

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 2026 年中期报告

2026 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：2026 年 8 月 29 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 月 28 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 2026 年 1 月 1 日起至 2026 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	7
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	10
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	11
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	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
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	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50
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	50
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	50
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	50

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	50
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50
7.12 投资组合报告附注	51
§ 8 基金份额持有人信息	52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	52
§ 9 开放式基金份额变动	52
§ 10 重大事件揭示	52
10.1 基金份额持有人大会决议	52
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	53
10.4 基金投资策略的改变	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	53
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	53
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	54
10.8 其他重大事件	58
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	59
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	59
§ 12 备查文件目录	59
12.1 备查文件目录	59
12.2 存放地点	60
12.3 查阅方式	60

§ 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	华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通 ETF
场内简称	MSCIETF（扩位证券简称：MSCI 中国 ETF 华泰柏瑞）
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	42,056,394.00 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	康珂	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 号楼 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 号楼 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 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
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.huatai-pb.com
基金中期报告置备地点	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(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	4,368,201.12
本期利润	5,837,883.88
加权平均基金份额本期利润	0.1231
本期加权平均净值利润率	8.30%
本期基金份额净值增长率	8.76%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	8,480,982.52
期末可供分配基金份额利润	0.2017
期末基金资产净值	65,848,810.11
期末基金份额净值	1.5657
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	99.39%

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。

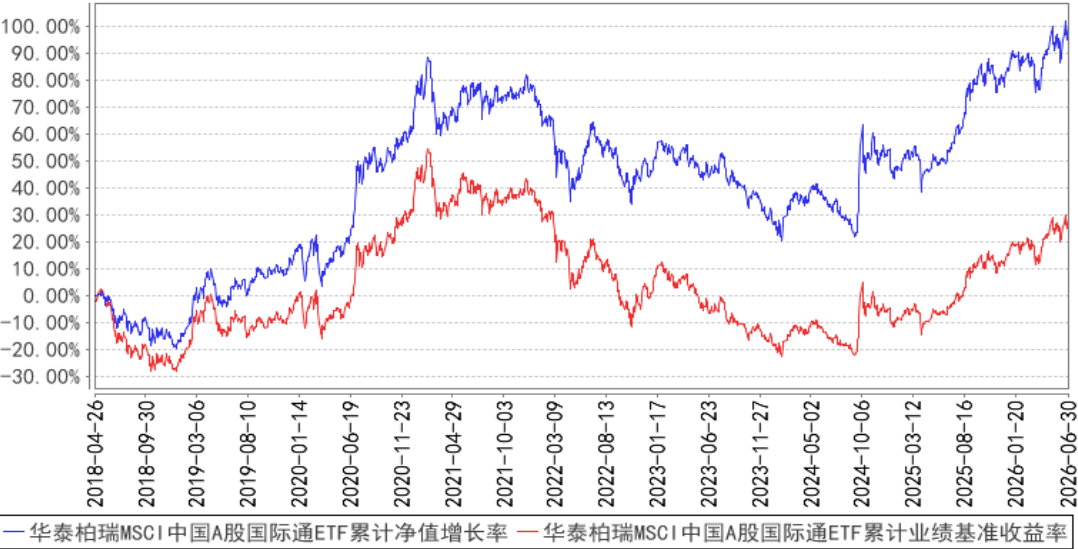
3.2 基金净值表现

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
过去三个月	12.58%	1.26%	13.76%	1.38%	-1.18%	-0.12%
过去六个月	8.76%	1.15%	11.03%	1.27%	-2.27%	-0.12%
过去一年	29.96%	1.03%	34.06%	1.11%	-4.10%	-0.08%
过去三年	36.73%	1.12%	36.11%	1.19%	0.62%	-0.07%
过去五年	11.53%	1.11%	-10.27%	1.23%	21.80%	-0.12%
过去七年	92.89%	1.16%	39.64%	1.28%	53.25%	-0.12%
自基金合同生效起至今	99.39%	1.20%	27.88%	1.33%	71.51%	-0.13%

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

华泰柏瑞MSCI中国A股国际通ETF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 2026 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、Heron View Partners LLC 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 2026 年 6 月 30 日，公司旗下管理 201 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	2026 年 2 月 25 日	7 年	理学硕士。2018 年 12 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。2026 年 2 月起任华泰柏瑞创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞中证企业核心竞争力 50 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞上证 180 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞上证 180 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2026 年 4 月起任华泰柏瑞中证物联网主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2026 年 6 月起任华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。
柳军	副总经理、本基金的基金经理	2018 年 4 月 26 日	-	24 年	副总经理，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、指数投资部总监、总经理助理兼指数投资部总监，现任公司副总经理，兼任华泰盈科资产管理有限公司证券交易负责人员（RO）、就证券提供意见负责人员（RO）、提供资产管理负责人员（RO）。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。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 月至 2025 年 1 月任华泰柏瑞中证 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的基金经理。2025 年 7 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发起式联接基金的基金经理。
--	--	--	--	--	--

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

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

4.2 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《证券投资基金法》等有关法律法规及本基金的基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定，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 11 次，是指数或量化投资组合因投

资策略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

上半年，A 股整体维持震荡上行格局，但市场内部风格分化明显，沪深 300 收于 4979 点，上半年上涨 8.63%，场内日均成交稳定维持 3 万亿元上方，整体资金活跃度充裕。本轮行情由 AI 产业红利主导，资金单向扎堆高景气成长赛道，其中电子、通信板块二季度涨幅分别高达 86.29%、73.59%。

复盘宏观基本面，一季度国内 GDP 同比 5% 开局平稳，二季度受国际油价上行扰动，内需修复动能边际放缓，经济呈现典型外需偏强、内需偏弱的特征，5 月社零同比转负，但出口韧性超预期，前五月出口同比增长 15.3%；同时 PPI 时隔数年同比转正，成长板块盈利预期提前升温，景气优势在中报落地前或已被市场充分定价。

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 1.5657 元，本报告期基金份额净值增长率为 8.76%，业绩比较基准收益率为 11.03%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度，我们认为 A 股仍然以结构性行情为主，当下需要重点警惕两大风险：一是外部流动性扰动，美元韧性走强叠加海外央行加息，全球流动性边际收紧，叠加海外科技股高位回撤、新兴市场外资大幅流出，较易压制 A 股风险偏好；二是内部赛道拥挤风险，AI 产业链经过二季度行情演绎，后续业绩兑现压力陡增。估值维度来看，当前沪深 300PE-TTM 为 13.9 倍、PB1.29 倍，处于历史偏低分位，大盘蓝筹具备一定估值优势；反观成长赛道，创业板市盈率达 52.99 倍，科技主线交易拥挤度逼近历史警戒线，局部估值泡沫凸显，继续上行容错率或大幅收窄。

