

# 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 2024 年中期报告

2024 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：2024 年 08 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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 2024 年 8 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
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	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>7</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>11</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	12
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>12</b>
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	14
6.4 报表附注	16
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>38</b>
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
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	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52
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	52

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	52
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	52
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 .....	52
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	52
7.12 投资组合报告附注 .....	53
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>54</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	54
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	54
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	54
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 .....	55
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>55</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>55</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	55
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 .....	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	55
10.4 基金投资策略的改变 .....	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	55
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 .....	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	56
10.8 其他重大事件 .....	60
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>61</b>
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 .....	61
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	61
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>61</b>
12.1 备查文件目录 .....	61
12.2 存放地点 .....	61
12.3 查阅方式 .....	61

## § 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	交易型开放式
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	78,056,394.00 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
	联系电话	021-38601777
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com
客户服务电话	400-888-0001	021-60637228
传真	021-38601799	021-60635778
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	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

	大五道口广场 1 号 17 层	1 号楼
邮政编码	200135	100033
法定代表人	贾波	张金良

## 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 层及基金托管人住所

## 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(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-6,076,746.15
本期利润	897,523.28
加权平均基金份额本期利润	0.0105
本期加权平均净值利润率	1.00%
本期基金份额净值增长率	0.53%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	3,542,561.06
期末可供分配基金份额利润	0.0454
期末基金资产净值	81,598,955.06
期末基金份额净值	1.0454
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	33.13%

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

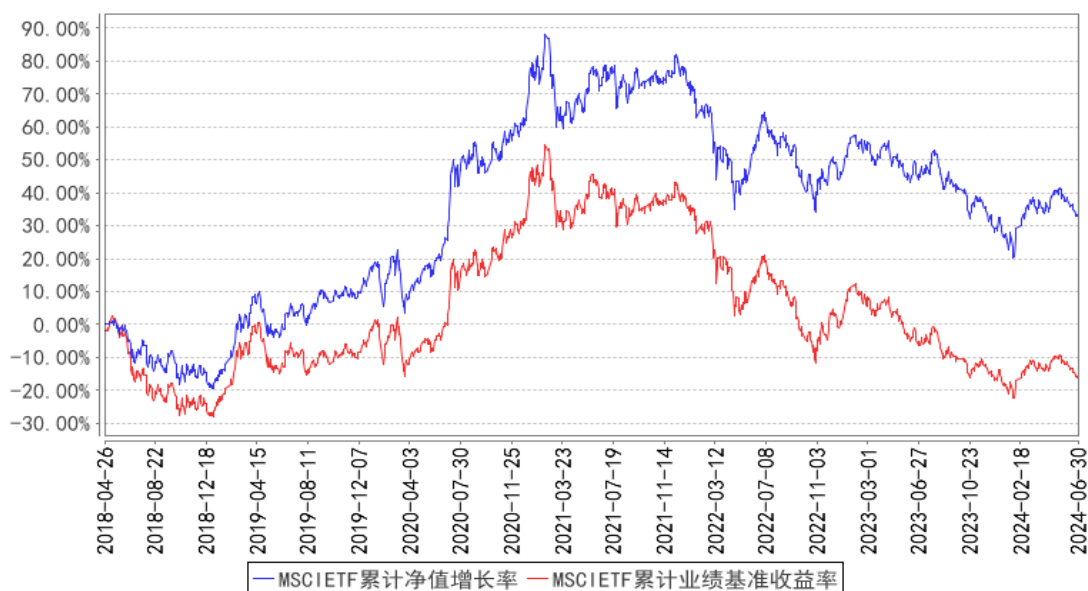
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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

	值增长率①	增长率标准差②	准收益率③	收益率标准差④		
过去一个月	-3.15%	0.51%	-4.17%	0.52%	1.02%	-0.01%
过去三个月	-1.63%	0.78%	-3.13%	0.81%	1.50%	-0.03%
过去六个月	0.53%	0.98%	-2.39%	1.02%	2.92%	-0.04%
过去一年	-8.71%	0.90%	-10.43%	0.99%	1.72%	-0.09%
过去三年	-25.53%	1.03%	-40.95%	1.19%	15.42%	-0.16%
自基金合同生效起至今	33.13%	1.20%	-15.84%	1.34%	48.97%	-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

MSCIETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：图示日期为 2018 年 4 月 26 日至 2024 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%。截至 2024 年 6 月 30 日，公司旗下管理 156 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		
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。
柳军	总经理助理、指数投资部总监、本基金的基金经理	2018年4月26日	-	23年	复旦大学财务管理硕士，2000-2001年任上海汽车集团财务有限公司财务，2001-2004年任华安基金管理有限公司高级基金核算员，2004年7月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任基金事务部总监、上证红利ETF基金经理助理。2009年6月起任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



					<p>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。2021年7月至2023年8月任华泰柏瑞中证沪港深创新药产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021年8月至2023年12月任华泰柏瑞中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021年12月起任华泰柏瑞中证500增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022年8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联接基金(QDII)的基金经理。2022年11月起任华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023年3月起任华泰柏瑞纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金(QDII)的基金经理。2023年9月起任华泰柏瑞中证2000交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023年10月起任华泰柏瑞中证A股交易型开放式指数证券投资基金基金经理。</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：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 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。

### 4.3 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

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内的公平交易模块，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。

#### 4.3.2 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 3 次，都为指数投资组合因跟踪指数需要而发生的反向交易。

### 4.4 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

2024 年上半年市场以结构性机会为主，其中银行、煤炭、公用事业、家用电器的表现相对较好，涨跌幅分别为 17.02%、11.96%、11.76% 和 8.48%。整体来看，沪深 300、中证 500、中证 1000 和创业板指的涨跌幅分别为 0.89%、-8.96%、-16.84% 和 -10.99%。从市场风格来看，期间沪深 300 价值指数和沪深 300 成长指数的涨跌幅分别为 12.54% 和 -7.00%，中证 500 价值相对中证 500 成长获得了超额收益。

2024 年上半年，市场呈现先扬后抑，二季度回调较大。随着积极政策的陆续出台，市场情绪显著提振，市场已经逐渐从过度悲观的预期中走出。基本面方面，制造业投资保持一定韧性，设备更新、新质生产力等对制造业投资持续助力。全球制造业回暖，外需延续向好或有利于我国出口。

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 0.032%，期间日跟踪误差为 0.044%，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 1.0454 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.53%，同期业绩比较基准收益率为 -2.39%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，进入中报业绩披露期与政策关键窗口期，市场将受到上市公司业绩与改革力度预期的共振影响，同时也受到海外流动性对市场的扰动，可能更多呈现震荡行情，建议寻找结构性机会。中期来看，在中国经济迎来新一轮盈利周期、中美经济周期错位进入下半场等利好因素作用下，中国资产有望实现相对收益，在历经修复后市场整体估值仍在偏低水平，与全球市场相比 A 股市场的估值比较具有吸引力，建议寻找结构性机会。

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

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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，本基金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，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

