华泰柏瑞中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金（QDII）
2025 年中期报告

2025 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：交通银行股份有限公司

送出日期：2025 年 8 月 30 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 08 月 29 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 2025 年 1 月 1 日起至 2025 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 5

2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 6
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人 7
2.5 信息披露方式 7
2.6 其他相关资料 7

§3 主要财务指标和基金净值表现 7

3.1 主要会计数据和财务指标 7
3.2 基金净值表现 8

§4 管理人报告 9

4.1 基金管理人及基金经理情况 9
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介 12
4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 12
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 12
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 12
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 13
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 13

§5 托管人报告 13

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 13
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 14
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 14

§6 半年度财务会计报告（未经审计） 14

6.1 资产负债表 14
6.2 利润表 15
6.3 净资产变动表 17
6.4 报表附注 19

§7 投资组合报告 40

7.1 期末基金资产组合情况 40
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布 40
7.3 期末按行业分类的权益投资组合 41
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细 41

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动 46
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合 50
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细 50
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细 50
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细 50
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 50
7.11 投资组合报告附注 50

§8 基金份额持有人信息 51

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 51
8.2 期末上市基金前十名持有人 51
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 52
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情况 52

§9 开放式基金份额变动 52

§10 重大事件揭示 53

10.1 基金份额持有人大会决议 53
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 53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 53
10.4 基金投资策略的改变 53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 53
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 53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 53
10.8 其他重大事件 56

§11 影响投资者决策的其他重要信息 57

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 57
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 57

§12 备查文件目录 57

12.1 备查文件目录 57
12.2 存放地点 58
12.3 查阅方式 58

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金（QDII）
基金简称	港股红利
场内简称	港股红利（扩位证券简称：港股通红利 ETF）
基金主代码	513530
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2022 年 4 月 8 日
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,673,938,710.00 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	2022 年 4 月 25 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 0.35%以内，年化跟踪误差控制在 4%以内。
投资策略	1、股票的投资策略 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：当标的指数进行定期调整、指数样本空间或者编制规则变更时，本基金将根据标的指数的编制规则及调整公告，及时进行投资组合的优化调整，尽量降低跟踪误差，力争将日均跟踪偏离度控制在 0.35%以内，年化跟踪误差控制在 4%以内。 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。 特殊情况包括但不限于以下情形：（1）法律法规的限制；（2）标的指数成份股流动性严重不足；（3）标的指数的成份股票长期停牌；（4）其他合理原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等。 在投资香港市场时，本基金可通过合格境内机构投资者（QDII）境外投资额度或内地与香港股票市场交易互联互通机制进行投资。 2、债券的投资策略 本基金管理人将基于对国内外宏观经济形势的深入分析、国内财政政策与货币市场政策等因素对债券的影响，进行合理的利率预期，判断市场的基本走势，构建债券投资组合，以保证基金资产流动性，并降低组合跟踪误差。 其中可转换债券和可交换债券，结合了权益类证券与固定收益类证

	券的特性,具有下行风险有限同时可分享基础股票价格上涨的特点。本基金将评估其内在投资价值，结合对可转换债券、可交换债券市场上的溢价率及其变动趋势、行业资金的配置以及基础股票基本面的综合分析，最终确定其投资权重及具体品种。 3、股指期货的投资策略 本基金投资股指期货时，将严格根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等。股指期货的投资主要采用流动性好、交易活跃的合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作,力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。 4、资产支持证券的投资策略 资产支持证券为本基金的辅助性投资工具，本基金将采用久期配置策略与期限结构配置策略，结合定量分析和定性分析的方法，综合分析资产支持证券的利率风险、提前偿付风险、流动性风险、税收溢价等因素，选择具有较高投资价值的资产支持证券进行配置。 5、融资及转融通证券出借业务 本基金还可以参与融资及转融通证券出借业务。本基金参与融资业务，将综合考虑融资成本、保证金比例、冲抵保证金证券折算率、信用资质等条件，选择合适的交易对手方。同时，在保障基金投资组合充足流动性以及有效控制融资杠杆风险的前提下，确定融资比例。 本基金参与转融通证券出借业务，将综合分析市场情况、投资者结构、基金历史申赎情况、出借证券流动性情况等条件，合理确定转融通证券出借的范围、期限和比例。 6、存托凭证投资策略 本基金在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素的基础上，根据审慎原则合理参与存托凭证的投资，以更好地跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
业绩比较基准	业绩比较基准为中证港股通高股息投资指数收益率。
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，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征：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。 本基金主要投资于香港证券市场中具有良好流动性的金融工具。除需承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险，还需承担汇率风险以及香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

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	交通银行股份有限公司
信息披露	姓名	刘万方	方圆

负责人	联系电话	021-38601777	95559
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	fangy_20@bankcomm.com
客户服务电话		400-888-0001	95559
传真		021-38601799	021-62701216
注册地址		上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号 17 层	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号
办公地址		上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号 17 层	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码		200135	200336
法定代表人		贾波	任德奇

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	-	HSBC Bank (China) Company Ltd.
	中文	-	香港上海汇丰银行有限公司
注册地址		-	香港中环皇后大道中一号汇丰总行大厦
办公地址		-	香港九龙深旺道一号，汇丰中心一座六楼
邮政编码		-	-

注：本基金不聘请境外投资顾问，华泰柏瑞基金管理有限公司对全部资产进行自行管理。

2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
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层及基金托管人住所

2.6 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	北京市西城区太平桥大街 17 号

§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(2025 年 1 月 1 日-2025 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	77,441,970.11
本期利润	215,056,254.07
加权平均基金份额本期利润	0.1988
本期加权平均净值利润率	13.32%
本期基金份额净值增长率	12.94%

3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	415,824,381.09
期末可供分配基金份额利润	0.2484
期末基金资产净值	2,698,151,295.98
期末基金份额净值	1.6119
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	63.16%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

