

# 景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放 式指数证券投资基金 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 23 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。本中期报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 08 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 2021 年 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	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	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	18
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>39</b>
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
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	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	55

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 .....	55
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 .....	55
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 .....	55
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 .....	55
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	56
7.12 投资组合报告附注 .....	56
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>58</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	58
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	58
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	59
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 .....	59
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>59</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>59</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	59
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 .....	59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	60
10.4 基金投资策略的改变 .....	60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	60
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 .....	60
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	60
10.8 其他重大事件 .....	66
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>68</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 .....	68
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	68
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>69</b>
12.1 备查文件目录 .....	69
12.2 存放地点 .....	69
12.3 查阅方式 .....	69

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城 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	景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通 ETF
场内简称	景顺 MSCI (扩位证券简称: 景顺 MSCIA 股 ETF)
基金主代码	512280
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2018 年 4 月 27 日
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	94,005,740.00 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 25 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，以期获得与标的指数收益相似的回报。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。
投资策略	本基金以 MSCI 中国 A 股国际通指数为标的指数，采用完全复制法，即以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。在因特殊情况（包括但不限于成份股停牌、流动性不足、法律法规限制、其它合理原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等）导致无法获得足够数量的股票时，本基金可以根据市场情况，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进行替代或者采用其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。
业绩比较基准	MSCI 中国 A 股国际通指数(MSCIChina A Inclusion RMB Index (CNY))。
风险收益特征	本基金为股票型指数基金，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，属于证券投资基金中预期风险较高、预期收益较高的品种。

### 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	景顺长城基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	杨皞阳	秦一楠
	联系电话	0755-82370388	010-66060069
	电子邮箱	investor@igwfm.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4008888606	95599
传真		0755-22381339	010-68121816
注册地址		深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		518048	100031
法定代表人		李进	谷澍

## 2.4 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	www.igwfm.com
基金中期报告备置地点	基金管理人的办公场所

## 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(2021年1月1日-2021年6月30日)
本期已实现收益	27,022,683.09
本期利润	16,210,030.46
加权平均基金份额本期利润	0.1697
本期加权平均净值利润率	10.34%
本期基金份额净值增长率	9.80%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)
期末可供分配利润	69,237,665.03
期末可供分配基金份额利润	0.7365
期末基金资产净值	163,243,405.03
期末基金份额净值	1.7365
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)
基金份额累计净值增长率	73.65%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、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、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。

### 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	1.35%	0.84%	-0.55%	0.84%	1.90%	0.00%
过去三个月	10.89%	0.96%	6.84%	0.98%	4.05%	-0.02%
过去六个月	9.80%	1.30%	3.38%	1.32%	6.42%	-0.02%
过去一年	45.12%	1.30%	28.40%	1.33%	16.72%	-0.03%
过去三年	88.52%	1.32%	59.85%	1.36%	28.67%	-0.04%
自基金合同生效起至今	73.65%	1.31%	48.30%	1.34%	25.35%	-0.03%

### 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

景顺长城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：基金的投资组合比例为：基金投资于标的指数成份股及备选成份股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%。本基金的建仓期为自 2018 年 4 月 27 日基金合同生效日起 6 个月。建仓期结束时，本基金投资组合达到上述投资组合比例的要求。

### 3.3 其他指标

无。

## § 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

本基金管理人景顺长城基金管理有限公司（以下简称“公司”或“本公司”）是经中国证监会证监基金字[2003]76号文批准设立的证券投资基金管理公司，由长城证券股份有限公司、景顺资产管理有限公司、开滦（集团）有限责任公司、大连实德集团有限公司共同发起设立，并于 2003 年 6 月 9 日获得开业批文，注册资本 1.3 亿元人民币，目前，各家出资比例分别为 49%、49%、1%、1%。总部设在深圳，在北京、上海、广州设有分公司。

截至 2021 年 6 月 30 日，景顺长城基金管理有限公司旗下共管理 124 只开放式基金，包括景顺长城景系列开放式证券投资基金、景顺长城内需增长混合型证券投资基金、景顺长城鼎益混合型证券投资基金 (LOF)、景顺长城资源垄断混合型证券投资基金 (LOF)、景顺长城新兴成长混合型证券投资基金、景顺长城内需增长贰号混合型证券投资基金、景顺长城精选蓝筹混合型证券投资



基金、景顺长城公司治理混合型证券投资基金、景顺长城能源基建混合型证券投资基金、景顺长城中小盘混合型证券投资基金、景顺长城稳定收益债券型证券投资基金、景顺长城大中华混合型证券投资基金(QDII)、景顺长城核心竞争力混合型证券投资基金、景顺长城优信增利债券型证券投资基金、景顺长城支柱产业混合型证券投资基金、景顺长城品质投资混合型证券投资基金、景顺长城四季金利债券型证券投资基金、景顺长城策略精选灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景兴信用纯债债券型证券投资基金、景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金、景顺长城景颐双利债券型证券投资基金、景顺长城景益货币市场基金、景顺长城成长之星股票型证券投资基金、景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城优质成长股票型证券投资基金、景顺长城优势企业混合型证券投资基金、景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金、景顺长城中小创精选股票型证券投资基金、景顺长城中证科技传媒通信 150 交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城研究精选股票型证券投资基金、景顺长城景丰货币市场基金、景顺长城中国回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城量化精选股票型证券投资基金、景顺长城稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城沪港深精选股票型证券投资基金、景顺长城领先回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城中证科技传媒通信 150 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、景顺长城安享回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、景顺长城泰和回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景瑞收益债券型证券投资基金、景顺长城改革机遇灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景盛双息收益债券型证券投资基金、景顺长城低碳科技主题灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城环保优势股票型证券投资基金、景顺长城量化新动力股票型证券投资基金、景顺长城景盈双利债券型证券投资基金、景顺长城景泰汇利定期开放债券型证券投资基金、景顺长城顺益回报混合型证券投资基金、景顺长城泰安回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景泰丰利纯债债券型证券投资基金、景顺长城景颐丰利债券型证券投资基金、景顺长城政策性金融债债券型证券投资基金、景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金、景顺长城沪港深领先科技股票型证券投资基金、景顺长城睿成灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景泰稳利定期开放债券型证券投资基金、景顺长城量化平衡灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城泰恒回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城量化小盘股票型证券投资基金、景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城 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、景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金、景顺长城量化先锋混合型证券投资基金、景顺长城景泰聚利纯债债券型证券投资基金、景顺长城景泰鑫利纯债债券型证券投资基金、景顺长城智能生活混合型证券投资基金、景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金、景顺长城集英成长两

年定期开放混合型证券投资基金、景顺长城量化港股通股票型证券投资基金、景顺长城景泰盈利纯债债券型证券投资基金、景顺长城绩优成长混合型证券投资基金、景顺长城中短债债券型证券投资基金、景顺长城中证沪港深红利成长低波动指数型证券投资基金、景顺长城稳健养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、景顺长城创新成长混合型证券投资基金、景顺长城景泰纯利债券型证券投资基金、景顺长城养老目标日期 2045 五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、景顺长城弘利 39 个月定期开放债券型证券投资基金、景顺长城品质成长混合型证券投资基金、景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、景顺长城泰申回报混合型证券投资基金、景顺长城科技创新混合型证券投资基金、景顺长城价值领航两年持有期混合型证券投资基金、景顺长城景泰裕利纯债债券型证券投资基金、景顺长城核心优选一年持有期混合型证券投资基金、景顺长城中证红利低波动 100 交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城创业板综指增强型证券投资基金、景顺长城成长领航混合型证券投资基金、景顺长城景颐嘉利 6 个月持有期债券型证券投资基金、景顺长城中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、景顺长城科技创新三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城安鑫回报一年持有期混合型证券投资基金、景顺长城弘远 66 个月定期开放债券型证券投资基金、景顺长城价值稳进三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城竞争优势混合型证券投资基金、景顺长城景泰添利一年定期开放债券型发起式证券投资基金、景顺长城价值边际灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城电子信息产业股票型证券投资基金、景顺长城消费精选混合型证券投资基金、景顺长城景颐招利 6 个月持有期债券型证券投资基金、景顺长城顺鑫回报混合型证券投资基金、景顺长城景泰宝利一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、景顺长城量化成长演化混合型证券投资基金、景顺长城泰祥回报混合型证券投资基金、景顺长城核心中景一年持有期混合型证券投资基金、景顺长城泰保三个月定期开放混合型发起式证券投资基金、景顺长城核心招景混合型证券投资基金、景顺长城景泰恒利一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、景顺长城产业趋势混合型证券投资基金、景顺长城景泰益利纯债债券型证券投资基金、景顺长城成长龙头一年持有期混合型证券投资基金、景顺长城品质长青混合型证券投资基金、景顺长城新能源产业股票型证券投资基金、景顺长城安泽回报一年持有期混合型证券投资基金、景顺长城泰源回报混合型证券投资基金、景顺长城景骊成长混合型证券投资基金、景顺长城安盈回报一年持有期混合型证券投资基金、景顺长城景气成长混合型证券投资基金、景顺长城安益回报一年持有期混合型证券投资基金、景顺长城中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城颐心养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）。其中景顺长城景系列开放式证券投资基金下设景顺长城优选混合型证券投资基金、景顺长城货币市场证券投资基金、景顺长城动力平衡证券投资基

金。

本公司采用团队投资方式，即通过整个投资部门全体人员的共同努力，争取良好投资业绩。

#### 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		
张晓南	本基金的基金经理	2020年7月3日	-	11年	经济学硕士，CFA，FRM。曾任鹏华基金管理有限公司产品规划部高级产品设计师，兴银基金管理有限公司研究发展部研究员、权益投资部基金经理。2020年2月加入本公司，自2020年4月起担任ETF投资部基金经理。具有11年证券、基金行业从业经验。

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”按基金合同生效日填写，“离任日期”为根据公司决定的解聘日期（公告前一日）；对此后的非首任基金经理，“任职日期”指根据公司决定聘任后的公告日期，“离任日期”指根据公司决定的解聘日期（公告前一日）；

