

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

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
6.4 报表附注.....	20
§7 投资组合报告.....	49
7.1 期末基金资产组合情况.....	49
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	49
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.....	50
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	64
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	65
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.....	66
7.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	66
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	66
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.....	66
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	66
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	67
7.12 投资组合报告附注.....	67
§8 基金份额持有人信息.....	69
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	69
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	69
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	69
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	69
§9 开放式基金份额变动.....	71
§10 重大事件揭示.....	72
10.1 基金份额持有人大会决议.....	72
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.....	72
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	72
10.4 基金投资策略的改变.....	72
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	72
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.....	72
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	72
10.8 其他重大事件.....	74

§11 影响投资者决策的其他重要信息	76
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.....	76
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	77
§12 备查文件目录	78
12.1 备查文件目录.....	78
12.2 存放地点.....	78
12.3 查阅方式.....	78

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	MSCIETF
场内简称	MSCIETF
扩位证券简称	MSCIETF
基金主代码	512520
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 4 月 26 日
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	390,056,394.00 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	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	中国证券登记结算有限责任公司	北京西城区金融大街 27 号投资广场 22-23 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年1月1日 - 2021年6月30日)
本期已实现收益	34,666,488.98
本期利润	44,122,945.84
加权平均基金份额本期利润	0.1110
本期加权平均净值利润率	6.46%
本期基金份额净值增长率	6.49%
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	184,558,289.82
期末可供分配基金份额利润	0.4732
期末基金资产净值	697,356,350.10
期末基金份额净值	1.7878
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	78.78%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.59%	0.84%	-2.10%	0.86%	2.69%	-0.02%
过去三个月	9.18%	0.97%	8.39%	1.02%	0.79%	-0.05%
过去六个月	6.49%	1.32%	4.63%	1.41%	1.86%	-0.09%
过去一年	40.15%	1.31%	40.58%	1.43%	-0.43%	-0.12%
过去三年	93.48%	1.35%	63.91%	1.48%	29.57%	-0.13%
自基金合同生效起至今	78.78%	1.33%	42.51%	1.47%	36.27%	-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（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 4 月 26 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，2001-2004

	基金经 理			<p>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</p>
--	----------	--	--	---

					<p>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。</p>
--	--	--	--	--	--

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

目前公司公募基金经理有兼任私募资产管理计划投资经理的情况，兼任业务遵照相关法律法规要求进行，同时遵守公司公平交易制度。公司机构设置合理，公平交易的相关管理制度健全，投资决策流程完善，各项制度执行情况良好。交易价差分析表明公司旗下各基金均得到了公平对

待，不存在非公平交易和利益输送的行为。经过对不同基金之间交易相同证券时的同向交易价差进行分析发现，报告期内基金之间的买卖交易价差总体上处于正常的合理水平。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期本基金与公司所管理的其他投资组合没有参与交易所公开竞价单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的同日反向交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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 0.028%，期间日跟踪误差为 0.030%，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 1.7878 元；本报告期基金份额净值增长率为 6.49%，业绩比较基准收益率为 4.63%。

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标的指数基本一致的投资回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定，基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率达到 1%以上，方可进行收益分配。本报告期内，本基金未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

注：无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

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

报告截止日：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	15,578,763.68	9,790,606.46
结算备付金		5,338,054.47	5,462,843.00
存出保证金		2,683,968.22	1,525,751.91
交易性金融资产	6.4.7.2	674,056,308.53	684,305,352.74
其中：股票投资		673,939,778.46	683,895,352.74
基金投资		-	-
债券投资		116,530.07	410,000.00
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		338,493.42	318,870.90
应收利息	6.4.7.5	3,774.14	3,748.63
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		697,999,362.46	701,407,173.64
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		-	-
应付管理人报酬		84,592.39	70,013.69
应付托管费		28,197.49	23,337.88
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	12,808.38	55,149.95
应交税费		22,731.55	30,436.16

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	494,682.55	1,069,309.05
负债合计		643,012.36	1,248,246.73
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	390,056,394.00	417,056,394.00
未分配利润	6.4.7.10	307,299,956.10	283,102,532.91
所有者权益合计		697,356,350.10	700,158,926.91
负债和所有者权益总计		697,999,362.46	701,407,173.64

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.7878 元，基金份额总额 390,056,394.00 份。

6.2 利润表

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

本报告期：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		45,270,330.25	18,228,380.60
1.利息收入		63,033.77	59,371.32
其中：存款利息收入	6.4.7.11	62,891.97	59,220.75
债券利息收入		141.80	27.50
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	123.07
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		35,708,199.11	22,732,327.13
其中：股票投资收益	6.4.7.12	30,045,032.62	20,172,213.85
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	186,148.16	55,797.00
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	798,951.46	843,572.82
股利收益	6.4.7.16	4,678,066.87	1,660,743.46
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	9,456,456.86	-4,608,494.58
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	42,640.51	45,176.73

减：二、费用		1,147,384.41	613,791.33
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	509,534.26	200,107.39
2. 托管费	6.4.10.2.2	169,844.85	66,702.45
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	204,305.06	167,595.18
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		2,876.60	3,036.89
7. 其他费用	6.4.7.20	260,823.64	176,349.42
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		44,122,945.84	17,614,589.27
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		44,122,945.84	17,614,589.27

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

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

本报告期：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）	417,056,394.00	283,102,532.91	700,158,926.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	44,122,945.84	44,122,945.84
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）	-27,000,000.00	-19,925,522.65	-46,925,522.65
其中：1. 基金申购款	6,000,000.00	4,721,026.39	10,721,026.39
2. 基金赎回款	-33,000,000.00	-24,646,549.04	-57,646,549.04
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	390,056,394.00	307,299,956.10	697,356,350.10

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
	金净值)		
一、期初所有者权益（基金净值）	293,056,394.00	46,038,313.33	339,094,707.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	17,614,589.27	17,614,589.27
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-116,000,000.00	-14,861,233.32	-130,861,233.32
其中：1. 基金申购款	44,000,000.00	8,525,031.70	52,525,031.70
2. 基金赎回款	-160,000,000.00	-23,386,265.02	-183,386,265.02
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	177,056,394.00	48,791,669.28	225,848,063.28

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 韩勇 _____

基金管理人负责人

_____ 房伟力 _____

主管会计工作负责人

_____ 赵景云 _____

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2018]501号《关于准予华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》核准,由华泰柏瑞基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,547,024,828.00 元(含募集股票市值),业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2018)第 0284 号验资报告予以验证。

经向中国证监会备案,《华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2018 年 4 月 26 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,547,056,394.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 31,566.00 份基金份额。本基金的基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。此外,为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于部分非成份股(包括中小板、创业板以及其他经中国证监会核准发行的股票)、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 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

本基金本报告期无重大会计差错。

6.4.6 税项

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

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	15,578,763.68
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:	15,578,763.68

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	574,842,257.04	673,939,778.46	99,097,521.42
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	102,400.00	116,530.07
	银行间市场	-	-
	合计	102,400.00	116,530.07
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	574,944,657.04	674,056,308.53	99,111,651.49

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30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	19,918,320.00	-	-	
股指期货	19,918,320.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	19,918,320.00	-	-	

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应收活期存款利息	1,365.72
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	2,363.59
应收债券利息	10.63
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	34.20
合计	3,774.14

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	12,808.38
银行间市场应付交易费用	-
合计	12,808.38

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	-

应付证券出借违约金	-
预提费用	89,260.15
应付指数使用费	405,422.40
合计	494,682.55

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	417,056,394.00	417,056,394.00
本期申购	6,000,000.00	6,000,000.00
本期赎回(以“-”号填列)	-33,000,000.00	-33,000,000.00
- 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	390,056,394.00	390,056,394.00

