

# 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 2019年半年度报告

2019年6月30日

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2019年8月29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。

基金托管人中国建设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。

## 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 主要财务指标和基金净值表现</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 其他指标.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	14
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	15
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>16</b>
6.1 资产负债表.....	16

<a href="#">6.2 利润表</a> .....	17
<a href="#">6.3 所有者权益（基金净值）变动表</a> .....	18
<a href="#">6.4 报表附注</a> .....	19
<b><a href="#">§7 投资组合报告</a></b> .....	<b>45</b>
<a href="#">7.1 期末基金资产组合情况</a> .....	45
<a href="#">7.2 期末按行业分类的股票投资组合</a> .....	45
<a href="#">7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细</a> .....	46
<a href="#">7.4 报告期内股票投资组合的重大变动</a> .....	53
<a href="#">7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合</a> .....	54
<a href="#">7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细</a> .....	55
<a href="#">7.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细</a> .....	55
<a href="#">7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细</a> .....	55
<a href="#">7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细</a> .....	55
<a href="#">7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明</a> .....	55
<a href="#">7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明</a> .....	55
<a href="#">7.12 投资组合报告附注</a> .....	55
<b><a href="#">§8 基金份额持有人信息</a></b> .....	<b>57</b>
<a href="#">8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构</a> .....	57
<a href="#">8.2 期末上市基金前十名持有人</a> .....	57
<a href="#">8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况</a> .....	57
<a href="#">8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况</a> .....	57
<b><a href="#">§9 开放式基金份额变动</a></b> .....	<b>59</b>
<b><a href="#">§10 重大事件揭示</a></b> .....	<b>60</b>
<a href="#">10.1 基金份额持有人大会决议</a> .....	60
<a href="#">10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动</a> .....	60
<a href="#">10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼</a> .....	60
<a href="#">10.4 基金投资策略的改变</a> .....	60
<a href="#">10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况</a> .....	60
<a href="#">10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况</a> .....	60
<a href="#">10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况</a> .....	61

---

<a href="#">10.8 其他重大事件</a> .....	63
<b><a href="#">§11 影响投资者决策的其他重要信息</a>.....</b>	<b>63</b>
<a href="#">11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况</a> .....	63
<a href="#">11.2 影响投资者决策的其他重要信息</a> .....	64
<b><a href="#">备查文件目录</a>.....</b>	<b>65</b>
<a href="#">11.3 备查文件目录</a> .....	65
<a href="#">11.4 存放地点</a> .....	65
<a href="#">11.5 查阅方式</a> .....	65

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	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
基金简称	MSCIETF
场内简称	MSCIETF
基金主代码	512520
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年4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	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	383,056,394.00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	2018年5月18日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金力争将日均跟踪偏离度控制在0.2%以内，年化跟踪误差控制在2%以内。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。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	本基金的业绩比较基准为标的指数，即MSCI中国A股国际通指数收益率。
风险收益特征	本基金属于股票型基金中的指数型基金，采用完全复制的被动式投资策略：一方面，相对于混合型基金、债券型基金与货币市场基金而言，其风险和收益较高；另一方面，相对于采用抽样复制的指数型基金而言，其风险和收益特征将更能与标的指数保持基本一致。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华泰柏瑞基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈晖	田青
	联系电话	021-38601777	010-67595096
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-888-0001	010-67595096
传真		021-38601799	010-66275853
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	北京市西城区金融大街25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	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		200135	100033
法定代表人		贾波	田国立

## 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
登载基金半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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京西城区金融大街27号投资广场22-23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	33,779,142.52
本期利润	215,636,589.04
加权平均基金份额本期利润	0.2761
本期加权平均净值利润率	28.77%
本期基金份额净值增长率	26.76%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配利润	12,919,619.42
期末可供分配基金份额利润	0.0337
期末基金资产净值	395,976,013.42
期末基金份额净值	1.0337
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)
基金份额累计净值增长率	3.37%

