

# 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 2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 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：2023 年 3 月 28 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。本年度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 2023 年 3 月 24 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。

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，基金管理人本报告中对相关事项亦有详细说明，请投资者注意阅读。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 2022 年 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况</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	9
3.4 过去三年基金的利润分配情况	9
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 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	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	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>15</b>
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>17</b>
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	18
7.3 净资产（基金净值）变动表	20
7.4 报表附注	23

<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>50</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	50
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	50
8.3 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 .....	51
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	63
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	64
8.6 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 .....	64
8.7 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 .....	64
8.8 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 .....	64
8.9 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 .....	64
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	64
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	65
8.12 投资组合报告附注 .....	65
<b>§ 9 基金份额持有人信息</b> .....	<b>67</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	67
9.2 期末上市基金前十名持有人 .....	67
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	67
9.4 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 .....	67
9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况 .....	68
<b>§ 10 开放式基金份额变动</b> .....	<b>68</b>
<b>§ 11 重大事件揭示</b> .....	<b>68</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	68
11.2 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 .....	68
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	68
11.4 基金投资策略的改变 .....	68
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	69
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	69
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	69
11.8 其他重大事件 .....	74
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>76</b>
12.1 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 .....	76
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	77
<b>§ 13 备查文件目录</b> .....	<b>77</b>
13.1 备查文件目录 .....	77
13.2 存放地点 .....	77
13.3 查阅方式 .....	77

## § 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	58,005,740.00 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 姓名	杨皞阳	秦一楠

负责人	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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.igwfm.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2022 年	2021 年	2020 年
本期已实现收益	-12,567,989.48	40,399,877.26	59,340,509.47
本期利润	-32,116,055.83	20,472,379.43	62,827,252.87
加权平均基金份额本期利润	-0.4523	0.2131	0.3993
本期加权平均净值利润率	-29.42%	12.65%	32.49%
本期基金份额净值增长率	-18.41%	12.04%	41.76%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
期末可供分配利润	25,854,961.56	75,652,302.25	65,861,396.99

期末可供分配基金份额利润	0.4457	0.7719	0.5398
期末基金资产净值	83,860,701.56	173,658,042.25	192,953,168.69
期末基金份额净值	1.4457	1.7719	1.5815
3.1.3 累计期末指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
基金份额累计净值增长率	44.57%	77.19%	58.15%

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。

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。

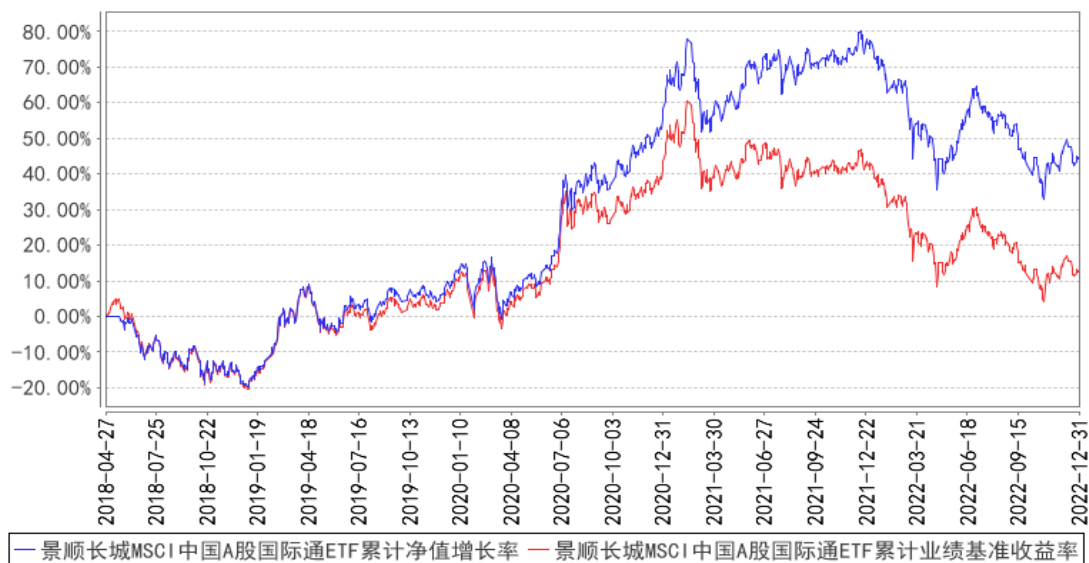
## 3.2 基金净值表现

### 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
过去三个月	1.20%	1.21%	1.03%	1.22%	0.17%	-0.01%
过去六个月	-11.82%	1.06%	-13.04%	1.07%	1.22%	-0.01%
过去一年	-18.41%	1.25%	-20.93%	1.27%	2.52%	-0.02%
过去三年	29.59%	1.27%	3.49%	1.30%	26.10%	-0.03%
自基金合同生效起至今	44.57%	1.26%	12.98%	1.30%	31.59%	-0.04%

### 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

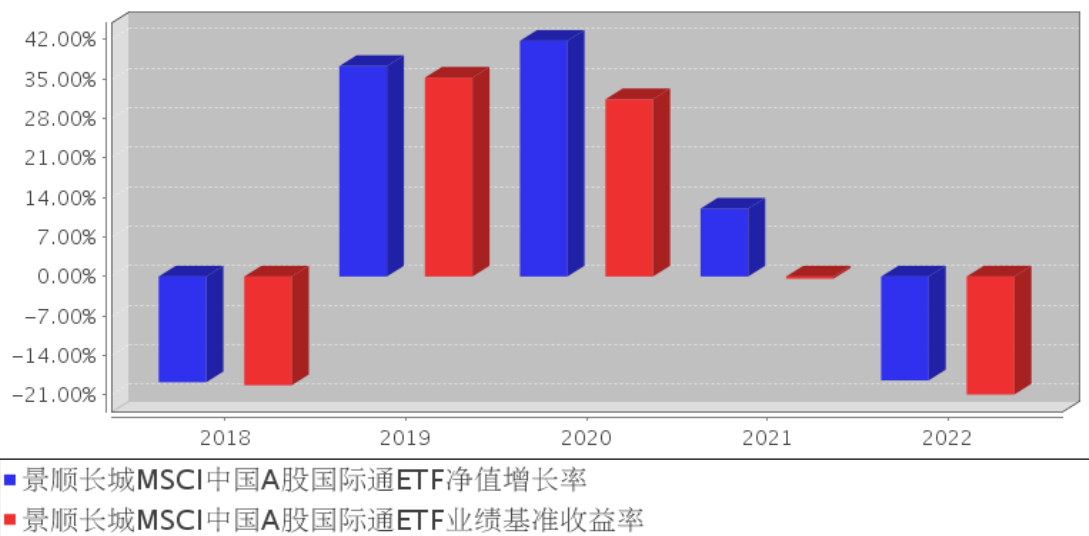
景顺长城MSCI中国A股国际通ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

景顺长城MSCI中国A股国际通ETF基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：2018 年净值增长率与业绩比较基准收益率的实际计算期间为 2018 年 4 月 27 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日。



### 3.3 其他指标

无。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

## § 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“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，并设立全资子公司——景顺长城资产管理（深圳）有限公司。

本公司拥有公募、特定客户资产管理、QDII等业务资格，截至2022年12月31日，本公司旗下共管理165只开放式基金，在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、海外投资、资产配置等多个领域布局。

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	-	12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与创新投资部基金经理。具有12年证券、基金行业从业经验。
金璜	本基金的基金经理助理	2022年10月13日	-	6年	工学硕士，CFA。曾任美国AltfestPersonalWealthManagement（艾福斯特个人财富管理）投资部量化研究员，Morgan Stanley（美国摩根士丹利）风险管理部信用风险分析员。2018年7月加入本公司，历任风险管理部经理、ETF与创新投资部研究员，现任基金经理助理。

					具有 6 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。

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

本报告期内，本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《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 公平交易制度和控制方法

为了进一步规范和完善本基金管理人（以下简称“本公司”）投资和交易管理，严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011 年修订）》、《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》等法律法规，本公司制定了《景顺长城基金管理有限公司公平交易指引》，该《指引》涵盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时对授权、研究分析与投资决策、交易执行的内部控制、交易指令的分配执行、公平交易监控、报告措施及信息披露、利益冲突的防范和异常交易的监控等方面进行了全面规范。具体控制措施如下：

##### 1、授权、研究分析与投资决策的内部控制

建立投资授权制度，明确各投资决策主体的职责和权限划分；建立客观的研究方法，任何投资分析和建议均应有充分的事实和数据支持，避免主观臆断，严禁利用内幕信息作为投资依据；

确保所有投资组合平等地享有研究成果；根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和投资限制等，建立不同投资组合的投资主题库和交易对手备选库，投资组合经理在此基础上根据投资授权构建具体的投资组合并独立进行投资决策。

## 2、交易执行的内部控制

本公司实行集中交易制度，将投资管理职能和交易执行职能相隔离；建立公平的交易分配机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。同时严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。

## 3、交易指令分配的控制

所有投资对象的投资指令必须经由交易管理部总监或其授权人审核后分配至交易员执行。

交易员对于接收到的交易指令依照时间优先、价格优先的顺序执行。在执行多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的投资指令时，需根据价格优先、比例分配的原则，经过公平性审核，公平对待多个不同投资组合的投资指令。