2、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。

#### 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

无。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》和《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011年修订）》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价，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 7 次，为投资组合的投资策略需要而发生的同日反向交易，按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年 6 月工业增加值当月同比 8.30%，前值 8.80%，受去年 1 季度疫情影响低基数所致，且去年低基数影响逐渐减弱，预期将很快回到长期均值；当月环比 0.56%，与之前基本持平，后疫情时代复苏趋势延续。6 月 PMI 指数为 50.90，维持在 50 以上，略有回调。6 月 PPI 同比 8.80%，前值 9.00%，环比 0.30%，通胀预期有所回落；CPI 同比 1.10%，前值 1.30%，环比 -0.40%，基本保持稳定。6 月 M2 同比增速 8.60%，M1 同比增速 5.50%，社会融资规模存量同比增长 11.00%，增速逐渐降低至均衡水平。6 月末外汇储备 3.21 万亿美元。受到变异病毒影响，部分国家疫情出现反复，生产活动无法完全恢复，从而令国内二季度延续去年三季度开始的高复苏态势，当前工业生产基本恢复至疫情前水平。2021 年上半年市场各板块走势分化较大，创业板指和科创 50 表现出明显的成长性，代表传统经济的上证 50 表现较差；上证综指、深证成指、沪深 300、中证 500、创业板指和科创 50 的收益率分别为 3.40%、4.78%、0.24%、6.93%、17.22% 和 14.01%，在去年四季度市场回暖后，一季度多数板块有所回调，二季度以芯片及新能源车为代表的科技板块显示出明显的盈利驱动复苏态势。

当前新冠疫情在国内已经得到控制，但全球抗疫形势仍不容乐观。随着病毒变种的逐渐出现，部分前期控制较好的国家疫情又出现了反复。当前英国已经处在第三波疫情爆发期；美国再次出现反弹；印度确诊病例虽较最高点回落，但仍居高不下；印尼成为亚洲除印度之外的又一病毒“培养皿”；日本急于举办奥运会，其国内管制放松令确诊数再次升高，奥运运动员的聚集可能导致新一轮世界疫情传播。

国内经济目前仍然能够享受到疫情红利，在全球主要经济体经济增长停滞甚至衰退的形势下，国内生产厂商在国内疫情结束较早、生产恢复较快的情形下，相当大一部分的填补了国内外需求缺口，且在国外尚未完全走出疫情影响前，这一趋势并不会发生转变。而在全球经济摆脱疫情影响后，国内生产厂商在全球供应链中的地位也会有所提高。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2021 年上半年，本基金份额净值增长率为 9.80%，业绩比较基准收益率为 3.38%。报告期内，

本基金相对于业绩比较基准的日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2% 以内，跟踪误差（年化）控制在 2% 以内。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，疫情仍然在全球蔓延，且由于大部分国家疫苗接种率无法快速提升，疫情拐点仍未可见。全球产能恢复的速度在当前时点无法明确预见，而“中国制造”为全球工业品和消费品的生产做出了卓越的贡献，也为国内经济增长提供了坚实的基础。同时，近期发布的《中共中央、国务院关于支持浦东新区高水平改革开放、打造社会主义现代化建设引领区的意见》提出在全证券市场稳步实施以信息披露为核心的注册制、在科创板引入做市商制度，逐步完善金融基础设置和制度。在整体经济复苏加快的基础上，资本市场仍有强大的吸引力，我们对市场保持乐观。当前继续看好成长板块在全球经济复苏阶段的表现，后续成长性高、现金流好、行业竞争格局稳定且公司地位明确的股票更有优势。

本基金采用完全复制 MSCI 中国 A 股国际通指数的方法进行组合管理，通过控制跟踪误差和跟踪偏离度，力争基金收益和指数收益基本一致。在报告期内，本基金结合申购赎回情况，根据指数成份股及其权重变化定期或不定期调整投资组合，保持对标的指数的紧密跟踪。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人成立基金估值委员会对基金财产的估值方法及程序作决策，基金估值委员会在遵守法律法规的前提下，通过参考行业协会的估值指引及独立第三方估值服务机构的估值数据等方式，谨慎合理地制定高效可行的估值方法，及时准确地进行份额净值的计量，保护基金份额持有人的合法权益。

基金日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行。基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以双方认可的方式报送给基金托管人，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，无误后返回给基金管理人，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

当发生了影响估值方法和程序的有效性及适用性的情况时，通过会议方式启动估值委员会的运作。研究人员凭借其丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究，综合宏观经济、行业发展及个券状况等各方面因素，从价值投资的角度进行理论分析，并根据分析的结果向基金估值委员会提出有关估值方法或估值模型的建议。风险管理人员根据研究人员提出的估值方法或估值模型进行计算及验证，并根据计算和验证的结果与投资人员共同确定估值方法并提交估值委员会。基金事务部基金会计负责与基金托管人沟通，必要时应就所采用的估值技术、假设及输入值得适当性等咨询会计师事务所的专业意见。法律、监察稽核部相关人员负责监察执行估值政策及

程序的合规性，控制执行中可能发生的风险。估值委员会共同讨论通过后，基金事务部基金会计根据估值委员会确认的估值方法对各基金进行估值核算并与基金托管行核对，法律、监察稽核部负责对外进行信息披露。

截止本报告期末，本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司合作，由其提供相关债券品种、流通受限股票的估值参考数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

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

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—景顺长城基金管理有限公司 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，景顺长城基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 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

本托管人认为，景顺长城基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## § 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：景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	3,628,658.52	3,919,553.36
结算备付金		192,566.04	200,323.57
存出保证金		31,849.88	89,999.34
交易性金融资产	6.4.7.2	159,202,885.23	189,005,490.65
其中：股票投资		159,110,748.21	188,974,425.55
基金投资		-	-
债券投资		92,137.02	31,065.10
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		435,671.50	375,641.14
应收利息	6.4.7.5	829.49	1,127.75
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	1.80
资产总计		163,492,460.66	193,592,137.61
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2020 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		63,428.26	76,553.89
应付托管费		12,685.64	15,310.77
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	52,556.41	104,486.80
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	120,385.32	442,617.46
负债合计		249,055.63	638,968.92
<b>所有者权益：</b>			

实收基金	6.4.7.9	94,005,740.00	122,005,740.00
未分配利润	6.4.7.10	69,237,665.03	70,947,428.69
所有者权益合计		163,243,405.03	192,953,168.69
负债和所有者权益总计		163,492,460.66	193,592,137.61

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.7365 元，基金份额总额 94,005,740.00 份。

## 6.2 利润表

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

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		17,102,772.78	12,885,841.46
1. 利息收入		14,191.83	27,379.66
其中：存款利息收入	6.4.7.11	14,158.69	27,362.98
债券利息收入		33.14	16.68
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		27,688,752.05	19,568,418.32
其中：股票投资收益	6.4.7.12	26,615,442.51	18,048,819.51
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	38,604.96	37,459.04
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	1,034,704.58	1,482,139.77
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-10,812,652.63	-6,861,484.23
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	212,481.53	151,527.71
减：二、费用		892,742.32	1,144,327.46
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	390,421.98	535,452.66
2. 托管费	6.4.10.2.2	78,084.34	107,090.46
3. 销售服务费		-	-



4. 交易费用	6.4.7.18	267,554.68	331,175.52
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.02	0.06
7. 其他费用	6.4.7.19	156,681.30	170,608.76
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		16,210,030.46	11,741,514.00
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		16,210,030.46	11,741,514.00

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

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

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	122,005,740.00	70,947,428.69	192,953,168.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	16,210,030.46	16,210,030.46
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-28,000,000.00	-17,919,794.12	-45,919,794.12
其中：1. 基金申购款	38,000,000.00	24,573,524.87	62,573,524.87
2. 基金赎回款	-66,000,000.00	-42,493,318.99	-108,493,318.99
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	94,005,740.00	69,237,665.03	163,243,405.03

项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	326,005,740.00	37,702,172.31	363,707,912.31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	11,741,514.00	11,741,514.00
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-188,000,000.00	-22,315,601.63	-210,315,601.63
其中：1. 基金申购款	60,000,000.00	5,305,841.25	65,305,841.25
2. 基金赎回款	-248,000,000.00	-27,621,442.88	-275,621,442.88
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	138,005,740.00	27,128,084.68	165,133,824.68

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：

康乐

吴建军

邵媛媛

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

景顺长城 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]548 号《关于准予景顺长城 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,由景顺长城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《景顺长城 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指数基金,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 1,533,998,240.00 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 0283 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《景顺长城 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 27 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,534,005,740.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 7,500.00 份基金份额。本基金的基金管理人为景顺长城基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)上证函[2018]67 号文审核同意,本基金 1,534,005,740.00 份基金份额于 2018 年 5 月 25 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城 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,本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数 MSCI 中国 A 股国际通指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股,投资于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%,且不低于非现金基金资产的 80%。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(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票及存托凭证)、股指期货、债券资产(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、现金资产以及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)。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%,年化跟踪误差不超过 2%。本基金的业绩比较基准为 MSCI 中国 A 股国际通指数(MSCI China A Inclusion RMB Index (CNY))。

本基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司以本基金为目标 ETF,募集成立了景顺长城 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“景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 联接基金”)。景顺长城 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景顺长城基金管理有限公司于 2021 年 8 月 19 日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

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

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

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

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)

的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

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

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

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	3,628,658.52
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月至 1 年	-
存款期限 1 年以上	-
其他存款	-
合计	3,628,658.52

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	141,979,284.18	159,110,748.21	17,131,464.03
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	92,137.02	3,037.02
	银行间市场	-	-
	合计	92,137.02	3,037.02
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	142,068,384.18	159,202,885.23	17,134,501.05

注：于 2021 年 6 月 30 日，股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值 0.00 元。

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

### 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

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

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。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应收活期存款利息	731.51
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	78.03
应收债券利息	6.99
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	12.96
合计	829.49

### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	52,556.41
银行间市场应付交易费用	-
合计	52,556.41

### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付券商交易单元保证金	-

应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	86,780.45
应付指数使用费	32,866.29
可退替代款	738.58
合计	120,385.32

