

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（QDII）  
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 8 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 08 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.....	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
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
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.....	11
4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	11
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
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>13</b>
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
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>14</b>
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
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>42</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	42
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	42
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	42
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.....	44

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	50
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	52
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.....	52
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.....	52
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.....	53
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.....	53
7.11 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.....	55
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>56</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	56
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.....	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	56
10.4 基金投资策略的改变.....	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	56
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.....	58
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>59</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.....	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	60
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>60</b>
12.1 备查文件目录.....	60
12.2 存放地点.....	60
12.3 查阅方式.....	61

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体交易型开放式指数证券投资基金 (QDII)
基金简称	中韩芯片
场内简称	中韩芯片 (扩位证券简称: 中韩半导体 ETF)
基金主代码	513310
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2022 年 11 月 2 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	370,427,000.00 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 12 月 22 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	<p>1、股票（含存托凭证）投资策略</p> <p>本基金采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股（含存托凭证）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（含存托凭证）及其权重的变动进行相应调整。本基金投资于标的指数成份股、备选成份股（含存托凭证）的资产不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。</p> <p>一般情形下，本基金将根据标的指数成份股（含存托凭证）的构成及其权重构建投资组合，但由于交易成本、交易制度、个别成份股（含存托凭证）停牌、流动性不足或者投资受限等原因导致基金无法完成按照指数成份股（含存托凭证）的构成及其权重构建投资组合时，基金管理人将对投资组合进行优化，采取包括成份股（含存托凭证）替代策略在内的其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以更紧密的跟踪标的指数。本基金将根据市场情况，结合经验判断，综合考虑相关性、估值、流动性等因素挑选标的指数中其他成份股或备选成份股（含存托凭证）进行替代，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。</p> <p>在正常情况下，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。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金日均跟踪偏离度和跟踪误差变大，基金管理人应采取合理措施，避免日均跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。</p> <p>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</p>

	<p>跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。</p> <p>2、债券的投资策略</p> <p>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。</p> <p>3、衍生品投资策略</p> <p>为更好的实现投资目标，本基金可投资股指期货、股票期权、国债期货。本基金将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的衍生品合约进行交易。</p> <p>4、资产支持证券的投资策略</p> <p>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。</p> <p>5、融资及转融通证券出借业务</p> <p>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。</p>
业绩比较基准	业绩比较基准为中证韩交所中韩半导体指数收益率。
风险收益特征	<p>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一致。</p> <p>本基金投资于境外证券市场，除了需要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之外，本基金还将面临汇率风险、境外证券市场风险等特殊投资风险。</p>

### 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	王小飞
	联系电话	021-38601777	021-60637103
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	wangxiaofei.zh@ccb.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 1 号楼
邮政编码		200135	100033

法定代表人	贾波	张金良
-------	----	-----

### 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	-	JPMorgan Chase Bank, National Association
	中文	-	摩根大通银行
注册地址		-	1111 Polaris Parkway, Columbus, OH 43240, U.S.A.
办公地址		-	383 Madison Avenue, New York, NY 10179-0001, U.S.A.
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	证券时报
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(2024年1月1日-2024年6月30日)
本期已实现收益	14,710,727.03
本期利润	33,172,006.37
加权平均基金份额本期利润	0.1352
本期加权平均净值利润率	10.86%
本期基金份额净值增长率	9.11%
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	44,727,608.01
期末可供分配基金份额利润	0.1207
期末基金资产净值	499,303,640.94
期末基金份额净值	1.3479
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	34.79%

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。

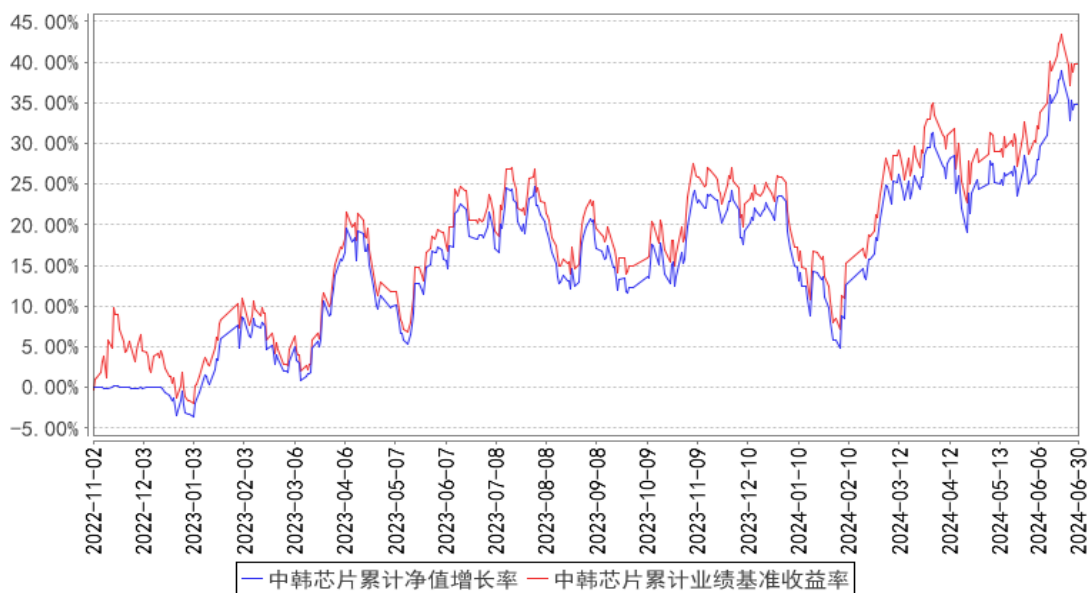
### 3.2 基金净值表现

#### 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	7.79%	1.15%	8.64%	1.20%	-0.85%	-0.05%
过去三个月	4.14%	1.43%	5.08%	1.51%	-0.94%	-0.08%
过去六个月	9.11%	1.46%	11.01%	1.55%	-1.90%	-0.09%
过去一年	13.85%	1.33%	15.97%	1.42%	-2.12%	-0.09%
自基金合同生效起至今	34.79%	1.26%	39.75%	1.42%	-4.96%	-0.16%