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。

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，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：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	2,683,435.42	1,193,769.76
结算备付金		2,720,722.62	4,904,768.52
存出保证金		563,449.87	675,295.89
交易性金融资产	6.4.7.2	59,957,755.79	66,861,666.32
其中：股票投资		59,957,755.79	66,861,666.32
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		-	-
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		65,925,363.70	73,635,500.49
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		7,899.20	9,253.09
应付托管费		2,633.07	3,084.39
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		9,881.67	1,190.19
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	56,139.65	120,967.23
负债合计		76,553.59	134,494.90
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	42,056,394.00	51,056,394.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	23,792,416.11	22,444,611.59
净资产合计		65,848,810.11	73,501,005.59
负债和净资产总计		65,925,363.70	73,635,500.49

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.5657 元，基金份额总额 42,056,394.00 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：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		5,964,822.24	775,080.36
1. 利息收入		23,607.50	32,779.09
其中：存款利息收入	6.4.7.13	23,607.50	32,779.09
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）		4,466,561.00	-52,637.35
其中：股票投资收益	6.4.7.14	3,234,358.73	-942,699.80
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	1,440.22
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	680,023.03	44,147.69
股利收益	6.4.7.19	552,179.24	844,474.54
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	1,469,682.76	779,926.05
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	4,970.98	15,012.57
减：二、营业总支出		126,938.36	162,660.62
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	52,361.58	56,529.26
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	17,453.84	18,843.03
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-

其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6. 4. 7. 22	-	-
7. 税金及附加		2, 449. 97	730. 69
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	54, 672. 97	86, 557. 64
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		5, 837, 883. 88	612, 419. 74
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		5, 837, 883. 88	612, 419. 74
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		5, 837, 883. 88	612, 419. 74

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：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 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	51, 056, 394. 00	-	22, 444, 611. 59	73, 501, 005. 59
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	51, 056, 394. 00	-	22, 444, 611. 59	73, 501, 005. 59
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-9, 000, 000. 00	-	1, 347, 804. 52	-7, 652, 195. 48
（一）、综合收益总额	-	-	5, 837, 883. 88	5, 837, 883. 88
（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）	-9, 000, 000. 00	-	-4, 490, 079. 36	-13, 490, 079. 36
其中：1. 基金申购款	3, 000, 000. 00	-	1, 454, 716. 37	4, 454, 716. 37
2. 基金赎回	-12, 000, 000. 00	-	-5, 944, 795. 73	-17, 944, 795. 73

回款				
（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	42,056,394.00	-	23,792,416.11	65,848,810.11
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	69,056,394.00	-	13,236,696.32	82,293,090.32
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	69,056,394.00	-	13,236,696.32	82,293,090.32
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-9,000,000.00	-	-938,731.71	-9,938,731.71
（一）、综合收益总额	-	-	612,419.74	612,419.74
（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）	-9,000,000.00	-	-1,551,151.45	-10,551,151.45
其中：1. 基金申购款	-	-	-	-
2. 基金赎回款	-9,000,000.00	-	-1,551,151.45	-10,551,151.45
（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	60,056,394.00	-	12,297,964.61	72,354,358.61

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2018]501 号《关于准予华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》核准，由华泰柏瑞基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,547,024,828.00 元(含募集股票市值)，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2018)第 0284 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2018 年 4 月 26 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,547,056,394.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 31,566.00 份基金份额。本基金的基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股(包括中小板、创业板以及其他经中国证监会核准发行的股票)、存托凭证、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货、权证以及法律法规或中国证监会允许

基金投资的其他金融工具。本基金将根据法律法规的规定，在履行适当程序后参与融资及转融通证券出借业务。根据《华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下 4 只证券投资基金修改基金合同和托管协议的公告》，本基金自 2019 年 10 月 16 日起，修改上述投资范围表述：本基金可根据法律法规的规定，参与转融通证券出借业务。本基金投资标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于基金非现金资产的 80%。在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 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 2026 年 8 月 28 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2026 年 01 月 01 日至 2026 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 2026 年 06 月 30 日的财务状况以及 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净资产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[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、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[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》、中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》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交易，资管产品管理人为纳税人。自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税交易，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税。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交易，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。

自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，对公募证券投资基金（封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入免征增值税。

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。

自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，金融同业往来利息收入免征增值税。根据财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

(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 2026 年 6 月 30 日
活期存款	2,683,435.42
等于：本金	2,683,181.93
加：应计利息	253.49
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	2,683,435.42

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动

股票		48,511,848.71	-	59,957,755.79	11,445,907.08
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		48,511,848.71	-	59,957,755.79	11,445,907.08

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 2026 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	4,521,320.00	-	-	
其中： 股指期货投资	4,521,320.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	4,521,320.00	-	-	

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
IC2609	中证 500 股指期货 2609	1.00	1,752,280.00	100,280.00
IF2609	沪深 300 股指期货 2609	2.00	2,909,880.00	40,560.00
合计				140,840.00
减：可抵销期货暂收款				140,840.00
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 2026 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	1,591.68
其中：交易所市场	1,591.68
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	54,547.97
合计	56,139.65

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	51,056,394.00	51,056,394.00
本期申购	3,000,000.00	3,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-12,000,000.00	-12,000,000.00
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	42,056,394.00	42,056,394.00

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	5,478,456.56	16,966,155.03	22,444,611.59
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	5,478,456.56	16,966,155.03	22,444,611.59
本期利润	4,368,201.12	1,469,682.76	5,837,883.88
本期基金份额交易产生的变动数	-1,365,675.16	-3,124,404.20	-4,490,079.36
其中：基金申购款	322,652.63	1,132,063.74	1,454,716.37

基金赎回款	-1,688,327.79	-4,256,467.94	-5,944,795.73
本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,480,982.52	15,311,433.59	23,792,416.11

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	4,346.68
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	19,255.32
其他	5.50
合计	23,607.50

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	1,960,591.37
股票投资收益——赎回差价收入	1,273,767.36
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	3,234,358.73

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	10,154,229.32
减：卖出股票成本总额	8,184,292.82
减：交易费用	9,345.13
买卖股票差价收入	1,960,591.37

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	17,944,795.73

减：现金支付赎回款总额	7,812,552.73
减：赎回股票成本总额	8,858,475.64
减：交易费用	-
赎回差价收入	1,273,767.36

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

注：本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.15.2 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。