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	122,005,740.00	122,005,740.00
本期申购	38,000,000.00	38,000,000.00
本期赎回(以“-”号填列)	-66,000,000.00	-66,000,000.00
- 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	94,005,740.00	94,005,740.00

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	65,861,396.99	5,086,031.70	70,947,428.69
本期利润	27,022,683.09	-10,812,652.63	16,210,030.46
本期基金份额交易产生的变动数	-16,801,849.26	-1,117,944.86	-17,919,794.12
其中：基金申购款	26,482,143.73	-1,908,618.86	24,573,524.87
基金赎回款	-43,283,992.99	790,674.00	-42,493,318.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	76,082,230.82	-6,844,565.79	69,237,665.03

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	12,379.60
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	1,343.20
其他	435.89
合计	14,158.69

## 6.4.7.12 股票投资收益

## 6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	18,488,756.00
股票投资收益——赎回差价收入	8,126,686.51
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	26,615,442.51

## 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	89,909,375.13
减：卖出股票成本总额	71,420,619.13
买卖股票差价收入	18,488,756.00

## 6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
赎回基金份额对价总额	108,493,318.99
减：现金支付赎回款总额	43,688,571.99
减：赎回股票成本总额	56,678,060.49
赎回差价收入	8,126,686.51

## 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	301,333.14
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	262,700.00
减：应收利息总额	28.18
买卖债券差价收入	38,604.96



**6.4.7.14 衍生工具收益**

本基金本报告期无衍生工具收益。

**6.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,034,704.58
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	1,034,704.58

**6.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-10,812,652.63
股票投资	-10,812,624.55
债券投资	-28.08
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-10,812,652.63

注：本基金本会计期间公允价值变动损益—股票投资中包括可退替代款产生的公允价值变动损益-564.00 元。

**6.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	212,481.53
合计	212,481.53

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	267,554.68
银行间市场交易费用	-
合计	267,554.68

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	27,273.08
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	4,018.77
指数使用费	65,522.08
其他费用	360.00
合计	156,681.30

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.0125% 的季费率计提，逐日累计，按季支付，标的指数许可使用费的收取下限为每季度（自然季度）美元 5,000 元。

#### 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，与本基金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
景顺长城基金管理有限公司	基金管理人
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人
长城证券股份有限公司（“长城证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
景顺长城 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（“景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 联接基	本基金的基金管理人管理的其他基金

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

本基金于本报告期及上年度可比区间未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金于本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6 月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	390,421.98	535,452.66
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：支付基金管理人景顺长城基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.50% / 当年天数。

###### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6 月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	78,084.34	107,090.46

注：支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.10% / 当年天数。

**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**

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

**6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明****6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行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**

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行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**

本基金的基金管理人本报告期和上年度可比期间均未运用自有资金投资本基金。

**6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况**

份额单位：份

关联方名称	本期末 2021年6月30日		上年度末 2020年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份 额的比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份 额的比例 (%)
景顺长城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	24,603,800.00	26.17	27,922,500.00	22.89

**6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
农业银行-活期	3,628,658.52	12,379.60	5,388,010.18	24,871.60

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有 9,100 股长城证券的 A 股普通股，成本总额为人民币 106,346.82 元，估值总额为人民币 101,283.00 元，占基金资产净值的比例为 0.06%；本基金持有 264,900 股中国农业银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 870,997.53 元，估值总额为人民币 802,647.00 元，占基金资产净值的比例为 0.49% (2020 年 12 月 31 日，本基金持有 9,500 股长城证券的 A 股普通股，成本总额为人民币 124,449.06 元，估值总额为人民币 122,265.00 元，占基金资产净值的比例为 0.06%；本基金持有 338,900 股中国农业银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 1,121,929.02 元，估值总额为人民币 1,064,146.00 元，占基金资产净值的比例为 0.55%)。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

#### 6.4.12 期末(2021 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300919	中伟股份	2020年12月15日	2021年7月2日	新股流通受限	24.60	163.00	220	5,412.00	35,860.00	-
300927	江天化学	2020年12月29日	2021年7月7日	新股流通受限	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
300929	华骐环保	2021年1月12日	2021年7月21日	新股流通受限	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
300932	三友联众	2021年1月15日	2021年7月22日	新股流通受限	24.69	31.71	379	9,357.51	12,018.09	-
300933	中辰股份	2021年1月15日	2021年7月22日	新股流通受限	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
300937	药易购	2021年1月20日	2021年7月27日	新股流通受限	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-

		日	日								
300941	创识科技	2021年 2月2日	2021年 8月9日	新股流 通受限	21.31	49.94	294	6,265.14	14,682.36	-	
300942	易瑞生物	2021年 2月2日	2021年 8月9日	新股流 通受限	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-	
300943	春晖智控	2021年 2月3日	2021年 8月10日	新股流 通受限	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-	
300948	冠中生态	2021年 2月18日	2021年 8月25日	新股流 通受限	13.00	27.42	216	2,808.00	5,922.72	-	
300948	冠中生态	2021年 6月4日	2021年 8月25日	新股流 通受限	-	27.42	108	-	2,961.36	-	
300953	震裕科技	2021年 3月11日	2021年 9月22日	新股流 通受限	28.77	99.85	195	5,610.15	19,470.75	-	
300955	嘉亨家化	2021年 3月16日	2021年 9月24日	新股流 通受限	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-	
300956	英力股份	2021年 3月16日	2021年 9月27日	新股流 通受限	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-	
300957	贝泰妮	2021年 3月18日	2021年 9月27日	新股流 通受限	47.33	251.96	117	5,537.61	29,479.32	-	
300958	建工修复	2021年 3月18日	2021年 9月29日	新股流 通受限	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-	
300960	通业科技	2021年 3月22日	2021年 9月29日	新股流 通受限	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-	
300961	深水海纳	2021年 3月23日	2021年 9月30日	新股流 通受限	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-	
300962	中金辐照	2021年 3月29日	2021年 10月11日	新股流 通受限	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-	
300966	共同药业	2021年 3月31日	2021年 10月11日	新股流 通受限	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-	
300967	晓鸣	2021年	2021年	新股流	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-	

	股份	4月2日	10月13日	通受限						
301004	嘉益股份	2021年6月18日	2021年12月27日	新股流通受限	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	-
301015	百洋医药	2021年6月22日	2021年12月30日	新股流通受限	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
301016	雷尔伟	2021年6月23日	2021年12月30日	新股流通受限	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
301018	申菱环境	2021年6月28日	2022年1月7日	新股流通受限	8.29	8.29	782	6,482.78	6,482.78	-
301018	申菱环境	2021年6月28日	2021年7月7日	新股流通受限	8.29	8.29	7,029	58,270.41	58,270.41	-
605162	新中港	2021年6月29日	2021年7月7日	新股流通受限	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
605287	德才股份	2021年6月28日	2021年7月6日	新股流通受限	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
688076	诺泰生物	2021年5月12日	2021年11月22日	新股流通受限	15.57	48.55	2,741	42,677.37	133,075.55	-
688087	英科再生	2021年6月30日	2021年7月9日	新股流通受限	21.96	21.96	1,678	36,848.88	36,848.88	-
688109	品茗股份	2021年3月22日	2021年9月30日	新股流通受限	50.05	72.10	838	41,941.90	60,419.80	-
688226	威腾电气	2021年6月28日	2021年7月7日	新股流通受限	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
688355	明志科技	2021年4月30日	2021年11月12日	新股流通受限	17.65	23.80	2,318	40,912.70	55,168.40	-
688383	新益昌	2021年4月21日	2021年10月28日	新股流通受限	19.58	106.24	2,296	44,955.68	243,927.04	-
688499	利元亨	2021年6月23日	2021年7月1日	新股流通受限	38.85	38.85	1,257	48,834.45	48,834.45	-

688565	力源科技	2021年5月6日	2021年11月15日	新股流通受限	9.39	14.00	2,464	23,136.96	34,496.00	-
688677	海泰新光	2021年2月18日	2021年8月26日	新股流通受限	35.76	103.23	1,326	47,417.76	136,882.98	-
688685	迈信林	2021年4月30日	2021年11月15日	新股流通受限	9.02	19.50	2,612	23,560.24	50,934.00	-
688696	极米科技	2021年2月23日	2021年9月3日	新股流通受限	133.73	780.24	465	62,184.45	362,811.60	-

## 6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113049	长汽转债	2021年6月11日	2021年7月8日	新债流通受限	100.00	100.00	40	4,000.00	4,000.00	-
113050	南银转债	2021年6月16日	2021年7月1日	新债流通受限	100.00	100.00	670	67,000.00	67,000.00	-
123117	健帆转债	2021年6月23日	2021年7月12日	新债流通受限	100.00	100.00	34	3,400.00	3,400.00	-
127038	国微转债	2021年6月10日	2021年7月14日	新债流通受限	100.00	100.00	49	4,900.00	4,900.00	-

注：1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起6个月。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。

2、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于6个月的限售期。

3、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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600460	士兰微	2021年6月30日	重大事项停牌	56.35	2021年7月1日	59.49	4,600	107,376.60	259,210.00	-
002024	苏宁易购	2021年6月16日	重大事项停牌	5.59	2021年7月6日	6.15	32,100	282,536.85	179,439.00	-

注：本基金截至 2021 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截止本报告期末，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截止本报告期末，本基金无因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

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 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

本基金在日常经营活动中由金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人秉承全面风险管理的理念，将风险管理融入业务中，建立了以风险管理委员会为核心，由风险管理委员会、督察长、法律监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。各业务部门负责人为其所在部门的风险管理第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控和及时报告的义务。员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。本基金管理人配备的风险管理人员对投资风险进行独立的监控并及时向管理层汇报。

##### 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的发行人

出现违约、拒绝支付到期本息等导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的投资范围及投资比例符合相关法律法规的要求、相关监管机构的相关规定及本基金的合同要求。本基金管理人通过建立和完善内部信用评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。本基金的活期银行存款存放在具有托管资格的银行；本基金存放定期存款前，均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险，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与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在银行间同业市场仅与达到本基金管理人既定信用政策标准的交易对手进行交易，以控制相应的信用风险。