### 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：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	2,617,686.64	1,935,272.31
结算备付金		3,992,724.61	4,001,927.54
存出保证金		730,335.73	758,054.21
交易性金融资产	6.4.7.2	74,436,802.70	90,275,233.56
其中：股票投资		74,436,802.70	90,275,233.56
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		856.01	14,737.48
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		81,778,405.69	96,985,225.10
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2023 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
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		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		10,242.45	12,262.83
应付托管费		3,414.16	4,087.61
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	165,794.02	195,273.80
负债合计		179,450.63	211,624.24
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	78,056,394.00	93,056,394.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	3,542,561.06	3,717,206.86
净资产合计		81,598,955.06	96,773,600.86
负债和净资产总计		81,778,405.69	96,985,225.10

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0454 元，基金份额总额 78,056,394.00 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		1,279,366.95	22,286,491.48
1. 利息收入		36,189.91	63,539.48
其中：存款利息收入	6.4.7.13	36,189.91	63,539.48
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）		-5,742,947.14	-17,854,741.56
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-6,729,782.20	-18,709,147.84
基金投资收益		-	-

债券投资收益	6.4.7.15	1,984.77	17,060.14
资产支持证券投资 收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	33,352.37	197,934.15
股利收益	6.4.7.19	951,497.92	639,411.99
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）	6.4.7.20	6,974,269.43	40,223,609.33
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.21	11,854.75	-145,915.77
<b>减：二、营业总支出</b>		381,843.67	352,700.25
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	66,881.48	157,048.88
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	22,293.86	52,349.66
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
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	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		703.51	1,501.90
8. 其他费用	6.4.7.23	291,964.82	141,799.81
<b>三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）</b>		897,523.28	21,933,791.23
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-” 号填列）</b>		897,523.28	21,933,791.23
<b>五、其他综合收益的税后 净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		897,523.28	21,933,791.23

### 6.3 净资产变动表

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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期
	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	93,056,394.00	-	3,717,206.86	96,773,600.86
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	93,056,394.00	-	3,717,206.86	96,773,600.86
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-15,000,000.00	-	-174,645.80	-15,174,645.80
(一)、综合收益总额	-	-	897,523.28	897,523.28
(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)	-15,000,000.00	-	-1,072,169.08	-16,072,169.08
其中：1. 基金申购款	3,000,000.00	-	152,736.64	3,152,736.64
2. 基金赎回款	-18,000,000.00	-	-1,224,905.72	-19,224,905.72
(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	78,056,394.00	-	3,542,561.06	81,598,955.06
项目	上年度可比期间			
	2023年1月1日至2023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	453,056,394.00	-	66,396,653.76	519,453,047.76
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	453,056,394.00	-	66,396,653.76	519,453,047.76
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-357,000,000.00	-	-52,460,408.64	-409,460,408.64
(一)、综合收益总额	-	-	21,933,791.23	21,933,791.23
(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)	-357,000,000.00	-	-74,394,199.87	-431,394,199.87
其中：1. 基金申购款	3,000,000.00	-	561,428.73	3,561,428.73
2. 基金赎回款	-360,000,000.00	-	-74,955,628.60	-434,955,628.60
(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	96,056,394.00	-	13,936,245.12	109,992,639.12

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 2024 年 8 月 31 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、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、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 2024 年 01 月 01 日至 2024 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 2024 年 06 月 30 日的财务状况以及 2024 年 01 月 01 日至 2024 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[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 日前取得的基金、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基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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。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。

(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 2024 年 6 月 30 日
----	------------------------

活期存款	2,617,686.64
等于：本金	2,617,442.96
加：应计利息	243.68
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	2,617,686.64

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	87,574,971.56	-	74,436,802.70	-13,138,168.86
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	87,574,971.56	-	74,436,802.70	-13,138,168.86

#### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生 工具	-	-	-	
货币衍生 工具	-	-	-	

权益衍生工具	6,187,140.00	-	-	-
其中：股指期货投资	6,187,140.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	6,187,140.00	-	-	-

#### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2409	中证 500 股指期货 2409	2.00	1,950,080.00	-70,600.00
IF2409	沪深 300 股指期货 2409	4.00	4,108,320.00	-58,140.00
合计				-128,740.00
减：可抵销期货暂收款				-128,740.00
净额				0.00

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

#### 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

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024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	5,397.92
其中：交易所市场	5,397.92
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	160,396.10
合计	165,794.02

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	93,056,394.00	93,056,394.00
本期申购	3,000,000.00	3,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-18,000,000.00	-18,000,000.00
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	78,056,394.00	78,056,394.00

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	12,151,867.44	-8,434,660.58	3,717,206.86
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	12,151,867.44	-8,434,660.58	3,717,206.86
本期利润	-6,076,746.15	6,974,269.43	897,523.28
本期基金份额交易产生的变动数	-1,457,002.63	384,833.55	-1,072,169.08
其中：基金申购款	261,388.41	-108,651.77	152,736.64
基金赎回款	-1,718,391.04	493,485.32	-1,224,905.72
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,618,118.66	-1,075,557.60	3,542,561.06

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	3,612.50
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	32,560.87
其他	16.54
合计	36,189.91

#### 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 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-5,627,949.01
股票投资收益——赎回差价收入	-1,101,833.19
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	-6,729,782.20
----	---------------

#### 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
	2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	11,258,948.66
减：卖出股票成本总额	16,868,634.98
减：交易费用	18,262.69
买卖股票差价收入	-5,627,949.01

#### 6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
赎回基金份额对价总额	19,224,905.72
减：现金支付赎回款总额	7,422,161.72
减：赎回股票成本总额	12,904,577.19
减：交易费用	-
赎回差价收入	-1,101,833.19

#### 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 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	0.75
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,984.02
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	1,984.77

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----



	2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	6,985.05
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	5,000.00
减：应计利息总额	0.75
减：交易费用	0.28
买卖债券差价收入	1,984.02

#### 6.4.7.15.3 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。

#### 6.4.7.15.4 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。

#### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

##### 6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

##### 6.4.7.16.3 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。

##### 6.4.7.16.4 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。

#### 6.4.7.17 贵金属投资收益

##### 6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

##### 6.4.7.17.2 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。

##### 6.4.7.17.3 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。

##### 6.4.7.17.4 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。

## 6.4.7.18 衍生工具收益

## 6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

## 6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股指期货投资收益	33,352.37

## 6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	951,497.92
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	951,497.92

## 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	7,100,489.43
股票投资	7,100,489.43
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	-126,220.00
权证投资	-
期货投资	-126,220.00
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	6,974,269.43

## 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	11,854.75

合计	11,854.75
----	-----------

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。

#### 6.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期内无信用减值损失。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	29,835.26
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
指数使用费	202,282.22
银行划款手续费	175.00
合计	291,964.82

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

#### 6.4.7.24 分部报告

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

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华泰柏瑞基金管理有限公司（“华泰柏瑞基金”）	基金管理人、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
华泰证券股份有限公司（“华泰证券”）	基金管理人的股东、申购赎回代理券商、基金销售机构
华泰联合证券有限责任公司（“华泰联合证券”）	基金管理人的股东华泰证券的控股子公司
华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“华泰柏瑞 MSCIETF 联接基金”）	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	5,036,176.86	36.62	5,855,981.18	22.60

#### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	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 成交总额的比例 (%)
华泰证券	4,807.20	68.82	7,962.57	10.03

#### 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均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 6.4.10.1.4 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。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024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	2,890.07	26.00	1,598.97	32.52
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	42,899.13	37.44	4,013.07	23.90

