

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 2020 年中期报告

2020 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：2020 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 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 2020 年 1 月 1 日起至 2020 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	16
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
6.4 报表附注.....	20
§7 投资组合报告.....	43
7.1 期末基金资产组合情况.....	43
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	43
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.....	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	57
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	58
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.....	58
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.....	58
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	58
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.....	58
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	59
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	59
7.12 投资组合报告附注.....	59
§8 基金份额持有人信息.....	61
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	61
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	61
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	61
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.....	61
§9 开放式基金份额变动.....	63
§10 重大事件揭示.....	64
10.1 基金份额持有人大会决议.....	64
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.....	64
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	64
10.4 基金投资策略的改变.....	64
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	64
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.....	64
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	64
10.8 其他重大事件.....	66

§11 影响投资者决策的其他重要信息	67
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.....	67
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	68
§12 备查文件目录	69
12.1 备查文件目录.....	69
12.2 存放地点.....	69
12.3 查阅方式.....	69

§ 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
扩位证券简称	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	177,056,394.00 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	李申
	联系电话	021-38601777	021-60637102
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		400-888-0001	021-60637111
传真		021-38601799	021-60635778
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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.huatai-pb.com
基金中期报告备置地点	上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 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(2020年1月1日 - 2020年6月30日)
本期已实现收益	22,223,083.85
本期利润	17,614,589.27
加权平均基金份额本期利润	0.0765
本期加权平均净值利润率	6.61%
本期基金份额净值增长率	10.24%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)
期末可供分配利润	41,613,546.02
期末可供分配基金份额利润	0.2350
期末基金资产净值	225,848,063.28
期末基金份额净值	1.2756
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)
基金份额累计净值增长率	27.56%

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。

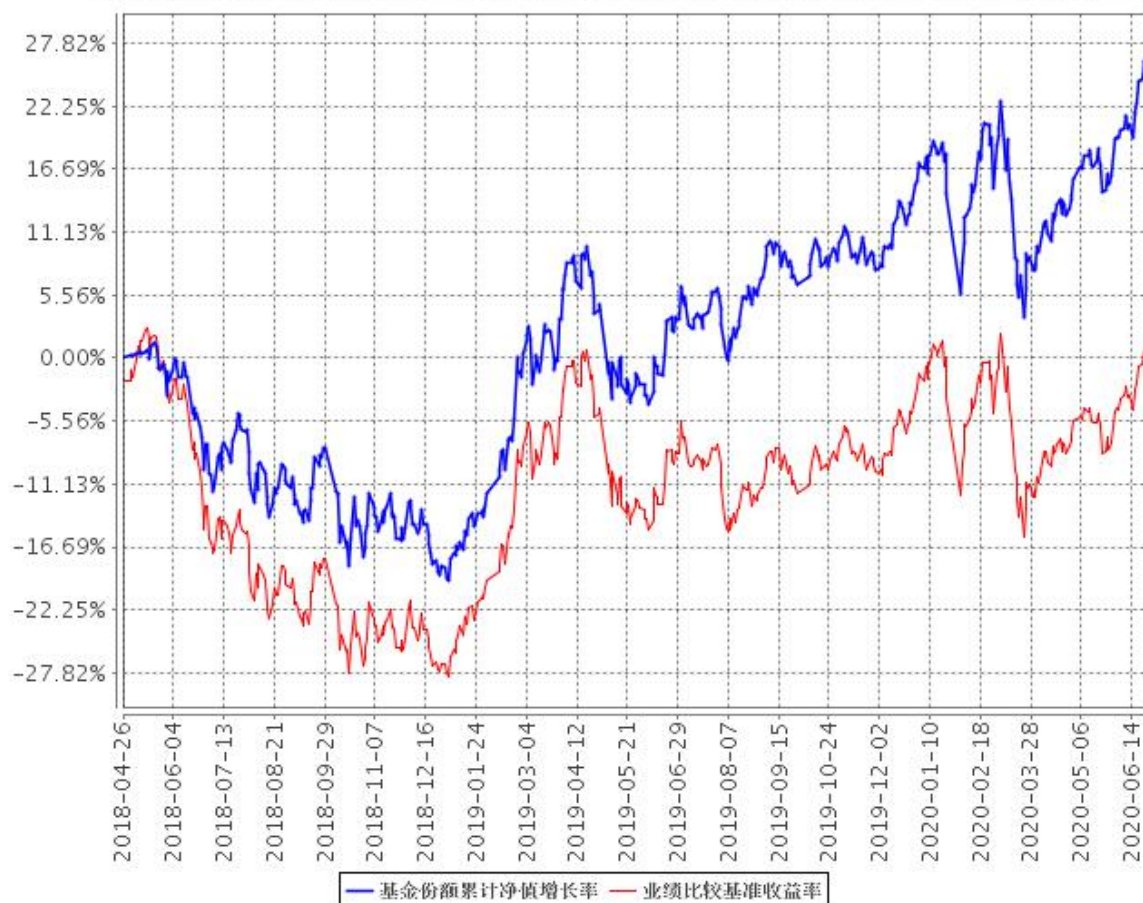
3.2 基金净值表现

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	9.79%	0.90%	9.50%	0.95%	0.29%	-0.05%
过去三个月	17.77%	0.94%	14.80%	1.02%	2.97%	-0.08%
过去六个月	10.24%	1.54%	4.18%	1.70%	6.06%	-0.16%
过去一年	23.40%	1.23%	10.70%	1.37%	12.70%	-0.14%
自基金合同生效起至今	27.56%	1.34%	1.38%	1.49%	26.18%	-0.15%

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 2018 年 4 月 26 日（基金合同生效日）至 2020 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。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、华泰柏瑞锦兴 39 个月定期开放债券型证券投资基金、华泰柏瑞锦瑞债券型证券投资基金、华泰柏瑞益商一年定期开放华泰柏瑞益商型发起式证券投资基金、华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞质量成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞行业精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞鸿利中短债债券型证券投资基金、华泰柏瑞景气优选混合型证券投资基金。截至 2020 年 6 月 30 日，公司基金管理规模为 1317.21 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	-	19 年	19 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 月至 2020 年 2 月任上证中小盘 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。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。2020年2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。任职日期和离任日期指基金管理公司作出决定之日。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司将投资管理职能和交易执行职能完全隔离，实行集中交易制度，由交易部为公募基金、专户理财和海外投资等业务统一交易服务，为公平交易的实施提供了较好的保障。目前公司公募基金经理有兼任私募资产管理计划投资经理的情况，兼任业务遵照相关法律法规要求进行，同时遵守公司公平交易制度。公司机构设置合理，公平交易的相关管理制度健全，投资决策流程完善，各项制度执行情况良好。交易价差分析表明公司旗下各基金均得到了公平对待，不存在非公平交易和利益输送的行为。经过对不同基金之间交易相同证券时的同向交易价差进行分析发现，报告期内基金之间的买卖交易价差总体上处于正常的合理水平。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期本基金与公司所管理的其他投资组合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

