

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 年年度报告

2020 年 12 月 31 日

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2021 年 3 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 3 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 2020 年 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
§ 4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	17
§ 5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	18
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	18
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	18
§ 6 审计报告	19
6.1 审计报告基本信息	19

6.2 审计报告的基本内容.....	19
§7 年度财务报表.....	22
7.1 资产负债表.....	22
7.2 利润表.....	23
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	24
7.4 报表附注.....	25
§8 投资组合报告.....	60
8.1 期末基金资产组合情况.....	60
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	60
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	61
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	74
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	76
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	76
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	76
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	76
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	76
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	77
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	77
8.12 投资组合报告附注.....	77
§9 基金份额持有人信息.....	79
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	79
9.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	79
9.3 期末上市基金前十名持有人.....	79
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	79
9.5 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	80
§10 开放式基金份额变动.....	81
§11 重大事件揭示.....	82
11.1 基金份额持有人大会决议.....	82
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	82
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	82

11.4 基金投资策略的改变.....	82
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	82
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	82
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	82
11.8 其他重大事件.....	84
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	87
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	87
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	88
§13 备查文件目录.....	89
13.1 备查文件目录.....	89
13.2 存放地点.....	89
13.3 查阅方式.....	89

§ 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	417,056,394.00 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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.huatai-pb.com
基金年度报告备置地点	上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京西城区金融大街 27 号投资广场 22-23 层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2020 年	2019 年	2018 年 4 月 26 日 (基金合同生效日)-2018 年 12 月 31 日
本期已实现收益	58,855,234.23	66,493,818.23	-15,680,687.89
本期利润	116,643,953.45	257,126,969.26	-173,965,923.51
加权平均基金份额本期利润	0.4740	0.4610	-0.1714
本期加权平均净值利润率	34.82%	46.28%	-18.83%
本期基金份额净值增长率	45.09%	41.89%	-18.45%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
期末可供分配利润	161,028,940.53	39,582,230.14	-193,888,614.18
期末可供分配基金份额利润	0.3861	0.1351	-0.1845
期末基金资产净值	700,158,926.91	339,094,707.33	857,167,779.82
期末基金份额净值	1.6788	1.1571	0.8155
3.1.3 累计期末指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
基金份额累计净值增长率	67.88%	15.71%	-18.45%

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

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

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

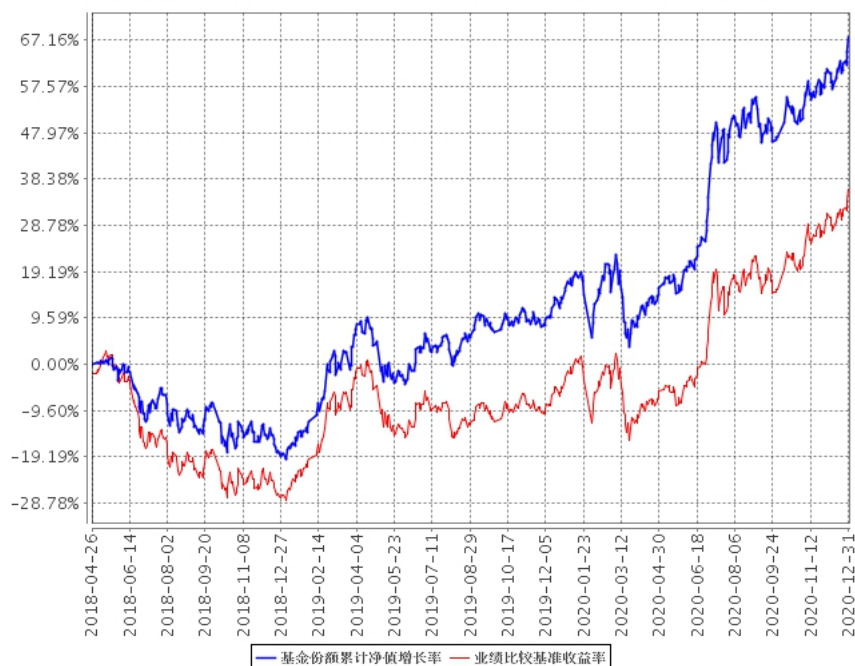
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	14.18%	1.01%	17.80%	1.14%	-3.62%	-0.13%
过去六个月	31.61%	1.31%	34.35%	1.45%	-2.74%	-0.14%
过去一年	45.09%	1.42%	39.96%	1.57%	5.13%	-0.15%
自基金合同生效起至今	67.88%	1.34%	36.20%	1.48%	31.68%	-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

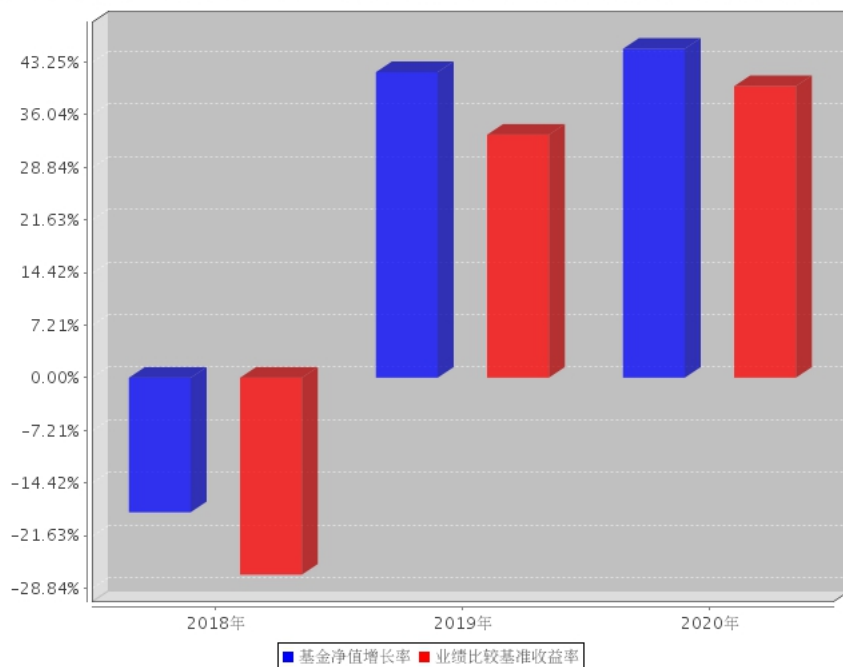
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：图示日期为2018年4月26日至2020年12月31日。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：基金合同生效日为2018年4月26日，2018年度的相关数据根据当年的实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金未实施过利润分配。

§ 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、华泰柏瑞医疗健康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债券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、华泰柏瑞品质优选混合型证券投资基金、华泰柏瑞景利混合型证券投资基金、华泰柏瑞优势领航混合型证券投资基金、华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞锦乾债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化创盈混合型证券投资基金、华泰柏瑞成长智选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞量化创享混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金。截至 2020 年 12 月 31 日，公司基金管理规模为 1622.89 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，2000-2001 年任上海汽车集团财务有限公司财务，2001-2004 年任华安基金管理有限公司高级基金核算员，2004 年 7 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任基金事务部总监、上证红利 ETF 基金经理助理。2009 年 6 月起任华泰柏瑞（原友邦华泰）上证红利交易型开放式指数基金基金经理。2010 年 10 月起担任指数投资部

				<p>副总监。2011年1月至2020年2月任华泰柏瑞上证中小盘ETF基金、华泰柏瑞上证中小盘ETF联接基金基金经理。2012年5月起兼任华泰柏瑞沪深300ETF基金、华泰柏瑞沪深300ETF联接基金基金经理。2015年2月起任指数投资部总监。2015年5月起任华泰柏瑞中证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。2020年9月起任华泰柏瑞上证科创板50成份交</p>
--	--	--	--	---

					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。任职日期和离职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 公平交易制度和控制方法

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

目前公司公募基金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。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本报告期内，本产品不存在基金经理同时兼任私募资产管理计划投资经理工作的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

本报告期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 年市场以结构性机会为主。其中休闲服务、电气设备、食品饮料、国防军工、医药生物等行业录得正收益，期间休闲服务行业指数上涨达 99.38%，电气设备行业指数上涨达 94.71%，食品饮料行业上涨 84.97%。整体来看，沪深 300、中证 500、中证 1000 和创业板涨跌幅分别为 27.21%、20.87%、19.39% 和 64.96%。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 成长指数分别涨幅为 0.19% 和 43.96%，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 13.681%，日均绝对跟踪偏离度为 0.050%，期间日跟踪误差为 0.102%，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 1.6788 元；本报告期基金份额净值增长率为 45.09%，业绩比较基准收益率为 39.96%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2021 年，经济随着疫苗逐步落地继续复苏，全球开始进入后疫情时代。货币政策方面，货币

