

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 2021 年中期报告

2021 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：2021 年 8 月 28 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 2021 年 8 月 27 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 2021 年 1 月 1 日起至 2021 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	7
2.4 信息披露方式	8
2.5 其他相关资料	8
§3 主要财务指标和基金净值表现	9
3.1 主要会计数据和财务指标	9
3.2 基金净值表现	9
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	15
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	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	17
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
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	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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	18
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	19
6.1 资产负债表	19
6.2 利润表	20
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	21

6.4 报表附注.....	22
§7 投资组合报告.....	48
7.1 期末基金资产组合情况.....	48
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	48
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.....	49
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.....	59
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.....	59
7.7 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.....	60
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	60
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.....	60
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细.....	60
7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	60
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	60
7.13 投资组合报告附注.....	61
§8 基金份额持有人信息.....	62
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	62
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	62
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	62
§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.....	69

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.....	69
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	69
§12 备查文件目录.....	70
12.1 备查文件目录.....	70
12.2 存放地点.....	70
12.3 查阅方式.....	70

§ 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联接基金	
基金简称	MSCIETF 联接	
基金主代码	006286	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 10 月 10 日	
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	334,999,412.58 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	MSCIETF 联接 A	MSCIETF 联接 C
下属分级基金的交易代码:	006286	006293
报告期末下属分级基金的份额总额	18,826,591.61 份	316,172,820.97 份

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	512520
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 4 月 26 日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2018 年 5 月 18 日
基金管理人名称	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人名称	中国建设银行股份有限公司

2.2 基金产品说明

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

债券型基金与货币市场基金。

2.2.1 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金力争将日均跟踪偏离度控制在 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 以内。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数，即 MSCI 中国 A 股国际通指数收益率。
风险收益特征	本基金属于股票型基金中的指数型基金，采用完全复制的被动式投资策略：一方面，相对于混合型基金、债券型基金与货币市场基金而言，其风险和收益较高；另一方面，相对于采用抽样复制的指数型基金而言，其风险和收益特征将更能与标的指数保持基本一致。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华泰柏瑞基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘万方	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	华泰柏瑞基金管理有限公司	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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	MSCIETF 联接 A	MSCIETF 联接 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年1月1日 - 2021年6月30日)	报告期(2021年1月1日 - 2021年6月30日)
本期已实现收益	118,881.07	1,353,392.89
本期利润	1,860,672.56	31,074,136.22
加权平均基金份额本期利润	0.1033	0.0999
本期加权平均净值利润率	6.16%	6.02%
本期基金份额净值增长率	6.19%	6.06%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)	
期末可供分配利润	2,980,293.46	45,140,286.42
期末可供分配基金份额利润	0.1583	0.1428
期末基金资产净值	32,107,515.85	532,977,201.70
期末基金份额净值	1.7054	1.6857
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	97.66%	95.66%

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

MSCIETF 联接 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.53%	0.80%	-1.99%	0.82%	2.52%	-0.02%
过去三个月	8.65%	0.92%	7.97%	0.97%	0.68%	-0.05%
过去六个月	6.19%	1.25%	4.46%	1.34%	1.73%	-0.09%
过去一年	36.45%	1.23%	38.39%	1.36%	-1.94%	-0.13%
自基金合同生效起至今	97.66%	1.21%	77.75%	1.40%	19.91%	-0.19%

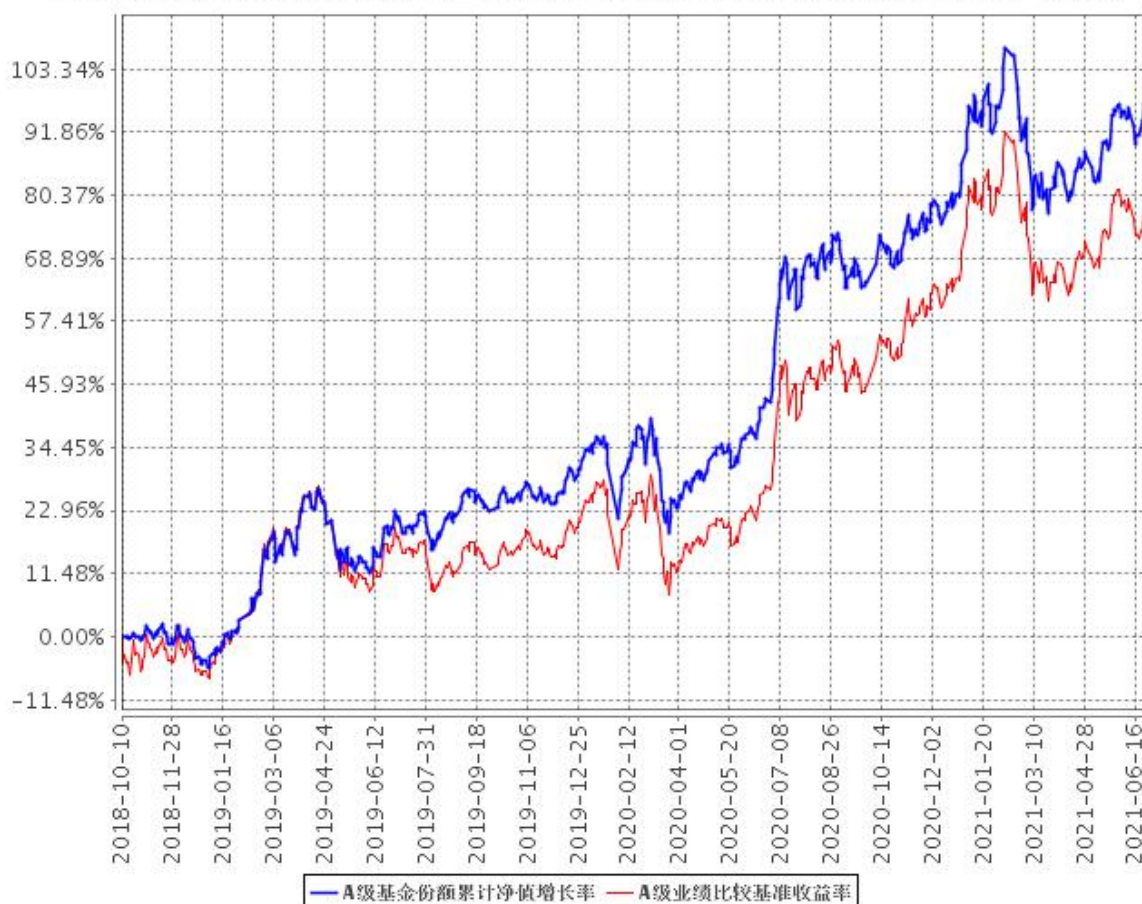
MSCIETF 联接 C

阶段	份额净值增	份额净值	业绩比较	业绩比较基准	①-③	②-④
----	-------	------	------	--------	-----	-----