本基金管理人还通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券余额的 10%。

于本期末，本基金持有除国债、央行票据、政策性金融债及地方政府债券之外的债券和资产支持证券资产的账面价值占基金净资产的比例为 0.06%（上年末：0.02%）。

#### **6.4.13.3 流动性风险**

流动性风险，是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难，另一方面来自于基金份额持有人可依据基金合同约定要求赎回其持有的基金份额。

本基金的基金管理人专业审慎、勤勉尽责地管控本基金的流动性风险，全覆盖、多维度的建立以压力测试为核心的流动性风险监测与预警制度，确保本基金组合的资产变现能力与投资者赎回需求匹配与平衡。

##### **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》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）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。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。由本基金的基

金管理人管理的所有开放式基金于开放期内共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制）。

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%。

本基金的基金管理人对其管理的所有开放式基金于开放期内，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

市场风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场价格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。本基金管理人通过对不同类型的风险分别设定风险限制，并由独立于投资部门的风险管理人员监控、报告以及定期风险回顾的方法管理投资组合的市场风险。

##### 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因市场利率变动而发生波动的风险。

本基金管理人通过定期监控组合中债券投资部分的利率风险，及时调整投资组合久期等方法管理利率风险。

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的重新定价日或到期日进行了分类。

## 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	3,628,658.52	-	-	-	-	-	3,628,658.52
结算备付金	192,566.04	-	-	-	-	-	192,566.04
存出保证金	31,849.88	-	-	-	-	-	31,849.88
交易性金融资产	-	-	-	-	92,137.02	159,110,748.21	159,202,885.23
应收利息	-	-	-	-	-	829.49	829.49
应收证券清算款	-	-	-	-	-	435,671.50	435,671.50
资产总计	3,853,074.44	-	-	-	92,137.02	159,547,249.20	163,492,460.66
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	63,428.26	63,428.26
应付托管费	-	-	-	-	-	12,685.64	12,685.64
应付交易费用	-	-	-	-	-	52,556.41	52,556.41
其他负债	-	-	-	-	-	120,385.32	120,385.32
负债总计	-	-	-	-	-	249,055.63	249,055.63
利率敏感度缺口	3,853,074.44	-	-	-	92,137.02	-	-
上年度末 2020年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	3,919,553.36	-	-	-	-	-	3,919,553.36
结算备付金	200,323.57	-	-	-	-	-	200,323.57
存出保证金	89,999.34	-	-	-	-	-	89,999.34
交易性金融资产	-	-	-	-	31,065.10	188,974,425.55	189,005,490.65
应收利息	-	-	-	-	-	1,127.75	1,127.75
应收证券清算款	-	-	-	-	-	375,641.14	375,641.14
其他资产	-	-	-	-	-	1.80	1.80
资产总计	4,209,876.27	-	-	-	31,065.10	189,351,196.24	193,592,137.61
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	76,553.89	76,553.89
应付托管费	-	-	-	-	-	15,310.77	15,310.77
应付交易费用	-	-	-	-	-	104,486.80	104,486.80
其他负债	-	-	-	-	-	442,617.46	442,617.46
负债总计	-	-	-	-	-	638,968.92	638,968.92
利率敏感度缺口	4,209,876.27	-	-	-	31,065.10	-	-

## 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末，本基金持有的债券资产的账面价值占资产净值比例为 0.06%（上年末：0.02%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年末：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。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

##### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

##### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因除外汇风险和利率风险以外的市场价格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证券，所面临的重大价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其它价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

经测算本基金面临的其他价格风险列示如下：

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日		上年度末 2020年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	159,110,748.21	97.47	188,974,425.55	97.94
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	159,110,748.21	97.47	188,974,425.55	97.94

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）		
	本期末（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）	
分析	沪深 300 指数上升 5%	8,041,930.69	9,756,420.70

	沪深 300 指数下降 5%	-8,041,930.69	-9,756,420.70
--	----------------	---------------	---------------

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 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。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 157,143,899.83 元，属于第二层次的余额为 2,058,985.40 元，无属于第三层次的余额(2020 年 12 月 31 日：第一层次 186,970,719.50 元，第二层次 2,034,771.15 元，无第三层次)。

##### (ii) 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。

##### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

##### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 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(2020 年 12 月 31 日：同)。

##### (d) 不以公允价值计量的金融工具

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。

##### (2) 基金申购款

于 2021 年上半年度，本基金申购基金份额的对价总额为 62,573,524.87 元(2020 年上半年度：65,305,841.25 元)，其中包括以股票支付的申购款 35,887,421.66 元和以现金支付的申购款 26,686,103.21 元(2020 年上半年度：其中包括以股票支付的申购款 33,652,125.17 元和以现金支付的申购款 31,653,716.08 元)。

(3) 除公允价值和基金申购款外，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	159,110,748.21	97.32
	其中：股票	159,110,748.21	97.32
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	92,137.02	0.06
	其中：债券	92,137.02	0.06
	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	3,821,224.56	2.34
8	其他各项资产	468,350.87	0.29
9	合计	163,492,460.66	100.00

注：本表权益投资股票项中，含可退替代款估值增值 0.00 元，而 7.2 中不含可退替代款估值增值，因此二者存在差异。

### 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	1,737,112.84	1.06
B	采矿业	3,961,133.49	2.43
C	制造业	93,305,108.95	57.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,867,868.22	1.76
E	建筑业	1,892,886.00	1.16
F	批发和零售业	2,033,661.50	1.25
G	交通运输、仓储和邮政业	4,564,135.58	2.80

H	住宿和餐饮业	182,240.00	0.11
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,650,479.19	2.85
J	金融业	30,259,980.17	18.54
K	房地产业	3,340,348.53	2.05
L	租赁和商务服务业	2,867,156.60	1.76
M	科学研究和技术服务业	2,265,048.60	1.39
N	水利、环境和公共设施管理业	176,682.00	0.11
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	167,120.00	0.10
Q	卫生和社会工作	2,479,198.22	1.52
R	文化、体育和娱乐业	754,380.00	0.46
S	综合	-	-
	合计	157,504,539.89	96.48

### 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

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	5,850.78	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,357,575.04	0.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.01
E	建筑业	11,014.44	0.01
F	批发和零售业	31,044.70	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	87,332.56	0.05
J	金融业	34,721.10	0.02
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	65,649.31	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-



Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,606,208.32	0.98

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

#### 7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	4,487	9,228,412.90	5.65
2	300750	宁德时代	8,315	4,446,862.00	2.72
3	000858	五粮液	13,872	4,132,330.08	2.53
4	600036	招商银行	73,378	3,976,353.82	2.44
5	601318	中国平安	38,537	2,477,158.36	1.52
6	300760	迈瑞医疗	4,400	2,112,220.00	1.29
7	601888	中国中免	7,000	2,100,700.00	1.29
8	601012	隆基股份	18,828	1,672,679.52	1.02
9	600900	长江电力	80,912	1,670,023.68	1.02
10	002594	比亚迪	6,520	1,636,520.00	1.00
11	603288	海天味业	12,485	1,609,940.75	0.99
12	000001	平安银行	69,000	1,560,780.00	0.96
13	600276	恒瑞医药	22,734	1,545,229.98	0.95
14	601166	兴业银行	73,900	1,518,645.00	0.93
15	603259	药明康德	9,140	1,431,232.60	0.88
16	600809	山西汾酒	3,101	1,389,248.00	0.85
17	300015	爱尔眼科	19,057	1,352,665.86	0.83
18	000568	泸州老窖	5,235	1,235,145.90	0.76
19	600309	万华化学	11,165	1,214,975.30	0.74
20	300059	东方财富	36,784	1,206,147.36	0.74
21	601398	工商银行	223,600	1,156,012.00	0.71
22	002475	立讯精密	24,880	1,144,480.00	0.70
23	002714	牧原股份	18,722	1,138,672.04	0.70
24	002304	洋河股份	5,413	1,121,573.60	0.69
25	002352	顺丰控股	16,250	1,100,125.00	0.67
26	300122	智飞生物	5,700	1,064,361.00	0.65
27	601919	中远海控	34,402	1,050,637.08	0.64
28	600000	浦发银行	104,400	1,044,000.00	0.64
29	603501	韦尔股份	3,100	998,200.00	0.61

30	600436	片仔癀	2,204	988,053.20	0.61
31	600030	中信证券	37,800	942,732.00	0.58
32	000333	美的集团	12,500	892,125.00	0.55
33	600031	三一重工	30,100	875,007.00	0.54
34	002142	宁波银行	21,406	834,191.82	0.51
35	000002	万科A	34,585	823,468.85	0.50
36	601288	农业银行	264,900	802,647.00	0.49
37	600887	伊利股份	21,600	795,528.00	0.49
38	601816	京沪高铁	145,500	769,695.00	0.47
39	000725	京东方A	120,400	751,296.00	0.46
40	002812	恩捷股份	3,200	749,120.00	0.46
41	300014	亿纬锂能	6,785	705,165.05	0.43
42	601601	中国太保	24,300	703,971.00	0.43
43	601668	中国建筑	149,160	693,594.00	0.42
44	600438	通威股份	15,968	690,935.36	0.42
45	601328	交通银行	139,500	683,550.00	0.42
46	601899	紫金矿业	70,100	679,269.00	0.42
47	300124	汇川技术	9,137	678,513.62	0.42
48	300782	卓胜微	1,200	645,000.00	0.40
49	002493	荣盛石化	35,950	620,856.50	0.38
50	600104	上汽集团	27,695	608,459.15	0.37
51	600019	宝钢股份	79,156	604,751.84	0.37
52	300274	阳光电源	5,200	598,312.00	0.37
53	600585	海螺水泥	14,249	584,921.45	0.36
54	000661	长春高新	1,500	580,500.00	0.36
55	600690	海尔智家	22,334	578,673.94	0.35
56	600016	民生银行	126,060	555,924.60	0.34
57	601818	光大银行	147,000	555,660.00	0.34
58	600346	恒力石化	20,840	546,841.60	0.33
59	002230	科大讯飞	7,900	533,882.00	0.33
60	000538	云南白药	4,600	532,312.00	0.33
61	300759	康龙化成	2,400	520,776.00	0.32
62	300433	蓝思科技	17,600	517,616.00	0.32
63	002241	歌尔股份	12,100	517,154.00	0.32
64	600196	复星医药	7,108	512,700.04	0.31
65	600048	保利地产	42,500	511,700.00	0.31
66	600703	三安光电	15,900	509,595.00	0.31
67	600893	航发动力	9,482	504,347.58	0.31
68	600999	招商证券	26,320	500,606.40	0.31
69	002371	北方华创	1,800	499,284.00	0.31
70	600028	中国石化	113,200	493,552.00	0.30
71	600763	通策医疗	1,200	493,200.00	0.30