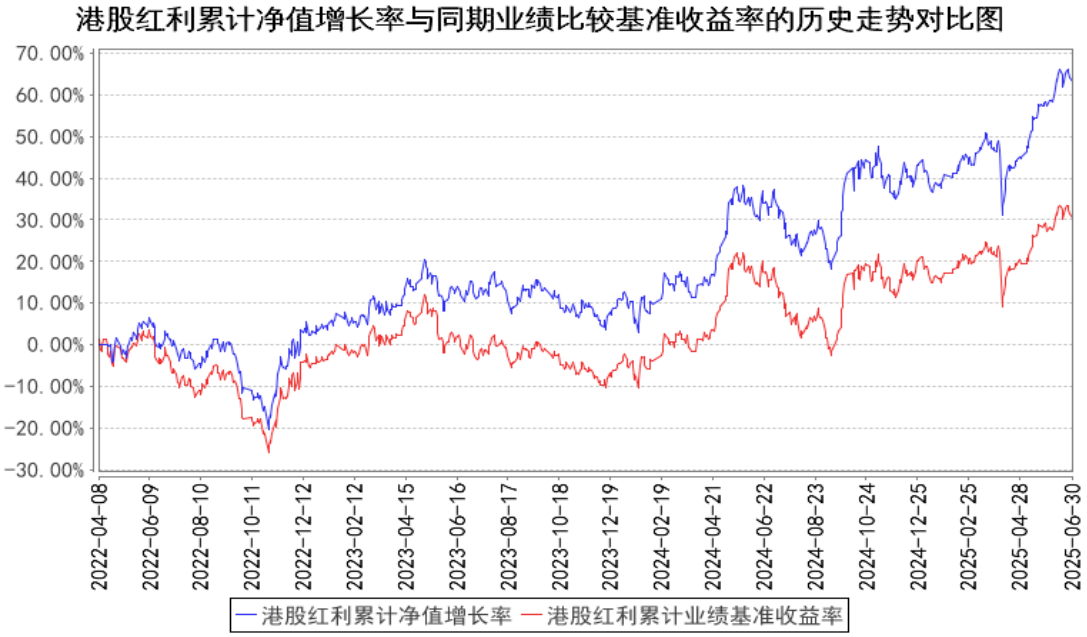
3、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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	3.63%	0.84%	2.54%	0.83%	1.09%	0.01%
过去三个月	11.57%	1.65%	7.83%	1.67%	3.74%	-0.02%
过去六个月	12.94%	1.30%	7.70%	1.31%	5.24%	-0.01%
过去一年	22.62%	1.36%	13.02%	1.38%	9.60%	-0.02%
过去三年	59.25%	1.32%	34.02%	1.33%	25.23%	-0.01%
自基金合同生效起至今	63.16%	1.32%	30.53%	1.33%	32.63%	-0.01%

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



注：图示日期为 2022 年 4 月 8 日至 2025 年 06 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%。截至 2025 年 6 月 30 日，公司旗下管理 179 只基金，其中包括股票型基金、混合型基金、债券型基金、货币型基金、QDII 基金、基金中基金等。

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		
何琦	本基金的基金经理	2022 年 4 月 8 日	-	16 年	上海交通大学经济学学士。曾任汇丰银行证券服务部证券结算师，2008 年 11 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，曾任交易部高级交易员，海外投资部基金经理助理。2017 年 7 月起任华泰柏瑞新经济沪港深灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 8 月起任华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 12 月起任华泰柏瑞中证港股通 50 交易型开

					放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 1 月起任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的基金经理。2021 年 5 月起任华泰柏瑞港股通时代机遇混合型证券投资基金和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。2021 年 9 月至 2024 年 9 月，任华泰柏瑞中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2022 年 1 月起任华泰柏瑞中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 4 月起任华泰柏瑞中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2022 年 12 月起任华泰柏瑞中证香港 300 金融服务交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2024 年 7 月起任华泰柏瑞南方东英沙特阿拉伯交易型开放式指数证券投资基金(QDII)基金经理。
柳叶青	本基金的基金经理助理	2024 年 4 月 22 日	-	6 年	英国萨塞克斯大学公司和财务风险管理专业硕士。2018 年 12 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，现任指数投资部基金经理助理。
李茜	指数投资部总监助理、本基金的基金经理	2022 年 4 月 8 日	-	10 年	伦敦政治经济学院金融数学硕士。曾任职于上海市虹口区金融服务局。2015 年 3 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任指数投资部助理研究员、研究员，现任指数投资部总监助理兼基金经理。2019 年 11 月至 2022 年 12 月任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的基金经理。2019 年 11 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。2020 年 12 月起任华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 1 月至 2025 年 6 月任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的基金经理。2021 年 2 月至 2024 年 5 月任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

					资基金的基金经理。2021 年 3 月至 2025 年 1 月任华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月起任华泰柏瑞中证物联网主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月至 2024 年 9 月任华泰柏瑞中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2021 年 11 月起任华泰柏瑞上证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022 年 1 月起任华泰柏瑞中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 4 月起任华泰柏瑞中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2022 年 12 月起任华泰柏瑞中证香港 300 金融服务交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2023 年 5 月起任华泰柏瑞中证中央企业红利交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 6 月起任华泰柏瑞中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2023 年 9 月起任华泰柏瑞中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2023 年 12 月起任华泰柏瑞中证中央企业红利交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2024 年 3 月起任华泰柏瑞中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 4 月起任华泰柏瑞中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2024 年 9 月起任华泰柏瑞恒生港股通高股息低波动交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 12 月起任华泰柏瑞恒生创新药交易型开放式指数证券投资基金(QDII)基金、华泰柏瑞上证 180 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 1 月起任华泰柏瑞上证 180 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：截至本报告期末，本基金的基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

注：本基金不聘请境外投资顾问，华泰柏瑞基金管理有限公司对全部资产进行自行管理。

4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求，通过科学完善的制度及流程，从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能的利益输送。

首先投资部和研究部通过规范的决策流程来确保公平对待不同投资组合。其次交易部对投资指令的合规性、有效性及合理性进行独立审核，在交易过程中启用投资交易系统中的公平交易模块，确保公平交易的实施。同时，风险管理部对报告期内的交易进行日常监控和分析评估。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。

4.4.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共有 2 次，都为指数投资组合因跟踪指数需要而发生的反向交易。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2025 上半年，港股市场震荡上行，结构性机会较为明显，港股红利类指数表现格外吸金，随着南下资金不断涌入，市场对于港股红利类资产的关注度持续上升。与 A 股相比，港股市场分红力度上具有更高的水平，具备更低估值、更高股息率的相对优势，从指数表现来看，港股通高股息全收益指数上涨 15.85%。

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 0.04%，期间日跟踪误差为 0.12%，较好地实现

了本基金的投资目标。

4.5.2 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 1.6119 元，本报告期基金份额净值增长率为 12.94%，业绩比较基准收益率为 7.70%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度，处于二季报披露期，外部关税扰动情况、国内政策发力节奏仍将是影响市场表现的关键因素，风险偏好或有所回落，红利策略或将具备一定的防御性。中期看，在新一轮财政发力的周期下，红利策略在基建等稳增长相关板块暴露较高，有望再次成为攻守兼备的标的的重要抓手。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定，基金管理人可以每月定期对基金相对标的指数的超额收益率进行评估，当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，可进行收益分配。