6.4.7.15.3 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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	680,023.03

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	552,179.24
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	552,179.24

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	1,509,822.76
股票投资	1,509,822.76
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	-40,140.00
权证投资	—
期货投资	-40,140.00
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	1,469,682.76

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	4,970.98
合计	4,970.98

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	14,876.39
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
银行划款手续费	125.00
合计	54,672.97

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、关联关系

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	3,458.76	0.02	-	-

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 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 2026 年 1 月 1 日至 2026 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	0.69	0.02	0.69	0.04
关联方名称	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	-	-	-	-

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、根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	52,361.58	56,529.26
其中：应支付销售机构的客户维护费	4,485.62	2,516.08
应支付基金管理人的净管理费	47,875.96	54,013.18

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	17,453.84	18,843.03

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固有资金投资本基金的情况

注：本报告期及上年度可比期间，基金管理人未投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 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	7,156,541.00	17.0165	8,766,541.00	17.1703
华泰证券股 份有限公司	1,855,120.00	4.4110	2,008,892.00	3.9347

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金适用的认（申）购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

6.4.10.6 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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股 份有限公司	2,683,435.42	4,346.68	1,186,151.19	2,864.64

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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

注：于 2026 年 6 月 30 日，本基金持有 24,436.00 股建设银行的普通股，成本总额为人民币

202,101.09 元, 估值总额为人民币 235,318.68 元, 占基金净资产的比例为 0.36%(于 2025 年 12 月 31 日, 本基金持有 30,436.00 股建设银行的普通股, 成本总额为人民币 250,126.12 元, 估值总额为人民币 282,446.08 元, 占基金净资产的比例为 0.38%)。

于 2026 年 6 月 30 日, 本基金持有 8,300.00 股华泰证券的普通股, 成本总额为人民币 133,416.04 元, 估值总额为人民币 171,146.00 元, 占基金净资产的比例为 0.26%(于 2025 年 12 月 31 日, 本基金持有 10,400.00 股华泰证券的普通股, 成本总额为人民币 161,868.87 元, 估值总额为人民币 245,336.00 元, 占基金净资产的比例为 0.33%)。

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（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026 年 6 月 29 日	重大事项停牌	832.00	2026 年 7 月 13 日	890.99	489	80,613.95	406,848.00	-

注：本基金截至 2026 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未参与转融通证券出借业务。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人开立的托管账户或其他商业银行开立的存款账户，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均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 2026 年 06 月 30 日，本基金无债券投资(2025 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 2026 年 06 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、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注“期末本基金持有的流通受限证券”。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%。于本报告期末，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 2026 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	2,683,435.42	-	-	-	-	-	2,683,435.42
结算备付金	2,720,722.62	-	-	-	-	-	2,720,722.62
存出保证金	3,990.67	-	-	-	-	559,459.20	563,449.87
交易性金融资产	-	-	-	-	-	59,957,755.79	59,957,755.79
资产总计	5,408,148.71	-	-	-	-	60,517,214.99	65,925,363.70
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	7,899.20	7,899.20
应付托管费	-	-	-	-	-	2,633.07	2,633.07
应交税费	-	-	-	-	-	9,881.67	9,881.67
其他负债	-	-	-	-	-	56,139.65	56,139.65
负债总计	-	-	-	-	-	76,553.59	76,553.59
利率敏感度缺口	5,408,148.71	-	-	-	-	60,440,661.40	65,848,810.11
上年度末 2025 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	1,193,769.76	-	-	-	-	-	1,193,769.76
结算备付金	4,904,768.52	-	-	-	-	-	4,904,768.52
存出保证金	2,431.89	-	-	-	-	672,864.00	675,295.89
交易性金融资产	-	-	-	-	-	66,861,666.32	66,861,666.32

资产总计	6,100,970.17	-	-	-	-	67,534,530.32	73,635,500.49
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	9,253.09	9,253.09
应付托管费	-	-	-	-	-	3,084.39	3,084.39
应交税费	-	-	-	-	-	1,190.19	1,190.19
其他负债	-	-	-	-	-	120,967.23	120,967.23
负债总计	-	-	-	-	-	134,494.90	134,494.90
利率敏感度缺口	6,100,970.17	-	-	-	-	67,400,035.42	73,501,005.59

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 2026 年 06 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2025 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（2025 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 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 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	59,957,755.79	91.05	66,861,666.32	90.97

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	59,957,755.79	91.05	66,861,666.32	90.97

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	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	3,168,795.22	3,661,563.87
	业绩比较基准下降 5%	-3,168,795.22	-3,661,563.87

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	59,550,907.79	66,531,436.36

第二层次	406,848.00	330,229.96
第三层次	—	—
合计	59,957,755.79	66,861,666.32

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 2026 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（2025 年 12 月 31 日：同）。
--

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

（1）基金申购款

于 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日止期间，本基金申购基金份额的对价总额为 4,454,716.37 元（2025 年度：0.00 元），其中包括以股票支付的申购款 2,625,269.00 元和以现金支付的申购款 1,829,447.37 元（2025 年度：其中包括以股票支付的申购款 0.00 元和以现金支付的申购款 0.00 元）。

（2）除基金申购款外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	59,957,755.79	90.95
	其中：股票	59,957,755.79	90.95
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	5,404,158.04	8.20
8	其他各项资产	563,449.87	0.85
9	合计	65,925,363.70	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	314,077.82	0.48
B	采矿业	2,732,460.17	4.15
C	制造业	37,925,769.15	57.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,816,230.52	2.76
E	建筑业	657,815.14	1.00
F	批发和零售业	304,845.52	0.46
G	交通运输、仓储和邮政业	1,449,542.44	2.20
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,283,152.56	4.99
J	金融业	10,160,846.07	15.43
K	房地产业	269,122.48	0.41
L	租赁和商务服务业	348,005.57	0.53
M	科学研究和技术服务业	442,946.85	0.67
N	水利、环境和公共设施管理业	31,006.08	0.05
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	90,174.42	0.14
R	文化、体育和娱乐	34,379.00	0.05

