | 170,300.00 | 0.21 |
| 148 | 600521 | 华海药业 | 9,862  | 170,218.12 | 0.21 |
| 149 | 600572 | 康恩贝  | 27,612 | 169,813.80 | 0.21 |
| 150 | 600820 | 隧道股份 | 27,984 | 169,023.36 | 0.21 |
| 151 | 600977 | 中国电影 | 11,100 | 168,942.00 | 0.21 |
| 152 | 603939 | 益丰药房 | 2,300  | 168,406.00 | 0.21 |
| 153 | 600446 | 金证股份 | 8,153  | 167,788.74 | 0.20 |
| 154 | 601808 | 中海油服 | 8,698  | 167,001.60 | 0.20 |
| 155 | 600410 | 华胜天成 | 16,180 | 166,815.80 | 0.20 |
| 156 | 600497 | 驰宏锌锗 | 37,636 | 164,845.68 | 0.20 |
| 157 | 600466 | 蓝光发展 | 22,280 | 164,203.60 | 0.20 |
| 158 | 603858 | 步长制药 | 7,953  | 163,990.86 | 0.20 |
| 159 | 600549 | 厦门钨业 | 12,540 | 163,521.60 | 0.20 |
| 160 | 601966 | 玲珑轮胎 | 7,100  | 162,803.00 | 0.20 |
| 161 | 601238 | 广汽集团 | 13,820 | 161,555.80 | 0.20 |
| 162 | 600839 | 四川长虹 | 54,636 | 158,990.76 | 0.19 |
| 163 | 600273 | 嘉化能源 | 14,100 | 158,625.00 | 0.19 |
| 164 | 603000 | 人民网  | 8,000  | 158,320.00 | 0.19 |
| 165 | 688128 | 中国电研 | 9,027  | 158,153.04 | 0.19 |
| 166 | 601633 | 长城汽车 | 17,833 | 157,822.05 | 0.19 |
| 167 | 600297 | 广汇汽车 | 48,260 | 157,327.60 | 0.19 |
| 168 | 601216 | 君正集团 | 49,988 | 156,462.44 | 0.19 |
| 169 | 600655 | 豫园股份 | 19,953 | 156,431.52 | 0.19 |
| 170 | 600415 | 小商品城 | 40,329 | 156,073.23 | 0.19 |
| 171 | 600845 | 宝信软件 | 4,740  | 155,946.00 | 0.19 |
| 172 | 600797 | 浙大网新 | 15,262 | 153,688.34 | 0.19 |
| 173 | 601333 | 广深铁路 | 50,154 | 153,471.24 | 0.19 |
| 174 | 600881 | 亚泰集团 | 48,055 | 153,295.45 | 0.19 |
| 175 | 600258 | 首旅酒店 | 7,400  | 152,514.00 | 0.19 |
| 176 | 601866 | 中远海发 | 58,633 | 151,859.47 | 0.19 |
| 177 | 600315 | 上海家化 | 4,900  | 151,606.00 | 0.19 |
| 178 | 600260 | 凯乐科技 | 11,149 | 151,291.93 | 0.18 |
| 179 | 600398 | 海澜之家 | 19,631 | 150,766.08 | 0.18 |
| 180 | 600779 | 水井坊  | 2,900  | 150,075.00 | 0.18 |
| 181 | 600380 | 健康元  | 14,388 | 148,915.80 | 0.18 |