政策会回归常态化，边际上有所收紧。但是鉴于通胀、房价等指标尚处于温和回升状态，货币政策仍可能属于稳健偏宽松的水平。企业盈利方面，中国增长率先恢复至疫情前水平。由于低基数效应，受企业资本开支增长、消费继续恢复等驱动，盈利同比的高增速可能进一步提振风险偏好。企业盈利将是核心驱动力，对股价形成有力支撑。2020 年刺激政策的滞后效应，供给企稳、疫情影响消退后引致的需求回暖以及海外经济的共振复苏是宏观层面驱动中国股票盈利增长的重要因素。

2020 年初，突如其来的疫情中断了“再库存”交易，风险资产波动率骤升，全球主要市场股指、部分商品价格都有所调整，特别是原油价格大幅下跌，黄金受益于避险情绪持续上涨。债券利率则在趋势下行，信用利差有所扩大。面对突如其来的新冠疫情，全球进一步进入量化宽松阶段，中国央行也加大了逆周期调节政策力度，存款准备金率、OMO、MLF、LPR 利率都有明显下降，货币政策的宽松也成为稳定资产价格的重要因素。随着疫情对经济活动的影响逐渐减弱，总需求企稳回升、增长复苏力度增强，货币政策会向正常化回归，大类资产配置由流动性和增长预期双驱动过渡到以增长为主导。

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

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2020 年度，本基金管理人在为基金份额持有人谋求最大利益的同时，始终将合规运作、防范风险工作放在各项工作的首位。依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。公司监察部门按照规定的权限和程序，通过实时监控、现场检查、重点抽查和人员询问等方法，独立地开展基金运作和公司管理的合规性稽核，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向董事长和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

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

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

(2) 开展定期和专项监察稽核工作，确保各项业务活动的合法合规

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

(3) 促进公司各项内部管理制度的完善

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

(4) 通过各种合规培训提高员工合规意识

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

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未进行利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

注：无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2021)第 22556 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	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全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了华泰柏瑞 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“华泰柏瑞 MSCIETF 基金”)的财务报表,包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表, 2020 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了华泰柏瑞 MSCIETF 基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于华泰柏瑞 MSCIETF 基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>

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

	<p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对华泰柏瑞 MSCIETF 基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致华泰柏瑞 MSCIETF 基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	张炯 朱宏宇
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2021 年 3 月 29 日

§ 7 年度财务报表

7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	9,790,606.46	10,198,192.63
结算备付金		5,462,843.00	2,883,879.77
存出保证金		1,525,751.91	1,283,705.68
交易性金融资产	7.4.7.2	684,305,352.74	324,960,406.69
其中：股票投资		683,895,352.74	324,960,406.69
基金投资		-	-
债券投资		410,000.00	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		318,870.90	171,824.45
应收利息	7.4.7.5	3,748.63	4,018.76
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		701,407,173.64	339,502,027.98
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	2,426.40
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		70,013.69	42,444.59
应付托管费		23,337.88	14,148.18
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	55,149.95	5,886.43
应交税费		30,436.16	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	1,069,309.05	342,415.05
负债合计		1,248,246.73	407,320.65
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	417,056,394.00	293,056,394.00
未分配利润	7.4.7.10	283,102,532.91	46,038,313.33
所有者权益合计		700,158,926.91	339,094,707.33
负债和所有者权益总计		701,407,173.64	339,502,027.98

注：报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.6788 元，基金份额总额 417,056,394.00 份。

7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
一、收入		118,105,230.65	260,809,641.29
1.利息收入		113,177.48	44,804.00
其中：存款利息收入	7.4.7.11	112,330.20	40,878.76
债券利息收入		122.07	38.43
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		725.21	3,886.81
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		58,637,385.21	69,531,342.88
其中：股票投资收益	7.4.7.12	51,194,603.98	61,150,966.10
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	169,845.85	18,673.67
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	3,137,514.57	-
股利收益	7.4.7.16	4,135,420.81	8,361,703.11
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	57,788,719.22	190,633,151.03
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	1,565,948.74	600,343.38

列)			
减：二、费用		1,461,277.20	3,682,672.03
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	500,647.60	2,052,625.85
2. 托管费	7.4.10.2.2	166,882.50	453,854.51
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	412,353.63	763,572.07
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		11,295.33	0.12
7. 其他费用	7.4.7.20	370,098.14	412,619.48
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		116,643,953.45	257,126,969.26
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		116,643,953.45	257,126,969.26

7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	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）	-	116,643,953.45	116,643,953.45
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）	124,000,000.00	120,420,266.13	244,420,266.13
其中：1.基金申购款	341,000,000.00	175,045,637.90	516,045,637.90
2.基金赎回款	-217,000,000.00	-54,625,371.77	-271,625,371.77
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）	417,056,394.00	283,102,532.91	700,158,926.91

项目	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	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）	-	257,126,969.26	257,126,969.26
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）	-758,000,000.00	-17,200,041.75	-775,200,041.75
其中：1. 基金申购款	280,000,000.00	1,476,445.30	281,476,445.30
2. 基金赎回款	-1,038,000,000.00	-18,676,487.05	-1,056,676,487.05
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）	293,056,394.00	46,038,313.33	339,094,707.33

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

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)、存托凭证、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。本基金将根据法律法规的规定,在履行适当程序后参与融资及转融通证券出借业务。根据《华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下 4 只证券投资基金修改基金合同和托管协议的公告》,本基金自 2019 年 10 月 16 日起,修改上述投资范围表述:本基金可根据法律法规的规定,参与转融通证券出借业务。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。

本基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司以本基金为目标 ETF,募集成立了华泰柏瑞 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“华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 联接基金”)。华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 联接基金为交易型开放式基金,投资目标与本基金类似,将绝大多数基金资产投资于本基金。

本财务报表由本基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于 2021 年 3 月 29 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本

准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《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 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金在投资人申购、赎回过程中而待与投资人结算的可退替代款分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，在资产负债表中以交易性金融负债列示。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

本基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司(以下简称“证金公司”)出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息确认为利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配；基金管理人每季度定期对基金

相对标的指数的超额收益率进行一次评估，基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率达到 1%以上，方可对超额收益进行分配；本基金的收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使还原后基金份额净值低于面值。基金收益分配比例为收益评价日符合上述分红条件的基金超额收益的 100%，基金收益分配每年至多 4 次。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

（1）对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》（以下简称“指引”），按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

（2）对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和私募债

券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。

对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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
活期存款	9,790,606.46	10,198,192.63
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：	9,790,606.46	10,198,192.63

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	594,258,638.11	683,895,352.74	89,636,714.63
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	410,000.00	410,000.00
	银行间市场	-	-
	合计	410,000.00	410,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	594,668,638.11	684,305,352.74	89,636,714.63
项目	上年度末 2019年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	293,137,031.28	324,960,406.69	31,823,375.41
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	293,137,031.28	324,960,406.69	31,823,375.41

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	11,381,520.00	-	-	
股指期货	11,381,520.00	-	-	

其他衍生工具	-	-	-	
合计	11,381,520.00	-	-	
项目	上年度末 2019年12月31日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	11,427,140.00	-	-	
股指期货	11,427,140.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	11,427,140.00	-	-	

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为0。

于2020年12月31日，本基金持有的股指期货合约情况如下：

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IF2103	沪深2103	6	9,380,880.00	447,840.00
IC2103	中证2103	2	2,500,560.00	52,080.00
总额合计			11,881,440.00	499,920.00
减：可抵销期货暂收款				-499,920.00
股指期货投资净额				-

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
----	--------------------	---------------------

应收活期存款利息	1,129.38	2,068.88
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	2,564.43	1,926.89
应收债券利息	30.07	-
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	24.75	22.99
合计	3,748.63	4,018.76

7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
交易所市场应付交易费用	55,149.95	5,886.43
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	55,149.95	5,886.43

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	180,000.00	218,000.00
应付指数使用费	235,577.55	50,000.00
应付替代款	653,731.50	74,415.05
合计	1,069,309.05	342,415.05

7.4.7.9 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12月31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	341,000,000.00	341,000,000.00
本期赎回(以“-”号填列)	-217,000,000.00	-217,000,000.00
- 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	417,056,394.00	417,056,394.00

注：投资者申购和赎回的基金份额需为最小申购赎回单位的整数倍。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	39,582,230.14	6,456,083.19	46,038,313.33
本期利润	58,855,234.23	57,788,719.22	116,643,953.45
本期基金份额交易产生的变动数	62,591,476.16	57,828,789.97	120,420,266.13
其中：基金申购款	110,019,410.13	65,026,227.77	175,045,637.90
基金赎回款	-47,427,933.97	-7,197,437.80	-54,625,371.77
本期已分配利润	-	-	-
本期末	161,028,940.53	122,073,592.38	283,102,532.91

7.4.7.11 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12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
活期存款利息收入	49,173.31	28,991.92
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	62,366.44	10,676.07
其他	790.45	1,210.77
合计	112,330.20	40,878.76

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12 月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	43,797,448.52	26,174,045.79
股票投资收益——赎回差价收入	7,397,155.46	34,976,920.31
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	51,194,603.98	61,150,966.10