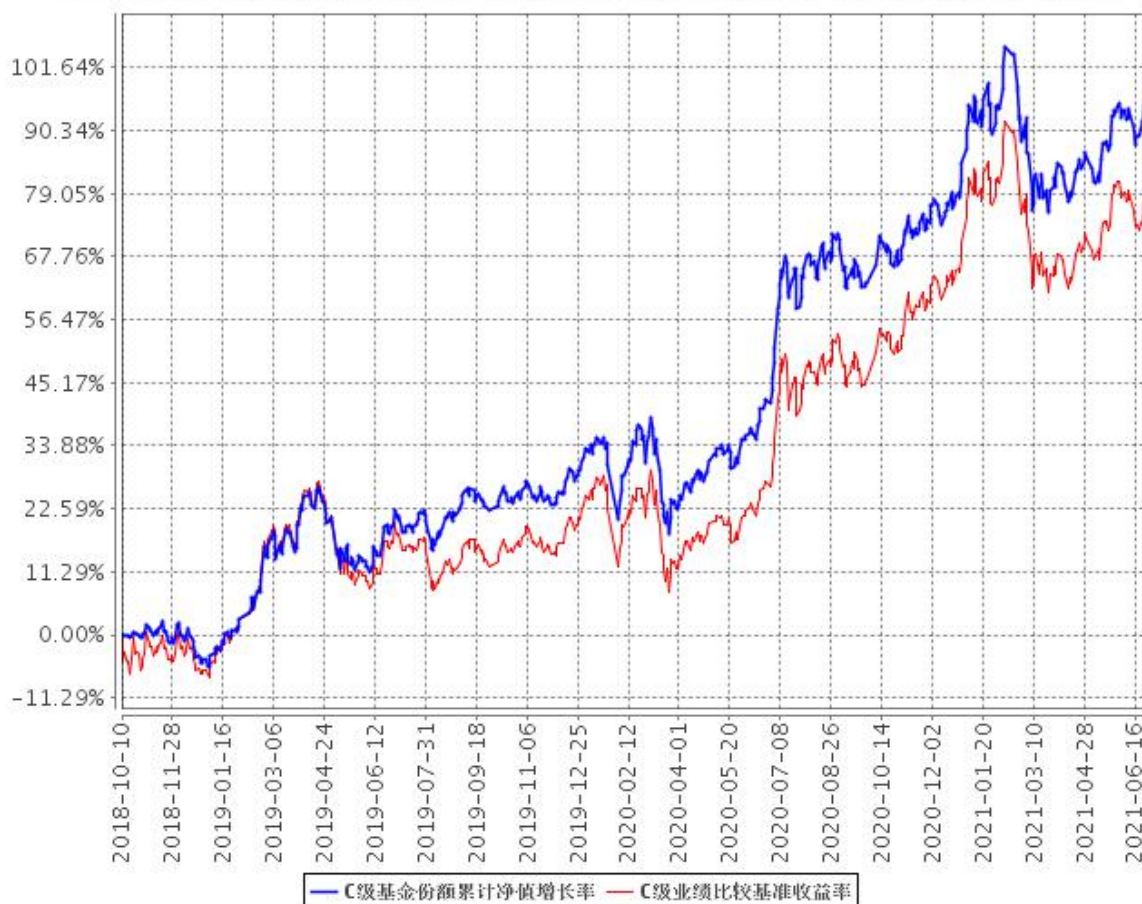
	长率①	增长率标准差②	基准收益率③	收益率标准差④		
过去一个月	0.51%	0.80%	-1.99%	0.82%	2.50%	-0.02%
过去三个月	8.58%	0.92%	7.97%	0.97%	0.61%	-0.05%
过去六个月	6.06%	1.25%	4.46%	1.34%	1.60%	-0.09%
过去一年	36.11%	1.23%	38.39%	1.36%	-2.28%	-0.13%
自基金合同生效起至今	95.66%	1.21%	77.75%	1.40%	17.91%	-0.19%

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

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：图示日期为 2018 年 10 月 10 日（基金合同生效日）至 2021 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、华泰柏瑞质量领先混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证稀土产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞品质成长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联接基金、华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证物联网主题交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞质量精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞港股通时代机遇混合型证券投资基金、华泰柏瑞行业严选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证企业核心竞争力 50 交易型开放式指数证券投资基金。截至 2021 年 6 月 30 日，公司基金管理规模为 2174.24 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	2018 年 10 月 10 日	-	20 年	20 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，

	基金经 理			<p>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 月起任上证红利交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2010 年 10 月起担任指数投资部副总监。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 月起任华泰柏瑞沪深 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的基金经理。2015 年 2 月起任指数投资部总监。2015 年 5 月起任华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及华泰柏瑞中证 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</p>
--	----------	--	--	--

					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月至2021年4月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月至2021年4月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成份交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021年3月起任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联接基金的基金经理。2021年5月起任华泰柏瑞南方东英恒生科技指数交易型开放式指数证券投资基金(QDII)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

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

2021 年上半年市场以结构性机会为主。其中电气设备、钢铁、化工等行业录得正收益，期间电气设备行业指数上涨达 23.83%，钢铁行业指数上涨达 23.62%。整体来看，沪深 300、中证 500、中证 1000 和创业板涨跌幅分别为 0.24%、6.93%、6.58%、和 17.22%。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 0.28% 和 4.78%。

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，本基金的日均绝对跟踪偏离度为 0.031%，期间日跟踪误差为 0.031%，较好地实现了本基金的投资目标。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末 MSCIETF 联接 A 基金份额净值为 1.7054 元，本报告期基金份额净值增长率为 6.19%；截至本报告期末 MSCIETF 联接 C 基金份额净值为 1.6857 元，本报告期基金份额净值增长率为 6.06%；同期业绩比较基准收益率为 4.46%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

二季度的全球股票市场摆脱了之前两个季度的高一一致性，即周期股持续跑赢成长风格。期间各类市场风格此起彼伏，驱动市场风格在成长和价值间反复徘徊。年初以来以宏观流动性边际收

紧，很多投资者担心高估值板块承压，然而我们发现，上半年 A 股表现分化加剧，高估值板块涨幅反而更大，无论是从细分行业还是概念指数，年初以来涨幅较高的板块大都处于相对较高的估值水平。原因还是在于投资者风险偏好高，愿意为高景气板块给予更高估值。

新冠疫情后中国经济增速或逐渐向新平台回归。外需层面上来看，全球复苏的主线逐渐从商品转向服务，可能意味着对全球、中国商品贸易的溢出效应下降。内需层面上来看，基建的支撑作用消退，政策严控下地产可能也面临逐渐降温，而消费虽然仍有缺口，受限于居民消费意愿回升较慢。随着经济波动的下降，政策的关注重点也转向中长期问题。而从长期来看，在存量债务压力下，政策重心从控制新增债务转向存量债务的维系问题，从这个角度来看，央行的货币政策或“易松难紧”。展望下半年，A 股市场或将伴随国内货币政策防范化解金融风险、保供稳价和碳中和等政策的方向不断小幅微调。结构上看，A 股分化趋势还将继续延续，建议成长和价值均衡配置。

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

报告期内，本基金实施利润分配的金额：华泰柏瑞 MSCI 联接 A 级为 1,281,845.88 元，华泰柏瑞 MSCI 联接 C 级为 22,100,578.14 元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

注：无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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，本基金实施利润分配的金额：华泰柏瑞 MSCI 联接 A 级为 1,281,845.88 元，华泰柏瑞 MSCI 联接 C 级为 22,100,578.14 元。