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。

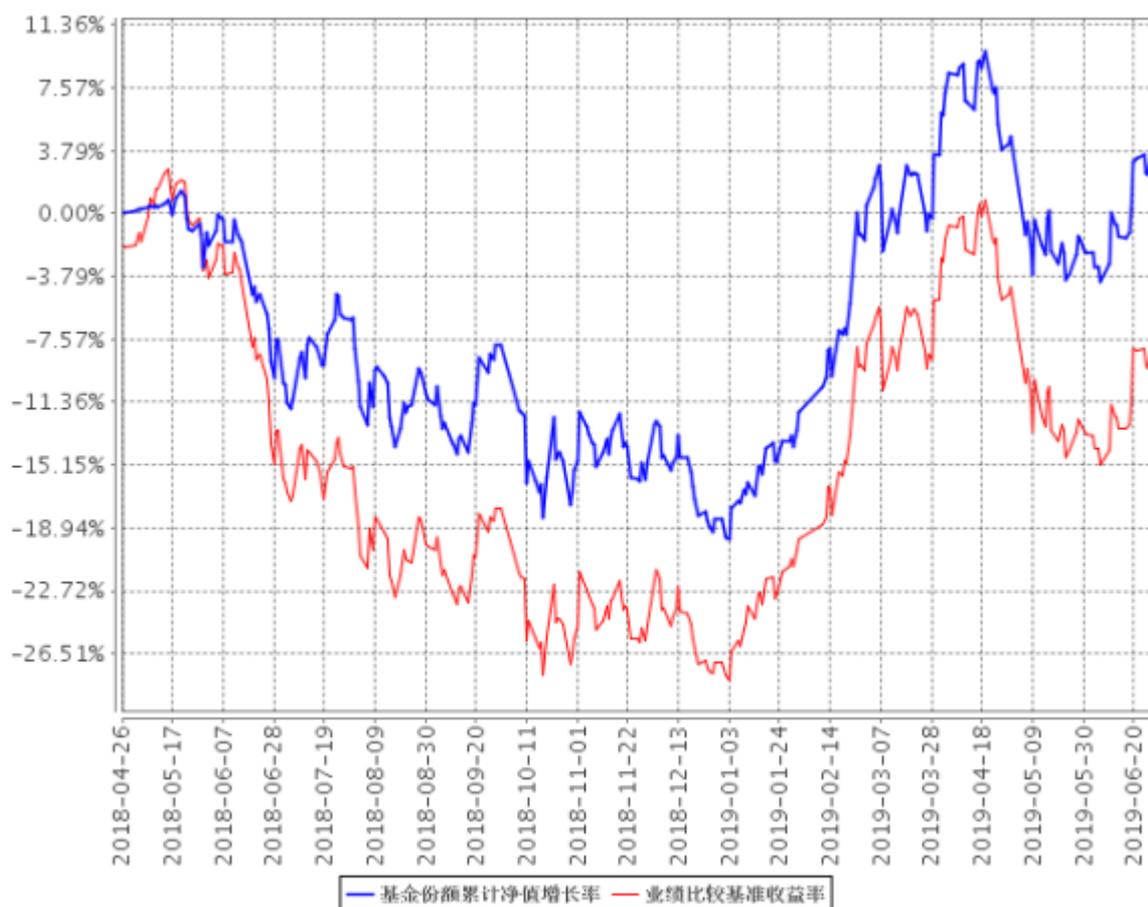
### 3.2 基金净值表现

#### 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	5.90%	1.14%	5.64%	1.29%	0.26%	-0.15%
过去三个月	-0.14%	1.49%	-3.38%	1.63%	3.24%	-0.14%
过去六个月	26.76%	1.51%	25.45%	1.62%	1.31%	-0.11%
过去一年	11.87%	1.50%	5.33%	1.63%	6.54%	-0.13%
自基金合同生效起至今	3.37%	1.44%	-8.42%	1.58%	11.79%	-0.14%

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、图示日期为2018年4月26日（基金合同生效日）至2019年6月30日。

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

## §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证券投资基金、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。截至2019年6月30日，公司基金管理规模为1030.82亿元。

#### 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		证券从业年限	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	2018年4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。

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

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司将投资管理职能和交易执行职能完全隔离，实行集中交易制度，由交易部为公募基金、专户理财和海外投资等业务统一交易服务，为公平交易的实施提供了较好的保障。目前公司公募基金、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1.240%，日均绝对跟踪偏离度为0.014%，期间日跟踪误差为0.028%，较好地实现了本基金的投资目标。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为1.0337元；本报告期基金份额净值增长率为26.76%，业绩比较基准收益率为25.45%。

#### 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。本报告期内，本基金未进行利润分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

### 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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

### 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

本托管人复核审查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。

## §6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞MSCI中国A股国际通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	附注号	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	3,952,310.11	1,880,598.57
结算备付金		423,594.50	3,873,978.71
存出保证金		97,558.81	58,919.46
交易性金融资产	6.4.7.2	393,948,978.02	852,126,428.90
其中：股票投资		393,948,978.02	852,126,428.90
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	1,341,378.76
应收利息	6.4.7.5	1,765.48	1,579.99
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-

其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		398,424,206.92	859,282,884.39
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019年6月30日</b>	<b>上年度末 2018年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	65,962.20
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1,056,369.26	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		106,285.65	360,833.80
应付托管费		26,909.80	89,125.63
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	71,612.06	64,926.83
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	1,187,016.73	1,534,256.11
负债合计		2,448,193.50	2,115,104.57

<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	383,056,394.00	1,051,056,394.00
未分配利润	6.4.7.10	12,919,619.42	-193,888,614.18
所有者权益合计		395,976,013.42	857,167,779.82
负债和所有者权益总计		398,424,206.92	859,282,884.39

注：报告截止日2019年6月30日，基金份额净值1.0337元，基金份额总额383,056,394.00份。

## 6.2 利润表

会计主体：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

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	附注号	本期 2019年1月1日 至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年4月26日(基金合 同生效日)至2018年6 月30日
<b>一、收入</b>		218,601,012.47	-71,546,823.60
1.利息收入		18,408.82	1,681,786.89
其中：存款利息收入	6.4.7.11	18,374.93	406,574.77
债券利息收入		33.89	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	1,275,212.12
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		36,233,045.78	6,964,644.79
其中：股票投资收益	6.4.7.12	31,756,093.73	-3,078,613.56
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	11,817.70	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-

股利收益	6.4.7.16	4,465,134.35	10,043,258.35
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	181,857,446.52	-81,391,589.71
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	492,111.35	1,198,334.43
<b>减：二、费用</b>		2,964,423.43	3,622,255.16
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,770,050.75	1,082,563.18
2. 托管费	6.4.10.2.2	359,662.82	216,512.64
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	448,092.25	2,100,569.02
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.11	-
7. 其他费用	6.4.7.20	386,617.50	222,610.32
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		215,636,589.04	-75,169,078.76
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		215,636,589.04	-75,169,078.76

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：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

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）	1,051,056,394.00	-193,888,614.18	857,167,779.82
二、本期经营活动产生的	-	215,636,589.04	215,636,589.04

基金净值变动数（本期利润）			
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）	-668,000,000.00	-8,828,355.44	-676,828,355.44
其中：1. 基金申购款	176,000,000.00	-7,381,327.77	168,618,672.23
2. 基金赎回款	-844,000,000.00	-1,447,027.67	-845,447,027.67
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）	383,056,394.00	12,919,619.42	395,976,013.42
项目	上年度可比期间 2018年4月26日（基金合同生效日）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）	1,547,056,394.00	-	1,547,056,394.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-75,169,078.76	-75,169,078.76
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）	-572,000,000.00	1,085,836.16	-570,914,163.84
其中：1. 基金申购款	40,000,000.00	-692,506.20	39,307,493.80
2. 基金赎回款	-612,000,000.00	1,778,342.36	-610,221,657.64
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）	975,056,394.00	-74,083,242.60	900,973,151.40

