# 上证红利交易型开放式指数证券投资基金 2019年半年度报告摘要

基金管理人:华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
送出日期:2019年8月29日

## §1 重要提示

1.1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年8月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自2019年1月1日起至2019年6月30日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

## §2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 华泰柏瑞上证红利ETF |
| 基金主代码 | 510880 |
| 基金运作方式 | 交易型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2006年11月17日 |
| 基金管理人 | 华泰柏瑞基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 招商银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 978,675,703.00份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |
| 基金份额上市的证券交易所 | 上海证券交易所 |
| 上市日期 | 2007年1月18日 |

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---|---|---|---|
| 名称 | | 华泰柏瑞基金管理有限公司 | 招商银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 陈晖 | 张燕 |
| | 联系电话 | 021-38601777 | 0755-83199084 |
| | 电子邮箱 | cs4008880001@hu-atai-pb.com | yan_zhang@cmbchina.com |
| 客户服务电话 | | 400-888-0001 | 95555 |
| 传真 | | 021-38601799 | 0755-83195201 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---|---|
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | http://www.huatai-pb.com |
| 基金半年度报告备置地点 | 上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼17层 |

## §3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2019年1月1日-2019年6月30日) |
|---|---|
| 本期已实现收益 | 79,658,349.71 |
| 本期利润 | 294,330,360.79 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.3121 |
| 本期基金份额净值增长率 | 12.11% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2019年6月30日) |
| 期末可供分配基金份额利润 | 1.2638 |
| 期末基金资产净值 | 2,730,388,329.23 |
| 期末基金份额净值 | 2.7899 |

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去一个月 | 2.81% | 0.83% | 1.51% | 0.83% | 1.30% | 0.00% |
| 过去三个月 | -4.59% | 1.22% | -6.78% | 1.22% | 2.19% | 0.00% |
| 过去六个月 | 12.11% | 1.25% | 9.72% | 1.25% | 2.39% | 0.00% |
| 过去一年 | 7.64% | 1.25% | 3.07% | 1.25% | 4.57% | 0.00% |
| 过去三年 | 31.04% | 0.93% | 16.90% | 0.94% | 14.14% | -0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 140.98% | 1.82% | 104.39% | 1.84% | 36.59% | -0.02% |

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

注:图示日期为2006年11月17日至2019年6月30日。

## §4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司(原友邦华泰基金管理有限公司)。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、华泰柏瑞价值精选30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。截至2019年6月30日,公司基金管理规模为1,030.82亿元。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理(助理)期限 任职日期 | 离任日期 | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| 柳军 | 指数投资部总监、基金的基金经理 | 2009年6月4日 | - | 18年 | 18年证券(基金)从业经历,复旦大学财务管理硕士,2000年至2001年在上海汽车集团财务有限公司从事财务工作,2001年至2004年任华安基金管理有限公司高级基金核算员,2004年7月起加入本公司,历任基金事务部总监、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月起任指数投资部副总监。2011年1月起担任上证中小盘ETF及华泰柏瑞上证中小盘ETF联接基金基金经理。2012年5月起担任华泰柏瑞沪深300ETF及华泰柏瑞沪深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500ETF及华泰柏瑞中证500ETF联接基金的基金经理。2018年3月至2018年11月任华泰柏瑞锐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。 |

| 李华孝 | 本基金基金经理助理 | 基金的基金经理 | 2017年11月9日 | - | 6年 | 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理助理。 |

注:证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。任职日期指基金管理公司作出决定之日。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期本基金与公司所管理的其他投资组合参与交易所公开竞价单边交易量超过该证券当日成交量5%的同日反向交易共1次。系因被动跟踪标的指数需要,与其他组合发生反向交易,不存在利益输送行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

今年上半年股票市场整体表现较佳,年初至四月中旬在政策面偏暖、外部环境缓和的背景下,A股市场走出了一波估值修复行情,市场量能出现了显著放大,部分概念和主题板块表现活跃。而在四月中旬以后,随着投资者在高位获利回吐以及外部不确定性增加,市场从高位开始回落。整个上半年,沪深300、中证500和创业板指分别上涨27.07%、18.77%和20.87%,成长风格总体表现要优于价值风格。分行业来看,食品饮料、非银金融和农林牧渔等板块涨幅居前,而建筑装饰、钢铁、传媒等板块则表现相对落后。

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2.395%,日均绝对跟踪偏离度为0.023%,期间日跟踪误差为0.063%,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2.7899元;本报告期基金份额净值增长率为12.11%,业绩比较基准收益率为9.72%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从目前市场表现来看,投资者风险偏好仍较低,以白酒为代表的消费股机构投资者抱团较为严重,部分抱团股的估值已经处于历史偏高水平,投资者对于这些股票的业绩抱有较为乐观预期,一旦未来它们业绩不及预期,容易发生踩踏风险,投资者需对其谨慎对待。考虑到当前市场情绪仍较为脆弱,建议投资者关注历史业绩稳定,当前估值水平较低且今年表现滞涨的高股息板块,以提升投资组合的确定性。