2020 年上半年市场以结构性机会为主。其中医药生物、休闲服务、电子、食品饮料等行业录得正收益，期间医药生物行业指数上涨达 40.28%，休闲服务行业指数上涨达 30.07%。整体来看，沪深 300、中证 500、中证 1000 和创业板涨跌幅分别为 1.64%、11.33%、13.52%、和 35.60%。从市场风格来看，成长风格表现相对强势，优于价值风格，期间沪深 300 价值指数和沪深 300 成长指数涨跌幅分别为-13.18%和 11.39%，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 4.443%，日均绝对跟踪偏离度为 0.047%，期间日跟踪误差为 0.062%，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 1.2756 元；本报告期基金份额净值增长率为 10.24%，业绩比较基准收益率为 4.18%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

随着疫情逐步控制和国内复工复产逐步完成，国内经济数据持续改善。二季度以来国内经济表现略超市场预期，实体经济各方面都在逐步恢复正轨，并且部分领域有明显的亮点。第一，工业生产持续恢复。工业增加值增速在 4 月已经转正（3.9%），且高频的耗煤量增速、发电量、高炉开工率等指标均在持续好转；工业品出厂价格环比也开始出现改善，预计后续通缩压力将逐渐减小。第二，国内需求有显著改善，尤其地产和汽车表现亮眼。30 个大中城市商品房成交 5 月同比已转正；乘联会公布的乘用车日均销售增速已恢复到疫情之前的水平，其中批发增速已创出两位数的阶段性新高。第三，出口表现好于预期。5 月份单月货物贸易顺差已创历史同期新高，再加上疫情导致的服务贸易逆差收窄，二季度净出口对 GDP 的贡献将显著增加。下半年，财政政策将成为主要的发力端。两会政策定调，首次不设 GDP 增长目标，财政政策力度明显加大，财政赤字率 3.6% 以上、地方专项债 3.75 万亿、抗疫特别国债 1 万亿，且增加的财政赤字与特别国债共 2 万亿全部转给地方，直达市县基层，直接惠企利民。宏观流动性角度，宽信用是三季度主旋律，充裕的货币将依然贯穿下半年，在流动性仍处于宽松状态下，我们认为指数震荡上行，继续看好下半年结构性机会。

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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本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：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	6,372,517.83	10,198,192.63
结算备付金		3,273,543.47	2,883,879.77
存出保证金		1,076,953.71	1,283,705.68
交易性金融资产	6.4.7.2	214,720,656.35	324,960,406.69
其中：股票投资		214,720,656.35	324,960,406.69
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		1,413,730.55	171,824.45
应收利息	6.4.7.5	2,651.99	4,018.76
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		226,860,053.90	339,502,027.98
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		11,554.60	2,426.40
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		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		24,902.59	42,444.59
应付托管费		8,300.86	14,148.18
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	22,627.70	5,886.43
应交税费		5,542.69	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	939,062.18	342,415.05
负债合计		1,011,990.62	407,320.65
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	177,056,394.00	293,056,394.00
未分配利润	6.4.7.10	48,791,669.28	46,038,313.33
所有者权益合计		225,848,063.28	339,094,707.33
负债和所有者权益总计		226,860,053.90	339,502,027.98

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.2756 元，基金份额总额 177,056,394.00 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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		18,228,380.60	218,601,012.47
1.利息收入		59,371.32	18,408.82
其中：存款利息收入	6.4.7.11	59,220.75	18,374.93
债券利息收入		27.50	33.89
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		123.07	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		22,732,327.13	36,233,045.78
其中：股票投资收益	6.4.7.12	20,172,213.85	31,756,093.73
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	55,797.00	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	843,572.82	-
股利收益	6.4.7.16	1,660,743.46	4,465,134.35
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-4,608,494.58	181,857,446.52
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	45,176.73	492,111.35

列)			
减：二、费用		613,791.33	2,964,423.43
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	200,107.39	1,770,050.75
2. 托管费	6.4.10.2.2	66,702.45	359,662.82
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	167,595.18	448,092.25
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		3,036.89	0.11
7. 其他费用	6.4.7.20	176,349.42	386,617.50
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		17,614,589.27	215,636,589.04
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		17,614,589.27	215,636,589.04

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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 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）	293,056,394.00	46,038,313.33	339,094,707.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	17,614,589.27	17,614,589.27
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）	-116,000,000.00	-14,861,233.32	-130,861,233.32
其中：1. 基金申购款	44,000,000.00	8,525,031.70	52,525,031.70
2. 基金赎回款	-160,000,000.00	-23,386,265.02	-183,386,265.02
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）	177,056,394.00	48,791,669.28	225,848,063.28
项目	上年度可比期间 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基金净值变动数（本期利润）	-	215,636,589.04	215,636,589.04
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-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

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 2020 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。

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 2020 年 1 月 1 日至 2020 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 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 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[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。

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 2020 年 6 月 30 日
活期存款	6,372,517.83
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：	6,372,517.83

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	187,179,474.52	214,720,656.35	27,541,181.83

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	187,179,474.52	214,720,656.35	27,541,181.83

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日			备注
	合同/名义金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	9,458,940.00	-	-	
股指期货	9,458,940.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	9,458,940.00	-	-	

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 2020年6月30日
应收活期存款利息	1,216.62
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	1,416.67

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	18.70
合计	2,651.99

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 2020年6月30日
交易所市场应付交易费用	22,627.70
银行间市场应付交易费用	-
合计	22,627.70

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	89,507.60
应付指数使用费	135,397.50
应付替代款	714,157.08
合计	939,062.18

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
----	----------------------------

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	293,056,394.00	293,056,394.00
本期申购	44,000,000.00	44,000,000.00
本期赎回(以“-”号填列)	-160,000,000.00	-160,000,000.00
- 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	177,056,394.00	177,056,394.00

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	39,582,230.14	6,456,083.19	46,038,313.33
本期利润	22,223,083.85	-4,608,494.58	17,614,589.27
本期基金份额交易产生的变动数	-20,191,767.97	5,330,534.65	-14,861,233.32
其中：基金申购款	7,913,796.36	611,235.34	8,525,031.70
基金赎回款	-28,105,564.33	4,719,299.31	-23,386,265.02
本期已分配利润	-	-	-
本期末	41,613,546.02	7,178,123.26	48,791,669.28

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
活期存款利息收入	35,065.74
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	23,779.54
其他	375.47
合计	59,220.75

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
----	----

	2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	18,286,958.56
股票投资收益——赎回差价收入	1,885,255.29
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	20,172,213.85

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 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出股票成交总额	101,394,728.91
减：卖出股票成本总额	83,107,770.35
买卖股票差价收入	18,286,958.56

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 2020年1月1日至2020年6月30日
赎回基金份额对价总额	183,386,265.02
减：现金支付赎回款总额	73,035,987.02
减：赎回股票成本总额	108,465,022.71
赎回差价收入	1,885,255.29

6.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入

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 2020年1月1日至2020年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债	55,797.00

券到期兑付) 差价收入	
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	55,797.00

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 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	239,024.83
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	183,200.00
减：应收利息总额	27.83
买卖债券差价收入	55,797.00

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

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2020年1月1日至2020年6月30日
国债期货投资收益	-
股指期货-投资收益	843,572.82

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,660,743.46
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	1,660,743.46