#### 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

中韩芯片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 2022 年 11 月 2 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。
李沐阳	指数投资部总监助理、本基金的基金经理	2022 年 11 月 2 日	-	6 年	美国哥伦比亚大学应用统计学硕士。2017 年 8 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、基金经理助理。2021 年 1 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的基金经理。2021 年 3 月起任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 8 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联接基金的基金经理。2022 年 4 月起任华泰柏瑞中证全指电力公用事业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。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 4 月起任华泰柏瑞中证全指电力公用事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 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、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发起式联接基金（QDII）的基金经理。

					<p>2023 年 10 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发起式联接基金 (QDII) 的基金经理。2023 年 11 月起任华泰柏瑞南方东英新交所泛东南亚科技交易型开放式指数证券投资基金 (QDII)、华泰柏瑞中证 2000 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 1 月起任华泰柏瑞南方东英新交所泛东南亚科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 (QDII) 的基金经理。</p>
柳军	<p>总经理助理、指数投资部总监、本基金的基金经理</p>	<p>2022 年 11 月 2 日</p>	-	23 年	<p>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</p>

				<p>年 4 月任华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2020 年 2 月至 2021 年 4 月任华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2020 年 9 月起任华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月起任华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2021 年 5 月起任华泰柏瑞南方东英恒生科技指数交易型开放式指数证券投资基金(QDII)的基金经理。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 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合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及其他相关法律、法规的规定以及本基金的《基

金合同》的约定，在严格控制风险的基础上，忠实履行基金管理职责，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金投资管理符合有关法律、法规的规定及基金合同的约定，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.4 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。

##### 4.4.2 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 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。

#### 4.5 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

2024 年一季度，随着 AI 产业及消费电子产品需求持续大幅推动，伴随半导体景气周期向上，中韩半导体指数整体收阳。韩国半导体成分表现亮眼，主要受 AI 芯片对 HBM 需求高增，存储芯片价格持续上涨，且该类韩国厂商计划继续发力扩大 AI 及半导体产业布局。

二季度，在国家大基金三期成立的增量产业支持推动的大背景下，以及全球 AI 大模型快速更新迭代、HPC 需求高增及端侧应用落地的持续催化，中韩半导体指数收涨，半导体 15、KRX15 指数均收阳。

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 0.022%，期间日跟踪误差为 0.035%，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 1.3479 元，本报告期基金份额净值增长率为 9.11%，业绩比较基准收益率为 11.01%。

#### 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，AI 产业趋势下国产替代空间依然广阔，AI 芯片、产品迭代对算力、存力的需求均有望对指数形成持续支撑，随着各类大模型落地与下游应用场景拓宽，指数表现或会受到进一步提振。

全球半导体产业景气度维持回升，费城半导体指数在报告期内续创新高。中国权重部分，国产替代、关键技术自主可控的演变趋势持续。大基金三期落地等政策面的实质性支持将进一步助力国内半导体产业自主化进程加速推进，同时也使得市场对半导体产业分链的关注进一步提升。韩国权重部分，HBM 投资热度维持高位。存力作为配合 AI 产业链高算力的并行基础，龙头格局相对确定。此外，随着全球各消费电子龙头发力布局，端侧 AI 创新加速落地，应用渗透率未来或将逐步提高，并有望带来更换周期，半导体产业下游格局进一步拓宽，指数权重下游需求基数有一定支撑。未来随着半导体产业继续全球化及国内链演绎，指数权重的相关产业链龙头均有望受到提振。

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。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未进行利润分配。

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

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合规守信、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：华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体交易型开放式指数证券投资基金（QDII）

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	9,651,125.56	13,780,552.54
结算备付金		79,466.51	128,509.92
存出保证金		29,742.72	10,537.69
交易性金融资产	6.4.7.2	495,362,329.59	183,866,852.59
其中：股票投资		495,362,329.59	183,866,852.59
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	39,809.58	-
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		-	1,453.13
应收股利		-	-
应收申购款		-	-

递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	75,409.12	-
资产总计		505,237,883.08	197,787,905.87
<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		-	768,562.57
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	1,959,194.29
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		302,074.15	117,513.21
应付托管费		56,638.93	22,033.74
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	5,575,529.06	438,658.61
负债合计		5,934,242.14	3,305,962.42
<b>净资产:</b>			
实收基金	6.4.7.10	370,427,000.00	157,427,000.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	128,876,640.94	37,054,943.45
净资产合计		499,303,640.94	194,481,943.45
负债和净资产总计		505,237,883.08	197,787,905.87

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.3479 元，基金份额总额 370,427,000.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：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（QDII）