本基金的基金管理人于 2025 年 6 月 11 日宣告 2025 年第一次分红，向截至 2025 年 6 月 13 日止在本基金注册登记机构登记在册的本基金全体基金份额持有人，按每 10 份基金份额派发红利 0.2000 元。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§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

本报告期内，交通银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在华泰柏瑞中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金（QDII）（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，华泰柏瑞基金管理有限公司在华泰柏瑞中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金（QDII）投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§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：华泰柏瑞中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金（QDII）

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	51,390,198.77	25,903,456.92
结算备付金		12,545,252.09	8,251,927.67
存出保证金		72,732.50	29,727.86
交易性金融资产	6.4.7.2	2,649,275,089.95	1,253,297,935.98
其中：股票投资		2,649,275,089.95	1,253,297,935.98
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		404.78	-
应收股利		28,916,576.97	2,615,846.65
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	805,118.52	-

资产总计		2,743,005,373.58	1,290,098,895.08
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2025 年 6 月 30 日**	**上年度末 2024 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		-	-
应付清算款		41,137,217.17	18,644,590.55
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		962,534.55	486,895.84
应付托管费		192,506.94	97,379.15
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	2,561,818.94	1,799,215.80
负债合计		44,854,077.60	21,028,081.34
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	1,673,938,710.00	878,438,710.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	1,024,212,585.98	390,632,103.74
净资产合计		2,698,151,295.98	1,269,070,813.74
负债和净资产总计		2,743,005,373.58	1,290,098,895.08

注： 报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.6119 元，基金份额总额 1,673,938,710.00 份。

6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金（QDII）

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		220,116,701.09	50,371,750.40
1.利息收入		34,920.53	39,438.88
其中：存款利息收入	6.4.7.13	34,920.53	39,438.88
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产		-	-

收入			
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		73,333,472.52	20,119,551.71
其中：股票投资收益	6.4.7.14	3,408,364.35	9,171,421.47
基金投资收益	6.4.7.15	-	-
债券投资收益	6.4.7.16	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.17	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.18	-	-
衍生工具收益	6.4.7.19	-	-
股利收益	6.4.7.20	69,925,108.17	10,948,130.24
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	137,614,283.96	31,582,233.82
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		1,498,149.81	-6,228,561.32
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.22	7,635,874.27	4,859,087.31
减：二、营业总支出		5,060,447.02	1,114,182.61
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	3,973,021.51	717,873.01
其中：暂估管理人报酬		-	-
2．托管费	6.4.10.2.2	794,604.38	143,574.57
3．销售服务费		-	-
4．投资顾问费		-	-
5．利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6．信用减值损失	6.4.7.23	-	-
7．税金及附加		-	-
8．其他费用	6.4.7.24	292,821.13	252,735.03
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		215,056,254.07	49,257,567.79
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		215,056,254.07	49,257,567.79
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		215,056,254.07	49,257,567.79

6.3 净资产变动表

会计主体：华泰柏瑞中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金（QDII）

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	878,438,710.00	-	390,632,103.74	1,269,070,813.74
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	878,438,710.00	-	390,632,103.74	1,269,070,813.74
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	795,500,000.00	-	633,580,482.24	1,429,080,482.24
（一）、综合收益总额	-	-	215,056,254.07	215,056,254.07
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	795,500,000.00	-	446,553,002.37	1,242,053,002.37
其中：1.基金申购款	922,000,000.00	-	500,271,950.02	1,422,271,950.02
2.基金赎回款	-126,500,000.00	-	-53,718,947.65	-180,218,947.65
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-28,028,774.20	-28,028,774.20
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-

四、本期期末净资产	1,673,938,710.00	-	1,024,212,585.98	2,698,151,295.98

项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	113,938,710.00	-	12,526,908.08	126,465,618.08
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	113,938,710.00	-	12,526,908.08	126,465,618.08
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	295,500,000.00	-	122,877,335.22	418,377,335.22
（一）、综合收益总额	-	-	49,257,567.79	49,257,567.79
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	295,500,000.00	-	73,619,767.43	369,119,767.43
其中：1.基金申购款	460,000,000.00	-	129,074,879.48	589,074,879.48
2.基金赎回款	-164,500,000.00	-	-55,455,112.05	-219,955,112.05
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	409,438,710.00	-	135,404,243.30	544,842,953.30

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：

贾波	房伟力	赵景云
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金(QDII)(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[2021]第 2793 号《关于准予华泰柏瑞中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金(QDII)注册的批复》注册，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《华泰柏瑞中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金(QDII)基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式基金，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 303,928,000.00 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(2022)第 0286 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金(QDII)基金合同》于 2022 年 4 月 8 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 303,938,710.00 份基金份额，认购资金利息折合 10,710.00 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，基金托管人为交通银行股份有限公司。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律管理决定书[2022]107 号核准，本基金 303,938,710.00 份基金份额于 2022 年 4 月 25 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《华泰柏瑞中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金(QDII)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(包括主板、创业板以及其他经中国证监会核准或注册发行的股票)、存托凭证、债券(包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券(含分离交易可转债的纯债部分)、可交换债券、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、非成份股的港股(包括港股通标的股票)、远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的期权、期货等金融衍生产品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(但须符合中国证监会相关规定)。在投资香港市场时，本基金可通过合格境内机构投资者(QDII)境外投资额度或内地与香港股票市场交易互联互通机制进行投资。基金的投资组合比例为：投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不得低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；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，

本基金应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；本基金参与融资业务时，在任何交易日日终，持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%。本基金力争日均跟踪偏离度控制在 0.35%以内，年化跟踪误差控制在 4%以内。本基金的业绩比较基准为中证港股通高股息投资指数收益率。

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中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(以下简称“华泰柏瑞中证港股通高股息 ETF 联接基金”)。华泰柏瑞中证港股通高股息 ETF 联接基金为契约型开放式基金，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 2025 年 8 月 29 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)、中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

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 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 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 2025 年 06 月 30 日的财务状况以及 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

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[2014]81 号《财政部国家税务总局

证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2)目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收企业所得税。

(3)目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

(4)根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
活期存款	51,390,198.77
等于：本金	51,389,405.59
加：应计利息	793.18
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	51,390,198.77