7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020 年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31日
卖出股票成交总额	202,642,083.22	465,259,511.80
减：卖出股票成本总额	158,844,634.70	439,085,466.01
买卖股票差价收入	43,797,448.52	26,174,045.79

7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至 2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019 年12月31日
赎回基金份额对价总额	271,625,371.77	1,056,676,487.05
减：现金支付赎回款总额	110,452,042.77	304,240,871.05
减：赎回股票成本总额	153,776,173.54	717,458,695.69
赎回差价收入	7,397,155.46	34,976,920.31

7.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无股票投资收益-申购差价收入。

7.4.7.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无股票投资收益-证券出借差价收入。

7.4.7.13 债券投资收益**7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月 31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	169,845.85	18,673.67
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	169,845.85	18,673.67

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月 31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	773,440.27	319,713.30
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	603,500.00	301,000.00
减：应收利息总额	94.42	39.63
买卖债券差价收入	169,845.85	18,673.67

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益-赎回差价收入。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益-申购差价收入。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益**7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益**7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

7.4.7.15.2 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12月 31日	上年度可比期间收益金额 2019年1月1日至2019年12月31 日
国债期货投资收益	-	-
股指期货-投资收益	3,137,514.57	-

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12 月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12 月31日
股票投资产生的股利收益	4,135,420.81	8,361,703.11
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	4,135,420.81	8,361,703.11
----	--------------	--------------

7.4.7.17 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12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31日
1. 交易性金融资产	57,813,339.22	190,112,043.03
——股票投资	57,813,339.22	190,112,043.03
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-24,620.00	524,540.00
——权证投资	-	-
股指期货	-24,620.00	524,540.00
3. 其他	-	-3,432.00
减：应税金融商品公允价值 变动产生的预估增值税	-	-
合计	57,788,719.22	190,633,151.03

注：其他为可退替代款的公允价值变动。

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12 月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	1,565,948.74	600,343.38
合计	1,565,948.74	600,343.38

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

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月
----	----------------------------	-------------------------------

	日	31 日
交易所市场交易费用	407,699.83	763,285.11
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	4,653.80	286.96
合计	412,353.63	763,572.07

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
审计费用	60,000.00	98,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行划款手续费	4,160.59	3,991.74
指数使用费	185,577.55	130,627.74
其他费用	360.00	-
上市费	-	60,000.00
合计	370,098.14	412,619.48

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.05% 的年费率计提，逐日累计，按季支付，标的指数许可使用费的收取下限为每季度伍(5)千美元或等值人民币(即不足 5 千美元部分按照 5 千美元或等值人民币收取)。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华泰柏瑞基金管理有限公司(“华泰柏瑞基金”)	基金管理人、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
PineBridge Investment LLC	基金管理人的股东
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、申购赎回代理券商、基金销售机构
苏州新区高新技术产业股份有限公司	基金管理人的股东
华泰联合证券有限责任公司(“华泰联合证券”)	基金管理人的股东华泰证券的控股子公司
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(“华泰柏瑞 MSCIETF 联接基金”)	本基金的基金管理人管理的其他基金
柏瑞爱建资产管理(上海)有限公司	基金管理人的控股子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31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	511,256,467.11	100.00%	656,933,973.52	93.05%

7.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31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	103,411.71	100.00%	55,149.95	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31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	157,125.12	81.77%	5,886.43	100.00%

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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12 月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31 日
	当期发生的基金应支付的管理费	500,647.60
其中：支付销售机构的客户维护费	10,331.71	71,571.59

注：自2019年1月1日至2019年6月9日，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。

7.4.10.2.2 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 12 月 31 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	166,882.50	453,854.51

注：自 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 9 日，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 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。

7.4.10.2.3 销售服务费

注：本期和上年可比期间均无数据。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

单位：人民币元

本期
2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
华泰证券	-	-	-	-
上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
华泰证券	383,020.00	253.22	-	-

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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注：本报告期及上年度，基金管理人未投资本基金。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2020年12月31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	68,551.00	0.0164%	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	292,017,341.00	70.0187%	70,964,641.00	24.2154%

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2020年1月1日至2020年12月31日		2019年1月1日至2019年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	9,790,606.46	49,173.31	10,198,192.63	28,991.92

注：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。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2020年1月1日至2020年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：份）	总金额
华泰联合证券	300919	中伟股份	网下申购	4,630	113,898.00
华泰联合证券	300907	康平科技	网下申购	4,724	67,553.20
上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：份）	总金额
-	-	-	-	-	-

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

于2020年12月31日，本基金持有122,100股华泰证券的A股普通股，成本总额为人民币2,340,115.00元，估值总额为人民币2,199,021.00元，占基金资产净值的比例为0.31%（2019年12月31日：本基金持有81,700股华泰证券的A股普通股，成本总额为人民币1,488,572.76元，估值总额为人民币1,659,327.00元，占基金资产净值的比例为0.49%。）。

于2020年12月31日，本基金持有162,536股建设银行的A股普通股，成本总额为人民币1,067,778.61元，估值总额为人民币1,020,726.08元，占基金资产净值的比例为0.15%（2019年12月31日：本基金持有107,236股建设银行的A股普通股，成本总额为人民币773,430.37元，估值总额为人民币775,316.28元，占基金资产净值的比例为0.23%。）。

7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2020 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688390	固德威	2020年8月27日	2021年3月4日	新股锁定期内	37.93	221.72	2,585	98,049.05	573,146.20	-
688133	泰坦科技	2020年10月22日	2021年4月30日	新股锁定期内	44.47	116.54	2,527	112,375.69	294,496.58	-
600919	江苏银行	2020年12月17日	2021年1月14日	配股未上市	4.59	5.46	38,903	178,564.77	212,410.38	-
688393	安必平	2020年8月12日	2021年2月22日	新股锁定期内	30.56	36.03	4,241	129,604.96	152,803.23	-
688617	惠泰医疗	2020年12月30日	2021年1月7日	新股未上市	74.46	74.46	1,238	92,181.48	92,181.48	-
688668	鼎通科技	2020年12月11日	2021年6月21日	新股锁定期内	20.07	24.56	3,037	60,952.59	74,588.72	-
688679	通源环境	2020年12月16日	2021年6月25日	新股锁定期内	12.05	13.49	3,139	37,824.95	42,345.11	-
300867	圣元环保	2020年8月12日	2021年3月3日	新股锁定期内	19.34	31.97	1,221	23,614.14	39,035.37	-
300926	博俊科技	2020年12月29日	2021年1月7日	新股未上市	10.76	10.76	3,584	38,563.84	38,563.84	-
300870	欧陆通	2020年8月13日	2021年2月24日	新股锁定期内	36.81	65.67	478	17,595.18	31,390.26	-
300919	中伟股份	2020年12月15日	2021年6月23日	新股锁定期内	24.60	61.51	463	11,389.80	28,479.13	-
300861	美畅	2020年	2021	新股锁	43.76	51.10	418	18,291.68	21,359.80	-

	股份	8月6日	年2月24日	定期内							
300910	瑞丰新材	2020年11月20日	2021年5月27日	新股锁定期内	30.26	47.87	431	13,042.06	20,631.97		-
300891	惠云钛业	2020年9月10日	2021年3月17日	新股锁定期内	3.64	16.40	1,143	4,160.52	18,745.20		-
300860	锋尚文化	2020年8月6日	2021年2月24日	新股锁定期内	138.02	126.67	140	19,322.80	17,733.80		-
300908	仲景食品	2020年11月13日	2021年5月24日	新股锁定期内	39.74	60.44	285	11,325.90	17,225.40		-
300884	狄耐克	2020年11月5日	2021年5月12日	新股锁定期内	24.87	33.51	499	12,410.13	16,721.49		-
300898	熊猫乳品	2020年10月9日	2021年4月16日	新股锁定期内	10.78	33.03	496	5,346.88	16,382.88		-
300889	爱克股份	2020年9月9日	2021年3月16日	新股锁定期内	27.97	30.12	479	13,397.63	14,427.48		-
300890	翔丰华	2020年9月10日	2021年3月18日	新股锁定期内	14.69	48.85	286	4,201.34	13,971.10		-
300925	法本信息	2020年12月21日	2021年6月30日	新股锁定期内	20.08	37.33	353	7,088.24	13,177.49		-
300895	铜牛信息	2020年9月17日	2021年3月24日	新股锁定期内	12.65	45.30	283	3,579.95	12,819.90		-
300907	康平科技	2020年11月11日	2021年5月18日	新股锁定期内	14.30	26.85	473	6,763.90	12,700.05		-
300879	大叶股份	2020年8月25日	2021年3月1日	新股锁定期内	10.58	27.12	466	4,930.28	12,637.92		-
300882	万胜智能	2020年8月27日	2021年3月10日	新股锁定期内	10.33	25.79	440	4,545.20	11,347.60		-
300911	亿田智能	2020年11月24日	2021年6月	新股锁定期内	24.35	33.06	309	7,524.15	10,215.54		-