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2020年1月1日至2020年6月30日
1. 交易性金融资产	-4,282,193.58
——股票投资	-4,282,193.58
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-326,840.00
——权证投资	-
股指期货	-326,840.00
3. 其他	539.00
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-4,608,494.58

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	45,176.73
合计	45,176.73

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
交易所市场交易费用	164,544.12
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	-
期货交易费用	3,051.06
合计	167,595.18

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	29,835.26
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行划款手续费	1,084.32
指数使用费	85,397.50
其他费用	360.00
合计	176,349.42

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(“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

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 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 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	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
华泰证券	151,256,730.79	100.00%	365,979,694.85	88.82%

6.4.10.1.2 债券回购交易

注：本基金本期与上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.3 权证交易

注：本基金本期与上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020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	31,530.58	100.00%	22,627.70	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 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%

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 2020年1月1日至2020年6 月30日	上年度可比期间 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	200,107.39
其中：支付销售机构的客户维护费	5,478.02	57,562.20

注：自2019年1月1日至2019年6月9日及上年度可比期间，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。

根据《华泰柏瑞基金管理有限公司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》，自 2019 年 6 月 10 日起，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 0.15% 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 × 0.15% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	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	66,702.45	359,662.82

注：自 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 9 日及上年度可比期间，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 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。

根据《华泰柏瑞基金管理有限公司关于调低旗下华泰柏瑞中证 500 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》，自 2019 年 6 月 10 日起，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 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 × 0.05% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

注：本基金本期与上年度可比期间无发生关联方销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本期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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明**6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

注：无。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自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。

6.4.10.5.2 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 2020年6月30日		上年度末 2019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	6,218,783.00	3.5123%	2,599,190.00	0.8869%
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	28,625,141.00	16.1672%	70,964,641.00	24.2154%

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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	6,372,517.83	35,065.74	3,952,310.11	14,306.45

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。

6.4.10.7 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。

6.4.10.8 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（2020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
688528	秦川物联	2020年6月19日	2020年7月1日	新股流通受限	11.33	11.33	8,337	94,458.21	94,458.21	-
688600	皖仪科技	2020年6月23日	2020年7月3日	新股流通受限	15.50	15.50	5,468	84,754.00	84,754.00	-
300847	中船汉光	2020年6月29日	2020年7月9日	新股流通受限	6.94	6.94	1,421	9,861.74	9,861.74	-
300845	捷安高科	2020年6月24日	2020年7月3日	新股流通受限	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-
300843	胜蓝股份	2020年6月23日	2020年7月2日	新股流通受限	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-
300840	酷特智能	2020年6月30日	2020年7月8日	新股流通受限	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-
300846	首都在线	2020年6月22日	2020年7月1日	新股流通受限	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-
688096	京源环保	2020年3月31日	2020年10月9日	新股锁定期内	14.34	21.42	4,485	64,314.90	96,068.70	-
688505	复旦	2020年	2020	新股锁	8.95	24.78	11,583	103,667.85	287,026.74	-

	张江	6月10日	年12月19日	定期内						
--	----	-------	---------	-----	--	--	--	--	--	--

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 2020 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 2020 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。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金的基金管理人建立的风险管理体系由“组织、制度、流程和报告”等四个方面构成。组织是指公司的风险管理组织架构包括董事会下设的风险管理与审计委员会、公司管理层的风险控制委员会、风险管理部和合规法律部以及公司各业务部门，董事会对建立基金风险管理内部控制系统和维持其有效性承担最终责任；制度是指风险管理相关的规章制度，是对组织职能及其工作流程等的具体规定；流程是风险管理的工作流程，它详细规定了各部门之间风险管理工作的内容和程序；报告是对流程的必要反映和记录，既是风险管理工作的重要环节，也是对风险管理工作的总结和披露。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现风险损失的频度。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，本基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近 1 年的分类结果为 A 类，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2020 年 6 月 30 日，本基金无债券投资 (2019 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 2020 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2020 年 6 月 30 日，本基金

持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 0.27%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020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	6,372,517.83	-	-	-	-	-	6,372,517.83
结算备付金	3,273,543.47	-	-	-	-	-	3,273,543.47
存出保证金	41,696.91	-	-	-	-	1,035,256.80	1,076,953.71
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-214,720,656.35	214,720,656.35
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,413,730.55	1,413,730.55
应收利息	-	-	-	-	-	2,651.99	2,651.99
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	9,687,758.21	-	-	-	-	-217,172,295.69	226,860,053.90
负债							
交易性金融负债	-	-	-	-	-	11,554.60	11,554.60
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	24,902.59	24,902.59
应付托管费	-	-	-	-	-	8,300.86	8,300.86
应付交易费用	-	-	-	-	-	22,627.70	22,627.70
应交税费	-	-	-	-	-	5,542.69	5,542.69
其他负债	-	-	-	-	-	939,062.18	939,062.18
负债总计	-	-	-	-	-	1,011,990.62	1,011,990.62
利率敏感度缺口	9,687,758.21	-	-	-	-	-216,160,305.07	225,848,063.28
上年度末 2019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	10,198,192.63	-	-	-	-	-	10,198,192.63
结算备付金	2,883,879.77	-	-	-	-	-	2,883,879.77
存出保证金	46,544.08	-	-	-	-	1,237,161.60	1,283,705.68
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-324,960,406.69	324,960,406.69
应收证券清算款	-	-	-	-	-	171,824.45	171,824.45
应收利息	-	-	-	-	-	4,018.76	4,018.76
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	13,128,616.48	-	-	-	-	-326,373,411.50	339,502,027.98

负债							
交易性金融负债	-	-	-	-	-	2,426.40	2,426.40
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	42,444.59	42,444.59
应付托管费	-	-	-	-	-	14,148.18	14,148.18
应付交易费用	-	-	-	-	-	5,886.43	5,886.43
其他负债	-	-	-	-	-	342,415.05	342,415.05
负债总计	-	-	-	-	-	407,320.65	407,320.65
利率敏感度缺口	13,128,616.48	-	-	-	-	-325,966,090.85	339,094,707.33

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约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 2020 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2019 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（2019 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 90%，且不低于基金非现金资产的 80%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 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	214,721,195.35	95.07	324,960,406.69	95.83
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	-12,093.60	-0.01	-2,426.40	0.00
合计	214,709,101.75	95.07	324,957,980.29	95.83

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（2020 年 6 月 30 日）	上年度末（2019 年 12 月 31 日）
	MSCI 中国 A 股国际通指数上升 5%	10,170,839.13	15,319,766.42
MSCI 中国 A 股国际通指数下降 5%	-10,170,839.13	-15,319,766.42	

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

注：无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	214,720,656.35	94.65
	其中：股票	214,720,656.35	94.65
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	9,646,061.30	4.25
8	其他各项资产	2,493,336.25	1.10
9	合计	226,860,053.90	100.00

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

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	3,564,376.00	1.58
B	采矿业	5,293,429.37	2.34
C	制造业	110,578,888.42	48.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,196,271.36	2.30
E	建筑业	4,372,132.45	1.94
F	批发和零售业	3,402,813.77	1.51
G	交通运输、仓储和邮政业	5,707,008.36	2.53
H	住宿和餐饮业	259,916.00	0.12
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,337,382.21	5.46
J	金融业	46,178,532.23	20.45
K	房地产业	7,758,432.30	3.44
L	租赁和商务服务业	3,169,493.67	1.40
M	科学研究和技术服务业	1,844,921.00	0.82
N	水利、环境和公共设施管理业	175,392.00	0.08