	乐业		
S	综合	97,382.00	0.15
	合计	59,957,755.79	91.05

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	300750	宁德时代	5,160	2,027,931.60	3.08
2	600519	贵州茅台	1,549	1,836,324.01	2.79
3	300308	中际旭创	1,340	1,701,800.00	2.58
4	688256	寒武纪	735	1,172,729.25	1.78
5	688041	海光信息	2,820	1,044,246.00	1.59
6	300502	新易盛	1,652	1,002,764.00	1.52
7	601138	工业富联	12,400	894,660.00	1.36
8	600036	招商银行	23,954	850,367.00	1.29
9	002371	北方华创	850	751,876.00	1.14
10	600900	长江电力	28,150	745,130.50	1.13
11	688012	中微公司	1,531	717,273.50	1.09
12	603986	兆易创新	736	599,840.00	0.91
13	601899	紫金矿业	23,856	599,739.84	0.91
14	601288	农业银行	98,077	595,327.39	0.90
15	002475	立讯精密	8,285	583,264.00	0.89
16	601318	中国平安	12,144	579,754.56	0.88
17	002384	东山精密	2,100	550,935.00	0.84
18	601398	工商银行	72,517	512,695.19	0.78
19	600183	生益科技	2,900	502,860.00	0.76
20	002594	比亚迪	6,213	495,176.10	0.75
21	688008	澜起科技	1,342	415,885.80	0.63
22	688072	拓荆科技	489	406,848.00	0.62
23	600030	中信证券	14,069	404,202.37	0.61
24	601166	兴业银行	24,382	403,765.92	0.61
25	601328	交通银行	61,364	394,570.52	0.60
26	600276	恒瑞医药	7,314	380,620.56	0.58
27	300059	东方财富	18,322	373,402.36	0.57

28	300274	阳光电源	2,340	372,106.80	0.57
29	603259	药明康德	2,960	368,549.60	0.56
30	000725	京东方 A	41,696	361,921.28	0.55
31	300394	天孚通信	1,159	350,806.12	0.53
32	603993	洛阳钼业	19,982	350,684.10	0.53
33	300408	三环集团	2,100	350,490.00	0.53
34	300476	胜宏科技	1,000	346,430.00	0.53
35	002463	沪电股份	2,260	345,328.00	0.52
36	002916	深南电路	748	342,509.20	0.52
37	000858	五粮液	4,606	340,844.00	0.52
38	600487	亨通光电	2,900	317,086.00	0.48
39	300433	蓝思科技	5,900	316,594.00	0.48
40	600000	浦发银行	36,689	315,892.29	0.48
41	600176	中国巨石	4,294	312,946.72	0.48
42	000333	美的集团	4,100	309,673.00	0.47
43	601211	国泰海通	16,204	294,912.80	0.45
44	600150	中国船舶	8,600	290,594.00	0.44
45	301308	江波龙	400	281,520.00	0.43
46	601988	中国银行	45,695	261,375.40	0.40
47	601816	京沪高铁	56,300	255,039.00	0.39
48	601088	中国神华	6,500	253,760.00	0.39
49	601857	中国石油	28,983	251,572.44	0.38
50	000657	中钨高新	2,600	248,872.00	0.38
51	600309	万华化学	3,600	246,276.00	0.37
52	002938	鹏鼎控股	2,300	242,374.00	0.37
53	300604	长川科技	700	238,994.00	0.36
54	600522	中天科技	3,900	236,652.00	0.36
55	601939	建设银行	24,436	235,318.68	0.36
56	002281	光迅科技	900	231,246.00	0.35
57	688120	华海清科	715	230,358.70	0.35
58	600919	江苏银行	21,279	229,387.62	0.35
59	601601	中国太保	8,000	228,160.00	0.35
60	002142	宁波银行	7,637	226,742.53	0.34
61	000001	平安银行	22,529	226,416.45	0.34
62	601225	陕西煤业	11,089	225,661.15	0.34
63	688521	芯原股份	600	222,684.00	0.34
64	300033	同花顺	920	221,720.00	0.34
65	002714	牧原股份	6,258	218,967.42	0.33
66	601985	中国核电	23,800	214,914.00	0.33
67	000338	潍柴动力	7,861	214,212.25	0.33
68	600406	国电南瑞	9,290	212,276.50	0.32
69	601668	中国建筑	47,604	206,601.36	0.31
70	600111	北方稀土	4,267	205,029.35	0.31

71	000988	华工科技	1,100	203,071.00	0.31
72	600584	长电科技	1,900	196,745.00	0.30
73	601919	中远海控	14,552	192,959.52	0.29
74	300857	协创数据	560	190,344.00	0.29
75	300760	迈瑞医疗	1,400	190,162.00	0.29
76	001309	德明利	200	188,580.00	0.29
77	000792	盐湖股份	6,100	184,159.00	0.28
78	603288	海天味业	5,391	178,765.56	0.27
79	688525	佰维存储	360	178,102.80	0.27
80	600999	招商证券	8,440	178,084.00	0.27
81	002352	顺丰控股	5,667	177,150.42	0.27
82	601100	恒立液压	1,628	175,107.68	0.27
83	600887	伊利股份	7,224	173,087.04	0.26
84	601688	华泰证券	8,300	171,146.00	0.26
85	002080	中材科技	1,900	171,000.00	0.26
86	600989	宝丰能源	8,400	170,772.00	0.26
87	601658	邮储银行	34,600	170,578.00	0.26
88	002353	杰瑞股份	1,100	167,750.00	0.25
89	600031	三一重工	9,637	166,527.36	0.25
90	600160	巨化股份	3,100	164,331.00	0.25
91	600809	山西汾酒	1,500	164,055.00	0.25
92	601869	长飞光纤	300	163,770.00	0.25
93	000063	中兴通讯	4,500	162,855.00	0.25
94	600549	厦门钨业	1,900	161,880.00	0.25
95	601872	招商轮船	9,200	161,644.00	0.25
96	000776	广发证券	6,766	158,324.40	0.24
97	601818	光大银行	53,527	154,693.03	0.23
98	688126	沪硅产业	3,850	153,576.50	0.23
99	600028	中国石化	34,130	152,219.80	0.23
100	688396	华润微	1,555	151,690.25	0.23
101	605117	德业股份	1,426	151,412.68	0.23
102	688347	华虹宏力	450	151,335.00	0.23
103	300014	亿纬锂能	2,325	151,194.75	0.23
104	688082	盛美上海	349	150,768.00	0.23
105	300475	香农芯创	500	150,000.00	0.23
106	300223	北京君正	600	149,340.00	0.23
107	601766	中国中车	28,000	145,600.00	0.22
108	600690	海尔智家	7,102	144,951.82	0.22
109	600050	中国联通	36,000	144,000.00	0.22
110	601066	中信建投	4,900	142,443.00	0.22
111	300442	润泽科技	1,700	141,219.00	0.21
112	601229	上海银行	16,269	141,214.92	0.21
113	601009	南京银行	14,264	141,070.96	0.21