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 韩勇 _____	_____ 房伟力 _____	_____ 赵景云 _____
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2018]501号《关于准予华泰柏瑞MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》核准,由华泰柏瑞基金管理有限公

司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞MSCI中国A股国际通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1,547,024,828.00元(含募集股票市值)，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2018)第0284号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《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基金合同》于2018年4月26日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为1,547,056,394.00份基金份额，其中认购资金利息折合31,566.00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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律管理决定书[2018]58号文审核同意，本基金1,547,056,394.00份基金份额于2018年5月18日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股(包括中小板、创业板以及其他经中国证监会核准发行的股票)、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%，且不低于基金非现金资产的80%。在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度(剔除成份股分红因素)的绝对值不超过0.2%，年跟踪误差不超过2%。本基金的业绩比较基准为MSCI中国A股国际通指数收益率。

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”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华

泰柏瑞MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 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1月1日至2019年6月30日止期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2019年6月30日的财务状况以及2019年1月1日至2019年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

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。

#### 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。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票的转让收入免征增值税。对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，包括买卖股票的差价收入，股票的股息、红利收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 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 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
活期存款	3,952,310.11
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：	3,952,310.11

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	370,376,767.12	393,948,978.02	23,572,210.90
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	370,376,767.12	393,948,978.02	23,572,210.90

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应收活期存款利息	1,530.98
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	190.60
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	-
其他	43.90
合计	1,765.48

#### 6.4.7.6 其他资产

注：无。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2019年6月30日
交易所市场应付交易费用	71,612.06
银行间市场应付交易费用	-
合计	71,612.06

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	197,364.21
应付指数使用费	434,164.94
应付替代款	555,487.58
合计	1,187,016.73

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,051,056,394.00	1,051,056,394.00
本期申购	176,000,000.00	176,000,000.00
本期赎回(以“-”号填列)	-844,000,000.00	-844,000,000.00
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	383,056,394.00	383,056,394.00

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-19,920,130.19	-173,968,483.99	-193,888,614.18
本期利润	33,779,142.52	181,857,446.52	215,636,589.04
本期基金份额交易产生的变动数	1,863,852.67	-10,692,208.11	-8,828,355.44
其中：基金申购款	-2,015,909.92	-5,365,417.85	-7,381,327.77
基金赎回款	3,879,762.59	-5,326,790.26	-1,447,027.67
本期已分配利润	-	-	-
本期末	15,722,865.00	-2,803,245.58	12,919,619.42

**6.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
活期存款利息收入	14,306.45
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	3,511.45
其他	557.03
合计	18,374.93

**6.4.7.12 股票投资收益****6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	5,334,506.68
股票投资收益——赎回差价收入	26,421,587.05
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	31,756,093.73

**6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出股票成交总额	294,480,128.15
减：卖出股票成本总额	289,145,621.47
买卖股票差价收入	5,334,506.68

**6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
赎回基金份额对价总额	845,447,027.67
减：现金支付赎回款总额	236,849,387.67
减：赎回股票成本总额	582,176,052.95
赎回差价收入	26,421,587.05

**6.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入**

注：无。

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

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	11,817.70
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	11,817.70

**6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	285,852.60
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	274,000.00
减：应收利息总额	34.90
买卖债券差价收入	11,817.70

**6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入**

注：无。

**6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入**

注：无。

**6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益**

注：无。

**6.4.7.14 贵金属投资收益****6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

注：无。

**6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

注：无。

**6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

注：无。

**6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

注：无。

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

注：无。

**6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

注：无。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	4,465,134.35
基金投资产生的股利收益	-
合计	4,465,134.35

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
1. 交易性金融资产	181,857,446.52
——股票投资	181,857,446.52
——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	181,857,446.52

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	492,111.35
合计	492,111.35

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
交易所市场交易费用	448,092.25
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	448,092.25

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
审计费用	48,596.69
信息披露费	119,014.74
银行划款手续费	2,356.04
上市费	29,752.78
指数使用费	186,897.25
合计	386,617.50

#### 6.4.7.21 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计

信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无其它需作披露的资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华泰柏瑞基金管理有限公司	基金管理人
中国建设银行股份有限公司	基金托管人
华泰证券股份有限公司（“华泰证券”）	基金管理人的股东、一级交易商

注：关联方与基金进行的关联交易均在正常业务范围内按照一般商业条款而订立的。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年4月26日(基金合同生效日) 至2018年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
华泰证券	365,979,694.85	88.82%	1,670,351,770.32	95.02%

#### 6.4.10.1.2 权证交易

注：无。

### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	82,425.03	70.42%	70,799.95	98.87%
关联方名称	上年度可比期间 2018年4月26日(基金合同生效日)至2018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	1,542,955.86	95.02%	1,542,955.86	95.02%

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年4月26日(基金合同生效日)至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,770,050.75	1,082,563.18
其中：支付销售机构的客户维护费	57,562.20	-

注：自2019年6月10日起，华泰柏瑞MSCI ETF的管理费率由0.50%调低至0.15%。

本基金应支付基金管理人报酬，按前一日基金资产净值的0.15%的年费率计提，计算方法如下：

$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$  H为每日应支付的管理人报酬 E为前一日的基金资产净值 基金管理人报酬每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前三个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年4月26日(基金合同生效日)至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	359,662.82	216,512.64

注：自2019年6月10日起，华泰柏瑞MSCI ETF的托管费率由0.10%调低至0.05%。

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0.05%的年费率计提，计算方法如下： $H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$  H为每日应支付的托管费 E为前一日的基金资产净值 基金托管费每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前三个工作日内从基金资产中一次性支取。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

注：本基金本期与上年度可比期间无发生关联方销售服务费。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本期与上年度可比期间与关联方未进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

