

# 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 2019年半年度报告摘要

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

### 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。

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	MSCIETF联接	
基金主代码	006286	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年10月10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	49,436,557.01份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	MSCIETF联接A	MSCIETF联接C
下属分级基金的交易代码:	006286	006293
报告期末下属分级基金的份额总额	36,105,548.48份	13,331,008.53份

#### 2.1.1 目标基金基本情况

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
基金管理人名称	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人名称	中国建设银行股份有限公司

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为华泰柏瑞MSCI中国A股国际通ETF的联接基金。华泰柏瑞MSCI中国A股国际通ETF是采用完全复制法实现对MSCI中国A股国际通指数紧密跟踪的全被动指数基金，本基金主要通过投资于华泰柏瑞MSCI中国A股国际通ETF实现对业绩比较基准的紧密跟踪。在投资运作过程中，本基金将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，决定采用一级市场申购赎回的方式或二级市场买卖的方式对目标ETF进行投资。
业绩比较基准	MSCI中国A股国际通指数收益率*95%+银行活期存款利率（税后）*5%
风险收益特征	本基金为华泰柏瑞MSCI中国A股国际通ETF的联接基金，采用主要投资于目

	标ETF实现对业绩比较基准的紧密跟踪。因此，本基金的业绩表现与MSCI中国A股国际通指数的表现密切相关。本基金的风险与收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。
--	--

### 2.2.1 目标基金产品说明

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	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-888-0001	010-67595096
传真		021-38601799	010-66275853

### 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	<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
-------------	------------------------------

### §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

基金级别	MSCIETF联接A	MSCIETF联接C
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)	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	6,698,864.76	7,630,486.65
本期利润	14,367,014.60	7,338,901.65
加权平均基金份额本期利润	0.3091	0.1106
本期基金份额净值增长率	25.15%	24.81%
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	0.1345	0.1300
期末基金资产净值	43,212,086.99	15,895,769.21
期末基金份额净值	1.1968	1.1924

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

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

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

MSCIETF联接A

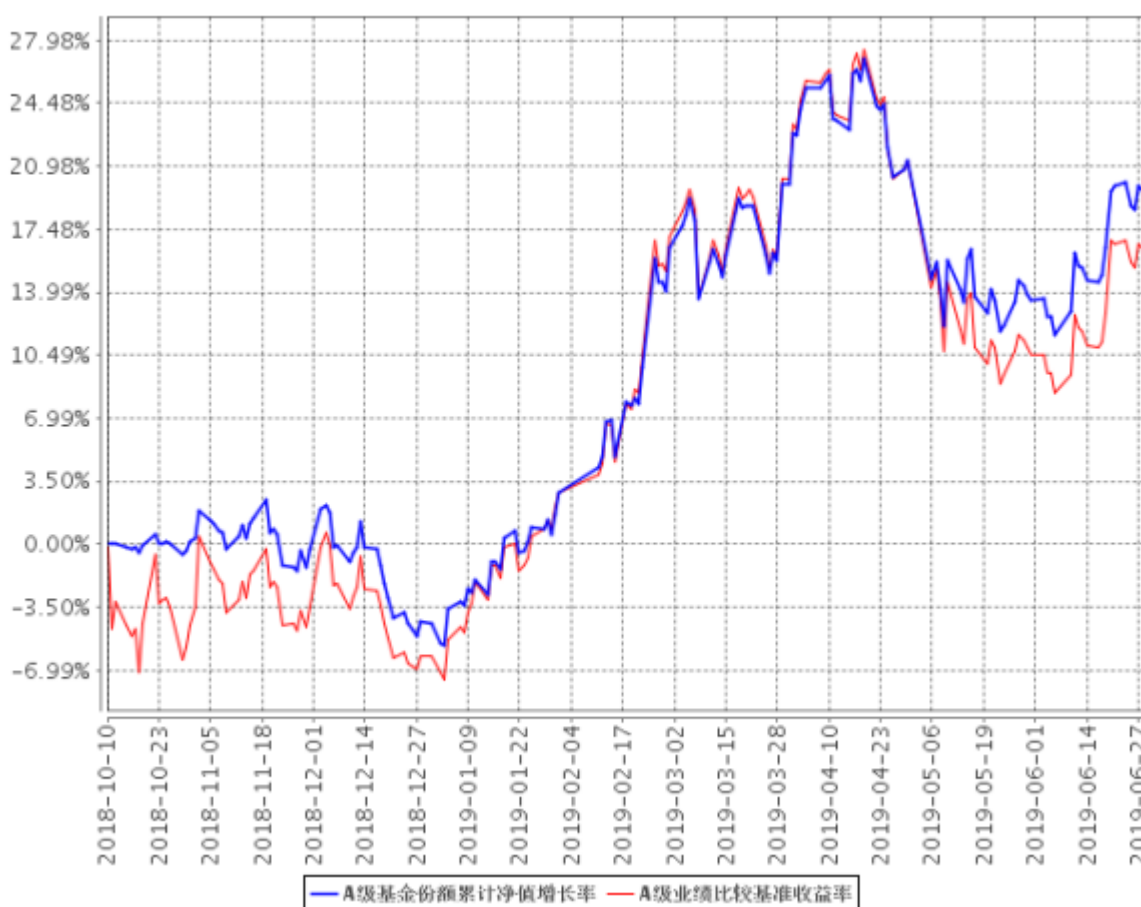
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	5.40%	1.09%	5.36%	1.23%	0.04%	-0.14%
过去三个月	-0.24%	1.40%	-3.18%	1.55%	2.94%	-0.15%
过去六个月	25.15%	1.43%	24.14%	1.54%	1.01%	-0.11%
自基金合同生效起至今	19.68%	1.26%	16.47%	1.57%	3.21%	-0.31%