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>		34,797,521.93	20,906,747.47
1. 利息收入		51,372.86	59,249.43
其中：存款利息收入	6.4.7.13	51,372.86	59,249.43
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）		18,622,897.03	7,431,528.48
其中：股票投资收益	6.4.7.14	17,715,529.54	6,393,188.61
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	6.4.7.17	-	-
收益			
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	907,367.49	1,038,339.87
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	18,461,279.34	14,502,296.68
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-1,183,300.91	-586,620.05
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.22	-1,154,726.39	-499,707.07
<b>减：二、营业总支出</b>		1,625,515.56	543,247.64
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,214,417.71	305,942.12
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	227,703.33	57,364.20
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	6.4.7.23	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.24	183,394.52	179,941.32
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		33,172,006.37	20,363,499.83
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		33,172,006.37	20,363,499.83
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		33,172,006.37	20,363,499.83



### 6.3 净资产变动表

会计主体：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（QDII）

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	157,427,000.00	-	37,054,943.45	194,481,943.45
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	157,427,000.00	-	37,054,943.45	194,481,943.45
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	213,000,000.00	-	91,821,697.49	304,821,697.49
（一）、综合收益总额	-	-	33,172,006.37	33,172,006.37
（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）	213,000,000.00	-	58,649,691.12	271,649,691.12
其中：1. 基金申购款	281,000,000.00	-	72,592,370.69	353,592,370.69
2. 基金赎回款	-68,000,000.00	-	-13,942,679.57	-81,942,679.57
（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	370,427,000.00	-	128,876,640.94	499,303,640.94
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	231,427,000.00	-	-7,535,330.56	223,891,669.44
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	231,427,000.00	-	-7,535,330.56	223,891,669.44
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-142,000,000.00	-	23,982,628.76	-118,017,371.24
(一)、综合收益总额	-	-	20,363,499.83	20,363,499.83
(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)	-142,000,000.00	-	3,619,128.93	-138,380,871.07
其中：1. 基金申购款	51,000,000.00	-	9,290,583.76	60,290,583.76
2. 基金赎回款	-193,000,000.00	-	-5,671,454.83	-198,671,454.83
(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	89,427,000.00	-	16,447,298.20	105,874,298.20

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

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

华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体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[2022]2242号《关于准予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(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《华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体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354,427,000.00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0903号验资报告予以验证。经向中国证监会备案《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(QDII)基金合同》于2022年11月2日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为354,427,000.00份基金份额,无认购资金利息折合基金份额。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,境外资产托管人为摩根大通银行(JPMorgan Chase Bank, National Association)。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2022]339号核准,本基金354,427,000.00份基金份额于2022年12月22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《华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体交易型开放式指数证券投资基金(QDII)基金合同》的有关规定,本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股(含存托凭证)。为更好地实现投资目标,本基金还可投资于境外市场和境内市场依法发行的金融工具,其中境外市场投资工具包括在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的跟踪同一标的指数的公募基金(包括开放式基金和交易型开放式指数基金(ETF));已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、存托凭证、房地产信托凭证;政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券;银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具;与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品;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。境内市场投资工具包括国内依法发行或上市的股票(包括主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证)、债券(包括国债、金融债、地方政府债、政府支持机构债券、企业债、公司债、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)、国债期货、股指期货、股票期权、货币市场

工具(包括银行存款、同业存单等)、债券回购、资产支持证券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的相关规定)。本基金的业绩比较基准为中证韩交所中韩半导体指数收益率。

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韩交所中韩半导体交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(QDII)(以下简称“华泰柏瑞中韩半导体 ETF 联接基金(QDII)”)。华泰柏瑞中韩半导体 ETF 联接基金(QDII)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》、《华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体交易型开放式指数证券投资基金(QDII)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[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》及其他相关境内外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) 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。

(4) 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	9,651,125.56
等于：本金	9,650,612.49
加：应计利息	513.07
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	9,651,125.56

注：于 2024 年 06 月 30 日，活期存款包括人民币活期存款 3,397,793.87，韩国元活期存款 947.00 元(折合人民币 4.91 元)和美元活期存款 877,438.23 元(折合人民币 6,253,326.78 元)。

#### 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	463,230,899.59	-	495,362,329.59	32,131,430.00
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	463,230,899.59	-	495,362,329.59	32,131,430.00

#### 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	-	-	-	
其他衍生	-	39,809.58	-	

工具				
合计	-	39,809.58	-	-

**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
----	-----

	2024 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	75,409.12
合计	75,409.12

#### 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	70,623.90
其中：交易所市场	70,623.90
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	96,965.96
应退退补款	5,407,939.20
合计	5,575,529.06

#### 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	157,427,000.00	157,427,000.00
本期申购	281,000,000.00	281,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-68,000,000.00	-68,000,000.00
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	370,427,000.00	370,427,000.00

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	11,880,428.84	25,174,514.61	37,054,943.45



加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	11,880,428.84	25,174,514.61	37,054,943.45
本期利润	14,710,727.03	18,461,279.34	33,172,006.37
本期基金份额交易产生的变动数	18,136,452.14	40,513,238.98	58,649,691.12
其中：基金申购款	23,480,168.44	49,112,202.25	72,592,370.69
基金赎回款	-5,343,716.30	-8,598,963.27	-13,942,679.57
本期已分配利润	-	-	-
本期末	44,727,608.01	84,149,032.93	128,876,640.94

#### 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	38,320.45	
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	12,890.90	
其他	161.51	
合计	51,372.86	

#### 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	17,715,529.54	
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	17,715,529.54	

##### 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	110,643,839.78	
减：卖出股票成本总额	92,483,949.80	
减：交易费用	444,360.44	
买卖股票差价收入	17,715,529.54	