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4月26日(基金合同生效日) 至2018年6月30日
基金合同生效日(2018年4月26日)持有的基金份额	2,000.00	2,000.00
期初持有的基金份额	0.00	0.00
期间申购/买入总份额	0.00	0.00
期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：期间赎回/卖出总份额	0.00	2,000.00
期末持有的基金份额	0.00	0.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.0000%	0.0000%

注：本报告期内，基金管理人未投资本基金。

##### 6.4.10.4.2 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	2,146,102.00	0.5603%	6,123,574.00	0.5826%
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	53,084,813.00	13.8582%	68,153,100.00	6.4842%

金				
---	--	--	--	--

#### 6.4.10.5 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4月26日(基金合同生效日)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
中国建设银行股份 有限公司	3,952,310.11	14,306.45	10,651,316.31	373,394.17

注：本基金的银行存款由基金托管人建设银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本期与上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

注：本基金本报告期与上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2019年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	可流 通日	流通受 限类型	认购 价格	期末估 值单价	数量 (单位： 股)	期末 成本总额	期末估值 总额	备注
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	-
300788	中信 出版	2019年6 月27日	2019 年7 月5日	新股流 通受限	14.85	14.85	1,556	23,106.60	23,106.60	-

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2019年6月30日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券余额0元，无债券作为质押。

### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2019年6月30日止，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。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为被动式指数基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金，主要投资于标的指数成份股和备选成份股。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，力争实现保持基金净值增长率与标的指数增长率间的高度正相关，并保持跟踪误差在合同约定的范围内。

本基金的基金管理人建立的风险管理体系由“组织、制度、流程和报告”等四个方面构成。组织是指公司的风险管理组织架构包括董事会下设的风险管理与审计委员会、公司管理层的风险控制委员会、风险管理部和法律监察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。

### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国建设银行，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6月30日，本基金无债券投资（2018年12月31日：同）。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：无。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

于2019年6月30日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息。本基金赎回基金份额采用一篮子股票形式，流动性风险相对较低。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

#### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自2017年10月1日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注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6月30日，本基金未持有流动性受限资产。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。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	3,952,310.11	-	-	-	-	-	3,952,310.11
结算备付金	423,594.50	-	-	-	-	-	423,594.50
存出保证金	97,558.81	-	-	-	-	-	97,558.81
交易性金融资产	-	-	-	-	-	393,948,978.02	393,948,978.02

应收利息	-	-	-	-	-	1,765.48	1,765.48
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	4,473,463.42	-	-	-	-	393,950,743.50	398,424,206.92
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	1,056,369.26	1,056,369.26
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	106,285.65	106,285.65
应付托管费	-	-	-	-	-	26,909.80	26,909.80
应付交易费用	-	-	-	-	-	71,612.06	71,612.06
其他负债	-	-	-	-	-	1,187,016.73	1,187,016.73
负债总计	-	-	-	-	-	2,448,193.50	2,448,193.50
利率敏感度缺口	4,473,463.42	-	-	-	-	-391,502,550.00	395,976,013.42
上年度末 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	1,880,598.57	-	-	-	-	-	1,880,598.57
结算备付金	3,873,978.71	-	-	-	-	-	3,873,978.71
存出保证金	58,919.46	-	-	-	-	-	58,919.46
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-852,126,428.90	852,126,428.90
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,341,378.76	1,341,378.76
应收利息	-	-	-	-	-	1,579.99	1,579.99
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	5,813,496.74	-	-	-	-	-853,469,387.65	859,282,884.39
负债	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	65,962.20	65,962.20
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	360,833.80	360,833.80
应付托管费	-	-	-	-	-	89,125.63	89,125.63
应付交易费用	-	-	-	-	-	64,926.83	64,926.83
其他负债	-	-	-	-	-	1,534,256.11	1,534,256.11
负债总计	-	-	-	-	-	2,115,104.57	2,115,104.57
利率敏感度缺口	5,813,496.74	-	-	-	-	-851,354,283.08	857,167,779.82

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于2019年6月30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）。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金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。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%，且不低于基金非现金资产的80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日		上年度末 2018年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	393,948,978.02	99.49	852,126,428.90	99.41
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	-	-	-65,962.20	-0.01
合计	393,948,978.02	99.49	852,060,466.70	99.40

注：其他为可退替代款。

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除MSCI 中国 A 股国际通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6月30日）	上年度末（2018年12月31日）

		日 )	
	MSCI 中国 A 股国际通指数 上升5%	18,226,457.00	38,624,714.00
	MSCI 中国 A 股国际通指数 下降5%	-18,226,457.00	-38,624,714.00

#### 6.4.13.1.4 采用风险价值法管理风险

注：无。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

注：无。

## §7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	393,948,978.02	98.88
	其中：股票	393,948,978.02	98.88
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	4,375,904.61	1.10
8	其他各项资产	99,324.29	0.02
9	合计	398,424,206.92	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	5,192,846.00	1.31
B	采矿业	15,342,699.31	3.87
C	制造业	154,496,373.35	39.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,171,622.23	2.82
E	建筑业	11,562,120.05	2.92
F	批发和零售业	7,348,280.08	1.86
G	交通运输、仓储和邮政业	10,855,981.39	2.74
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,310,012.07	4.12
J	金融业	130,332,436.96	32.91
K	房地产业	19,904,918.56	5.03
L	租赁和商务服务业	5,606,566.05	1.42
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	339,493.05	0.09
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	3,150,644.86	0.80
R	文化、体育和娱乐业	2,334,984.06	0.59
S	综合	-	-
	合计	393,948,978.02	99.49