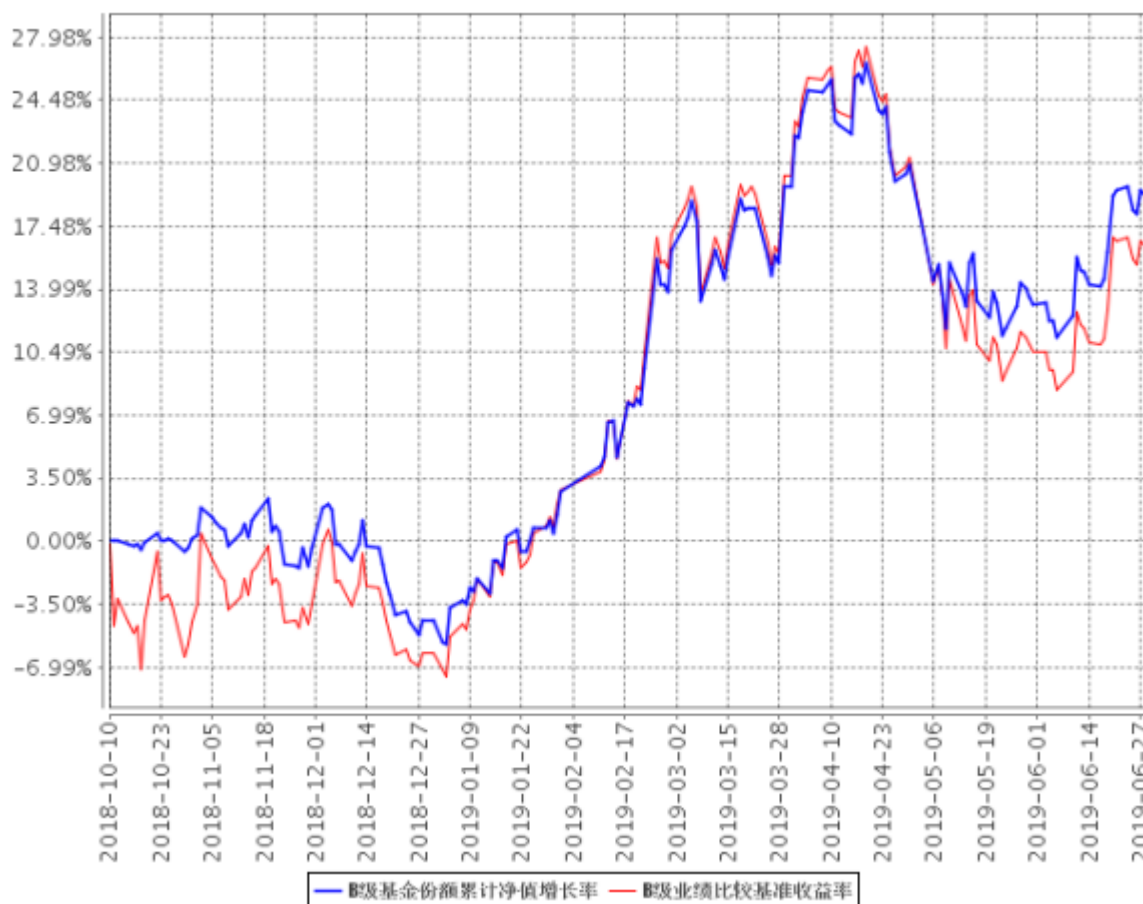
MSCIETF联接C

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	5.35%	1.09%	5.36%	1.23%	-0.01%	-0.14%
过去三个月	-0.34%	1.40%	-3.18%	1.55%	2.84%	-0.15%
过去六个月	24.81%	1.43%	24.14%	1.54%	0.67%	-0.11%
自基金合同生效起至今	19.24%	1.26%	16.47%	1.57%	2.77%	-0.31%

### 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

**A级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**



**B级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10月10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。

3、自基金合同生效起至本报告期末不满一年。



## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司。华泰柏瑞基金管理有限公司是经中国证监会批准，于2004年11月18日成立的合资基金管理公司，注册资本为2亿元人民币。目前的股东构成为华泰证券股份有限公司、柏瑞投资有限责任公司（原AIGGIC）和苏州新区高新技术产业股份有限公司，出资比例分别为49%、49%和2%。目前公司旗下管理华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金、华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金、上证红利交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金、华泰柏瑞货币市场证券投资基金、华泰柏瑞行业领先混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化先行混合型证券投资基金、华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金、上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金、华泰柏瑞沪深300交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金、华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金、华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金、华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金、华泰柏瑞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10月10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500 ETF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

					<p>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。</p>
--	--	--	--	--	--

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

## 4.2 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0.910%，日均绝对跟踪偏离度为0.031%，期间日跟踪误差为0.049%，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MSCIETF联接A基金份额净值为1.1968元，本报告期基金份额净值增长率为25.15%；截至本报告期末MSCIETF联接C基金份额净值为1.1924元，本报告期基金份额净值增长率为24.81%；同期业绩比较基准收益率为24.14%。

#### 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业绩基准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

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联接基金