## 4、公平交易监控

本公司建立异常交易行为日常监控和分析评估制度。交易管理部负责异常交易的日常实时监控，风险管理部于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗内（如 1 日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合的同向交易的交易价差进行分析，对不同投资组合临近交易日的反向交易的交易价差进行分析。相关投资组合经理应对异常交易情况进行合理性解释，由投资组合经理、督察长、总经理签署后，妥善保存分析报告备查。如果在上述分析期间内，公司管理的所有投资组合同向交易价差出现异常情况，应重新核查公司投资决策和交易执行环节的内部控制，针对潜在问题完善公平交易制度，并在监察稽核季度报告和年度报告中对此做专项说明。

### 4.3.2 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投资组合。本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（2011 年修订）》及《景顺长城基金管理有限公司公平交易指引》对本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现不公平交易的情况。

#### 4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本报告期内，本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

### 4.3.3 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 47 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

2022 年经济整体呈现 M 型态势，年初的经济复苏受到俄乌冲突这一突发事件的影响，双方的相互制裁令全球风险偏好快速下降，对大宗商品及全球商贸活动的影响令滞胀风险再次出现；同时国内受到境外输入疫情的影响加大，深圳、上海等地经济活动受到了极大影响，国内市场对疫情的担忧再次出现；年中的低点过后经济韧性再次凸显，虽然美联储加息加快影响全球流动性水平，但国内相对来说影响较小；年末随着政策向经济建设转变，出现了短期的扰动因素，但相关冲击预计将快速结束。相对来说，2022 年一、三季度市场表现较差，二、四季度均有所回暖，但全年市场仍然呈现跌势，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-15.13%、-25.85%、-21.63%、-20.31%、-29.37%和-31.35%。

2022 年海外主要风险是俄乌冲突的爆发及美联储的持续加息。在灰犀牛事件的影响下，全球投资者风险厌恶程度快速上升，由于对能源、粮食等大宗商品的供给担忧，全球大宗商品价格出现了比较大的波动，同时全球流动性进一步收紧，新兴市场资产价格普遍走低。而国内全年疫情对经济的扰动较大，上海、深圳/广州、北京等一线城市在不同时期均受到了干扰，并对全国供应链有较大影响。2022 年国内货币政策整体偏向宽松，但由于消费场景受限，实际社融增速及居民部门信心较差，经济整体表现疲软。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2022 年，本基金份额净值增长率为-18.41%，业绩比较基准收益率为-20.93%。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 2023 年，预计各项负面影响因素均有所好转，经济复苏态势愈加凸显。虽然仍然存在变数，但海外投资者当前风险偏好上升明显，同时虽然美联储当前仍处于加息周期，但节奏明显放缓，且可能随着通胀缓解逐渐转变政策方向。国内疫情第一波高峰已经过去，由于今年春节较早，2 月份开始经济恢复速度明显加快，同时带动消费的快速回暖。在国内经济复苏的基础上，资本

市场仍有强大的吸引力，预计其将迎来估值修复及盈利改善，我们对后市保持乐观。

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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人继续完善内部控制体系和内部控制制度，健全管理制度和业务规章，依据国家相关法律法规、内部控制制度、内部管理制度和业务规章、基金合同以及基金招募说明书对本基金的投资、销售、运营等业务中的内部控制完善程度和执行情况进行持续的监察稽核，对监察稽核中发现的问题及时提示，督促改进并跟踪改进效果。定期编制监察稽核报告，及时报送上级监管部门（如需）。

为提高防范和化解经营风险的能力，确保经营业务稳健运行和受托资产安全完整，保障基金份额持有人利益，本基金管理人采取的主要措施包括：

1、进一步完善内部控制体系和内部控制制度。本公司已经建立了科学合理的层次分明的包括内控组织架构、控制程序和控制措施以及控制职责在内的运行高效、严密的内部控制体系。

2、进一步健全管理制度和业务规章。在已建立的基本管理制度、业务流程、规章等基础上，根据公司的业务发展和法律法规的颁布情况，对相关管理制度和业务流程规章进行全面修订及更新，从管理制度和业务流程上进行风险控制，进一步强化内部制度的执行力度。

3、坚持岗位分离、相互制衡的内控机制。在岗位设置上继续采取严格的分离制度，形成不同岗位之间的相互制衡机制，从岗位设置上减少和防范操作及操守风险。

4、持续地对基金经营业务的合法合规性进行监控。采取了实时监控、常规稽核、专项稽核和临时稽核等方式，对发现的问题及时提示并督促改进，防范各种违法违规行为的发生，切实保护基金份额持有人的合法权益。

5、执行以 KPI (Key Performance Indicator 主要绩效指标) 为风险控制主要手段和评估标准的风险评估、预警、报告、控制以及监督程序。并通过适当的控制流程，定期或实时对风险进行评估、预警和监督，从而确认、评估和预警与公司管理及基金运作有关的风险。通过顺畅的报告渠道，对风险问题进行层层监督、管理和控制，使部门和管理层及时把握风险状况并快速做出风险控制决策。

6、采用自动化监督控制系统。采用电子化投资交易系统，对投资比例进行限制，有效地防止合规性运作风险和操作风险。

7、按照法律法规的要求，认真做好旗下各只基金的信息披露工作，确保有关信息披露的真实、

完整、准确、及时。

8、定期不定期地组织合规培训。通过结合外部律师培训、内部合规培训以及证券业协会的后续教育课程，进一步加强对员工的合规教育，健全公司合规文化。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

#### 4.7 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。

#### 4.8 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。

截至本报告期末，根据相关法律法规和基金合同的要求以及本基金的实际运作情况，经本基

金管理人研究决定暂不实施利润分配。

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

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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 托管人对本年度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年度报告中的财务指标、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 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2023)第 24201 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	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全体基金份额持有人
审计意见	(一)我们审计的内容 我们审计了景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式

	<p>指数证券投资基金(以下简称“景顺长城 MSCI ETF”)的财务报表,包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表,2022 年度的利润表和净资产(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了景顺长城 MSCI ETF2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
<p>形成审计意见的基础</p>	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于景顺长城 MSCI ETF,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>景顺长城 MSCI ETF 的基金管理人景顺长城基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估景顺长城 MSCI ETF 的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算景顺长城 MSCI ETF、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督景顺长城 MSCI ETF 的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p>



	<p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对导致对景顺长城 MSCI ETF 持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致景顺长城 MSCI ETF 不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	单峰	郭劲扬
会计师事务所的地址	中国上海市	
审计报告日期	2023 年 3 月 24 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 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：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	1,277,361.62	3,999,846.12
结算备付金		32,984.14	158,463.18
存出保证金		4,515.71	31,134.97
交易性金融资产	7.4.7.2	82,807,524.68	169,756,197.23
其中：股票投资		82,807,524.68	169,564,197.23
基金投资		-	-
债券投资		-	192,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-

买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		-	99,802.94
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	866.29
资产总计		84,122,386.15	174,046,310.73
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年12月31日</b>	<b>上年度末 2021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	7.4.7.3	-	-
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		35,963.55	72,191.88
应付托管费		7,192.70	14,438.34
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	218,528.34	301,638.26
负债合计		261,684.59	388,268.48
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.10	58,005,740.00	98,005,740.00
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	25,854,961.56	75,652,302.25
净资产合计		83,860,701.56	173,658,042.25
负债和净资产总计		84,122,386.15	174,046,310.73

注：报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.4457 元，基金份额总额 58,005,740.00 份。

## 7.2 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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		-31,181,288.15	22,271,861.27
1. 利息收入		17,064.33	28,501.15
其中：存款利息收入	7.4.7.13	17,064.33	28,448.58
债券利息收入		-	52.57
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）		-11,403,849.99	40,766,188.24
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-13,438,007.20	38,406,623.09
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	96,062.29	94,187.49
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	1,938,094.92	2,265,377.66
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）	7.4.7.20	-19,548,066.35	-19,927,497.83
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	-246,436.14	1,404,669.71
<b>减：二、营业总支出</b>		934,767.68	1,799,481.84
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	551,318.72	811,156.10
2. 托管费	7.4.10.2.2	110,263.76	162,231.15
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		0.02	0.02

8. 其他费用	7.4.7.23	273,185.18	826,094.57
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-32,116,055.83	20,472,379.43
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-32,116,055.83	20,472,379.43
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-32,116,055.83	20,472,379.43

### 7.3 净资产（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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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(基金净值)	98,005,740.00	-	75,652,302.25	173,658,042.25
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	98,005,740.00	-	75,652,302.25	173,658,042.25
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-40,000,000.00	-	-49,797,340.69	-89,797,340.69
(一)、综合收益总额	-	-	-32,116,055.83	-32,116,055.83
(二)、本期基金份额	-40,000,000.00	-	-17,681,284.86	-57,681,284.86

交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)				
其中:1. 基金申购款	18,000,000.00	-	10,708,282.82	28,708,282.82
2. 基金赎回款	-58,000,000.00	-	-28,389,567.68	-86,389,567.68
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	58,005,740.00	-	25,854,961.56	83,860,701.56
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31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(基金净值)	122,005,740.00	-	70,947,428.69	192,953,168.69
加:会计政策变更	-	-	-	-