72	603799	华友钴业	4,310	492,202.00	0.30
73	002027	分众传媒	52,160	490,825.60	0.30
74	002311	海大集团	5,900	481,440.00	0.29
75	601066	中信建投	15,300	480,879.00	0.29
76	002460	赣锋锂业	3,950	478,305.50	0.29
77	601658	邮储银行	94,500	474,390.00	0.29
78	601088	中国神华	23,430	457,353.60	0.28
79	600406	国电南瑞	19,653	456,735.72	0.28
80	601211	国泰君安	26,628	456,403.92	0.28
81	000063	中兴通讯	13,700	455,251.00	0.28
82	603986	兆易创新	2,380	447,202.00	0.27
83	300413	芒果超媒	6,290	431,494.00	0.26
84	000338	潍柴动力	24,100	430,667.00	0.26
85	600745	闻泰科技	4,400	426,360.00	0.26
86	601225	陕西煤业	35,500	420,675.00	0.26
87	000625	长安汽车	15,811	415,513.08	0.25
88	601229	上海银行	50,504	414,132.80	0.25
89	002129	中环股份	10,700	413,020.00	0.25
90	601688	华泰证券	26,109	412,522.20	0.25
91	601857	中国石油	76,749	406,002.21	0.25
92	601100	恒立液压	4,664	400,730.88	0.25
93	600660	福耀玻璃	7,100	396,535.00	0.24
94	600837	海通证券	34,324	394,726.00	0.24
95	300454	深信服	1,500	389,220.00	0.24
96	603486	科沃斯	1,700	387,736.00	0.24
97	600588	用友网络	11,622	386,547.72	0.24
98	601988	中国银行	124,900	384,692.00	0.24
99	300999	金龙鱼	4,500	382,320.00	0.23
100	000100	TCL 科技	49,800	380,970.00	0.23
101	601390	中国中铁	72,400	379,376.00	0.23
102	000166	申万宏源	80,100	374,868.00	0.23
103	601009	南京银行	35,566	374,154.32	0.23
104	600919	江苏银行	52,480	372,608.00	0.23
105	300601	康泰生物	2,500	372,500.00	0.23
106	601169	北京银行	75,100	365,737.00	0.22
107	600760	中航沈飞	5,794	349,378.20	0.21
108	603806	福斯特	3,320	349,031.60	0.21
109	600570	恒生电子	3,729	347,729.25	0.21
110	002709	天赐材料	3,260	347,450.80	0.21
111	601633	长城汽车	7,900	344,361.00	0.21
112	300142	沃森生物	5,503	339,535.10	0.21
113	002049	紫光国微	2,200	339,218.00	0.21

114	600132	重庆啤酒	1,700	336,515.00	0.21
115	601336	新华保险	7,319	336,015.29	0.21
116	002821	凯莱英	900	335,340.00	0.21
117	000596	古井贡酒	1,400	335,300.00	0.21
118	601989	中国重工	81,053	333,938.36	0.20
119	601628	中国人寿	9,850	333,816.50	0.20
120	603659	璞泰来	2,440	333,304.00	0.20
121	601155	新城控股	8,000	332,800.00	0.20
122	300498	温氏股份	22,640	325,336.80	0.20
123	000895	双汇发展	10,200	324,360.00	0.20
124	603993	洛阳钼业	62,800	324,048.00	0.20
125	601138	工业富联	25,857	320,885.37	0.20
126	000776	广发证券	21,000	317,940.00	0.19
127	688185	康希诺	400	311,108.00	0.19
128	600926	杭州银行	21,000	309,750.00	0.19
129	300595	欧普康视	2,980	308,579.00	0.19
130	002179	中航光电	3,900	308,178.00	0.19
131	001979	招商蛇口	28,100	307,695.00	0.19
132	000799	酒鬼酒	1,200	306,720.00	0.19
133	002050	三花智控	12,770	306,224.60	0.19
134	600989	宝丰能源	21,700	296,856.00	0.18
135	600741	华域汽车	11,200	294,224.00	0.18
136	002841	视源股份	2,334	290,092.86	0.18
137	600600	青岛啤酒	2,482	287,043.30	0.18
138	000963	华东医药	6,217	286,044.17	0.18
139	600015	华夏银行	45,518	281,756.42	0.17
140	603899	晨光文具	3,300	279,048.00	0.17
141	601901	方正证券	29,228	273,574.08	0.17
142	002601	龙蟠佰利	7,900	273,182.00	0.17
143	300408	三环集团	6,400	271,488.00	0.17
144	300628	亿联网络	3,203	268,411.40	0.16
145	600111	北方稀土	12,903	267,092.10	0.16
146	600150	中国船舶	15,900	262,509.00	0.16
147	002001	新和成	9,140	262,135.20	0.16
148	601985	中国核电	51,700	261,602.00	0.16
149	600460	士兰微	4,600	259,210.00	0.16
150	000768	中航西飞	9,800	257,544.00	0.16
151	603882	金域医学	1,600	255,632.00	0.16
152	002568	百润股份	2,680	254,037.20	0.16
153	601877	正泰电器	7,600	253,688.00	0.16
154	603833	欧派家居	1,787	253,682.52	0.16
155	300347	泰格医药	1,300	251,290.00	0.15

156	600010	包钢股份	162,000	251,100.00	0.15
157	601788	光大证券	13,827	247,365.03	0.15
158	601600	中国铝业	46,500	246,450.00	0.15
159	600547	山东黄金	12,804	246,092.88	0.15
160	300529	健帆生物	2,830	244,398.80	0.15
161	002736	国信证券	22,700	244,025.00	0.15
162	603737	三棵树	1,360	239,360.00	0.15
163	603369	今世缘	4,400	238,304.00	0.15
164	000301	东方盛虹	11,400	238,260.00	0.15
165	002648	卫星石化	6,060	237,491.40	0.15
166	600584	长电科技	6,300	237,384.00	0.15
167	600886	国投电力	24,700	237,367.00	0.15
168	601916	浙商银行	59,400	235,818.00	0.14
169	300496	中科创达	1,500	235,590.00	0.14
170	000786	北新建材	6,000	235,500.00	0.14
171	000876	新希望	16,001	234,734.67	0.14
172	002007	华兰生物	6,390	234,385.20	0.14
173	002064	华峰化学	16,400	232,880.00	0.14
174	000157	中联重科	25,100	231,924.00	0.14
175	600426	华鲁恒升	7,440	230,268.00	0.14
176	601377	兴业证券	23,800	229,908.00	0.14
177	002600	领益智造	25,000	229,750.00	0.14
178	603345	安井食品	900	228,618.00	0.14
179	002414	高德红外	8,260	227,810.80	0.14
180	300316	晶盛机电	4,500	227,250.00	0.14
181	601939	建设银行	34,100	226,765.00	0.14
182	601799	星宇股份	1,000	225,720.00	0.14
183	002236	大华股份	10,600	223,660.00	0.14
184	000938	紫光股份	10,079	220,528.52	0.14
185	600176	中国巨石	14,173	219,823.23	0.13
186	600029	南方航空	36,300	218,526.00	0.13
187	000069	华侨城 A	29,100	216,504.00	0.13
188	600779	水井坊	1,700	214,795.00	0.13
189	300033	同花顺	1,900	214,282.00	0.13
190	002791	坚朗五金	1,100	213,455.00	0.13
191	601966	玲珑轮胎	4,860	212,576.40	0.13
192	600958	东方证券	21,200	211,788.00	0.13
193	601669	中国电建	54,300	210,141.00	0.13
194	603160	汇顶科技	1,600	207,408.00	0.13
195	601360	三六零	16,911	206,483.31	0.13
196	300003	乐普医疗	6,300	202,356.00	0.12
197	300661	圣邦股份	800	202,184.00	0.12

197	600115	中国东航	39,800	202,184.00	0.12
198	600845	宝信软件	3,940	200,546.00	0.12
199	300146	汤臣倍健	6,000	197,400.00	0.12
200	002074	国轩高科	4,500	196,020.00	0.12
201	601233	桐昆股份	8,100	195,129.00	0.12
202	600061	国投资本	22,831	193,835.19	0.12
203	002938	鹏鼎控股	5,400	193,752.00	0.12
204	601995	中金公司	3,100	190,650.00	0.12
205	600143	金发科技	9,100	189,826.00	0.12
206	600183	生益科技	8,100	189,621.00	0.12
207	601618	中国中冶	63,400	188,932.00	0.12
208	002916	深南电路	1,680	186,698.40	0.11
209	601111	中国国航	23,600	183,608.00	0.11
210	300207	欣旺达	5,600	182,336.00	0.11
211	600754	锦江酒店	3,200	182,240.00	0.11
212	601021	春秋航空	3,200	182,080.00	0.11
213	300751	迈为股份	400	181,880.00	0.11
214	002459	晶澳科技	3,700	181,300.00	0.11
215	002555	三七互娱	7,500	180,150.00	0.11
216	002024	苏宁易购	32,100	179,439.00	0.11
217	601878	浙商证券	13,700	179,196.00	0.11
218	002252	上海莱士	23,900	179,011.00	0.11
219	603185	上机数控	1,000	178,950.00	0.11
220	000425	徐工机械	27,800	177,086.00	0.11
221	603517	绝味食品	2,100	177,009.00	0.11
222	601636	旗滨集团	9,500	176,320.00	0.11
223	002920	德赛西威	1,600	176,128.00	0.11
224	300285	国瓷材料	3,500	170,625.00	0.10
225	603816	顾家家居	2,200	170,016.00	0.10
226	002602	世纪华通	26,420	169,616.40	0.10
227	600089	特变电工	13,144	168,900.40	0.10
228	688008	澜起科技	2,682	167,303.16	0.10
229	002607	中公教育	8,000	167,120.00	0.10
230	600332	白云山	4,926	166,745.10	0.10
231	300676	华大基因	1,400	166,040.00	0.10
232	600161	天坛生物	4,820	165,085.00	0.10
233	600079	人福医药	5,800	163,966.00	0.10
234	688002	睿创微纳	1,642	163,920.86	0.10
235	601881	中国银河	15,200	163,856.00	0.10
236	002624	完美世界	6,851	163,807.41	0.10
237	600009	上海机场	3,400	163,642.00	0.10
238	600383	金地集团	15,962	163,450.88	0.10