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
<b>资产：</b>		
银行存款	3,033,165.11	7,023,999.62
结算备付金	5,896.00	18,264.73
存出保证金	50,281.68	24,357.49
交易性金融资产	56,025,567.20	91,893,020.36
其中：股票投资	1,151,796.00	36,314,167.31
基金投资	54,873,771.20	55,578,853.05
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	-	284,659.70
应收利息	4,920.80	1,717.71
应收股利	-	-
应收申购款	204,041.32	52,718.74
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	960,576.87
资产总计	59,323,872.11	100,259,315.22
<b>负债和所有者权益</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	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-

应付证券清算款	-	327,422.87
应付赎回款	118,103.27	298,904.05
应付管理人报酬	2,224.31	37,267.02
应付托管费	583.77	7,453.41
应付销售服务费	20,679.08	8,117.20
应付交易费用	14.06	98,139.35
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	74,411.42	150,814.48
负债合计	216,015.91	928,118.38
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	49,436,557.01	103,909,501.85
未分配利润	9,671,299.19	-4,578,305.01
所有者权益合计	59,107,856.20	99,331,196.84
负债和所有者权益总计	59,323,872.11	100,259,315.22

注：报告截止日2019年6月30日，基金份额总额49436557.01份，其中华泰柏瑞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A类基金份额净值1.1968元，A类基金份额36105548.48份；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C类基金份额净值1.1924元，C类基金份额13331008.53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联接基金

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
<b>一、收入</b>	21,996,669.37
1.利息收入	35,737.61
其中：存款利息收入	35,737.50
债券利息收入	0.11
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）	14,500,220.17
其中：股票投资收益	-577,570.40
基金投资收益	15,064,879.94
债券投资收益	25.99
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	12,884.64
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7,376,564.84
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	84,146.75
<b>减：二、费用</b>	<b>290,753.12</b>
1. 管理人报酬	24,638.00
2. 托管费	5,066.53
3. 销售服务费	94,073.04
4. 交易费用	89,897.84
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	77,077.71
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>21,705,916.25</b>
减：所得税费用	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>21,705,916.25</b>