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	161,028,940.53	122,073,592.38	283,102,532.91
本期利润	34,666,488.98	9,456,456.86	44,122,945.84
本期基金份额交易产生的变动数	-11,137,139.69	-8,788,382.96	-19,925,522.65
其中：基金申购款	2,392,541.42	2,328,484.97	4,721,026.39
基金赎回款	-13,529,681.11	-11,116,867.93	-24,646,549.04
本期已分配利润	-	-	-
本期末	184,558,289.82	122,741,666.28	307,299,956.10

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
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	44,765.83
其他	686.87
合计	62,891.97

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	25,223,073.21
股票投资收益——赎回差价收入	4,821,959.41
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	30,045,032.62

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	111,059,418.05
减：卖出股票成本总额	85,836,344.84
买卖股票差价收入	25,223,073.21

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
赎回基金份额对价总额	57,646,549.04
减：现金支付赎回款总额	23,420,640.04
减：赎回股票成本总额	29,403,949.59
赎回差价收入	4,821,959.41

6.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

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

单位：人民币元

项目	本期 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	186,148.16
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	186,148.16

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 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	1,306,112.69
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,119,800.00
减：应收利息总额	164.53
买卖债券差价收入	186,148.16

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：无。

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

注：无。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

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

注：无。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2021年1月1日至2021年6月30日
国债期货投资收益	-
股指期货-投资收益	798,951.46

6.4.7.16 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	4,678,066.87
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	4,678,066.87

6.4.7.17 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	9,474,936.86
——股票投资	9,460,806.79
——债券投资	14,130.07
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-18,480.00
——权证投资	-
股指期货	-18,480.00
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	9,456,456.86

6.4.7.18 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	-
替代损益	42,640.51
合计	42,640.51

6.4.7.19 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	204,305.06
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	204,305.06

6.4.7.20 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	1,358.64
指数使用费	169,844.85
其他费用	360.00
合计	260,823.64

6.4.7.21 分部报告

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

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无其它需作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华泰柏瑞基金管理有限公司(“华泰柏瑞基金”)	基金管理人、登记机构、基金销售机构

中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人、基金销售机构
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
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
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：关联方与基金进行的关联交易均在正常业务范围内按照一般商业条款而订立的。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	156,675,951.08	81.39%	151,256,730.79	100.00%

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	46,508.52	90.82%	8,105.20	63.28%
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	31,530.58	100.00%	22,627.70	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。

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	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管理费	509,534.26	200,107.39
其中：支付销售机构的客户维护费	4,166.89	5,478.02

注：自2019年1月1日至2019年6月9日及上年度可比期间，支付基金管理人华泰柏瑞基金的管理人报酬按前一日基金资产净值0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.50% / 当年天数。

根据《华泰柏瑞基金管理有限公司关于调低旗下华泰柏瑞MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金基金费率并修订基金合同和托管协议的公告》，自2019年6月10日起，支付基金管理人华泰柏瑞基金的管理人报酬按前一日基金资产净值0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.15% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	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	169,844.85	66,702.45

注：自2019年1月1日至2019年6月9日及上年度可比期间，支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.10% / 当年天数。

根据《华泰柏瑞基金管理有限公司关于调低旗下华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金基金费率并修订基金合同和托管协议的公告》，自 2019 年 6 月 10 日起，支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.05% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.05% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

注：本基金本期与上年度可比期间无发生关联方销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：无。

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

注：无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期内与上年度可比期间，基金管理人未投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	1,294,063.00	0.3318%	68,551.00	0.0164%
华泰柏瑞 MSCI	291,967,441.00	74.8526%	292,017,341.00	70.0187%

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				
---	--	--	--	--

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 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	
	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	15,578,763.68	17,439.27	6,372,517.83	35,065.74

注：本基金的银行存款由基金托管人建设银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 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	688083	中望软件	网下申购	1,717	258,408.50
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	688656	浩欧博	网下申购	1,371	48,341.46
华泰联合证 券有限责任 公司	688350	富淼科技	网下申购	2,552	34,656.16
华泰联合证 券有限责任 公司	300952	恒辉安防	网下申购	3,398	39,824.56
华泰联合证 券有限责任 公司	688097	博众精工	网下申购	3,983	44,888.41
华泰联合证 券有限责任 公司	688314	康拓医疗	网下申购	1,085	18,813.90
华泰联合证	600905	三峡能源	网上申购	33,000	87,450.00

券有限责任公司						
华泰联合证券有限责任公司	688613	奥精医疗	网下申购	2,617	42,997.31	
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	688161	威高骨科	网下申购	3,069	111,159.18	
华泰联合证券有限责任公司	600909	华安证券	配股	16,467	60,598.56	

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：本基金本报告期与上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（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
301018	申菱环境	2021年6月28日	2021年7月7日	新股未上市	8.29	8.29	7,811	64,753.19	64,753.19	-
688239	航宇科技	2021年6月25日	2021年7月5日	新股未上市	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48	-
688087	英科再生	2021年6月30日	2021年7月9日	新股未上市	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
301017	漱玉平民	2021年6月23日	2021年7月5日	新股未上市	8.86	8.86	5,550	49,173.00	49,173.00	-
301020	密封	2021年	2021	新股未上市	10.64	10.64	4,210	44,794.40	44,794.40	-

	科技	6月28日	2021年7月6日	上市							
301021	英诺激光	2021年6月28日	2021年7月6日	新股未上市	9.46	9.46	2,899	27,424.54	27,424.54		-
688226	威腾电气	2021年6月28日	2021年7月7日	新股未上市	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06		-
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		-
688696	极米科技	2021年2月23日	2021年9月3日	新股锁定期内	133.73	780.24	1,252	167,429.96	976,860.48		-
688630	芯碁微装	2021年3月25日	2021年10月8日	新股锁定期内	15.23	58.42	3,397	51,736.31	198,452.74		-
300957	贝泰妮	2021年3月18日	2021年9月27日	新股锁定期内	47.33	251.96	477	22,576.41	120,184.92		-
688700	东威科技	2021年6月7日	2021年12月15日	新股锁定期内	9.41	38.46	3,049	28,691.09	117,264.54		-
688682	霍莱沃	2021年4月13日	2021年10月20日	新股锁定期内	45.72	103.85	946	43,251.12	98,242.10		-
688456	有研粉材	2021年3月10日	2021年9月17日	新股锁定期内	10.62	26.50	3,396	36,065.52	89,994.00		-
300979	华利集团	2021年4月15日	2021年10月26日	新股锁定期内	33.22	87.50	722	23,984.84	63,175.00		-
688217	睿昂基因	2021年5月7日	2021年11月17日	新股锁定期内	18.42	58.40	1,040	19,156.80	60,736.00		-
300973	立高	2021年	2021	新股锁	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60		-

	食品	4月8日	年10月15日	定期内							
300981	中红医疗	2021年4月19日	2021年10月27日	新股锁定期内	48.59	90.39	343	16,666.37	31,003.77		-
301009	可靠股份	2021年6月8日	2021年12月17日	新股锁定期内	12.54	27.89	801	10,044.54	22,339.89		-
300941	创识科技	2021年2月2日	2021年8月9日	新股锁定期内	21.31	49.94	399	8,502.69	19,926.06		-
301015	百洋医药	2021年6月22日	2021年12月30日	新股锁定期内	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46		-
300932	三友联众	2021年1月15日	2021年7月22日	新股锁定期内	24.69	31.71	492	12,147.48	15,601.32		-
300982	苏文电能	2021年4月19日	2021年10月27日	新股锁定期内	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93		-
300968	格林精密	2021年4月6日	2021年10月15日	新股锁定期内	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34		-
300940	南极光	2021年1月27日	2021年8月3日	新股锁定期内	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66		-
300614	百川畅银	2021年5月18日	2021年11月25日	新股锁定期内	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02		-
300937	药易购	2021年1月20日	2021年7月27日	新股锁定期内	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24		-
301013	利和兴	2021年6月21日	2021年12月29日	新股锁定期内	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81		-