114	002600	领益智造	8,100	140,454.00	0.21
115	688111	金山办公	654	139,334.70	0.21
116	000100	TCL 科技	23,834	138,713.88	0.21
117	000568	泸州老窖	1,787	138,528.24	0.21
118	601336	新华保险	2,300	137,218.00	0.21
119	600019	宝钢股份	25,170	136,673.10	0.21
120	002156	通富微电	1,800	136,566.00	0.21
121	603501	豪威集团	1,403	133,074.55	0.20
122	000408	藏格矿业	1,900	131,708.00	0.20
123	600016	民生银行	40,756	131,234.32	0.20
124	002837	英维克	1,640	130,478.40	0.20
125	002460	赣锋锂业	1,953	127,726.20	0.19
126	600089	特变电工	5,540	124,650.00	0.19
127	601600	中国铝业	15,100	124,122.00	0.19
128	688249	晶合集成	2,100	123,963.00	0.19
129	600893	航发动力	3,205	122,879.70	0.19
130	601127	赛力斯	2,000	122,500.00	0.19
131	600905	三峡能源	32,800	121,688.00	0.18
132	600926	杭州银行	8,402	121,408.90	0.18
133	002602	世纪华通	8,600	121,260.00	0.18
134	000977	浪潮信息	1,728	120,960.00	0.18
135	600703	三安光电	5,700	120,954.00	0.18
136	600346	恒力石化	6,780	120,073.80	0.18
137	601169	北京银行	24,355	119,339.50	0.18
138	300136	信维通信	1,000	119,250.00	0.18
139	688183	生益电子	900	119,160.00	0.18
140	601888	中国中免	2,199	118,108.29	0.18
141	600498	烽火通信	1,600	117,760.00	0.18
142	688702	盛科通信	300	116,997.00	0.18
143	002493	荣盛石化	10,778	115,863.50	0.18
144	601995	中金公司	3,200	115,680.00	0.18
145	600010	包钢股份	51,844	115,612.12	0.18
146	600105	永鼎股份	1,700	114,716.00	0.17
147	600886	国投电力	8,600	114,466.00	0.17
148	000166	申万宏源	26,011	114,448.40	0.17
149	601012	隆基绿能	8,688	113,986.56	0.17
150	600188	兖矿能源	6,405	113,816.85	0.17
151	600660	福耀玻璃	2,241	113,036.04	0.17
152	000651	格力电器	3,000	112,500.00	0.17
153	688777	中控技术	953	111,977.50	0.17
154	002466	天齐锂业	1,800	110,376.00	0.17
155	300124	汇川技术	1,650	109,444.50	0.17
156	002230	科大讯飞	2,672	109,124.48	0.17

157	000425	徐工机械	13,400	108,406.00	0.16
158	601006	大秦铁路	23,200	106,952.00	0.16
159	605499	东鹏饮料	853	105,285.79	0.16
160	600460	士兰微	1,900	103,854.00	0.16
161	601689	拓普集团	1,835	103,530.70	0.16
162	688361	中科飞测	240	103,200.00	0.16
163	601727	上海电气	14,500	101,500.00	0.15
164	601958	金钼股份	3,600	101,196.00	0.15
165	002709	天赐材料	1,960	100,802.80	0.15
166	688048	长光华芯	200	100,400.00	0.15
167	002851	麦格米特	600	100,308.00	0.15
168	600547	山东黄金	4,291	99,079.19	0.15
169	601390	中国中铁	23,700	98,829.00	0.15
170	601881	中国银河	7,800	98,046.00	0.15
171	601868	中国能建	36,700	97,989.00	0.15
172	601998	中信银行	14,100	97,713.00	0.15
173	600362	江西铜业	2,255	97,641.50	0.15
174	600015	华夏银行	15,277	97,620.03	0.15
175	688271	联影医疗	964	97,585.72	0.15
176	600489	中金黄金	5,400	97,470.00	0.15
177	600673	东阳光	2,900	97,382.00	0.15
178	300316	晶盛机电	1,600	96,640.00	0.15
179	603799	华友钴业	2,002	96,616.52	0.15
180	300661	圣邦股份	673	96,562.04	0.15
181	002001	新 和 成	3,352	95,263.84	0.14
182	002202	金风科技	3,983	95,193.70	0.14
183	300498	温氏股份	7,720	95,110.40	0.14
184	600875	东方电气	3,300	94,941.00	0.14
185	001389	广合科技	400	94,900.00	0.14
186	600795	国电电力	20,200	94,334.00	0.14
187	603893	瑞芯微	500	94,180.00	0.14
188	688629	华丰科技	500	93,755.00	0.14
189	601669	中国电建	19,947	93,750.90	0.14
190	688469	芯联集成	8,780	93,155.80	0.14
191	601628	中国人寿	2,618	92,546.30	0.14
192	688313	仕佳光子	500	92,325.00	0.14
193	000630	铜陵有色	14,400	91,584.00	0.14
194	002648	卫星化学	3,874	91,000.26	0.14
195	300015	爱尔眼科	10,917	90,174.42	0.14
196	002311	海大集团	2,000	89,220.00	0.14
197	002241	歌尔股份	3,952	89,038.56	0.14
198	000807	云铝股份	4,000	88,560.00	0.13
199	688019	安集科技	260	88,259.60	0.13