		日	3日							
300893	松原股份	2020年9月17日	2021年3月24日	新股锁定期内	13.47	35.08	276	3,717.72	9,682.08	-
300918	南山智尚	2020年12月15日	2021年6月22日	新股锁定期内	4.97	8.94	1,063	5,283.11	9,503.22	-
300922	天秦装备	2020年12月18日	2021年6月25日	新股锁定期内	16.05	31.58	287	4,606.35	9,063.46	-
300917	特发服务	2020年12月14日	2021年6月21日	新股锁定期内	18.78	31.94	281	5,277.18	8,975.14	-
605277	新亚电子	2020年12月25日	2021年1月6日	新股未上市	16.95	16.95	507	8,593.65	8,593.65	-
003030	祖名股份	2020年12月25日	2021年1月6日	新股未上市	15.18	15.18	480	7,286.40	7,286.40	-
300886	华业香料	2020年9月8日	2021年3月16日	新股锁定期内	18.59	45.67	147	2,732.73	6,713.49	-
003031	中瓷电子	2020年12月24日	2021年1月4日	新股未上市	15.27	15.27	387	5,909.49	5,909.49	-

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券

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:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113044	大秦转债	2020年12月14日	2021年1月15日	配债未上市	100.00	100.00	3,610	361,000.00	361,000.00	-
113616	韦尔转债	2020年12月28日	2021年1月22日	配债未上市	100.00	100.00	400	40,000.00	40,000.00	-
113614	健20转债	2020年12月17日	2021年1月18日	配债未上市	100.00	100.00	90	9,000.00	9,000.00	-

注：

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

日起6个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后6个月内不得转让。

2、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于6个月的限售期。

3、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金的基金管理人建立的风险管理体系由“组织、制度、流程和报告”等四个方面构成。

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国建设银行，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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
AAA	361,000.00	0.00
AAA 以下	49,000.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	410,000.00	0.00

注：债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

7.4.13.3 流动性风险

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

于2020年12月31日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合

约到期现金流量。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限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 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 0.33%。

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

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

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020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	9,790,606.46	-	-	-	-	-	9,790,606.46
结算备付金	5,462,843.00	-	-	-	-	-	5,462,843.00
存出保证金	49,967.91	-	-	-	-	1,475,784.00	1,525,751.91
交易性金融资产	-	-	-	-	410,000.00	683,895,352.74	684,305,352.74
应收证券清算款	-	-	-	-	-	318,870.90	318,870.90
应收利息	-	-	-	-	-	3,748.63	3,748.63
资产总计	15,303,417.37	-	-	-	410,000.00	685,693,756.27	701,407,173.64
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	70,013.69	70,013.69
应付托管费	-	-	-	-	-	23,337.88	23,337.88
应付交易费用	-	-	-	-	-	55,149.95	55,149.95
应交税费	-	-	-	-	-	30,436.16	30,436.16
其他负债	-	-	-	-	-	1,069,309.05	1,069,309.05
负债总计	-	-	-	-	-	1,248,246.73	1,248,246.73
利率敏感度缺口	15,303,417.37	-	-	-	410,000.00	684,445,509.54	700,158,926.91
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，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于2020年12月31日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为0.06%（2019年12月31日：无），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）。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金为被动式指数基金，原则上采用完全复制的方法，按照个股在标的指数中的基准权重构建投资组合。基金所构建的指数化投资组合将根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。同时，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况、新股增发等变化，对基金投资组合进行相应调整，以保证基金份额净值增长率与标的指数间的高度正相关和跟踪误差最小化。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金主要投资于指数的成份股及其备选成份股，其投资比例不低于基金资产净值的 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 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	683,895,352.74	97.68	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	-	-	-2,426.40	0.00
合计	683,895,352.74	97.68	324,957,980.29	95.83

注：其他包含

1. 可退替代款。
2. 在期货交易所交易的期货投资(附注 7.4.7.3)。在当日无负债结算制度下，期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

7.4.13.4.3.2 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12月31日）	上年度末（2019年12月31日）
	MSCI 中国 A 股国际通指数上升 5%	31,154,301.39	15,319,766.42
	MSCI 中国 A 股国际通指数下降 5%	-31,154,301.39	-15,319,766.42

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 基金申购款

于 2020 年度，本基金申购基金份额的对价总额为 516,045,637.90 元（2019 年度：281,476,445.30 元），其中包括以股票支付的申购款 288,683,396.60 元和以现金支付的申购款 227,362,241.30 元（2019 年度：其中包括以股票支付的申购款 185,679,190.20 元和以现金支付的申购款 95,797,255.10 元）。

(2) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 682,020,087.89 元，属于第二层次的余额为 2,285,264.85 元，无属于第三层次的余额（2019 年 12 月 31 日：第一层次 323,259,062.13 元，第二层次 1,701,344.56 元，无第三层次）。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2020 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2019 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

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

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	683,895,352.74	97.50
	其中：股票	683,895,352.74	97.50
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	410,000.00	0.06
	其中：债券	410,000.00	0.06
	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	15,253,449.46	2.17
8	其他各项资产	1,848,371.44	0.26
9	合计	701,407,173.64	100.00

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增。

报告期末，本基金未参与转融通证券出借业务出借股票。报告期末，本基金与关联方进行转融通证券出借业务的余额为 0.00 元。

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	8,263,688.60	1.18
B	采矿业	16,236,781.75	2.32
C	制造业	388,169,038.91	55.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,132,839.54	1.73
E	建筑业	10,979,247.24	1.57
F	批发和零售业	9,651,489.99	1.38
G	交通运输、仓储和邮政业	19,283,533.15	2.75
H	住宿和餐饮业	690,502.00	0.10
I	信息传输、软件和信息技术服务业	25,770,165.01	3.68
J	金融业	140,353,927.98	20.05
K	房地产业	18,811,518.04	2.69

L	租赁和商务服务业	12,373,236.93	1.77
M	科学研究和技术服务业	6,420,547.58	0.92
N	水利、环境和公共设施管理业	487,595.48	0.07
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	955,536.00	0.14
Q	卫生和社会工作	9,083,142.24	1.30
R	文化、体育和娱乐业	3,980,056.30	0.57
S	综合	252,506.00	0.04
	合计	683,895,352.74	97.68

注：上述股票投资组合不包括可退替代款估值增。

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	20,848	41,654,304.00	5.95
2	000858	五粮液	64,606	18,855,261.10	2.69
3	601318	中国平安	179,920	15,649,441.60	2.24
4	600036	招商银行	342,554	15,055,248.30	2.15
5	300750	宁德时代	39,300	13,798,623.00	1.97
6	600276	恒瑞医药	84,462	9,414,134.52	1.34
7	601888	中国中免	32,399	9,151,097.55	1.31
8	603288	海天味业	42,832	8,589,529.28	1.23
9	002415	海康威视	155,379	7,537,435.29	1.08
10	601166	兴业银行	344,982	7,199,774.34	1.03
11	300760	迈瑞医疗	16,800	7,156,800.00	1.02
12	600900	长江电力	365,850	7,009,686.00	1.00
13	002475	立讯精密	117,885	6,615,706.20	0.94
14	000001	平安银行	323,129	6,249,314.86	0.89
15	002304	洋河股份	25,100	5,923,349.00	0.85
16	601012	隆基股份	62,798	5,789,975.60	0.83
17	002352	顺丰控股	63,167	5,573,224.41	0.80
18	002594	比亚迪	28,471	5,531,915.30	0.79
19	000568	泸州老窖	24,387	5,515,363.92	0.79
20	600809	山西汾酒	14,500	5,441,705.00	0.78
21	600030	中信证券	176,864	5,199,801.60	0.74
22	300015	爱尔眼科	68,125	5,101,881.25	0.73

23	603259	药明康德	37,400	5,038,528.00	0.72
24	600031	三一重工	140,637	4,919,482.26	0.70
25	002714	牧原股份	62,370	4,808,727.00	0.69
26	600309	万华化学	52,600	4,788,704.00	0.68
27	600000	浦发银行	487,989	4,723,733.52	0.67
28	000002	万科A	161,869	4,645,640.30	0.66
29	600887	伊利股份	100,924	4,477,997.88	0.64
30	601398	工商银行	896,517	4,473,619.83	0.64
31	300059	东方财富	143,240	4,440,440.00	0.63
32	601601	中国太保	104,600	4,016,640.00	0.57
33	300122	智飞生物	26,600	3,934,406.00	0.56
34	601288	农业银行	1,238,477	3,888,817.78	0.56
35	002142	宁波银行	99,688	3,522,973.92	0.50
36	601668	中国建筑	694,804	3,453,175.88	0.49
37	600585	海螺水泥	66,586	3,437,169.32	0.49
38	000725	京东方A	562,296	3,373,776.00	0.48
39	603501	韦尔股份	14,400	3,327,840.00	0.48
40	600104	上汽集团	129,529	3,165,688.76	0.45
41	600048	保利地产	199,810	3,160,994.20	0.45
42	600690	海尔智家	104,902	3,064,187.42	0.44
43	600016	民生银行	588,756	3,061,531.20	0.44
44	000661	长春高新	6,800	3,052,588.00	0.44
45	601899	紫金矿业	326,556	3,033,705.24	0.43
46	601328	交通银行	652,564	2,923,486.72	0.42
47	600999	招商证券	122,840	2,867,085.60	0.41
48	600346	恒力石化	97,380	2,723,718.60	0.39
49	600438	通威股份	70,400	2,706,176.00	0.39
50	600436	片仔癀	10,100	2,701,851.00	0.39
51	601818	光大银行	661,927	2,641,088.73	0.38
52	002493	荣盛石化	94,819	2,617,952.59	0.37
53	300124	汇川技术	27,700	2,584,410.00	0.37
54	300014	亿纬锂能	30,525	2,487,787.50	0.36
55	601100	恒立液压	21,728	2,455,264.00	0.35
56	000538	云南白药	21,265	2,415,704.00	0.35
57	002027	分众传媒	244,042	2,408,694.54	0.34
58	600588	用友网络	54,464	2,389,335.68	0.34
59	300601	康泰生物	13,100	2,285,950.00	0.33
60	600893	航发动力	38,405	2,279,336.75	0.33
61	000895	双汇发展	48,137	2,259,550.78	0.32