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	260,850.00	0.12
Q	卫生和社会工作	2,686,183.98	1.19
R	文化、体育和娱乐业	1,797,124.23	0.80
S	综合	137,509.00	0.06
	合计	214,720,656.35	95.07

注：上述股票投资组合不包括可退替代款估值增。

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	8,448	12,358,410.24	5.47
2	601318	中国平安	73,020	5,213,628.00	2.31
3	600036	招商银行	136,354	4,597,856.88	2.04
4	000858	五粮液	25,506	4,364,586.72	1.93
5	600276	恒瑞医药	35,090	3,238,807.00	1.43
6	600900	长江电力	145,450	2,754,823.00	1.22
7	300750	宁德时代	14,800	2,580,528.00	1.14
8	002475	立讯精密	47,185	2,422,949.75	1.07
9	603288	海天味业	17,912	2,228,252.80	0.99
10	601166	兴业银行	136,582	2,155,263.96	0.95
11	300760	迈瑞医疗	7,000	2,139,900.00	0.95
12	600000	浦发银行	196,589	2,079,911.62	0.92
13	002714	牧原股份	25,070	2,055,740.00	0.91
14	601888	中国中免	13,199	2,033,041.97	0.90
15	002415	海康威视	61,779	1,874,992.65	0.83
16	601398	工商银行	362,817	1,806,828.66	0.80
17	000002	万科A	65,469	1,711,359.66	0.76
18	601288	农业银行	501,077	1,693,640.26	0.75
19	000001	平安银行	127,729	1,634,931.20	0.72
20	600030	中信证券	66,264	1,597,625.04	0.71
21	600585	海螺水泥	26,386	1,396,083.26	0.62
22	603259	药明康德	14,200	1,371,720.00	0.61
23	601328	交通银行	263,964	1,354,135.32	0.60

24	600016	民生银行	238,456	1,352,045.52	0.60
25	601668	中国建筑	281,304	1,341,820.08	0.59
26	600887	伊利股份	41,024	1,277,077.12	0.57
27	600048	保利地产	78,810	1,164,811.80	0.52
28	601601	中国太保	42,300	1,152,675.00	0.51
29	300015	爱尔眼科	26,225	1,139,476.25	0.50
30	000661	长春高新	2,600	1,131,780.00	0.50
31	000651	格力电器	19,621	1,109,959.97	0.49
32	000725	京东方A	229,196	1,070,345.32	0.47
33	600031	三一重工	57,037	1,070,014.12	0.47
34	300059	东方财富	52,740	1,065,348.00	0.47
35	002142	宁波银行	40,488	1,063,619.76	0.47
36	002352	顺丰控股	19,267	1,053,904.90	0.47
37	600309	万华化学	20,700	1,034,793.00	0.46
38	601012	隆基股份	25,298	1,030,387.54	0.46
39	000063	中兴通讯	25,500	1,023,315.00	0.45
40	002304	洋河股份	9,500	998,830.00	0.44
41	600588	用友网络	22,164	977,432.40	0.43
42	601818	光大银行	268,027	959,536.66	0.42
43	300498	温氏股份	42,820	933,476.00	0.41
44	300122	智飞生物	9,000	901,350.00	0.40
45	601766	中国中车	161,609	900,162.13	0.40
46	000568	泸州老窖	9,687	882,679.44	0.39
47	600104	上汽集团	51,529	875,477.71	0.39
48	601211	国泰君安	50,521	871,992.46	0.39
49	600809	山西汾酒	6,000	870,000.00	0.39
50	002594	比亚迪	11,871	852,337.80	0.38
51	601688	华泰证券	45,300	851,640.00	0.38
52	600999	招商证券	38,723	849,969.85	0.38
53	600050	中国联通	174,067	842,484.28	0.37
54	000876	新希望	27,907	831,628.60	0.37
55	000895	双汇发展	17,937	826,716.33	0.37
56	601988	中国银行	236,395	822,654.60	0.36
57	603501	韦尔股份	4,000	807,800.00	0.36
58	600745	闻泰科技	6,400	806,080.00	0.36
59	000538	云南白药	8,565	803,482.65	0.36
60	601229	上海银行	93,769	778,282.70	0.34
61	000166	申万宏源	152,011	767,655.55	0.34
62	603986	兆易创新	3,240	764,348.40	0.34

63	300601	康泰生物	4,700	762,152.00	0.34
64	600570	恒生电子	6,992	753,038.40	0.33
65	600690	海尔智家	42,402	750,515.40	0.33
66	601066	中信建投	18,200	716,716.00	0.32
67	001979	招商蛇口	43,258	711,161.52	0.31
68	300413	芒果超媒	10,860	708,072.00	0.31
69	601006	大秦铁路	99,857	702,993.28	0.31
70	600436	片仔癀	4,100	698,025.00	0.31
71	601169	北京银行	141,055	691,169.50	0.31
72	601390	中国中铁	136,400	684,728.00	0.30
73	600703	三安光电	26,926	673,150.00	0.30
74	600837	海通证券	53,454	672,451.32	0.30
75	600028	中国石化	171,330	669,900.30	0.30
76	002555	三七互娱	14,300	669,240.00	0.30
77	601186	中国铁建	77,329	648,017.02	0.29
78	002241	歌尔股份	22,052	647,446.72	0.29
79	600406	国电南瑞	31,300	633,825.00	0.28
80	600547	山东黄金	17,222	630,669.64	0.28
81	601336	新华保险	14,200	628,776.00	0.28
82	603160	汇顶科技	2,800	624,120.00	0.28
83	601989	中国重工	153,300	613,200.00	0.27
84	601857	中国石油	145,183	608,316.77	0.27
85	601138	工业富联	40,100	607,515.00	0.27
86	601933	永辉超市	64,520	605,197.60	0.27
87	000938	紫光股份	14,040	603,439.20	0.27
88	002007	华兰生物	11,990	600,818.90	0.27
89	002371	北方华创	3,500	598,185.00	0.26
90	601899	紫金矿业	132,256	581,926.40	0.26
91	002916	深南电路	3,460	579,619.20	0.26
92	600019	宝钢股份	124,670	568,495.20	0.25
93	000100	TCL 科技	91,122	564,956.40	0.25
94	000776	广发证券	39,966	564,319.92	0.25
95	002230	科大讯飞	14,872	556,658.96	0.25
96	600346	恒力石化	39,680	555,520.00	0.25
97	000338	潍柴动力	40,261	552,380.92	0.24
98	300014	亿纬锂能	11,425	546,686.25	0.24
99	300347	泰格医药	5,350	545,058.00	0.24
100	002027	分众传媒	97,742	544,422.94	0.24
101	002024	苏宁易购	61,500	539,355.00	0.24

