

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：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2023 年 3 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 3 月 29 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。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介.....	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	6
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	8
§4 管理人报告.....	8
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.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.9 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	13
§5 托管人报告.....	14
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 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	14
§6 审计报告.....	14
6.1 审计报告基本信息.....	14
6.2 审计报告的基本内容.....	14
§7 年度财务报表.....	16
7.1 资产负债表.....	16
7.2 利润表.....	18
7.3 净资产（基金净值）变动表.....	19
7.4 报表附注.....	21
§8 投资组合报告.....	53
8.1 期末基金资产组合情况.....	53
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	54
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.....	55
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	68
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	69
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.....	69

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.....	70
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.....	70
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.....	70
8.10	本基金投资股指期货的投资政策.....	70
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	70
8.12	投资组合报告附注.....	70
§9	基金份额持有人信息.....	71
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	71
9.2	期末上市基金前十名持有人.....	72
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	72
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.....	72
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.....	73
§10	开放式基金份额变动.....	73
§11	重大事件揭示.....	73
11.1	基金份额持有人大会决议.....	73
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.....	73
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	73
11.4	基金投资策略的改变.....	73
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	74
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.....	74
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	74
11.8	其他重大事件.....	75
§12	影响投资者决策的其他重要信息.....	77
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.....	77
12.2	影响投资者决策的其他重要信息.....	78
§13	备查文件目录.....	78
13.1	备查文件目录.....	78
13.2	存放地点.....	78
13.3	查阅方式.....	78

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	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	南方 MSCI 中国 A 股国际通 ETF
场内简称	MSCI 基金（MSCI 中国 A 股 ETF）
基金主代码	512160
交易代码	512160
基金运作方式	交易型开放式（ETF）
基金合同生效日	2018 年 4 月 3 日
基金管理人	南方基金管理股份有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	303,777,775.00 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 4 月 27 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪误差最小化。
投资策略	<p>本基金为被动式指数基金，采用完全复制法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。</p> <p>当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。</p>
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数收益率。本基金标的指数为 MSCI China A Inclusion RMB Index（MSCI 中国 A 股国际通指数）及其未来可能发生的变更。
风险收益特征	本基金属股票型基金，一般而言，其风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，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。

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	南方基金管理股份有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	常克川
		许俊

	联系电话	0755-82763888	010-66596688
	电子邮箱	manager@southernfund.com	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		400-889-8899	95566
传真		0755-82763889	010-66594942
注册地址	深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼		北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址	深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼		北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	518017		100818
法定代表人	周易		刘连舸

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	http://www.nffund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的住所、基金上市交易的证券交易所（如有）

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）	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 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

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	-30,016,773.97	108,141,495.72	229,614,175.73
本期利润	-116,005,308.01	24,887,657.32	275,470,879.85
加权平均基金份额本期利润	-0.3511	0.0665	0.4903
本期加权平均净值利润率	-23.58%	3.88%	35.64%
本期基金份额净值增长率	-19.20%	4.41%	43.32%
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	124,122,439.00	236,234,678.73	317,832,619.37
期末可供分配基金份额利润	0.4085	0.7433	0.6234
期末基金资产净值	427,900,214.00	554,012,453.73	851,224,039.70
期末基金份额净值	1.4086	1.7434	1.6698
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	40.86%	74.34%	66.98%

注：1、基金业绩指标不包括持有人认（申）购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

3、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.32%	1.22%	1.03%	1.22%	0.29%	0.00%
过去六个月	-11.89%	1.07%	-13.04%	1.07%	1.15%	0.00%
过去一年	-19.20%	1.28%	-20.93%	1.27%	1.73%	0.01%
过去三年	20.90%	1.30%	3.49%	1.30%	17.41%	0.00%
自基金合同生效起至今	40.86%	1.29%	8.91%	1.29%	31.95%	0.00%