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联接基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	29,615,484.12	29,595,197.06
结算备付金		-	-
存出保证金		58,043.79	37,976.38
交易性金融资产	6.4.7.2	535,634,675.63	513,140,041.22
其中：股票投资		13,654,284.61	21,977,419.15
基金投资		521,979,391.02	490,238,712.07
债券投资		1,000.00	923,910.00
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		-	119,620.43
应收利息	6.4.7.5	2,897.93	23,032.50
应收股利		-	-
应收申购款		15,427.89	164,158.76
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	653,731.50
资产总计		565,326,529.36	543,733,757.85
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
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		32,175.44	87,359.00
应付管理人报酬		5,269.25	4,810.87
应付托管费		1,756.43	1,603.62
应付销售服务费		107,774.17	73,341.53
应付交易费用	6.4.7.7	5,498.89	146,379.79
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	89,337.63	120,189.34
负债合计		241,811.81	433,684.15
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	334,999,412.58	326,289,926.06
未分配利润	6.4.7.10	230,085,304.97	217,010,147.64
所有者权益合计		565,084,717.55	543,300,073.70
负债和所有者权益总计		565,326,529.36	543,733,757.85

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额总额 334,999,412.58 份，其中 MSCIETF 联接 A 基金份额净值 1.7054 元，份额总额 18,826,591.61 份；MSCIETF 联接 C 基金份额净值 1.6857 元，份额总额 316,172,820.97 份；

6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		33,740,620.47	3,812,501.45
1.利息收入		54,597.70	11,863.59
其中：存款利息收入	6.4.7.11	54,150.32	11,357.29
债券利息收入		447.38	506.30
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		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,218,925.30	5,615,293.17
其中：股票投资收益	6.4.7.12	1,951,980.62	-40,114.83
基金投资收益	6.4.7.13	150,950.26	5,654,246.00
债券投资收益	6.4.7.14	4,210.35	250.00
资产支持证券投资收益	6.4.7.14.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	111,784.07	912.00
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	31,462,534.82	-1,862,825.91
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	4,562.65	48,170.60

减：二、费用		805,811.69	104,375.25
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	33,170.97	2,124.12
2. 托管费	6.4.10.2.2	11,057.05	707.98
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	641,779.30	14,205.81
4. 交易费用	6.4.7.20	29,417.63	15,928.94
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.21	90,386.74	71,408.40
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		32,934,808.78	3,708,126.20
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		32,934,808.78	3,708,126.20

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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）	326,289,926.06	217,010,147.64	543,300,073.70
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	32,934,808.78	32,934,808.78
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）	8,709,486.52	3,522,772.57	12,232,259.09
其中：1. 基金申购款	20,296,452.68	12,282,657.56	32,579,110.24
2. 基金赎回款	-11,586,966.16	-8,759,884.99	-20,346,851.15
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）	-	-23,382,424.02	-23,382,424.02
五、期末所有者权益（基金净值）	334,999,412.58	230,085,304.97	565,084,717.55

项目	上年度可比期间 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）	65,383,886.85	21,197,731.46	86,581,618.31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,708,126.20	3,708,126.20
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）	-38,558,975.79	-12,941,844.19	-51,500,819.98
其中：1. 基金申购款	9,205,852.29	2,910,375.71	12,116,228.00
2. 基金赎回款	-47,764,828.08	-15,852,219.90	-63,617,047.98
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）	26,824,911.06	11,964,013.47	38,788,924.53

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：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2018]688 号《关于准予华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金注册的批复》核准，由华泰柏瑞基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 508,619,331.56 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2018)第 0654 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金

合同》于 2018 年 10 月 10 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 508,879,103.91 份基金份额，其中认购资金利息折合 259,772.35 份基金份额。本基金的基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

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

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》的有关规定，本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具，包括目标 ETF、标的指数成份股及备选成份股、非成份股、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、权证、股指期货、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。正常情况下，本基金资产中投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者到期日在一年以内的政府债券；股指期货以套期保值为目的，权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为： $MSCI 中国 A 股国际通指数收益率 \times 95\% + 银行活期存款利率(税后) \times 5\%$ 。

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 8 月 28 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、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联接基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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 2021 年 6 月 30 日
----	------------------------

活期存款	29,615,484.12
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	29,615,484.12

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	13,185,241.01	13,654,284.61	469,043.60
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	1,000.00	-
	银行间市场	-	-
	合计	1,000.00	-
资产支持证券	-	-	-
基金	447,640,737.00	521,979,391.02	74,338,654.02
其他	-	-	-
合计	460,826,978.01	535,634,675.63	74,807,697.62

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
----	------------------------

应收活期存款利息	2,871.74
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	-
应收债券利息	0.09
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	26.10
合计	2,897.93

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 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	5,498.89
银行间市场应付交易费用	-
合计	5,498.89

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	77.48
应付证券出借违约金	-
预提费用	89,260.15
合计	89,337.63

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

MSCIETF 联接 A		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	17,844,995.21	17,844,995.21
本期申购	4,153,916.03	4,153,916.03
本期赎回(以“-”号填列)	-3,172,319.63	-3,172,319.63
- 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	18,826,591.61	18,826,591.61

金额单位：人民币元

MSCIETF 联接 C		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	308,444,930.85	308,444,930.85
本期申购	16,142,536.65	16,142,536.65
本期赎回(以“-”号填列)	-8,414,646.53	-8,414,646.53
- 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	316,172,820.97	316,172,820.97

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

MSCIETF 联接 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,011,143.56	8,136,642.18	12,147,785.74
本期利润	118,881.07	1,741,791.49	1,860,672.56
本期基金份额交易产生的变动数	132,114.71	422,197.11	554,311.82
其中：基金申购款	790,721.23	2,045,554.01	2,836,275.24
基金赎回款	-658,606.52	-1,623,356.90	-2,281,963.42
本期已分配利润	-1,281,845.88	-	-1,281,845.88
本期末	2,980,293.46	10,300,630.78	13,280,924.24

单位：人民币元

MSCIETF 联接 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	65,199,621.89	139,662,740.01	204,862,361.90
本期利润	1,353,392.89	29,720,743.33	31,074,136.22
本期基金份额交易产生的变动数	687,849.78	2,280,610.97	2,968,460.75
其中：基金申购款	2,383,227.03	7,063,155.29	9,446,382.32
基金赎回款	-1,695,377.25	-4,782,544.32	-6,477,921.57
本期已分配利润	-22,100,578.14	-	-22,100,578.14
本期末	45,140,286.42	171,664,094.31	216,804,380.73

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	50,754.09
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	2,857.83
其他	538.40
合计	54,150.32

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	13,302,906.95
减：卖出股票成本总额	11,350,926.33
买卖股票差价收入	1,951,980.62

6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	1,377,500.00

减：卖出/赎回基金成本总额	1,226,549.74
基金投资收益	150,950.26

6.4.7.14 债券投资收益

6.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	4,210.35
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	4,210.35

6.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	962,095.60
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	937,630.00
减：应收利息总额	20,255.25
买卖债券差价收入	4,210.35

6.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.14.5 资产支持证券投资收益

注：无。

6.4.7.15 贵金属投资收益**6.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成**

注：无。

6.4.7.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

6.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.16 衍生工具收益**6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：无。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	111,784.07
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	111,784.07

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	31,462,534.82
——股票投资	-238,100.37
——债券投资	-280.00
——基金投资	31,700,915.19

——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	31,462,534.82

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	4,526.90
转换费收入 006286	35.75
合计	4,562.65

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	29,298.48
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	119.15
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	29,417.63