注：于 2025 年 06 月 30 日，活期存款包括人民币活期存款 47,036,265.59 元，港币活期存款 200,043.84(折合人民币 182,429.98 元)，美元活期存款 582,726.12(折合人民币 4,171,503.20 元)。于 2024 年 12 月 31 日，活期存款包括人民币活期存款 24,190,218.94，港币活期存款 1,849,948.38 元(折合人民币 1,713,126.20 元)和美元活期存款 15.55 元(折合人民币 111.78 元)。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		2,440,481,770.51	-	2,649,275,089.95	208,793,319.44
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-

基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	2,440,481,770.51	-	2,649,275,089.95	208,793,319.44

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末未持有期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

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：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

注：无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具。

6.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	805,118.52
待摊费用	-
合计	805,118.52

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 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	-
应付交易费用	224,759.02
其中：交易所市场	224,759.02
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	233,560.90
应退退补款	2,103,499.02
合计	2,561,818.94

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	878,438,710.00	878,438,710.00
本期申购	922,000,000.00	922,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-126,500,000.00	-126,500,000.00
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,673,938,710.00	1,673,938,710.00

注：投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购赎回单位的整数倍。

6.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期末无其他综合收益。

6.4.7.12 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	177,268,842.51	213,363,261.23	390,632,103.74
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	177,268,842.51	213,363,261.23	390,632,103.74
本期利润	77,441,970.11	137,614,283.96	215,056,254.07
本期基金份额交易产生的变动数	189,142,342.67	257,410,659.70	446,553,002.37
其中：基金申购款	216,362,335.18	283,909,614.84	500,271,950.02
基金赎回款	-27,219,992.51	-26,498,955.14	-53,718,947.65
本期已分配利润	-28,028,774.20	-	-28,028,774.20
本期末	415,824,381.09	608,388,204.89	1,024,212,585.98

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	12,351.71
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	22,391.83
其他	176.99
合计	34,920.53

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	3,408,364.35
股票投资收益——赎回差价收入	-
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	3,408,364.35

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	190,668,159.23
减：卖出股票成本总额	184,965,313.16
减：交易费用	2,294,481.72
买卖股票差价收入	3,408,364.35

6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益——申购差价收入。

6.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益——证券出借差价收入。

6.4.7.15 基金投资收益

注：本基金本报告期内无基金投资收益。

6.4.7.16 债券投资收益

6.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——买卖债券差价收入。

6.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.17 资产支持证券投资收益

6.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.18 贵金属投资收益

6.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

6.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——申购差价收入。

6.4.7.19 衍生工具收益

6.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

6.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	69,925,108.17
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	69,925,108.17

6.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	137,614,283.96
股票投资	137,614,283.96
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
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	137,614,283.96

6.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	7,635,874.27
合计	7,635,874.27

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

6.4.7.23 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.24 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	-
证券组合费	16,923.76
注册登记费	74,383.76
IOPV 计算发布费	9,916.99
银行划款手续费	102,336.47
合计	292,821.13

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

本基金的基金管理人于 2025 年 7 月 9 日宣告 2025 年第二次分红，向截至 2025 年 7 月 11 日止在本基金注册登记机构登记在册的本基金全体基金份额持有人，按每 10 份基金份额派发红利 0.2000 元；

于 2025 年 8 月 13 日宣告 2025 年第三次分红，向截至 2025 年 8 月 15 日止在本基金注册登记机构登记在册的本基金全体基金份额持有人，按每 10 份基金份额派发红利 0.1000 元。

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、基金销售机构
交通银行股份有限公司(“交通银行”)	基金托管人
香港上海汇丰银行有限公司(“香港上海汇丰银行”)	境外资产托管人
华泰柏瑞中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(“华泰柏瑞中证港股通高股息 ETF 联接”)	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 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

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 基金交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行基金交易。

6.4.10.1.5 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元支付关联方佣金。

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

当期发生的基金应支付的管理费	3,973,021.51	717,873.01
其中：应支付销售机构的客户维护费	43,811.52	34,618.67
应支付基金管理人的净管理费	3,929,209.99	683,254.34

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×0.50%÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	794,604.38	143,574.57

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10%的年费率计提。境外托管人的托管费从基金托管人的托管费中扣除。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.10%÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

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：本基金本报告期及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发生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。

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发生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。

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：本报告期及上年度可比期间，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 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024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（%）
华泰柏瑞中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	822,681,477.00	49.1465	157,436,700.00	17.9223

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024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
交通银行股份有限公司	47,036,262.79	9,505.70	16,796,555.62	13,007.32
香港上海汇丰银行有限公司	4,353,935.98	2,846.01	29,717,330.79	25,412.57

注：本基金由基金托管人交通银行和境外资产托管人汇丰香港保管的银行存款按适用利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

于 2025 年 6 月 30 日，本基金持有 12,372,000.00 股交通银行的普通股，成本总额为人民币 72,826,277.88 元，估值总额为人民币 82,363,311.42 元,占基金净资产的比例为 3.05%(2024 年 12 月 31 日，本基金持有 6,403,000.00 股交通银行的普通股，成本总额为人民币 33,514,694.74 元，估值总额为人民币 37,889,084.03 元,占基金净资产的比例为 2.99%)。

6.4.11 利润分配情况

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	2025 年 06 月 13 日	2025 年 6 月 16 日	-	0.2000	28,028,774.20	-	28,028,774.20	-
合计	-	-	-	0.2000	28,028,774.20	-	28,028,774.20	-

6.4.12 期末（2025 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

注：本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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

注：本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

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开立的托管账户或其他商业银行开立的存款账户，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通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小；在场外交易市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于 2025 年 6 月 30 日，本基金无债券投资(2024 年 12 月 31 日：同)。

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 2025 年 06 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约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(净资产)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 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 2025 年 06 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符合法律法规的相关要求。

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未来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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 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							
货币资金	51,390,198.77	-	-	-	-	-	51,390,198.77
结算备付金	12,545,252.09	-	-	-	-	-	12,545,252.09
存出保证金	72,732.50	-	-	-	-	-	72,732.50
交易性金融资产	-	-	-	-	-	2,649,275,089.95	2,649,275,089.95
应收股利	-	-	-	-	-	28,916,576.97	28,916,576.97
应收清算款	-	-	-	-	-	404.78	404.78
其他资产	-	-	-	-	-	805,118.52	805,118.52
资产总计	64,008,183.36	-	-	-	-	2,678,997,190.22	2,743,005,373.58
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	962,534.55	962,534.55
应付托管费	-	-	-	-	-	192,506.94	192,506.94
应付清算款	-	-	-	-	-	41,137,217.17	41,137,217.17
其他负债	-	-	-	-	-	2,561,818.94	2,561,818.94
负债总计	-	-	-	-	-	44,854,077.60	44,854,077.60
利率敏感度缺口	64,008,183.36	-	-	-	-	2,634,143,112.62	2,698,151,295.98
上年度末 2024 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							
货币资金	25,903,456.92	-	-	-	-	-	25,903,456.92
结算备付金	8,251,927.67	-	-	-	-	-	8,251,927.67
存出保证金	29,727.86	-	-	-	-	-	29,727.86
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,253,297,935.98	1,253,297,935.98
应收股利	-	-	-	-	-	2,615,846.65	2,615,846.65
资产总计	34,185,112.45	-	-	-	-	1,255,913,782.63	1,290,098,895.08
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	486,895.84	486,895.84
应付托管费	-	-	-	-	-	97,379.15	97,379.15