前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期末期初净资产(基金净值)	122,005,740.00	-	70,947,428.69	192,953,168.69
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-24,000,000.00	-	4,704,873.56	-19,295,126.44
(一)、综合收益总额	-	-	20,472,379.43	20,472,379.43
(二)、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)	-24,000,000.00	-	-15,767,505.87	-39,767,505.87
其中:1.基金申购款	82,000,000.00	-	55,447,878.89	137,447,878.89
2.基金赎回款	-106,000,000.00	-	-71,215,384.76	-177,215,384.76
(三)、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)				
(四)、 其他综合收益 结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末 净资产(基金 净值)	98,005,740.00	-	75,652,302.25	173,658,042.25

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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 2023 年 3 月 24 日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、本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。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2022 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 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。



### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### 新金融工具准则

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

#### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

#### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

#### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款和其他各类应收款项等。

#### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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主要为债券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

#### 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

#### (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括其他各类应付款项等。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

#### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括和其他各类应付款项等。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

#### 新金融工具准则

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处

于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

##### 新金融工具准则

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

##### 原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。基金收益以现金形式分配。当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，本基金的基金管理人可进行收益分配；本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。本基金收益每年最多分

配 12 次，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（以下合称“新金融工具准则”），财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，财政部于 2022 年颁布了《关于印发《资产管理产品相关会计处理规定》的通知》（财会[2022]14 号），中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《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〉》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

##### (a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度可比期间的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收

利息和应收证券清算款，金额分别为 3,999,846.12 元、158,463.18 元、31,134.97 元、866.29 元和 99,802.94 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息和应收清算款，金额分别为 4,000,622.40 元、158,534.48 元、31,149.07 元、0.00 元和 99,802.94 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 169,756,197.23 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 169,756,201.84 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付管理人报酬、应付托管费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 72,191.88 元、14,438.34 元、61,757.29 元和 64,880.97 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付管理人报酬、应付托管费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 72,191.88 元、14,438.34 元、61,757.29 元和 64,880.97 元。

于 2021 年 12 月 31 日，“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，本基金无期初留存收益影响。

#### (b) 《资产管理产品相关会计处理规定》

根据《资产管理产品相关会计处理规定》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

无。

### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营

业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前(如适用)运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起(如适用)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。

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

(4) 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。基金通过沪港通或深港通(如有)买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税



法规定缴纳印花税。

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

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
活期存款	1,277,361.62	3,999,846.12
等于：本金	1,277,076.71	3,999,846.12
加：应计利息	284.91	-
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个月（含）-3个月	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	1,277,361.62	3,999,846.12

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	94,335,935.18	-	82,807,524.68	-11,528,410.50
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	94,335,935.18	-	82,807,524.68	-11,528,410.50

项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	161,544,541.38	-	169,564,197.23	8,019,655.85	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	192,000.00	-	192,000.00	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	192,000.00	-	192,000.00	-
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	161,736,541.38	-	169,756,197.23	8,019,655.85	

注：于 2022 年 12 月 31 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 (2021 年 12 月 31 日：-564.00 元)。

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末及上年度末的衍生金融资产/负债余额为零。

##### 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

##### 7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末的买入返售金融资产余额为零。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末买断式逆回购交易中取得的债券余额为零。

##### 7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

#### 7.4.7.5 债权投资

##### 7.4.7.5.1 债权投资情况

无。

##### 7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

## 7.4.7.6 其他债权投资

## 7.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

## 7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

## 7.4.7.7 其他权益工具投资

## 7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

## 7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

## 7.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
应收利息	-	866.29
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	866.29

## 7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31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	13,219.37	61,757.29
其中：交易所市场	13,219.37	61,757.29
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	135,000.00	175,000.00
应付指数使用费	70,308.97	64,880.97
合计	218,528.34	301,638.26

## 7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	98,005,740.00	98,005,740.00

本期申购	18,000,000.00	18,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-58,000,000.00	-58,000,000.00
本期末	58,005,740.00	58,005,740.00

#### 7.4.7.11 其他综合收益

无。

#### 7.4.7.12 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
本期期初	93,240,510.60	-17,588,208.35	75,652,302.25
本期利润	-12,567,989.48	-19,548,066.35	-32,116,055.83
本期基金份额交易产生的变动数	-35,510,663.25	17,829,378.39	-17,681,284.86
其中：基金申购款	16,272,472.56	-5,564,189.74	10,708,282.82
基金赎回款	-51,783,135.81	23,393,568.13	-28,389,567.68
本期已分配利润	-	-	-
本期末	45,161,857.87	-19,306,896.31	25,854,961.56

#### 7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
活期存款利息收入	15,846.48	25,185.46
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	922.76	2,580.86
其他	295.09	682.26
合计	17,064.33	28,448.58

#### 7.4.7.14 股票投资收益

##### 7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-8,238,591.82	29,158,064.99
股票投资收益——赎回差价收入	-5,199,415.38	9,248,558.10
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	-13,438,007.20	38,406,623.09

#### 7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
卖出股票成交总额	62,588,446.46	164,707,604.90
减：卖出股票成本总额	70,654,481.20	135,549,539.91
减：交易费用	172,557.08	-
买卖股票差价收入	-8,238,591.82	29,158,064.99

#### 7.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
赎回基金份额对价总额	86,389,567.68	177,215,384.76
减：现金支付赎回款总额	34,666,297.68	73,097,275.76
减：赎回股票成本总额	56,922,685.38	94,869,550.90
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	-5,199,415.38	9,248,558.10

#### 7.4.7.14.4 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

#### 7.4.7.15 债券投资收益

##### 7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
债券投资收益——利息收入	78.29	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	95,984.00	94,187.49

债券投资收益——赎回 差价收入	-	-
债券投资收益——申购 差价收入	-	-
合计	96,062.29	94,187.49

#### 7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31 日	2021年1月1日至2021年12月31 日
卖出债券（债转股及债券 到期兑付）成交总额	576,272.79	560,437.48
减：卖出债券（债转股及 债券到期兑付）成本总额	480,200.00	466,200.00
减：应计利息总额	83.18	49.99
减：交易费用	5.61	-
买卖债券差价收入	95,984.00	94,187.49

#### 7.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

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

无。

##### 7.4.7.16.3

#### 7.4.7.17 贵金属投资收益

##### 7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

##### 7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

#### 7.4.7.18 衍生工具收益

##### 7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

##### 7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

## 7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月 31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月 31日
股票投资产生的股利收益	1,938,094.92	2,265,377.66
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	1,938,094.92	2,265,377.66

## 7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021 年12月31日
1. 交易性金融资产	-19,548,066.35	-19,927,497.83
股票投资	-19,548,066.35	-19,924,432.73
债券投资	-	-3,065.10
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	-19,548,066.35	-19,927,497.83

注：本基金本报告期公允价值变动损益—股票投资中包括可退替代款产生的公允价值变动损益0.00元(上年度可比期间：-564.00元)。

## 7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月 31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021 年12月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	-247,852.68	348,271.54
其他	1,416.54	1,056,398.17
合计	-246,436.14	1,404,669.71

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。

#### 7.4.7.22 信用减值损失

无。

#### 7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
审计费用	55,000.00	55,000.00
信息披露费	80,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行划款手续费	3,735.90	8,086.14
指数使用费	134,449.28	130,403.05
其他	-	360.00
交易费用	-	512,245.38
合计	273,185.18	826,094.57

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。

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 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。

##### 7.4.8.2 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。

#### 7.4.9 关联方关系

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
景顺资产管理有限公司	基金管理人的股东
大连实德集团有限公司	基金管理人的股东
开滦(集团)有限责任公司	基金管理人的股东
景顺长城资产管理(深圳)有限公司	基金管理人的子公司
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（“景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31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（%）
长城证券	457,020.40	0.44	-	-

###### 7.4.10.1.2 权证交易

无。

###### 7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31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（%）
长城证券	425.56	0.44	143.89	1.09
关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31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（%）
长城证券	-	-	-	-

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	551,318.72	811,156.10
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：支付基金管理人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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.50\% / \text{当年天数}。$$

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	110,263.76	162,231.15

注：支付基金托管人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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期及上年度可比期间无支付给各关联方的销售服务费。

#### 7.4.10.3 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。

#### 7.4.10.4 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

##### 7.4.10.4.1 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发生转融通证券出借业务交易。

##### 7.4.10.4.2 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发生转融通证券出借业务交易。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 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于本报告期及上年度可比期间均未运用自有资金投资本基金。

##### 7.4.10.5.2 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		上年度末	
	2022年12月31日		2021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	-	-	22,352,800.00	22.8100

## 7.4.10.6 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 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行-活期	1,277,361.62	15,846.48	3,999,846.12	25,185.46

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。

## 7.4.10.7 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。

## 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

于2022年12月31日，本基金持有7,400股长城证券的A股普通股，成本总额为人民币77,749.94元，估值总额为人民币61,272.00元，占基金净资产的比例为0.07%；本基金持有188,000股中国农业银行的A股普通股，成本总额为人民币577,201.29元，估值总额为人民币547,080.00元，占基金资产净值的比例为0.65%（2021年12月31日：本基金持有9,700股长城证券的A股普通股，成本总额为人民币110,364.48元，估值总额为人民币125,615.00元，占基金资产净值的比例为0.07%；本基金持有281,700股中国农业银行的A股普通股，成本总额为人民币883,962.73元，估值总额为人民币828,198.00元，占基金资产净值的比例为0.48%）。

## 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

## 7.4.12 期末（2022年12月31日）本基金持有的流通受限证券

## 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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。

## 7.4.12.2 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	复牌开盘价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600038	中直股份	2022年12月26日	重大事项停牌	46.41	2023年1月10日	51.05	1,200	57,350.46	55,692.00	-
300850	新强联	2022年12月30日	重大事项停牌	53.28	2023年1月10日	56.88	680	68,282.39	36,230.40	-