### 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联接基金

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）	103,909,501.85	-4,578,305.01	99,331,196.84
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	21,705,916.25	21,705,916.25
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）	-54,472,944.84	-7,456,312.05	-61,929,256.89
其中：1. 基金申购款	124,299,464.16	18,253,232.96	142,552,697.12
2. 基金赎回款	-178,772,409.00	-25,709,545.01	-204,481,954.01
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）	49,436,557.01	9,671,299.19	59,107,856.20

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联接基金(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]688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联接基金注册的批复》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联接基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,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508,619,331.56元,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0654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联接基金基金合同》于2018年10月10日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为508,879,103.91份基金份额，其中认购资金利息折合259,772.35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。

根据《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基金合同》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联接基金招募说明书》的有关规定，本基金根据认购费、申购费和销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购时收取认购、申购费用而不计提销售服务费的，称为A类基金份额；在投资者认购、申购基金份额时不收取认购、申购费用，而从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为C类基金份额。本基金A类基金份额和C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，A类基金份额和C类基金份额分别计算基金份额净值并分别公告。投资人可自行选择认购、申购的基金份额类别，但不同基金份额类别之间不得互相转换。

本基金为华泰柏瑞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“目标ETF”)的联接基金。目标ETF是采用完全复制法实现对MSCI中国A股国际通指数紧密跟踪的全被动指数基金，本基金主要通过投资于目标ETF实现对业绩比较基准的紧密跟踪，力争使本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.3%，年跟踪误差不超过4%。

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联接基金基金合同》的有关规定，本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具，包括目标ETF、标的指数成份股及备选成份股、非成份股、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、权证、股指期货、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金资产中投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者到期日在一年以内的政府债券；股指期货以套期保值为目的，权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为：MSCI中国A股国际通指数收益率X95%+银行活期存款利率(税后)X5%。

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<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华泰柏瑞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基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2019年1月1日至2019年6月30日止期间的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

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 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 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(“华泰柏瑞基金”)	基金管理人、登记机构、基金销售机构

中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人、基金销售机构
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
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(“目标ETF”)	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。

## 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		上年度可比期间 2018年1月1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	39,920,768.28	64.12%	-	-

注：本基金基金合同生效日为2018年10月10日，无上年度可比数据。

#### 6.4.8.1.2 权证交易

注：无。

#### 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	37,178.71	64.23%	10.72	76.24%

### 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
当期发生的基金应支付的管理费	24,638.00
其中：支付销售机构的客户维护费	44,880.55

注：1、自2019年6月10日起，华泰柏瑞MSCI ETF联接的管理费率由0.50%调低至0.15%。

2、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扣除基金财产中目标ETF份额所对应资产净值后剩余部分(若为负数，则取0)0.15%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 - 基金财产中目标ETF份额所对应的资产净值) × 0.15% ÷ 当年天数。

3、本基金基金合同生效日为2018年10月10日，无上年度可比期间。

#### 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
当期发生的基金应支付的托管费	5,066.53

注：1、自2019年6月10日起，华泰柏瑞MSCI ETF联接的托管费率由0.10%调低至0.05%。

2、支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值扣除基金财产中目标ETF份额所对应资产净值后剩余部分(若为负数，则取0)0.05%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 - 基金财产中目标ETF份额所对应的资产净值) × 0.05% ÷ 当年天数。

3、本基金基金合同生效日为2018年10月10日，无上年度可比期间。

#### 6.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费

	MSCIETF联接A	MSCIETF联接C	合计
华泰证券股份有限公司	0.00	7,611.84	7,611.84
华泰柏瑞基金管理有限 公司	0.00	66,564.82	66,564.82
合计	0.00	74,176.66	74,176.66

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金资产净值的0.25%的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日的基金资产净值

C类基金份额销售服务费每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前5个工作日内从基金资产中一次性支取。

#### 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：无。

#### 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

份额单位：份

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	MSCIETF联接A	MSCIETF联接C
基金合同生效日（2018年10月10日）持有的基金份额	0.00	0.00
期初持有的基金份额	0.00	0.00
期间申购/买入总份额	19,443,904.34	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	0.00
期末持有的基金份额	19,443,904.34	0.00
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	39.3310%	0.0000%