## 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	24,648	24,253,632.00	6.13
2	601318	中国平安	203,220	18,007,324.20	4.55
3	600036	招商银行	387,754	13,951,388.92	3.52
4	000858	五粮液	73,506	8,670,032.70	2.19
5	601166	兴业银行	389,982	7,132,770.78	1.80
6	600000	浦发银行	554,489	6,476,431.52	1.64
7	601398	工商银行	1,019,717	6,006,133.13	1.52
8	600276	恒瑞医药	84,192	5,556,672.00	1.40
9	000002	万科A	182,969	5,088,367.89	1.29
10	601288	农业银行	1,404,177	5,055,037.20	1.28
11	002415	海康威视	176,879	4,878,322.82	1.23
12	600900	长江电力	272,350	4,875,065.00	1.23
13	601668	中国建筑	795,104	4,571,848.00	1.15
14	603288	海天味业	43,260	4,542,300.00	1.15
15	601328	交通银行	738,564	4,520,011.68	1.14
16	000001	平安银行	322,529	4,444,449.62	1.12
17	600030	中信证券	183,764	4,375,420.84	1.10
18	601601	中国太保	118,900	4,341,039.00	1.10
19	600016	民生银行	668,756	4,246,600.60	1.07
20	600887	伊利股份	114,524	3,826,246.84	0.97
21	600104	上汽集团	146,429	3,733,939.50	0.94
22	601766	中国中车	458,309	3,707,719.81	0.94
23	300498	温氏股份	101,200	3,629,032.00	0.92
24	002304	洋河股份	29,600	3,598,176.00	0.91
25	600050	中国联通	582,267	3,586,764.72	0.91
26	000333	美的集团	66,080	3,426,908.80	0.87
27	601888	中国国旅	36,799	3,262,231.35	0.82
28	000651	格力电器	56,521	3,108,655.00	0.79
29	600585	海螺水泥	74,686	3,099,469.00	0.78
30	600048	保利地产	223,610	2,853,263.60	0.72
31	601818	光大银行	747,827	2,849,220.87	0.72

32	601688	华泰证券	124,700	2,783,304.00	0.70
33	601211	国泰君安	142,921	2,622,600.35	0.66
34	600028	中国石化	476,730	2,607,713.10	0.66
35	001979	招商蛇口	122,958	2,569,822.20	0.65
36	601988	中国银行	659,895	2,468,007.30	0.62
37	601229	上海银行	203,453	2,410,918.05	0.61
38	601989	中国重工	429,000	2,385,240.00	0.60
39	002142	宁波银行	98,388	2,384,925.12	0.60
40	000568	泸州老窖	29,187	2,359,185.21	0.60
41	601169	北京银行	394,755	2,333,002.05	0.59
42	600019	宝钢股份	350,670	2,279,355.00	0.58
43	601006	大秦铁路	277,557	2,245,436.13	0.57
44	000725	京东方A	634,996	2,184,386.24	0.55
45	601336	新华保险	39,500	2,173,685.00	0.55
46	601186	中国铁建	217,529	2,164,413.55	0.55
47	600837	海通证券	152,454	2,163,322.26	0.55
48	000063	中兴通讯	65,900	2,143,727.00	0.54
49	601857	中国石油	302,183	2,079,019.04	0.53
50	002024	苏宁易购	175,800	2,018,184.00	0.51
51	600690	海尔智家	114,402	1,978,010.58	0.50
52	002475	立讯精密	77,509	1,921,448.11	0.49
53	600031	三一重工	146,737	1,919,319.96	0.48
54	601933	永辉超市	181,820	1,856,382.20	0.47
55	600999	招商证券	107,923	1,844,404.07	0.47
56	600015	华夏银行	239,077	1,840,892.90	0.46
57	600340	华夏幸福	55,925	1,821,477.25	0.46
58	300015	爱尔眼科	57,750	1,788,517.50	0.45
59	000166	申万宏源	352,411	1,765,579.11	0.45
60	601155	新城控股	43,530	1,732,929.30	0.44
61	002594	比亚迪	33,771	1,712,865.12	0.43
62	601088	中国神华	83,700	1,705,806.00	0.43
63	000538	云南白药	19,765	1,648,796.30	0.42
64	600406	国电南瑞	86,600	1,614,224.00	0.41
65	300059	东方财富	119,100	1,613,805.00	0.41
66	600919	江苏银行	219,276	1,591,943.76	0.40
67	601012	隆基股份	68,408	1,580,908.88	0.40
68	002714	牧原股份	26,600	1,563,814.00	0.39
69	600009	上海机场	18,214	1,525,968.92	0.39
70	000776	广发证券	110,966	1,524,672.84	0.39

71	601628	中国人寿	52,020	1,473,206.40	0.37
72	002027	分众传媒	274,442	1,451,798.18	0.37
73	600010	包钢股份	854,244	1,443,672.36	0.36
74	600547	山东黄金	34,673	1,427,487.41	0.36
75	601225	陕西煤业	154,289	1,425,630.36	0.36
76	000876	新希望	80,107	1,391,458.59	0.35
77	000338	潍柴动力	112,161	1,378,458.69	0.35
78	601939	建设银行	182,236	1,355,835.84	0.34
79	601009	南京银行	161,264	1,332,040.64	0.34
80	002230	科大讯飞	39,672	1,318,697.28	0.33
81	603993	洛阳钼业	332,782	1,317,816.72	0.33
82	601985	中国核电	235,994	1,312,126.64	0.33
83	600436	片仔癀	11,300	1,301,760.00	0.33
84	000895	双汇发展	52,037	1,295,200.93	0.33
85	600741	华域汽车	59,820	1,292,112.00	0.33
86	600588	用友网络	47,480	1,276,262.40	0.32
87	601669	中国电建	237,647	1,257,152.63	0.32
88	600029	南方航空	160,000	1,235,200.00	0.31
89	601899	紫金矿业	323,356	1,219,052.12	0.31
90	600958	东方证券	111,921	1,195,316.28	0.30
91	600115	东方航空	182,710	1,145,591.70	0.29
92	600809	山西汾酒	16,100	1,111,705.00	0.28
93	601901	方正证券	155,767	1,107,503.37	0.28
94	600332	白云山	26,879	1,101,232.63	0.28
95	600018	上港集团	161,306	1,100,106.92	0.28
96	000069	华侨城A	154,043	1,070,598.85	0.27
97	600606	绿地控股	152,124	1,039,006.92	0.26
98	600438	通威股份	73,400	1,032,004.00	0.26
99	600383	金地集团	86,400	1,030,752.00	0.26
100	300122	智飞生物	23,900	1,030,090.00	0.26
101	002736	国信证券	77,025	1,013,649.00	0.26
102	600570	恒生电子	14,871	1,013,458.65	0.26
103	601618	中国中冶	330,300	1,004,112.00	0.25
104	600886	国投电力	127,945	994,132.65	0.25
105	600352	浙江龙盛	61,820	974,901.40	0.25
106	600893	航发动力	42,905	974,372.55	0.25
107	601600	中国铝业	246,100	964,712.00	0.24
108	600061	国投资本	68,200	955,482.00	0.24
109	600196	复星医药	37,577	950,698.10	0.24