|     |        |      |        |            |      |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 182 | 600875 | 东方电气 | 16,200 | 148,878.00 | 0.18 |
| 183 | 600160 | 巨化股份 | 20,377 | 148,344.56 | 0.18 |
| 184 | 600776 | 东方通信 | 7,100  | 147,893.00 | 0.18 |
| 185 | 600811 | 东方集团 | 43,940 | 147,638.40 | 0.18 |
| 186 | 600718 | 东软集团 | 12,900 | 146,415.00 | 0.18 |
| 187 | 600816 | 安信信托 | 32,424 | 143,962.56 | 0.18 |
| 188 | 600166 | 福田汽车 | 68,092 | 142,312.28 | 0.17 |
| 189 | 601360 | 三六零  | 6,000  | 141,060.00 | 0.17 |
| 190 | 600392 | 盛和资源 | 15,535 | 140,902.45 | 0.17 |
| 191 | 600635 | 大众公用 | 28,661 | 140,725.51 | 0.17 |
| 192 | 600755 | 厦门国贸 | 19,073 | 139,995.82 | 0.17 |
| 193 | 688138 | 清溢光电 | 10,066 | 139,816.74 | 0.17 |
| 194 | 600884 | 杉杉股份 | 10,338 | 139,666.38 | 0.17 |
| 195 | 600188 | 兖州煤业 | 13,176 | 139,138.56 | 0.17 |
| 196 | 600022 | 山东钢铁 | 97,105 | 138,860.15 | 0.17 |
| 197 | 600643 | 爱建集团 | 14,440 | 138,624.00 | 0.17 |
| 198 | 600094 | 大名城  | 23,500 | 137,475.00 | 0.17 |
| 199 | 600373 | 中文传媒 | 10,100 | 137,461.00 | 0.17 |
| 200 | 600580 | 卧龙电驱 | 11,408 | 137,124.16 | 0.17 |
| 201 | 601898 | 中煤能源 | 27,066 | 135,871.32 | 0.17 |
| 202 | 600282 | 南钢股份 | 39,300 | 135,585.00 | 0.17 |
| 203 | 600808 | 马钢股份 | 44,140 | 135,509.80 | 0.17 |
| 204 | 600216 | 浙江医药 | 9,989  | 133,353.15 | 0.16 |
| 205 | 600155 | 华创阳安 | 9,400  | 131,882.00 | 0.16 |
| 206 | 601636 | 旗滨集团 | 23,900 | 131,211.00 | 0.16 |
| 207 | 600967 | 内蒙一机 | 12,340 | 131,174.20 | 0.16 |
| 208 | 600737 | 中粮糖业 | 15,481 | 130,969.26 | 0.16 |
| 209 | 600804 | 鹏博士  | 21,262 | 130,123.44 | 0.16 |
| 210 | 600026 | 中远海能 | 20,245 | 129,163.10 | 0.16 |
| 211 | 601699 | 潞安环能 | 17,761 | 128,944.86 | 0.16 |
| 212 | 601098 | 中南传媒 | 10,702 | 127,781.88 | 0.16 |
| 213 | 600848 | 上海临港 | 5,200  | 127,660.00 | 0.16 |
| 214 | 600171 | 上海贝岭 | 8,100  | 127,575.00 | 0.16 |
| 215 | 600435 | 北方导航 | 15,274 | 127,079.68 | 0.16 |
| 216 | 603816 | 顾家家居 | 2,760  | 126,214.80 | 0.15 |
| 217 | 603658 | 安图生物 | 1,300  | 125,294.00 | 0.15 |
| 218 | 601118 | 海南橡胶 | 25,400 | 124,968.00 | 0.15 |
| 219 | 600064 | 南京高科 | 12,800 | 124,800.00 | 0.15 |
| 220 | 600060 | 海信视像 | 11,427 | 123,982.95 | 0.15 |

|     |        |      |        |            |      |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 221 | 603885 | 吉祥航空 | 8,220  | 123,300.00 | 0.15 |
| 222 | 600777 | 新潮能源 | 58,000 | 121,800.00 | 0.15 |
| 223 | 600323 | 瀚蓝环境 | 6,857  | 120,271.78 | 0.15 |
| 224 | 600782 | 新钢股份 | 23,200 | 119,016.00 | 0.15 |
| 225 | 600863 | 内蒙华电 | 43,027 | 118,324.25 | 0.14 |
| 226 | 601106 | 中国一重 | 40,600 | 118,146.00 | 0.14 |
| 227 | 600754 | 锦江酒店 | 4,100  | 117,711.00 | 0.14 |
| 228 | 603228 | 景旺电子 | 2,680  | 117,437.60 | 0.14 |
| 229 | 603077 | 和邦生物 | 78,359 | 115,971.32 | 0.14 |
| 230 | 600409 | 三友化工 | 18,334 | 115,870.88 | 0.14 |
| 231 | 601958 | 金钼股份 | 14,316 | 114,671.16 | 0.14 |
| 232 | 601000 | 唐山港  | 43,869 | 114,059.40 | 0.14 |
| 233 | 600864 | 哈投股份 | 14,146 | 114,016.76 | 0.14 |
| 234 | 600597 | 光明乳业 | 8,969  | 113,816.61 | 0.14 |
| 235 | 600989 | 宝丰能源 | 11,900 | 113,169.00 | 0.14 |
| 236 | 600025 | 华能水电 | 26,700 | 112,674.00 | 0.14 |
| 237 | 600566 | 济川药业 | 4,651  | 112,461.18 | 0.14 |
| 238 | 600008 | 首创股份 | 33,680 | 110,807.20 | 0.14 |
| 239 | 601577 | 长沙银行 | 12,200 | 110,654.00 | 0.14 |
| 240 | 600511 | 国药股份 | 4,042  | 110,306.18 | 0.13 |
| 241 | 601689 | 拓普集团 | 6,300  | 109,809.00 | 0.13 |
| 242 | 603883 | 老百姓  | 1,700  | 108,936.00 | 0.13 |
| 243 | 600507 | 方大特钢 | 10,800 | 108,648.00 | 0.13 |
| 244 | 600711 | 盛屯矿业 | 20,531 | 108,608.99 | 0.13 |
| 245 | 600729 | 重庆百货 | 3,632  | 108,415.20 | 0.13 |
| 246 | 600388 | 龙净环保 | 11,104 | 108,264.00 | 0.13 |
| 247 | 600372 | 中航电子 | 7,600  | 108,224.00 | 0.13 |
| 248 | 600039 | 四川路桥 | 32,104 | 107,869.44 | 0.13 |
| 249 | 600320 | 振华重工 | 29,544 | 107,244.72 | 0.13 |
| 250 | 600138 | 中青旅  | 8,500  | 107,100.00 | 0.13 |
| 251 | 600649 | 城投控股 | 18,700 | 106,964.00 | 0.13 |
| 252 | 600970 | 中材国际 | 15,276 | 106,473.72 | 0.13 |
| 253 | 600640 | 号百控股 | 4,100  | 105,821.00 | 0.13 |
| 254 | 600633 | 浙数文化 | 11,511 | 105,325.65 | 0.13 |
| 255 | 601228 | 广州港  | 27,500 | 105,325.00 | 0.13 |
| 256 | 600305 | 恒顺醋业 | 6,900  | 105,225.00 | 0.13 |
| 257 | 600702 | 舍得酒业 | 3,500  | 105,035.00 | 0.13 |
| 258 | 600598 | 北大荒  | 10,600 | 103,244.00 | 0.13 |
| 259 | 600120 | 浙江东方 | 11,793 | 102,952.89 | 0.13 |