102	002050	三花智控	24,390	534,141.00	0.24
103	300142	沃森生物	10,200	534,072.00	0.24
104	002410	广联达	7,600	529,720.00	0.23
105	600015	华夏银行	85,277	521,895.24	0.23
106	300433	蓝思科技	18,600	521,544.00	0.23
107	601088	中国神华	35,300	506,908.00	0.22
108	601628	中国人寿	18,320	498,487.20	0.22
109	002624	完美世界	8,596	495,473.44	0.22
110	002311	海大集团	10,400	494,936.00	0.22
111	601009	南京银行	67,264	493,045.12	0.22
112	300033	同花顺	3,700	492,396.00	0.22
113	601100	恒立液压	6,100	489,220.00	0.22
114	600009	上海机场	6,614	476,670.98	0.21
115	601155	新城控股	15,130	472,661.20	0.21
116	002841	视源股份	4,700	467,744.00	0.21
117	600196	复星医药	13,777	466,351.45	0.21
118	688023	安恒信息	1,500	461,850.00	0.20
119	600340	华夏幸福	19,825	453,199.50	0.20
120	600183	生益科技	15,400	450,758.00	0.20
121	600741	华域汽车	21,620	449,479.80	0.20
122	600438	通威股份	25,700	446,666.00	0.20
123	603993	洛阳钼业	118,482	434,828.94	0.19
124	300124	汇川技术	11,400	433,086.00	0.19
125	300003	乐普医疗	11,700	427,284.00	0.19
126	002493	荣盛石化	34,719	427,043.70	0.19
127	002001	新和成	14,600	424,860.00	0.19
128	600383	金地集团	30,200	413,740.00	0.18
129	002129	中环股份	18,400	413,264.00	0.18
130	601788	光大证券	25,600	411,136.00	0.18
131	002600	领益智造	38,500	409,255.00	0.18
132	601939	建设银行	64,736	408,484.16	0.18
133	002602	世纪华通	26,600	407,246.00	0.18
134	000596	古井贡酒	2,700	405,648.00	0.18
135	601225	陕西煤业	56,189	405,122.69	0.18
136	600919	江苏银行	71,276	404,134.92	0.18
137	002120	韵达股份	16,250	397,312.50	0.18
138	002460	赣锋锂业	7,409	396,900.13	0.18
139	300454	深信服	1,900	391,324.00	0.17
140	601901	方正证券	55,167	390,582.36	0.17

141	002271	东方雨虹	9,600	390,048.00	0.17
142	300529	健帆生物	5,590	388,505.00	0.17
143	601877	正泰电器	14,555	383,524.25	0.17
144	600600	青岛啤酒	5,000	382,500.00	0.17
145	002236	大华股份	19,900	382,279.00	0.17
146	600958	东方证券	40,221	381,697.29	0.17
147	300558	贝达药业	2,700	377,946.00	0.17
148	002812	恩捷股份	5,700	375,060.00	0.17
149	002044	美年健康	25,953	373,982.73	0.17
150	000977	浪潮信息	9,528	373,307.04	0.17
151	002821	凯莱英	1,500	364,500.00	0.16
152	300676	华大基因	2,300	358,593.00	0.16
153	300628	亿联网络	5,250	358,365.00	0.16
154	600893	航发动力	15,205	357,013.40	0.16
155	600926	杭州银行	40,002	356,817.84	0.16
156	601669	中国电建	102,647	355,158.62	0.16
157	601985	中国核电	86,594	354,169.46	0.16
158	600763	通策医疗	2,100	350,217.00	0.16
159	002127	南极电商	16,500	349,305.00	0.15
160	600845	宝信软件	5,900	348,572.00	0.15
161	600886	国投电力	43,745	343,835.70	0.15
162	603899	晨光文具	6,200	338,520.00	0.15
163	000069	华侨城 A	55,343	335,378.58	0.15
164	603369	今世缘	8,400	334,236.00	0.15
165	002456	欧菲科技	18,000	331,020.00	0.15
166	600010	宝钢股份	306,144	330,635.52	0.15
167	300253	卫宁健康	14,400	330,336.00	0.15
168	600872	中炬高新	5,600	327,768.00	0.15
169	600521	华海药业	9,650	327,424.50	0.14
170	000768	中航飞机	18,346	325,458.04	0.14
171	603658	安图生物	2,000	324,880.00	0.14
172	603019	中科曙光	8,440	324,096.00	0.14
173	300136	信维通信	6,100	323,422.00	0.14
174	600161	天坛生物	7,100	321,843.00	0.14
175	600606	绿地控股	52,024	321,508.32	0.14
176	300308	中际旭创	5,100	321,300.00	0.14
177	601990	南京证券	22,400	319,648.00	0.14
178	300408	三环集团	11,500	318,550.00	0.14
179	002384	东山精密	10,600	317,470.00	0.14

180	002179	中航光电	7,500	307,575.00	0.14
181	000425	徐工机械	51,800	306,138.00	0.14
182	002049	紫光国微	4,200	305,550.00	0.14
183	002736	国信证券	26,925	304,252.50	0.13
184	600061	国投资本	23,800	302,974.00	0.13
185	601881	中国银河	26,400	302,808.00	0.13
186	603939	益丰药房	3,320	302,120.00	0.13
187	000860	顺鑫农业	5,300	301,994.00	0.13
188	601618	中国中冶	119,800	300,698.00	0.13
189	600332	白云山	9,279	299,990.07	0.13
190	601377	兴业证券	43,718	299,468.30	0.13
191	300144	宋城演艺	17,280	298,944.00	0.13
192	600029	南方航空	57,700	298,309.00	0.13
193	002157	正邦科技	16,800	293,664.00	0.13
194	002414	高德红外	9,960	291,628.80	0.13
195	603799	华友钴业	7,494	291,216.84	0.13
196	601111	中国国航	43,900	290,179.00	0.13
197	000656	金科股份	35,500	289,680.00	0.13
198	000963	华东医药	11,396	288,318.80	0.13
199	688505	复旦张江	11,583	287,026.74	0.13
200	600298	安琪酵母	5,800	286,984.00	0.13
201	002252	上海莱士	33,800	285,948.00	0.13
202	002463	沪电股份	11,400	284,772.00	0.13
203	600660	福耀玻璃	13,641	284,687.67	0.13
204	300595	欧普康视	4,100	284,294.00	0.13
205	000625	长安汽车	25,800	283,800.00	0.13
206	300450	先导智能	6,100	281,881.00	0.12
207	601360	三六零	15,200	278,312.00	0.12
208	600352	浙江龙盛	21,720	277,798.80	0.12
209	603882	金城医学	3,100	277,450.00	0.12
210	000157	中联重科	42,910	275,911.30	0.12
211	300661	圣邦股份	900	274,545.00	0.12
212	603444	吉比特	500	274,505.00	0.12
213	601727	上海电气	53,700	270,648.00	0.12
214	002032	苏泊尔	3,800	269,800.00	0.12
215	600536	中国软件	3,400	269,280.00	0.12
216	603517	绝味食品	3,800	268,812.00	0.12
217	600674	川投能源	28,900	267,903.00	0.12
218	300383	光环新网	10,200	265,914.00	0.12