300942	易瑞生物	2021年2月2日	2021年8月9日	新股锁定期内	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300997	欢乐家	2021年5月26日	2021年12月2日	新股锁定期内	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
300933	中辰股份	2021年1月15日	2021年7月22日	新股锁定期内	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
301002	崧盛股份	2021年5月27日	2021年12月7日	新股锁定期内	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
300956	英力股份	2021年3月16日	2021年9月27日	新股锁定期内	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-
300962	中金辐照	2021年3月29日	2021年10月11日	新股锁定期内	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300952	恒辉安防	2021年3月3日	2021年9月13日	新股锁定期内	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-
300945	曼卡龙	2021年2月3日	2021年8月10日	新股锁定期内	4.56	18.88	479	2,184.24	9,043.52	-
300966	共同药业	2021年3月31日	2021年10月11日	新股锁定期内	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300948	冠中生态	2021年2月18日	2021年8月25日	新股锁定期内	13.00	27.42	324	2,808.00	8,884.08	-
300931	通用电梯	2021年1月13日	2021年7月21日	新股锁定期内	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300961	深水海纳	2021年3月23日	2021年9月30日	新股锁定期内	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300950	德固特	2021年2月24日	2021年9月3日	新股锁定期内	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
300986	志特新材	2021年4月21日	2021年11月	新股锁定期内	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-

		日	月1日								
300987	川网传媒	2021年4月28日	2021年11月11日	新股锁定期内	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-	
300978	东箭科技	2021年4月15日	2021年10月26日	新股锁定期内	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-	
300926	博俊科技	2021年1月7日	2021年7月7日	新股锁定期内	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-	
300930	屹通新材	2021年1月13日	2021年7月21日	新股锁定期内	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-	
300985	致远新能	2021年4月21日	2021年10月29日	新股锁定期内	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	-	
300991	创益通	2021年5月12日	2021年11月22日	新股锁定期内	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-	
300963	中洲特材	2021年3月30日	2021年10月11日	新股锁定期内	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-	
301011	华立科技	2021年6月9日	2021年12月17日	新股锁定期内	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-	
300929	华骐环保	2021年1月12日	2021年7月20日	新股锁定期内	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-	
300995	奇德新材	2021年5月17日	2021年11月26日	新股锁定期内	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-	
301007	德迈仕	2021年6月4日	2021年12月16日	新股锁定期内	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-	
300998	宁波	2021年	2021	新股锁	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-	

	方正	5月25日	年12月2日	定期内						
300992	泰福泵业	2021年5月17日	2021年11月25日	新股锁定期内	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
300919	中伟股份	2020年12月15日	2021年7月2日	新股锁定期内	24.60	163.00	463	11,389.80	75,469.00	-

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
127038	国微转债	2021年6月10日	2021年7月14日	新债未上市	100.00	100.00	227	22,700.00	22,700.00	-
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	190	19,000.00	19,000.00	-
123117	健帆转债	2021年6月23日	2021年7月12日	新债未上市	100.00	100.00	151	15,100.00	15,100.00	-

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	20,000	368,032.04	1,127,000.00	-
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	139,900	1,363,873.22	782,041.00	-

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

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券余额 0 元，无债券作为质押。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券余额 0 元，无债券作为质押。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现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，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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末	上年度末
--------	-----	------

	2021 年 6 月 30 日	2020 年 12 月 31 日
AAA	19,000.00	361,000.00
AAA 以下	97,530.07	49,000.00
未评级	0.00	0.00
合计	116,530.07	410,000.00

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 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 0.65%。

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、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 2021年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	15,578,763.68	-	-	-	-	-	15,578,763.68
结算备付金	5,338,054.47	-	-	-	-	-	5,338,054.47
存出保证金	75,989.02	-	-	-	-	2,607,979.20	2,683,968.22
交易性金融资产	-	-	116,530.07	-	-	-673,939,778.46	674,056,308.53
应收证券清算款	-	-	-	-	-	338,493.42	338,493.42
应收利息	-	-	-	-	-	3,774.14	3,774.14
资产总计	20,992,807.17	-	116,530.07	-	-	-676,890,025.22	697,999,362.46
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	84,592.39	84,592.39
应付托管费	-	-	-	-	-	28,197.49	28,197.49
应付交易费用	-	-	-	-	-	12,808.38	12,808.38
应交税费	-	-	-	-	-	22,731.55	22,731.55
其他负债	-	-	-	-	-	494,682.55	494,682.55
负债总计	-	-	-	-	-	643,012.36	643,012.36
利率敏感度缺口	20,992,807.17	-	116,530.07	-	-	-676,247,012.86	697,356,350.10
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	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							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
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

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 0.02% (2020 年 12 月 31 日：0.06%)，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。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金主要投资于指数的成份股及其备选成份股，其投资比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于基金非现金资产的 80%。此外，本基金

的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	673,939,778.46	96.64	683,895,352.74	97.68
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	—	—	—	—
合计	673,939,778.46	96.64	683,895,352.74	97.68

注：其他为可退替代款。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除 MSCI 中国 A 股国际通指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（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%	32,111,685.92	31,154,301.39
MSCI 中国 A 股国际通指数下降 5%	-32,111,685.92	-31,154,301.39	

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	673,939,778.46	96.55
	其中：股票	673,939,778.46	96.55
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	116,530.07	0.02
	其中：债券	116,530.07	0.02
	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	20,916,818.15	3.00
8	其他各项资产	3,026,235.78	0.43
9	合计	697,999,362.46	100.00

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。报告期末，本基金未参与转融通证券出借业务。

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。

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	7,381,130.96	1.06
B	采矿业	16,950,767.27	2.43
C	制造业	398,798,084.49	57.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,245,748.30	1.76
E	建筑业	8,132,003.37	1.17
F	批发和零售业	8,884,599.21	1.27
G	交通运输、仓储和邮政业	19,515,775.28	2.80
H	住宿和餐饮业	774,520.00	0.11
I	信息传输、软件和信息技术服务业	19,847,829.39	2.85
J	金融业	129,140,013.20	18.52
K	房地产业	14,285,301.03	2.05
L	租赁和商务服务业	12,106,613.96	1.74
M	科学研究和技术服务业	10,539,459.40	1.51
N	水利、环境和公共设施管理业	796,297.33	0.11

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	718,616.00	0.10
Q	卫生和社会工作	10,600,054.27	1.52
R	文化、体育和娱乐业	3,222,965.00	0.46
S	综合	-	-
	合计	673,939,778.46	96.64