200	002050	三花智控	2,000	87,660.00	0.13
201	000938	紫光股份	3,036	87,618.96	0.13
202	600104	上汽集团	8,829	86,171.04	0.13
203	000301	东方盛虹	7,500	85,875.00	0.13
204	000538	云南白药	1,811	85,787.07	0.13
205	601991	大唐发电	12,100	85,668.00	0.13
206	000960	锡业股份	2,000	85,380.00	0.13
207	300751	迈为股份	300	84,738.00	0.13
208	300390	天华新能	900	84,159.00	0.13
209	300782	卓胜微	768	84,157.44	0.13
210	000895	双汇发展	3,737	83,708.80	0.13
211	301269	华大九天	700	83,594.00	0.13
212	601179	中国西电	5,600	83,552.00	0.13
213	300548	长芯博创	300	83,400.00	0.13
214	601838	成都银行	4,700	83,190.00	0.13
215	603296	华勤技术	1,120	83,182.40	0.13
216	600026	中远海能	4,600	82,524.00	0.13
217	601825	沪农商行	10,900	81,641.00	0.12
218	600674	川投能源	5,700	80,769.00	0.12
219	002027	分众传媒	16,642	80,547.28	0.12
220	002185	华天科技	3,600	80,316.00	0.12
221	300395	菲利华	600	80,238.00	0.12
222	688036	传音控股	1,347	79,405.65	0.12
223	600958	东方证券	8,395	79,248.80	0.12
224	688387	信科移动	3,980	78,963.20	0.12
225	600011	华能国际	10,378	78,769.02	0.12
226	688002	睿创微纳	500	77,345.00	0.12
227	600585	海螺水泥	4,486	76,037.70	0.12
228	601168	西部矿业	2,800	75,992.00	0.12
229	002625	光启技术	2,500	75,800.00	0.12
230	300620	光库科技	200	75,640.00	0.11
231	600115	中国东航	19,610	74,714.10	0.11
232	002422	科伦药业	1,932	74,420.64	0.11
233	601319	中国人保	10,900	73,684.00	0.11
234	002812	恩捷股份	1,100	73,601.00	0.11
235	688110	东芯股份	360	73,332.00	0.11
236	688047	龙芯中科	469	72,540.23	0.11
237	603228	景旺电子	1,000	72,410.00	0.11
238	601111	中国国航	11,900	71,995.00	0.11
239	002049	紫光国微	800	71,000.00	0.11
240	600895	张江高科	1,900	70,775.00	0.11
241	300866	安克创新	670	70,015.00	0.11
242	000625	长安汽车	9,692	69,491.64	0.11

243	600601	方正科技	5,000	69,200.00	0.11
244	002304	洋河股份	1,800	68,670.00	0.10
245	601360	三六零	7,900	68,651.00	0.10
246	000066	中国长城	3,600	68,580.00	0.10
247	301358	湖南裕能	900	68,283.00	0.10
248	002736	国信证券	6,825	68,181.75	0.10
249	601231	环旭电子	2,100	68,040.00	0.10
250	601901	方正证券	9,400	67,680.00	0.10
251	001979	招商蛇口	10,458	67,244.94	0.10
252	600066	宇通客车	2,500	67,025.00	0.10
253	603659	璞泰来	2,316	67,001.88	0.10
254	000831	中国稀土	1,200	66,588.00	0.10
255	002653	海思科	1,000	66,340.00	0.10
256	600221	海航控股	49,000	66,150.00	0.10
257	600029	南方航空	12,700	65,786.00	0.10
258	600436	片仔癀	600	65,568.00	0.10
259	601916	浙商银行	24,660	64,855.80	0.10
260	600418	江淮汽车	2,500	64,575.00	0.10
261	600415	小商品城	6,300	64,008.00	0.10
262	601788	光大证券	4,400	63,492.00	0.10
263	600048	保利发展	13,610	63,014.30	0.10
264	600438	通威股份	5,200	62,972.00	0.10
265	688188	柏楚电子	588	62,739.60	0.10
266	002414	高德红外	4,680	62,056.80	0.09
267	300757	罗博特科	100	61,900.00	0.09
268	601077	渝农商行	10,100	61,711.00	0.09
269	000783	长江证券	6,300	61,425.00	0.09
269	600233	圆通速递	3,900	61,425.00	0.09
270	002236	大华股份	3,700	61,013.00	0.09
271	000617	中油资本	9,200	60,628.00	0.09
272	300418	昆仑万维	1,500	60,540.00	0.09
273	600039	四川路桥	7,719	60,362.58	0.09
274	601877	正泰电器	2,400	60,168.00	0.09
275	600580	卧龙电驱	1,800	59,580.00	0.09
276	600023	浙能电力	11,300	59,438.00	0.09
277	688099	晶晨股份	573	58,961.70	0.09
278	688506	百利天恒	200	58,806.00	0.09
279	601377	兴业证券	9,683	58,485.32	0.09
280	002558	巨人网络	2,100	57,876.00	0.09
281	002128	电投能源	2,500	57,800.00	0.09
282	300058	蓝色光标	4,200	57,792.00	0.09
283	600096	云天化	1,900	57,760.00	0.09
284	688187	时代电气	830	56,987.80	0.09

285	002532	天山铝业	5,300	56,869.00	0.09
286	002850	科达利	300	56,790.00	0.09
287	600426	华鲁恒升	2,360	56,451.20	0.09
288	002595	豪迈科技	1,205	56,153.00	0.09
289	000157	中联重科	8,010	55,829.70	0.08
290	000933	神火股份	2,600	55,120.00	0.08
291	300803	指南针	600	55,002.00	0.08
292	001965	招商公路	6,000	54,960.00	0.08
293	600741	华域汽车	3,520	54,630.40	0.08
294	688578	艾力斯	500	54,600.00	0.08
295	688223	晶科能源	11,485	54,553.75	0.08
296	600196	复星医药	2,377	53,411.19	0.08
297	002064	华峰化学	5,600	53,144.00	0.08
298	603260	合盛硅业	1,100	53,086.00	0.08
299	600219	南山铝业	13,300	53,067.00	0.08
300	000975	山金国际	3,120	53,040.00	0.08
301	300759	康龙化成	1,825	52,797.25	0.08
302	000426	兴业银锡	1,600	52,736.00	0.08
303	688617	惠泰医疗	290	52,652.40	0.08
304	002129	TCL 中环	4,350	52,287.00	0.08
305	002074	国轩高科	1,900	52,269.00	0.08
306	688331	荣昌生物	400	52,104.00	0.08
307	603806	福斯特	3,081	51,729.99	0.08
308	601117	中国化学	6,938	50,994.30	0.08
309	001203	大中矿业	1,700	50,915.00	0.08
310	000963	华东医药	1,796	50,503.52	0.08
311	000559	万向钱潮	3,900	50,427.00	0.08
312	300628	亿联网络	1,490	50,391.80	0.08
313	600988	赤峰黄金	1,900	50,008.00	0.08
314	601878	浙商证券	5,200	49,400.00	0.08
315	601618	中国中冶	20,200	49,288.00	0.07
316	002920	德赛西威	600	48,900.00	0.07
317	601198	东兴证券	3,594	48,842.46	0.07
318	600642	申能股份	5,500	48,015.00	0.07
319	688472	阿特斯	4,400	47,608.00	0.07
320	002555	三七互娱	2,500	47,175.00	0.07
321	600061	国投资本	7,200	47,160.00	0.07
322	601607	上海医药	3,060	47,124.00	0.07
323	688122	西部超导	741	46,542.21	0.07
324	600027	华电国际	10,400	46,280.00	0.07
325	002601	龙佰集团	2,800	46,144.00	0.07
326	601108	财通证券	5,310	45,931.50	0.07
327	601699	潞安环能	3,215	45,910.20	0.07