110	300750	宁德时代	13,800	950,544.00	0.24
111	601877	正泰电器	41,155	950,268.95	0.24
112	600795	国电电力	369,900	939,546.00	0.24
113	300033	同花顺	9,500	934,420.00	0.24
114	600705	中航资本	166,484	902,343.28	0.23
115	601138	工业富联	72,900	878,445.00	0.22
116	600111	北方稀土	67,467	866,276.28	0.22
117	600703	三安光电	76,426	862,085.28	0.22
118	600660	福耀玻璃	37,541	853,306.93	0.22
119	000100	TCL 集团	255,822	851,887.26	0.22
120	601377	兴业证券	125,618	846,665.32	0.21
121	601788	光大证券	73,100	834,802.00	0.21
122	000963	华东医药	32,096	833,212.16	0.21
123	603833	欧派家居	7,700	828,674.00	0.21
124	000768	中航飞机	52,346	824,449.50	0.21
125	000783	长江证券	105,500	823,955.00	0.21
126	002422	科伦药业	27,632	821,499.36	0.21
127	002202	金风科技	65,983	820,168.69	0.21
128	300142	沃森生物	28,900	819,604.00	0.21
129	002236	大华股份	55,900	811,668.00	0.20
130	600271	航天信息	35,204	811,452.20	0.20
131	600926	杭州银行	96,402	803,028.66	0.20
132	601727	上海电气	146,300	787,094.00	0.20
133	002146	荣盛发展	83,351	782,665.89	0.20
134	601021	春秋航空	17,200	774,000.00	0.20
135	002352	顺丰控股	22,467	762,979.32	0.19
136	600085	同仁堂	26,197	759,713.00	0.19
137	600482	中国动力	32,001	755,863.62	0.19
138	600674	川投能源	84,400	751,160.00	0.19
139	002044	美年健康	59,294	737,617.36	0.19
140	300003	乐普医疗	32,000	736,640.00	0.19
141	000157	中联重科	122,410	735,684.10	0.19
142	601108	财通证券	67,000	735,660.00	0.19
143	000703	恒逸石化	53,300	728,078.00	0.18
144	300760	迈瑞医疗	4,400	718,080.00	0.18
145	601111	中国国航	74,100	709,137.00	0.18
146	300124	汇川技术	30,900	707,919.00	0.18
147	600637	东方明珠	67,120	707,444.80	0.18
148	600346	恒力石化	56,980	692,876.80	0.17

149	002673	西部证券	67,700	682,416.00	0.17
150	600489	中金黄金	66,200	679,874.00	0.17
151	600297	广汇汽车	149,441	666,506.86	0.17
152	601607	上海医药	36,260	658,119.00	0.17
153	002493	荣盛石化	54,419	656,293.14	0.17
154	000425	徐工机械	144,500	644,470.00	0.16
155	300408	三环集团	32,700	636,015.00	0.16
156	600600	青岛啤酒	12,700	634,111.00	0.16
157	601998	中信银行	105,496	629,811.12	0.16
158	600516	方大炭素	50,966	626,372.14	0.16
159	300347	泰格医药	8,100	624,510.00	0.16
160	600362	江西铜业	39,355	619,447.70	0.16
161	601919	中远海控	122,886	616,887.72	0.16
162	300144	宋城演艺	26,600	615,524.00	0.16
163	000656	金科股份	101,500	612,045.00	0.15
164	601198	东兴证券	51,194	608,184.72	0.15
165	002153	石基信息	16,800	607,992.00	0.15
166	601838	成都银行	68,200	602,206.00	0.15
167	000709	河钢股份	201,129	601,375.71	0.15
168	600487	亨通光电	35,784	599,739.84	0.15
169	000728	国元证券	64,700	593,299.00	0.15
170	601992	金隅集团	157,419	591,895.44	0.15
171	600867	通化东宝	38,205	588,357.00	0.15
172	601800	中国交建	51,825	586,659.00	0.15
173	300601	康泰生物	11,100	582,750.00	0.15
174	601555	东吴证券	55,750	571,437.50	0.14
175	601360	三六零	26,000	555,880.00	0.14
176	600011	华能国际	89,178	555,578.94	0.14
177	002466	天齐锂业	21,892	553,429.76	0.14
178	601117	中国化学	91,838	552,864.76	0.14
179	600109	国金证券	56,769	551,794.68	0.14
180	600875	东方电气	51,700	549,054.00	0.14
181	600066	宇通客车	42,142	548,688.84	0.14
182	002241	歌尔股份	61,652	548,086.28	0.14
183	300450	先导智能	16,300	547,680.00	0.14
184	600688	上海石化	106,000	546,960.00	0.14
185	000413	东旭光电	104,900	539,186.00	0.14
186	000999	华润三九	18,253	535,543.02	0.14
187	601997	贵阳银行	61,551	532,416.15	0.13