**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	81,942,679.57
减：现金支付赎回款总额	81,942,679.57
减：赎回股票成本总额	-
减：交易费用	-
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 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	907,367.49
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	907,367.49

### 6.4.7.21 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	18,439,544.68
股票投资	18,439,544.68
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	39,809.58
权证投资	39,809.58
3. 其他	-18,074.92

减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	18,461,279.34

#### 6.4.7.22 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	-1,154,726.39
合计	-1,154,726.39

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 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	27,349.14
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
注册登记费	74,590.88
IOPV 计算发布费	-9,507.57
银行划款手续费	31,289.73
合计	183,394.52

#### 6.4.7.25 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
摩根大通银行（“摩根大通银行”）	境外资产托管人
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”）	基金管理人的股东的子公司
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发起式联接基金(QDII)（“华泰柏瑞中韩半导体 ETF 发起式联接基金(QDII)”）	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	794,413.36	0.16	49,256,721.10	19.81

#### 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：本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

### 6.4.10.1.6 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	388.79	0.14	334.72	0.47
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	36,720.41	22.23	6,293.69	34.27

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	1,214,417.71	305,942.12
其中：应支付销售机构的客户维护费	20,902.71	7,789.93
应支付基金管理人的净管理费	1,193,515.00	298,152.19

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 0.80% 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.80\% / \text{当年天数}。$$

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	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	227,703.33	57,364.20

注：支付基金托管人中国建设银行(含境外托管人收取的费用)的托管费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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当年天数}。$$

### 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 (%)

华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(QDII)	41,345,000.00	11.1614	50,115,500.00	31.8341
---	---------------	---------	---------------	---------

#### 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
摩根大通银行	6,253,331.69	24,196.86	1,085,691.78	45,196.15
中国建设银行	3,397,793.87	14,123.59	1,222,076.96	8,642.64

注：本基金由基金托管人中国建设银行和境外资产托管人摩根大通银行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

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
华泰联合证券	688709	成都华微	网下申购	3,552	55730.88
华泰联合证券	603341	龙旗科技	网下申购	1,103	28,678.00
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	603291	联合水务	网下申购	536	3,140.96
华泰联合证券	600925	苏能股份	网下申购	8,512	52,604.16

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

注：本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
603082	北自科技	2024 年 1 月 23 日	6 个月	新股锁定期内	21.28	29.49	82	1,744.96	2,418.18	-
603285	键邦股份	2024 年 6 月 28 日	1 个月内(含)	新股未上市	18.65	18.65	1,287	24,002.55	24,002.55	-
603341	龙旗科技	2024 年 2 月 23 日	6 个月	新股锁定期内	26.00	37.49	111	2,886.00	4,161.39	-
603344	星德胜	2024 年 3 月 13 日	6 个月	新股锁定期内	19.18	22.66	111	2,128.98	2,515.26	-
603350	安乃达	2024 年 6 月 26 日	1 个月内(含)	新股未上市	20.56	20.56	1,051	21,608.56	21,608.56	-
603375	盛景微	2024 年 1 月 17 日	6 个月	新股锁定期内	38.18	38.90	49	1,870.82	1,906.10	-
603381	永臻股份	2024 年 6 月 19 日	6 个月	新股锁定期内	23.35	25.13	170	3,969.50	4,272.10	-
688530	欧莱新材	2024 年 4 月 29 日	6 个月	新股锁定期内	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-
688584	上海合晶	2024 年 2 月 1 日	6 个月	新股锁定期内	22.66	15.89	284	6,435.44	4,512.76	-
688691	灿芯股份	2024 年 4 月 2 日	6 个月	新股锁定期内	19.86	42.51	222	4,408.92	9,437.22	-
688692	达梦数据	2024 年 6 月 4 日	6 个月	新股锁定期内	86.96	174.93	133	11,565.68	23,265.69	-
688695	中创股份	2024 年 3 月 6 日	6 个月	新股锁定期内	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-
688709	成都华微	2024 年 1 月 31 日	6 个月	新股锁定期内	15.69	18.79	356	5,585.64	6,689.24	-
6.4.12.1.4 受限证券类别：权证										

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:份)	期末成本总额	期末估值总额	备注
0673101E	HANA MICRON INC RTS	-	1 个月 内(含)	权证未 上市	-	10.27	3,875	-	39,809.58	-
6.4.12.1.5 受限证券类别：基金										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:份)	期末成本总额	期末估值总额	备注

注：1、根据中国证监会《上市公司证券发行注册管理办法》，基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

2、基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

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

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

#### 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及境外资产托管人摩根大通银行，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 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	9,651,125.56	-	-	-	-	-	9,651,125.56
结算备付金	79,466.51	-	-	-	-	-	79,466.51
存出保证金	29,742.72	-	-	-	-	-	29,742.72
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-495,362,329.59	495,362,329.59
衍生金融资产	-	-	-	-	-	39,809.58	39,809.58
其他资产	-	-	-	-	-	75,409.12	75,409.12
资产总计	9,760,334.79	-	-	-	-	-495,477,548.29	505,237,883.08
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	302,074.15	302,074.15
应付托管费	-	-	-	-	-	56,638.93	56,638.93
其他负债	-	-	-	-	-	5,575,529.06	5,575,529.06
负债总计	-	-	-	-	-	5,934,242.14	5,934,242.14
利率敏感度缺口	9,760,334.79	-	-	-	-	-489,543,306.15	499,303,640.94
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	13,780,552.54	-	-	-	-	-	13,780,552.54
结算备付金	128,509.92	-	-	-	-	-	128,509.92
存出保证金	10,537.69	-	-	-	-	-	10,537.69
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-183,866,852.59	183,866,852.59