219	603707	健友股份	4,100	264,737.00	0.12
220	601162	天风证券	43,100	261,186.00	0.12
221	002607	中公教育	9,400	260,850.00	0.12
222	601872	招商轮船	44,500	259,435.00	0.11
223	600760	中航沈飞	7,900	259,278.00	0.11
224	600115	东方航空	61,210	258,306.20	0.11
225	002065	东华软件	20,606	257,987.12	0.11
226	002773	康弘药业	5,200	257,920.00	0.11
227	002690	美亚光电	4,900	257,740.00	0.11
228	002439	启明星辰	6,100	256,627.00	0.11
229	002603	以岭药业	8,200	255,758.00	0.11
230	000066	中国长城	19,300	254,760.00	0.11
231	603338	浙江鼎力	3,360	254,587.20	0.11
232	601319	中国人保	39,500	254,380.00	0.11
233	600018	上港集团	60,506	254,125.20	0.11
234	002385	大北农	27,681	252,173.91	0.11
235	002223	鱼跃医疗	6,900	251,160.00	0.11
236	601108	财通证券	24,200	248,050.00	0.11
237	600118	中国卫星	8,025	247,410.75	0.11
238	600085	同仁堂	9,097	246,710.64	0.11
239	000783	长江证券	36,400	245,336.00	0.11
240	002373	千方科技	10,200	244,698.00	0.11
241	002299	圣农发展	8,400	243,600.00	0.11
242	600795	国电电力	131,100	242,535.00	0.11
243	601607	上海医药	13,160	241,880.80	0.11
244	601799	星宇股份	1,900	241,300.00	0.11
245	002180	纳思达	7,317	240,802.47	0.11
246	000786	北新建材	11,200	238,896.00	0.11
247	002153	石基信息	6,100	238,083.00	0.11
248	600705	中航资本	59,484	235,556.64	0.10
249	601600	中国铝业	85,300	235,428.00	0.10
250	600132	重庆啤酒	3,200	233,600.00	0.10
251	002202	金风科技	23,383	233,128.51	0.10
252	600522	中天科技	20,300	232,435.00	0.10
253	601800	中国交建	31,625	232,127.50	0.10
254	600867	通化东宝	13,305	231,906.15	0.10
255	002185	华天科技	17,100	231,363.00	0.10
256	600998	九州通	12,400	230,888.00	0.10
257	600315	上海家化	4,800	229,920.00	0.10

258	600111	北方稀土	24,467	228,032.44	0.10
259	000703	恒逸石化	24,910	227,428.30	0.10
260	600498	烽火通信	7,800	225,498.00	0.10
261	002146	荣盛发展	27,751	224,783.10	0.10
262	300357	我武生物	3,600	224,100.00	0.10
263	601919	中远海控	64,486	223,766.42	0.10
264	002466	天齐锂业	9,750	223,762.50	0.10
265	600637	东方明珠	23,120	223,108.00	0.10
266	002405	四维图新	13,500	222,615.00	0.10
267	603858	步长制药	7,703	222,231.55	0.10
268	600109	国金证券	19,469	222,141.29	0.10
269	000961	中南建设	24,900	221,610.00	0.10
270	001914	招商积余	7,200	221,256.00	0.10
271	300699	光威复材	3,500	219,555.00	0.10
272	601021	春秋航空	6,200	218,488.00	0.10
273	300285	国瓷材料	6,500	217,815.00	0.10
274	600380	健康元	13,400	217,616.00	0.10
275	600176	中国巨石	23,700	216,855.00	0.10
276	002739	万达电影	14,200	216,834.00	0.10
277	600487	亨通光电	13,184	216,349.44	0.10
278	600511	国药股份	5,300	215,551.00	0.10
279	600004	白云机场	14,100	214,884.00	0.10
280	600801	华新水泥	9,000	213,390.00	0.09
281	600489	中金黄金	23,300	212,962.00	0.09
282	600885	宏发股份	5,300	212,636.00	0.09
283	000050	深天马 A	13,800	211,968.00	0.09
284	000975	银泰黄金	13,500	211,680.00	0.09
285	002152	广电运通	16,300	210,922.00	0.09
286	002294	信立泰	7,107	210,793.62	0.09
287	300316	晶盛机电	8,500	210,290.00	0.09
288	002212	南洋股份	7,900	209,982.00	0.09
289	601555	东吴证券	25,665	209,426.40	0.09
290	600201	生物股份	7,500	208,800.00	0.09
291	603833	欧派家居	1,800	208,620.00	0.09
292	600011	华能国际	49,378	208,375.16	0.09
293	603712	七一二	5,400	207,252.00	0.09
294	002601	龙蟠佰利	11,200	207,200.00	0.09
295	601018	宁波港	58,000	207,060.00	0.09
296	002074	国轩高科	7,700	206,668.00	0.09

297	300251	光线传媒	18,900	206,199.00	0.09
298	601231	环旭电子	9,300	203,112.00	0.09
299	002508	老板电器	6,500	202,215.00	0.09
300	002507	涪陵榨菜	5,600	201,656.00	0.09
301	000513	丽珠集团	4,200	201,642.00	0.09
302	002353	杰瑞股份	6,500	201,500.00	0.09
303	002465	海格通信	15,548	201,191.12	0.09
304	601689	拓普集团	7,200	200,880.00	0.09
305	600177	雅戈尔	33,700	200,852.00	0.09
306	300146	汤臣倍健	10,200	200,838.00	0.09
307	002422	科伦药业	9,532	200,172.00	0.09
308	600271	航天信息	12,304	199,816.96	0.09
309	600779	水井坊	3,200	199,744.00	0.09
310	601998	中信银行	38,396	197,739.40	0.09
311	600699	均胜电子	8,300	197,623.00	0.09
312	002242	九阳股份	5,300	197,531.00	0.09
313	601198	东兴证券	18,094	197,224.60	0.09
314	000999	华润三九	6,753	197,120.07	0.09
315	000021	深科技	9,000	196,470.00	0.09
316	600642	申能股份	33,100	195,621.00	0.09
317	002156	通富微电	7,800	195,390.00	0.09
318	603589	口子窖	3,837	195,303.30	0.09
319	300418	昆仑万维	7,800	194,688.00	0.09
320	300207	欣旺达	10,300	194,670.00	0.09
321	601838	成都银行	24,300	193,428.00	0.09
322	002013	中航机电	24,400	192,760.00	0.09
323	600655	豫园股份	21,700	192,262.00	0.09
324	002511	中顺洁柔	8,600	191,780.00	0.08
325	000728	国元证券	22,800	191,520.00	0.08
326	600739	辽宁成大	10,099	191,174.07	0.08
327	002673	西部证券	23,400	190,944.00	0.08
328	002019	亿帆医药	8,300	190,651.00	0.08
329	603883	老百姓	1,900	190,076.00	0.08
330	600895	张江高科	9,300	189,441.00	0.08
331	600362	江西铜业	14,055	189,180.30	0.08
332	600426	华鲁恒升	10,700	189,176.00	0.08
333	600598	北大荒	11,700	188,370.00	0.08
334	002075	沙钢股份	15,000	187,500.00	0.08
335	000739	普洛药业	8,000	186,320.00	0.08