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	1,126.59

合计	90,386.74
----	-----------

6.4.7.22 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。

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
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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	13,284,492.95	84.46%	6,971,443.95	99.96%

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021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	12,371.99	84.74%	3,270.83	59.48%
关联方名称	上年度可比期间 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	6,492.38	99.96%	-	-

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 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	33,170.97
其中：支付销售机构的客	6,682.70	9,779.63

户维护费		
------	--	--

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扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分（若为负数，则取 0）0.50% 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：

$$\text{日管理人报酬} = (\text{前一日基金资产净值} - \text{基金财产中目标 ETF 份额所对应的资产净值}) \times 0.50\% / \text{当年天数}。$$

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扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分（若为负数，则取 0）0.15% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = (\text{前一日基金资产净值} - \text{基金财产中目标 ETF 份额所对应的资产净值}) \times 0.15\% / \text{当年天数}。$$

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
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	11,057.05	707.98

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托管费按前一日基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分（若为负数，则取 0）0.10% 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：

$$\text{日托管费} = (\text{前一日基金资产净值} - \text{基金财产中目标 ETF 份额所对应的资产净值}) \times 0.10\% \div \text{当年天数}。$$

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托管费按前一日基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分（若为负数，则取 0）0.05% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：

日托管费 = (前一日基金资产净值 - 基金财产中目标 ETF 份额所对应的资产净值) × 0.05% ÷ 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	MSCIETF 联接 A	MSCIETF 联接 C	合计
华泰证券股份有限公司	0.00	2,440.37	2,440.37
华泰柏瑞基金管理有限 公司	0.00	631,177.53	631,177.53
合计	0.00	633,617.90	633,617.90
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	MSCIETF 联接 A	MSCIETF 联接 C	合计
华泰证券股份有限公司	0.00	3,313.45	3,313.45
华泰柏瑞基金管理有限 公司	0.00	366.71	366.71
合计	0.00	3,680.16	3,680.16

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

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

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

6.4.10.3 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未发生与关联方进行的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：本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行证券出借业务。

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：本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行证券出借业务。

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**

份额单位：份

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	MSCIETF 联接 A	MSCIETF 联接 C
基金合同生效日（2018年10月10日）持有的基金份额	0.00	0.00
报告期初持有的基金份额	4,991,904.34	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	4,991,904.34	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.4901%	0.0000%

项目	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	MSCIETF 联接 A	MSCIETF 联接 C
基金合同生效日（2018年10月10日）持有的基金份额	0.00	0.00
报告期初持有的基金份额	19,443,904.34	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	14,452,000.00	0.00
报告期末持有的基金份额	4,991,904.34	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	18.6092%	0.0000%

占基金总份额比例		
----------	--	--

注：1. 期间买入/申购总份额含转换入份额，期间卖出/赎回总份额含转换出份额。

2. 基金管理人投资本基金适用的认(申)购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本报告期及上年度可比期间内，除基金管理人之外的其它关联方未投资本基金。

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		上年度可比期间	
	2021年1月1日至2021年6月30日		2020年1月1日至2020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	29,615,484.12	50,754.09	1,999,137.82	11,109.22

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。

6.4.10.7 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

关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	本期		
				2021年1月1日至2021年6月30日		
				基金在承销期内买入		
				数量(单位:份)	总金额	
华泰联合证券	605389	长龄液压	网下申购		356	14,026.40
华泰联合证券有限责任公司	600905	三峡能源	网上申购		17,000	45,050.00
华泰联合证券有限责任公司	605499	东鹏饮料	网下申购		632	29,242.64
华泰联合证券有限责任公司	600909	华安证券	配股		600	2,208.00

注：本基金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：本基金本报告期及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

MSCIETF 联接 A

金额单位：人民币元

序号	权益	除息日		每10份 基金份额分红	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配 合计	备注
		场内	场外					

	登记日			数				
1	2021年3月30日	-	2021年3月30日	0.7300	1,063,560.95	218,284.93	1,281,845.88	
合计	-		-	0.7300	1,063,560.95	218,284.93	1,281,845.88	

MSCIETF 联接 C

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2021年3月30日	-	2021年3月30日	0.7300	309,218.24	21,791,359.90	22,100,578.14	
合计	-		-	0.7300	309,218.24	21,791,359.90	22,100,578.14	

6.4.12 期末（2021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
605287	德才股份	2021年6月28日	2021年7月6日	新股未上市	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
605162	新中港	2021年6月29日	2021年7月7日	新股未上市	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-

6.4.12.1.2 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
113049	长汽转债	2021年6月10日	2021年7月8日	新债未上市	100.00	100.00	10	1,000.00	1,000.00	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600460	士兰微	2021年6月30日	临时停牌	56.35	2021年7月1日	59.49	500	11,716.15	28,175.00	-
002024	苏宁易购	2021年6月16日	临时停牌	5.59	2021年7月6日	6.15	2,800	18,424.00	15,652.00	-

注：本基金截至 2021 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

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

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未参与转融通证券出借业务。

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

本基金为目标 ETF 的联接基金，采用主要投资于目标 ETF 基金实现对业绩比较基准的紧密跟踪。因此，本基金的业绩表现与 MSCI 中国 A 股国际通指数的表现密切相关。本基金的风险与收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金投资的金融工具主要包括基金投资、股票投资及债券投资。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，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配” 的风险收益目标。

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。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款 存放在本基金的托管人中国建设银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所 进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险 可能性很小；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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	899,910.00
合计	0.00	899,910.00

注：未评级的债券包括国债。债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	1,000.00	21,000.00
AAA 以下	0.00	3,000.00
未评级	0.00	0.00
合计	1,000.00	24,000.00

注：债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

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一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种

所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。

于 2021 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、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间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。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

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 2021 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 0.01%。

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、存出保证金和债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
-----	--------	--------	--------	-------	-------	-----	----

2021年6月30日			年				
资产							
银行存款	29,615,484.12	-	-	-	-	-	29,615,484.12
存出保证金	58,043.79	-	-	-	-	-	58,043.79
交易性金融资产	-	-	-	-	1,000.00	535,633,675.63	535,634,675.63
应收利息	-	-	-	-	-	2,897.93	2,897.93
应收申购款	-	-	-	-	-	15,427.89	15,427.89
资产总计	29,673,527.91	-	-	-	1,000.00	535,652,001.45	565,326,529.36
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	32,175.44	32,175.44
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	5,269.25	5,269.25
应付托管费	-	-	-	-	-	1,756.43	1,756.43
应付销售服务费	-	-	-	-	-	107,774.17	107,774.17
应付交易费用	-	-	-	-	-	5,498.89	5,498.89
其他负债	-	-	-	-	-	89,337.63	89,337.63
负债总计	-	-	-	-	-	241,811.81	241,811.81
利率敏感度缺口	29,673,527.91	-	-	-	1,000.00	535,410,189.64	565,084,717.55
上年度末 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	29,595,197.06	-	-	-	-	-	29,595,197.06
存出保证金	37,976.38	-	-	-	-	-	37,976.38
交易性金融资产	899,910.00	-	-	-	24,000.00	512,216,131.22	513,140,041.22
应收证券清算款	-	-	-	-	-	119,620.43	119,620.43
应收利息	-	-	-	-	-	23,032.50	23,032.50
应收申购款	-	-	-	-	-	164,158.76	164,158.76
其他资产	-	-	-	-	-	653,731.50	653,731.50
资产总计	30,533,083.44	-	-	-	24,000.00	513,176,674.41	543,733,757.85
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	87,359.00	87,359.00
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	4,810.87	4,810.87
应付托管费	-	-	-	-	-	1,603.62	1,603.62
应付销售服务费	-	-	-	-	-	73,341.53	73,341.53