注：上述股票投资组合不包括可退替代款估值增。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	19,148	39,381,691.60	5.65
2	300750	宁德时代	35,500	18,985,400.00	2.72
3	000858	五粮液	59,106	17,607,086.34	2.52
4	600036	招商银行	313,654	16,996,910.26	2.44
5	601318	中国平安	164,720	10,588,201.60	1.52
6	601888	中国中免	29,399	8,822,639.90	1.27
7	300760	迈瑞医疗	18,100	8,688,905.00	1.25
8	600900	长江电力	345,950	7,140,408.00	1.02
9	601012	隆基股份	80,357	7,138,915.88	1.02
10	603259	药明康德	45,060	7,055,945.40	1.01
11	002594	比亚迪	27,271	6,845,021.00	0.98
12	603288	海天味业	52,792	6,807,528.40	0.98
13	000001	平安银行	292,929	6,626,053.98	0.95
14	600276	恒瑞医药	97,394	6,619,870.18	0.95
15	601166	兴业银行	315,782	6,489,320.10	0.93
16	600809	山西汾酒	13,100	5,868,800.00	0.84
17	300015	爱尔眼科	81,328	5,772,661.44	0.83
18	000568	泸州老窖	22,287	5,258,394.78	0.75
19	600309	万华化学	47,800	5,201,596.00	0.75
20	300059	东方财富	155,368	5,094,516.72	0.73
21	601398	工商银行	956,817	4,946,743.89	0.71
22	002475	立讯精密	105,185	4,838,510.00	0.69
23	002714	牧原股份	79,158	4,814,389.56	0.69
24	002304	洋河股份	23,000	4,765,600.00	0.68

25	002352	顺丰控股	69,367	4,696,145.90	0.67
26	300122	智飞生物	24,400	4,556,212.00	0.65
27	601919	中远海控	147,186	4,495,060.44	0.64
28	600000	浦发银行	446,489	4,464,890.00	0.64
29	603501	韦尔股份	13,100	4,218,200.00	0.60
30	600436	片仔癀	9,200	4,124,360.00	0.59
31	600030	中信证券	161,964	4,039,382.16	0.58
32	000333	美的集团	52,400	3,739,788.00	0.54
33	600031	三一重工	127,437	3,704,593.59	0.53
34	000002	万科A	147,969	3,523,141.89	0.51
35	002142	宁波银行	90,288	3,518,523.36	0.50
36	601288	农业银行	1,132,977	3,432,920.31	0.49
37	600887	伊利股份	91,424	3,367,145.92	0.48
38	601816	京沪高铁	622,400	3,292,496.00	0.47
39	000725	京东方A	514,996	3,213,575.04	0.46
40	002812	恩捷股份	13,400	3,136,940.00	0.45
41	601601	中国太保	102,900	2,981,013.00	0.43
42	601668	中国建筑	638,304	2,968,113.60	0.43
43	300014	亿纬锂能	28,425	2,954,210.25	0.42
44	601328	交通银行	596,664	2,923,653.60	0.42
45	601899	紫金矿业	300,256	2,909,480.64	0.42
46	300124	汇川技术	38,950	2,892,427.00	0.41
47	600438	通威股份	66,800	2,890,436.00	0.41
48	002493	荣盛石化	152,878	2,640,203.06	0.38
49	300782	卓胜微	4,880	2,623,000.00	0.38
50	600019	宝钢股份	338,770	2,588,202.80	0.37
51	600104	上汽集团	117,029	2,571,127.13	0.37
52	300274	阳光电源	22,200	2,554,332.00	0.37
53	600585	海螺水泥	60,886	2,499,370.30	0.36
54	600690	海尔智家	96,002	2,487,411.82	0.36
55	000661	长春高新	6,200	2,399,400.00	0.34
56	601818	光大银行	628,627	2,376,210.06	0.34
57	600016	民生银行	538,756	2,375,913.96	0.34
58	600346	恒力石化	89,180	2,340,083.20	0.34
59	002230	科大讯飞	33,872	2,289,069.76	0.33
60	000538	云南白药	19,465	2,252,489.80	0.32
61	300433	蓝思科技	75,700	2,226,337.00	0.32
62	300759	康龙化成	10,100	2,191,599.00	0.31
63	600196	复星医药	30,277	2,183,880.01	0.31

64	002241	歌尔股份	51,052	2,181,962.48	0.31
65	600048	保利地产	179,810	2,164,912.40	0.31
66	600703	三安光电	67,326	2,157,798.30	0.31
67	600999	招商证券	112,940	2,148,118.80	0.31
68	600893	航发动力	40,105	2,133,184.95	0.31
69	600028	中国石化	484,530	2,112,550.80	0.30
70	002371	北方华创	7,600	2,108,088.00	0.30
71	002027	分众传媒	223,242	2,100,707.22	0.30
72	603799	华友钴业	18,294	2,089,174.80	0.30
73	002311	海大集团	25,300	2,064,480.00	0.30
74	600763	通策医疗	5,000	2,055,000.00	0.29
75	002460	赣锋锂业	16,809	2,035,401.81	0.29
76	601658	邮储银行	404,300	2,029,586.00	0.29
77	601066	中信建投	63,600	1,998,948.00	0.29
78	600406	国电南瑞	84,360	1,960,526.40	0.28
79	601211	国泰君安	114,321	1,959,461.94	0.28
80	601088	中国神华	100,300	1,957,856.00	0.28
81	000063	中兴通讯	58,700	1,950,601.00	0.28
82	603986	兆易创新	10,156	1,908,312.40	0.27
83	300413	芒果超媒	26,860	1,842,596.00	0.26
84	600745	闻泰科技	19,000	1,841,100.00	0.26
85	000338	潍柴动力	101,961	1,822,043.07	0.26
86	601225	陕西煤业	152,089	1,802,254.65	0.26
87	002129	中环股份	46,200	1,783,320.00	0.26
88	601229	上海银行	215,969	1,770,945.80	0.25
89	601688	华泰证券	112,000	1,769,600.00	0.25
90	000625	长安汽车	67,100	1,763,388.00	0.25
91	601857	中国石油	328,183	1,736,088.07	0.25
92	601100	恒立液压	19,928	1,712,213.76	0.25
93	600837	海通证券	146,854	1,688,821.00	0.24
94	600660	福耀玻璃	30,141	1,683,374.85	0.24
95	600588	用友网络	49,764	1,655,150.64	0.24
96	601988	中国银行	534,295	1,645,628.60	0.24
97	603486	科沃斯	7,200	1,642,176.00	0.24
98	300999	金龙鱼	19,300	1,639,728.00	0.24
99	300454	深信服	6,300	1,634,724.00	0.23
100	000100	TCL 科技	213,422	1,632,678.30	0.23
101	601390	中国中铁	309,800	1,623,352.00	0.23
102	000166	申万宏源	342,611	1,603,419.48	0.23

103	601009	南京银行	152,164	1,600,765.28	0.23
104	600919	江苏银行	224,679	1,595,220.90	0.23
105	601169	北京银行	321,655	1,566,459.85	0.22
106	300601	康泰生物	10,500	1,564,500.00	0.22
107	600760	中航沈飞	24,940	1,503,882.00	0.22
108	002709	天赐材料	14,030	1,495,317.40	0.21
109	601633	长城汽车	33,900	1,477,701.00	0.21
110	600570	恒生电子	15,792	1,472,604.00	0.21
111	600132	重庆啤酒	7,400	1,464,830.00	0.21
112	601336	新华保险	31,800	1,459,938.00	0.21
113	300142	沃森生物	23,500	1,449,950.00	0.21
114	603659	璞泰来	10,560	1,442,496.00	0.21
115	000596	古井贡酒	6,000	1,437,000.00	0.21
116	002049	紫光国微	9,300	1,433,967.00	0.21
117	601155	新城控股	34,430	1,432,288.00	0.21
118	601989	中国重工	346,800	1,428,816.00	0.20
119	002821	凯莱英	3,800	1,415,880.00	0.20
120	601628	中国人寿	41,720	1,413,890.80	0.20
121	300498	温氏股份	97,020	1,394,177.40	0.20
122	603993	洛阳钼业	268,382	1,384,851.12	0.20
123	000895	双汇发展	43,437	1,381,296.60	0.20
124	601138	工业富联	110,900	1,376,269.00	0.20
125	603806	福斯特	12,920	1,358,279.60	0.19
126	000776	广发证券	88,966	1,346,945.24	0.19
127	300595	欧普康视	12,891	1,334,863.05	0.19
128	001979	招商蛇口	120,558	1,320,110.10	0.19
129	600926	杭州银行	89,102	1,314,254.50	0.19
130	002179	中航光电	16,600	1,311,732.00	0.19
131	002050	三花智控	53,990	1,294,680.20	0.19
132	000799	酒鬼酒	5,000	1,278,000.00	0.18
133	002841	视源股份	10,200	1,267,758.00	0.18
134	600741	华域汽车	48,020	1,261,485.40	0.18
135	600600	青岛啤酒	10,800	1,249,020.00	0.18
136	600989	宝丰能源	89,000	1,217,520.00	0.17
137	000963	华东医药	26,396	1,214,479.96	0.17
138	600015	华夏银行	195,077	1,207,526.63	0.17
139	603899	晨光文具	14,000	1,183,840.00	0.17
140	002601	龙蟠佰利	34,100	1,179,178.00	0.17
141	601901	方正证券	125,267	1,172,499.12	0.17