62	300433	蓝思科技	72,700	2,225,347.00	0.32
63	601688	华泰证券	122,100	2,199,021.00	0.31
64	000063	中兴通讯	64,200	2,160,330.00	0.31
65	601211	国泰君安	123,021	2,156,558.13	0.31
66	601766	中国中车	404,709	2,149,004.79	0.31
67	601336	新华保险	36,800	2,133,296.00	0.30
68	600406	国电南瑞	79,500	2,112,315.00	0.30
69	600837	海通证券	163,154	2,098,160.44	0.30
70	002812	恩捷股份	14,600	2,069,988.00	0.30
71	600745	闻泰科技	20,700	2,049,300.00	0.29
72	300413	芒果超媒	28,060	2,034,350.00	0.29
73	002241	歌尔股份	54,152	2,020,952.64	0.29
74	600703	三安光电	74,326	2,007,545.26	0.29
75	601919	中远海控	162,086	1,979,070.06	0.28
76	000166	申万宏源	374,711	1,978,474.08	0.28
77	300498	温氏股份	106,020	1,932,744.60	0.28
78	600050	中国联通	429,767	1,916,760.82	0.27
79	601988	中国银行	584,095	1,857,422.10	0.27
80	601066	中信建投	44,200	1,856,400.00	0.27
81	002460	赣锋锂业	18,309	1,852,870.80	0.26
82	601229	上海银行	235,869	1,849,212.96	0.26
83	603993	洛阳钼业	293,782	1,836,137.50	0.26
84	600019	宝钢股份	308,570	1,835,991.50	0.26
85	600570	恒生电子	17,292	1,813,930.80	0.26
86	600196	复星医药	33,277	1,796,625.23	0.26
87	601390	中国中铁	339,200	1,787,584.00	0.26
88	300274	阳光电源	24,200	1,749,176.00	0.25
89	300454	深信服	7,000	1,736,070.00	0.25
90	002311	海大集团	26,300	1,722,650.00	0.25
91	600028	中国石化	423,230	1,705,616.90	0.24
92	601169	北京银行	351,555	1,701,526.20	0.24
93	601628	中国人寿	44,320	1,701,444.80	0.24
94	601088	中国神华	91,400	1,646,114.00	0.24
95	000625	长安汽车	74,000	1,619,120.00	0.23
96	000776	广发证券	98,266	1,599,770.48	0.23
97	000876	新希望	71,407	1,599,516.80	0.23
98	600660	福耀玻璃	33,141	1,592,425.05	0.23
99	601989	中国重工	379,800	1,591,362.00	0.23
100	000100	TCL 科技	224,722	1,591,031.76	0.23

101	601006	大秦铁路	245,857	1,588,236.22	0.23
102	000338	潍柴动力	99,461	1,570,489.19	0.22
103	000768	中航西飞	42,546	1,560,587.28	0.22
104	600741	华域汽车	54,020	1,556,856.40	0.22
105	002271	东方雨虹	40,100	1,555,880.00	0.22
106	603986	兆易创新	7,840	1,548,400.00	0.22
107	002230	科大讯飞	37,872	1,547,828.64	0.22
108	600760	中航沈飞	19,600	1,532,328.00	0.22
109	601186	中国铁建	190,729	1,506,759.10	0.22
110	002371	北方华创	8,300	1,500,142.00	0.21
111	603799	华友钴业	18,894	1,498,294.20	0.21
112	002841	视源股份	13,000	1,495,390.00	0.21
113	601857	中国石油	358,683	1,488,534.45	0.21
114	002050	三花智控	59,790	1,473,823.50	0.21
115	601877	正泰电器	37,555	1,470,653.80	0.21
116	600926	杭州银行	98,502	1,469,649.84	0.21
117	001979	招商蛇口	109,358	1,453,367.82	0.21
118	601633	长城汽车	38,200	1,444,342.00	0.21
119	002179	中航光电	18,400	1,440,536.00	0.21
120	600547	山东黄金	60,391	1,426,435.42	0.20
121	601901	方正证券	136,767	1,418,273.79	0.20
122	000596	古井贡酒	5,200	1,414,400.00	0.20
123	601155	新城控股	39,430	1,373,346.90	0.20
124	603899	晨光文具	15,500	1,372,680.00	0.20
125	600919	江苏银行	249,179	1,360,517.34	0.19
126	601138	工业富联	99,100	1,356,679.00	0.19
127	002049	紫光国微	10,100	1,351,481.00	0.19
128	600600	青岛啤酒	13,500	1,341,900.00	0.19
129	600015	华夏银行	213,277	1,332,981.25	0.19
130	600763	通策医疗	4,800	1,327,296.00	0.19
131	601009	南京银行	163,864	1,324,021.12	0.19
132	601225	陕西煤业	138,389	1,292,553.26	0.18
133	002129	中环股份	50,500	1,287,750.00	0.18
134	002001	新和成	37,400	1,259,632.00	0.18
135	300450	先导智能	14,700	1,234,653.00	0.18
136	601360	三六零	78,300	1,230,093.00	0.18
137	002007	华兰生物	28,690	1,211,865.60	0.17
138	600009	上海机场	16,014	1,211,619.24	0.17
139	603369	今世缘	21,000	1,204,980.00	0.17

140	601788	光大证券	65,000	1,203,800.00	0.17
141	002555	三七互娱	38,500	1,202,355.00	0.17
142	002024	苏宁易购	154,600	1,191,966.00	0.17
143	603160	汇顶科技	7,600	1,182,180.00	0.17
144	002600	领益智造	97,600	1,170,224.00	0.17
145	601933	永辉超市	162,320	1,165,457.60	0.17
146	600176	中国巨石	58,100	1,159,676.00	0.17
147	600958	东方证券	99,021	1,151,614.23	0.16
148	300033	同花顺	9,000	1,115,820.00	0.16
149	600183	生益科技	39,400	1,109,504.00	0.16
150	000786	北新建材	27,700	1,109,385.00	0.16
151	002414	高德红外	26,560	1,108,880.00	0.16
152	300782	卓胜微	1,900	1,084,026.00	0.15
153	601816	京沪高铁	190,500	1,078,230.00	0.15
154	603806	福斯特	12,600	1,076,040.00	0.15
155	600383	金地集团	79,000	1,066,500.00	0.15
156	000157	中联重科	107,710	1,066,329.00	0.15
157	601985	中国核电	216,694	1,066,134.48	0.15
158	300408	三环集团	28,000	1,043,000.00	0.15
159	601939	建设银行	162,536	1,020,726.08	0.15
160	002821	凯莱英	3,400	1,017,076.00	0.15
161	600426	华鲁恒升	27,100	1,010,830.00	0.14
162	603233	大参林	12,800	1,002,880.00	0.14
163	002236	大华股份	50,000	994,500.00	0.14
164	601669	中国电建	254,447	987,254.36	0.14
165	300142	沃森生物	25,600	987,136.00	0.14
166	603882	金域医学	7,700	986,524.00	0.14
167	600845	宝信软件	14,300	986,414.00	0.14
168	600886	国投电力	112,845	974,980.80	0.14
169	000938	紫光股份	47,636	974,156.20	0.14
170	000069	华侨城A	136,243	965,962.87	0.14
171	600132	重庆啤酒	8,100	963,819.00	0.14
172	002607	中公教育	27,200	955,536.00	0.14
173	002709	天赐材料	9,200	954,960.00	0.14
174	002624	完美世界	32,344	954,148.00	0.14
175	601377	兴业证券	109,018	946,276.24	0.14
176	300628	亿联网络	12,850	939,592.00	0.13
177	300347	泰格医药	5,750	929,257.50	0.13
178	000860	顺鑫农业	12,800	928,512.00	0.13