应收清算款	-	-	-	-	1,453.13	1,453.13
资产总计	13,919,600.15	-	-	-	-183,868,305.72	197,787,905.87
负债						
交易性金融负债	-	-	-	-	768,562.57	768,562.57
应付管理人报酬	-	-	-	-	117,513.21	117,513.21
应付托管费	-	-	-	-	22,033.74	22,033.74
应付清算款	-	-	-	-	1,959,194.29	1,959,194.29
其他负债	-	-	-	-	438,658.61	438,658.61
负债总计	-	-	-	-	3,305,962.42	3,305,962.42
利率敏感度缺口	13,919,600.15	-	-	-	-180,562,343.30	194,481,943.45

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 2024 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
货币资金	6,253,326 .78	-	4.91	6,253,331.69
交易性金融资 产	-	-	249,666,059.05	249,666,059.05
衍生金融资产	-	-	39,809.58	39,809.58
资产合计	6,253,326 .78	-	249,705,873.54	255,959,200.32
以外币计价的 负债				

负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 外汇风险敞口净 额	6,253,326 .78	-	249,705,873.54	255,959,200.32
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民 币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
货币资金	2,785,744 .19	-	4.97	2,785,749.16
交易性金融资 产	-	-	95,275,995.25	95,275,995.25
资产合计	2,785,744 .19	-	95,276,000.22	98,061,744.41
以外币计价的 负债				
应付清算款	-	-	1,959,194.29	1,959,194.29
负债合计	-	-	1,959,194.29	1,959,194.29
资产负债表外 外汇风险敞口净 额	2,785,744 .19	-	93,316,805.93	96,102,550.12

#### 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（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	所有外币相对人民 币升值 5%	12,797,960.02	4,805,127.51
	所有外币相对人民 币贬值 5%	-12,797,960.02	-4,805,127.51

#### 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	495,362,329.59	99.21	183,866,852.59	94.54
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	39,809.58	0.01	-	-
其他	-	-	-768,562.57	-0.40
合计	495,402,139.17	99.22	183,098,290.02	94.15

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证韩交所中韩半导体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）
	中证韩交所中韩半导体指数上升5%	23,123,940.02	8,436,457.37
中证韩交所中韩半导体指数下降5%	-23,123,940.02	-8,436,457.37	



## 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	495,246,133.84	183,866,852.59
第二层次	85,420.69	-
第三层次	70,584.64	-
合计	495,402,139.17	183,866,852.59

#### 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	495,362,329.59	98.05
	其中：普通股	495,362,329.59	98.05
	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	39,809.58	0.01
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	39,809.58	0.01
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	9,730,592.07	1.93
8	其他各项资产	105,151.84	0.02
9	合计	505,237,883.08	100.00

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

#### 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 (%)
韩国	249,666,059.05	50.00
中国	245,696,270.54	49.21
合计	495,362,329.59	99.21

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

#### 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 (%)
------	------	---------------

境内股票投资组合分类：	-	-
农、林、牧、渔业	-	-
采矿业	-	-
制造业	226,244,707.51	45.31
电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
建筑业	-	-
批发和零售业	-	-
交通运输、仓储和邮政业	-	-
住宿和餐饮业	-	-
信息传输、软件和信息技术服务业	19,335,367.28	3.87
金融业	-	-
房地产业	-	-
租赁和商务服务业	-	-
科学研究和技术服务业	-	-
水利、环境和公共设施管理业	-	-
居民服务、修理和其他服务业	-	-
教育	-	-
卫生和社会工作	-	-
文化、体育和娱乐业	-	-
综合	-	-
境外股票投资组合分类：	-	-
通信服务	-	-
非必需消费品	-	-
必需消费品	-	-
能源	-	-
金融	-	-
医疗保健	-	-
工业	3,952,680.75	0.79
原材料	-	-
房地产	-	-
信息科技	245,713,378.30	49.21
公共事业	-	-
合计	495,246,133.84	99.19

注：1. 上述股票价值不包括可退替代估增。

2. 境外股票投资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

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(%)
境内股票投资组合分类：	-	-
农、林、牧、渔业	-	-
采矿业	-	-
制造业	77,624.54	0.02
电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-

建筑业	-	-
批发和零售业	-	-
交通运输、仓储和邮政业	-	-
住宿和餐饮业	-	-
信息传输、软件和信息技术服务业	38,571.21	0.01
金融业	-	-
房地产业	-	-
租赁和商务服务业	-	-
科学研究和技术服务业	-	-
水利、环境和公共设施管理业	-	-
居民服务、修理和其他服务业	-	-
教育	-	-
卫生和社会工作	-	-
文化、体育和娱乐业	-	-
综合	-	-
境外股票投资组合分类：	-	-
通信服务	-	-
非必需消费品	-	-
必需消费品	-	-
能源	-	-
金融	-	-
医疗保健	-	-
工业	-	-
原材料	-	-
房地产	-	-
信息科技	-	-
公共事业	-	-
合计	116,195.75	0.02

注：上述股票价值不包括可退替代估增。

#### 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	SAMSUNG ELECTRO NICS CO LTD	三星电子有限公司	005930 KS	韩国证券交易所	韩国	172,657	73,011,702.90	14.62
2	SK HYNIX INC	SK海力士株式会社	000660 KS	韩国证券交易所	韩国	52,683	64,647,587.30	12.95
3	NAURA	北方华创	002371	深圳证券	中国	105,859	33,863,235.51	6.78