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

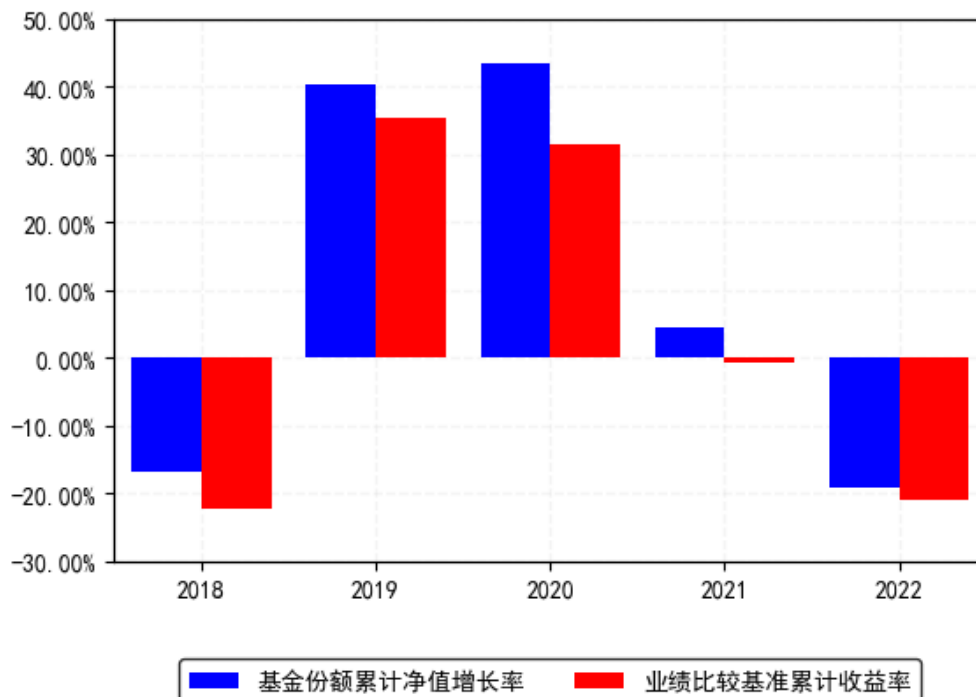
基准收益率变动的比较

南方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



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

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



注：基金合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 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

1998 年 3 月 6 日，经中国证监会批准，南方基金管理有限公司作为国内首批规范的基金管理公司正式成立，成为我国“新基金时代”的起始标志。

2018 年 1 月，公司整体变更设立为南方基金管理股份有限公司。2019 年 7 月，根据南方基金管理股份有限公司股东大会决议，并经中国证监会核准，本公司原股东及新增股东共同认购了本公司新增的注册资本，认购完成后注册资本为 36172 万元人民币。目前股权结构为：华泰证券股份有限公司 41.16%、深圳市投资控股有限公司 27.44%、厦门国际信托有限公司 13.72%、兴业证券股份有限公司 9.15%、厦门合泽吉企业管理合伙企业(有限合伙)1.72%、厦门合泽祥企业管理合伙企业（有限合伙）2.24%、厦门合泽益企业管理合伙企业（有限合伙）2.25%、厦门合泽盈企业管理合伙企业（有限合伙）2.32%。目前，公司总部设在深圳，在北京、上海、深圳、南京、成都、合肥等地设有分公司，在香港和深圳前海设有子公司——南方东英资产管理有限公司（香港子公司）和南方资本管理有限公司（深圳子公司）。其中，南方东英是境内基金公司获批成立的第一家境外分支机构。

截至本报告期末，南方基金管理股份有限公司（不含子公司）管理资产规模超过 1.72 万亿元，旗下管理 317 只公募基金，多个全国社保、基本养老保险、企业年金、职业年金和专户组合。

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		
罗文杰	本基金基金经理	2018 年 4 月 3 日	-	17 年	女，美国南加州大学数学金融硕士、美国加州大学计算机科学硕士，具有基金从业资格。曾任职于摩根士丹利投资银行，从事量化分析工作。2008 年 9 月加入南方基金，曾任南方基金数量化投资部基金经理助理；现任指数投资部总经理。2013 年 5 月 17 日至 2015 年 6 月 16 日，任南方策略基金经理；2017 年 11 月 9 日至 2019 年 1 月 18 日，任南方策