应付清算款	-	-	-	-	-	18,644,590.55	18,644,590.55
其他负债	-	-	-	-	-	1,799,215.80	1,799,215.80
负债总计	-	-	-	-	-	21,028,081.34	21,028,081.34
利率敏感度缺口	34,185,112.45	-	-	-	-	1,234,885,701.29	1,269,070,813.74

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 2025 年 06 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2024 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2024 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。本基金持有不以记账本位币人民币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
货币资金	4,171,503.20	182,429.98	-	4,353,933.18
交易性金融资产	-	2,649,275,089.95	-	2,649,275,089.95
应收股利	-	11,852,409.17	-	11,852,409.17
其他资产	-	805,118.52	-	805,118.52
资产合计	4,171,503.20	2,662,115,047.62	-	2,666,286,550.82
以外币计价的				

负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	4,171,503.20	2,662,115,047.62	-	2,666,286,550.82
项目	上年度末 2024 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
货币资金	111.78	1,713,126.20	-	1,713,237.98
交易性金融资产	-	1,253,297,935.98	-	1,253,297,935.98
应收股利	-	2,615,846.65	-	2,615,846.65
资产合计	111.78	1,257,626,908.83	-	1,257,627,020.61
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	111.78	1,257,626,908.83	-	1,257,627,020.61

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率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（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	所有外币相对人民币升值 5%	133,314,327.54	62,881,351.03
	所有外币相对人民币贬值 5%	-133,314,327.54	-62,881,351.03

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或银行间同业市场交易的股票和债券，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。

本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。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 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024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	2,649,275,089.95	98.19	1,253,297,935.98	98.76
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
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	2,649,275,089.95	98.19	1,253,297,935.98	98.76

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准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（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	129,198,364.75	60,705,214.47
	业绩比较基准下降 5%	-129,198,364.75	-60,705,214.47

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	2,649,275,089.95	1,253,297,935.98
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	2,649,275,089.95	1,253,297,935.98

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2025 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2024 年 12 月 31 日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 基金申购款

于 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日止期间，本基金申购基金份额的对价总额为 1,422,271,950.02 元(2024 年度：1,326,311,931.62 元)，其中包括以股票支付的申购款 0.00 元和以现金支付的申购款 1,422,271,950.02 元(2024 年度：其中包括以股票支付的申购款 0.00 元和以现金支付的申购款 1,326,311,931.62 元)。

(2) 除基金申购款外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§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	2,649,275,089.95	96.58
	其中：普通股	2,649,275,089.95	96.58
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	63,935,450.86	2.33
8	其他各项资产	29,794,832.77	1.09
9	合计	2,743,005,373.58	100.00

注：通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币 1,438,763,392.85 元，占基金资产净值的比例为 53.32%。

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
中国香港	2,649,275,089.95	98.19

合计	2,649,275,089.95	98.19

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

7.3.1 期末指数投资按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
能源	250,961,921.71	9.30
原材料	356,695,542.65	13.22
工业	583,375,085.31	21.62
可选消费	-	-
主要消费	-	-
医药卫生	-	-
金融	973,237,091.60	36.07
信息技术	-	-
通信服务	231,422,694.88	8.58
公用事业	212,667,022.71	7.88
房地产	40,915,731.09	1.52
合计	2,649,275,089.95	98.19

注：以上分类采用彭博行业分类标准。

7.3.2 期末积极投资按行业分类的权益投资组合

注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

7.4.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	COSCO SHIPPING Holdings Co., Ltd.	中远海控	1919 HK	香港联合交易所	中国香港	9,781,500	121,672,058.94	4.51
1	COSCO SHIPPING Holdings Co., Ltd.	中远海控	01919 HG	沪港通联合市场	中国香港	9,570,500	119,047,430.36	4.41
2	Yancoal	兖煤澳大利亚	03668 HG	沪港通联合市	中国香港	3,478,100	93,728,264.87	3.47

	Australia Ltd			场				
2	Yancoal Australia Ltd	兖煤澳大利亚	3668 HK	香港联合交易所	中国香港	2,874,600	77,465,072.94	2.87
3	SITC	海丰国际	01308 HG	沪港通联合市场	中国香港	3,224,000	73,944,189.02	2.74
3	SITC	海丰国际	1308 HK	香港联合交易所	中国香港	1,947,872	44,675,501.04	1.66
4	OOIL	东方海外国际	00316 HG	沪港通联合市场	中国香港	528,000	64,233,380.64	2.38
4	OOIL	东方海外国际	316 HK	香港联合交易所	中国香港	441,432	53,702,025.91	1.99
5	Minsheng Bank	民生银行	01988 HG	沪港通联合市场	中国香港	15,760,000	63,956,877.40	2.37
5	Minsheng Bank	民生银行	1988 HK	香港联合交易所	中国香港	13,068,463	53,034,142.51	1.97
6	CNCB	中信银行	00998 HG	沪港通联合市场	中国香港	9,045,000	61,699,436.37	2.29
6	CNCB	中信银行	998 HK	香港联合交易所	中国香港	7,506,461	51,204,467.97	1.90
7	PetroChina	中国石油股份	00857 HG	沪港通联合市场	中国香港	8,410,000	51,769,121.63	1.92
7	PetroChina	中国石油股份	857 HK	香港联合交易所	中国香港	6,992,372	43,042,682.11	1.60
8	Guotai Haitong Securities	国泰海通	02611 HG	沪港通联合市场	中国香港	4,512,000	51,845,451.84	1.92