应付交易费用	-	-	-	-	146,379.79	146,379.79
其他负债	-	-	-	-	120,189.34	120,189.34
负债总计	-	-	-	-	433,684.15	433,684.15
利率敏感度缺口	30,533,083.44	-	-	-	24,000.00	512,742,990.26
						543,300,073.70

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2021 年 6 月 30 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 0.0002% (2020 年 12 月 31 日：0.17%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2020 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。本基金主要投资于目标 ETF，所面临的其他价格风险主要来源于 MSCI 中国 A 股国际通指数波动的影响。

本基金通过把全部或接近全部的基金资产投资于目标 ETF、标的指数成份股和备选成份股进行被动式指数化投资，正常情况下投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%；本基金投资于目标 ETF 的方式以二级市场交易买卖为主。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金资产中投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金 (不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等) 或者到期日在一年以内的政府债券。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 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	13,654,284.61	2.42	21,977,419.15	4.05
交易性金融资产-基金投资	521,979,391.02	92.37	490,238,712.07	90.23
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	-	-	-	-
合计	535,633,675.63	94.79	512,216,131.22	94.28

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（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	MSCI 中国 A 股国际通指数上升 5%	24,845,467.31	22,647,263.65
MSCI 中国 A 股国际通指数下降 5%	-24,845,467.31	-22,647,263.65	

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	13,654,284.61	2.42
	其中：股票	13,654,284.61	2.42
2	基金投资	521,979,391.02	92.33
3	固定收益投资	1,000.00	0.00
	其中：债券	1,000.00	0.00
	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	29,615,484.12	5.24
8	其他各项资产	76,369.61	0.01
9	合计	565,326,529.36	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	36,296.00	0.01
B	采矿业	522,192.00	0.09
C	制造业	6,841,046.02	1.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	401,557.39	0.07
E	建筑业	287,436.44	0.05
F	批发和零售业	215,169.00	0.04
G	交通运输、仓储和邮政业	556,353.80	0.10
H	住宿和餐饮业	22,780.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	424,698.60	0.08
J	金融业	3,448,914.10	0.61
K	房地产业	275,225.00	0.05
L	租赁和商务服务业	249,465.00	0.04
M	科学研究和技术服务业	253,049.44	0.04
N	水利、环境和公共设施管理业	7,577.00	0.00

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	12,534.00	0.00
Q	卫生和社会工作	68,557.82	0.01
R	文化、体育和娱乐业	23,800.00	0.00
S	综合	7,633.00	0.00
	合计	13,654,284.61	2.42

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	800	1,645,360.00	0.29
2	000858	五粮液	2,000	595,780.00	0.11
3	600036	招商银行	10,000	541,900.00	0.10
4	601318	中国平安	5,200	334,256.00	0.06
5	603259	药明康德	1,616	253,049.44	0.04
6	601012	隆基股份	2,520	223,876.80	0.04
7	600900	长江电力	10,800	222,912.00	0.04
8	601166	兴业银行	10,000	205,500.00	0.04
9	603288	海天味业	1,468	189,298.60	0.03
10	000001	平安银行	8,100	183,222.00	0.03
11	601888	中国中免	600	180,060.00	0.03
12	600809	山西汾酒	400	179,200.00	0.03
13	601398	工商银行	30,000	155,100.00	0.03
14	600309	万华化学	1,400	152,348.00	0.03
15	601919	中远海控	4,600	140,484.00	0.02
16	600000	浦发银行	14,000	140,000.00	0.02
17	600030	中信证券	5,200	129,688.00	0.02
18	002352	顺丰控股	1,800	121,860.00	0.02
19	600031	三一重工	4,000	116,280.00	0.02
20	601668	中国建筑	23,800	110,670.00	0.02
21	601288	农业银行	35,600	107,868.00	0.02
22	600887	伊利股份	2,800	103,124.00	0.02
23	603501	韦尔股份	302	97,244.00	0.02

24	000725	京东方 A	15,100	94,224.00	0.02
25	601899	紫金矿业	9,600	93,024.00	0.02
26	601601	中国太保	3,200	92,704.00	0.02
27	601328	交通银行	18,800	92,120.00	0.02
28	600276	恒瑞医药	1,320	89,720.40	0.02
29	600436	片仔癀	200	89,660.00	0.02
30	600438	通威股份	2,000	86,540.00	0.02
31	600690	海尔智家	3,200	82,912.00	0.01
32	600585	海螺水泥	2,000	82,100.00	0.01
33	600019	宝钢股份	10,500	80,220.00	0.01
34	600104	上汽集团	3,600	79,092.00	0.01
35	002142	宁波银行	2,000	77,940.00	0.01
36	600016	民生银行	16,800	74,088.00	0.01
36	601818	光大银行	19,600	74,088.00	0.01
37	600346	恒力石化	2,800	73,472.00	0.01
38	600845	宝信软件	1,430	72,787.00	0.01
39	601857	中国石油	13,200	69,828.00	0.01
40	600999	招商证券	3,600	68,472.00	0.01
41	600028	中国石化	15,700	68,452.00	0.01
42	002230	科大讯飞	1,000	67,580.00	0.01
43	600048	保利地产	5,600	67,424.00	0.01
44	600406	国电南瑞	2,880	66,931.20	0.01
45	601988	中国银行	21,600	66,528.00	0.01
46	000063	中兴通讯	2,000	66,460.00	0.01
47	300059	东方财富	2,000	65,580.00	0.01
48	600893	航发动力	1,200	63,828.00	0.01
49	601009	南京银行	6,000	63,120.00	0.01
50	601088	中国神华	3,200	62,464.00	0.01
51	601211	国泰君安	3,600	61,704.00	0.01
52	601390	中国中铁	11,600	60,784.00	0.01
53	600196	复星医药	800	57,704.00	0.01
54	000333	美的集团	800	57,096.00	0.01
55	601225	陕西煤业	4,800	56,880.00	0.01
56	601229	上海银行	6,800	55,760.00	0.01
57	600837	海通证券	4,800	55,200.00	0.01
58	000338	潍柴动力	3,000	53,610.00	0.01
59	300750	宁德时代	100	53,480.00	0.01
60	600588	用友网络	1,600	53,216.00	0.01
61	002027	分众传媒	5,600	52,696.00	0.01