336	603659	璞泰来	1,800	185,436.00	0.08
337	600068	葛洲坝	30,916	183,950.20	0.08
338	300088	长信科技	16,400	183,680.00	0.08
339	600170	上海建工	59,800	183,586.00	0.08
340	603866	桃李面包	3,600	183,204.00	0.08
341	600066	宇通客车	14,942	182,292.40	0.08
342	601117	中国化学	33,138	181,596.24	0.08
343	002926	华西证券	17,000	180,710.00	0.08
344	002683	宏大爆破	5,100	177,990.00	0.08
345	002399	海普瑞	7,100	177,784.00	0.08
346	300070	碧水源	21,600	175,392.00	0.08
347	601878	浙商证券	17,600	174,416.00	0.08
348	300168	万达信息	7,900	174,353.00	0.08
349	000627	天茂集团	33,281	173,394.01	0.08
350	002939	长城证券	14,000	172,480.00	0.08
351	601992	金隅集团	56,319	172,336.14	0.08
352	600089	特变电工	25,300	171,281.00	0.08
353	002131	利欧股份	44,300	170,998.00	0.08
354	000423	东阿阿胶	4,757	170,348.17	0.08
355	600369	西南证券	37,100	170,289.00	0.08
356	000723	美锦能源	27,200	170,272.00	0.08
357	600208	新湖中宝	57,119	170,214.62	0.08
358	000671	阳光城	26,700	169,278.00	0.07
359	000988	华工科技	6,900	168,567.00	0.07
360	600038	中直股份	4,100	168,387.00	0.07
361	600667	太极实业	14,200	167,844.00	0.07
362	600909	华安证券	24,390	166,583.70	0.07
363	002030	达安基因	6,060	165,316.80	0.07
364	600486	扬农化工	2,000	165,000.00	0.07
365	002797	第一创业	23,700	164,004.00	0.07
366	601966	玲珑轮胎	8,100	163,620.00	0.07
367	600221	海航控股	108,900	163,350.00	0.07
368	600875	东方电气	18,400	162,840.00	0.07
369	002078	太阳纸业	17,100	162,792.00	0.07
370	002958	青农商行	36,600	162,138.00	0.07
371	002174	游族网络	6,200	161,696.00	0.07
372	002558	巨人网络	9,268	161,263.20	0.07
373	002281	光迅科技	4,900	161,014.00	0.07
374	002500	山西证券	24,602	160,897.08	0.07

375	300271	华宇软件	5,700	160,797.00	0.07
376	002340	格林美	32,300	160,531.00	0.07
377	600219	南山铝业	79,000	160,370.00	0.07
378	600516	方大炭素	25,512	160,215.36	0.07
379	002925	盈趣科技	2,700	156,438.00	0.07
380	000750	国海证券	35,860	155,632.40	0.07
381	600754	锦江酒店	5,600	155,400.00	0.07
382	000932	华菱钢铁	40,900	154,193.00	0.07
383	300212	易华录	2,700	151,200.00	0.07
384	600026	中远海能	23,300	150,518.00	0.07
385	000540	中天金融	46,700	150,374.00	0.07
386	002572	索菲亚	6,100	147,437.00	0.07
387	600027	华电国际	42,800	146,376.00	0.06
388	600153	建发股份	18,055	146,245.50	0.06
389	601233	桐昆股份	11,400	145,464.00	0.06
390	600566	济川药业	5,700	145,122.00	0.06
391	600688	上海石化	41,300	143,724.00	0.06
392	600188	兖州煤业	16,400	143,664.00	0.06
393	000998	隆平高科	8,600	143,190.00	0.06
394	000709	河钢股份	70,129	143,063.16	0.06
395	000401	冀东水泥	8,900	142,756.00	0.06
396	600704	物产中大	33,900	142,719.00	0.06
397	601099	太平洋	45,000	142,650.00	0.06
398	601216	君正集团	55,900	141,986.00	0.06
399	300024	机器人	10,300	140,801.00	0.06
400	002081	金螳螂	17,754	139,546.44	0.06
401	002468	申通快递	8,500	139,485.00	0.06
402	300017	网宿科技	16,400	139,236.00	0.06
403	000688	建新矿业	7,500	138,975.00	0.06
404	600673	东阳光	19,900	137,509.00	0.06
405	600583	海油工程	29,900	136,045.00	0.06
406	600977	中国电影	10,315	135,435.95	0.06
407	000630	铜陵有色	69,915	134,935.95	0.06
408	600167	联美控股	9,400	134,796.00	0.06
409	601128	常熟银行	17,900	134,429.00	0.06
410	000686	东北证券	15,600	131,820.00	0.06
411	600372	中航电子	9,800	130,536.00	0.06
412	002387	维信诺	9,000	128,520.00	0.06
413	000402	金融街	19,300	128,152.00	0.06

414	600021	上海电力	17,200	127,280.00	0.06
415	000825	太钢不锈	38,300	127,156.00	0.06
416	600460	士兰微	8,600	126,248.00	0.06
417	002268	卫 士 通	5,900	125,906.00	0.06
418	601098	中南传媒	11,900	125,902.00	0.06
419	600160	巨化股份	18,200	125,398.00	0.06
420	300482	万孚生物	1,200	124,800.00	0.06
421	300496	中科创达	1,600	124,320.00	0.06
422	000623	吉林敖东	7,900	124,267.00	0.06
423	000547	航天发展	9,000	123,030.00	0.05
424	000729	燕京啤酒	17,900	122,615.00	0.05
425	000415	渤海金控	41,100	122,478.00	0.05
426	002372	伟星新材	10,400	120,952.00	0.05
427	600820	隧道股份	21,399	120,904.35	0.05
428	000027	深圳能源	25,998	120,630.72	0.05
429	002010	传化智联	22,104	120,245.76	0.05
430	600733	北汽蓝谷	18,400	118,312.00	0.05
431	000581	威孚高科	5,700	117,876.00	0.05
432	600256	广汇能源	43,500	117,450.00	0.05
433	600967	内蒙一机	11,300	117,407.00	0.05
434	600879	航天电子	18,200	117,208.00	0.05
435	000028	国药一致	2,600	117,026.00	0.05
436	600446	金证股份	6,000	116,400.00	0.05
437	000629	*ST 钒钛	57,800	116,178.00	0.05
438	000997	新 大 陆	7,200	115,056.00	0.05
439	300012	华测检测	5,800	114,608.00	0.05
440	002563	森马服饰	15,800	111,390.00	0.05
441	002110	三钢闽光	16,500	109,890.00	0.05
442	600675	中华企业	26,900	109,483.00	0.05
443	002217	合力泰	20,700	108,675.00	0.05
444	002195	二三四五	38,664	108,645.84	0.05
445	601958	金钼股份	17,531	108,341.58	0.05
446	601699	潞安环能	19,415	108,141.55	0.05
447	600549	厦门钨业	9,100	107,744.00	0.05
448	300026	红日药业	19,500	107,640.00	0.05
449	600373	中文传媒	8,976	105,737.28	0.05
450	000089	深圳机场	13,800	105,708.00	0.05
451	000738	航发控制	7,700	105,105.00	0.05
451	600466	蓝光发展	19,500	105,105.00	0.05