|     |        |      |        |            |      |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 260 | 600500 | 中化国际 | 19,374 | 102,682.20 | 0.13 |
| 261 | 600515 | 海航基础 | 22,900 | 102,134.00 | 0.12 |
| 262 | 600563 | 法拉电子 | 2,046  | 101,174.70 | 0.12 |
| 263 | 600490 | 鹏欣资源 | 21,748 | 101,128.20 | 0.12 |
| 264 | 600056 | 中国医药 | 7,742  | 101,033.10 | 0.12 |
| 265 | 600823 | 世茂股份 | 22,200 | 99,900.00  | 0.12 |
| 266 | 600062 | 华润双鹤 | 7,627  | 99,532.35  | 0.12 |
| 267 | 601717 | 郑煤机  | 15,300 | 98,991.00  | 0.12 |
| 268 | 601375 | 中原证券 | 18,424 | 98,752.64  | 0.12 |
| 269 | 600348 | 阳泉煤业 | 17,798 | 98,422.94  | 0.12 |
| 270 | 600206 | 有研新材 | 8,022  | 97,868.40  | 0.12 |
| 271 | 601598 | 中国外运 | 22,931 | 97,686.06  | 0.12 |
| 272 | 600908 | 无锡银行 | 17,600 | 97,680.00  | 0.12 |
| 273 | 600803 | 新奥股份 | 9,175  | 97,622.00  | 0.12 |
| 274 | 600648 | 外高桥  | 5,600  | 97,272.00  | 0.12 |
| 275 | 600868 | 梅雁吉祥 | 28,100 | 96,945.00  | 0.12 |
| 276 | 600621 | 华鑫股份 | 6,300  | 96,453.00  | 0.12 |
| 277 | 600418 | 江淮汽车 | 19,200 | 96,384.00  | 0.12 |
| 278 | 600667 | 太极实业 | 11,800 | 95,698.00  | 0.12 |
| 279 | 601608 | 中信重工 | 25,709 | 95,637.48  | 0.12 |
| 280 | 600307 | 酒钢宏兴 | 46,388 | 95,559.28  | 0.12 |
| 281 | 600733 | 北汽蓝谷 | 16,300 | 95,192.00  | 0.12 |
| 282 | 600093 | 易见股份 | 6,700  | 93,532.00  | 0.11 |
| 283 | 600717 | 天津港  | 14,885 | 93,477.80  | 0.11 |
| 284 | 600559 | 老白干酒 | 8,280  | 93,067.20  | 0.11 |
| 285 | 601880 | 大连港  | 45,843 | 93,061.29  | 0.11 |
| 286 | 600604 | 市北高新 | 10,500 | 93,030.00  | 0.11 |
| 287 | 600330 | 天通股份 | 11,537 | 92,757.48  | 0.11 |
| 288 | 600277 | 亿利洁能 | 20,262 | 92,394.72  | 0.11 |
| 289 | 688058 | 宝兰德  | 1,003  | 90,921.95  | 0.11 |
| 290 | 601519 | 大智慧  | 11,500 | 90,735.00  | 0.11 |
| 291 | 600557 | 康缘药业 | 6,147  | 90,606.78  | 0.11 |
| 292 | 600525 | 长园集团 | 15,277 | 90,592.61  | 0.11 |
| 293 | 601991 | 大唐发电 | 36,733 | 89,995.85  | 0.11 |
| 294 | 603708 | 家家悦  | 3,636  | 88,500.24  | 0.11 |
| 295 | 600072 | 中船科技 | 6,600  | 88,308.00  | 0.11 |
| 296 | 600862 | 中航高科 | 8,000  | 88,160.00  | 0.11 |
| 297 | 600968 | 海油发展 | 30,000 | 87,900.00  | 0.11 |
| 298 | 600226 | 瀚叶股份 | 27,900 | 87,606.00  | 0.11 |