188	002555	三七互娱	39,200	531,160.00	0.13
189	600816	安信信托	104,634	528,401.70	0.13
190	600068	葛洲坝	84,616	527,157.68	0.13
191	002081	金螳螂	50,554	521,211.74	0.13
192	000050	深天马A	38,700	520,128.00	0.13
193	600535	天士力	31,400	519,670.00	0.13
194	601216	君正集团	157,200	517,188.00	0.13
195	600118	中国卫星	22,725	512,448.75	0.13
196	002926	华西证券	48,700	511,350.00	0.13
197	600642	申能股份	84,100	505,441.00	0.13
198	000627	天茂集团	77,481	502,851.69	0.13
199	600398	海澜之家	55,441	502,849.87	0.13
200	600760	中航沈飞	17,300	502,219.00	0.13
201	300017	网宿科技	46,500	501,270.00	0.13
202	300413	芒果超媒	12,200	500,810.00	0.13
203	002460	赣锋锂业	21,209	496,926.87	0.13
204	601238	广汽集团	45,460	496,877.80	0.13
205	600089	特变电工	68,500	496,625.00	0.13
206	600208	新湖中宝	157,219	493,667.66	0.12
207	000630	铜陵有色	199,715	491,298.90	0.12
208	002558	巨人网络	26,768	486,374.56	0.12
209	000423	东阿阿胶	12,157	484,091.74	0.12
210	600027	华电国际	128,300	483,691.00	0.12
211	000938	紫光股份	17,640	480,690.00	0.12
212	002508	老板电器	17,700	480,378.00	0.12
213	000625	长安汽车	71,700	475,371.00	0.12
214	600583	海油工程	84,100	470,960.00	0.12
215	600153	建发股份	52,755	468,464.40	0.12
216	002010	传化智联	61,904	466,137.12	0.12
217	600188	兖州煤业	42,800	465,236.00	0.12
218	600256	广汇能源	128,300	456,748.00	0.12
219	002180	纳思达	20,017	452,384.20	0.11
220	600977	中国电影	28,715	449,676.90	0.11
221	601699	潞安环能	55,815	443,171.10	0.11
222	603799	华友钴业	20,664	440,349.84	0.11
223	600909	华安证券	66,890	437,460.60	0.11
224	000402	金融街	55,600	435,904.00	0.11
225	002384	东山精密	29,800	434,186.00	0.11
226	600998	九州通	34,800	430,128.00	0.11

227	002797	第一创业	67,800	429,852.00	0.11
228	002385	大北农	80,681	426,802.49	0.11
229	600415	小商品城	103,495	426,399.40	0.11
230	002500	山西证券	52,409	424,512.90	0.11
231	603858	步长制药	16,410	422,885.70	0.11
232	002465	海格通信	43,948	419,263.92	0.11
233	002456	欧菲光	53,400	418,656.00	0.11
234	600739	辽宁成大	28,699	417,283.46	0.11
235	600372	中航电子	28,100	417,004.00	0.11
236	300433	蓝思科技	59,600	415,412.00	0.10
237	601098	中南传媒	32,700	413,328.00	0.10
238	002065	东华软件	58,806	411,053.94	0.10
239	002195	二三四五	105,664	411,032.96	0.10
240	002624	完美世界	15,896	410,275.76	0.10
241	601866	中远海发	147,657	401,627.04	0.10
242	000027	深圳能源	62,815	389,453.00	0.10
243	000898	鞍钢股份	99,990	378,962.10	0.10
244	600808	马钢股份	110,900	378,169.00	0.10
245	600820	隧道股份	59,699	376,700.69	0.10
246	000046	泛海控股	67,100	374,418.00	0.09
247	000883	湖北能源	84,200	365,428.00	0.09
248	000983	西山煤电	59,971	363,424.26	0.09
249	002563	森马服饰	32,400	358,344.00	0.09
250	600968	海油发展	100,170	355,603.50	0.09
251	002294	信立泰	15,807	353,760.66	0.09
252	000826	启迪环境	28,795	339,493.05	0.09
253	601333	广深铁路	104,968	339,046.64	0.09
254	600373	中文传媒	26,476	332,538.56	0.08
255	601966	玲珑轮胎	19,200	326,400.00	0.08
256	601958	金铂股份	48,531	325,157.70	0.08
257	000039	中集集团	30,063	321,072.84	0.08
258	000060	中金岭南	67,537	316,748.53	0.08
259	000559	万向钱潮	50,605	302,617.90	0.08
260	000839	中信国安	72,212	290,292.24	0.07
261	000581	威孚高科	15,100	280,256.00	0.07
262	300782	卓胜微	743	80,927.56	0.02
263	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.01
264	603863	松炆资源	1,612	37,204.96	0.01
265	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.01

266	300594	朗进科技	721	31,803.31	0.01
267	603867	新化股份	1,045	26,971.45	0.01
268	300788	中信出版	1,556	23,106.60	0.01

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300498	温氏股份	5,293,002.00	0.62
2	002415	海康威视	3,075,061.60	0.36
3	000858	五粮液	2,922,040.13	0.34
4	601138	工业富联	2,871,858.00	0.34
5	002304	洋河股份	2,770,717.47	0.32
6	000002	万科A	2,428,021.00	0.28
7	601600	中国铝业	2,367,571.00	0.28
8	600061	国投资本	2,325,078.00	0.27
9	300015	爱尔眼科	2,300,731.10	0.27
10	300059	东方财富	2,134,788.00	0.25
11	000001	平安银行	2,039,327.79	0.24
12	601989	中国重工	1,784,589.00	0.21
13	300760	迈瑞医疗	1,761,687.28	0.21
14	300033	同花顺	1,537,936.00	0.18
15	000568	泸州老窖	1,519,804.00	0.18
16	300750	宁德时代	1,501,573.00	0.18
17	000333	美的集团	1,485,745.00	0.17
18	600256	广汇能源	1,429,379.00	0.17
19	001979	招商蛇口	1,360,862.46	0.16
20	002926	华西证券	1,318,257.25	0.15

注：本项买入金额均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑其他交易费用。

### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000333	美的集团	15,881,964.74	1.85