239	600362	江西铜业	7,300	163,374.00	0.10
240	600885	宏发股份	2,600	163,020.00	0.10
241	601838	成都银行	12,800	161,792.00	0.10
242	300223	北京君正	1,600	161,472.00	0.10
243	600674	川投能源	13,000	160,290.00	0.10
244	601727	上海电气	37,800	160,272.00	0.10
245	601933	永辉超市	33,808	159,911.84	0.10
246	603444	吉比特	300	159,000.00	0.10
247	002340	格林美	17,000	158,950.00	0.10
248	002625	光启技术	7,600	158,156.00	0.10
249	601865	福莱特	4,000	158,120.00	0.10
250	600352	浙江龙盛	11,500	158,010.00	0.10
251	600298	安琪酵母	2,900	157,702.00	0.10
252	600606	绿地控股	28,800	156,960.00	0.10
253	600018	上港集团	32,900	156,933.00	0.10
254	000703	恒逸石化	13,010	155,469.50	0.10
255	300144	宋城演艺	9,220	154,896.00	0.09
256	002080	中材科技	5,900	154,403.00	0.09
257	002508	老板电器	3,300	153,450.00	0.09
258	300450	先导智能	2,540	152,755.60	0.09
259	601216	君正集团	30,000	152,700.00	0.09
260	600219	南山铝业	42,400	152,640.00	0.09
261	601117	中国化学	17,400	152,424.00	0.09
262	002353	杰瑞股份	3,400	151,980.00	0.09
263	000066	中国长城	10,400	151,840.00	0.09
264	603658	安图生物	2,000	151,540.00	0.09
265	300558	贝达药业	1,400	151,536.00	0.09
266	000825	太钢不锈	20,200	151,298.00	0.09
267	600862	中航高科	4,900	150,822.00	0.09
268	300677	英科医疗	1,200	149,760.00	0.09
269	601162	天风证券	30,800	149,688.00	0.09
270	002185	华天科技	9,700	149,283.00	0.09
271	600489	中金黄金	17,215	148,393.30	0.09
272	002202	金风科技	12,184	148,157.44	0.09
273	603127	昭衍新药	800	147,000.00	0.09
274	601689	拓普集团	3,900	145,977.00	0.09
275	000977	浪潮信息	5,156	145,038.28	0.09
276	688009	中国通号	25,449	144,804.81	0.09
277	600315	上海家化	2,400	144,336.00	0.09
278	601607	上海医药	6,800	143,684.00	0.09
279	000783	长江证券	19,600	143,472.00	0.09
280	000932	华菱钢铁	21,700	143,220.00	0.09

281	603589	口子窖	2,100	142,149.00	0.09
282	603456	九洲药业	2,900	140,882.00	0.09
283	600704	物产中大	17,900	140,873.00	0.09
284	300037	新宙邦	1,400	140,140.00	0.09
285	300724	捷佳伟创	1,200	139,212.00	0.09
286	603233	大参林	2,720	139,019.20	0.09
287	002013	中航机电	13,800	138,966.00	0.09
288	002120	韵达股份	10,210	138,141.30	0.08
289	601990	南京证券	13,100	137,812.00	0.08
290	603605	珀莱雅	700	137,697.00	0.08
291	300699	光威复材	1,800	136,710.00	0.08
292	002444	巨星科技	4,000	136,320.00	0.08
293	600109	国金证券	10,700	135,783.00	0.08
294	600188	兖州煤业	8,800	135,168.00	0.08
295	601696	中银证券	6,500	133,835.00	0.08
296	002690	美亚光电	2,400	133,824.00	0.08
297	002223	鱼跃医疗	3,500	133,455.00	0.08
298	600655	豫园股份	11,500	133,285.00	0.08
299	601108	财通证券	12,700	133,223.00	0.08
300	601872	招商轮船	28,660	132,409.20	0.08
301	603939	益丰药房	2,358	132,260.22	0.08
302	000807	云铝股份	11,100	132,090.00	0.08
303	002157	正邦科技	11,000	131,450.00	0.08
304	002673	西部证券	15,842	130,696.50	0.08
305	002409	雅克科技	1,600	129,600.00	0.08
306	000027	深圳能源	14,020	128,563.40	0.08
307	002294	信立泰	3,880	127,652.00	0.08
308	603638	艾迪精密	2,960	126,895.20	0.08
309	002511	中顺洁柔	4,600	126,730.00	0.08
310	002044	美年健康	13,876	126,410.36	0.08
311	000830	鲁西化工	6,700	125,491.00	0.08
312	601077	渝农商行	31,400	125,286.00	0.08
313	601699	潞安环能	10,600	125,186.00	0.08
314	002384	东山精密	6,000	125,040.00	0.08
315	601319	中国人保	21,000	124,530.00	0.08
316	002078	太阳纸业	9,300	124,155.00	0.08
317	000050	深天马 A	8,700	123,366.00	0.08
318	000728	国元证券	15,460	123,216.20	0.08
319	600486	扬农化工	1,100	122,947.00	0.08
320	600705	中航资本	31,700	122,679.00	0.08
321	600699	均胜电子	4,800	122,496.00	0.08
322	002603	以岭药业	4,200	122,472.00	0.08



323	002180	纳思达	3,800	122,360.00	0.07
324	300253	卫宁健康	7,520	122,350.40	0.07
325	002032	苏泊尔	1,900	121,201.00	0.07
326	000739	普洛药业	4,100	120,540.00	0.07
327	000983	山西焦煤	14,490	120,411.90	0.07
328	603613	国联股份	1,200	119,964.00	0.07
329	000800	一汽解放	11,000	119,020.00	0.07
330	002430	杭氧股份	3,400	117,606.00	0.07
331	002405	四维图新	8,000	117,600.00	0.07
332	002507	涪陵榨菜	3,100	116,746.00	0.07
333	000723	美锦能源	15,400	116,424.00	0.07
334	002372	伟星新材	5,600	115,752.00	0.07
335	600872	中炬高新	2,749	115,512.98	0.07
336	300357	我武生物	1,800	115,416.00	0.07
337	600369	西南证券	23,600	114,932.00	0.07
338	600827	百联股份	5,700	114,855.00	0.07
339	601555	东吴证券	13,699	114,249.66	0.07
340	002156	通富微电	4,700	112,988.00	0.07
341	600372	中航电子	6,800	112,540.00	0.07
342	300251	光线传媒	10,400	112,424.00	0.07
343	600739	辽宁成大	5,400	112,374.00	0.07
344	600233	圆通速递	11,200	112,112.00	0.07
345	603707	健友股份	2,680	111,890.00	0.07
346	601615	明阳智能	6,900	111,711.00	0.07
347	002152	广电运通	8,500	110,755.00	0.07
348	600803	新奥股份	6,700	110,617.00	0.07
349	688006	杭可科技	1,299	110,415.00	0.07
350	000513	丽珠集团	2,200	110,044.00	0.07
351	000860	顺鑫农业	2,600	109,668.00	0.07
352	600011	华能国际	25,987	109,665.14	0.07
353	000656	金科股份	18,900	109,431.00	0.07
354	600522	中天科技	10,900	109,000.00	0.07
355	002138	顺络电子	2,800	108,556.00	0.07
356	600177	雅戈尔	16,400	108,076.00	0.07
357	601058	赛轮轮胎	10,800	107,892.00	0.07
358	600392	盛和资源	6,200	107,632.00	0.07
359	000547	航天发展	5,700	107,559.00	0.07
360	600875	东方电气	9,800	107,506.00	0.07
361	601198	东兴证券	9,800	107,114.00	0.07
362	600642	申能股份	17,400	106,836.00	0.07
363	600521	华海药业	5,110	106,696.80	0.07
364	002797	第一创业	14,900	106,386.00	0.07

365	600039	四川路桥	16,900	105,963.00	0.06
366	002030	达安基因	4,976	105,690.24	0.06
367	600038	中直股份	2,000	105,480.00	0.06
368	000021	深科技	5,500	105,270.00	0.06
369	002299	圣农发展	4,400	105,072.00	0.06
370	002541	鸿路钢构	1,800	105,030.00	0.06
371	300136	信维通信	3,400	104,992.00	0.06
372	603866	桃李面包	3,360	104,832.00	0.06
373	600549	厦门钨业	5,000	104,150.00	0.06
374	603267	鸿远电子	800	102,336.00	0.06
375	600998	九州通	6,631	101,918.47	0.06
376	002422	科伦药业	5,100	101,745.00	0.06
377	000630	铜陵有色	37,400	101,728.00	0.06
378	002385	大北农	14,900	101,320.00	0.06
379	002939	长城证券	9,100	101,283.00	0.06
380	300482	万孚生物	1,560	100,916.40	0.06
381	600516	方大炭素	13,514	100,544.16	0.06
382	600895	张江高科	5,500	100,485.00	0.06
383	600415	小商品城	19,500	100,425.00	0.06
384	600848	上海临港	5,600	100,240.00	0.06
385	603712	七一二	2,700	97,470.00	0.06
386	603338	浙江鼎力	1,660	97,425.40	0.06
387	600066	宇通客车	7,800	97,422.00	0.06
388	002429	兆驰股份	16,000	97,120.00	0.06
389	600536	中国软件	1,700	96,781.00	0.06
390	300308	中际旭创	2,500	96,300.00	0.06
391	002266	浙富控股	19,000	94,810.00	0.06
392	600380	健康元	6,900	94,737.00	0.06
393	002563	森马服饰	7,900	94,405.00	0.06
394	002463	沪电股份	6,100	94,367.00	0.06
395	600598	北大荒	6,300	94,248.00	0.06
396	000975	银泰黄金	9,860	93,768.60	0.06
397	002373	千方科技	5,600	93,520.00	0.06
398	600909	华安证券	16,710	93,074.70	0.06
399	000709	河钢股份	37,700	92,742.00	0.06
400	603218	日月股份	3,400	92,072.00	0.06
401	000999	华润三九	3,400	90,950.00	0.06
402	603858	步长制药	4,031	90,657.19	0.06
403	002010	传化智联	11,700	90,207.00	0.06
404	002925	盈趣科技	2,310	89,882.10	0.06
405	002926	华西证券	9,300	89,559.00	0.05
406	600988	赤峰黄金	5,900	88,441.00	0.05