				略、南方量化混合基金经理；2016 年 12 月 30 日至 2019 年 4 月 18 日，任南方安享绝对收益、南方卓享绝对收益基金经理；2018 年 2 月 8 日至 2020 年 3 月 27 日，任 H 股 ETF 基金经理；2018 年 2 月 12 日至 2020 年 3 月 27 日，任南方 H 股联接基金经理；2014 年 10 月 30 日至 2020 年 12 月 23 日，任 500 医药基金经理；2013 年 4 月 22 日至今，任南方 500、南方 500ETF 基金经理；2013 年 5 月 17 日至今，任南方 300、南方 300 联接基金经理；2015 年 2 月 16 日至今，任南方恒生 ETF 基金经理；2017 年 7 月 21 日至今，任恒生联接基金经理；2017 年 8 月 24 日至今，任南方房地产联接基金经理；2017 年 8 月 25 日至今，任南方房地产 ETF 基金经理；2018 年 4 月 3 日至今，任 MSCI 基金基金经理；2018 年 6 月 8 日至今，任 MSCI 联接基金经理；2020 年 7 月 24 日至今，兼任投资经理；2020 年 12 月 25 日至今，任南方策略基金经理；2021 年 3 月 12 日至今，任南方中证创新药产业 ETF 基金经理；2021 年 7 月 2 日至今，任南方中证香港科技 ETF（QDII）基金经理；2021 年 10 月 22 日至今，任南方中证全指医疗保健 ETF 基金经理；2022 年 6 月 17 日至今，任南方恒生香港上市生物科技 ETF（QDII）基金经理。
--	--	--	--	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

注：1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告（生效）日期；

2、证券从业年限计算标准遵从中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券投资基金从业人员范围的相关规定。

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

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
罗文杰	公募基金	15	79,109,839,245.40	2013 年 04 月 22 日
	私募资产管理计划	8	2,741,258,733.15	2020 年 08 月 07 日
	其他组合	-	-	-
	合计	23	81,851,097,978.55	-

4.1.4 基金经理薪酬机制

公司基金经理薪酬由工资、奖金等构成。工资由基金经理任职的职位职级决定，重点体现员工能力和职位价值导向原则；奖金由员工的绩效贡献决定，重点体现绩效导向与差异化原则。对于兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理，公司对私募资产管理计划产生的超额业绩报酬实施对应激励，并依据其管理产品的长期业绩与个人综合贡献情况实施分配。为贯彻激励约束相结合、激励与约束并重的管理理念，鼓励长期任职，防范经营风险，公司对基金经理奖金实施递延发放；同时，为加强员工利益与持有人利益相捆绑及一致性，公司对基金经理实施了跟投购基机制，有效引导基金经理为客户持续创造价值。

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》等有关法律法规、中国证监会和本基金基金合同的规定，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，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。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

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》和有关法律法规的规定，针对股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等投资管理活动，以及授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节，建立了股票、债券、基金等证券池管理制度和细则，投资管理制度和细则，集中交易管理办法，公平交易操作指引，异常交易管理制度等公平交易相关的公司制度或流程指引。通过加强投资决策、交易执行的内部控制，完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估，以及履行相关的报告和信息披露义务，切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为，保护投资者合法权益。

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》，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。公司每季度对旗下组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析。

本报告期内，两两组合间单日、3日、5日时间窗口内同向交易买入溢价率均值或卖出溢价率均值显著不为0的情况不存在，并且交易占比也没有明显异常，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

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

本基金管理人依据《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》的要求，建立和完善了兼任相关的制度及流程，确保兼任基金经理公平对待其管理的所有投资组合。通过对基金经理的投资交易行为进行监控和分析，本报告期内，两两组间各项操作、流程及事后分析均正常，未发现不公平对待各组合或组间相互利益输送的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金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% 的交易次数为 12 次，是由于投资组合的投资策略导致。

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

报告期内，MSCI 国际通指数下跌 20.93%。期间我们通过自建的指数化交易系统、日内择时交易模型、跟踪误差归因分析系统、ETF 现金流精算系统等，将本基金的跟踪误差指标控制在较好水平，并通过严格的风险管理流程，确保了本基金的安全运作。