142	300408	三环集团	26,800	1,136,856.00	0.16
143	600111	北方稀土	54,667	1,131,606.90	0.16
144	600460	士兰微	20,000	1,127,000.00	0.16
145	601985	中国核电	221,294	1,119,747.64	0.16
146	300628	亿联网络	13,350	1,118,730.00	0.16
147	603882	金域医学	7,000	1,118,390.00	0.16
148	002001	新和成	38,760	1,111,636.80	0.16
149	300347	泰格医药	5,750	1,111,475.00	0.16
150	603833	欧派家居	7,720	1,095,931.20	0.16
151	000768	中航西飞	41,646	1,094,456.88	0.16
152	601877	正泰电器	32,755	1,093,361.90	0.16
153	002568	百润股份	11,480	1,088,189.20	0.16
154	600150	中国船舶	65,100	1,074,801.00	0.15
155	600010	宝钢股份	692,944	1,074,063.20	0.15
156	601788	光大证券	59,500	1,064,455.00	0.15
157	601600	中国铝业	198,800	1,053,640.00	0.15
158	300529	健帆生物	12,190	1,052,728.40	0.15
159	002736	国信证券	97,525	1,048,393.75	0.15
160	600547	山东黄金	54,391	1,045,395.02	0.15
161	603369	今世缘	19,100	1,034,456.00	0.15
162	000301	东方盛虹	49,000	1,024,100.00	0.15
163	300496	中科创达	6,500	1,020,890.00	0.15
164	002648	卫星石化	25,980	1,018,156.20	0.15
165	600584	长电科技	26,900	1,013,592.00	0.15
166	601916	浙商银行	254,000	1,008,380.00	0.14
167	600886	国投电力	104,645	1,005,638.45	0.14
168	002064	华峰氨纶	70,500	1,001,100.00	0.14
169	002007	华兰生物	27,190	997,329.20	0.14
170	600426	华鲁恒升	32,220	997,209.00	0.14
171	000786	北新建材	25,400	996,950.00	0.14
172	000157	中联重科	107,610	994,316.40	0.14
173	300316	晶盛机电	19,600	989,800.00	0.14
174	000876	新希望	67,307	987,393.69	0.14
175	002600	领益智造	107,400	987,006.00	0.14
176	002414	高德红外	35,764	986,371.12	0.14
177	601377	兴业证券	101,818	983,561.88	0.14
178	688696	极米科技	1,252	976,860.48	0.14
179	601939	建设银行	145,936	970,474.40	0.14
180	002236	大华股份	45,600	962,160.00	0.14

181	600779	水井坊	7,500	947,625.00	0.14
182	600176	中国巨石	60,922	944,900.22	0.14
183	000938	紫光股份	43,036	941,627.68	0.14
184	603345	安井食品	3,700	939,874.00	0.13
185	603737	三棵树	5,320	936,320.00	0.13
186	688185	康希诺	1,200	933,324.00	0.13
187	002791	坚朗五金	4,800	931,440.00	0.13
188	600029	南方航空	154,300	928,886.00	0.13
189	000069	华侨城 A	124,743	928,087.92	0.13
190	300033	同花顺	8,200	924,796.00	0.13
191	601966	玲珑轮胎	20,900	914,166.00	0.13
192	603160	汇顶科技	7,000	907,410.00	0.13
193	601669	中国电建	232,747	900,730.89	0.13
194	600958	东方证券	89,621	895,313.79	0.13
195	601360	三六零	72,500	885,225.00	0.13
196	601799	星宇股份	3,900	880,308.00	0.13
197	300661	圣邦股份	3,450	871,918.50	0.13
198	600115	中国东航	170,410	865,682.80	0.12
199	600845	宝信软件	16,900	860,210.00	0.12
200	300003	乐普医疗	26,700	857,604.00	0.12
201	002074	国轩高科	19,500	849,420.00	0.12
202	002938	鹏鼎控股	23,500	843,180.00	0.12
203	300146	汤臣倍健	25,500	838,950.00	0.12
204	601233	桐昆股份	34,800	838,332.00	0.12
205	600061	国投资本	97,820	830,491.80	0.12
206	002916	深南电路	7,460	829,029.80	0.12
207	600183	生益科技	34,900	817,009.00	0.12
208	601995	中金公司	13,200	811,800.00	0.12
209	601618	中国中冶	271,600	809,368.00	0.12
210	600143	金发科技	38,700	807,282.00	0.12
211	002459	晶澳科技	16,100	788,900.00	0.11
212	601111	中国国航	101,000	785,780.00	0.11
213	601021	春秋航空	13,800	785,220.00	0.11
214	603517	绝味食品	9,300	783,897.00	0.11
215	002024	苏宁易购	139,900	782,041.00	0.11
216	300207	欣旺达	24,000	781,440.00	0.11
217	600754	锦江酒店	13,600	774,520.00	0.11
218	002555	三七互娱	32,200	773,444.00	0.11
219	601878	浙商证券	59,000	771,720.00	0.11

220	002920	德赛西威	7,000	770,560.00	0.11
221	002252	上海莱士	102,500	767,725.00	0.11
222	300676	华大基因	6,400	759,040.00	0.11
223	601636	旗滨集团	40,600	753,536.00	0.11
224	000425	徐工机械	117,700	749,749.00	0.11
225	603816	顾家家居	9,700	749,616.00	0.11
226	300285	国瓷材料	15,100	736,125.00	0.11
227	002602	世纪华通	113,360	727,771.20	0.10
228	600332	白云山	21,479	727,064.15	0.10
229	300223	北京君正	7,200	726,624.00	0.10
230	600089	特变电工	56,500	726,025.00	0.10
231	002607	中公教育	34,400	718,616.00	0.10
232	600161	天坛生物	20,960	717,880.00	0.10
233	600885	宏发股份	11,400	714,780.00	0.10
234	688008	澜起科技	11,453	714,438.14	0.10
235	600362	江西铜业	31,655	708,438.90	0.10
236	600079	人福医药	24,900	703,923.00	0.10
237	002624	完美世界	29,244	699,224.04	0.10
238	600009	上海机场	14,514	698,558.82	0.10
239	300450	先导智能	11,580	696,421.20	0.10
240	601881	中国银河	64,600	696,388.00	0.10
241	600383	金地集团	67,900	695,296.00	0.10
242	300558	贝达药业	6,400	692,736.00	0.10
243	601727	上海电气	162,000	686,880.00	0.10
244	300677	英科医疗	5,500	686,400.00	0.10
245	601838	成都银行	54,300	686,352.00	0.10
246	600298	安琪酵母	12,600	685,188.00	0.10
247	601933	永辉超市	144,820	684,998.60	0.10
248	002625	光启技术	32,800	682,568.00	0.10
249	603658	安图生物	8,990	681,172.30	0.10
250	002340	格林美	72,800	680,680.00	0.10
251	600674	川投能源	55,200	680,616.00	0.10
252	600352	浙江龙盛	49,520	680,404.80	0.10
253	688002	睿创微纳	6,780	676,847.40	0.10
254	600606	绿地控股	123,424	672,660.80	0.10
255	600018	上港集团	139,906	667,351.62	0.10
256	002080	中材科技	25,500	667,335.00	0.10
257	002508	老板电器	14,300	664,950.00	0.10
258	000703	恒逸石化	55,410	662,149.50	0.09