179	002736	国信证券	68,025	927,861.00	0.13
180	000066	中国长城	48,700	924,813.00	0.13
181	300529	健帆生物	13,590	921,673.80	0.13
182	603659	璞泰来	8,200	921,598.00	0.13
183	601878	浙商证券	59,900	916,470.00	0.13
184	600029	南方航空	153,100	912,476.00	0.13
185	002568	百润股份	8,700	907,323.00	0.13
186	601881	中国银河	71,300	891,963.00	0.13
187	601658	邮储银行	186,000	889,080.00	0.13
188	600010	包钢股份	757,944	886,794.48	0.13
189	600872	中炬高新	13,300	886,445.00	0.13
190	002916	深南电路	8,160	881,769.60	0.13
191	600161	天坛生物	21,060	878,202.00	0.13
192	002602	世纪华通	123,160	875,667.60	0.13
193	603816	顾家家居	12,400	874,324.00	0.12
194	002601	龙鳞佰利	27,800	855,406.00	0.12
195	601021	春秋航空	15,200	842,536.00	0.12
196	600340	华夏幸福	65,072	841,380.96	0.12
197	603338	浙江鼎力	8,260	835,829.40	0.12
198	002625	光启技术	37,500	834,375.00	0.12
199	002074	国轩高科	21,300	833,256.00	0.12
200	300595	欧普康视	10,100	827,392.00	0.12
201	603019	中科曙光	24,140	826,312.20	0.12
202	601111	中国国航	110,100	824,649.00	0.12
203	600521	华海药业	24,250	819,892.50	0.12
204	600109	国金证券	50,369	819,503.63	0.12
205	300496	中科创达	7,000	819,000.00	0.12
206	002202	金风科技	57,283	816,282.75	0.12
207	601618	中国中冶	297,700	812,721.00	0.12
208	600061	国投资本	58,500	809,055.00	0.12
209	603939	益丰药房	8,920	804,494.80	0.11
210	300207	欣旺达	26,100	801,531.00	0.11
211	600111	北方稀土	60,467	791,513.03	0.11
212	603517	绝味食品	10,200	790,908.00	0.11
213	601600	中国铝业	217,500	789,525.00	0.11
214	600606	绿地控股	135,124	787,772.92	0.11
215	000783	长江证券	93,500	785,400.00	0.11
216	300699	光威复材	8,800	783,640.00	0.11
217	000703	恒逸石化	61,210	783,488.00	0.11

218	603833	欧派家居	5,820	782,790.00	0.11
219	300003	乐普医疗	28,400	771,912.00	0.11
220	002410	广联达	9,800	771,652.00	0.11
221	000963	华东医药	28,896	767,477.76	0.11
222	600079	人福医药	22,600	765,688.00	0.11
223	600362	江西铜业	38,255	763,187.25	0.11
224	002120	韵达股份	48,250	757,525.00	0.11
225	601108	财通证券	59,800	756,470.00	0.11
226	601916	浙商银行	185,300	756,024.00	0.11
227	601990	南京证券	61,300	752,151.00	0.11
228	300144	宋城演艺	42,080	745,657.60	0.11
229	601966	玲珑轮胎	21,100	742,087.00	0.11
230	601799	星宇股份	3,700	741,850.00	0.11
231	002013	中航机电	64,600	739,670.00	0.11
232	002044	美年健康	65,153	738,183.49	0.11
233	600352	浙江龙盛	54,120	737,114.40	0.11
234	600674	川投能源	73,300	736,665.00	0.11
235	000547	航天发展	26,700	734,250.00	0.10
236	601727	上海电气	135,300	730,620.00	0.10
237	002384	东山精密	28,100	730,600.00	0.10
238	600115	东方航空	155,210	726,382.80	0.10
239	002459	晶澳科技	17,800	724,816.00	0.10
240	300285	国瓷材料	16,000	721,760.00	0.10
241	000799	酒鬼酒	4,600	719,900.00	0.10
242	002032	苏泊尔	9,200	717,508.00	0.10
243	600143	金发科技	41,700	714,738.00	0.10
244	600489	中金黄金	80,800	711,848.00	0.10
245	300676	华大基因	5,500	707,080.00	0.10
246	600018	上港集团	154,106	704,264.42	0.10
247	000425	徐工机械	130,300	699,711.00	0.10
248	300037	新宙邦	6,900	699,660.00	0.10
249	600298	安琪酵母	13,700	699,659.00	0.10
250	002157	正邦科技	41,000	698,640.00	0.10
251	002252	上海莱士	94,200	697,080.00	0.10
252	600885	宏发股份	12,800	694,016.00	0.10
253	601216	君正集团	140,100	693,495.00	0.10
254	002797	第一创业	69,600	692,520.00	0.10
255	603589	口子窖	10,037	691,549.30	0.10
256	002791	坚朗五金	4,800	691,200.00	0.10

257	600754	锦江酒店	13,400	690,502.00	0.10
258	603638	艾迪精密	10,000	689,400.00	0.10
259	600779	水井坊	8,300	689,066.00	0.10
260	600332	白云山	23,379	683,835.75	0.10
261	601689	拓普集团	17,700	680,211.00	0.10
262	300253	卫宁健康	38,600	675,500.00	0.10
263	601162	天风证券	110,500	674,050.00	0.10
264	002385	大北农	69,381	670,220.46	0.10
265	002080	中材科技	27,500	664,950.00	0.09
266	600066	宇通客车	39,142	662,282.64	0.09
267	300677	英科医疗	3,900	655,785.00	0.09
268	600705	中航资本	149,284	653,863.92	0.09
269	600536	中国软件	8,300	653,708.00	0.09
270	300357	我武生物	8,500	651,950.00	0.09
271	000977	浪潮信息	24,228	651,248.64	0.09
272	000728	国元证券	72,640	650,854.40	0.09
273	300316	晶盛机电	21,500	646,720.00	0.09
274	601319	中国人保	98,200	645,174.00	0.09
275	002508	老板电器	15,800	644,324.00	0.09
276	600219	南山铝业	202,700	640,532.00	0.09
277	601838	成都银行	59,900	639,133.00	0.09
278	601555	东吴证券	64,565	636,610.90	0.09
279	600511	国药股份	12,900	636,099.00	0.09
280	300146	汤臣倍健	26,300	635,145.00	0.09
281	300558	贝达药业	5,900	633,483.00	0.09
282	601233	桐昆股份	30,700	632,113.00	0.09
283	000656	金科股份	88,800	629,592.00	0.09
284	600118	中国卫星	19,525	628,314.50	0.09
285	600089	特变电工	61,900	628,285.00	0.09
286	603658	安图生物	4,300	624,274.00	0.09
287	601872	招商轮船	110,100	622,065.00	0.09
288	600233	圆通速递	54,000	621,000.00	0.09
289	300308	中际旭创	12,200	620,492.00	0.09
290	600739	辽宁成大	25,499	620,135.68	0.09
291	603345	安井食品	3,200	617,184.00	0.09
292	002773	康弘药业	12,800	616,320.00	0.09
293	000800	一汽解放	52,700	615,536.00	0.09
294	600038	中直股份	9,800	614,558.00	0.09
295	601607	上海医药	31,860	611,712.00	0.09

296	002078	太阳纸业	41,900	604,617.00	0.09
297	000050	深天马A	40,800	601,392.00	0.09
298	600369	西南证券	110,100	592,338.00	0.08
299	002673	西部证券	58,100	589,134.00	0.08
300	300251	光线传媒	48,700	587,809.00	0.08
301	601198	东兴证券	44,094	587,332.08	0.08
302	601800	中国交建	80,225	582,433.50	0.08
303	300724	捷佳伟创	4,000	582,400.00	0.08
304	300661	圣邦股份	2,200	580,360.00	0.08
305	600699	均胜电子	22,800	578,208.00	0.08
306	300136	信维通信	16,100	577,668.00	0.08
307	002185	华天科技	42,400	577,488.00	0.08
308	601456	国联证券	26,900	573,777.00	0.08
309	688390	固德威	2,585	573,146.20	0.08
310	600177	雅戈尔	79,500	571,605.00	0.08
311	600522	中天科技	52,600	570,184.00	0.08
312	600004	白云机场	40,300	569,439.00	0.08
313	002340	格林美	81,200	567,588.00	0.08
314	002507	涪陵榨菜	13,400	566,820.00	0.08
315	600998	九州通	31,100	564,776.00	0.08
316	002353	杰瑞股份	16,000	560,000.00	0.08
317	002127	南极电商	40,800	558,144.00	0.08
318	002156	通富微电	22,100	557,804.00	0.08
319	000961	中南建设	62,900	555,407.00	0.08
320	600486	扬农化工	4,200	554,400.00	0.08
321	002456	欧菲光	42,000	553,560.00	0.08
322	603712	七一二	13,200	549,780.00	0.08
323	600487	亨通光电	39,284	549,583.16	0.08
324	002299	圣农发展	20,700	549,378.00	0.08
325	002705	新宝股份	13,000	549,250.00	0.08
326	600460	士兰微	21,900	547,500.00	0.08
327	600011	华能国际	121,978	546,461.44	0.08
328	603737	三棵树	3,600	545,400.00	0.08
329	603866	桃李面包	9,200	543,720.00	0.08
330	600598	北大荒	28,000	539,000.00	0.08
331	002500	山西证券	59,602	533,437.90	0.08
332	000750	国海证券	90,560	530,681.60	0.08
333	002926	华西证券	42,300	527,904.00	0.08
334	600068	葛洲坝	79,516	523,215.28	0.07