	Co., Ltd.							
8	Guotai Haitong Securities Co., Ltd.	国泰海通	2611 HK	香港联合交易所	中国香港	3,723,000	42,779,392.11	1.59
9	ABC Ltd	农业银行	01288 HG	沪港通市场	中国香港	9,788,000	49,986,532.96	1.85
9	ABC Ltd	农业银行	1288 HK	香港联合交易所	中国香港	8,121,035	41,473,476.06	1.54
10	CNOOC	中国海洋石油	00883 HG	沪港通市场	中国香港	2,988,000	48,285,344.95	1.79
10	CNOOC	中国海洋石油	883 HK	香港联合交易所	中国香港	2,483,433	40,131,666.36	1.49
11	CCB Corp	建设银行	939 HK	香港联合交易所	中国香港	6,134,622	44,308,190.78	1.64
11	CCB Corp	建设银行	00939 HG	沪港通市场	中国香港	5,971,000	43,126,407.32	1.60
12	ICBC	工商银行	01398 HG	沪港通市场	中国香港	8,143,000	46,189,775.05	1.71
12	ICBC	工商银行	1398 HK	香港联合交易所	中国香港	6,755,708	38,320,598.40	1.42
13	THE PEOPLE'S INSURANCE COMPANY (GROUP) OF CHINA LIMIT	中国人民保险集团	01339 HG	沪港通市场	中国香港	8,479,000	46,162,571.58	1.71

	ED							
13	THE PEOPLE'S INSURANCE COMPANY (GROUP) OF CHINA LIMITED	中国人民保险集团	1339 HK	香港联合交易所	中国香港	7,035,469	38,303,495.85	1.42
14	China Unicom	中国联通	00762 HG	沪港通联合市场	中国香港	5,366,000	45,509,770.41	1.69
14	China Unicom	中国联通	762 HK	香港联合交易所	中国香港	4,471,893	37,926,728.24	1.41
15	Bank of Comm	交通银行	03328 HG	沪港通联合市场	中国香港	6,762,000	45,016,223.07	1.67
15	Bank of Comm	交通银行	3328 HK	香港联合交易所	中国香港	5,610,000	37,347,088.35	1.38
16	Bank of China	中国银行	03988 HG	沪港通联合市场	中国香港	10,795,000	44,890,921.14	1.66
16	Bank of China	中国银行	3988 HK	香港联合交易所	中国香港	8,954,739	37,238,210.49	1.38
17	China Shenhua	中国神华	01088 HG	沪港通联合市场	中国香港	1,565,000	43,458,293.29	1.61
17	China Shenhua	中国神华	1088 HK	香港联合交易所	中国香港	1,301,222	36,133,474.32	1.34
18	Guangdong Invest	粤海投资	00270 HG	沪港通联合市场	中国香港	7,240,000	43,312,518.08	1.61
18	Guangdong Invest	粤海投资	270 HK	香港联合交易所	中国香港	6,018,000	36,002,035.06	1.33

19	China Mobile Ltd	中国移动	00941 HG	沪港通联合市场	中国香港	529,000	42,018,917.01	1.56
19	China Mobile Ltd	中国移动	941 HK	香港联合交易所	中国香港	442,770	35,169,595.24	1.30
20	BJ Enterprise	北京控股	00392 HG	沪港通联合市场	中国香港	1,322,000	38,940,812.17	1.44
20	BJ Enterprise	北京控股	392 HK	香港联合交易所	中国香港	1,100,500	32,416,311.49	1.20
21	China Telecom	中国电信	00728 HG	沪港通联合市场	中国香港	7,598,000	38,663,798.24	1.43
21	China Telecom	中国电信	728 HK	香港联合交易所	中国香港	6,314,777	32,133,885.74	1.19
22	HSBC	汇丰控股	00005 HG	沪港通联合市场	中国香港	420,000	36,367,654.05	1.35
22	HSBC	汇丰控股	5 HK	香港联合交易所	中国香港	368,000	31,864,992.12	1.18
23	PICC P&C	中国财险	02328 HG	沪港通联合市场	中国香港	2,680,000	37,149,195.20	1.38
23	PICC P&C	中国财险	2328 HK	香港联合交易所	中国香港	2,234,367	30,971,990.98	1.15
24	Sinopec Corp	中国石油化工股份	00386 HG	沪港通联合市场	中国香港	9,756,000	36,566,605.06	1.36
24	Sinopec Corp	中国石油化工股份	386 HK	香港联合交易所	中国香港	8,315,248	31,166,501.60	1.16
25	BJ Water Group	北控水务集团	00371 HG	沪港通联合市场	中国香港	15,678,000	33,885,198.48	1.26
25	BJ Water Group	北控水务集团	371 HK	香港联合交易所	中国香港	13,006,000	28,110,147.43	1.04
26	CN Coal	中煤能源	01898 HG	沪港通联合市	中国香港	3,952,000	32,724,559.71	1.21

	Energy			场				
26	CN Coal Energy	中煤能源	1898 HK	香港联合交易所	中国香港	3,284,000	27,193,181.70	1.01
27	Pacific Basin	太平洋航运	02343 HG	沪港通联合市场	中国香港	15,703,000	28,927,108.72	1.07
27	Pacific Basin	太平洋航运	2343 HK	香港联合交易所	中国香港	13,345,671	24,584,581.03	0.91
28	China Commu Cons	中国交通建设	01800 HG	沪港通联合市场	中国香港	6,142,000	28,734,140.10	1.06
28	China Commu Cons	中国交通建设	1800 HK	香港联合交易所	中国香港	5,099,000	23,854,669.55	0.88
29	CN Building Matl	中国建材	03323 HG	沪港通联合市场	中国香港	7,682,000	26,270,999.63	0.97
29	CN Building Matl	中国建材	3323 HK	香港联合交易所	中国香港	5,766,894	19,721,696.19	0.73
30	Yuexiu Property	越秀地产	00123 HG	沪港通联合市场	中国香港	5,700,000	22,351,894.50	0.83
30	Yuexiu Property	越秀地产	123 HK	香港联合交易所	中国香港	4,734,000	18,563,836.59	0.69

注：上述股票价值不包括可退替代估增。

7.4.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	COSCO SHIPPING	01919 HG	126,834,777.25	9.99