259	300144	宋城演艺	39,280	659,904.00	0.09
260	601117	中国化学	75,038	657,332.88	0.09
261	600862	中航高科	21,200	652,536.00	0.09
262	000066	中国长城	44,600	651,160.00	0.09
263	000825	太钢不锈	86,700	649,383.00	0.09
264	601216	君正集团	127,400	648,466.00	0.09
265	002353	杰瑞股份	14,500	648,150.00	0.09
266	600219	南山铝业	179,500	646,200.00	0.09
267	600489	中金黄金	73,800	636,156.00	0.09
268	601162	天风证券	130,800	635,688.00	0.09
269	002202	金风科技	51,883	630,897.28	0.09
270	300037	新宙邦	6,300	630,630.00	0.09
271	600315	上海家化	10,400	625,456.00	0.09
272	002185	华天科技	40,500	623,295.00	0.09
273	000977	浪潮信息	22,128	622,460.64	0.09
274	601689	拓普集团	16,600	621,338.00	0.09
275	688009	中国通号	109,150	621,063.50	0.09
276	603589	口子窖	9,137	618,483.53	0.09
277	603233	大参林	12,100	618,431.00	0.09
278	603456	九洲药业	12,700	616,966.00	0.09
279	000783	长江证券	84,100	615,612.00	0.09
280	300724	捷佳伟创	5,300	614,853.00	0.09
281	601607	上海医药	28,960	611,924.80	0.09
282	603185	上机数控	3,400	608,430.00	0.09
283	000932	华菱钢铁	92,100	607,860.00	0.09
284	600704	物产中大	76,500	602,055.00	0.09
285	300699	光威复材	7,900	600,005.00	0.09
286	002120	韵达股份	44,150	597,349.50	0.09
287	002013	中航机电	59,100	595,137.00	0.09
288	603939	益丰药房	10,526	590,403.34	0.08
289	600109	国金证券	46,069	584,615.61	0.08
290	601990	南京证券	55,500	583,860.00	0.08
291	600188	兖州煤业	37,700	579,072.00	0.08
292	002223	鱼跃医疗	15,100	575,763.00	0.08
293	002409	雅克科技	7,100	575,100.00	0.08
294	002690	美亚光电	10,300	574,328.00	0.08
295	600655	豫园股份	49,300	571,387.00	0.08
296	603605	珀莱雅	2,900	570,459.00	0.08
297	601872	招商轮船	123,060	568,537.20	0.08

298	601108	财通证券	54,000	566,460.00	0.08
299	000807	云铝股份	47,600	566,440.00	0.08
300	601865	福莱特	14,300	565,279.00	0.08
301	002157	正邦科技	47,200	564,040.00	0.08
302	002673	西部证券	67,200	554,400.00	0.08
303	000027	深圳能源	60,298	552,932.66	0.08
304	002511	中顺洁柔	20,000	551,000.00	0.08
305	603638	艾迪精密	12,740	546,163.80	0.08
306	300751	迈为股份	1,200	545,640.00	0.08
307	002044	美年健康	59,553	542,527.83	0.08
308	000830	鲁西化工	28,700	537,551.00	0.08
309	601699	潞安环能	45,515	537,532.15	0.08
310	601077	渝农商行	134,600	537,054.00	0.08
311	600486	扬农化工	4,800	536,496.00	0.08
312	002032	苏泊尔	8,400	535,836.00	0.08
313	002384	东山精密	25,700	535,588.00	0.08
314	600699	均胜电子	20,900	533,368.00	0.08
315	603127	昭衍新药	2,900	532,875.00	0.08
316	002603	以岭药业	18,200	530,712.00	0.08
317	000050	深天马 A	37,400	530,332.00	0.08
318	603444	吉比特	1,000	530,000.00	0.08
319	601696	中银证券	25,700	529,163.00	0.08
320	300253	卫宁健康	32,500	528,775.00	0.08
321	601319	中国人保	88,900	527,177.00	0.08
322	000739	普洛药业	17,900	526,260.00	0.08
323	600705	中航资本	135,684	525,097.08	0.08
324	002078	太阳纸业	39,300	524,655.00	0.08
325	000728	国元证券	65,640	523,150.80	0.08
326	002180	纳思达	16,217	522,187.40	0.07
327	002294	信立泰	15,807	520,050.30	0.07
328	000983	山西焦煤	62,402	518,560.62	0.07
329	300357	我武生物	8,000	512,960.00	0.07
330	600872	中炬高新	12,200	512,644.00	0.07
331	000800	一汽解放	47,200	510,704.00	0.07
332	002405	四维图新	34,700	510,090.00	0.07
333	002430	杭氧股份	14,600	505,014.00	0.07
334	002372	伟星新材	24,300	502,281.00	0.07
335	603707	健友股份	11,850	494,737.50	0.07
336	600827	百联股份	24,500	493,675.00	0.07

337	601555	东吴证券	59,065	492,602.10	0.07
338	600369	西南证券	101,100	492,357.00	0.07
339	002156	通富微电	20,300	488,012.00	0.07
340	002444	巨星科技	14,300	487,344.00	0.07
341	002507	涪陵榨菜	12,900	485,814.00	0.07
342	600739	辽宁成大	23,299	484,852.19	0.07
343	300251	光线传媒	44,700	483,207.00	0.07
344	000723	美锦能源	63,700	481,572.00	0.07
345	600233	圆通速递	48,100	481,481.00	0.07
346	002152	广电运通	36,700	478,201.00	0.07
347	002138	顺络电子	12,300	476,871.00	0.07
348	000860	顺鑫农业	11,300	476,634.00	0.07
349	000513	丽珠集团	9,500	475,190.00	0.07
350	600038	中直股份	9,000	474,660.00	0.07
351	600011	华能国际	111,578	470,859.16	0.07
352	600522	中天科技	46,700	467,000.00	0.07
353	002541	鸿路钢构	8,000	466,800.00	0.07
354	601058	赛轮轮胎	46,700	466,533.00	0.07
355	000656	金科股份	80,300	464,937.00	0.07
356	600177	雅戈尔	70,500	464,595.00	0.07
357	600372	中航电子	28,000	463,400.00	0.07
358	600521	华海药业	22,150	462,492.00	0.07
359	000547	航天发展	24,500	462,315.00	0.07
360	600392	盛和资源	26,500	460,040.00	0.07
361	600642	申能股份	74,800	459,272.00	0.07
362	601615	明阳智能	28,200	456,558.00	0.07
363	002797	第一创业	63,900	456,246.00	0.07
364	600039	四川路桥	72,685	455,734.95	0.07
365	000021	深科技	23,800	455,532.00	0.07
366	002030	达安基因	21,376	454,026.24	0.07
367	002299	圣农发展	19,000	453,720.00	0.07
368	601198	东兴证券	41,494	453,529.42	0.07
369	600803	新奥股份	27,400	452,374.00	0.06
370	300136	信维通信	14,600	450,848.00	0.06
371	600549	厦门钨业	21,600	449,928.00	0.06
372	600875	东方电气	40,800	447,576.00	0.06
373	300482	万孚生物	6,870	444,420.30	0.06
374	688006	杭可科技	5,185	440,725.00	0.06
375	603338	浙江鼎力	7,460	437,827.40	0.06