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（截至2024年6月30日）。

#### 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 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	66,881.48
其中：应支付销售机构的客户维护 费	2,629.73	3,606.96
应支付基金管理人的净管理费	64,251.75	153,441.92

注：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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当年天数}。$$

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
	当期发生的基金应支付的托管费	22,293.86

注：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。

#### 6.4.10.3 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自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 2024年6月30日		上年度末 2023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	13,536,741.00	17.3423	15,710,141.00	16.8824
华泰证券股份 有限公司	641,921.00	0.8224	1,359,450.00	1.4609

#### 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 2024年1月1日至2024年6月30 日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	2,617,686.64	3,612.50	4,299,982.39	8,949.66

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行股份有限公司保管，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 2024年1月1日至2024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： 股/张）	总金额
-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2023年1月1日至2023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： 股/张）	总金额
华泰联合证券	301408.SZ	华人健康	网下申购	2,889	46,917.36
华泰联合证券	603291.SH	联合水务	网下申购	536	3,140.96
华泰联合证券	600925.SH	苏能股份	网下申购	8,960	55,372.80
华泰联合证券	603137.SH	恒尚节能	网下申购	916	14,564.40
华泰联合证券	688469.SH	中芯集成	网下申购	14,075	80,086.75
华泰联合证券	688512.SH	慧智微	网下申购	1,982	41,463.44
华泰联合证券	688472.SH	阿特斯	网下申购	4,312	47,863.20
华泰联合证券	688429.SH	时创能源	网下申购	1,294	24,844.80
华泰联合证券	113066.SH	平煤转债	网上配售	90	9,000.00
华泰联合证券	118031.SH	天23转债	网上配售	260	26,000.00
华泰联合证券	601916.SH	浙商银行	网上配售	12,660	25,573.20

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

于2024年6月30日，本基金持有15,000.00股华泰证券的普通股，成本总额为人民币233,321.63元，估值总额为人民币185,850.00元，占基金净资产的比例为0.23%(2023年12月31日：本基金持有18,200股华泰证券的普通股，成本总额为人民币284,306.01元，估值总额为人民币253,890.00元，占基金净资产的比例为0.26%)。

于2024年6月30日，本基金持有19,936.00股建设银行的A股普通股，成本总额为人民币123,033.44元，估值总额为人民币147,526.40元，占基金资产净值的比例为0.18%(2023年12月31日：本基金持有23,436股建设银行的A股普通股，成本总额为人民币143,389.65元，估值总额为人民币152,568.36元，占基金资产净值的比例为0.16%)。

#### 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（2024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：本基金本期末未持有因认购新发/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的流通受限股票。

##### 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，将风险控制可在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国建设银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于 2024 年 6 月 30 日，本基金无债券投资(2023 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 2024 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(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期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2024 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 2024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	2,617,686.64	-	-	-	-	-	2,617,686.64
结算备付金	3,992,724.61	-	-	-	-	-	3,992,724.61
存出保证金	730,335.73	-	-	-	-	-	730,335.73
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-74,436,802.70	74,436,802.70
应收清算款	-	-	-	-	-	856.01	856.01
资产总计	7,340,746.98	-	-	-	-	-74,437,658.71	81,778,405.69
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	10,242.45	10,242.45
应付托管费	-	-	-	-	-	3,414.16	3,414.16
其他负债	-	-	-	-	-	165,794.02	165,794.02
负债总计	-	-	-	-	-	179,450.63	179,450.63
利率敏感度缺口	7,340,746.98	-	-	-	-	-74,258,208.08	81,598,955.06
上年度末 2023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	1,935,272.31	-	-	-	-	-	1,935,272.31
结算备付金	4,001,927.54	-	-	-	-	-	4,001,927.54
存出保证金	1,756.61	-	-	-	-	756,297.60	758,054.21
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-90,275,233.56	90,275,233.56
应收清算款	-	-	-	-	-	14,737.48	14,737.48
资产总计	5,938,956.46	-	-	-	-	-91,046,268.64	96,985,225.10
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	12,262.83	12,262.83
应付托管费	-	-	-	-	-	4,087.61	4,087.61
其他负债	-	-	-	-	-	195,273.80	195,273.80
负债总计	-	-	-	-	-	211,624.24	211,624.24
利率敏感度缺口	5,938,956.46	-	-	-	-	-90,834,644.40	96,773,600.86

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2024年6月30日，本基金未持有交易性债券投资(2023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(2023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 2024年6月30日		上年度末 2023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	74,436,802.70	91.22	90,275,233.56	93.28
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	74,436,802.70	91.22	90,275,233.56	93.28

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资(附注 6.4.7.3)。在当日无负债结算制度下，期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为0。

#### 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(2024年6月30日)	上年度末(2023年12月31日)
	MSCI 中国 A 股国际通指数上升 5%	3,858,588.00	3,783,338.82

	MSCI 中国 A 股国际 通指数下降 5%	-3,858,588.00	-3,783,338.82
--	---------------------------	---------------	---------------

#### 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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	74,436,802.70	90,162,043.69
第二层次	-	-
第三层次	-	113,189.87
合计	74,436,802.70	90,275,233.56

###### 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 2024 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（2023 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

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	74,436,802.70	91.02
	其中：股票	74,436,802.70	91.02
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	6,610,411.25	8.08
8	其他各项资产	731,191.74	0.89
9	合计	81,778,405.69	100.00

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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	811,370.20	0.99
B	采矿业	4,895,592.06	6.00
C	制造业	39,767,967.44	48.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,925,565.76	4.81
E	建筑业	1,571,269.00	1.93
F	批发和零售业	486,174.00	0.60
G	交通运输、仓储和邮政业	3,127,153.99	3.83
H	住宿和餐饮业	41,364.00	0.05
I	信息传输、软件和	2,706,264.73	3.32

	信息技术服务业		
J	金融业	14,936,365.16	18.30
K	房地产业	702,580.19	0.86
L	租赁和商务服务业	571,906.03	0.70
M	科学研究和技术服务业	305,511.90	0.37
N	水利、环境和公共设施管理业	73,676.40	0.09
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	227,573.44	0.28
R	文化、体育和娱乐业	242,820.40	0.30
S	综合	43,648.00	0.05
	合计	74,436,802.70	91.22

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

## 7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

## 7.2.3 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

### 7.3.1 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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	2,649	3,887,116.11	4.76
2	300750	宁德时代	9,160	1,649,074.80	2.02
3	600900	长江电力	50,950	1,473,474.00	1.81
4	600036	招商银行	42,954	1,468,597.26	1.80
5	000858	五粮液	8,006	1,025,088.24	1.26
6	002594	比亚迪	3,771	943,692.75	1.16
7	601318	中国平安	22,444	928,283.84	1.14
8	601288	农业银行	177,577	774,235.72	0.95
9	601166	兴业银行	43,282	762,628.84	0.93
10	601138	工业富联	27,600	756,240.00	0.93
11	601899	紫金矿业	42,856	752,979.92	0.92
12	601398	工商银行	131,217	747,936.90	0.92
13	300760	迈瑞医疗	2,500	727,275.00	0.89
14	601328	交通银行	81,864	611,524.08	0.75