328	600803	新奥股份	2,900	45,820.00	0.07
329	601021	春秋航空	1,000	45,580.00	0.07
330	000999	华润三九	2,011	45,227.39	0.07
331	600352	浙江龙盛	3,700	44,807.00	0.07
332	301236	软通动力	1,050	44,572.50	0.07
333	601555	东吴证券	5,625	44,550.00	0.07
334	000688	国城矿业	1,300	44,499.00	0.07
335	600143	金发科技	2,800	43,260.00	0.07
336	300919	中伟新材	980	42,875.00	0.07
337	600570	恒生电子	2,016	42,719.04	0.06
338	601058	赛轮轮胎	3,700	42,661.00	0.06
339	688303	大全能源	2,440	42,529.20	0.06
340	601216	君正集团	9,400	41,924.00	0.06
341	601696	中银证券	3,300	41,745.00	0.06
342	002294	信立泰	1,307	41,680.23	0.06
343	002738	中矿资源	700	41,293.00	0.06
344	600021	上海电力	2,700	40,689.00	0.06
345	601456	国联民生	4,600	40,664.00	0.06
346	002487	大金重工	700	40,579.00	0.06
347	600845	宝信软件	2,439	40,560.57	0.06
348	000708	中信特钢	3,200	40,384.00	0.06
349	600157	永泰能源	25,000	40,250.00	0.06
350	000596	古井贡酒	500	39,900.00	0.06
350	600918	中泰证券	7,500	39,900.00	0.06
351	600085	同仁堂	1,700	39,287.00	0.06
352	300765	石药创新	1,440	39,211.20	0.06
353	300115	长盈精密	1,400	39,116.00	0.06
354	601162	天风证券	11,600	39,092.00	0.06
355	601577	长沙银行	4,400	38,324.00	0.06
356	000983	山西焦煤	6,502	37,711.60	0.06
357	601777	千里科技	4,600	37,536.00	0.06
358	002340	格林美	5,600	37,016.00	0.06
359	000728	国元证券	4,940	37,000.60	0.06
360	600839	四川长虹	5,300	36,994.00	0.06
361	002379	宏桥控股	2,500	36,925.00	0.06
362	002939	长城证券	4,400	36,696.00	0.06
363	600600	青岛啤酒	700	36,561.00	0.06
364	600588	用友网络	3,964	36,389.52	0.06
365	601799	星宇股份	400	36,248.00	0.06
366	002078	太阳纸业	2,900	36,221.00	0.06
367	300207	欣旺达	1,900	36,081.00	0.05
368	688568	中科星图	860	35,664.20	0.05
369	600515	海南机场	13,000	35,620.00	0.05

370	002966	苏州银行	5,100	35,496.00	0.05
371	300896	爱美客	400	34,880.00	0.05
372	603606	东方电缆	840	34,868.40	0.05
373	300251	光线传媒	3,100	34,379.00	0.05
374	002517	恺英网络	2,100	34,125.00	0.05
375	300748	金力永磁	1,100	33,935.00	0.05
376	300832	新产业	800	33,600.00	0.05
377	688599	天合光能	2,368	33,436.16	0.05
378	000661	长春高新	500	33,300.00	0.05
379	002252	上海莱士	7,600	32,984.00	0.05
380	600009	上海机场	1,414	32,663.40	0.05
381	000876	新希望	5,207	32,647.89	0.05
382	600298	安琪酵母	900	32,580.00	0.05
383	000002	万科A	10,969	32,468.24	0.05
384	300122	智飞生物	2,750	32,147.50	0.05
385	002195	岩山科技	4,900	32,046.00	0.05
386	688375	国博电子	300	31,290.00	0.05
387	603568	伟明环保	2,016	31,006.08	0.05
388	603486	科沃斯	600	30,450.00	0.05
389	002459	晶澳科技	3,716	30,099.60	0.05
390	601933	永辉超市	10,500	29,820.00	0.05
391	600733	北汽蓝谷	6,100	29,707.00	0.05
392	601238	广汽集团	5,700	28,956.00	0.04
393	000786	北新建材	1,600	28,944.00	0.04
394	603392	万泰生物	1,072	28,911.84	0.04
395	300454	深信服	300	28,860.00	0.04
396	300413	芒果超媒	1,960	28,674.80	0.04
397	600536	中国软件	1,010	28,401.20	0.04
398	002131	利欧股份	5,800	27,550.00	0.04
399	000932	华菱钢铁	7,900	27,413.00	0.04
400	000564	供销大集	20,600	27,398.00	0.04
401	601567	三星电气	1,700	25,398.00	0.04
402	300347	泰格医药	450	21,600.00	0.03
403	601212	白银有色	4,200	21,336.00	0.03
404	002465	海格通信	1,500	19,155.00	0.03
405	600711	盛屯矿业	1,700	18,649.00	0.03
406	300255	常山药业	600	14,052.00	0.02

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

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	000657	中钨高新	209,036.00	0.28
2	300750	宁德时代	185,251.00	0.25
3	002602	世纪华通	180,678.00	0.25
4	601869	长飞光纤	118,167.00	0.16
5	002851	麦格米特	113,311.00	0.15
6	601231	环旭电子	110,886.00	0.15
7	002371	北方华创	109,450.00	0.15
8	600498	烽火通信	107,160.00	0.15
9	002379	宏桥控股	99,048.00	0.13
10	000960	锡业股份	96,529.64	0.13
11	300136	信维通信	94,770.00	0.13
12	002812	恩捷股份	92,351.00	0.13
13	300058	蓝色光标	90,247.00	0.12
14	001309	德明利	90,016.00	0.12
15	688702	盛科通信	84,384.00	0.11
16	000559	万向钱潮	84,313.00	0.11
17	002738	中矿资源	84,256.00	0.11
18	600105	永鼎股份	80,915.00	0.11
19	688387	信科移动	80,874.59	0.11
20	300395	菲利华	80,694.00	0.11

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	708,184.00	0.96
2	688256	寒武纪	474,417.30	0.65
3	300308	中际旭创	311,656.00	0.42
4	601138	工业富联	265,310.00	0.36
5	002594	比亚迪	220,946.00	0.30
6	002371	北方华创	207,457.00	0.28
7	300502	新易盛	200,288.00	0.27
8	002475	立讯精密	184,119.00	0.25
9	000858	五粮液	148,513.00	0.20
10	300059	东方财富	134,225.00	0.18
11	300274	阳光电源	125,882.00	0.17
12	300394	天孚通信	124,532.00	0.17