我们对本基金报告期内跟踪误差归因分析如下：

(1) 大额申购赎回带来的成份股权重偏差，对此我们通过日内择时交易争取跟踪误差最小化；

(2) 报告期内指数成份股（包括调出指数成份股）的长期停牌，引起的成份股权重偏离及基金整体仓位的微小偏离；

(3) 股指期货和现货之间的基差波动带来的本基金与基准的偏离；

(4) 报告期内，我们根据指数定期的成份股调整进行了基金调仓，事前我们制定了详细的调仓方案，在实施过程中引入多方校验机制防范风险发生，从实施结果来看，效果良好，跟踪误差控制在理想范围内。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.4086 元，报告期内，份额净值增长率为-19.20%，同期业绩基准增长率为-20.93%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年海内外宏观环境较为复杂，俄乌冲突、美元紧缩，以及本土疫情等，A 股和港股市场有较大幅度调整。现阶段，大中华权益市场估值已处于历史底部区域，下行空间收窄，具长期配置价值。

本基金为指数基金，作为基金管理人，我们将通过严格的投资管理流程、精确的数量化计算、精益求精的工作态度、恪守指数化投资的宗旨，力求实现对标的指数的有效跟踪，为持有人提供与之相近的收益。投资者可以根据自身对证券市场的判断及投资风格，借助投资本基金参与市场。

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，本基金管理人根据法律法规、监管要求、自律规则和业务发展情况，严格遵循包括《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》在内的公募基金行业各项法律法规及其他规范要求，有效落实了 2022 年度发布的《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》和《个人养老金投资公开募集证券投资基金业务管理暂行规定》等公募基金相关新法律法规。

本基金管理人坚持从保护基金份额持有人利益出发，树立并坚守“全员合规、合规从高层做起、合规创造价值、合规是公司生存基础、合规为先、行稳致远”的合规理念，继续致力于合规与内控机制的完善，严守底线，通过有效过程管控，将合规管理全面深度嵌入流程与业务，积极推动主动合规风控管理，持续加强业务风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，有效保障了旗下基金及公司各项业务合法合规、稳健有序运作开展。

本报告期内，本基金管理人结合新法规的实施、新的监管要求和公司业务发展实际情况，积极推动监管新规落实，持续完善内部控制体系和内部控制制度、业务流程，制订和修订了包括《合规手册制度》《防控内幕信息及交易管理制度》《合规绩效管理制度》《责任追究管理办法》《洗钱及制裁风险名单管理规定》和《非居民金融账户涉税信息尽职调查管理规则》等一系列与监察稽核和合规内控相关的管理制度。

在进一步优化制度体系的基础上，本基金管理人贯彻“合规为先，行稳致远”的合规理念，提升合规文化建设效果，着力增强合规培训实效性，提升合规宣导影响力；根据《基金从业人员管理规则》等监管办法要求，认真梳理并优化了员工行为检查工作方案，加强员工行为规范检查、严格进行合规问责，强化全员合规、主动合规理念；对投研交易、市场销售、后台运营及人员管理等业务和相关部门开展了定期稽核、专项稽核及多项自查，通过专项稽核和合规检查工作识别问题、防范风险、推动解决，促进公司业务合规运作、稳健经营；结合内部风控系统大数据分析结果对各类合规指标采取差异化管控措施，采取事前防范、事中控制和事后监督等三阶段工作，持续完善投资合规风控制度流程和系统，加强流动性指标等重要指标的监控和内幕交易防控，有效确保投研交易业务合规运作；全面履行新产品、新业务合规评估程序，保障新产品、新业务合规开展；严格审查基金宣传推介材料以及包括网络直播脚本在内的其他宣传材料合规性，不断强化销售合规风险管控，督促落实投资者适当性管理制度；完成各项信息披露工作，保障所披露信息的真实性、准确性和完整性；开展各类

监管组织的投教活动，提升投教质效；监督和落实客户投诉处理，重视媒体监督和投资者关系管理。

本基金管理人高度重视反洗钱相关工作，贯彻风险为本，自评估驱动，反洗钱重点问题解决方案实现落地推进。从制度建设、系统功能建设、业务流程规范、宣传培训、监督检查等方面入手，将反洗钱工作贯穿于公司各项业务流程，有效提升了公司反洗钱工作的合规水平。