407	601456	国联证券	5,700	87,780.00	0.05
408	601231	环旭电子	5,219	87,731.39	0.05
409	002242	九阳股份	2,700	87,723.00	0.05
410	002065	东华软件	11,000	87,230.00	0.05
411	600170	上海建工	31,600	87,216.00	0.05
412	002146	荣盛发展	15,400	86,856.00	0.05
413	600867	通化东宝	7,205	86,027.70	0.05
414	600511	国药股份	2,600	85,956.00	0.05
415	002500	山西证券	12,740	85,485.40	0.05
416	002075	沙钢股份	7,800	85,098.00	0.05
417	002127	南极电商	8,700	84,999.00	0.05
418	002456	欧菲光	9,500	84,360.00	0.05
419	600801	华新水泥	4,800	84,336.00	0.05
420	002958	青农商行	19,700	84,316.00	0.05
421	600160	巨化股份	9,500	83,980.00	0.05
422	000738	航发控制	4,000	83,320.00	0.05
423	600027	华电国际	24,100	82,904.00	0.05
424	000423	东阿阿胶	2,300	82,593.00	0.05
425	000988	华工科技	3,500	82,320.00	0.05
426	000987	越秀金控	6,500	82,290.00	0.05
427	002153	石基信息	3,498	82,237.98	0.05
428	601099	太平洋	24,200	82,038.00	0.05
429	000750	国海证券	19,340	82,001.60	0.05
430	300070	碧水源	11,200	81,872.00	0.05
431	600153	建发股份	10,090	81,729.00	0.05
432	600688	上海石化	21,630	81,328.80	0.05
433	002212	天融信	4,100	81,057.00	0.05
434	300463	迈克生物	1,900	79,971.00	0.05
435	600256	广汇能源	24,000	79,920.00	0.05
436	601992	金隅集团	29,600	79,624.00	0.05
437	000961	中南建设	13,400	79,328.00	0.05
438	300773	拉卡拉	2,800	79,044.00	0.05
439	002558	巨人网络	5,900	78,470.00	0.05
440	601598	中国外运	15,500	78,275.00	0.05
441	600859	王府井	2,700	77,976.00	0.05
442	300383	光环新网	5,400	77,706.00	0.05
443	002557	洽洽食品	1,800	77,580.00	0.05
444	002151	北斗星通	1,800	77,526.00	0.05
445	002465	海格通信	8,100	76,626.00	0.05
446	002705	新宝股份	2,900	76,125.00	0.05
447	000671	阳光城	14,600	75,920.00	0.05
448	600026	中远海能	12,300	75,768.00	0.05

449	002081	金螳螂	9,500	75,240.00	0.05
450	603883	老百姓	1,420	74,805.60	0.05
451	603027	千禾味业	2,840	74,663.60	0.05
452	600498	烽火通信	4,000	74,520.00	0.05
453	002019	亿帆医药	4,300	74,175.00	0.05
454	000998	隆平高科	4,600	73,784.00	0.05
455	600340	华夏幸福	13,820	72,416.80	0.04
456	000729	燕京啤酒	10,000	72,400.00	0.04
457	002506	协鑫集成	20,800	72,384.00	0.04
458	002683	宏大爆破	2,600	72,202.00	0.04
459	600879	航天电子	9,600	72,192.00	0.04
460	300088	长信科技	8,700	71,862.00	0.04
461	000402	金融街	10,600	71,550.00	0.04
462	600529	山东药玻	2,100	71,295.00	0.04
463	600583	海油工程	15,700	70,650.00	0.04
464	300296	利亚德	9,000	70,380.00	0.04
465	000686	东北证券	8,300	70,135.00	0.04
466	000629	攀钢钒钛	30,500	69,845.00	0.04
467	002727	一心堂	2,100	69,531.00	0.04
468	000540	中天金融	24,900	67,977.00	0.04
469	300418	昆仑万维	4,100	67,158.00	0.04
470	001914	招商积余	3,700	63,566.00	0.04
471	000623	吉林敖东	4,100	63,509.00	0.04
472	000627	天茂集团	17,500	63,350.00	0.04
473	300212	易华录	2,300	61,893.00	0.04
474	000581	威孚高科	2,953	61,510.99	0.04
475	601128	常熟银行	9,700	60,140.00	0.04
476	000401	冀东水泥	4,700	58,045.00	0.04
477	002399	海普瑞	3,600	57,348.00	0.04
478	002131	利欧股份	24,000	56,160.00	0.03
479	601098	中南传媒	6,300	55,566.00	0.03
480	002572	索菲亚	1,600	38,720.00	0.02

### 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

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	688696	极米科技	465	362,811.60	0.22
2	688383	新益昌	2,296	243,927.04	0.15
3	688677	海泰新光	1,326	136,882.98	0.08
4	688076	诺泰生物	2,741	133,075.55	0.08
5	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.04

6	688109	品茗股份	838	60,419.80	0.04
7	688355	明志科技	2,318	55,168.40	0.03
8	688685	迈信林	2,612	50,934.00	0.03
9	688499	利元亨	1,257	48,834.45	0.03
10	688087	英科再生	1,678	36,848.88	0.02
11	300919	中伟股份	220	35,860.00	0.02
12	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.02
13	688565	力源科技	2,464	34,496.00	0.02
14	300957	贝泰妮	117	29,479.32	0.02
15	300953	震裕科技	195	19,470.75	0.01
16	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.01
17	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.01
18	300941	创识科技	294	14,682.36	0.01
19	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.01
20	300937	药易购	244	13,105.24	0.01
21	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.01
22	603171	税友股份	637	12,230.40	0.01
23	300932	三友联众	379	12,018.09	0.01
24	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.01
25	605287	德才股份	349	11,014.44	0.01
26	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.01
27	300956	英力股份	371	9,571.80	0.01
28	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.01
29	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.01
30	300966	共同药业	286	9,020.44	0.01
31	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.01
32	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.01
33	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.01
34	300958	建工修复	300	8,166.00	0.01
35	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
36	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
37	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
38	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
39	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
40	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
41	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000858	五粮液	2,289,738.00	1.19
2	300750	宁德时代	2,004,824.00	1.04

3	000333	美的集团	1,647,283.00	0.85
4	300760	迈瑞医疗	1,551,229.00	0.80
5	600519	贵州茅台	1,237,549.00	0.64
6	000001	平安银行	865,698.00	0.45
7	002714	牧原股份	776,900.00	0.40
8	002352	顺丰控股	770,207.00	0.40
9	000568	泸州老窖	658,542.00	0.34
10	002475	立讯精密	657,882.00	0.34
11	601318	中国平安	657,372.00	0.34
12	002594	比亚迪	654,564.00	0.34
13	300059	东方财富	612,089.30	0.32
14	000002	万科 A	603,196.00	0.31
15	601816	京沪高铁	597,194.00	0.31
16	300015	爱尔眼科	580,907.00	0.30
17	600036	招商银行	561,849.00	0.29
18	002304	洋河股份	558,825.00	0.29
19	601888	中国中免	546,437.00	0.28
20	002142	宁波银行	531,220.00	0.28

注：买入金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

#### 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	000858	五粮液	3,437,585.82	1.78
2	300750	宁德时代	2,842,362.00	1.47
3	002415	海康威视	2,410,016.76	1.25
4	300760	迈瑞医疗	1,591,592.00	0.82
5	000001	平安银行	1,270,227.15	0.66
6	002714	牧原股份	1,184,043.70	0.61
7	002475	立讯精密	1,023,033.05	0.53
8	002594	比亚迪	1,020,498.00	0.53
9	000568	泸州老窖	1,002,488.00	0.52
10	000002	万科 A	915,815.00	0.47
11	300059	东方财富	882,889.00	0.46
12	002352	顺丰控股	873,531.72	0.45
13	600519	贵州茅台	865,233.44	0.45
14	002271	东方雨虹	860,671.00	0.45
15	300015	爱尔眼科	857,628.00	0.44
16	002304	洋河股份	842,828.00	0.44
17	300122	智飞生物	765,017.00	0.40
18	002142	宁波银行	763,160.00	0.40
19	300014	亿纬锂能	676,105.00	0.35

20	000725	京东方 A	654,612.00	0.34
----	--------	-------	------------	------

注：卖出金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

#### 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	73,160,205.17
卖出股票收入（成交）总额	89,909,375.13

注：买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额均为买卖股票成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	92,137.02	0.06
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	92,137.02	0.06

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113050	南银转债	670	67,000.00	0.04
2	127036	三花转债	98	12,837.02	0.01
3	127038	国微转债	49	4,900.00	0.00
4	113049	长汽转债	40	4,000.00	0.00
5	123117	健帆转债	34	3,400.00	0.00

#### 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

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 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

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

## 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

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

## 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

1、招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”，股票代码：600036）于 2021 年 5 月 17 日收到中国银行保险监督管理委员会出具的行政处罚决定书（银保监罚决字（2021）16 号）。其因为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产、违规协助无衍生产品交易业务资格的银行发行结构性衍生产品、理财产品之间风险隔离不到位等二十七项违法违规事实，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十五条、第四十六条和相关审慎经营规则，被处以罚款 7170 万元。