	Techn ology Group Co.,Ltd .		SZ	交易所				
4	Semicon ductor Man ufactur ing In ternati onal C orporat ion	中芯国际	688981 SH	上海证 券交 易所	中国	656,431	30,261,469.10	6.06
5	Will Semic onducto r CO., Ltd. S hanghai	韦尔股份	603501 SH	上海证 券交 易所	中国	283,085	28,130,156.45	5.63
6	HANMI SEMICON DUCTOR CO LTD	韩美半导 体有限公 司	042700 KS	韩国证 券交 易所	韩国	31,228	27,917,731.54	5.59
7	Hygon Infor mation Techn ology Co., L td.	海光信息	688041 SH	上海证 券交 易所	中国	309,216	21,744,069.12	4.35
8	GigaDev ice Semicon ductor (Beijin g) Inc.	兆易创新	603986 SH	上海证 券交 易所	中国	221,800	21,208,516.00	4.25
9	Advance d Micro-F abricat ion Equipme nt Inc. . Chin	中微公司	688012 SH	上海证 券交 易所	中国	144,383	20,395,542.58	4.08

	a							
10	Montage Technology Co., Ltd.	澜起科技	688008 SH	上海证券交易所	中国	303,704	17,359,720.64	3.48
11	JCET Group Co., Ltd.	长电科技	600584 SH	上海证券交易所	中国	476,200	15,100,302.00	3.02
12	LEENO INDUSTRIAL INC	LEENO 工业股份有限公司	058470 KS	韩国证券交易所	韩国	11,601	14,145,358.79	2.83
13	Cambricon Technologies Corporation Limited	寒武纪	688256 SH	上海证券交易所	中国	69,284	13,764,652.28	2.76
14	Unigroup Guoxin Microelectronics Co., Ltd.	紫光国微	002049 SZ	深圳证券交易所	中国	226,100	11,892,860.00	2.38
15	HPSP CO LTD	HPSP 股份有限公司	403870 KS	韩国证券交易所	韩国	54,449	11,060,438.70	2.22
16	Maxscend Microelectronics Company Limited	卓胜微	300782 SZ	深圳证券交易所	中国	124,463	9,675,753.62	1.94
17	EO TECHNICS CO LTD	EO 技术有限公司	039030 KS	韩国证券交易所	韩国	9,807	9,510,342.45	1.90
18	DB HITEK CO LTD	DB HiTek 股份有限公司	000990 KS	韩国证券交易所	韩国	36,460	9,250,734.19	1.85
19	JEL	周星工程	036930 KS	韩国证券交易所	韩国	41,309	8,005,454.00	1.60
20	National	沪硅产业	688126 SH	上海证券交易所	中国	548,272	7,571,636.32	1.52

	Silicon Industry Group Co., Ltd							
21	WONIK IPS CO LTD	Wonik IPS 有限公司	240810 KS	韩国证券交易所	韩国	38,612	6,971,917.19	1.40
22	China Resources Microelectronics Limited	华润微	688396 SH	上海证券交易所	中国	176,116	6,593,783.04	1.32
23	Empyrean Technology Co., Ltd.	华大九天	301269 SZ	深圳证券交易所	中国	72,300	5,570,715.00	1.12
24	LX SEMICON CO LTD	LX 半导体株式会社	108320 KS	韩国证券交易所	韩国	12,707	5,360,240.23	1.07
25	HANA MICRON INC	Hana 股份有限公司	067310 KS	韩国证券交易所	韩国	48,148	5,121,330.36	1.03
26	TOKAI CARBON KOREA CO LTD	韩国东海碳素株式会社	064760 KS	韩国证券交易所	韩国	6,847	4,760,535.46	0.95
27	ISC CO LTD	ISC 有限公司	095340 KS	韩国证券交易所	韩国	11,954	4,062,610.91	0.81
28	KOH YOUNG TECHNOLOGY INC	KOH YOUNG 科技股份有限公司	098460 KS	韩国证券交易所	韩国	60,269	3,952,680.75	0.79
29	ACM Research (Shanghai), Inc.	盛美上海	688082 SH	上海证券交易所	中国	28,963	2,447,663.13	0.49
30	GAONCHIPS CO LTD	GAONCHIPS 有限公司	399720 KS	韩国证券交易所	韩国	5,389	1,887,394.28	0.38

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**  
 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	Shandong Jianbang New Material Co., Ltd.	键邦股份	603285 SH	上海证券交易所	中国	1,287	24,002.55	0.00
2	Wuhan Dameng Database Company Limited	达梦数据	688692 SH	上海证券交易所	中国	133	23,265.69	0.00
3	Ananda Drive Techniques (Shanghai) Co., Ltd.	安乃达	603350 SH	上海证券交易所	中国	1,051	21,608.56	0.00
4	Brite Semiconductor (Shanghai) Co., Ltd.	灿芯股份	688691 SH	上海证券交易所	中国	222	9,437.22	0.00
5	Chengdu Sino-Microelectronics Tech. Co., Ltd.	成都华微	688709 SH	上海证券交易所	中国	356	6,689.24	0.00
6	Shandong Cvicse Middleare Co., Ltd.	中创股份	688695 SH	上海证券交易所	中国	186	5,868.30	0.00
7	Omat	欧莱新材	688530	上海证券交易所	中国	344	5,538.40	0.00