62	603986	兆易创新	280	52,612.00	0.01
63	601155	新城控股	1,200	49,920.00	0.01
64	000100	TCL 科技	6,400	48,960.00	0.01
65	603369	今世缘	900	48,744.00	0.01
66	601169	北京银行	10,000	48,700.00	0.01
67	601006	大秦铁路	7,200	47,376.00	0.01
68	601066	中信建投	1,500	47,145.00	0.01
69	600600	青岛啤酒	400	46,260.00	0.01
70	603799	华友钴业	400	45,680.00	0.01
71	600703	三安光电	1,400	44,870.00	0.01
72	601138	工业富联	3,600	44,676.00	0.01
73	601989	中国重工	10,800	44,496.00	0.01
74	603993	洛阳钼业	8,400	43,344.00	0.01
75	601100	恒立液压	500	42,960.00	0.01
76	600741	华域汽车	1,600	42,032.00	0.01
77	600926	杭州银行	2,800	41,300.00	0.01
78	601628	中国人寿	1,200	40,668.00	0.01
79	601877	正泰电器	1,200	40,056.00	0.01
80	600132	重庆啤酒	200	39,590.00	0.01
81	600745	闻泰科技	400	38,760.00	0.01
82	603659	璞泰来	280	38,248.00	0.01
83	603806	福斯特	360	37,846.80	0.01
84	600886	国投电力	3,900	37,479.00	0.01
85	601901	方正证券	4,000	37,440.00	0.01
86	600570	恒生电子	400	37,300.00	0.01
87	601669	中国电建	9,600	37,152.00	0.01
88	600015	华夏银行	6,000	37,140.00	0.01
89	601336	新华保险	800	36,728.00	0.01
90	601788	光大证券	2,000	35,780.00	0.01
91	601966	玲珑轮胎	800	34,992.00	0.01
92	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.01
93	002601	龙蟠佰利	1,000	34,580.00	0.01
94	601985	中国核电	6,800	34,408.00	0.01
95	601600	中国铝业	6,400	33,920.00	0.01
96	603899	晨光文具	400	33,824.00	0.01
97	600760	中航沈飞	560	33,768.00	0.01
98	603517	绝味食品	400	33,716.00	0.01
99	600660	福耀玻璃	600	33,510.00	0.01
100	600010	包钢股份	21,600	33,480.00	0.01

101	601816	京沪高铁	6,300	33,327.00	0.01
102	600111	北方稀土	1,600	33,120.00	0.01
103	600183	生益科技	1,400	32,774.00	0.01
104	600426	华鲁恒升	1,040	32,188.00	0.01
105	600176	中国巨石	2,072	32,136.72	0.01
106	603882	金城医学	200	31,954.00	0.01
107	601658	邮储银行	6,300	31,626.00	0.01
108	601377	兴业证券	3,200	30,912.00	0.01
109	600547	山东黄金	1,600	30,752.00	0.01
110	601360	三六零	2,400	29,304.00	0.01
111	600029	南方航空	4,800	28,896.00	0.01
112	002064	华峰氨纶	2,000	28,400.00	0.01
113	601933	永辉超市	6,000	28,380.00	0.01
114	600460	士兰微	500	28,175.00	0.00
115	600958	东方证券	2,800	27,972.00	0.00
116	000157	中联重科	3,000	27,720.00	0.00
117	002414	高德红外	1,000	27,580.00	0.00
118	002600	领益智造	3,000	27,570.00	0.00
119	600161	天坛生物	800	27,400.00	0.00
120	600332	白云山	800	27,080.00	0.00
121	600219	南山铝业	7,500	27,000.00	0.00
122	600115	中国东航	5,200	26,416.00	0.00
123	601878	浙商证券	2,000	26,160.00	0.00
124	601633	长城汽车	600	26,154.00	0.00
125	603160	汇顶科技	200	25,926.00	0.00
126	600061	国投资本	3,040	25,809.60	0.00
127	600655	豫园股份	2,200	25,498.00	0.00
128	600779	水井坊	200	25,270.00	0.00
129	601111	中国国航	3,200	24,896.00	0.00
130	002714	牧原股份	400	24,328.00	0.00
131	600315	上海家化	400	24,056.00	0.00
132	603816	顾家家居	300	23,184.00	0.00
133	600754	锦江酒店	400	22,780.00	0.00
134	601021	春秋航空	400	22,760.00	0.00
135	601727	上海电气	5,200	22,048.00	0.00
136	600352	浙江龙盛	1,600	21,984.00	0.00
137	600606	绿地控股	4,000	21,800.00	0.00
138	600298	安琪酵母	400	21,752.00	0.00
139	002236	大华股份	1,000	21,100.00	0.00

140	601117	中国化学	2,400	21,024.00	0.00
141	600018	上港集团	4,400	20,988.00	0.00
142	000069	华侨城 A	2,800	20,832.00	0.00
143	002493	荣盛石化	1,200	20,724.00	0.00
144	600489	中金黄金	2,400	20,688.00	0.00
145	600089	特变电工	1,600	20,560.00	0.00
146	600383	金地集团	2,000	20,480.00	0.00
147	000425	徐工机械	3,200	20,384.00	0.00
148	601216	君正集团	4,000	20,360.00	0.00
149	600109	国金证券	1,600	20,304.00	0.00
150	601838	成都银行	1,600	20,224.00	0.00
151	600674	川投能源	1,600	19,728.00	0.00
152	601618	中国中冶	6,600	19,668.00	0.00
153	601881	中国银河	1,800	19,404.00	0.00
154	002129	中环股份	500	19,300.00	0.00
155	600009	上海机场	400	19,252.00	0.00
156	600522	中天科技	1,900	19,000.00	0.00
157	601162	天风证券	3,900	18,954.00	0.00
158	600704	物产中大	2,400	18,888.00	0.00
159	600885	宏发股份	300	18,810.00	0.00
160	603233	大参林	360	18,399.60	0.00
161	300015	爱尔眼科	259	18,383.82	0.00
162	002044	美年健康	2,000	18,220.00	0.00
163	002013	中航机电	1,800	18,126.00	0.00
164	600362	江西铜业	800	17,904.00	0.00
165	601872	招商轮船	3,840	17,740.80	0.00
166	600705	中航资本	4,400	17,028.00	0.00
167	601607	上海医药	800	16,904.00	0.00
168	601990	南京证券	1,600	16,832.00	0.00
169	002340	格林美	1,800	16,830.00	0.00
170	601108	财通证券	1,600	16,784.00	0.00
171	600521	华海药业	800	16,704.00	0.00
172	603707	健友股份	400	16,700.00	0.00
173	600143	金发科技	800	16,688.00	0.00
174	601555	东吴证券	2,000	16,680.00	0.00
175	600739	辽宁成大	800	16,648.00	0.00
176	601319	中国人保	2,800	16,604.00	0.00
177	300253	卫宁健康	1,000	16,270.00	0.00
178	000895	双汇发展	500	15,900.00	0.00