本基金管理人承诺将坚持诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，积极健全全部管理制度，不断提高监察稽核及合规管理工作的科学性和有效性，持续全面推进合规数智化工作在更广范围应用并与合规管理工作深度融合，努力防范和管理各类风险，切实维护基金资产的安全与利益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术；建立了估值委员会，组成人员包括副总经理、督察长、权益研究部总经理、固定收益研究部总经理、指数投资部总经理、现金及债券指数投资部总经理、风险管理部总经理及运作保障部总经理等。本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规的规定和基金合同的约定，以及本基金的实际运作情况，本基金报告期末未进行利润分配。在符合分红条件的前提下，本基金已实现尚未分配的可供分配收益部分，将严格按照基金合同的约定适时向投资者予以分配。

4.9 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 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 27467 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	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 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“南方 MSCI 中国 A 股国际通 ETF

	<p>基金”)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,公允反映了南方 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 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。</p>
形成审计意见的基础	<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,我们独立于南方 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>南方 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司(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南方 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 基金的持续经营能力,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南方 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 基金、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南方 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<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</p>

	<p>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，就可能对南方 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 基金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南方 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 基金不能持续经营。</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	张振波 陈薇瑶
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2023 年 3 月 29 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：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	上年度末 2021 年 12 月
----	-----	--------------------	------------------

		日	31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	1,663,538.70	2,512,242.66
结算备付金		497,192.02	1,038,445.33
存出保证金		337,659.35	825,068.46
交易性金融资产	7.4.7.2	426,003,343.88	550,384,990.46
其中：股票投资		426,003,343.88	549,764,990.46
基金投资		-	-
债券投资		-	620,000.00
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		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		212,446.96	72,088.99
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	702.49
资产总计		428,714,180.91	554,833,538.39
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
负债：			
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		183,598.16	230,057.83
应付托管费		36,719.65	46,011.56
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.07	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	593,649.03	545,015.27

负债合计		813,966.91	821,084.66
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	303,777,775.00	317,777,775.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	124,122,439.00	236,234,678.73
净资产合计		427,900,214.00	554,012,453.73
负债和净资产总计		428,714,180.91	554,833,538.39

注：报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.4086 元，基金份额总额 303,777,775.00 份。

7.2 利润表

会计主体：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
一、营业总收入		-112,624,769.88	30,102,748.49
1.利息收入		18,900.03	35,074.41
其中：存款利息收入	7.4.7.9	18,900.03	34,583.07
债券利息收入		-	491.34
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）		-26,967,313.44	110,576,305.98
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-37,512,351.22	99,889,296.34
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	421,628.29	498,789.41
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.12	-	-
衍生工具收益	7.4.7.13	-708,956.78	823,294.76
股利收益	7.4.7.14	10,832,366.27	9,364,925.47
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）	7.4.7.15	-85,988,534.04	-83,253,838.40
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	312,177.57	2,745,206.50
减：二、营业总支出		3,380,538.13	5,215,091.17
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	2,465,815.40	3,221,489.29
2.托管费	7.4.10.2.2	493,163.04	644,297.83
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.税金及附加		0.46	3,336.52
8.其他费用	7.4.7.17	421,559.23	1,345,967.53
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-116,005,308.01	24,887,657.32
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-116,005,308.01	24,887,657.32
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-116,005,308.01	24,887,657.32

7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：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）	317,777,775.00	-	236,234,678.73	554,012,453.73
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）	317,777,775.00	-	236,234,678.73	554,012,453.73
三、本期增减变	-14,000,000.00	-	-112,112,239.73	-126,112,239.73

动额（减少以“-”号填列）				
（一）、综合收益总额	-	-	-116,005,308.01	-116,005,308.01
（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）	-14,000,000.00	-	3,893,068.28	-10,106,931.72
其中：1.基金申购款	146,000,000.00	-	78,416,559.31	224,416,559.31
2.基金赎回款	-160,000,000.00	-	-74,523,491.03	-234,523,491.03
（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、本期期末净资产（基金净值）	303,777,775.00	-	124,122,439.00	427,900,214.00
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）	509,777,775.00	-	341,446,264.70	851,224,039.70
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）	509,777,775.00	-	341,446,264.70	851,224,039.70
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-192,000,000.00	-	-105,211,585.97	-297,211,585.97
（一）、综合收益总额	-	-	24,887,657.32	24,887,657.32
（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）	-192,000,000.00	-	-130,099,243.29	-322,099,243.29