376	002422	科伦药业	21,932	437,543.40	0.06
377	002939	长城证券	39,300	437,409.00	0.06
378	600848	上海临港	24,360	436,044.00	0.06
379	000630	铜陵有色	160,115	435,512.80	0.06
380	002385	大北农	63,781	433,710.80	0.06
381	600998	九州通	28,200	433,434.00	0.06
382	600536	中国软件	7,600	432,668.00	0.06
383	600895	张江高科	23,600	431,172.00	0.06
384	600516	方大炭素	57,912	430,865.28	0.06
385	600415	小商品城	83,500	430,025.00	0.06
386	603712	七一二	11,800	425,980.00	0.06
387	600066	宇通客车	33,742	421,437.58	0.06
388	603613	国联股份	4,200	419,874.00	0.06
389	300308	中际旭创	10,900	419,868.00	0.06
390	603866	桃李面包	13,260	413,712.00	0.06
391	002429	兆驰股份	68,100	413,367.00	0.06
392	002563	森马服饰	34,200	408,690.00	0.06
393	002266	浙富控股	81,700	407,683.00	0.06
394	600380	健康元	29,500	405,035.00	0.06
395	002373	千方科技	24,100	402,470.00	0.06
396	002463	沪电股份	26,000	402,220.00	0.06
397	600909	华安证券	71,657	399,129.49	0.06
398	603218	日月股份	14,700	398,076.00	0.06
399	000709	河钢股份	161,529	397,361.34	0.06
400	600598	北大荒	26,500	396,440.00	0.06
401	000999	华润三九	14,753	394,642.75	0.06
402	000975	银泰黄金	41,420	393,904.20	0.06
403	002925	盈趣科技	10,050	391,045.50	0.06
404	002010	传化智联	50,304	387,843.84	0.06
405	603858	步长制药	17,203	386,895.47	0.06
406	002926	华西证券	39,500	380,385.00	0.05
407	600511	国药股份	11,500	380,190.00	0.05
408	002242	九阳股份	11,700	380,133.00	0.05
409	600988	赤峰黄金	25,300	379,247.00	0.05
410	601456	国联证券	24,600	378,840.00	0.05
411	601231	环旭电子	22,400	376,544.00	0.05
412	002065	东华软件	47,406	375,929.58	0.05
413	600170	上海建工	135,500	373,980.00	0.05
414	603267	鸿远电子	2,900	370,968.00	0.05

415	002146	荣盛发展	65,351	368,579.64	0.05
416	002075	沙钢股份	33,600	366,576.00	0.05
417	600801	华新水泥	20,800	365,456.00	0.05
418	600867	通化东宝	30,605	365,423.70	0.05
419	002127	南极电商	37,400	365,398.00	0.05
420	002500	山西证券	54,002	362,353.42	0.05
421	002958	青农商行	84,500	361,660.00	0.05
422	000738	航发控制	17,300	360,359.00	0.05
423	002153	石基信息	15,260	358,762.60	0.05
424	300463	迈克生物	8,500	357,765.00	0.05
425	000423	东阿阿胶	9,957	357,555.87	0.05
426	000988	华工科技	15,200	357,504.00	0.05
427	600160	巨化股份	40,100	354,484.00	0.05
428	002456	欧菲光	39,900	354,312.00	0.05
429	300070	碧水源	48,200	352,342.00	0.05
430	002212	天融信	17,800	351,906.00	0.05
431	000750	国海证券	82,860	351,326.40	0.05
432	600027	华电国际	102,000	350,880.00	0.05
433	600153	建发股份	43,155	349,555.50	0.05
434	000987	越秀金控	27,600	349,416.00	0.05
435	601099	太平洋	102,400	347,136.00	0.05
436	600688	上海石化	91,800	345,168.00	0.05
437	300773	拉卡拉	12,200	344,406.00	0.05
438	600859	王府井	11,900	343,672.00	0.05
439	600256	广汇能源	102,700	341,991.00	0.05
440	002558	巨人网络	25,668	341,384.40	0.05
441	601992	金隅集团	126,819	341,143.11	0.05
442	000961	中南建设	57,500	340,400.00	0.05
443	300383	光环新网	23,500	338,165.00	0.05
444	002557	洽洽食品	7,800	336,180.00	0.05
445	002151	北斗星通	7,800	335,946.00	0.05
446	603883	老百姓	6,320	332,937.60	0.05
447	601598	中国外运	65,800	332,290.00	0.05
448	002465	海格通信	35,048	331,554.08	0.05
449	002705	新宝股份	12,600	330,750.00	0.05
450	000671	阳光城	62,700	326,040.00	0.05
451	002019	亿帆医药	18,700	322,575.00	0.05
452	000998	隆平高科	20,100	322,404.00	0.05
453	603027	千禾味业	12,240	321,789.60	0.05

454	600026	中远海能	52,100	320,936.00	0.05
455	600498	烽火通信	17,100	318,573.00	0.05
456	002081	金螳螂	40,154	318,019.68	0.05
457	002683	宏大爆破	11,400	316,578.00	0.05
458	600340	华夏幸福	59,572	312,157.28	0.04
459	002506	协鑫集成	89,000	309,720.00	0.04
460	600529	山东药玻	9,100	308,945.00	0.04
461	300088	长信科技	37,400	308,924.00	0.04
462	000402	金融街	45,500	307,125.00	0.04
463	000729	燕京啤酒	42,400	306,976.00	0.04
464	600879	航天电子	40,200	302,304.00	0.04
465	002727	一心堂	9,100	301,301.00	0.04
466	000686	东北证券	35,600	300,820.00	0.04
467	600583	海油工程	66,500	299,250.00	0.04
468	300296	利亚德	38,200	298,724.00	0.04
469	000629	攀钢钒钛	129,100	295,639.00	0.04
470	300418	昆仑万维	17,700	289,926.00	0.04
471	000540	中天金融	105,300	287,469.00	0.04
472	001914	招商积余	16,000	274,880.00	0.04
473	000623	吉林敖东	17,600	272,624.00	0.04
474	000627	天茂集团	75,181	272,155.22	0.04
475	300212	易华录	9,940	267,485.40	0.04
476	000581	威孚高科	12,800	266,624.00	0.04
477	000401	冀东水泥	20,500	253,175.00	0.04
478	002399	海普瑞	15,700	250,101.00	0.04
479	601128	常熟银行	40,200	249,240.00	0.04
480	002131	利欧股份	102,000	238,680.00	0.03
481	601098	中南传媒	26,900	237,258.00	0.03
482	688630	芯碁微装	3,397	198,452.74	0.03
483	002572	索菲亚	7,000	169,400.00	0.02
484	300957	贝泰妮	477	120,184.92	0.02
485	688700	东威科技	3,049	117,264.54	0.02
486	688682	霍莱沃	946	98,242.10	0.01
487	688456	有研粉材	3,396	89,994.00	0.01
488	300919	中伟股份	463	75,469.00	0.01
489	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.01
490	300979	华利集团	722	63,175.00	0.01
491	688217	睿昂基因	1,040	60,736.00	0.01
492	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.01