|     |        |      |        |           |      |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 299 | 600377 | 宁沪高速 | 7,681  | 86,180.82 | 0.11 |
| 300 | 600756 | 浪潮软件 | 4,128  | 85,367.04 | 0.10 |
| 301 | 603712 | 七一二  | 3,500  | 84,630.00 | 0.10 |
| 302 | 600664 | 哈药股份 | 22,294 | 84,494.26 | 0.10 |
| 303 | 600339 | 中油工程 | 24,800 | 84,072.00 | 0.10 |
| 304 | 600901 | 江苏租赁 | 13,300 | 84,056.00 | 0.10 |
| 305 | 600316 | 洪都航空 | 6,416  | 83,600.48 | 0.10 |
| 306 | 601975 | 招商南油 | 29,700 | 83,457.00 | 0.10 |
| 307 | 600517 | 置信电气 | 10,079 | 83,050.96 | 0.10 |
| 308 | 600422 | 昆药集团 | 7,682  | 82,427.86 | 0.10 |
| 309 | 601611 | 中国核建 | 11,400 | 81,282.00 | 0.10 |
| 310 | 600125 | 铁龙物流 | 13,562 | 81,100.76 | 0.10 |
| 311 | 600682 | 南京新百 | 8,000  | 80,880.00 | 0.10 |
| 312 | 600748 | 上实发展 | 13,600 | 80,784.00 | 0.10 |
| 313 | 600859 | 王府井  | 5,756  | 80,526.44 | 0.10 |
| 314 | 600259 | 广晟有色 | 2,300  | 79,971.00 | 0.10 |
| 315 | 600110 | 诺德股份 | 17,039 | 79,742.52 | 0.10 |
| 316 | 600765 | 中航重机 | 7,794  | 79,732.62 | 0.10 |
| 317 | 600233 | 圆通速递 | 6,300  | 79,695.00 | 0.10 |
| 318 | 600562 | 国睿科技 | 5,550  | 79,587.00 | 0.10 |
| 319 | 600267 | 海正药业 | 7,953  | 78,814.23 | 0.10 |
| 320 | 600017 | 日照港  | 26,963 | 78,462.33 | 0.10 |
| 321 | 600582 | 天地科技 | 24,564 | 78,359.16 | 0.10 |
| 322 | 600073 | 上海梅林 | 9,802  | 78,121.94 | 0.10 |
| 323 | 600751 | 海航科技 | 26,600 | 77,938.00 | 0.10 |
| 324 | 600596 | 新安股份 | 7,839  | 77,135.76 | 0.09 |
| 325 | 601588 | 北辰实业 | 23,310 | 76,456.80 | 0.09 |
| 326 | 601222 | 林洋能源 | 15,675 | 76,180.50 | 0.09 |
| 327 | 600478 | 科力远  | 17,196 | 75,662.40 | 0.09 |
| 328 | 601011 | 宝泰隆  | 16,700 | 75,317.00 | 0.09 |
| 329 | 601200 | 上海环境 | 6,770  | 75,147.00 | 0.09 |
| 330 | 600312 | 平高电气 | 11,627 | 75,110.42 | 0.09 |
| 331 | 600993 | 马应龙  | 4,281  | 74,874.69 | 0.09 |
| 332 | 600317 | 营口港  | 28,711 | 73,213.05 | 0.09 |
| 333 | 600771 | 广誉远  | 4,300  | 72,928.00 | 0.09 |
| 334 | 603198 | 迎驾贡酒 | 3,600  | 71,712.00 | 0.09 |
| 335 | 600269 | 赣粤高速 | 17,292 | 71,415.96 | 0.09 |
| 336 | 601212 | 白银有色 | 19,300 | 71,024.00 | 0.09 |
| 337 | 600151 | 航天机电 | 14,900 | 70,626.00 | 0.09 |