2	000858	五 粮 液	15,849,856.56	1.85
3	002415	海康威视	13,639,769.04	1.59
4	000002	万科A	12,383,267.45	1.44
5	000001	平安银行	10,062,111.67	1.17
6	002304	洋河股份	9,178,218.91	1.07
7	600519	贵州茅台	8,127,268.03	0.95
8	000651	格力电器	6,801,081.46	0.79
9	001979	招商蛇口	6,486,698.37	0.76
10	000725	京东方A	5,652,487.70	0.66
11	002024	苏宁易购	5,224,308.65	0.61
12	002714	牧原股份	5,061,548.34	0.59
13	000568	泸州老窖	5,027,036.50	0.59
14	000063	中兴通讯	4,915,844.81	0.57
15	002142	宁波银行	4,738,303.77	0.55
16	002594	比亚迪	4,607,938.68	0.54
17	000166	申万宏源	4,489,596.36	0.52
18	000776	广发证券	4,046,945.00	0.47
19	002475	立讯精密	4,008,201.64	0.47
20	000538	云南白药	3,756,304.66	0.44

注：本项卖出金额均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑其他交易费用。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	119,982,585.02
卖出股票收入（成交）总额	294,644,536.55

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

### 7.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

**7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细**

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

注：本基金本报告期末未持有权证。

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

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

**7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****7.11.1 本期国债期货投资政策**

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

**7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

**7.11.3 本期国债期货投资评价**

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

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

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

**7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明**

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的。

**7.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	97,558.81
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,765.48

5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	99,324.29

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## §8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

#### 8.1.1 本基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
6,358	60,247.94	82,464,148.00	21.53%	300,592,246.00	78.47%

#### 8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额(份)	占总份额比例
联接基金	53,084,813.00	13.86%

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	中信期货有限公司—中信期货永富11号1期资产管理计划	12,623,621.00	3.30%
2	华泰长城国际贸易有限公司	7,000,000.00	1.83%
3	张招兴	6,850,000.00	1.79%
4	于长清	5,748,100.00	1.50%
5	何少雄	2,961,800.00	0.77%
6	张益忠	2,952,100.00	0.77%
7	台建军	2,404,500.00	0.63%
8	李威	2,348,500.00	0.61%
9	彭金荣	2,225,400.00	0.58%
10	华泰证券股份有限公司	2,146,102.00	0.56%
11	中国建设银行股份有限公司—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	53,084,813.00	13.86%

注：前十名持有人为除华泰柏瑞MSCIETF联接基金之外的前十名持有人。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：本报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0



## §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2018年4月26日）基金份额总额	1,547,056,394.00
本报告期期初基金份额总额	1,051,056,394.00
本报告期期间基金总申购份额	176,000,000.00
减：本报告期期间基金总赎回份额	844,000,000.00
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	383,056,394.00

## §10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2019年3月11日，公司股东批准Anthony Gerard Fasso先生为公司董事。  
上述人事变动已按相关规定备案、报告。

2019年4月4日，公司股东批准王永筠女士为公司监事。

2019年4月15日，经公司董事会批准刘万方先生为公司副总经理。  
上述人事变动已按相关规定备案、公告。

托管人中国建设银行2019年6月4日发布公告，聘任蔡亚蓉为中国建设银行股份有限公司资产托管业务部总经理。

### 10.3 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。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未改聘为其审计的会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华泰证券	4	365,979,694.85	88.82%	82,425.03	70.42%	-
海通证券	2	15,391,462.83	3.74%	11,225.40	9.59%	-
中信建投	2	10,274,451.36	2.49%	9,363.06	8.00%	-
爱建证券	1	8,488,733.00	2.06%	7,905.72	6.75%	-
方正证券	1	6,183,931.42	1.50%	812.11	0.69%	-
天风证券	2	3,164,714.50	0.77%	2,947.30	2.52%	-
东吴证券	2	1,391,800.80	0.34%	1,296.24	1.11%	-
浙商证券	1	1,151,763.83	0.28%	1,072.71	0.92%	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
西藏东方财富	2	-	-	-	-	-
宏信证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
财达证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-

注：1、选择代理证券买卖的证券经营机构的标准

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为，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。

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华泰证券	285,852.60	100.00%	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-

华西证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票的公告	证监会指定报刊和公司网站	2019年6月25日
2	关于调低旗下华泰柏瑞MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金基金费率并修订基金合同和托管协议的公告	证监会指定报刊和公司网站	2019年6月10日

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	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	-	-	-	-	-	-	-
联接基金	1	20190417-20190624	48,153,100.00	230,285,200.00	225,353,487.00	53,084,813.00	13.86%

#### 产品特有风险

本基金报告期内本基金联接基金持有基金份额超过20%的情形。如果这些份额持有比例较大的投资者赎回，可能导致巨额赎回，从而引发流动性风险，可能对基金产生如下影响：（1）延期办理赎回申请或暂停赎回的风险。当发生巨额赎回时，投资者可能面临赎回申请延期办理、延缓支付或暂停赎回的风险。（2）基金净值大幅波动的风险。基金管理人为了应对大额赎回可能短时间内进行资产变现，这将对基金资产净值产生不利影响，同时可能发生大额赎回费用归入基金资产、基金份额净值保留位数四舍五入等问题，这些都可能会造成基金资产净值的较大波动。（3）基金投资目标偏离的风险。单一投资者大额赎回后可能导致基金规模缩小，基金将面临投资银行间债券、交易

所债券时交易困难的情形，从而使得实现基金投资目标存在一定的不确定性。（4）基金合同提前终止的风险。如果投资者大额赎回可能导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。本基金管理人将密切关注申赎动向，审慎评估大额申赎对基金持有集中度的影响，同时将完善流动性风险管控机制，最大限度的保护基金份额持有人的合法权益。

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

-

## 备查文件目录

### 11.3 备查文件目录

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

### 11.4 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

### 11.5 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

2019年8月29日