15	601088	中国神华	13,700	607,869.00	0.74
16	002475	立讯精密	14,885	585,129.35	0.72
17	601816	京沪高铁	102,400	549,888.00	0.67
18	600809	山西汾酒	2,500	527,200.00	0.65
19	600309	万华化学	6,500	525,590.00	0.64
20	601225	陕西煤业	20,189	520,270.53	0.64
21	600276	恒瑞医药	13,114	504,364.44	0.62
22	600000	浦发银行	61,189	503,585.47	0.62
23	002714	牧原股份	11,358	495,208.80	0.61
24	000333	美的集团	7,200	464,400.00	0.57
25	600030	中信证券	25,469	464,299.87	0.57
26	601857	中国石油	44,983	464,224.56	0.57
27	601668	中国建筑	86,804	460,929.24	0.56
28	000568	泸州老窖	3,087	442,953.63	0.54
29	600028	中国石化	67,630	427,421.60	0.52
30	601985	中国核电	39,300	418,938.00	0.51
31	600406	国电南瑞	16,490	411,590.40	0.50
32	601919	中远海控	26,552	411,290.48	0.50
33	000001	平安银行	40,429	410,354.35	0.50
34	601601	中国太保	14,200	395,612.00	0.48
35	002371	北方华创	1,200	383,868.00	0.47
36	601766	中国中车	50,700	380,757.00	0.47
37	600150	中国船舶	9,300	378,603.00	0.46
38	600690	海尔智家	12,902	366,158.76	0.45
39	002352	顺丰控股	10,167	362,860.23	0.44
40	300059	东方财富	32,922	347,656.32	0.43
41	688041	海光信息	4,820	338,942.40	0.42
42	601988	中国银行	73,195	338,160.90	0.41
43	600887	伊利股份	13,024	336,540.16	0.41
44	603288	海天味业	9,491	327,154.77	0.40
45	000725	京东方 A	77,096	315,322.64	0.39
46	603993	洛阳钼业	36,782	312,647.00	0.38
47	600050	中国联通	66,300	311,610.00	0.38
48	300308	中际旭创	2,240	308,851.20	0.38
49	601658	邮储银行	60,600	307,242.00	0.38
50	601818	光大银行	96,727	306,624.59	0.38
51	600019	宝钢股份	46,070	306,365.50	0.38
52	002142	宁波银行	13,737	303,038.22	0.37
53	601127	赛力斯	3,200	291,584.00	0.36
54	600031	三一重工	17,637	291,010.50	0.36
55	600919	江苏银行	38,279	284,412.97	0.35
56	600016	民生银行	73,956	280,293.24	0.34
57	600886	国投电力	15,300	279,072.00	0.34



58	601390	中国中铁	42,800	279,056.00	0.34
59	300498	温氏股份	13,620	269,948.40	0.33
60	300274	阳光电源	4,340	269,210.20	0.33
61	601006	大秦铁路	36,600	262,056.00	0.32
62	600905	三峡能源	59,700	260,292.00	0.32
63	600989	宝丰能源	15,000	259,950.00	0.32
64	601169	北京银行	44,055	257,281.20	0.32
65	002304	洋河股份	3,100	250,294.00	0.31
66	601888	中国中免	3,999	249,897.51	0.31
67	688111	金山办公	1,098	249,795.00	0.31
68	603501	韦尔股份	2,503	248,723.11	0.30
69	600436	片仔癀	1,200	248,604.00	0.30
70	000063	中兴通讯	8,300	232,151.00	0.28
71	000625	长安汽车	17,192	230,888.56	0.28
72	000338	潍柴动力	14,061	228,350.64	0.28
73	000651	格力电器	5,800	227,476.00	0.28
74	601009	南京银行	21,564	224,049.96	0.27
75	600795	国电电力	37,200	222,828.00	0.27
76	600104	上汽集团	16,029	222,161.94	0.27
77	601012	隆基绿能	15,788	221,347.76	0.27
78	600048	保利发展	24,910	218,211.60	0.27
79	601229	上海银行	29,569	214,670.94	0.26
80	600999	招商证券	15,240	211,988.40	0.26
81	601600	中国铝业	27,500	209,825.00	0.26
82	601211	国泰君安	15,421	208,954.55	0.26
83	688271	联影医疗	1,900	208,430.00	0.26
84	603259	药明康德	5,260	206,139.40	0.25
85	002230	科大讯飞	4,772	204,957.40	0.25
86	600346	恒力石化	14,680	204,786.00	0.25
87	002493	荣盛石化	21,078	203,613.48	0.25
88	000166	申万宏源	47,011	202,617.41	0.25
89	600547	山东黄金	7,391	202,365.58	0.25
90	600893	航发动力	5,505	201,207.75	0.25
91	601669	中国电建	35,847	200,384.73	0.25
92	300015	爱尔眼科	19,417	200,383.44	0.25
93	000792	盐湖股份	11,300	197,185.00	0.24
94	688036	传音控股	2,569	196,631.26	0.24
95	600660	福耀玻璃	4,041	193,563.90	0.24
96	600585	海螺水泥	8,186	193,107.74	0.24
97	002938	鹏鼎控股	4,800	190,848.00	0.23
98	000596	古井贡酒	900	189,963.00	0.23
99	000538	云南白药	3,711	189,817.65	0.23
100	600674	川投能源	10,100	189,375.00	0.23

101	300433	蓝思科技	10,200	186,150.00	0.23
102	601688	华泰证券	15,000	185,850.00	0.23
103	688256	寒武纪	935	185,756.45	0.23
104	600011	华能国际	19,078	183,530.36	0.22
105	688012	中微公司	1,293	182,649.18	0.22
106	002027	分众传媒	30,042	182,054.52	0.22
107	601111	中国国航	24,200	178,596.00	0.22
108	600188	兖矿能源	7,850	178,430.50	0.22
109	601628	中国人寿	5,718	177,543.90	0.22
110	600015	华夏银行	27,577	176,492.80	0.22
111	000425	徐工机械	24,600	175,890.00	0.22
112	600438	通威股份	9,100	173,901.00	0.21
113	601066	中信建投	9,000	173,160.00	0.21
114	600837	海通证券	20,054	171,662.24	0.21
115	000100	TCL 科技	39,134	169,058.88	0.21
116	300014	亿纬锂能	4,225	168,662.00	0.21
117	000895	双汇发展	7,037	167,269.49	0.20
118	001979	招商蛇口	18,858	165,761.82	0.20
119	600023	浙能电力	23,300	165,663.00	0.20
120	002311	海大集团	3,500	164,675.00	0.20
121	601881	中国银河	15,100	163,986.00	0.20
122	600926	杭州银行	12,302	160,541.10	0.20
123	003816	中国广核	32,800	151,864.00	0.19
124	601995	中金公司	5,000	148,050.00	0.18
125	300502	新易盛	1,400	147,770.00	0.18
126	601939	建设银行	19,936	147,526.40	0.18
127	000776	广发证券	12,066	146,843.22	0.18
128	600489	中金黄金	9,900	146,520.00	0.18
129	002463	沪电股份	3,960	144,540.00	0.18
130	600089	特变电工	10,340	143,415.80	0.18
131	601868	中国能建	67,600	143,312.00	0.18
132	603392	万泰生物	2,172	143,091.36	0.18
133	601872	招商轮船	16,900	142,805.00	0.18
134	600115	中国东航	35,610	142,796.10	0.17
135	600845	宝信软件	4,439	141,737.27	0.17
136	300124	汇川技术	2,750	141,075.00	0.17
137	000002	万 科 A	20,269	140,464.17	0.17
138	688169	石头科技	357	140,158.20	0.17
139	300122	智飞生物	4,950	138,748.50	0.17
140	688008	澜起科技	2,415	138,041.40	0.17
141	600029	南方航空	23,400	137,826.00	0.17
142	002241	歌尔股份	6,952	135,633.52	0.17
143	600160	巨化股份	5,600	135,128.00	0.17