|     |        |      |        |           |      |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 338 | 603323 | 苏农银行 | 13,340 | 70,568.60 | 0.09 |
| 339 | 600789 | 鲁抗医药 | 9,780  | 70,513.80 | 0.09 |
| 340 | 601666 | 平煤股份 | 17,500 | 70,350.00 | 0.09 |
| 341 | 600988 | 赤峰黄金 | 13,800 | 69,414.00 | 0.08 |
| 342 | 600846 | 同济科技 | 7,452  | 69,378.12 | 0.08 |
| 343 | 600366 | 宁波韵升 | 10,259 | 68,324.94 | 0.08 |
| 344 | 601828 | 美凯龙  | 6,027  | 68,285.91 | 0.08 |
| 345 | 600835 | 上海机电 | 4,117  | 68,218.69 | 0.08 |
| 346 | 600787 | 中储股份 | 13,025 | 67,860.25 | 0.08 |
| 347 | 600210 | 紫江企业 | 18,000 | 67,860.00 | 0.08 |
| 348 | 601326 | 秦港股份 | 21,200 | 67,628.00 | 0.08 |
| 349 | 601698 | 中国卫通 | 5,900  | 66,788.00 | 0.08 |
| 350 | 600108 | 亚盛集团 | 22,891 | 66,612.81 | 0.08 |
| 351 | 600783 | 鲁信创投 | 4,209  | 66,249.66 | 0.08 |
| 352 | 603568 | 伟明环保 | 2,867  | 65,768.98 | 0.08 |
| 353 | 600123 | 兰花科创 | 10,231 | 65,683.02 | 0.08 |
| 354 | 603888 | 新华网  | 3,100  | 65,410.00 | 0.08 |
| 355 | 601019 | 山东出版 | 9,300  | 64,635.00 | 0.08 |
| 356 | 600057 | 厦门象屿 | 15,482 | 64,250.30 | 0.08 |
| 357 | 600740 | 山西焦化 | 8,600  | 64,156.00 | 0.08 |
| 358 | 603515 | 欧普照明 | 2,280  | 64,090.80 | 0.08 |
| 359 | 600759 | 洲际油气 | 23,000 | 63,710.00 | 0.08 |
| 360 | 603377 | 东方时尚 | 3,480  | 63,544.80 | 0.08 |
| 361 | 600611 | 大众交通 | 15,550 | 63,133.00 | 0.08 |
| 362 | 601139 | 深圳燃气 | 7,991  | 62,569.53 | 0.08 |
| 363 | 600685 | 中船防务 | 4,241  | 62,554.75 | 0.08 |
| 364 | 603260 | 合盛硅业 | 2,120  | 62,476.40 | 0.08 |
| 365 | 600502 | 安徽建工 | 15,296 | 62,101.76 | 0.08 |
| 366 | 600116 | 三峡水利 | 8,073  | 61,274.07 | 0.07 |
| 367 | 600390 | 五矿资本 | 7,360  | 60,793.60 | 0.07 |
| 368 | 603881 | 数据港  | 1,600  | 60,720.00 | 0.07 |
| 369 | 601311 | 骆驼股份 | 6,400  | 60,032.00 | 0.07 |
| 370 | 600694 | 大商股份 | 2,183  | 59,792.37 | 0.07 |
| 371 | 601016 | 节能风电 | 24,600 | 59,286.00 | 0.07 |
| 372 | 603328 | 依顿电子 | 5,200  | 58,864.00 | 0.07 |
| 373 | 600020 | 中原高速 | 13,300 | 58,520.00 | 0.07 |
| 374 | 600175 | 美都能源 | 31,744 | 57,774.08 | 0.07 |
| 375 | 601069 | 西部黄金 | 3,800  | 57,380.00 | 0.07 |
| 376 | 603766 | 隆鑫通用 | 15,250 | 56,882.50 | 0.07 |

|     |        |      |        |           |      |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 377 | 600928 | 西安银行 | 7,200  | 55,944.00 | 0.07 |
| 378 | 601162 | 天风证券 | 7,600  | 55,936.00 | 0.07 |
| 379 | 600329 | 中新药业 | 3,957  | 54,844.02 | 0.07 |
| 380 | 603068 | 博通集成 | 600    | 54,042.00 | 0.07 |
| 381 | 600623 | 华谊集团 | 8,000  | 53,200.00 | 0.06 |
| 382 | 600006 | 东风汽车 | 11,553 | 52,912.74 | 0.06 |
| 383 | 600343 | 航天动力 | 5,752  | 52,630.80 | 0.06 |
| 384 | 600750 | 江中药业 | 4,181  | 52,387.93 | 0.06 |
| 385 | 601001 | 大同煤业 | 11,788 | 51,867.20 | 0.06 |
| 386 | 603113 | 金能科技 | 4,700  | 50,713.00 | 0.06 |
| 387 | 600757 | 长江传媒 | 8,186  | 50,425.76 | 0.06 |
| 388 | 600903 | 贵州燃气 | 3,400  | 50,252.00 | 0.06 |
| 389 | 601886 | 江河集团 | 6,861  | 49,810.86 | 0.06 |
| 390 | 600495 | 晋西车轴 | 11,816 | 49,627.20 | 0.06 |
| 391 | 603596 | 伯特利  | 2,200  | 49,500.00 | 0.06 |
| 392 | 601298 | 青岛港  | 7,200  | 49,464.00 | 0.06 |
| 393 | 600350 | 山东高速 | 10,000 | 49,100.00 | 0.06 |
| 394 | 601949 | 中国出版 | 7,700  | 48,741.00 | 0.06 |
| 395 | 601890 | 亚星锚链 | 8,500  | 48,620.00 | 0.06 |
| 396 | 600971 | 恒源煤电 | 8,080  | 48,318.40 | 0.06 |
| 397 | 601615 | 明阳智能 | 3,900  | 47,970.00 | 0.06 |
| 398 | 600338 | 西藏珠峰 | 3,820  | 47,750.00 | 0.06 |
| 399 | 600391 | 航发科技 | 3,431  | 47,382.11 | 0.06 |
| 400 | 600677 | 航天通信 | 5,400  | 47,088.00 | 0.06 |
| 401 | 600874 | 创业环保 | 6,433  | 46,253.27 | 0.06 |
| 402 | 600963 | 岳阳林纸 | 10,384 | 46,001.12 | 0.06 |
| 403 | 603613 | 国联股份 | 600    | 45,402.00 | 0.06 |
| 404 | 600571 | 信雅达  | 4,700  | 44,791.00 | 0.05 |
| 405 | 601908 | 京运通  | 14,829 | 44,487.00 | 0.05 |
| 406 | 600299 | 安迪苏  | 4,000  | 44,240.00 | 0.05 |
| 407 | 603236 | 移远通信 | 300    | 43,770.00 | 0.05 |
| 408 | 600569 | 安阳钢铁 | 17,000 | 43,350.00 | 0.05 |
| 409 | 603056 | 德邦股份 | 3,900  | 43,329.00 | 0.05 |
| 410 | 601952 | 苏垦农发 | 6,190  | 43,268.10 | 0.05 |
| 411 | 601003 | 柳钢股份 | 7,600  | 42,940.00 | 0.05 |
| 412 | 601869 | 长飞光纤 | 1,300  | 42,939.00 | 0.05 |
| 413 | 600096 | 云天化  | 8,100  | 42,930.00 | 0.05 |
| 414 | 600458 | 时代新材 | 6,000  | 42,300.00 | 0.05 |
| 415 | 688181 | 八亿时空 | 956    | 42,044.88 | 0.05 |