179	600177	雅戈尔	2,400	15,816.00	0.00
180	002024	苏宁易购	2,800	15,652.00	0.00
181	600369	西南证券	3,200	15,584.00	0.00
182	002602	世纪华通	2,400	15,408.00	0.00
183	002185	华天科技	1,000	15,390.00	0.00
184	600011	华能国际	3,600	15,192.00	0.00
185	000723	美锦能源	2,000	15,120.00	0.00
186	600066	宇通客车	1,200	14,988.00	0.00
187	000825	太钢不锈	2,000	14,980.00	0.00
187	600068	葛洲坝	2,000	14,980.00	0.00
188	601689	拓普集团	400	14,972.00	0.00
189	600516	方大炭素	2,000	14,880.00	0.00
190	600642	申能股份	2,400	14,736.00	0.00
191	000027	深圳能源	1,600	14,672.00	0.00
192	600895	张江高科	800	14,616.00	0.00
193	000066	中国长城	1,000	14,600.00	0.00
194	603939	益丰药房	260	14,583.40	0.00
195	600909	华安证券	2,600	14,482.00	0.00
196	600859	王府井	500	14,440.00	0.00
196	603712	七一二	400	14,440.00	0.00
197	601916	浙商银行	3,600	14,292.00	0.00
198	000050	深天马 A	1,000	14,180.00	0.00
199	600079	人福医药	500	14,135.00	0.00
200	600801	华新水泥	800	14,056.00	0.00
201	600688	上海石化	3,700	13,912.00	0.00
202	600188	兖州煤业	900	13,824.00	0.00
203	600487	亨通光电	1,200	13,680.00	0.00
204	600667	太极实业	1,500	13,650.00	0.00
205	000630	铜陵有色	5,000	13,600.00	0.00
205	002385	大北农	2,000	13,600.00	0.00
206	603589	口子窖	200	13,538.00	0.00
207	002120	韵达股份	1,000	13,530.00	0.00
208	601231	环旭电子	800	13,448.00	0.00
209	600004	白云机场	1,200	13,416.00	0.00
210	002078	太阳纸业	1,000	13,350.00	0.00
211	000983	山西焦煤	1,600	13,296.00	0.00
212	600160	巨化股份	1,500	13,260.00	0.00
213	600372	中航电子	800	13,240.00	0.00
214	002405	四维图新	900	13,230.00	0.00

215	600511	国药股份	400	13,224.00	0.00
216	600875	东方电气	1,200	13,164.00	0.00
217	601198	东兴证券	1,200	13,116.00	0.00
218	600637	东方明珠	1,600	13,104.00	0.00
219	600583	海油工程	2,900	13,050.00	0.00
220	601699	潞安环能	1,100	12,991.00	0.00
221	600699	均胜电子	500	12,760.00	0.00
222	600872	中炬高新	300	12,606.00	0.00
223	002607	中公教育	600	12,534.00	0.00
224	600566	济川药业	700	12,530.00	0.00
225	600549	厦门钨业	600	12,498.00	0.00
226	600998	九州通	800	12,296.00	0.00
227	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
228	600208	新湖中宝	4,000	12,160.00	0.00
229	600170	上海建工	4,400	12,144.00	0.00
230	601233	桐昆股份	500	12,045.00	0.00
231	603638	艾迪精密	280	12,003.60	0.00
232	600988	赤峰黄金	800	11,992.00	0.00
233	600598	北大荒	800	11,968.00	0.00
234	000703	恒逸石化	1,000	11,950.00	0.00
234	002563	森马服饰	1,000	11,950.00	0.00
235	000807	云铝股份	1,000	11,900.00	0.00
236	000932	华菱钢铁	1,800	11,880.00	0.00
237	000961	中南建设	2,000	11,840.00	0.00
238	002736	国信证券	1,100	11,825.00	0.00
239	603338	浙江鼎力	200	11,738.00	0.00
240	600536	中国软件	200	11,386.00	0.00
241	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
242	600233	圆通速递	1,100	11,011.00	0.00
243	600027	华电国际	3,200	11,008.00	0.00
244	600380	健康元	800	10,984.00	0.00
245	601099	太平洋	3,200	10,848.00	0.00
246	601992	金隅集团	4,000	10,760.00	0.00
247	600848	上海临港	600	10,740.00	0.00
248	600256	广汇能源	3,200	10,656.00	0.00
249	600038	中直股份	200	10,548.00	0.00
250	603883	老百姓	200	10,536.00	0.00
251	000625	长安汽车	400	10,512.00	0.00
252	600340	华夏幸福	2,000	10,480.00	0.00

253	000671	阳光城	2,000	10,400.00	0.00
254	600021	上海电力	1,500	10,365.00	0.00
255	000876	新希望	700	10,269.00	0.00
256	600977	中国电影	800	10,024.00	0.00
257	600026	中远海能	1,600	9,856.00	0.00
258	002127	南极电商	1,000	9,770.00	0.00
259	600153	建发股份	1,200	9,720.00	0.00
260	002429	兆驰股份	1,600	9,712.00	0.00
261	603858	步长制药	430	9,670.70	0.00
262	002555	三七互娱	400	9,608.00	0.00
263	600867	通化东宝	800	9,552.00	0.00
264	603027	千禾味业	360	9,464.40	0.00
265	000402	金融街	1,400	9,450.00	0.00
266	000629	攀钢钒钛	4,000	9,160.00	0.00
267	600879	航天电子	1,200	9,024.00	0.00
268	002252	上海莱士	1,200	8,988.00	0.00
269	603866	桃李面包	280	8,736.00	0.00
270	002958	青农商行	2,000	8,560.00	0.00
271	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
272	300088	长信科技	1,000	8,260.00	0.00
273	600967	内蒙一机	800	8,096.00	0.00
274	600167	联美控股	900	8,037.00	0.00
275	600673	东阳光	1,700	7,633.00	0.00
276	601077	渝农商行	1,900	7,581.00	0.00
277	600498	烽火通信	400	7,452.00	0.00
278	601128	常熟银行	1,200	7,440.00	0.00
279	000709	河钢股份	3,000	7,380.00	0.00
280	000729	燕京啤酒	1,000	7,240.00	0.00
281	601098	中南传媒	800	7,056.00	0.00
282	600201	生物股份	400	6,980.00	0.00
283	002506	协鑫集成	2,000	6,960.00	0.00
284	002010	传化智联	900	6,939.00	0.00
285	600529	山东药玻	200	6,790.00	0.00
286	300144	宋城演艺	400	6,720.00	0.00
287	300070	碧水源	900	6,579.00	0.00
288	000540	中天金融	2,400	6,552.00	0.00
289	000728	国元证券	820	6,535.40	0.00
290	002065	东华软件	800	6,344.00	0.00
291	300296	利亚德	800	6,256.00	0.00

292	601456	国联证券	400	6,160.00	0.00
293	300433	蓝思科技	200	5,882.00	0.00
294	002939	长城证券	500	5,565.00	0.00
295	000768	中航西飞	200	5,256.00	0.00
296	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
297	601598	中国外运	900	4,545.00	0.00
298	002241	歌尔股份	100	4,274.00	0.00
299	002456	欧菲光	400	3,552.00	0.00
300	001979	招商蛇口	300	3,285.00	0.00
301	000776	广发证券	200	3,028.00	0.00
302	000783	长江证券	400	2,928.00	0.00
303	000686	东北证券	300	2,535.00	0.00
304	002673	西部证券	300	2,475.00	0.00
305	000002	万科A	100	2,381.00	0.00
306	000301	东方盛虹	100	2,090.00	0.00
307	002625	光启技术	100	2,081.00	0.00
308	002926	华西证券	200	1,926.00	0.00
309	000656	金科股份	300	1,737.00	0.00
310	000627	天茂集团	400	1,448.00	0.00
311	002797	第一创业	200	1,428.00	0.00
312	000166	申万宏源	300	1,404.00	0.00
313	002202	金风科技	100	1,216.00	0.00
314	002157	正邦科技	100	1,195.00	0.00
315	002146	荣盛发展	200	1,128.00	0.00
316	000800	一汽解放	100	1,082.00	0.00
317	002266	浙富控股	200	998.00	0.00
318	000975	银泰黄金	100	951.00	0.00
319	002465	海格通信	100	946.00	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	000858	五粮液	620,138.00	0.11
2	000001	平安银行	196,298.00	0.04
3	002352	顺丰控股	131,037.00	0.02