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内,基金管理人严格执行基金估值控制流程,定期评估估值技术的合理性,每日将估值结果报托管银行复核后对外披露。参与估值流程的人员包括负责运营的副总经理以及投资研究、风险控制、金融工程和基金事务部门负责人,基金经理不参与估值流程。参与人员的相关工作经历均在五年以上。参与各方之间不存在任何重大利益冲突。已采用的估值技术相关参数或定价服务均来自独立第三方。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定,基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率达到1%以上,方可进行收益分配。本基金已于2019年1月对2018年度可分配利润实施了分红,每10份基金份额派发现金红利0.98元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

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

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

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

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

本半年度报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

## §6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:上证红利交易型开放式指数证券投资基金
报告截止日:2019年6月30日

单位:人民币元

| 资产 | 本期末 2019年6月30日 | 上年度末 2018年12月31日 |
|---|---|---|
| 资产: | | |
| 银行存款 | 7,220,858.11 | 5,115,314.31 |
| 结算备付金 | 272,540.12 | - |
| 存出保证金 | 46,160.38 | 17,116.43 |
| 交易性金融资产 | 2,729,318,522.46 | 2,352,852,501.48 |
| 其中:股票投资 | 2,729,318,522.46 | 2,352,852,501.48 |
| 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 | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | - |
| 应收证券清算款 | - | 275,672.14 |
| 应收利息 | 1,080.64 | 1,048.00 |
| 应收股利 | - | - |
| 应收申购款 | - | - |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 2,736,859,161.71 | 2,358,261,652.36 |
| 负债和所有者权益 | 本期末 2019年6月30日 | 上年度末 2018年12月31日 |
| 负债: | | |
| 短期借款 | - | - |
| 交易性金融负债 | - | - |
| 衍生金融负债 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | - | - |
| 应付证券清算款 | 4,564,130.89 | - |
| 应付赎回款 | - | - |
| 应付管理人报酬 | 1,122,450.32 | 983,504.17 |
| 应付托管费 | 224,490.08 | 196,700.82 |
| 应付销售服务费 | - | - |
| 应付交易费用 | 31,654.13 | 1,299,332.20 |
| 应交税费 | - | - |
| 应付利息 | - | - |
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 528,107.06 | 700,000.00 |
| 负债合计 | 6,470,832.48 | 3,179,537.19 |
| 所有者权益: | | |
| 实收基金 | 1,493,524,945.33 | 1,390,515,405.58 |
| 未分配利润 | 1,236,863,383.90 | 964,566,709.59 |
| 所有者权益合计 | 2,730,388,329.23 | 2,355,082,115.17 |
| 负债和所有者权益总计 | 2,736,859,161.71 | 2,358,261,652.36 |

注:报告截止日2019年6月30日,基金份额净值2.7899元,基金份额总额978,675,703.00份。

6.2 利润表

会计主体:上证红利交易型开放式指数证券投资基金
本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2019年1月1日至2019年6月30日 | 上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日 |
|---|---|---|
| 一、收入 | 302,742,933.85 | -173,510,967.46 |
| 1.利息收入 | 23,657.47 | 16,409.15 |
| 其中:存款利息收入 | 23,657.47 | 16,409.15 |
| 债券利息收入 | - | - |
| 资产支持证券利息收入 | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | - | - |
| 其他利息收入 | - | - |
| 2.投资收益(损失以"-"填列) | 88,068,238.38 | 50,653,051.97 |
| 其中:股票投资收益 | 20,679,995.44 | 22,559,823.13 |
| 基金投资收益 | - | - |
| 债券投资收益 | - | - |
| 资产支持证券投资收益 | - | - |
| 贵金属投资收益 | - | - |
| 衍生工具收益 | - | - |
| 股利收益 | 67,388,242.94 | 28,093,228.84 |
| 3.公允价值变动收益(损失以"-"填列) | 214,672,011.08 | -224,170,786.88 |
| 4.汇兑收益(损失以"-"号填列) | - | - |
| 5.其他收入(损失以"-"号填列) | -20,973.08 | -9,641.70 |
| 减:二、费用 | 8,412,573.06 | 5,162,179.59 |
| 1. 管理人报酬 | 6,459,424.27 | 3,943,232.93 |
| 2. 托管费 | 1,291,884.83 | 788,646.58 |
| 3. 销售服务费 | - | - |
| 4. 交易费用 | 339,718.37 | 151,517.08 |
| 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 | 321,545.59 | 278,783.00 |
| 三、利润总额(亏损总额以"-"号填列) | 294,330,360.79 | -178,673,147.05 |
| 减:所得税费用 | - | - |
| 四、净利润(净亏损以"-"号填列) | 294,330,360.79 | -178,673,147.05 |