	Holdings Co., Ltd.			
1	COSCO SHIPPING Holdings Co., Ltd.	1919 HK	3,152,750.93	0.25
2	Yancoal Australia Ltd	03668 HG	86,457,053.73	6.81
2	Yancoal Australia Ltd	3668 HK	1,945,015.13	0.15
3	Guotai Haitong Securities Co., Ltd.	02611 HG	52,982,128.85	4.17
3	Guotai Haitong Securities Co., Ltd.	2611 HK	19,534,395.76	1.54
4	SITC	01308 HG	69,966,445.60	5.51
4	SITC	1308 HK	1,003,210.48	0.08
5	OOIL	00316 HG	61,660,869.52	4.86
5	OOIL	316 HK	1,290,417.21	0.10
6	Minsheng Bank	01988 HG	58,483,549.48	4.61
6	Minsheng Bank	1988 HK	1,319,791.15	0.10
7	CNCB	00998 HG	55,767,756.74	4.39
7	CNCB	998 HK	1,226,604.18	0.10
8	PetroChina	00857 HG	49,986,585.33	3.94
8	PetroChina	857 HK	1,105,918.63	0.09
9	CNOOC	00883 HG	49,339,675.96	3.89
9	CNOOC	883 HK	1,194,082.08	0.09
10	China Shenhua	01088 HG	47,056,993.26	3.71
10	China Shenhua	1088 HK	1,091,404.06	0.09
11	ABC Ltd	01288 HG	45,368,330.78	3.57
11	ABC Ltd	1288 HK	1,074,441.05	0.08
12	Bank of China	03988 HG	44,243,522.24	3.49
12	Bank of China	3988 HK	1,095,410.66	0.09
13	China Unicom	00762 HG	43,933,582.51	3.46
13	China Unicom	762 HK	1,037,406.47	0.08
14	Bank of Comm	03328 HG	43,132,098.84	3.40
14	Bank of Comm	3328 HK	1,032,772.96	0.08
15	ICBC	01398 HG	42,815,918.38	3.37
15	ICBC	1398 HK	997,783.89	0.08
16	Guangdong Invest	00270 HG	42,132,472.19	3.32
16	Guangdong Invest	270 HK	988,349.78	0.08
17	China Mobile Ltd	00941 HG	40,702,855.65	3.21
17	China Mobile Ltd	941 HK	922,833.28	0.07
18	CCB Corp	00939 HG	40,012,574.61	3.15
18	CCB Corp	939 HK	1,000,805.05	0.08
19	China Telecom	00728 HG	39,007,700.56	3.07

19	China Telecom	728 HK	974,535.82	0.08
20	THE PEOPLE'S INSURANCE COMPANY (GROUP) OF CHINA LIMITED	01339 HG	39,001,643.40	3.07
20	THE PEOPLE'S INSURANCE COMPANY (GROUP) OF CHINA LIMITED	1339 HK	804,079.17	0.06
21	Sinopec Corp	00386 HG	37,347,115.14	2.94
21	Sinopec Corp	386 HK	916,997.03	0.07
22	BJ Enterprise	00392 HG	37,395,839.51	2.95
22	BJ Enterprise	392 HK	803,830.97	0.06
23	PICC P&C	02328 HG	35,437,781.43	2.79
23	PICC P&C	2328 HK	840,682.98	0.07
24	BJ Water Group	00371 HG	34,851,689.63	2.75
24	BJ Water Group	371 HK	801,874.70	0.06
25	HSBC	00005 HG	33,696,396.27	2.66
25	HSBC	5 HK	852,602.66	0.07
26	CN Coal Energy	01898 HG	30,960,586.46	2.44
26	CN Coal Energy	1898 HK	713,027.38	0.06
27	China Commu Cons	01800 HG	28,721,202.30	2.26
27	China Commu Cons	1800 HK	675,815.80	0.05
28	Pacific Basin	02343 HG	26,876,953.81	2.12
28	Pacific Basin	2343 HK	604,816.92	0.05
29	CN Building Matl	03323 HG	25,442,263.88	2.00
29	CN Building Matl	3323 HK	116,054.21	0.01

注：不考虑相关交易费用。

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	COSCO SHIPPING Holdings Co., Ltd.	01919 HG	16,035,959.45	1.26
1	COSCO SHIPPING Holdings Co., Ltd.	1919 HK	12,664,986.01	1.00
2	Yancoal Australia Ltd	3668 HK	8,621,317.44	0.68
2	Yancoal Australia Ltd	03668 HG	3,319,661.32	0.26
3	CN Building Matl	3323 HK	8,718,936.04	0.69
3	CN Building Matl	03323 HG	1,210,411.26	0.10
4	Guotai Haitong	02611 HG	5,908,537.36	0.47

	Securities Co., Ltd.			
4	Guotai Haitong Securities Co., Ltd.	2611 HK	2,834,909.24	0.22
5	Minsheng Bank	1988 HK	5,031,544.80	0.40
5	Minsheng Bank	01988 HG	1,950,824.90	0.15
6	OOIL	316 HK	5,073,535.99	0.40
6	OOIL	00316 HG	1,776,723.76	0.14
7	CNOOC	883 HK	5,004,363.40	0.39
7	CNOOC	00883 HG	1,728,945.01	0.14
8	CNCB	998 HK	4,549,178.52	0.36
8	CNCB	00998 HG	1,761,461.26	0.14
9	PetroChina	857 HK	4,615,950.51	0.36
9	PetroChina	00857 HG	1,587,383.04	0.13
10	China Shenhua	1088 HK	4,288,680.31	0.34
10	China Shenhua	01088 HG	1,575,006.81	0.12
11	Bank of China	3988 HK	4,076,551.17	0.32
11	Bank of China	03988 HG	1,605,948.66	0.13
12	China Unicom	762 HK	3,934,850.47	0.31
12	China Unicom	00762 HG	1,670,730.08	0.13
13	SITC	1308 HK	4,088,890.54	0.32
13	SITC	01308 HG	1,408,053.21	0.11
14	Bank of Comm	3328 HK	3,954,711.37	0.31
14	Bank of Comm	03328 HG	1,499,484.62	0.12
15	ABC Ltd	1288 HK	3,914,184.30	0.31
15	ABC Ltd	01288 HG	1,529,512.72	0.12
16	ICBC	1398 HK	3,846,720.88	0.30
16	ICBC	01398 HG	1,484,726.86	0.12
17	Guangdong Invest	270 HK	3,855,495.29	0.30
17	Guangdong Invest	00270 HG	1,442,264.72	0.11
18	China Telecom	728 HK	3,686,927.87	0.29
18	China Telecom	00728 HG	1,486,249.37	0.12
19	Sinopec Corp	386 HK	3,767,739.61	0.30
19	Sinopec Corp	00386 HG	1,368,479.27	0.11
20	China Mobile Ltd	941 HK	3,513,921.96	0.28
20	China Mobile Ltd	00941 HG	1,400,032.85	0.11

注：不考虑相关交易费用。

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	1,442,943,335.66
卖出收入（成交）总额	190,668,159.23

注：不考虑相关交易费用。

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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名的前五名金融衍生品投资明细