|     |        |      |        |           |      |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 416 | 601002 | 晋亿实业 | 7,050  | 41,454.00 | 0.05 |
| 417 | 600855 | 航天长峰 | 3,334  | 40,974.86 | 0.05 |
| 418 | 600581 | 八一钢铁 | 11,400 | 40,584.00 | 0.05 |
| 419 | 601858 | 中国科传 | 3,600  | 39,456.00 | 0.05 |
| 420 | 601330 | 绿色动力 | 3,700  | 39,331.00 | 0.05 |
| 421 | 600230 | 沧州大化 | 3,660  | 37,807.80 | 0.05 |
| 422 | 600335 | 国机汽车 | 6,500  | 37,700.00 | 0.05 |
| 423 | 600122 | 宏图高科 | 13,771 | 36,493.15 | 0.04 |
| 424 | 601606 | 长城军工 | 3,300  | 36,102.00 | 0.04 |
| 425 | 603983 | 丸美股份 | 600    | 36,018.00 | 0.04 |
| 426 | 603267 | 鸿远电子 | 700    | 35,917.00 | 0.04 |
| 427 | 601860 | 紫金银行 | 6,000  | 33,720.00 | 0.04 |
| 428 | 603379 | 三美股份 | 900    | 33,615.00 | 0.04 |
| 429 | 600929 | 湖南盐业 | 5,100  | 33,456.00 | 0.04 |
| 430 | 600996 | 贵广网络 | 4,100  | 33,005.00 | 0.04 |
| 431 | 600758 | 红阳能源 | 7,600  | 32,984.00 | 0.04 |
| 432 | 603980 | 吉华集团 | 3,920  | 32,340.00 | 0.04 |
| 433 | 600231 | 凌钢股份 | 11,700 | 32,292.00 | 0.04 |
| 434 | 603220 | 中贝通信 | 1,500  | 32,235.00 | 0.04 |
| 435 | 603225 | 新风鸣  | 2,552  | 31,517.20 | 0.04 |
| 436 | 603650 | 彤程新材 | 1,763  | 30,711.46 | 0.04 |
| 437 | 603587 | 地素时尚 | 1,200  | 30,456.00 | 0.04 |
| 438 | 601777 | 力帆股份 | 9,717  | 29,928.36 | 0.04 |
| 439 | 603317 | 天味食品 | 600    | 26,940.00 | 0.03 |
| 440 | 601865 | 福莱特  | 2,200  | 26,686.00 | 0.03 |
| 441 | 603868 | 飞科电器 | 700    | 26,376.00 | 0.03 |
| 442 | 603876 | 鼎胜新材 | 1,500  | 23,790.00 | 0.03 |
| 443 | 603103 | 横店影视 | 1,200  | 22,572.00 | 0.03 |
| 444 | 603421 | 鼎信通讯 | 1,300  | 22,516.00 | 0.03 |
| 445 | 601068 | 中铝国际 | 4,000  | 22,160.00 | 0.03 |
| 446 | 603105 | 芯能科技 | 2,900  | 20,735.00 | 0.03 |
| 447 | 603256 | 宏和科技 | 1,400  | 20,678.00 | 0.03 |
| 448 | 603327 | 福蓉科技 | 700    | 20,433.00 | 0.02 |
| 449 | 603693 | 江苏新能 | 1,900  | 19,342.00 | 0.02 |
| 450 | 601619 | 嘉泽新能 | 4,600  | 17,572.00 | 0.02 |
| 451 | 603603 | 博天环境 | 1,900  | 17,442.00 | 0.02 |
| 452 | 603619 | 中曼石油 | 1,200  | 16,728.00 | 0.02 |
| 453 | 603109 | 神驰机电 | 622    | 16,464.34 | 0.02 |
| 454 | 603733 | 仙鹤股份 | 1,000  | 14,260.00 | 0.02 |

|     |        |      |     |           |      |
|-----|--------|------|-----|-----------|------|
| 455 | 603279 | 景津环保 | 600 | 12,816.00 | 0.02 |
|-----|--------|------|-----|-----------|------|