144	601825	沪农商行	20,100	135,072.00	0.17
145	000938	紫光股份	5,936	132,669.60	0.16
146	601901	方正证券	17,100	132,183.00	0.16
147	601100	恒立液压	2,828	131,728.24	0.16
148	605499	东鹏饮料	600	129,450.00	0.16
149	600010	包钢股份	92,244	129,141.60	0.16
150	601633	长城汽车	5,096	128,928.80	0.16
151	603986	兆易创新	1,336	127,748.32	0.16
152	600111	北方稀土	7,367	126,712.40	0.16
153	601336	新华保险	4,200	126,126.00	0.15
154	300033	同花顺	1,200	124,440.00	0.15
155	601916	浙商银行	44,860	123,813.60	0.15
156	002648	卫星化学	6,874	123,594.52	0.15
157	688223	晶科能源	17,385	123,433.50	0.15
158	601689	拓普集团	2,300	123,303.00	0.15
159	600027	华电国际	17,700	122,838.00	0.15
160	002916	深南电路	1,160	122,693.20	0.15
161	000983	山西焦煤	11,802	121,678.62	0.15
162	300896	爱美客	700	120,470.00	0.15
163	603369	今世缘	2,600	120,120.00	0.15
164	600703	三安光电	10,200	119,544.00	0.15
165	600039	四川路桥	15,119	119,288.91	0.15
166	600066	宇通客车	4,600	118,680.00	0.15
167	002001	新和成	6,152	118,118.40	0.14
168	600584	长电科技	3,700	117,327.00	0.14
169	601838	成都银行	7,700	116,963.00	0.14
170	601788	光大证券	8,000	116,960.00	0.14
171	600958	东方证券	15,295	116,242.00	0.14
172	002736	国信证券	13,325	115,794.25	0.14
173	601618	中国中冶	37,200	115,320.00	0.14
174	601360	三六零	14,900	114,432.00	0.14
175	300408	三环集团	3,900	113,841.00	0.14
176	600426	华鲁恒升	4,260	113,486.40	0.14
177	603195	公牛集团	1,450	111,824.00	0.14
178	001965	招商公路	9,400	111,484.00	0.14
179	000157	中联重科	14,510	111,436.80	0.14
180	600026	中远海能	7,100	110,831.00	0.14
181	600085	同仁堂	2,900	110,809.00	0.14
182	600803	新奥股份	5,300	110,240.00	0.14
183	000977	浪潮信息	3,028	110,128.36	0.13
184	601607	上海医药	5,760	110,073.60	0.13
185	600233	圆通速递	7,000	109,550.00	0.13
186	600522	中天科技	6,900	109,365.00	0.13

187	601699	潞安环能	6,015	109,051.95	0.13
188	000999	华润三九	2,539	108,110.62	0.13
189	300832	新产业	1,600	107,904.00	0.13
190	000301	东方盛虹	13,500	107,595.00	0.13
191	002028	思源电气	1,600	107,040.00	0.13
192	601021	春秋航空	1,900	107,027.00	0.13
193	002252	上海莱士	13,600	106,352.00	0.13
194	600875	东方电气	5,700	105,165.00	0.13
195	601117	中国化学	12,738	104,961.12	0.13
196	688396	华润微	2,800	104,832.00	0.13
197	002920	德赛西威	1,200	104,508.00	0.13
198	002600	领益智造	14,600	103,952.00	0.13
199	000786	北新建材	3,500	103,810.00	0.13
200	600741	华域汽车	6,320	103,521.60	0.13
201	002236	大华股份	6,600	102,036.00	0.13
202	600600	青岛啤酒	1,400	101,878.00	0.12
203	601567	三星医疗	2,900	101,500.00	0.12
204	601319	中国人保	19,700	101,455.00	0.12
205	600183	生益科技	4,800	101,088.00	0.12
206	000963	华东医药	3,596	100,004.76	0.12
207	600161	天坛生物	4,080	99,552.00	0.12
208	300394	天孚通信	1,120	99,030.40	0.12
209	605117	德业股份	1,326	98,574.84	0.12
210	600362	江西铜业	4,155	98,390.40	0.12
211	601727	上海电气	26,400	97,680.00	0.12
212	002128	电投能源	4,600	97,060.00	0.12
213	000617	中油资本	17,500	96,600.00	0.12
214	002460	赣锋锂业	3,353	96,063.45	0.12
215	000807	云铝股份	7,100	95,921.00	0.12
216	000630	铜陵有色	26,400	95,304.00	0.12
217	300628	亿联网络	2,590	95,234.30	0.12
218	601058	赛轮轮胎	6,800	95,200.00	0.12
219	002422	科伦药业	3,132	94,993.56	0.12
220	000708	中信特钢	7,000	94,990.00	0.12
221	600196	复星医药	4,277	94,692.78	0.12
222	600985	淮北矿业	5,600	93,744.00	0.11
223	600733	北汽蓝谷	11,600	93,728.00	0.11
224	000975	山金国际	5,720	93,178.80	0.11
225	000933	神火股份	4,600	93,058.00	0.11
226	300999	金龙鱼	3,400	92,990.00	0.11
227	600219	南山铝业	24,400	92,964.00	0.11
228	002466	天齐锂业	3,100	92,721.00	0.11
229	600398	海澜之家	10,000	92,400.00	0.11