注：本基金本报告期末未持有金融衍生品。

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

注：本基金本报告期末未持有基金。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体中，农业银行在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行的处罚。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，民生银行在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规、基金合同及公司投资制度的要求。

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

7.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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情形。

7.11.3 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	72,732.50
2	应收清算款	404.78
3	应收股利	28,916,576.97
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	805,118.52
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	29,794,832.77

7.11.4 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。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§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

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		华泰柏瑞中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	
		持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
8,380	199,754.02	620,987,793.00	37.10	230,269,440.00	13.76	822,681,477.00	49.15

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	新华人寿保险股份有限公司	357,390,003.00	21.35
2	招商银行股份有限公司－南方浩睿进取京选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）	16,900,000.00	1.01
3	中国银河证券股份有限公司	13,500,000.00	0.81
4	建元信托股份有限公司	13,455,000.00	0.80
5	渤银理财有限责任公	13,372,500.00	0.80

	司－渤银理财理财有术系列丰裕持盈 180 天最短持有期固收增强理		
6	上海国际信托有限公司－上海信托添越睿银 1 号集合资金信托计划	10,929,400.00	0.65
7	潍坊银行股份有限公司－潍坊银行惟行稳盈 182 天客户周期净值型人民币理财产品	10,518,343.00	0.63
8	中信证券－工行－中信证券贵宾定制 6 号集合资产管理计划	9,121,200.00	0.54
9	上海岩山科技股份有限公司	8,002,000.00	0.48
10	中国太平洋人寿保险股份有限公司－分红－个人分红	7,075,700.00	0.42
11	华泰柏瑞中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	822,681,477.00	49.15

注：前十名持有人为除本基金的联接基金之外的前十名持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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（2022 年 4 月 8 日）基金份额总额	303,938,710.00
本报告期期初基金份额总额	878,438,710.00
本报告期基金总申购份额	922,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	126,500,000.00

本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,673,938,710.00

§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

基金管理人重大人事变动：

经公司董事会审议通过，田汉卿女士于 2025 年 4 月 30 日起，不再担任公司副总经理。

经公司董事会审议通过，韩勇先生于 2025 年 5 月 9 日起不再担任公司总经理，董事长贾波先生代为履行总经理职责。

经公司股东会书面决定，韩勇先生于 2025 年 5 月 9 日起不再担任公司董事。

上述人事变动已按相关规定备案、报告。

报告期内本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

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：报告期内基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：报告期内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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注

	数量	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(%)	
中信证券	1	1,188,590,370.22	72.76	237,717.89	63.47	-
国泰海通证券	1	268,715,579.52	16.45	53,741.92	14.35	-
Haitong International Securities Company Limited	1	150,921,928.02	9.24	75,461.04	20.15	-
The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited	1	25,360,124.42	1.55	7,608.03	2.03	-
中信建投	1	23,492.71	0.00	4.70	0.00	-
CLSA Limited	1	-	-	-	-	-
Huatai Financial Holdings (Hong Kong) Limited	1	-	-	-	-	-

注：1、选择证券公司参与证券交易的标准

公司选择财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强的证券公司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综合考虑下列因素：

(1)具有相应的业务经营资格；

(2)具备研究实力，有固定的研究机构和充足的研究人员，或者获得过知名金融媒体奖项，能及时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，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告和特色研究服务等；

(3)诚信记录良好，最近两年券商研究、交易业务无重大违法违规行为，未受监管机构重大处罚；

(4)财务状况良好，信誉良好，内部管理规范、严格，风控合规管理人员充足，具备健全的

内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

（5)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；

（6)被动股票型基金选择的提供交易单元的券商需综合考虑上述(1)、(3)、(4)和(5)基本条件，在此基础上可以设置指标进行评价，对相关未公开数据、证券公司内部业务流程及其他适用并纳入评价标准的相关信息，公司相关部门发送《尽职调查函》至各证券公司详询。

根据上述条件标准，公司建立被动股票型基金和其他类型基金证券公司白名单。

证券公司白名单进行定期或不定期更新，每年更新不得少于一次。

2、选择证券公司参与证券交易的程序

公司选择证券公司租用基金专用交易席位，应遵循以下程序：

（1)公司投研部门根据拟合作的证券公司名单，负责安排与券商签订经公司合规法律部审核的《证券研究服务协议》，协议需约定双方的权利义务，明确服务内容、收取交易佣金的价格标准与计算方式。

（2)基金事务部依据公司相关部门对券商的综合评价，根据基金运作需要，与券商签署《证券交易单元租用协议》。

（3)如因业务需要，公司需新增租用已合作券商的交易单元，基金事务部应提出申请，与券商签订《证券交易单元租用协议》。

公司选择代理证券买卖的证券经营机构的程序：

基金管理人根据业务需要与被选择的证券经营机构签订证券经纪服务协议。

3、本报告期内，本基金无变更租用证券公司交易单元的情况。

4、国泰君安证券股份有限公司吸收合并海通证券股份有限公司。根据《国泰海通证券股份有限公司关于完成公司名称变更、注册资本变更、公司章程修订及相应市场主体变更登记的公告》，自 2025 年 4 月 3 日起,国泰君安证券股份有限公司中文名称变更为“国泰海通证券股份有限公司”。

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(%)

中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
Haitong International Securities Company Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
CLSA Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Huatai Financial Holdings (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-

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	华泰柏瑞中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金（QDII）分红公告	证监会规定报刊和网站	2025 年 06 月 11 日
2	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	2025 年 06 月 04 日
3	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止民商基金销售(上海)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	2025 年 05 月 24 日
4	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下证券投资基金调整收益分配原则并相应修订基金合同、托管协议的公告	证监会规定报刊和网站	2025 年 05 月 23 日
5	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金参加中国邮政储蓄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	2025 年 05 月 14 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	2025 年 05 月 10 日
7	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	2025 年 05 月 01 日
8	关于华泰柏瑞中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金份额参考净值（IOPV）	证监会规定报刊和网站	2025 年 04 月 09 日

	计算中汇率换算有关事项的公告		
9	华泰柏瑞基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况(2024 年度)	证监会规定报刊和网站	2025 年 3 月 31 日
10	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金 2025 年香港市场节假日暂停申购赎回业务的公告	证监会规定报刊和网站	2025 年 01 月 20 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	20250101-20250630;	295,715,603.00	96,044,800.00	34,370,400.00	357,390,003.00	21.35
联接基金	1	20250324-20250630;	157,436,700.00	667,944,777.00	2,700,000.00	822,681,477.00	49.15
产品特有风险							
本基金报告期内有单一持有人持有基金份额超过 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

托管人住所

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

2025 年 8 月 30 日