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:上证红利交易型开放式指数证券投资基金
本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2019年1月1日至2019年6月30日 | | |
|---|---|---|---|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益(基金净值) | 1,390,515,405.58 | 964,566,709.59 | 2,355,082,115.17 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 294,330,360.79 | 294,330,360.79 |
| 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) | 103,009,539.75 | 69,907,533.02 | 172,917,072.77 |
| 其中:1.基金申购款 | 466,976,580.63 | 377,830,150.90 | 844,806,731.53 |
| 2.基金赎回款 | -363,967,040.88 | -307,922,617.88 | -671,889,658.76 |
| 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) | - | -91,941,219.50 | -91,941,219.50 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 1,493,524,945.33 | 1,236,863,383.90 | 2,730,388,329.23 |
| 项目 | 上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日 | | |
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益(基金净值) | 699,969,971.96 | 723,697,153.18 | 1,423,667,125.14 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | -178,673,147.05 | -178,673,147.05 |
| 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) | 278,507,274.39 | 252,388,036.57 | 530,895,310.96 |
| 其中:1.基金申购款 | 415,090,294.00 | 389,075,573.19 | 804,165,867.19 |
| 2.基金赎回款 | -136,583,019.61 | -136,687,536.62 | -273,270,556.23 |
| 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) | - | -49,777,652.42 | -49,777,652.42 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 978,477,246.35 | 747,634,390.28 | 1,726,111,636.63 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

韩勇 房伟力 赵景云
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

上证红利交易型开放式指数证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监基金字[2006]第196号《关于同意上证红利交易型开放式指数证券投资基金募集的批复》核准,由华泰柏瑞基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《上证红利交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币2,222,962,819.00元(含募集股票市值),业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2006)第170号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《上证红利交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于2006年11月17日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为2,222,985,094.00份基金份额,其中认购资金利息折合22,275.00份基金份额。本基金的基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。根据《上证红利交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《上证红利交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金于2007年1月10日进行了基金份额折算,折算比例为0.65527799,并于2007年1月11日进行了变更登记。 经上海证券交易所(以下简称"上交所")上证债字[2007]第4号文审核同意,本基金1,456,675,703份基金份额于2007年1月18日在上交所挂牌交易。 根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《上证红利交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的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%。本基金的业绩基准为上证红利指数。

本财务报表由本基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于2019年8月29日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则-基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会公告[2010]5号《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号(年度报告和半年度报告)》、中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《上证红利交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注6.4.4所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2019年半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6月30日的财务状况以及2019年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估值与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错。

6.4.6 税项

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

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务,以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

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

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

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

6.4.7 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|---|---|
| 华泰柏瑞基金管理有限公司 | 基金管理人 |
| 招商银行股份有限公司 | 基金托管人 |
| 华泰证券股份有限公司 | 基金管理人的股东、一级交易商 |

注:1、关联方与基金进行的关联交易均在正常业务范围内按照一般商业条款而订立的。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

| 关联方名称 | 本期 2019年1月1日至2019年6月30日 | |
|---|---|---|
| | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 |
| 华泰证券 | 208,161,578.16 | 61.63% |

注:上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.8.1.2 权证交易

注:本报告期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

| 关联方名称 | 本期 2019年1月1日至2019年6月30日 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 当期佣金 | 占当期佣金总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例 |
| 华泰证券 | 27,329.74 | 21.81% | 27,329.74 | 86.34% |

注:上年度可比期间本基金未支付关联方佣金。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2019年1月1日至2019年6月30日 | 上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 6,459,424.27 | 3,943,232.93 |
| 其中:支付销售机构的客户维护费 | - | - |

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

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2019年1月1日至2019年6月30日 | 上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,291,884.83 | 788,646.58 |

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

6.4.8.2.3 销售服务费

注:本基金本期与上年度可比期间无发生关联方销售服务费。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:本基金本报告期内以及上年度可比期间内均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注:本报告期内与上年度可比期间,基金管理人未投资本基金。

6.4.8.4.2 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 2019年6月30日 | | 上年度末 2018年12月31日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 持有的基金份额 | 持有的基金份额占基金总份额的比例 | 持有的基金份额 | 持有的基金份额占基金总份额的比例 |
| 华泰证券股份有限公司 | 1,276,038.00 | 0.1304% | 1,695,730.00 | 0.1861% |

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

| 关联方名称 | 本期 2019年1月1日至2019年6月30日 | | 上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 招商银行股份有限公司 | 7,220,858.11 | 10,783.49 | 6,194,311.55 | 11,164.07 |

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

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本基金在本报告期内及上年可比期间内未参与关联方承销证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金在本报告期内及上年可比期间未有其他关联交易事项。

6.4.9 期末(2019年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别:股票 | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 可流通日 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量(单位:股) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 601236 | 红塔证券 | 2019年6月26日 | 2019年7月5日 | 新股流通受限 | 3.46 | 3.46 | 9,789 | 33,869.94 | 33,869.94 | - |

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:截至本报告期末,本基金未持有流通受限的股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券余额0元,无债券作为质押。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末,本基金从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券余额0元,无债券作为质押。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## §7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 2,729,318,522.46 | 99.72 |
| | 其中:股票 | 2,729,318,522.46 | 99.72 |
| 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 | 7,493,398.23 | 0.27 |
| 8