注：股票明细不包含可退替代款估值增（减）值。

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 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  | 601169 | 北京银行 | 1,303,395.00 | 2.16           |
| 2  | 601229 | 上海银行 | 962,166.00   | 1.60           |
| 3  | 601006 | 大秦铁路 | 739,323.00   | 1.23           |
| 4  | 600019 | 宝钢股份 | 736,362.00   | 1.22           |
| 5  | 688111 | 金山办公 | 672,261.74   | 1.12           |
| 6  | 600029 | 南方航空 | 427,546.00   | 0.71           |
| 7  | 600989 | 宝丰能源 | 382,880.72   | 0.64           |
| 8  | 600547 | 山东黄金 | 370,434.00   | 0.62           |
| 9  | 600606 | 绿地控股 | 362,534.00   | 0.60           |
| 10 | 601108 | 财通证券 | 339,120.00   | 0.56           |
| 11 | 600100 | 同方股份 | 309,349.00   | 0.51           |
| 12 | 601800 | 中国交建 | 308,153.00   | 0.51           |
| 13 | 600900 | 长江电力 | 304,906.00   | 0.51           |
| 14 | 601872 | 招商轮船 | 251,316.00   | 0.42           |
| 15 | 600150 | 中国船舶 | 220,523.00   | 0.37           |
| 16 | 600895 | 张江高科 | 213,836.00   | 0.36           |
| 17 | 688025 | 杰普特  | 204,168.30   | 0.34           |
| 18 | 601899 | 紫金矿业 | 198,144.00   | 0.33           |
| 19 | 688196 | 卓越新能 | 191,124.36   | 0.32           |
| 20 | 600031 | 三一重工 | 183,384.00   | 0.30           |

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。

### 8.4.2 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  | 688111 | 金山办公 | 2,081,578.00 | 3.46           |
| 2  | 600837 | 海通证券 | 1,491,137.00 | 2.48           |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 3  | 600009 | 上海机场 | 1,203,134.80 | 2.00 |
| 4  | 600031 | 三一重工 | 1,042,520.75 | 1.73 |
| 5  | 601012 | 隆基股份 | 986,201.21   | 1.64 |
| 6  | 600547 | 山东黄金 | 488,429.60   | 0.81 |
| 7  | 600989 | 宝丰能源 | 414,052.00   | 0.69 |
| 8  | 688116 | 天奈科技 | 404,251.16   | 0.67 |
| 9  | 688188 | 柏楚电子 | 385,974.00   | 0.64 |
| 10 | 601111 | 中国国航 | 382,284.60   | 0.63 |
| 11 | 688321 | 微芯生物 | 372,400.00   | 0.62 |
| 12 | 688030 | 山石网科 | 362,212.30   | 0.60 |
| 13 | 688036 | 传音控股 | 353,112.50   | 0.59 |
| 14 | 688025 | 杰普特  | 274,645.00   | 0.46 |
| 15 | 600023 | 浙能电力 | 268,052.40   | 0.45 |
| 16 | 688068 | 热景生物 | 237,690.00   | 0.39 |
| 17 | 688368 | 晶丰明源 | 223,816.00   | 0.37 |
| 18 | 688168 | 安博通  | 215,178.60   | 0.36 |
| 19 | 688196 | 卓越新能 | 208,798.80   | 0.35 |
| 20 | 688166 | 博瑞医药 | 205,525.40   | 0.34 |

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。

#### 8.4.3 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 | 22,756,709.24 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 22,223,626.96 |

注：不考虑相关交易费用。

#### 8.5 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。

#### 8.6 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。

#### 8.7 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。

#### 8.8 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。

## 8.9 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。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.10.1 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。

### 8.10.2 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。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 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。

### 8.11.2 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。

### 8.11.3 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。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 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被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

### 8.12.2 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。

### 8.12.3 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   | 2,682.49 |
| 2  | 应收证券清算款 | -        |
| 3  | 应收股利    | -        |
| 4  | 应收利息    | 379.47   |
| 5  | 应收申购款   | -        |
| 6  | 其他应收款   | -        |
| 7  | 待摊费用    | -        |
| 8  | 其他      | -        |

|   |    |          |
|---|----|----------|
| 9 | 合计 | 3,061.96 |
|---|----|----------|

#### 8.12.4 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。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票未存在流通受限的情况。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

#### 9.1.1 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<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>额比例 | 持有份额         | 占总份<br>额比例 |
| 651          | 29,537.88     | 15,052,200.00 | 78.28%     | 4,176,961.00 | 21.72%     |