230	601077	渝农商行	18,400	92,368.00	0.11
231	600256	广汇能源	13,600	91,120.00	0.11
232	601377	兴业证券	17,983	90,993.98	0.11
233	002601	龙佰集团	4,900	90,993.00	0.11
234	300782	卓胜微	1,168	90,800.32	0.11
235	600176	中国巨石	8,194	90,543.70	0.11
236	600221	海航控股	87,900	89,658.00	0.11
237	002049	紫光国微	1,700	89,420.00	0.11
238	688009	中国通号	14,890	89,340.00	0.11
239	600642	申能股份	10,000	88,300.00	0.11
240	601168	西部矿业	4,900	87,955.00	0.11
241	688188	柏楚电子	475	87,661.25	0.11
242	600332	白云山	2,979	87,374.07	0.11
243	601878	浙商证券	7,900	84,688.00	0.10
244	600415	小商品城	11,400	84,588.00	0.10
245	601179	中国西电	10,500	84,420.00	0.10
246	688072	拓荆科技	702	84,317.22	0.10
247	600009	上海机场	2,614	84,301.50	0.10
248	000876	新希望	9,207	84,151.98	0.10
249	600018	上港集团	14,506	83,844.68	0.10
250	300866	安克创新	1,170	83,315.70	0.10
251	300661	圣邦股份	1,002	82,945.56	0.10
252	000661	长春高新	900	82,593.00	0.10
253	600918	中泰证券	14,500	82,215.00	0.10
254	601877	正泰电器	4,300	81,958.00	0.10
255	002078	太阳纸业	5,800	80,910.00	0.10
256	300418	昆仑万维	2,500	80,600.00	0.10
257	600487	亨通光电	5,100	80,427.00	0.10
258	000408	藏格矿业	3,300	79,431.00	0.10
259	688126	沪硅产业	5,750	79,407.50	0.10
260	002180	纳思达	3,000	79,260.00	0.10
261	601238	广汽集团	10,200	78,948.00	0.10
262	000423	东阿阿胶	1,257	78,688.20	0.10
263	601865	福莱特	3,900	78,390.00	0.10
264	601233	桐昆股份	4,900	78,204.00	0.10
265	601991	大唐发电	25,800	77,658.00	0.10
266	300316	晶盛机电	2,700	77,571.00	0.10
267	603799	华友钴业	3,502	77,499.26	0.09
268	002532	天山铝业	9,500	77,045.00	0.09
269	300413	芒果超媒	3,660	76,494.00	0.09
270	600061	国投资本	13,400	75,710.00	0.09
271	688303	大全能源	3,710	75,646.90	0.09
272	688599	天合光能	4,468	75,598.56	0.09

273	300751	迈为股份	632	75,511.36	0.09
274	002459	晶澳科技	6,716	75,219.20	0.09
275	002223	鱼跃医疗	2,000	75,200.00	0.09
276	603198	迎驾贡酒	1,300	74,750.00	0.09
277	600515	海南机场	23,800	74,732.00	0.09
278	603806	福斯特	5,081	74,690.70	0.09
279	002625	光启技术	4,300	74,605.00	0.09
280	688187	时代电气	1,510	74,563.80	0.09
281	002384	东山精密	3,600	74,520.00	0.09
282	300765	新诺威	2,940	74,176.20	0.09
283	600096	云天化	3,800	73,796.00	0.09
284	603568	伟明环保	3,580	73,676.40	0.09
285	002353	杰瑞股份	2,100	73,668.00	0.09
286	600745	闻泰科技	2,600	73,450.00	0.09
287	600348	华阳股份	7,350	73,206.00	0.09
288	002064	华峰化学	10,200	73,134.00	0.09
289	002129	TCL 中环	8,350	72,227.50	0.09
290	300442	润泽科技	3,000	71,850.00	0.09
291	002156	通富微电	3,200	71,648.00	0.09
292	002074	国轩高科	3,700	70,855.00	0.09
293	000027	深圳能源	9,698	70,795.40	0.09
294	002050	三花智控	3,700	70,596.00	0.09
295	603260	合盛硅业	1,500	70,065.00	0.09
296	600418	江淮汽车	4,400	69,696.00	0.09
297	600588	用友网络	6,964	69,640.00	0.09
298	688777	中控技术	1,833	69,104.10	0.08
299	603160	汇顶科技	1,000	68,750.00	0.08
300	603606	东方电缆	1,400	68,334.00	0.08
301	601577	长沙银行	8,300	67,894.00	0.08
302	601958	金钼股份	6,500	67,665.00	0.08
303	601799	星宇股份	600	67,224.00	0.08
304	600177	雅戈尔	9,400	66,928.00	0.08
305	002340	格林美	10,500	66,885.00	0.08
306	600060	海信视像	2,700	66,798.00	0.08
307	600970	中材国际	5,500	66,330.00	0.08
308	002709	天赐材料	3,760	66,025.60	0.08
309	600570	恒生电子	3,716	65,624.56	0.08
310	301236	软通动力	1,850	65,138.50	0.08
311	601216	君正集团	17,600	64,944.00	0.08
312	603338	浙江鼎力	1,060	64,045.20	0.08
313	000932	华菱钢铁	14,400	63,792.00	0.08
314	600282	南钢股份	12,800	63,744.00	0.08
315	002409	雅克科技	1,000	62,910.00	0.08

316	601108	财通证券	9,510	62,861.10	0.08
317	600132	重庆啤酒	1,024	62,156.80	0.08
318	600038	中直股份	1,500	61,665.00	0.08
319	301269	华大九天	800	61,640.00	0.08
320	002294	信立泰	2,307	61,435.41	0.08
321	603486	科沃斯	1,300	61,334.00	0.08
322	600460	士兰微	3,500	61,285.00	0.08
323	000921	海信家电	1,900	61,256.00	0.08
324	600873	梅花生物	6,100	61,122.00	0.07
325	601231	环旭电子	3,800	60,990.00	0.07
326	603659	璞泰来	4,316	60,985.08	0.07
327	300223	北京君正	1,100	60,984.00	0.07
328	688120	华海清科	320	60,665.60	0.07
329	603979	金诚信	1,200	60,636.00	0.07
330	002812	恩捷股份	1,900	60,135.00	0.07
331	002032	苏泊尔	1,200	60,120.00	0.07
332	603939	益丰药房	2,448	60,098.40	0.07
333	603833	欧派家居	1,120	59,987.20	0.07
334	688065	凯赛生物	1,320	59,914.80	0.07
335	000988	华工科技	2,000	59,860.00	0.07
336	002007	华兰生物	3,790	59,844.10	0.07
337	002281	光迅科技	1,600	59,792.00	0.07
338	601555	东吴证券	10,125	59,737.50	0.07
339	002444	巨星科技	2,400	59,280.00	0.07
340	600582	天地科技	8,600	59,254.00	0.07
341	600895	张江高科	3,200	59,136.00	0.07
342	688099	晶晨股份	990	58,726.80	0.07
343	002555	三七互娱	4,500	58,725.00	0.07
344	600079	人福医药	3,400	58,378.00	0.07
345	601990	南京证券	7,600	58,368.00	0.07
346	300919	中伟股份	1,880	58,261.20	0.07
347	002085	万丰奥威	4,400	58,256.00	0.07
348	600968	海油发展	14,100	58,092.00	0.07
349	300759	康龙化成	3,125	58,062.50	0.07
350	300003	乐普医疗	3,900	57,876.00	0.07
351	002673	西部证券	9,300	57,567.00	0.07
352	600109	国金证券	7,600	57,380.00	0.07
353	600021	上海电力	5,800	57,362.00	0.07
354	002595	豪迈科技	1,500	57,255.00	0.07
355	600988	赤峰黄金	3,500	57,190.00	0.07
356	601666	平煤股份	5,100	57,120.00	0.07
357	600566	济川药业	1,800	57,078.00	0.07
358	600546	山煤国际	3,900	57,018.00	0.07