		日							
--	--	---	--	--	--	--	--	--	--

注：本基金截至 2022 年 12 月 31 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。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 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。

##### 7.4.12.3.2 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。

#### 7.4.12.4 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。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 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。

##### 7.4.13.2 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%。

于本报告期末，本基金未持有除国债、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（上年度末：0.11%）。

#### 7.4.13.3 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。

##### 7.4.13.3.1 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 7.4.12。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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

本基金管理人通过风险管理人员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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 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	1,277,361.62	-	-	-	-	-	1,277,361.62
结算备付金	32,984.14	-	-	-	-	-	32,984.14
存出保证金	4,515.71	-	-	-	-	-	4,515.71
交易性金融资产	-	-	-	-	-	82,807,524.68	82,807,524.68
资产总计	1,314,861.47	-	-	-	-	82,807,524.68	84,122,386.15
负债							
应付管理人报	-	-	-	-	-	35,963.55	35,963.55

酬							
应付托管费	-	-	-	-	-	7,192.70	7,192.70
其他负债	-	-	-	-	-	218,528.34	218,528.34
负债总计	-	-	-	-	-	261,684.59	261,684.59
利率敏感度缺口	1,314,861.47	-	-	-	-	-	-
上年度末 2021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	3,999,846.12	-	-	-	-	-	3,999,846.12
结算备付金	158,463.18	-	-	-	-	-	158,463.18
存出保证金	31,134.97	-	-	-	-	-	31,134.97
交易性金融资产	-	-	-	-192,000.00	169,564,197.23	169,756,197.23	
应收证券清算款	-	-	-	-	-	99,802.94	99,802.94
其他资产	-	-	-	-	-	866.29	866.29
资产总计	4,189,444.27	-	-	-192,000.00	169,664,866.46	174,046,310.73	
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	72,191.88	72,191.88
应付托管费	-	-	-	-	-	14,438.34	14,438.34
其他负债	-	-	-	-	-	301,638.26	301,638.26
负债总计	-	-	-	-	-	388,268.48	388,268.48
利率敏感度缺口	4,189,444.27	-	-	-192,000.00	-	-	-

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期末，本基金持有的债券资产的账面价值占资产净值比例为 0.00%（上年度末：0.11%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年度末：同）。

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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。

## 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日		上年度末 2021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	82,807,524.68	98.74	169,564,197.23	97.64
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	82,807,524.68	98.74	169,564,197.23	97.64

## 7.4.13.4.3.2 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（2022年12月31日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	沪深 300 指数上升 5%	3,864,562.53	8,143,452.23
	沪深 300 指数下降 5%	-3,864,562.53	-8,143,452.23

## 7.4.14 公允价值

## 7.4.14.1 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。



#### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 7.4.14.2.1 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 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	82,715,602.28	168,477,302.91
第二层次	91,922.40	1,278,894.32
第三层次	-	-
合计	82,807,524.68	169,756,197.23

##### 7.4.14.2.2 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。

##### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

###### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

无。

###### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

无。

##### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2021 年 12 月 31 日：同)。

##### 7.4.14.4 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。

#### 7.4.15 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 2022 年度，本基金申购基金份额的对价总额为 28,708,282.82 元(2021 年度：

137,447,878.89 元)，其中包括以股票支付的申购款 16,654,501.00 元和以现金支付的申购款 12,053,781.82 元(2021 年度：其中包括以股票支付的申购款 70,100,220.34 元和以现金支付的申购款 67,347,658.55 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。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	82,807,524.68	98.44
	其中：股票	82,807,524.68	98.44
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	1,310,345.76	1.56
8	其他各项资产	4,515.71	0.01
9	合计	84,122,386.15	100.00

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 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	1,024,009.70	1.22
B	采矿业	3,275,293.67	3.91
C	制造业	48,238,769.80	57.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,632,959.27	3.14
E	建筑业	1,564,320.80	1.87
F	批发和零售业	788,795.46	0.94
G	交通运输、仓储和邮政业	2,501,443.27	2.98
H	住宿和餐饮业	176,220.00	0.21
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,932,660.24	3.50
J	金融业	14,905,987.37	17.77
K	房地产业	1,424,211.26	1.70
L	租赁和商务服务业	1,226,760.80	1.46
M	科学研究和技术服务业	857,826.48	1.02

N	水利、环境和公共设施管理业	152,539.00	0.18
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	718,951.76	0.86
R	文化、体育和娱乐业	261,717.80	0.31
S	综合	125,058.00	0.15
	合计	82,807,524.68	98.74

### 8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

### 8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

### 8.3 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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	2,787	4,813,149.00	5.74
2	300750	宁德时代	5,415	2,130,369.30	2.54
3	600036	招商银行	45,578	1,698,236.28	2.03
4	000858	五粮液	8,572	1,548,874.68	1.85
5	601318	中国平安	23,937	1,125,039.00	1.34
6	600900	长江电力	50,212	1,054,452.00	1.26
7	002594	比亚迪	4,020	1,033,019.40	1.23
8	601888	中国中免	4,400	950,532.00	1.13
9	300760	迈瑞医疗	2,700	853,119.00	1.02
10	601166	兴业银行	45,900	807,381.00	0.96
11	600809	山西汾酒	2,741	781,157.59	0.93
12	000568	泸州老窖	3,335	747,973.80	0.89
13	601012	隆基绿能	16,739	707,390.14	0.84
14	603288	海天味业	8,603	684,798.80	0.82
15	600309	万华化学	6,965	645,307.25	0.77
16	002352	顺丰控股	10,850	626,696.00	0.75
17	601398	工商银行	138,900	602,826.00	0.72
18	002714	牧原股份	11,822	576,322.50	0.69
19	300059	东方财富	29,161	565,723.40	0.67
20	000001	平安银行	42,900	564,564.00	0.67
21	002304	洋河股份	3,413	547,786.50	0.65
22	601288	农业银行	188,000	547,080.00	0.65
23	600276	恒瑞医药	14,134	544,583.02	0.65
24	600030	中信证券	27,050	538,565.50	0.64
25	601668	中国建筑	92,560	502,600.80	0.60

26	002475	立讯精密	15,680	497,840.00	0.59
27	300015	爱尔眼科	15,484	481,087.88	0.57
28	002142	宁波银行	14,566	472,666.70	0.56
29	600000	浦发银行	64,800	471,744.00	0.56
30	603259	药明康德	5,740	464,940.00	0.55
31	601899	紫金矿业	45,400	454,000.00	0.54
32	600887	伊利股份	14,100	437,100.00	0.52
33	601328	交通银行	86,600	410,484.00	0.49
34	300124	汇川技术	5,837	405,671.50	0.48
35	600436	片仔癀	1,404	404,997.84	0.48
36	300014	亿纬锂能	4,585	403,021.50	0.48
37	601088	中国神华	14,530	401,318.60	0.48
38	600048	保利发展	26,400	399,432.00	0.48
39	601225	陕西煤业	21,400	397,612.00	0.47
40	000002	万科 A	21,385	389,207.00	0.46
41	600438	通威股份	9,968	384,565.44	0.46
42	601601	中国太保	15,100	370,252.00	0.44
43	300274	阳光电源	3,300	368,940.00	0.44
44	600406	国电南瑞	14,764	360,241.60	0.43
45	600905	三峡能源	63,200	357,080.00	0.43
46	600690	海尔智家	13,934	340,825.64	0.41
47	688111	金山办公	1,200	317,388.00	0.38
48	300122	智飞生物	3,600	316,188.00	0.38
49	002459	晶澳科技	5,220	313,669.80	0.37
50	600028	中国石化	70,300	306,508.00	0.37
51	600050	中国联通	68,300	305,984.00	0.36
52	688599	天合光能	4,796	305,792.96	0.36
53	600031	三一重工	18,700	295,460.00	0.35
54	601919	中远海控	28,043	288,562.47	0.34
55	300498	温氏股份	14,440	283,457.20	0.34
56	300896	爱美客	500	283,175.00	0.34
57	601818	光大银行	91,300	280,291.00	0.33
58	000725	京东方 A	82,800	279,864.00	0.33
59	002493	荣盛石化	22,350	274,905.00	0.33
60	600019	宝钢股份	49,156	274,782.04	0.33
61	601766	中国中车	53,700	274,407.00	0.33
62	601658	邮储银行	58,700	271,194.00	0.32
63	002371	北方华创	1,200	270,360.00	0.32
64	000792	盐湖股份	11,900	270,011.00	0.32
65	600016	民生银行	78,260	269,997.00	0.32
66	002129	TCL 中环	7,100	267,386.00	0.32
67	002812	恩捷股份	2,000	262,580.00	0.31
68	002466	天齐锂业	3,300	260,667.00	0.31