招商银行于 2020 年 7 月 28 日收到中国银行保险监督管理委员会上海监管局出具的行政处罚决定书（沪银保监银罚决字（2020）7 号）。其信用卡中心因某客户个人信息未尽安全保护义务、对部分信用卡催收外包管理严重不审慎，被处以 100 万元罚款。

本基金基金经理依据基金合同及公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对招商银行进行了投资。

2、南京银行股份有限公司（以下简称“南京银行”，股票代码：601009）于 2020 年 12 月 28 日收到人民银行南京分行出具的行政处罚决定书（（南银）罚字（2020）第 30 号）。其因未按规定履行客户身份识别义务、未按照规定保存客户身份资料和交易记录等多项违法违规行为，被警告，



并处罚款 736 万元，没收违法所得人民币 208778.02 元。

本基金基金经理依据基金合同及公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对南京银行进行了投资。

3、中国平安保险(集团)股份有限公司（以下简称“中国平安”，股票代码：601318）因其子公司中国平安财产保险股份有限公司于 2020 年 8 月 6 日收到中国银行保险监督管理委员会出具的行政处罚决定书(银保监罚决字〔2020〕58 号)。其因未按车辆实际使用性质承保商业车险行为违反了《保险法》第一百三十五条的规定，被罚款 50 万元。手续费支出未分摊至各分支机构行为违反了《保险法》第八十六条的规定，被罚款 25 万元。

本基金基金经理依据基金合同及公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对中国平安进行了投资。

4、其余七名证券的发行主体本报告期内没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 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	31,849.88
2	应收证券清算款	435,671.50
3	应收股利	-
4	应收利息	829.49
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	468,350.87

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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

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的情况。

#### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	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	688696	极米科技	362,811.60	0.22	新股流通受限
2	688383	新益昌	243,927.04	0.15	新股流通受限
3	688677	海泰新光	136,882.98	0.08	新股流通受限
4	688076	诺泰生物	133,075.55	0.08	新股流通受限
5	301018	申菱环境	64,753.19	0.04	新股流通受限

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

#### 8.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
1,532	61,361.45	13,396,721.00	14.25	56,005,219.00	59.58

#### 8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额 (份)	占总份额比例 (%)
中国农业银行股份有限公司 —景顺长城 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	24,603,800.00	26.17

### 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	中国农业银行股份有限公司—景顺长城 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	24,603,800.00	26.17
2	广发证券股份有限公司	7,151,574.00	7.61
3	唐崇霖	2,500,000.00	2.66
4	中信证券股份有限公司	2,397,015.00	2.55
5	陈树明	2,291,600.00	2.44

6	张晓川	2,000,000.00	2.13
7	中信建投证券股份有限公司	1,906,759.00	2.03
8	方正证券股份有限公司	1,865,712.00	1.98
9	张红	1,790,400.00	1.90
10	郭莉芬	1,612,800.00	1.72
11	林李丽琴	1,600,000.00	1.70

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本期末基金管理人的所有从业人员未持有本基金。

### 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

1. 本期末基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。
2. 本期末本基金的基金经理未持有本基金。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2018年4月27日） 基金份额总额	1,534,005,740.00
本报告期期初基金份额总额	122,005,740.00
本报告期基金总申购份额	38,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	66,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	94,005,740.00

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

在本报告期内，本基金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：

本基金管理人于2021年3月30日发布公告，经景顺长城基金管理有限公司董事会审议通过，聘任刘彦春先生担任本公司副总经理。

上述事项已按规定向中国证券投资基金业协会备案，同时抄送中国证券监督管理委员会深圳监管局。有关公告已在中国证监会指定的全国性报刊及指定互联网网站等媒介披露。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

2021 年 5 月，中国农业银行总行决定谭敦宇任托管业务部总裁。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金财产、基金托管业务的诉讼，报告期内基金管理人无涉及基金财产的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

在本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期末未更换会计师事务所。

### 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

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员、托管人托管业务部门及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中国国际金融股份有限公司	2	68,362,154.96	43.24%	63,666.33	43.24%	-
方正证券股份有限公司	2	29,746,822.72	18.82%	27,704.82	18.82%	-
长江证券股份有限公司	2	23,934,863.61	15.14%	22,290.99	15.14%	-
光大证券股份有限公司	2	7,337,100.46	4.64%	6,832.99	4.64%	-
国泰君安证券股份有限公司	1	7,045,071.35	4.46%	6,561.20	4.46%	-

公司						
川财证券有 限责任公司	1	5,100,236.16	3.23%	4,750.24	3.23%	-
中泰证券股 份有限公司	2	4,210,504.74	2.66%	3,921.14	2.66%	-
申万宏源证 券有限公司	1	3,788,477.00	2.40%	3,528.35	2.40%	-
海通证券股 份有限公司	1	3,730,430.76	2.36%	3,474.42	2.36%	-
国盛证券有 限责任公司	1	3,033,748.89	1.92%	2,825.38	1.92%	-
安信证券股 份有限公司	1	719,505.00	0.46%	670.04	0.46%	-
东兴证券股 份有限公司	1	657,166.39	0.42%	612.03	0.42%	-
申港证券股 份有限公司	1	267,288.00	0.17%	248.94	0.17%	-
中国银河证 券股份有限 公司	2	85,040.20	0.05%	79.20	0.05%	-
新时代证券 股份有限公 司	1	45,802.86	0.03%	42.65	0.03%	-
东北证券股 份有限公司	1	17,174.70	0.01%	16.00	0.01%	-
长城证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
大同证券有 限责任公司	2	-	-	-	-	-

东方证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
广发证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
国金证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
国信证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
恒泰证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
华创证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
华福证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
民生证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
平安证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
瑞银证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
天风证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
西南证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股	2	-	-	-	-	-

份有限公司						
中信建投证 券股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
中信证券股 份有限公司	4	-	-	-	-	-

注：1. 基金专用交易单元的选择标准和程序如下：

1) 选择标准

- a、资金实力雄厚，信誉良好；
- b、财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- c、经营行为规范，最近三年未因重大违规行为受到监管机关的处罚；
- d、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；
- e、该证券经营机构具有较强的研究能力，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析报告、个股分析报告及其他专门报告以及全面的信息服务。并能根据基金管理人的特定要求，提供专门研究报告。

2) 选择程序

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协议。

2. 本基金本报告期交易单元未发生变更。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中国国际金融股份有限公司	4,029.68	1.34%	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	89,195.90	29.60%	-	-	-	-

长江证券股份有限公司	86,509.64	28.71%	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	39,335.52	13.05%	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
川财证券有限责任公司	82,262.40	27.30%	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
申港证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
新时代证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长城证券股份有限	-	-	-	-	-	-



公司						
大同证券 有限责任 公司						
东方证券 股份有限 公司						
广发证券 股份有限 公司						
国金证券 股份有限 公司						
国信证券 股份有限 公司						
恒泰证券 股份有限 公司						
华创证券 有限责任 公司						
华福证券 有限责任 公司						
华泰证券 股份有限 公司						
民生证券 股份有限 公司						
平安证券 股份有限 公司						
瑞银证券 有限责任 公司						
天风证券 股份有限 公司						
西南证券 股份有限 公司						
兴业证券						

股份有限 公司						
招商证券 股份有限 公司						
中信建投 证券股份 有限公司						
中信证券 股份有限 公司						

### 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	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-08
2	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-15
3	景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-21
4	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2020 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-21
5	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-05
6	景顺长城基金管理有限公司关于终止包商银行股份有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-09
7	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-25
8	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-12
9	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-20
10	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-26
11	景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金 2020 年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-29
12	景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金 2021 年第 1 号更新招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-29
13	景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-29

14	景顺长城 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（基金合同更新）	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-29
15	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分公募基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号-指数基金指引》修改基金合同等法律文件的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-29
16	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2020 年年度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-29
17	景顺长城基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-30
18	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-02
19	景顺长城基金管理有限公司关于持续完善客户身份信息的提示	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-12
20	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-15
21	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-19
22	关于网络平台冒用“景顺长城基金”名义进行不法活动的澄清公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-20
23	景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-22
24	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2021 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-22
25	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-23
26	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-12
27	关于旗下部分基金新增中信证券（华南）为一级交易商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-14
28	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-20
29	关于网络平台冒用“景顺长城基金”名义进行不法活动的澄清公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-04
30	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-15
31	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-18

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比(%)
本基金的联接基金	1	20210101-20210630	27,922,500.00	7,847,000.00	11,165,700.00	24,603,800.00	26.17

#### 产品特有风险

本基金由于存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%的情况，可能会出现如下风险：

#### 1、大额申购风险

在出现投资者大额申购时，如本基金所投资的标的资产未及时准备，则可能降低基金净值涨幅。

#### 2、如面临大额赎回的情况，可能导致以下风险：

(1) 基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；

(2) 如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20%的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回，如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；

(3) 基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；

(4) 因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，导致基金净值出现较大波动；

(5) 基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略；

(6) 大额赎回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。

本基金管理人将建立完善的风险管理机制，以有效防止和化解上述风险，最大限度地保护基金份额持有人的合法权益。投资者在投资本基金前，请认真阅读本风险提示及基金合同等信息披露文件，全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，获得基金投资收益，亦自行承担基金投资中出现的各类风险。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据《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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号—指数基金指引》等法律法规及各基金基金合同、招募说明书及其更新等规定，经与各基金托管人协商一致，并向中国证监会备案，我司对旗下包括本基金在内的 15 只基金的基金合同等法律文件进行修订。本次修订属于法律法规规定无需召开基金份额持有人大会的事项，修订自 2021 年 3 月 29 日起正式生效。有关详细信息参见本基金管理人于 2021 年 3 月 29 日发布的《景顺长城基金管

理有限公司关于旗下部分公募基金根据〈公开募集证券投资基金运作指引第 3 号-指数基金指引〉修改基金合同等法律文件的公告》。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

1、中国证监会准予景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金募集注册的文件；

2、《景顺长城 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》；

3、《景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；

4、《景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；

5、景顺长城基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程；

6、其他在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、定期报告及临时公告。

### 12.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

### 12.3 查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅。

景顺长城基金管理有限公司

2021 年 8 月 23 日