493	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.01
494	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.01
495	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.01
496	300973	立高食品	360	41,655.60	0.01
497	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
498	300981	中红医疗	343	31,003.77	0.00
499	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
500	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00
501	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00
502	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
503	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
504	300932	三友联众	492	15,601.32	0.00
505	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
506	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
507	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
508	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
509	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
510	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
511	301013	利和兴	471	12,768.81	0.00
512	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
513	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
514	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
515	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
516	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
517	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
518	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
519	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
520	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
521	300945	曼卡龙	479	9,043.52	0.00
522	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
523	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
524	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
525	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
526	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
527	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
528	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
529	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
530	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
531	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00

532	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
533	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
534	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
535	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
536	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
537	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
538	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
539	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
540	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
541	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
542	300992	泰福泵业	200	4,064.00	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	000333	美的集团	4,953,108.00	0.71
2	601816	京沪高铁	2,620,473.31	0.37
3	600519	贵州茅台	2,322,499.00	0.33
4	300759	康龙化成	1,893,963.00	0.27
5	300999	金龙鱼	1,774,448.00	0.25
6	601658	邮储银行	1,526,271.00	0.22
7	300760	迈瑞医疗	1,440,007.00	0.21
8	600989	宝丰能源	1,338,275.00	0.19
9	002352	顺丰控股	1,286,864.00	0.18
10	000858	五粮液	1,154,186.00	0.16
11	600150	中国船舶	1,151,287.00	0.16
12	600584	长电科技	1,064,293.00	0.15
13	603486	科沃斯	922,136.00	0.13
14	603259	药明康德	918,724.60	0.13
15	002064	华峰氨纶	902,130.00	0.13
16	000301	东方盛虹	877,708.00	0.13
17	600036	招商银行	871,119.00	0.12
18	600276	恒瑞医药	838,659.00	0.12

19	002648	卫星石化	838,421.00	0.12
20	002493	荣盛石化	833,080.00	0.12

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	002415	海康威视	8,711,932.13	1.24
2	000858	五粮液	2,767,027.00	0.40
3	600519	贵州茅台	2,469,580.00	0.35
4	002271	东方雨虹	2,411,081.00	0.34
5	601766	中国中车	2,239,730.21	0.32
6	300750	宁德时代	2,038,344.00	0.29
7	600050	中国联通	1,885,441.44	0.27
8	601006	大秦铁路	1,556,399.07	0.22
9	601186	中国铁建	1,512,905.61	0.22
10	600036	招商银行	1,334,566.00	0.19
11	000001	平安银行	994,742.00	0.14
12	002714	牧原股份	899,676.28	0.13
13	000568	泸州老窖	888,224.00	0.13
14	002410	广联达	864,902.00	0.12
15	603019	中科曙光	851,560.00	0.12
16	002594	比亚迪	849,195.00	0.12
17	601318	中国平安	809,600.00	0.12
18	002475	立讯精密	793,529.00	0.11
19	300124	汇川技术	762,523.00	0.11
20	002304	洋河股份	750,094.25	0.11

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	89,545,069.36
卖出股票收入（成交）总额	111,059,418.05

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）	116,530.07	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	116,530.07	0.02

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	127036	三花转债	456	59,730.07	0.01
2	127038	国微转债	227	22,700.00	0.00
3	113049	长汽转债	190	19,000.00	0.00
4	123117	健帆转债	151	15,100.00	0.00

7.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IC2109	中证 500 期货 2109 合约	6	8,000,400.00	224,400.00	-
IF2109	沪深 300 期货 2109 合约	8	12,399,360.00	257,040.00	-
公允价值变动总额合计（元）					481,440.00

股指期货投资本期收益（元）	798,951.46
股指期货投资本期公允价值变动（元）	-18,480.00

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,683,968.22
2	应收证券清算款	338,493.42
3	应收股利	-
4	应收利息	3,774.14
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,026,235.78

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

8.1.1 本基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
2,793	139,654.99	301,548,721.00	77.31%	88,507,673.00	22.69%

8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额（份）	占总份额比例
联接基金	291,967,441.00	74.85%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额 比例
1	于长清	5,511,100.00	1.41%
2	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	5,000,000.00	1.28%
3	何少雄	2,032,000.00	0.52%
4	张招兴	2,000,000.00	0.51%
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	2,000,000.00	0.51%
6	华泰证券股份有限公司	1,294,063.00	0.33%
7	王丹红	1,172,900.00	0.30%
8	徐红	906,100.00	0.23%
9	中国银河证券股份有限公司	795,959.00	0.20%
10	郑晓星	750,000.00	0.19%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2018年4月26日）基金份额总额	1,547,056,394.00
本报告期期初基金份额总额	417,056,394.00
本报告期基金总申购份额	6,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	33,000,000.00
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	390,056,394.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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	4	156,675,951.08	81.39%	46,508.52	90.82%	-
方正证券	1	35,820,357.79	18.61%	4,703.18	9.18%	-
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	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
爱建证券	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	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
财达证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-

注：1、选择代理证券买卖的证券经营机构的标准

公司应选择财务状况良好，经营行为规范，具备研究实力的证券公司及专业研究机构，向其或其合作券商租用基金专用交易席位。公司选择的提供交易单元的券商应当满足下列基本条件：

- 1) 具有相应的业务经营资格；
- 2) 诚信记录良好，最近两年无重大违法违规行为，未受监管机构重大处罚；
- 3) 资金雄厚，信誉良好。内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求；
- 4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服务；
- 5) 具备研究实力，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、股票分析的研究报告及周到的信息服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告。

2、选择代理证券买卖的证券经营机构的程序 基金管理人根据以上标准进行考察后确定证券经营机构的选择。基金管理人与被选择的证券经营机构签订交易单元租用协议和证券研究服务协议。

3、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：无。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华泰证券	775,617.70	59.38%	-	-	-	-
方正证券	530,494.99	40.62%	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下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24日
2	华泰柏瑞基金管理有限公司关于	证监会规定报刊和	2021年6月22日

	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	网站	
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14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	2021年5月12日
10	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
11	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
12	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
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3月5日
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	证监会规定报刊和网站	2021年3月4日

	销证券的公告		
16	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
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1月22日
19	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
20	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
21	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	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
联接基金	1	20210101-20210630 ;	292,017,341.00	750,100.00	800,000.00	291,967,441.00	74.85%

产品特有风险

本基金报告期内有本基金联接基金持有基金份额超过 20% 的情形。如果这些份额持有比例较大的投资者赎回，可能导致巨额赎回，从而引发流动性风险，可能对基金产生如下影响：（1）延期办理赎回申请或暂停赎回的风险。当发生巨额赎回时，投资者可能面临赎回申请延期办理、延缓支付或暂停赎回的风险。（2）基金净值大幅波动的风险。基金管理人为了应对大额赎回可能短时间内进行资产

变现，这将对基金资产净值产生不利影响，同时可能发生大额赎回费用归入基金资产、基金份额净值保留位数四舍五入等问题，这些都可能会造成基金资产净值的较大波动。（3）基金投资目标偏离的风险。单一投资者大额赎回后可能导致基金规模缩小，基金将面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形，从而使得实现基金投资目标存在一定的不确定性。（4）基金合同提前终止的风险。如果投资者大额赎回可能导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。本基金管理人将密切关注申赎动向，审慎评估大额申赎对基金持有集中度的影响，同时将完善流动性风险管控机制，最大限度的保护基金份额持有人的合法权益。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

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