13	300476	胜宏科技	123,593.00	0.17
14	002384	东山精密	118,264.00	0.16
15	002916	深南电路	116,884.00	0.16
16	000333	美的集团	102,850.00	0.14
17	002938	鹏鼎控股	98,946.00	0.13
18	003816	中国广核	93,602.00	0.13
19	002714	牧原股份	93,567.00	0.13
20	688008	澜起科技	82,169.60	0.11

注：不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	6,003,766.17
卖出股票收入（成交）总额	10,154,229.32

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，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约定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同约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	563,449.87
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	-
8	其他	-
9	合计	563,449.87

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 (%)
1,067	39,415.55	4,782,592.00	11.37	30,117,261.00	71.61	7,156,541.00	17.02

8.2 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

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2018 年 4 月 26 日) 基金份额总额	1,547,056,394.00
本报告期期初基金份额总额	51,056,394.00
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	12,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	42,056,394.00

§ 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： 经公司股东书面决定，谢仕荣先生于 2026 年 1 月 16 日起担任公司董事，陈健先生担任公司监事，Kirk Chester SWEENEY 先生不再担任公司董事，卢龙威先生不再担任公司监事。 经公司股东书面决定，刘晓冰先生于 2026 年 3 月 21 日起担任公司董事，徐珊女士担任公司监事，陆春光先生不再担任公司董事，刘晓冰先生不再担任公司监事。 经公司董事会审议通过，董辰先生于 2026 年 3 月 25 日起担任公司副总经理。 上述人事变动已按相关规定备案、报告。 基金托管人重大人事变动： 中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）研究决定，聘任陈颖钰为中国建设银行资产托管业务部总经理。 陈颖钰女士曾先后在中国建设银行财务会计、重组改制、资产负债、同业业务、金融科技等领域工作，并在中国建设银行总行同业业务中心、财务会计部、资产托管业务部以及山东省分行、建信金融科技有限责任公司等机构担任领导职务，具有丰富的财会、科技和资金资产管理经验。 上述人事变动已按相关规定备案、报告。
--

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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

注：报告期内基金管理人未受监管部门稽查或处罚。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

管理人相关从业人员受调查或处罚等情况 1	内容
受到调查或处罚等措施的主体	高级管理人员 1

受到调查或处罚等措施的时间	2026 年 3 月 9 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证监会上海监管局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施
受到的具体措施类型	监管谈话
受到调查或处罚等措施的原因	人员管理
受到处罚的依据	《证券投资基金行业高级管理人员任职管理办法》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	未涉及
其他	-
管理人相关从业人员受调查或处罚等情况 2	内容
受到调查或处罚等措施的主体	高级管理人员 2
受到调查或处罚等措施的时间	2026 年 6 月 8 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证监会上海监管局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施
受到的具体措施类型	监管谈话
受到调查或处罚等措施的原因	人员管理
受到处罚的依据	《证券投资基金行业高级管理人员任职管理办法》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	未涉及
其他	-

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

注：无。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：无。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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 (%)	
国联民生证券	4	12,721,560.27	78.74	2,544.60	78.74	-
东北证券	2	3,431,789.34	21.24	686.41	21.24	-
华泰证券	6	3,458.76	0.02	0.69	0.02	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-

长江证券	2	-	-	-	-	-
诚通证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	3	-	-	-	-	-
东方财富 证券	2	-	-	-	-	-
东海证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国泰海通 证券	3	-	-	-	-	-
国投证券	3	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
国元证券	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	-	-	-	-	-
金融街证 券	1	-	-	-	-	-
金元证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
野村证券	1	-	-	-	-	-
银泰证券	1	-	-	-	-	-
粤开证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	4	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中金财富 证券	2	-	-	-	-	-

中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	3	-	-	-	-	-

注：1、选择证券公司参与证券交易的标准

公司选择财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强的证券公司租用基金专用交易席位。公司选择的提供交易单元的券商应当综合考虑下列因素：

(1) 具有相应的业务经营资格；

(2) 具备研究实力，有固定的研究机构和充足的研究人员，或者获得过知名金融媒体奖项，能及时为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、股票分析的研究报告，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告和特色研究服务等；

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

(4) 财务状况良好，信誉良好，内部管理规范、严格，风控合规管理人员充足，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

(5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要；

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

根据上述条件标准，公司建立被动股票型基金和其他类型基金证券公司白名单。

证券公司白名单进行定期或不定期更新，每年更新不得少于一次。

2、选择证券公司参与证券交易的程序

公司选择证券公司租用基金专用交易席位，应遵循以下程序：

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

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

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

公司选择代理证券买卖的证券经营机构的程序：

基金管理人根据业务需要与被选择的证券经营机构签订证券经纪服务协议。

3、本报告期内，退租中航证券的交易单元；新增东方财富证券的交易单元。

10.7.2 基金租用或者通过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 (%)
国联民生 证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
诚通证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东方财富 证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通 证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-

金融街证 券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
野村证券	-	-	-	-	-	-
银泰证券	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中金财富 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旗下部分基金参与汇添富基金销售（上海）有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 06 月 25 日
2	华泰柏瑞基金管理有限公司关于停牌股票估值调整情况的公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 06 月 25 日
3	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止浦领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	2026 年 06 月 12 日
4	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止中证金牛（北京）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	2026 年 06 月 06 日
5	华泰柏瑞基金管理有限公司关于高	证监会规定报刊和网站	2026 年 03 月 27 日

	级管理人员变更的公告		
6	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分交易型开放式基金变更基金简称的公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 03 月 17 日
7	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分上交所 ETF 变更扩位证券简称的公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 03 月 17 日
8	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金持有停牌证券估值调整的提示性公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 03 月 05 日
9	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金持有停牌证券估值调整的提示性公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 02 月 27 日
10	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金持有停牌证券估值调整的提示性公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 01 月 26 日
11	华泰柏瑞基金管理有限公司关于注销深圳分公司的公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 01 月 10 日
12	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参与易方达财富管理基金销售(广州)有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 01 月 09 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

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、本基金的中国证监会批准募集文件
- 2、本基金的《基金合同》
- 3、本基金的《招募说明书》
- 4、本基金的《托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、本基金的公告

12.2 存放地点

上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

托管人住所

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。 投资者对本报告如有疑问，可咨询基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司。 客户服务热线：400-888-0001（免长途费） 021-3878 4638 公司网址：www.huatai-pb.com

华泰柏瑞基金管理有限公司

2026 年 8 月 29 日