	Advanced Materials (Guangdong) Co., Ltd		SH	交易所				
8	Wafer Works (Shanghai) Co., Ltd	上海合晶	688584 SH	上海证券交易所	中国	284	4,512.76	0.00
9	Yonz Technology Co., Ltd	永臻股份	603381 SH	上海证券交易所	中国	170	4,272.10	0.00
10	Shanghai Longcheer Technology Co., Ltd	龙旗科技	603341 SH	上海证券交易所	中国	111	4,161.39	0.00
11	Cinderson Tech (Suzhou) Co., Ltd	星德胜	603344 SH	上海证券交易所	中国	111	2,515.26	0.00
12	Riamb (Beijing) Technology Development Co., Ltd	北自科技	603082 SH	上海证券交易所	中国	82	2,418.18	0.00
13	Wuxi Holyview Microelectronics	盛景微	603375 SH	上海证券交易所	中国	49	1,906.10	0.00

	cs Co.,Ltd						
--	---------------	--	--	--	--	--	--

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	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	005930 KS	54,028,919.26	27.78
2	SK HYNIX INC	000660 KS	37,513,750.03	19.29
3	NAURA Technology Group Co.,Ltd.	002371 SZ	26,571,339.24	13.66
4	HANMI SEMICONDUCTOR CO LTD	042700 KS	24,115,126.45	12.40
5	Semiconductor Manufacturing International Corporation	688981 SH	23,241,244.17	11.95
6	Will Semiconductor CO.,Ltd. Shanghai	603501 SH	22,837,483.08	11.74
7	Hygon Information Technology Co., Ltd.	688041 SH	17,998,536.57	9.25
8	Advanced Micro-Fabrication Equipment Inc. China	688012 SH	16,125,387.18	8.29
9	GigaDevice Semiconductor (Beijing) Inc.	603986 SH	14,010,745.48	7.20
10	Montage Technology Co., Ltd.	688008 SH	12,063,297.54	6.20
11	LEENO INDUSTRIAL INC	058470 KS	11,416,671.35	5.87
12	Unigroup Guoxin Microelectronics Co., Ltd.	002049 SZ	10,635,771.00	5.47
13	JCET Group Co., Ltd.	600584 SH	10,358,562.00	5.33
14	HPSP CO LTD	403870 KS	9,727,019.89	5.00
15	Maxscend Microelectronics	300782 SZ	9,393,189.60	4.83

	Company Limited			
16	Cambricon Technologies Corporation Limited	688256 SH	9,350,196.84	4.81
17	EO TECHNICS CO LTD	039030 KS	7,937,432.80	4.08
18	DB HITEK CO LTD	000990 KS	6,506,190.95	3.35
19	National Silicon Industry Group Co., Ltd.	688126 SH	6,135,023.04	3.15
20	JEL	036930 KS	5,718,128.51	2.94
21	WONIK IPS CO LTD	240810 KS	5,544,096.35	2.85
22	China Resources Microelectronics Limited	688396 SH	5,429,760.18	2.79
23	HANA MICRON INC	067310 KS	5,253,758.86	2.70
24	Empyrean Technology Co., Ltd.	301269 SZ	4,706,233.00	2.42
25	KOH YOUNG TECHNOLOGY INC	098460 KS	3,986,117.91	2.05

注：不考虑相关交易费用。

### 7.5.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	HANMI SEMICONDUCTOR CO LTD	042700 KS	30,368,438.22	15.62
2	SK HYNIX INC	000660 KS	12,752,166.19	6.56
3	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	005930 KS	9,240,104.22	4.75
4	SG Micro Corp.	300661 SZ	7,454,733.93	3.83
5	FADU INC	440110 KS	4,777,020.90	2.46
6	SIMMTECH CO LTD	222800 KS	4,409,030.36	2.27
7	Semiconductor Manufacturing International Corporation	688981 SH	3,880,133.45	2.00
8	Hygon Information Technology Co., Ltd.	688041 SH	3,280,517.60	1.69
9	NAURA Technology Group Co., Ltd.	002371 SZ	3,104,176.00	1.60

10	Will Semiconductor CO., Ltd. Shanghai	603501 SH	2,829,835.00	1.46
11	Advanced Micro-Fabrication Equipment Inc. China	688012 SH	2,539,276.77	1.31
12	HPSP CO LTD	403870 KS	2,105,565.20	1.08
13	GigaDevice Semiconductor (Beijing) Inc.	603986 SH	2,083,330.00	1.07
14	Montage Technology Co., Ltd.	688008 SH	2,026,441.74	1.04
15	Unigroup Guoxin Microelectronics Co., Ltd.	002049 SZ	1,853,740.00	0.95
16	LEENO INDUSTRIAL INC	058470 KS	1,798,120.85	0.92
17	DB HITEK CO LTD	000990 KS	1,731,763.63	0.89
18	Maxscend Microelectronics Company Limited	300782 SZ	1,616,080.00	0.83
19	JCET Group Co., Ltd.	600584 SH	1,582,863.00	0.81
20	Cambricon Technologies Corporation Limited	688256 SH	1,367,685.80	0.70

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	385,539,882.12
卖出收入（成交）总额	110,643,839.78

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

金额单位：人民币元

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	权证品种_配股	HANA MICRON INC RTS	39,809.58	0.01

### 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

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的情形，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	29,742.72
2	应收清算款	-
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	75,409.12
8	其他	-
9	合计	105,151.84

#### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	公司名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
----	------	------	-------------	--------------	----------