359	601928	凤凰传媒	5,200	56,992.00	0.07
360	601966	玲珑轮胎	3,100	56,947.00	0.07
361	000066	中国长城	6,500	56,875.00	0.07
362	688363	华熙生物	1,004	56,796.28	0.07
363	603899	晨光股份	1,800	56,304.00	0.07
364	002966	苏州银行	7,500	56,250.00	0.07
365	600352	浙江龙盛	6,500	55,835.00	0.07
366	002939	长城证券	8,300	55,610.00	0.07
367	000783	长江证券	11,500	55,545.00	0.07
368	600497	驰宏锌锗	10,400	55,536.00	0.07
369	600153	建发股份	6,200	55,366.00	0.07
370	603156	养元饮品	2,600	55,302.00	0.07
371	603658	安图生物	1,200	55,284.00	0.07
372	000728	国元证券	9,040	54,782.40	0.07
373	300207	欣旺达	3,600	54,612.00	0.07
374	600583	海油工程	9,200	54,372.00	0.07
375	002603	以岭药业	3,540	54,268.20	0.07
376	688728	格科微	4,477	54,216.47	0.07
377	000738	航发控制	2,700	54,189.00	0.07
378	002152	广电运通	5,100	53,346.00	0.07
379	600157	永泰能源	45,200	53,336.00	0.07
380	002465	海格通信	5,148	53,333.28	0.07
381	603893	瑞芯微	900	53,253.00	0.07
382	000703	恒逸石化	7,510	53,245.90	0.07
383	000831	中国稀土	2,100	53,235.00	0.07
384	000683	远兴能源	7,700	53,207.00	0.07
385	002739	万达电影	4,400	53,196.00	0.07
386	601866	中远海发	20,600	53,148.00	0.07
387	600486	扬农化工	940	53,063.00	0.07
388	000960	锡业股份	3,400	52,666.00	0.06
389	002602	世纪华通	15,260	52,341.80	0.06
390	002414	高德红外	8,880	52,303.20	0.06
391	002185	华天科技	6,400	52,160.00	0.06
392	603345	安井食品	700	52,017.00	0.06
393	600521	华海药业	3,050	52,002.50	0.06
394	688122	西部超导	1,355	51,923.60	0.06
395	601696	中银证券	5,700	51,756.00	0.06
396	600549	厦门钨业	3,000	51,750.00	0.06
397	601198	东兴证券	6,494	51,692.24	0.06
398	002456	欧菲光	6,600	51,546.00	0.06
399	000729	燕京啤酒	5,800	51,214.00	0.06
400	600998	九州通	10,443	50,961.84	0.06
401	002372	伟星新材	3,300	50,886.00	0.06



402	603596	伯特利	1,300	50,570.00	0.06
403	000733	振华科技	1,200	49,836.00	0.06
404	300251	光线传媒	5,900	49,619.00	0.06
405	603885	吉祥航空	4,500	49,455.00	0.06
406	600369	西南证券	13,800	49,404.00	0.06
407	603816	顾家家居	1,530	49,403.70	0.06
408	000800	一汽解放	6,300	49,329.00	0.06
409	300146	汤臣倍健	3,600	48,780.00	0.06
410	603589	口子窖	1,237	48,478.03	0.06
411	000629	钒钛股份	19,300	48,250.00	0.06
412	000937	冀中能源	7,200	48,240.00	0.06
413	603290	斯达半导	560	48,221.60	0.06
414	600536	中国软件	1,610	48,171.20	0.06
415	300487	蓝晓科技	1,150	48,024.00	0.06
416	002202	金风科技	7,083	47,597.76	0.06
417	688538	和辉光电	24,000	47,520.00	0.06
418	600298	安琪酵母	1,700	47,481.00	0.06
419	002262	恩华药业	2,000	47,480.00	0.06
420	002821	凯莱英	720	47,376.00	0.06
421	688082	盛美上海	560	47,325.60	0.06
422	601456	国联证券	4,900	47,236.00	0.06
423	601880	辽港股份	38,400	47,232.00	0.06
424	600004	白云机场	4,900	46,452.00	0.06
425	600704	物产中大	10,700	46,438.00	0.06
426	600598	北大荒	3,700	46,213.00	0.06
427	002831	裕同科技	1,800	46,062.00	0.06
428	002120	韵达股份	5,950	46,053.00	0.06
429	603000	人民网	2,300	45,977.00	0.06
430	300496	中科创达	1,000	45,590.00	0.06
431	000009	中国宝安	5,300	45,580.00	0.06
432	300454	深信服	900	45,477.00	0.06
433	002080	中材科技	3,500	45,150.00	0.06
434	002850	科达利	591	45,140.58	0.06
435	000513	丽珠集团	1,200	44,652.00	0.05
436	002430	杭氧股份	2,000	44,500.00	0.05
437	002797	第一创业	8,700	44,283.00	0.05
438	600848	上海临港	4,860	44,274.60	0.05
439	603529	爱玛科技	1,600	43,728.00	0.05
440	600673	东阳光	6,200	43,648.00	0.05
441	300957	贝泰妮	900	43,488.00	0.05
442	300144	宋城演艺	5,380	43,201.40	0.05
443	600511	国药股份	1,400	43,106.00	0.05
444	000987	越秀资本	8,677	43,037.92	0.05

445	600699	均胜电子	2,900	42,978.00	0.05
446	000723	美锦能源	9,000	42,840.00	0.05
447	688114	华大智造	900	42,669.00	0.05
448	600839	四川长虹	9,500	42,655.00	0.05
449	002756	永兴材料	1,190	42,578.20	0.05
450	600637	东方明珠	7,000	42,560.00	0.05
451	002056	横店东磁	3,400	42,398.00	0.05
452	002508	老板电器	1,900	41,990.00	0.05
453	600072	中船科技	3,100	41,912.00	0.05
454	000709	河钢股份	21,529	41,766.26	0.05
455	600779	水井坊	1,100	41,393.00	0.05
456	600754	锦江酒店	1,800	41,364.00	0.05
457	002841	视源股份	1,400	41,342.00	0.05
458	600380	健康元	3,700	41,329.00	0.05
459	300347	泰格医药	850	41,310.00	0.05
460	600655	豫园股份	8,000	41,200.00	0.05
461	002517	恺英网络	4,300	41,065.00	0.05
462	600705	中航产融	18,384	40,812.48	0.05
463	300037	新宙邦	1,420	40,555.20	0.05
464	600378	昊华科技	1,400	40,460.00	0.05
465	000825	太钢不锈	11,900	40,222.00	0.05
466	600977	中国电影	3,700	39,812.00	0.05
467	600170	上海建工	18,500	39,775.00	0.05
468	600702	舍得酒业	700	39,669.00	0.05
469	601162	天风证券	18,000	39,240.00	0.05
470	300699	光威复材	1,560	38,734.80	0.05
471	300142	沃森生物	3,400	38,692.00	0.05
472	600563	法拉电子	500	38,090.00	0.05
473	600884	杉杉股份	4,600	37,352.00	0.05
474	600166	福田汽车	16,600	37,350.00	0.05
475	300601	康泰生物	2,340	36,527.40	0.04
476	300763	锦浪科技	850	35,394.00	0.04
477	603233	大参林	2,398	34,291.40	0.04
478	603688	石英股份	1,150	34,051.50	0.04
479	002738	中矿资源	1,260	33,768.00	0.04
480	603728	鸣志电器	800	32,184.00	0.04
481	002271	东方雨虹	2,600	32,084.00	0.04
482	600732	爱旭股份	3,520	31,856.00	0.04
483	600872	中炬高新	1,400	31,766.00	0.04
484	603077	和邦生物	17,800	29,370.00	0.04
485	603882	金域医学	1,000	27,190.00	0.03