4	000725	京东方 A	91,005.00	0.02
5	002142	宁波银行	84,568.00	0.02
6	601963	重庆银行	80,921.76	0.01
7	000063	中兴通讯	66,623.00	0.01
8	300059	东方财富	62,216.00	0.01
9	000333	美的集团	61,333.00	0.01
10	002230	科大讯飞	59,013.00	0.01
11	002027	分众传媒	56,742.00	0.01
12	000338	潍柴动力	53,622.00	0.01
13	000100	TCL 科技	46,404.00	0.01
14	600905	三峡能源	45,050.00	0.01
15	300750	宁德时代	40,750.00	0.01
16	605090	九丰能源	37,681.30	0.01
17	002601	龙蟠佰利	36,333.00	0.01
18	601665	齐鲁银行	36,078.16	0.01
19	601156	东航物流	32,959.30	0.01
20	605296	神农集团	31,909.52	0.01

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	600519	贵州茅台	1,493,605.00	0.27
2	600036	招商银行	621,939.00	0.11
3	601318	中国平安	451,546.00	0.08
4	600809	山西汾酒	323,675.00	0.06
5	603259	药明康德	257,330.00	0.05
6	601166	兴业银行	249,198.00	0.05
7	600031	三一重工	194,250.00	0.04
8	600900	长江电力	191,737.79	0.04
9	600000	浦发银行	170,480.00	0.03
10	600030	中信证券	161,499.00	0.03
11	601766	中国中车	153,250.00	0.03
12	601888	中国中免	146,096.00	0.03
13	601012	隆基股份	145,560.00	0.03
14	600887	伊利股份	143,631.00	0.03

15	605499	东鹏饮料	143,018.20	0.03
16	600346	恒力石化	131,274.00	0.02
17	601398	工商银行	129,744.00	0.02
18	600309	万华化学	123,109.00	0.02
19	603288	海天味业	122,745.00	0.02
20	601601	中国太保	121,275.00	0.02

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	3,265,892.16
卖出股票收入（成交）总额	13,302,906.95

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

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）	1,000.00	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,000.00	0.00

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

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	113049	长汽转债	10	1,000.00	0.00

7.7 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。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	MSCIETF	指数型	交易型开放式	华泰柏瑞基金管理有限公司	521,979,391.02	92.37

7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**7.11.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**7.12.1 本期国债期货投资政策**

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.13 投资组合报告附注

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

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。

7.13.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的。

7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	58,043.79
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,897.93
5	应收申购款	15,427.89
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	76,369.61

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：截至本报告期末，本基金前十名股票中不存在流通受限的情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
MSCIETF 联接 A	1,165	16,160.16	4,991,937.67	26.52%	13,834,653.94	73.48%
MSCIETF 联接 C	1,104	286,388.42	311,103,122.82	98.40%	5,069,698.15	1.60%
合计	2,218	151,036.71	316,095,060.49	94.36%	18,904,352.09	5.64%

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

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	MSCIETF 联接 A	6.15	0.0000%
	MSCIETF 联接 C	680.91	0.0002%
	合计	687.06	0.0002%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	MSCIETF 联接 A	MSCIETF 联接 C
基金合同生效日（2018 年 10 月 10 日）基金份额总额	124,471,473.51	384,407,630.40
本报告期期初基金份额总额	17,844,995.21	308,444,930.85
本报告期基金总申购份额	4,153,916.03	16,142,536.65
减：本报告期基金总赎回份额	3,172,319.63	8,414,646.53
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	18,826,591.61	316,172,820.97

§ 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

2021 年 5 月 19 日，经公司董事会批准陈晖女士不再担任公司督察长，刘万方先生担任公司督察长并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

报告期内基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华泰证券	5	13,284,492.95	84.46%	12,371.99	84.74%	-
恒泰证券	1	2,444,902.00	15.54%	2,228.06	15.26%	-
万联证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-

华西证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
东海证券	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	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	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。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易	债券回购交易	权证交易	基金交易
------	------	--------	------	------

	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
华泰证券	41,845.60	100.00%	-	-	-	-	2,643,813.50	100.00%
恒泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富	-	-	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华泰柏瑞基金管理有限公司关于参加交通银行股份有限公司申购及定期定额投资一折费率优惠活动	证监会规定报刊和网站	2021年6月30日

	动的公告		
2	华泰柏瑞基金管理有限公司关于提醒客户及时更新身份证件及非自然人客户及时登记受益所有人信息的公告	证监会规定报刊和网站	2021年6月22日
3	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金参与华安证券股份有限公司配股的公告	证监会规定报刊和网站	2021年6月11日
4	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	2021年6月3日
5	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参与珠海盈米基金销售有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2021年6月2日
6	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	2021年5月21日
7	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	2021年5月20日
8	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参加浙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	2021年4月30日
9	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止上海尚善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	2021年4月27日
10	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参与蚂蚁（杭州）基金销售有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2021年4月20日
11	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暂停大额申购（含转换转入、定期定额投资）业务的公告	证监会规定报刊和网站	2021年3月29日
12	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收益分配公告	证监会规定报刊和网站	2021年3月29日
13	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第3号指数基金指引》修改基金合同和托管协议的公告	证监会规定报刊和网站	2021年3月27日
14	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金在东方财富证券股	证监会规定报刊和网站	2021年3月18日

	份有限公司开通基金定期定额投资业务及定期定额投资手续费率优惠活动的公告		
15	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	2021年2月27日
16	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金持有停牌证券估值调整的提示性公告	证监会规定报刊和网站	2021年2月19日
17	关于终止包商银行股份有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	证监会规定报刊和网站	2021年2月9日
18	华泰柏瑞基金管理有限公司关于网上直销直连招商银行升级签约方式的提示性公告	证监会规定报刊和网站	2021年1月14日
19	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金参加北京增财基金销售有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2021年1月7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	1	20210101-20210630;	154,282,508.58	7,187,837.85	0.00	161,470,346.43	48.20%
	2	20210101-20210630;	132,192,038.29	5,897,771.91	5,600,000.00	132,489,810.20	39.55%
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

本基金报告期内有单一机构持有基金份额超过 20%的情形。如果这些份额持有比例较大的投资者赎回，可能导致巨额赎回，从而引发流动性风险，可能对基金产生如下影响：（1）延期办理赎回申请或暂停赎回的风险。当发生巨额赎回时，投资者可能面临赎回申请延期办理、延缓支付或暂停赎回的风险。（2）基金净值大幅波动的风险。基金管理人为了应对大额赎回可能短时间内进行资产变现，这将对基金资产净值产生不利影响，同时可能发生大额赎回费用归入基金资产、基金份额净值保留位数四舍五入等问题，这些都可能会造成基金资产净值的较大波动。（3）基金投资目标偏离的风险。单一投资者大额赎回后可能导致基金规模缩小，基金将面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形，从而使得实现基金投资目标存在一定的不确定性。（4）基金合同提前终止的风险。如果投资者大额赎回可能导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。本基金管理人将密切关注申赎动向，审慎评估大额申赎对基金持有集中度的影响，同时将完善流动性风险管控机制，最大限度的保护基金份额持有人的合法权益。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

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

2021 年 8 月 28 日