69	601390	中国中铁	45,300	251,868.00	0.30
70	601985	中国核电	41,600	249,600.00	0.30
71	600893	航发动力	5,882	248,690.96	0.30
72	600104	上汽集团	17,195	247,779.95	0.30
73	002460	赣锋锂业	3,550	246,760.50	0.29
74	002049	紫光国微	1,860	245,185.20	0.29
75	601988	中国银行	77,500	244,900.00	0.29
76	000596	古井贡酒	900	240,210.00	0.29
77	600585	海螺水泥	8,749	239,547.62	0.29
78	600919	江苏银行	32,580	237,508.20	0.28
79	601857	中国石油	47,649	236,815.53	0.28
80	601669	中国电建	33,400	236,472.00	0.28
81	601009	南京银行	22,666	236,179.72	0.28
82	002311	海大集团	3,700	228,401.00	0.27
83	601066	中信建投	9,500	225,625.00	0.27
84	000063	中兴通讯	8,700	224,982.00	0.27
85	601211	国泰君安	16,528	224,615.52	0.27
86	000625	长安汽车	18,245	224,595.95	0.27
87	601628	中国人寿	6,050	224,576.00	0.27
88	601006	大秦铁路	32,800	219,104.00	0.26
89	600150	中国船舶	9,800	218,344.00	0.26
90	600999	招商证券	16,320	217,056.00	0.26
91	001979	招商蛇口	17,000	214,710.00	0.26
92	000538	云南白药	3,920	213,091.20	0.25
93	002027	分众传媒	31,860	212,824.80	0.25
94	601688	华泰证券	16,209	206,502.66	0.25
95	603501	韦尔股份	2,635	203,132.15	0.24
96	000776	广发证券	13,000	201,370.00	0.24
97	600346	恒力石化	12,940	200,958.20	0.24
98	601169	北京银行	46,600	200,846.00	0.24
99	601138	工业富联	21,857	200,647.26	0.24
100	600111	北方稀土	8,003	200,475.15	0.24
101	000651	格力电器	6,200	200,384.00	0.24
102	000166	申万宏源	49,700	197,806.00	0.24
103	603799	华友钴业	3,553	197,653.39	0.24
104	000895	双汇发展	7,600	197,068.00	0.23
105	603806	福斯特	2,948	195,865.12	0.23
106	600010	宝钢股份	100,700	193,344.00	0.23
107	600029	南方航空	24,800	188,480.00	0.22
108	600188	兖矿能源	5,600	188,048.00	0.22
109	600837	海通证券	21,324	185,305.56	0.22
110	002709	天赐材料	4,220	185,089.20	0.22
111	601229	上海银行	31,304	185,006.64	0.22

112	300316	晶盛机电	2,900	184,324.00	0.22
113	600588	用友网络	7,522	181,806.74	0.22
114	300751	迈为股份	440	181,209.60	0.22
115	601100	恒立液压	2,864	180,861.60	0.22
116	000963	华东医药	3,817	178,635.60	0.21
117	603993	洛阳钼业	39,000	177,450.00	0.21
118	600600	青岛啤酒	1,582	170,065.00	0.20
119	600926	杭州银行	13,000	170,040.00	0.20
120	603392	万泰生物	1,330	168,511.00	0.20
121	600795	国电电力	39,300	167,811.00	0.20
122	600570	恒生电子	4,143	167,625.78	0.20
123	600089	特变电工	8,344	167,547.52	0.20
124	002230	科大讯飞	5,100	167,433.00	0.20
125	605117	德业股份	500	165,600.00	0.20
126	601868	中国能建	71,600	163,964.00	0.20
127	600196	复星医药	4,608	162,385.92	0.19
128	600989	宝丰能源	13,400	161,738.00	0.19
129	002180	纳思达	3,100	160,859.00	0.19
130	601633	长城汽车	5,400	159,948.00	0.19
131	603659	璞泰来	3,080	159,821.20	0.19
132	688008	澜起科技	2,540	159,004.00	0.19
133	600009	上海机场	2,700	155,817.00	0.19
134	601111	中国国航	14,600	154,760.00	0.18
135	600660	福耀玻璃	4,400	154,308.00	0.18
136	600426	华鲁恒升	4,640	153,816.00	0.18
137	600011	华能国际	20,187	153,623.07	0.18
138	300763	锦浪科技	850	153,042.50	0.18
139	000338	潍柴动力	14,900	151,682.00	0.18
140	603986	兆易创新	1,480	151,655.60	0.18
141	600547	山东黄金	7,904	151,440.64	0.18
142	600233	圆通速递	7,500	150,675.00	0.18
143	000661	长春高新	900	149,805.00	0.18
144	300759	康龙化成	2,200	149,600.00	0.18
145	600015	华夏银行	28,318	146,970.42	0.18
146	600958	东方证券	16,412	146,723.28	0.17
147	600845	宝信软件	3,202	143,449.60	0.17
148	600745	闻泰科技	2,700	141,966.00	0.17
149	300142	沃森生物	3,503	140,785.57	0.17
150	601689	拓普集团	2,400	140,592.00	0.17
151	000100	TCL 科技	37,700	140,244.00	0.17
152	600132	重庆啤酒	1,100	140,118.00	0.17
153	600115	中国东航	25,200	139,356.00	0.17
154	688036	传音控股	1,747	138,921.44	0.17

155	300661	圣邦股份	800	138,080.00	0.16
156	688012	中微公司	1,404	137,606.04	0.16
157	603369	今世缘	2,700	137,430.00	0.16
158	601336	新华保险	4,519	135,931.52	0.16
159	300999	金龙鱼	3,100	135,036.00	0.16
160	300782	卓胜微	1,180	134,874.00	0.16
161	600085	同仁堂	3,000	134,040.00	0.16
162	000425	徐工机械	26,100	132,327.00	0.16
163	603833	欧派家居	1,087	132,103.11	0.16
164	603290	斯达半导	400	131,720.00	0.16
165	600256	广汇能源	14,500	130,790.00	0.16
166	601877	正泰电器	4,700	130,190.00	0.16
167	601600	中国铝业	29,100	130,077.00	0.16
168	688396	华润微	2,463	129,676.95	0.15
169	688390	固德威	400	129,236.00	0.15
170	300408	三环集团	4,200	128,982.00	0.15
171	601788	光大证券	8,627	128,283.49	0.15
172	600875	东方电气	6,100	128,222.00	0.15
173	000876	新希望	9,901	127,821.91	0.15
174	002001	新和成	6,788	127,275.00	0.15
175	600039	四川路桥	11,400	126,768.00	0.15
176	002920	德赛西威	1,200	126,408.00	0.15
177	688063	派能科技	400	126,260.00	0.15
178	002241	歌尔股份	7,500	126,225.00	0.15
179	000733	振华科技	1,100	125,653.00	0.15
180	601618	中国中冶	39,400	125,292.00	0.15
181	601825	沪农商行	21,300	125,244.00	0.15
182	002736	国信证券	14,100	125,208.00	0.15
183	601865	福莱特	3,700	123,247.00	0.15
184	300413	芒果超媒	4,090	122,781.80	0.15
185	000938	紫光股份	6,279	122,503.29	0.15
186	600522	中天科技	7,500	121,125.00	0.14
187	601838	成都银行	7,900	120,870.00	0.14
188	600176	中国巨石	8,773	120,277.83	0.14
189	600741	华域汽车	6,900	119,577.00	0.14
190	601238	广汽集团	10,800	119,124.00	0.14
191	601939	建设银行	21,100	118,793.00	0.14
192	000301	东方盛虹	9,100	118,664.00	0.14
193	300033	同花顺	1,200	118,332.00	0.14
194	600754	锦江酒店	2,000	116,700.00	0.14
195	601615	明阳智能	4,600	116,196.00	0.14
196	300628	亿联网络	1,903	115,302.77	0.14
197	002938	鹏鼎控股	4,200	115,248.00	0.14

198	300433	蓝思科技	10,900	114,777.00	0.14
199	002648	卫星化学	7,393	114,591.50	0.14
200	603345	安井食品	700	113,316.00	0.14
201	601699	潞安环能	6,600	111,210.00	0.13
202	002603	以岭药业	3,680	110,252.80	0.13
203	688536	思瑞浦	400	110,164.00	0.13
204	603899	晨光股份	2,000	109,960.00	0.13
205	601727	上海电气	27,900	109,926.00	0.13
206	002821	凯莱英	740	109,520.00	0.13
207	600018	上港集团	20,500	109,470.00	0.13
208	601377	兴业证券	19,050	109,347.00	0.13
209	601319	中国人保	20,900	109,098.00	0.13
210	601607	上海医药	6,100	108,763.00	0.13
211	601916	浙商银行	36,876	108,415.44	0.13
212	600763	通策医疗	700	107,093.00	0.13
213	601117	中国化学	13,400	106,396.00	0.13
214	600027	华电国际	18,000	105,840.00	0.13
215	688180	君实生物	1,681	105,230.60	0.13
216	000983	山西焦煤	8,990	104,733.50	0.12
217	688363	华熙生物	768	103,895.04	0.12
218	002074	国轩高科	3,600	103,788.00	0.12
219	688777	中控技术	1,139	103,455.37	0.12
220	601360	三六零	15,711	102,749.94	0.12
221	600383	金地集团	9,962	101,911.26	0.12
222	603606	东方电缆	1,500	101,745.00	0.12
223	600460	士兰微	3,100	101,649.00	0.12
224	300454	深信服	900	101,295.00	0.12
225	601155	新城控股	4,900	100,450.00	0.12
226	300496	中科创达	1,000	100,300.00	0.12
227	601872	招商轮船	17,900	100,061.00	0.12
228	603939	益丰药房	1,558	99,462.72	0.12
229	600674	川投能源	8,100	99,063.00	0.12
230	002601	龙佰集团	5,200	98,384.00	0.12
231	000999	华润三九	2,100	98,301.00	0.12
232	603737	三棵树	860	97,893.80	0.12
233	603613	国联股份	1,105	97,726.20	0.12
234	000799	酒鬼酒	700	96,558.00	0.12
235	000069	华侨城 A	18,100	96,473.00	0.12
236	000786	北新建材	3,700	95,756.00	0.11
237	688122	西部超导	1,008	95,447.52	0.11
238	601995	中金公司	2,500	95,325.00	0.11
239	002252	上海莱士	14,800	93,832.00	0.11
240	603185	上机数控	880	93,148.00	0.11