1	603285	键邦股份	24,002.55	0.00	新股未上市
2	688692	达梦数据	23,265.69	0.00	新股锁定期内
3	603350	安乃达	21,608.56	0.00	新股未上市
4	688691	灿芯股份	9,437.22	0.00	新股锁定期内
5	688709	成都华微	6,689.24	0.00	新股锁定期内

7.11.6 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		华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 (QDII)	
		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 (%)
7,939	46,659.15	202,138,090.00	54.57	126,943,910.00	34.27	41,345,000.00	11.16

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	BARCLAYS BANK PLC	29,773,710.00	8.04
2	UBS AG	20,048,800.00	5.41
3	中国农业银行股份有限公司—易方达养老目标日期 2050 五年持有期混合型基金中基金 (	16,137,666.00	4.36
4	招商银行股份有限公司—平安养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金 (FOF	11,000,000.00	2.97
5	中国工商银行股份有限公司—易方达养老目标日期 2055 五年持有期混合型基金中基	8,442,393.00	2.28

	金 (		
6	上海浦东发展银行股份有限公司一易方达汇裕积极养老目标五年持有期混合型基金中基金	8,086,010.00	2.18
7	华夏银行股份有限公司一易方达养老目标日期 2045 五年持有期混合型基金中基金 (FOF	7,773,096.00	2.10
8	歌斐诺宝 (上海) 资产管理有限公司一歌斐目标策略平衡型私募证券投资基金	6,618,100.00	1.79
9	歌斐诺宝 (上海) 资产管理有限公司一歌斐大趋势主题私募基金	6,550,200.00	1.77
10	上海宁苑资产管理有限公司一宁苑沛华二号私募证券投资基金	5,093,700.00	1.38
11	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发起式联接基金 (QDII)	41,345,000.00	11.16

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 11 月 2 日) 基金份额总额	354,427,000.00
本报告期期初基金份额总额	157,427,000.00
本报告期基金总申购份额	281,000,000.00

减：本报告期基金总赎回份额	68,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	370,427,000.00

## § 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，陆桢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。

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

### 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	



			(%)		(%)	
Daishin Securities	1	138,471,029.53	27.94	69,227.41	24.83	-
Samsung	1	124,683,050.95	25.16	62,341.66	22.36	-
长江证券	1	98,900,788.71	19.95	93,550.87	33.55	-
方正证券	3	82,170,868.38	16.58	16,434.90	5.89	-
海通证券	3	42,935,503.17	8.66	29,630.78	10.63	-
国投证券	1	4,543,384.12	0.92	4,297.50	1.54	-
华金证券	1	2,224,015.00	0.45	2,081.55	0.75	-
东海证券	1	935,804.00	0.19	885.24	0.32	-
华泰证券	2	794,413.36	0.16	388.79	0.14	-
CLSA Securities	1	-	-	-	-	-
东方财富证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-

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、本基金新增租用东海证券、方正证券、华金证券、CLSA Securities 交易单元。

### 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 (%)
Daishin Securities	-	-	-	-	-	-	-	-
Samsung	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
CLSA Securities	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-

### 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	证监会规定报刊和网站	2024 年 06 月 25 日

	户的公告		
2	华泰柏瑞基金管理有限公司关于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(QDII)暂停申购和赎回业务的公告	证监会规定报刊和网站	2024年06月04日
3	华泰柏瑞基金管理有限公司关于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(QDII)暂停申购和赎回业务的公告	证监会规定报刊和网站	2024年06月03日
4	华泰柏瑞基金管理有限公司关于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(QDII)暂停申购和赎回业务的公告	证监会规定报刊和网站	2024年05月11日
5	华泰柏瑞基金管理有限公司关于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(QDII)暂停申购和赎回业务的公告	证监会规定报刊和网站	2024年04月26日
6	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
7	华泰柏瑞基金管理有限公司关于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(QDII)暂停申购和赎回业务的公告	证监会规定报刊和网站	2024年02月26日
8	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2024年02月24日
9	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业务公告	证监会规定报刊和网站	2024年02月21日
10	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2024年02月01日
11	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
12	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

投资者	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况
-----	----------------	------------

类别	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	20240202-20240229;20240327-20240327;	1,519,802.00	341,532,383.00	313,278,475.00	29,773,710.00	8.04
联接基金	1	20240101-20240201;	50,115,500.00	26,980,400.00	35,750,900.00	41,345,000.00	11.16

产品特有风险

本基金报告期内有单一持有人和本基金联接基金持有基金份额超过 20%的情形。如果这些份额持有比例较大的投资者赎回，可能导致巨额赎回，从而引发流动性风险，可能对基金产生如下影响：（1）延期办理赎回申请或暂停赎回的风险。当发生巨额赎回时，投资者可能面临赎回申请延期办理、延缓支付或暂停赎回的风险。（2）基金净值大幅波动的风险。基金管理人为了应对大额赎回可能短时间内进行资产变现，这将对基金资产净值产生不利影响，同时可能发生大额赎回费用归入基金资产、基金份额净值保留位数四舍五入等问题，这些都可能会造成基金资产净值的较大波动。（3）基金投资目标偏离的风险。单一投资者大额赎回后可能导致基金规模缩小，基金将面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形，从而使得实现基金投资目标存在一定的不确定性。（4）基金合同提前终止的风险。如果投资者大额赎回可能导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。本基金管理人将密切关注申赎动向，审慎评估大额申赎对基金持有集中度的影响，同时将完善流动性风险管控机制，最大限度的保护基金份额持有人的合法权益。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

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](http://www.huatai-pb.com)

华泰柏瑞基金管理有限公司

2024 年 8 月 31 日