### 9.2 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 | 14,574,000.00 | 75.79% |

### 9.3 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<br>比例 |
|----|--|------------|--------------|
| 1  | 中海基金—西南证券股份有限公司—中海基金—浦发银行—睿阳恒盈单一资产管理计划 | 371,747.00 | 1.93%        |
| 2  | 钱中明                                    | 359,360.00 | 1.87%        |
| 3  | 黄颂雷                                    | 169,500.00 | 0.88%        |
| 4  | 徐钧                                     | 108,134.00 | 0.56%        |
| 5  | 郭秀琴                                    | 100,000.00 | 0.52%        |
| 6  | 钟鸣                                     | 100,000.00 | 0.52%        |
| 7  | 沈曙明                                    | 96,295.00  | 0.50%        |
| 8  | 西南证券股份有限公司                             | 82,980.00  | 0.43%        |
| 9  | 陈密                                     | 68,558.00  | 0.36%        |
| 10 | 王秀芬                                    | 65,240.00  | 0.34%        |

注：前十名持有人为除华泰柏瑞上证中小盘 ETF 联接基金之外的前十名持有人。

### 9.4 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%  |

注：本报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

### 9.5 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 |

## § 10 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              | 18,729,161.00  |
| 本报告期基金总申购份额               | 22,500,000.00  |
| 减:本报告期基金总赎回份额             | 22,000,000.00  |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）  | -              |
| 本报告期末基金份额总额               | 19,229,161.00  |

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 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

2019 年 3 月 11 日，公司股东批准 Anthony Gerard Fasso 先生担任公司董事。

2019 年 4 月 4 日，公司股东批准王永筠女士担任公司监事。

2019 年 4 月 15 日，经公司董事会批准刘万方先生担任公司副总经理。

2019 年 7 月 1 日，经公司董事会批准高山先生不再担任公司副总经理。

2019 年 11 月 25 日，公司股东批准陆春光先生担任公司董事，陆桢女士、李晗女士担任公司独立董事，翟军先生不再担任公司董事，沈志群先生、杨科先生不再担任公司独立董事。

上述人事变动已按相关规定备案、报告。

2019 年 5 月，陈四清先生因工作调动，辞去中国银行股份有限公司董事长职务。

2019 年 6 月，刘连舸先生任中国银行股份有限公司董事长职务。

上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

### 11.5 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（特殊普通合伙）。报告期内基金未改聘为其审计的会计师事务所。本报告期基金应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 60,000.00 元人民币，该事务所已向本基金提供了 9 年的审计服务。

### 11.6 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。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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      | 39,896,034.29 | 100.00%      | 37,072.79 | 100.00%    | -  |

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要，并能为基金提供全面的信息服务。
- 5) 具备研究实力，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、股票分析的研究报告及周到的信息服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告。

2、选择代理证券买卖的证券经营机构的程序

基金管理人根据以上标准进行考察后确定证券经营机构的选择。基金管理人与被选择的证券经营机构签订交易单元租用协议和证券研究服务协议。

### 11.7.2 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 | 62,334.20 | 100.00%      | -      | -              | -    | -            |

### 11.8 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 61 只证券投资基金修改基金合同和托管协议的公告 | 证监会指定报刊和网站 | 2019 年 12 月 30 日 |

|   |   |            |             |
|---|---|------------|-------------|
| 2 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于可对旗下在上海证券交易所上市的交易型开放式指数证券投资基金设置申购上限、赎回上限的公告 | 证监会指定报刊和网站 | 2019年12月18日 |
| 3 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于聘任上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金基金经理的公告                | 证监会指定报刊和网站 | 2019年11月7日  |
| 4 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于董事、监事、高级管理人员及其他从业人员子公司兼职情况公告                | 证监会指定报刊和网站 | 2019年7月3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                                 | 证监会指定报刊和网站 | 2019年7月3日   |
| 6 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票的公告                           | 证监会指定报刊和网站 | 2019年6月25日  |
| 7 | 华泰柏瑞基金管理有限公司关于聘任副总经理的公告                                   | 证监会指定报刊和网站 | 2019年4月16日  |

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 |                         |               |               |               | 报告期末持有基金情况    |        |
|-------|----------------|-------------------------|---------------|---------------|---------------|---------------|--------|
|       | 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   |
| 机构    | -              | -                       | -             | -             | -             | -             | -      |
| 个人    | 1              | 20190927-20191011       | 125,300.00    | 31,132,519.00 | 31,257,819.00 | 0.00          | 0.00%  |
| 联接基金  | 1              | 20190101-20191231       | 14,500,000.00 | 583,300.00    | 509,300.00    | 14,574,000.00 | 75.79% |

#### 产品特有风险

本基金报告期内有单一投资者持有基金份额超过 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。

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 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

### 13.2 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

### 13.3 查阅方式

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

华泰柏瑞基金管理有限公司

2020 年 3 月 30 日