241	002120	韵达股份	6,410	92,175.80	0.11
242	300769	德方纳米	400	91,836.00	0.11
243	600803	新奥股份	5,700	91,770.00	0.11
244	600026	中远海能	7,600	91,580.00	0.11
245	688301	奕瑞科技	200	91,576.00	0.11
246	600160	巨化股份	5,900	91,509.00	0.11
247	002384	东山精密	3,700	91,501.00	0.11
248	603260	合盛硅业	1,100	91,234.00	0.11
249	300724	捷佳伟创	800	91,216.00	0.11
250	002841	视源股份	1,534	90,567.36	0.11
251	002007	华兰生物	3,990	90,293.70	0.11
252	600332	白云山	3,026	90,144.54	0.11
253	600153	建发股份	6,590	89,953.50	0.11
254	600584	长电科技	3,900	89,895.00	0.11
255	000629	钒钛股份	19,000	89,870.00	0.11
256	300003	乐普医疗	3,900	89,583.00	0.11
257	300957	贝泰妮	600	89,544.00	0.11
258	688187	时代电气	1,629	88,894.53	0.11
259	000408	藏格矿业	3,400	88,298.00	0.11
260	603198	迎驾贡酒	1,400	87,892.00	0.10
261	603486	科沃斯	1,200	87,528.00	0.10
262	601881	中国银河	9,400	87,326.00	0.10
263	002555	三七互娱	4,800	86,880.00	0.10
264	600079	人福医药	3,600	86,004.00	0.10
265	600219	南山铝业	26,300	86,001.00	0.10
266	600298	安琪酵母	1,900	85,918.00	0.10
267	000723	美锦能源	9,500	85,690.00	0.10
268	600884	杉杉股份	4,700	85,540.00	0.10
269	002013	中航机电	8,500	85,425.00	0.10
270	300832	新产业	1,700	85,238.00	0.10
271	000157	中联重科	15,600	84,864.00	0.10
272	000807	云铝股份	7,600	84,512.00	0.10
273	300146	汤臣倍健	3,700	84,434.00	0.10
274	600779	水井坊	1,000	84,420.00	0.10
275	601878	浙商证券	8,500	84,405.00	0.10
276	600096	云天化	4,000	84,160.00	0.10
277	002568	百润股份	2,252	84,134.72	0.10
278	300347	泰格医药	800	83,840.00	0.10
279	300144	宋城演艺	5,720	83,512.00	0.10
280	002202	金风科技	7,584	83,424.00	0.10
281	002756	永兴材料	900	82,953.00	0.10
282	002430	杭氧股份	2,100	82,656.00	0.10
283	002422	科伦药业	3,100	82,491.00	0.10

284	688385	复旦微电	1,176	82,096.56	0.10
285	600918	中泰证券	12,800	82,048.00	0.10
286	603233	大参林	2,064	81,734.40	0.10
287	600536	中国软件	1,400	81,662.00	0.10
288	002385	大北农	9,100	80,990.00	0.10
289	002625	光启技术	4,700	79,994.00	0.10
290	600563	法拉电子	500	79,940.00	0.10
291	300699	光威复材	1,100	79,475.00	0.09
292	002414	高德红外	7,224	79,464.00	0.09
293	603517	绝味食品	1,300	79,417.00	0.09
294	002080	中材科技	3,700	79,291.00	0.09
295	300919	中伟股份	1,200	78,732.00	0.09
296	600362	江西铜业	4,500	78,435.00	0.09
297	600487	亨通光电	5,200	78,312.00	0.09
298	300207	欣旺达	3,700	78,255.00	0.09
299	603882	金域医学	1,000	78,200.00	0.09
300	002294	信立泰	2,380	78,183.00	0.09
301	002340	格林美	10,500	78,015.00	0.09
302	300438	鹏辉能源	1,000	77,990.00	0.09
303	002916	深南电路	1,080	77,922.00	0.09
304	300601	康泰生物	2,460	77,563.80	0.09
305	601233	桐昆股份	5,300	76,585.00	0.09
306	601799	星宇股份	600	76,422.00	0.09
307	603456	九洲药业	1,800	76,374.00	0.09
308	688009	中国通号	15,814	75,749.06	0.09
309	600348	华阳股份	5,300	75,525.00	0.09
310	002240	盛新锂能	2,000	74,980.00	0.09
311	603589	口子窖	1,300	74,971.00	0.09
312	002372	伟星新材	3,500	74,690.00	0.09
313	002236	大华股份	6,600	74,646.00	0.09
314	000738	航发控制	2,900	74,356.00	0.09
315	601216	君正集团	18,600	74,214.00	0.09
316	002064	华峰化学	10,900	74,120.00	0.09
317	600183	生益科技	5,100	73,491.00	0.09
318	603816	顾家家居	1,720	73,461.20	0.09
319	000933	神火股份	4,900	73,304.00	0.09
320	002791	坚朗五金	700	72,765.00	0.09
321	000066	中国长城	7,100	72,420.00	0.09
322	000630	铜陵有色	23,200	72,384.00	0.09
323	601108	财通证券	10,160	72,339.20	0.09
324	601555	东吴证券	11,059	72,215.27	0.09
325	603596	伯特利	900	71,820.00	0.09
326	000932	华菱钢铁	15,200	71,440.00	0.09

327	300223	北京君正	1,000	70,440.00	0.08
328	002600	领益智造	15,500	70,370.00	0.08
329	600521	华海药业	3,210	70,170.60	0.08
330	002223	鱼跃医疗	2,200	70,092.00	0.08
331	600141	兴发集团	2,400	69,600.00	0.08
332	300037	新宙邦	1,600	69,552.00	0.08
333	002518	科士达	1,200	69,120.00	0.08
333	600985	淮北矿业	5,400	69,120.00	0.08
334	000831	中国稀土	2,100	69,048.00	0.08
335	601077	渝农商行	19,500	68,835.00	0.08
336	603568	伟明环保	3,700	68,561.00	0.08
337	002078	太阳纸业	5,900	67,968.00	0.08
338	000977	浪潮信息	3,156	67,917.12	0.08
339	000009	中国宝安	5,600	67,704.00	0.08
340	601880	辽港股份	41,500	67,230.00	0.08
341	601636	旗滨集团	5,900	67,201.00	0.08
342	601058	赛轮轮胎	6,700	67,134.00	0.08
343	300595	欧普康视	1,880	67,116.00	0.08
344	300390	天华超净	1,200	67,056.00	0.08
345	000975	银泰黄金	6,060	66,902.40	0.08
346	601966	玲珑轮胎	3,260	66,764.80	0.08
347	002738	中矿资源	1,000	66,660.00	0.08
348	688005	容百科技	966	66,412.50	0.08
349	000027	深圳能源	10,420	66,271.20	0.08
350	002831	裕同科技	2,000	66,140.00	0.08
351	000729	燕京啤酒	6,200	65,844.00	0.08
352	002532	天山铝业	8,500	65,620.00	0.08
353	002056	横店东磁	3,500	65,590.00	0.08
354	000783	长江证券	12,200	65,026.00	0.08
355	603885	吉祥航空	4,000	64,720.00	0.08
356	600655	豫园股份	8,500	64,685.00	0.08
357	600705	中航产融	19,700	64,616.00	0.08
358	600177	雅戈尔	10,200	64,566.00	0.08
359	002176	江特电机	3,700	64,565.00	0.08
360	601696	中银证券	6,100	64,477.00	0.08
361	002299	圣农发展	2,700	63,963.00	0.08
362	603707	健友股份	3,519	63,482.76	0.08
363	600415	小商品城	12,100	63,404.00	0.08
364	000591	太阳能	8,600	63,038.00	0.08
365	603444	吉比特	200	62,568.00	0.07
366	002602	世纪华通	16,420	62,560.20	0.07
367	688516	奥特维	311	62,511.00	0.07
368	600486	扬农化工	600	62,340.00	0.07