注：基金管理人投资本基金的费用均参照本基金公布的费率收取。



**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**

注：本报告期内，除基金管理人之外的其它关联方未投资本基金。

**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	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	3,033,165.11	33,989.48

注：1、本基金基金合同生效日为2018年10月10日，无上年度可比期间。

2、本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

**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：无。

**6.4.8.7 其他关联交易事项的说明**

注：无。

**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**

注：无。

**6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

注：无。

**6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****6.4.9.1.1 银行间市场债券正回购**

注：无。

**6.4.9.1.2 交易所市场债券正回购**

注：无。

**6.4.10 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	1,151,796.00	1.94
	其中：股票	1,151,796.00	1.94
2	基金投资	54,873,771.20	92.50
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	3,039,061.11	5.12
8	其他各项资产	259,243.80	0.44
9	合计	59,323,872.11	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	-	-
B	采矿业	58,707.00	0.10
C	制造业	456,140.20	0.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,365.00	0.06
E	建筑业	86,273.00	0.15
F	批发和零售业	8,056.00	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	62,941.00	0.11
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	28,308.80	0.05
J	金融业	370,163.00	0.63

K	房地产业	39,586.00	0.07
L	租赁和商务服务业	2,472.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	3,784.00	0.01
S	综合	-	-
	合计	1,151,796.00	1.95

## 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前十名股票投资明细

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	100	98,400.00	0.17
2	000630	铜陵有色	22,900	56,334.00	0.10
3	601211	国泰君安	2,400	44,040.00	0.07
4	601166	兴业银行	2,200	40,238.00	0.07
5	601857	中国石油	5,100	35,088.00	0.06
6	601398	工商银行	5,600	32,984.00	0.06
7	601288	农业银行	7,800	28,080.00	0.05
8	601668	中国建筑	4,400	25,300.00	0.04
9	600030	中信证券	1,000	23,810.00	0.04
10	600016	民生银行	3,700	23,495.00	0.04

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于管理人网站的半年度报告正文。

## 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	600519	贵州茅台	2,873,304.00	2.89
2	601318	中国平安	2,318,597.00	2.33
3	600036	招商银行	1,988,147.83	2.00
4	601166	兴业银行	1,535,197.00	1.55
5	601398	工商银行	1,218,336.00	1.23
6	600000	浦发银行	1,156,930.75	1.16
7	601288	农业银行	1,127,934.00	1.14
8	601668	中国建筑	1,059,652.00	1.07
9	600016	民生银行	916,083.00	0.92
10	600900	长江电力	907,935.50	0.91
11	600104	上汽集团	818,359.00	0.82
12	600276	恒瑞医药	773,008.00	0.78
13	601766	中国中车	752,283.00	0.76
14	601601	中国太保	751,375.07	0.76
15	601818	光大银行	658,788.59	0.66
16	600030	中信证券	611,374.00	0.62
17	601211	国泰君安	597,487.00	0.60
18	600048	保利地产	595,405.00	0.60
19	601988	中国银行	574,566.00	0.58
20	600019	宝钢股份	544,255.00	0.55

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	002415	海康威视	579,160.96	0.58
2	000001	平安银行	476,050.00	0.48
3	000858	五粮液	460,928.00	0.46
4	002304	洋河股份	437,974.00	0.44
5	600519	贵州茅台	405,294.00	0.41
6	601318	中国平安	398,840.00	0.40
7	000651	格力电器	372,237.00	0.37
8	600036	招商银行	363,858.00	0.37
9	000002	万科A	336,476.00	0.34

10	002594	比亚迪	322,198.00	0.32
11	002027	分众传媒	309,859.00	0.31
12	002024	苏宁易购	260,113.00	0.26
13	001979	招商蛇口	254,264.00	0.26
14	000725	京东方A	245,428.00	0.25
15	000166	申万宏源	241,146.00	0.24
16	601166	兴业银行	207,429.00	0.21
17	600000	浦发银行	192,448.00	0.19
18	601398	工商银行	181,776.00	0.18
19	601288	农业银行	168,558.00	0.17
20	601668	中国建筑	157,080.00	0.16

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

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	46,131,298.54
卖出股票收入（成交）总额	16,551,789.22