335	002690	美亚光电	11,700	518,076.00	0.07
336	002463	沪电股份	27,200	511,088.00	0.07
337	600637	东方明珠	56,820	507,970.80	0.07
338	002603	以岭药业	19,900	507,450.00	0.07
339	000513	丽珠集团	12,500	506,250.00	0.07
340	002373	千方科技	26,300	502,856.00	0.07
341	002030	达安基因	14,560	499,408.00	0.07
342	603605	珀莱雅	2,800	498,400.00	0.07
343	000423	东阿阿胶	12,857	497,694.47	0.07
344	600529	山东药玻	9,900	496,485.00	0.07
345	002939	长城证券	38,200	491,634.00	0.07
346	002294	信立泰	17,307	490,307.31	0.07
347	002372	伟星新材	26,200	489,940.00	0.07
348	600988	赤峰黄金	27,300	488,943.00	0.07
349	000932	华菱钢铁	101,900	487,082.00	0.07
350	002558	巨人网络	27,868	485,739.24	0.07
351	600372	中航电子	24,600	483,390.00	0.07
352	002925	盈趣科技	7,500	482,475.00	0.07
353	603027	千禾味业	12,900	482,202.00	0.07
354	600655	豫园股份	54,200	481,838.00	0.07
355	600909	华安证券	60,090	480,720.00	0.07
356	601117	中国化学	81,738	479,802.06	0.07
357	002429	兆驰股份	77,200	478,640.00	0.07
358	002958	青农商行	93,800	477,442.00	0.07
359	002146	荣盛发展	72,351	472,452.03	0.07
360	600498	烽火通信	19,600	471,968.00	0.07
361	002180	纳思达	17,617	470,902.41	0.07
362	603707	健友股份	13,350	468,985.50	0.07
363	600801	华新水泥	22,700	468,301.00	0.07
364	002223	鱼跃医疗	16,600	468,286.00	0.07
365	601231	环旭电子	24,200	468,028.00	0.07
366	002405	四维图新	32,700	466,629.00	0.07
367	000021	深科技	24,500	465,745.00	0.07
368	002422	科伦药业	23,932	465,238.08	0.07
369	002153	石基信息	14,900	463,241.00	0.07
370	601099	太平洋	113,200	461,856.00	0.07
371	002683	宏大爆破	12,800	460,160.00	0.07
372	002557	洽洽食品	8,500	457,725.00	0.07
373	300223	北京君正	5,000	457,450.00	0.07

374	002511	中顺洁柔	21,800	454,966.00	0.06
375	000723	美锦能源	68,000	454,240.00	0.06
376	000739	普洛药业	19,500	453,960.00	0.06
377	000630	铜陵有色	176,115	452,615.55	0.06
378	600380	健康元	32,500	452,075.00	0.06
379	600315	上海家化	13,000	451,490.00	0.06
380	600867	通化东宝	33,705	450,972.90	0.06
381	600516	方大炭素	63,412	448,322.84	0.06
382	600170	上海建工	148,100	445,781.00	0.06
383	000987	越秀金控	30,600	445,536.00	0.06
384	600848	上海临港	22,200	444,444.00	0.06
385	000671	阳光城	68,000	443,360.00	0.06
386	600208	新湖中宝	143,019	443,358.90	0.06
387	300383	光环新网	25,700	441,269.00	0.06
388	603858	步长制药	19,103	440,706.21	0.06
389	601077	渝农商行	97,900	440,550.00	0.06
390	000738	航发控制	19,200	440,256.00	0.06
391	600895	张江高科	25,800	439,632.00	0.06
392	603883	老百姓	6,920	434,783.60	0.06
393	002065	东华软件	52,306	434,139.80	0.06
394	000998	隆平高科	21,900	433,839.00	0.06
395	300463	迈克生物	9,300	433,380.00	0.06
396	600859	王府井	13,200	430,056.00	0.06
397	002465	海格通信	39,648	429,387.84	0.06
398	002152	广电运通	40,200	429,336.00	0.06
398	002242	九阳股份	13,400	429,336.00	0.06
399	002075	沙钢股份	39,000	427,830.00	0.06
400	600642	申能股份	81,700	426,474.00	0.06
401	600875	东方电气	42,400	422,728.00	0.06
402	002151	北斗星通	8,200	417,462.00	0.06
403	600188	兖州煤业	40,900	411,863.00	0.06
404	601992	金隅集团	138,619	411,698.43	0.06
405	000999	华润三九	16,353	407,843.82	0.06
406	300070	碧水源	53,100	406,215.00	0.06
407	002212	天融信	19,300	405,493.00	0.06
408	000027	深圳能源	65,998	401,927.82	0.06
409	002081	金螳螂	42,654	400,521.06	0.06
410	000627	天茂集团	81,781	398,273.47	0.06
411	300773	拉卡拉	13,300	397,936.00	0.06

412	300212	易华录	12,940	396,611.00	0.06
413	600549	厦门钨业	23,500	395,975.00	0.06
414	000709	河钢股份	176,629	395,648.96	0.06
415	000686	东北证券	40,100	393,782.00	0.06
416	002563	森马服饰	39,100	391,782.00	0.06
417	002019	亿帆医药	20,600	389,958.00	0.06
418	000988	华工科技	16,800	389,592.00	0.06
419	600201	生物股份	18,600	388,554.00	0.06
420	300418	昆仑万维	19,400	387,030.00	0.06
421	600026	中远海能	57,700	385,436.00	0.06
422	000983	山西焦煤	68,102	384,095.28	0.05
423	603444	吉比特	900	383,400.00	0.05
424	600027	华电国际	112,700	383,180.00	0.05
425	000729	燕京啤酒	44,800	381,696.00	0.05
426	001914	招商积余	17,700	381,081.00	0.05
427	300012	华测检测	13,900	380,443.00	0.05
428	002281	光迅科技	13,100	380,424.00	0.05
429	000540	中天金融	119,900	377,685.00	0.05
430	000975	银泰黄金	43,820	377,290.20	0.05
431	300482	万孚生物	4,100	365,761.00	0.05
432	600667	太极实业	38,400	362,880.00	0.05
433	600704	物产中大	82,600	360,962.00	0.05
434	300088	长信科技	40,600	360,934.00	0.05
435	002506	协鑫集成	82,800	351,900.00	0.05
436	600688	上海石化	101,600	349,504.00	0.05
437	600153	建发股份	42,055	345,271.55	0.05
438	002216	三全食品	13,300	345,135.00	0.05
439	000825	太钢不锈	95,000	342,950.00	0.05
440	600160	巨化股份	42,200	342,242.00	0.05
441	002131	利欧股份	112,300	340,269.00	0.05
442	600967	内蒙一机	27,300	331,968.00	0.05
443	600583	海油工程	73,600	330,464.00	0.05
444	300271	华宇软件	13,600	324,632.00	0.05
445	601699	潞安环能	49,815	323,797.50	0.05
446	600977	中国电影	25,915	322,900.90	0.05
447	000581	威孚高科	13,900	322,341.00	0.05
448	000623	吉林敖东	19,500	321,165.00	0.05
449	000402	金融街	49,700	320,565.00	0.05
450	601598	中国外运	72,700	319,880.00	0.05

451	300024	机器人	26,000	319,800.00	0.05
452	600256	广汇能源	112,800	319,224.00	0.05
453	000401	冀东水泥	22,500	318,375.00	0.05
454	600879	航天电子	42,200	315,656.00	0.05
455	300376	易事特	39,200	312,032.00	0.04
456	000089	深圳机场	38,000	310,460.00	0.04
457	000629	攀钢钒钛	142,900	310,093.00	0.04
458	601128	常熟银行	41,900	309,222.00	0.04
459	600566	济川药业	14,800	299,404.00	0.04
460	600021	上海电力	42,000	299,040.00	0.04
461	002399	海普瑞	17,200	296,184.00	0.04
462	688133	泰坦科技	2,527	294,496.58	0.04
463	600167	联美控股	25,400	288,290.00	0.04
464	300017	网宿科技	40,800	281,112.00	0.04
465	601098	中南传媒	28,500	271,605.00	0.04
466	300296	利亚德	41,400	263,304.00	0.04
467	002387	维信诺	22,800	259,920.00	0.04
468	002468	申通快递	25,500	257,040.00	0.04
469	002010	传化智联	54,204	255,300.84	0.04
470	600673	东阳光	50,200	252,506.00	0.04
471	000046	泛海控股	72,000	236,160.00	0.03
472	000028	国药一致	5,100	233,580.00	0.03
473	300026	红日药业	50,000	229,000.00	0.03
474	002439	启明星辰	7,800	227,838.00	0.03
475	002572	索菲亚	7,600	196,840.00	0.03
476	688393	安必平	4,241	152,803.23	0.02
477	688617	惠泰医疗	1,238	92,181.48	0.01
478	688668	鼎通科技	3,037	74,588.72	0.01
479	688679	通源环境	3,139	42,345.11	0.01
480	300867	圣元环保	1,221	39,035.37	0.01
481	300926	博俊科技	3,584	38,563.84	0.01
482	300870	欧陆通	478	31,390.26	0.00
483	300919	中伟股份	463	28,479.13	0.00
484	003026	中晶科技	461	21,740.76	0.00
485	300861	美畅股份	418	21,359.80	0.00
486	300910	瑞丰新材	431	20,631.97	0.00
487	300891	惠云钛业	1,143	18,745.20	0.00
488	003029	吉大正元	716	18,716.24	0.00
489	003028	振邦智能	432	18,010.08	0.00