注：自 2024 年 7 月 25 日起，证券代码为 000975 的证券简称由“银泰黄金”变更为“山金国际”。

### 7.3.2 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股票投资明细

注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

### 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	530,792.00	0.55
2	688041	海光信息	163,226.62	0.17
3	300750	宁德时代	131,673.00	0.14
4	001965	招商公路	115,540.00	0.12
5	002594	比亚迪	107,343.00	0.11
6	000708	中信特钢	105,574.00	0.11
7	601567	三星医疗	85,596.00	0.09
8	601881	中国银河	77,887.00	0.08
9	000921	海信家电	77,079.00	0.08
10	603979	金诚信	67,069.00	0.07
11	600282	南钢股份	66,263.00	0.07
12	601666	平煤股份	66,051.00	0.07
13	002085	万丰奥威	65,887.00	0.07
14	688114	华大智造	64,203.38	0.07
15	600582	天地科技	61,102.00	0.06
16	601816	京沪高铁	60,504.00	0.06
17	600968	海油发展	58,818.00	0.06
18	601138	工业富联	49,342.00	0.05
19	600900	长江电力	46,886.00	0.05
20	000858	五粮液	45,900.00	0.05

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	300750	宁德时代	440,367.00	0.46
2	000858	五粮液	281,219.00	0.29
3	002594	比亚迪	247,542.00	0.26
4	300760	迈瑞医疗	177,900.00	0.18
5	002714	牧原股份	128,055.00	0.13
6	000568	泸州老窖	126,182.00	0.13
7	300059	东方财富	109,996.00	0.11
8	000001	平安银行	106,948.00	0.11
9	002475	立讯精密	106,388.00	0.11

10	300308	中际旭创	95,351.00	0.10
11	002352	顺丰控股	90,905.00	0.09
12	000333	美的集团	81,759.00	0.08
13	002142	宁波银行	80,541.00	0.08
14	000725	京东方 A	79,488.00	0.08
15	300498	温氏股份	70,950.00	0.07
16	002304	洋河股份	69,141.00	0.07
17	300274	阳光电源	68,774.00	0.07
18	688111	金山办公	66,780.00	0.07
19	300015	爱尔眼科	64,992.00	0.07
20	688516	奥特维	64,882.50	0.07

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	4,899,790.88
卖出股票收入（成交）总额	11,258,948.66

注：“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

#### 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 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 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 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（601288）在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行（600036）在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。

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。

#### 7.12.2 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。

#### 7.12.3 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	730,335.73
2	应收清算款	856.01
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	731,191.74

#### 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

##### 7.12.5.1 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的前十名股票中不存在流通受限情况。

##### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：截至本报告期末，本基金未持有积极投资的股票。

## 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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 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	
		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 (%)
1,817	42,958.94	6,845,462.00	8.77	57,674,191.00	73.89	13,536,741.00	17.34

### 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	广发证券股份有限公司	3,398,587.00	4.35
2	王丹红	1,172,900.00	1.50
3	林泽斌	1,135,700.00	1.45
4	徐红	1,026,100.00	1.31
5	中国银河证券股份有 限公司	991,600.00	1.27
6	中国国际金融股份有 限公司	950,565.00	1.22
7	宋军	825,000.00	1.06
8	郑晓星	750,000.00	0.96
9	魏宏晓	698,900.00	0.90
10	华泰证券股份有限公 司	641,921.00	0.82
11	华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放 式指数证券投资基金 联接基金	13,536,741.00	17.34

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、基金投资和研发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	93,056,394.00
本报告期基金总申购份额	3,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	18,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	78,056,394.00

### § 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

基金管理人重大人事变动：

2024年1月19日，公司股东会书面决定尹雷先生担任公司独立董事，陆楨女士不再担任公司独立董事。

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 (%)	
中信建投	3	6,180,499.00	38.25	5,784.49	49.88	-
华泰证券	5	5,036,176.86	31.17	2,890.07	24.92	-
方正证券	2	2,405,832.24	14.89	481.30	4.15	-
天风证券	2	2,138,928.47	13.24	2,066.02	17.82	-
国投证券	3	283,126.85	1.75	267.83	2.31	-
粤开证券	1	112,370.00	0.70	105.17	0.91	-
浙商证券	1	1,806.12	0.01	1.71	0.01	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
财达证券	2	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	4	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东方财富证券	2	-	-	-	-	-
东海证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
东亚前海证券	2	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
国元证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
宏信证券	2	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-



华创证券	1	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	2	-	-	-	-	-
金元证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	4	-	-	-	-	-
摩根大通 证券	2	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	2	-	-	-	-	-
世纪证券	2	-	-	-	-	-
首创证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证 券	2	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
诚通证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
野村证券	1	-	-	-	-	-
银泰证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	4	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
中金财富 证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-

注：本报告期内：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，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。

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、本报告期内，无变更租用证券公司交易单元的情况。

### 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	4,807.20	68.82	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	2,177.85	31.18	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
东海证	-	-	-	-	-	-

券						
东吴证 券	-	-	-	-	-	-
东亚前 海证券	-	-	-	-	-	-
东莞证 券	-	-	-	-	-	-
方正证 券	-	-	-	-	-	-
国盛证 券	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
国元证 券	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
恒泰证 券	-	-	-	-	-	-
宏信证 券	-	-	-	-	-	-
华宝证 券	-	-	-	-	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-
华福证 券	-	-	-	-	-	-
华金证 券	-	-	-	-	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-
江海证 券	-	-	-	-	-	-
金元证 券	-	-	-	-	-	-
开源证 券	-	-	-	-	-	-
民生证 券	-	-	-	-	-	-
摩根大 通证券	-	-	-	-	-	-
南京证 券	-	-	-	-	-	-
平安证	-	-	-	-	-	-

券						
山西证 券	-	-	-	-	-	-
世纪证 券	-	-	-	-	-	-
首创证 券	-	-	-	-	-	-
太平洋 证券	-	-	-	-	-	-
西部证 券	-	-	-	-	-	-
西南证 券	-	-	-	-	-	-
诚通证 券	-	-	-	-	-	-
信达证 券	-	-	-	-	-	-
野村证 券	-	-	-	-	-	-
银泰证 券	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-
中航证 券	-	-	-	-	-	-
中金财 富证券	-	-	-	-	-	-
中泰证 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变更网上直销汇款交易业务的收款银行账户的公告	证监会规定报刊和网站	2024年06月25日
2	华泰柏瑞基金管理有限公司关于提醒投资者防范不法分子假冒公司名义从事非法活动的公告	证监会规定报刊和网站	2024年03月29日
3	关于同意广发证券股份有限公司为华泰柏瑞MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金提供主做市服务的公告	证监会规定报刊和网站	2024年03月27日
4	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止和合期货有限公司办理旗下基金相关	证监会规定报刊和网站	2024年02月21日

	业务公告		
5	华泰柏瑞基金管理有限公司关于对营业执照吊销客户采取限制交易措施的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 02 月 01 日
6	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止北京中期时代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	2024 年 01 月 06 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

注：本基金本报告期内未有单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 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 层及托管人住所

### 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

2024 年 8 月 31 日