369	002966	苏州银行	8,000	62,240.00	0.07
370	600021	上海电力	6,200	62,062.00	0.07
371	300073	当升科技	1,100	62,040.00	0.07
372	600848	上海临港	5,200	61,984.00	0.07
373	000683	远兴能源	7,900	61,936.00	0.07
374	002353	杰瑞股份	2,200	61,402.00	0.07
375	002939	长城证券	7,400	61,272.00	0.07
376	002028	思源电气	1,600	61,152.00	0.07
377	600872	中炬高新	1,649	60,798.63	0.07
378	688188	柏楚电子	280	60,782.40	0.07
379	300357	我武生物	1,100	60,610.00	0.07
380	600549	厦门钨业	3,100	60,605.00	0.07
381	000728	国元证券	9,560	60,514.80	0.07
382	300395	菲利华	1,100	60,500.00	0.07
383	002244	滨江集团	6,800	60,044.00	0.07
384	002673	西部证券	9,842	59,937.78	0.07
385	688202	美迪西	280	59,889.20	0.07
386	605358	立昂微	1,400	59,640.00	0.07
387	600258	首旅酒店	2,400	59,520.00	0.07
388	601577	长沙银行	8,800	59,488.00	0.07
389	300568	星源材质	2,796	59,442.96	0.07
390	002850	科达利	500	59,405.00	0.07
391	603712	七一二	1,700	59,364.00	0.07
392	603077	和邦生物	19,500	59,280.00	0.07
393	002531	天顺风能	3,900	59,007.00	0.07
394	000519	中兵红箭	3,000	58,920.00	0.07
395	600583	海油工程	9,700	58,782.00	0.07
396	601456	国联证券	5,200	58,500.00	0.07
397	600499	科达制造	4,100	58,261.00	0.07
398	002497	雅化集团	2,500	58,125.00	0.07
399	002185	华天科技	7,000	58,030.00	0.07
400	300604	长川科技	1,300	57,954.00	0.07
401	300373	扬杰科技	1,100	57,860.00	0.07
402	600673	东阳光	6,600	57,354.00	0.07
403	002405	四维图新	5,200	57,304.00	0.07
404	002153	石基信息	3,817	57,216.83	0.07
405	000155	川能动力	3,200	57,088.00	0.07
406	000423	东阿阿胶	1,400	56,980.00	0.07
407	600056	中国医药	3,300	56,859.00	0.07
408	000703	恒逸石化	8,010	56,310.30	0.07
409	000739	普洛药业	2,600	56,004.00	0.07
410	600038	中直股份	1,200	55,692.00	0.07
411	002508	老板电器	2,000	55,520.00	0.07

412	300251	光线传媒	6,400	55,424.00	0.07
413	688099	晶晨股份	786	55,420.86	0.07
414	000987	越秀资本	9,221	55,233.79	0.07
415	601666	平煤股份	5,100	55,131.00	0.07
416	002268	卫士通	1,800	54,954.00	0.07
417	600704	物产中大	11,400	54,834.00	0.07
418	601198	东兴证券	7,100	54,812.00	0.07
419	600369	西南证券	14,600	54,750.00	0.07
420	601016	节能风电	14,300	54,483.00	0.06
421	000825	太钢不锈	12,600	54,432.00	0.06
422	002032	苏泊尔	1,100	54,406.00	0.06
423	002156	通富微电	3,300	54,384.00	0.06
424	000893	亚钾国际	2,000	54,360.00	0.06
425	002624	完美世界	4,251	54,072.72	0.06
426	600998	九州通	4,131	53,868.24	0.06
427	002152	广电运通	5,400	53,676.00	0.06
428	600598	北大荒	3,900	53,664.00	0.06
429	300529	健帆生物	1,730	53,578.10	0.06
430	002407	多氟多	1,600	53,312.00	0.06
431	600392	盛和资源	3,800	53,200.00	0.06
432	601168	西部矿业	5,200	53,040.00	0.06
433	603127	昭衍新药	908	53,036.28	0.06
434	000709	河钢股份	23,400	52,884.00	0.06
435	601866	中远海发	21,800	52,756.00	0.06
436	002044	美年健康	8,576	52,570.88	0.06
437	000800	一汽解放	6,800	52,564.00	0.06
438	301035	润丰股份	600	52,260.00	0.06
439	000830	鲁西化工	4,200	52,038.00	0.06
440	002128	电投能源	4,200	51,828.00	0.06
441	002797	第一创业	9,200	51,796.00	0.06
442	600566	济川药业	1,900	51,718.00	0.06
443	603858	步长制药	2,431	51,075.31	0.06
444	600170	上海建工	19,600	50,960.00	0.06
445	600516	方大炭素	8,314	50,881.68	0.06
446	601991	大唐发电	18,200	50,778.00	0.06
447	000960	锡业股份	3,600	50,760.00	0.06
448	603338	浙江鼎力	1,060	50,721.00	0.06
449	603267	鸿远电子	500	50,580.00	0.06
450	002409	雅克科技	1,000	50,370.00	0.06
451	600688	上海石化	16,130	50,164.30	0.06
452	002487	大金重工	1,200	49,644.00	0.06
453	000937	冀中能源	7,800	49,608.00	0.06
454	300363	博腾股份	1,200	49,020.00	0.06

455	002507	涪陵榨菜	1,900	48,963.00	0.06
456	002192	融捷股份	500	48,950.00	0.06
457	002463	沪电股份	4,100	48,790.00	0.06
458	002030	达安基因	3,076	47,862.56	0.06
459	000401	冀东水泥	5,800	47,734.00	0.06
460	603605	珀莱雅	280	46,894.40	0.06
461	000050	深天马 A	5,400	46,764.00	0.06
462	601992	金隅集团	18,400	46,736.00	0.06
463	000998	隆平高科	2,900	46,603.00	0.06
464	300676	华大基因	900	46,521.00	0.06
465	600380	健康元	4,100	46,289.00	0.06
466	002266	浙富控股	11,800	46,138.00	0.06
467	300308	中际旭创	1,700	45,951.00	0.05
468	300034	钢研高纳	1,000	45,840.00	0.05
468	600338	西藏珠峰	2,000	45,840.00	0.05
469	603866	桃李面包	2,924	45,029.60	0.05
470	603218	日月股份	2,200	44,660.00	0.05
471	002138	顺络电子	1,700	44,506.00	0.05
472	600801	华新水泥	3,000	44,460.00	0.05
473	300558	贝达药业	900	44,343.00	0.05
474	002408	齐翔腾达	6,200	43,648.00	0.05
475	002926	华西证券	5,700	42,921.00	0.05
476	002541	鸿路钢构	1,460	42,763.40	0.05
477	002092	中泰化学	5,700	42,522.00	0.05
478	000513	丽珠集团	1,300	42,224.00	0.05
479	600699	均胜电子	3,000	42,150.00	0.05
480	002500	山西证券	7,840	41,552.00	0.05
481	002326	永太科技	1,900	41,477.00	0.05
482	600711	盛屯矿业	6,900	40,641.00	0.05
483	002465	海格通信	5,000	40,600.00	0.05
484	002145	中核钛白	6,505	40,070.80	0.05
485	000750	国海证券	11,940	39,760.20	0.05
486	300726	宏达电子	900	39,726.00	0.05
487	002065	东华软件	7,000	39,620.00	0.05
488	600295	鄂尔多斯	2,560	38,886.40	0.05
489	300070	碧水源	8,000	37,840.00	0.05
490	300776	帝尔激光	300	37,800.00	0.05
491	002506	协鑫集成	12,900	37,539.00	0.04
492	688006	杭可科技	849	37,160.73	0.04
493	300850	新强联	680	36,230.40	0.04
494	000988	华工科技	2,200	36,102.00	0.04
495	600885	宏发股份	1,080	36,082.80	0.04
496	688002	睿创微纳	958	35,628.02	0.04

497	002456	欧菲光	7,100	33,441.00	0.04
498	002557	洽洽食品	500	25,000.00	0.03

### 8.3.2 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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 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	300750	宁德时代	1,398,859.00	0.81
2	002594	比亚迪	786,617.00	0.45
3	600905	三峡能源	771,247.00	0.44
4	000858	五粮液	643,630.00	0.37
5	688599	天合光能	555,262.32	0.32
6	600436	片仔癀	458,101.00	0.26
7	002460	赣锋锂业	455,835.34	0.26
8	002049	紫光国微	447,934.00	0.26
9	000651	格力电器	430,362.00	0.25
10	002466	天齐锂业	408,309.00	0.24
11	601006	大秦铁路	393,186.00	0.23
12	300760	迈瑞医疗	384,178.00	0.22
13	600519	贵州茅台	370,714.00	0.21
14	002812	恩捷股份	364,308.00	0.21
15	000792	盐湖股份	361,306.00	0.21
16	300014	亿纬锂能	339,397.00	0.20
17	601868	中国能建	334,502.00	0.19
18	601888	中国中免	323,636.00	0.19
19	002475	立讯精密	317,394.00	0.18
20	300059	东方财富	314,734.00	0.18

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。

### 8.4.2 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	2,880,857.00	1.66
2	000858	五粮液	1,669,732.00	0.96
3	002594	比亚迪	1,513,076.00	0.87
4	300760	迈瑞医疗	962,460.84	0.55
5	000001	平安银行	729,957.25	0.42
6	000568	泸州老窖	702,952.00	0.40
7	002714	牧原股份	693,521.37	0.40

8	300059	东方财富	683,491.00	0.39
9	002460	赣锋锂业	669,378.00	0.39
10	002352	顺丰控股	668,100.00	0.38
11	002475	立讯精密	665,112.00	0.38
12	002812	恩捷股份	650,474.00	0.37
13	002049	紫光国微	625,662.00	0.36
14	002142	宁波银行	573,844.00	0.33
15	002304	洋河股份	546,113.61	0.31
16	300014	亿纬锂能	511,324.73	0.29
17	000002	万科 A	485,027.00	0.28
18	601816	京沪高铁	480,960.00	0.28
19	300015	爱尔眼科	465,420.00	0.27
20	002129	TCL 中环	424,178.00	0.24

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。

#### 8.4.3 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	43,714,059.38
卖出股票收入（成交）总额	62,588,446.46

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。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

#### 8.6 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

本基金本报告期末未持有债券投资。

#### 8.7 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。

#### 8.8 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。

#### 8.9 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。

#### 8.10 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。



## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 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。