490	300860	锋尚文化	140	17,733.80	0.00
491	300908	仲景食品	285	17,225.40	0.00
492	300884	狄耐克	499	16,721.49	0.00
493	605179	一鸣食品	939	16,582.74	0.00
494	300898	熊猫乳品	496	16,382.88	0.00
495	300889	爱克股份	479	14,427.48	0.00
496	300890	翔丰华	286	13,971.10	0.00
497	300925	法本信息	353	13,177.49	0.00
498	300895	铜牛信息	283	12,819.90	0.00
499	300907	康平科技	473	12,700.05	0.00
500	300879	大叶股份	466	12,637.92	0.00
501	300882	万胜智能	440	11,347.60	0.00
502	300911	亿田智能	309	10,215.54	0.00
503	300893	松原股份	276	9,682.08	0.00
504	300918	南山智尚	1,063	9,503.22	0.00
505	300922	C天秦	287	9,063.46	0.00
506	300917	特发服务	281	8,975.14	0.00
507	605277	新亚电子	507	8,593.65	0.00
508	003030	祖名股份	480	7,286.40	0.00
509	300886	华业香料	147	6,713.49	0.00
510	003031	中瓷电子	387	5,909.49	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000858	五粮液	13,277,231.00	3.92
2	300750	宁德时代	8,710,621.60	2.57
3	300760	迈瑞医疗	7,192,177.00	2.12
4	002415	海康威视	5,899,659.00	1.74
5	002475	立讯精密	5,352,813.56	1.58
6	000001	平安银行	5,172,855.48	1.53
7	002714	牧原股份	4,934,071.98	1.46
8	002352	顺丰控股	4,649,535.34	1.37
9	000002	万科A	4,207,340.12	1.24
10	002304	洋河股份	3,679,555.00	1.09

11	300015	爱尔眼科	3,422,800.00	1.01
12	000568	泸州老窖	3,415,407.00	1.01
13	300601	康泰生物	3,286,870.00	0.97
14	300059	东方财富	3,215,392.00	0.95
15	002594	比亚迪	3,093,754.97	0.91
16	300122	智飞生物	3,079,425.00	0.91
17	002142	宁波银行	3,070,109.06	0.91
18	000725	京东方A	2,571,553.00	0.76
19	600519	贵州茅台	2,357,039.00	0.70
20	000063	中兴通讯	2,170,857.00	0.64

注：不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000858	五粮液	5,362,377.00	1.58
2	300750	宁德时代	3,956,677.00	1.17
3	688981	中芯国际	3,676,537.39	1.08
4	000651	格力电器	3,394,163.25	1.00
5	002415	海康威视	3,369,170.00	0.99
6	300760	迈瑞医疗	3,186,004.00	0.94
7	000001	平安银行	2,618,522.75	0.77
8	000002	万科A	2,612,432.70	0.77
9	002475	立讯精密	2,540,727.00	0.75
10	002714	牧原股份	2,382,667.00	0.70
11	000333	美的集团	2,115,251.60	0.62
12	300601	康泰生物	1,979,969.57	0.58
13	002142	宁波银行	1,587,970.00	0.47
14	002304	洋河股份	1,500,778.60	0.44
15	000725	京东方A	1,464,048.00	0.43
16	000063	中兴通讯	1,441,417.88	0.43
17	300015	爱尔眼科	1,430,657.40	0.42
18	002594	比亚迪	1,410,082.00	0.42
19	300498	温氏股份	1,400,134.00	0.41
20	300347	泰格医药	1,398,726.40	0.41

注：不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	325,059,018.47
卖出股票收入（成交）总额	202,642,083.22

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	410,000.00	0.06
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	410,000.00	0.06

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113044	大秦转债	3,610	361,000.00	0.05
2	113616	韦尔转债	400	40,000.00	0.01
3	113614	健20转债	90	9,000.00	0.00

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

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
IC2103	中证 500 期货 2103 合约	2	2,500,560.00	52,080.00	-
IF2103	沪深 300 期货 2103 合约	6	9,380,880.00	447,840.00	-
公允价值变动总额合计(元)					499,920.00
股指期货投资本期收益(元)					3,137,514.57
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-24,620.00

8.10.2 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的情况，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
----	----	----

1	存出保证金	1,525,751.91
2	应收证券清算款	318,870.90
3	应收股利	-
4	应收利息	3,748.63
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,848,371.44

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

9.1.1 本基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (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
3,070	135,848.99	314,093,107.00	75.31%	102,963,287.00	24.69%

9.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额（份）	占总份额比例
联接基金	292,017,341.00	70.02%

9.3 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额 比例
1	友邦保险有限公司江苏分公司—传 统一普通保险产品	15,819,700.00	3.79%
2	于长清	5,511,100.00	1.32%
3	生命保险资管—招商银行—生命保 险资产管理有限公司富盈5号	3,500,000.00	0.84%
4	张招兴	2,000,000.00	0.48%
5	生命保险资管—农业银行—生命资 产价值精选资产管理产品	1,800,000.00	0.43%
6	何少雄	1,727,300.00	0.41%
7	王丹红	1,172,900.00	0.28%
8	徐国云	907,800.00	0.22%
9	高建隆	894,500.00	0.21%
10	郑晓星	750,000.00	0.18%

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

9.5 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（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	341,000,000.00
减:本报告期基金总赎回份额	217,000,000.00
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	417,056,394.00

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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。

2020年12月9日，公司选举周俊梁先生担任公司监事，童辉先生不再担任公司监事。

2020年12月14日，经公司董事会批准童辉先生担任公司首席信息官，房伟力先生不再担任公司首席信息官。

上述人事变动已按相关规定备案、报告。

本报告期内基金托管人未发生重大人事变动。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未改聘为其审计的会计师事务所。本报告期基金应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为60,000.00元人民币，该事务所已向本基金提供了3年的审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票	佣金	占当期佣金	

			成交总额的比例		总量的比例	
华泰证券	4	511,256,467.11	100.00%	103,411.71	100.00%	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	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	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
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。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华泰证券	773,440.27	100.00%	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华泰柏瑞基金管理有限公司关于	证监会规定报刊和	2020年12月31日

	终止北京电盈基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	网站	
2	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金参加泉州银行股份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12月30日
3	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金参加平安银行股份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12月24日
4	华泰柏瑞基金管理有限公司关于调整华泰柏瑞MSCI中国A股国际通ETF最小申购赎回单位的公告	证监会规定报刊和网站	2020年12月22日
5	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止泰诚财富基金销售(大连)有限公司和深圳盈信基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	证监会规定报刊和网站	2020年12月18日
6	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2020年12月16日
7	华泰柏瑞基金管理有限公司关于首席信息官变更的公告	证监会规定报刊和网站	2020年12月15日
8	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金投资范围增加存托凭证并相应修订基金合同及托管协议的公告	证监会规定报刊和网站	2020年11月20日
9	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2020年11月13日
10	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2020年11月5日
11	华泰柏瑞基金管理有限公司关于调整旗下基金参加招商银行股份有限公司旗下招赢通平台费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2020年9月30日
12	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金参加招商银行股份有限公司旗下招赢通平台费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2020年9月28日
13	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金参加鼎信汇金(北京)投资管理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7月27日
14	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下交易型开放式指数证券投资	证监会规定报刊和网站	2020年7月16日

	基金在科创板股票上市首日的风险提示性公告		
15	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金参加徽商银行股份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7月2日
16	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
17	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
18	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
19	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
20	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
21	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
22	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

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
联接基金	1	20200101-20200206;20200716-20201231;	70,964,64 1.00	610,403,50 0.00	389,350,80 0.00	292,017,34 1.00	70.0 2%

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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无。

§ 13 备查文件目录

13.1 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

13.2 存放地点

上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

托管人住所

13.3 查阅方式

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

华泰柏瑞基金管理有限公司

2021 年 3 月 31 日