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.8 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。

#### 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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	MSCIETF	指数型	交易型开放式	华泰柏瑞基金管理有限公司	54,873,771.20	92.84

## 7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.11.1 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。

### 7.11.2 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。

## 7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.12.1 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。

### 7.12.2 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。

### 7.12.3 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。

## 7.13 投资组合报告附注

### 7.13.1 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

本基金本报告期末投资的前十名证券中，中国建筑（601668）于2019年3月24日公告下属子公司中国建筑第二工程局有限公司所承建的扬州中航宝胜海洋工程电缆项目发生突发事故，项目部立即启动应急预案，及时向有关部门和公司进行报告，相关负责人配合政府有关部门开展应急救援工作。按照《生产安全事故报告和调查处理条例》规定，本次事故属于较大安全事故，由江苏省应急管理厅成立事故调查组进行调查，并判定事故责任，目前事故正在调查之中，尚未认定责任主体。本项目工程施工合同额约为1.48亿元，本次事故预计不会对公司生产经营及业绩产生重大影响，对公司当期损益也无较大影响。对该股票投资决策程序的说明：根据我司的基金投资

管理相关制度，以相应的研究报告为基础，结合其未来增长前景，由基金经理决定具体投资行为。

本基金本报告期末投资的前十名证券中，中国银行保险监督管理委员会于2018年11月9日对民生银行（600016）作出行政处罚决定，对公司贷款业务严重违反审慎经营规则罚款200万元，对相关责任人处以警告并罚款。以及对公司内控管理严重违反审慎经营规则；同业投资违规接受担保；同业投资、理财资金违规投资房地产，用于缴交或置换土地出让金及土地储备融资；本行理财产品之间风险隔离不到位；个人理财资金违规投资；票据代理未明示，增信未簿记和计提资本占用；为非保本理财产品提供保本承诺等行为处以罚款3160万元。对该股票投资决策程序的说明：根据我司的基金投资管理相关制度，以相应的研究报告为基础，结合其未来增长前景，由基金经理决定具体投资行为。

报告期内基金投资的前十名证券的其他发行主体，没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 7.13.2 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。

### 7.13.3 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	50,281.68
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,920.80
5	应收申购款	204,041.32
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	259,243.80

### 7.13.4 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。

### 7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：截至本报告期末，本基金前十名股票中不存在流通受限的情况。



## §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

份额单位：份

份额级 别	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
MSCIETF 联接A	1,080	33,431.06	19,443,904.34	53.85%	16,661,644.14	46.15%
MSCIETF 联接C	736	18,112.78	0.00	0.00%	13,331,008.53	100.00%
合计	1,816	27,222.77	19,443,904.34	39.33%	29,992,652.67	60.67%

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 8.2 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。

### 8.3 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	份额级别	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	MSCIETF联接A	0
	MSCIETF联接C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开 放式基金	MSCIETF联接A	0
	MSCIETF联接C	0
	合计	0

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	MSCIETF联接A	MSCIETF联接C
基金合同生效日（2018年10月10日）基金份额总额	124,471,473.51	384,407,630.40
本报告期期初基金份额总额	66,495,930.94	37,413,570.91
本报告期期间基金总申购份额	26,275,543.30	98,023,920.86
减：本报告期期间基金总赎回份额	56,665,925.76	122,106,483.24
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	36,105,548.48	13,331,008.53

## §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	5	39,920,768.28	64.12%	37,178.71	64.23%	-
东吴证券	1	8,977,849.18	14.42%	8,360.80	14.44%	-
爱建证券	1	8,507,994.16	13.67%	7,923.61	13.69%	-
浙商证券	1	4,289,196.83	6.89%	3,994.49	6.90%	-
海通证券	2	448,086.57	0.72%	321.74	0.56%	-
中信建投	2	58,090.04	0.09%	52.94	0.09%	-
天风证券	2	57,436.00	0.09%	53.56	0.09%	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	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	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	2	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-

### 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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
华泰证券	1,026.10	100.00%	-	-	-	-	132,175,161.60	71.70%
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-	45,798,535.93	24.84%
浙商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	6,364,112.80	3.45%
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

注：本基金本报告期内未有单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

-
---

华泰柏瑞基金管理有限公司

2019年8月29日