452	600258	首旅酒店	6,800	104,516.00	0.05
453	000046	泛海控股	27,600	104,052.00	0.05
454	600808	马钢股份	40,300	103,974.00	0.05
455	600056	中国医药	7,300	103,295.00	0.05
456	300296	利亚德	16,800	101,976.00	0.05
457	000983	西山煤电	26,802	100,507.50	0.04
458	000883	湖北能源	28,300	99,616.00	0.04
459	603885	吉祥航空	10,900	99,190.00	0.04
460	600376	首开股份	16,900	99,034.00	0.04
461	601866	中远海发	53,457	98,360.88	0.04
462	002557	洽洽食品	1,800	97,542.00	0.04
463	600863	内蒙华电	39,400	96,924.00	0.04
464	600572	康恩贝	17,600	96,800.00	0.04
465	000031	大悦城	18,900	96,201.00	0.04
466	688096	京源环保	4,485	96,068.70	0.04
467	600260	凯乐科技	7,100	95,992.00	0.04
468	002396	星网锐捷	2,700	95,391.00	0.04
469	601598	中国外运	29,400	94,962.00	0.04
470	002085	万丰奥威	14,600	94,608.00	0.04
471	688528	秦川物联	8,337	94,458.21	0.04
472	000598	兴蓉环境	19,700	90,620.00	0.04
473	603605	珀莱雅	500	90,010.00	0.04
474	000898	鞍钢股份	35,990	88,175.50	0.04
475	002506	协鑫集成	33,600	87,696.00	0.04
476	688600	皖仪科技	5,468	84,754.00	0.04
477	603087	甘李药业	667	66,900.10	0.03
478	300824	北鼎股份	1,954	26,789.34	0.01
479	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.01
480	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.01
481	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.01
482	300847	中船汉光	1,421	9,861.74	0.00
483	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
484	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
485	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
486	300846	首都在线	1,131	3,811.47	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300760	迈瑞医疗	1,872,497.00	0.55
2	600745	闻泰科技	1,418,764.06	0.42
3	002714	牧原股份	1,071,706.00	0.32
4	000858	五粮液	977,538.00	0.29
5	300750	宁德时代	962,382.00	0.28
6	000001	平安银行	915,604.96	0.27
7	002415	海康威视	811,944.00	0.24
8	600519	贵州茅台	772,930.00	0.23
9	000002	万科 A	727,277.00	0.21
10	300601	康泰生物	653,490.00	0.19
11	002352	顺丰控股	578,614.00	0.17
12	002252	上海莱士	500,034.00	0.15
13	002841	视源股份	494,736.00	0.15
14	002475	立讯精密	487,241.00	0.14
15	002142	宁波银行	475,747.00	0.14
16	000063	中兴通讯	450,628.00	0.13
17	601318	中国平安	439,709.00	0.13
18	601319	中国人保	421,893.00	0.12
19	300347	泰格医药	391,784.00	0.12
20	002602	世纪华通	384,677.04	0.11

注：不考虑相关交易费用。

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	000858	五粮液	3,153,517.00	0.93
2	300750	宁德时代	2,327,026.00	0.69
3	002415	海康威视	2,180,795.00	0.64
4	000333	美的集团	2,115,251.60	0.62
5	000002	万科 A	1,879,134.70	0.55

6	000001	平安银行	1,742,404.76	0.51
7	002714	牧原股份	1,584,655.00	0.47
8	002475	立讯精密	1,446,069.00	0.43
9	300760	迈瑞医疗	1,401,577.00	0.41
10	688396	华润微	1,139,304.00	0.34
11	000063	中兴通讯	1,116,611.88	0.33
12	688233	神工股份	1,078,570.98	0.32
13	300498	温氏股份	1,072,305.00	0.32
14	000651	格力电器	1,055,107.00	0.31
15	002142	宁波银行	1,027,538.00	0.30
16	000725	京东方A	977,616.00	0.29
17	001979	招商蛇口	968,498.31	0.29
18	300601	康泰生物	956,201.52	0.28
19	002304	洋河股份	930,396.00	0.27
20	300015	爱尔眼科	898,231.40	0.26

注：不考虑相关交易费用。

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	54,695,496.30
卖出股票收入（成交）总额	101,394,728.91

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的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IC2007	中证 500 期货 2007 合约	3	3,479,640.00	67,800.00	-
IF2007	沪深 300 期货 2007 合约	5	6,177,000.00	129,900.00	-
公允价值变动总额合计（元）					197,700.00
股指期货投资本期收益（元）					868,880.00
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-326,840.00

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期内，基金投资股指期货的目的是为了提升基金的流动性水平，以及在期货贴水时作为现货的替代。

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	1,076,953.71

2	应收证券清算款	1,413,730.55
3	应收股利	-
4	应收利息	2,651.99
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,493,336.25

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
3,353	52,805.37	52,890,193.00	29.87%	124,166,201.00	70.13%

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	28,625,141.00	16.17%

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	友邦保险有限公司江苏分公司一传 统一普通保险产品	15,819,700.00	8.93%
2	华泰证券股份有限公司	6,218,783.00	3.51%
3	于长清	5,511,100.00	3.11%
4	罗雄强	3,530,000.00	1.99%
5	张招兴	2,739,700.00	1.55%
6	罗魁	2,000,000.00	1.13%
7	中国银河证券股份有限公司	1,814,724.00	1.02%
8	曹新勤	1,415,900.00	0.80%
9	何少雄	1,320,200.00	0.75%
10	王丹红	1,172,900.00	0.66%

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

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	0.00	0.0000%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
----	-------------------

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（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	293,056,394.00
本报告期基金总申购份额	44,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	160,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	177,056,394.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2020年2月10日，经公司董事会批准程安至先生不再担任公司副总经理。
上述人事变动已按相关规定备案、公告。

基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

2020年3月，公司收到上海证监局对公司采取责令改正措施的决定。公司高度重视，立即制定并实施相关整改措施，落实整改要求。2020年4月公司完成整改事项并及时向监管机构提交整改报告。

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	151,256,730.79	100.00%	31,530.58	100.00%	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-

华西证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
西藏东方财富	2	-	-	-	-	-
宏信证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
财达证券	2	-	-	-	-	-

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。

3、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：无。

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	239,024.83	100.00%	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-

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ETF申赎清单版本更新公告	证监会规定报刊和网站	2020年6月4日

2	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金参加中国国际期货有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2020年3月18日
3	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下上海证券交易所上市基金增加扩位证券简称的公告	证监会规定报刊和网站	2020年3月13日
4	华泰柏瑞基金管理有限公司关于调整旗下基金最低申购金额、最低赎回份额和最低持有份额的公告	证监会规定报刊和网站	2020年3月9日
5	华泰柏瑞基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证监会规定报刊和网站	2020年2月14日
6	华泰柏瑞基金管理有限公司关于调整旗下基金2020年春节假期申购赎回等交易业务及清算交收安排的提示性公告	证监会规定报刊和网站	2020年1月30日
7	关于华泰柏瑞MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金调整申赎模式并修改基金合同的公告	证监会规定报刊和网站	2020年1月15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	20200101-20200206	70,964,641.00	10,000,000.00	52,339,500.00	28,625,141.00	16.17%
产品特有风险							
<p>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</p>							

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

注：无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

12.3 查阅方式

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

华泰柏瑞基金管理有限公司

2020 年 8 月 29 日