### 8.11.2 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。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 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

2022 年 3 月 21 日，招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”，股票代码：600036）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〔2022〕21 号），其因不良贷款余额 EAST 数据存在偏差、漏报贷款核销业务 EAST 数据等违法违规行为，被处以罚款人民币 300 万元。

2022 年 8 月 31 日，招商银行收到中国人民银行出具的行政处罚决定书（银罚决字〔2022〕1 号），其因违反账户管理规定、违反清算管理规定等违法违规行为，被处以没收违法所得 5.692641 万元、罚款 3423.5 万元的行政处罚。

2022 年 9 月 9 日，招商银行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〔2022〕48 号），其因个人经营贷款挪用至房地产市场、个人经营贷款“三查”不到位、总行对分支机构管控不力承担管理责任等违法违规行为，被处以罚款人民币 460 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招商银行进行了投资。

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）于 2022 年 8 月 22 日收到国家外汇管理局深圳市分局出具的行政处罚决定书，其因未按照规定进行国际收支统计申报，被罚款人民币 30 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。

兴业银行股份有限公司（以下简称“兴业银行”，股票代码：601166）于 2022 年 3 月 21 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〔2022〕22 号），其因漏报贸易融资业务 EAST 数据、漏报贷款核销业务 EAST 数据等违法违规行为，被处以罚款人民币 350 万元。

兴业银行于 2022 年 9 月 9 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〔2022〕41 号），其因债券承销业务严重违反审慎经营规则的违法违规行为，被处以罚

款人民币 150 万元。

兴业银行于 2022 年 9 月 28 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〔2022〕50 号)，其因老产品规模在部分时点出现反弹、未按规定开展理财业务内部审计等违法违规行为，被处以罚款人民币 450 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兴业银行进行了投资。

本基金投资前十名证券的其余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。

### 8.12.2 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。

### 8.12.3 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	4,515.71
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	4,515.71

### 8.12.4 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。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 8.12.5.1 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。

#### 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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		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	
		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 (%)
1,196	48,499.78	19,842,923.00	34.21	38,162,817	65.79	0.00	0

### 9.2 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	中国平安财产保险股份有限公司—传统—普通保险产品	11,890,600.00	20.50
2	广发证券股份有限公司	3,115,362.00	5.37
3	唐崇霖	2,568,000.00	4.43
4	中信证券股份有限公司	2,248,440.00	3.88
5	张红	1,790,400.00	3.09
6	林李丽琴	1,600,000.00	2.76
7	中信建投证券股份有限公司	1,352,260.00	2.33
8	方正证券股份有限公司	1,202,400.00	2.07
9	于凌	678,200.00	1.17
10	郑时昭	650,000.00	1.12

### 9.3 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。

### 9.4 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。

## 9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

无。

## § 10 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	98,005,740.00
本报告期基金总申购份额	18,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	58,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	58,005,740.00

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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2022年12月6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，聘任康乐先生担任本公司财务负责人。

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：

1、2022年3月，中国农业银行总行决定王霄勇任托管业务部总裁。

2、2022年3月，中国农业银行总行决定王洪滨任托管业务部高级专家。

### 11.3 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。

### 11.4 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。

## 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）已经连续 5 年为本基金提供审计服务，本年度应支付给会计师事务所的报酬为人民币 55,000.00 元。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金的管理人及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中无受稽查或处罚等情况。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 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	47,664,549.01	46.10	44,390.58	46.12	-
华福证券有限责任公司	1	11,016,625.30	10.65	10,260.42	10.66	-
长江证券股份有限公司	2	6,653,525.38	6.44	6,196.97	6.44	-
东兴证券股份有限公司	1	5,549,853.98	5.37	5,168.65	5.37	-
中信建投证券股份有限公司	1	3,850,990.92	3.72	3,586.69	3.73	-
天风证券股份有限公司	1	3,084,767.92	2.98	2,872.92	2.98	-
川财证券有限责任公司	1	3,014,144.22	2.92	2,807.31	2.92	-
中泰证券股份有限公司	2	2,279,690.64	2.20	2,123.12	2.21	-
国泰君安证券股份有限公司	1	2,213,447.18	2.14	2,061.36	2.14	-
瑞银证券有限责任公司	1	1,910,030.26	1.85	1,779.04	1.85	-
国盛证券有限责任公司	1	1,905,146.89	1.84	1,774.28	1.84	-
中信证券股份有限公司	6	1,758,678.71	1.70	1,590.09	1.65	本期新增

						1 个
光大证券股份有限公司	2	1,672,507.09	1.62	1,557.58	1.62	-
华创证券有限责任公司	1	1,595,951.29	1.54	1,486.67	1.54	-
兴业证券股份有限公司	1	1,476,056.24	1.43	1,374.69	1.43	-
国金证券股份有限公司	1	1,432,988.58	1.39	1,334.52	1.39	-
申港证券股份有限公司	1	1,389,060.74	1.34	1,293.70	1.34	-
东北证券股份有限公司	2	1,300,743.50	1.26	1,211.46	1.26	-
民生证券股份有限公司	1	1,193,233.40	1.15	1,111.30	1.15	-
长城证券股份有限公司	1	457,020.40	0.44	425.56	0.44	-
国信证券股份有限公司	1	453,048.72	0.44	421.87	0.44	-
广发证券股份有限公司	2	390,680.93	0.38	363.84	0.38	本期新增 1 个
西南证券股份有限公司	1	341,462.55	0.33	317.97	0.33	-
华泰证券股份有限公司	1	298,266.50	0.29	277.83	0.29	-
东方证券股份有限公司	2	269,808.55	0.26	251.31	0.26	-
平安证券股份有限公司	2	187,031.54	0.18	174.15	0.18	-
申万宏源证券有限公司	1	17,968.65	0.02	16.73	0.02	-
安信证券股份有限公司	1	17,530.50	0.02	16.32	0.02	-
诚通证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
大同证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
恒泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

招商证券股份有 限公司	2	-	-	-	-	-
中国银河证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-

注：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。

### 11.7.2 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	-	-	-	-	-	-
华福证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	30,288.48	5.26	-	-	-	-
东兴证	36,012.64	6.25	-	-	-	-

券股份 有限公司						
中信建 投证券 股份有 限公司	72,761.80	12.63	-	-	-	-
天风证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
川财证 券有限 责任公 司	122,678.86	21.29	-	-	-	-
中泰证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
国泰君 安证券 股份有 限公司	-	-	-	-	-	-
瑞银证 券有限 责任公 司	37,701.60	6.54	-	-	-	-
国盛证 券有限 责任公 司	12,242.99	2.12	-	-	-	-
中信证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
光大证 券股份 有限公 司	219,100.10	38.02	-	-	-	-
华创证 券有限 责任公 司	8,968.19	1.56	-	-	-	-
兴业证 券股份	-	-	-	-	-	-



有限公司						
国金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
申港证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	5,293.60	0.92	-	-	-	-
民生证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	5,338.32	0.93	-	-	-	-
西南证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	8,978.23	1.56	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	4,603.70	0.80	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

司						
申万宏源证券有限公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	12,304.28	2.14	-	-	-	-
诚通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
大同证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
恒泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

### 11.8 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旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022年1月1日
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	2022年1月7日

3	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	2022 年 1 月 20 日
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 2021 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 1 月 24 日
5	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2021 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 1 月 24 日
6	景顺长城基金管理有限公司关于投资旗下偏股型公募基金的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 1 月 27 日
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	2022 年 2 月 18 日
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	2022 年 2 月 25 日
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	2022 年 3 月 4 日
10	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2021 年年度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 3 月 28 日
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 2021 年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 3 月 28 日
12	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机升级的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 4 月 8 日
13	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	2022 年 4 月 12 日
14	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	2022 年 4 月 16 日
15	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2022 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 4 月 22 日
16	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	2022 年 4 月 22 日
17	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 2022 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 4 月 22 日
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	2022 年 4 月 29 日
19	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	2022 年 5 月 6 日
20	关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金调整持有停牌股票估值价格的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 5 月 12 日
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	2022 年 6 月 10 日
22	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	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 6 月 16 日

	料概要更新		
23	景顺长城基金管理有限公司关于旗下管理的上海证券交易所上市 ETF 实施申赎业务多码合一的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 6 月 20 日
24	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	2022 年 6 月 22 日
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	2022 年 6 月 24 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20220819-20221016; 20221114-20221122; 20221128-20221231	11,890,600.00	0.00	0.00	11,890,600.00	20.50
本基金的联接基金	2	20220101-20220424	22,352,800.00	28,795,000.00	51,147,800.00	0.00	0.00

#### 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。

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据上海证券交易所（以下简称“上交所”）《关于上海证券交易所 ETF 申赎业务多码合一及平台迁移切换上线有关事项的通知》，自 2022 年 6 月 20 日起，景顺长城基金管理有限公司旗下管理的上交所上市 ETF 取消申赎业务相关代码，投资者可通过 ETF 基金的证券代码（与交易使用的证券代码相同），选择申赎相关业务类型，参与 ETF 申赎业务。本基金原申赎代码 512281 取消，多码合一上线后参与申赎业务的证券代码为 512280。详情请参阅本基金管理人于 2022 年 6 月 20 日发布的《景顺长城基金管理有限公司关于旗下管理的上海证券交易所上市 ETF 实施申赎业务多码合一的公告》。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 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。

### 13.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

### 13.3 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

2023 年 3 月 28 日