号填列)				
其中: 1.基金申购款	330,000,000.00	-	242,154,337.13	572,154,337.13
2.基金赎回款	-522,000,000.00	-	-372,253,580.42	-894,253,580.42
(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、本期期末净资产(基金净值)	317,777,775.00	-	236,234,678.73	554,012,453.73

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：

_____ 杨小松 _____ 徐超 _____ 徐超 _____
 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

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]408 号《关于准予 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》注册,由南方基金管理股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,309,777,775.00 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 0216 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《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 3 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,309,777,775.00 份基金份额,无认购资金利息折合基金份额。本基金的基金管理人为南方基金管理股份有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2018]45 号审核同意,本基金 1,309,777,775.00 份基金份额于 2018 年 4 月 27 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《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 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；主要投资于 MSCI 中国 A 股国际通指数成份股和备选成份股。此外，本基金可少量投资于非成份股（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票以及存托凭证）、衍生工具（权证、股指期货等）、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、货币市场工具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）。本基金投资于 MSCI 中国 A 股国际通指数成份股、备选成份股的资产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%。在正常市场情况下，本基金力争控制本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.1%，年跟踪误差不超过 2%。本基金的业绩比较基准为：MSCI 中国 A 股国际通指数收益率。

本基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司以本基金为目标 ETF，募集成立了 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（以下简称“MSCI 中国 A 股国际通 ETF 联接基金”）。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南方基金管理股份有限公司于 2023 年 3 月 29 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》、《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 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

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

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、买入返售金融资产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和资产支持证券投资，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卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以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衍生金融资产/负债。

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

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或资产支持证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。

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、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具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

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。债券投资和资产支持证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和资产支持证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扣除按票面利率(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后的净额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及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税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。

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。本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,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。收益分配不须以弥补浮动亏损为前提,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

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作,本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下:

(1) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票,根据中国基金业协会中基协发

[2017]6 号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”),按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(2) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

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 2,512,242.66 元、1,038,445.33 元、825,068.46 元、702.49 元和 72,088.99 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 2,512,500.41 元、1,038,850.26 元、825,093.46 元、0.00 元和 72,088.99 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 550,384,990.46 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 550,385,005.27 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 230,057.83 元、46,011.56 元、16,283.68 元和 353,731.59 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 230,057.83 元、46,011.56 元、16,283.68 元和 353,731.59 元。

i) 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

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

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[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。

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	1,663,538.70	2,512,242.66
等于：本金	1,663,435.65	2,512,242.66
加：应计利息	103.05	-
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-

等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	1,663,538.70	2,512,242.66

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		485,713,072.71	-	426,003,343.88	-59,709,728.83
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		485,713,072.71	-	426,003,343.88	-59,709,728.83
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		523,531,945.25	-	549,764,990.46	26,233,045.21
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	620,000.00	-	620,000.00	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	620,000.00	-	620,000.00	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		524,151,945.25	-	550,384,990.46	26,233,045.21

注：于 2022 年 12 月 31 日，股票投资的公允价值和公允价值变动包含的可退替代款的估值增值为 0.00 元(2021 年 12 月 31 日：-6.00 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

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日
----	----------------------

	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	2,308,880.00	-	-	-
— 股指期货	2,308,880.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	2,308,880.00	-	-	-
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	5,842,000.00	-	-	-
— 股指期货	5,842,000.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	5,842,000.00	-	-	-

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

代码	名称	持仓量 (买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2303	IC2303	1.00	1,174,880.00	16,800.00
IF2301	IF2301	1.00	1,165,800.00	15,000.00
合计				31,800.00
减: 可抵销期货暂收款				31,800.00
净额				-

注: 1、买入持仓量以正数表示, 卖出持仓量以负数表示。

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

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无各项买入返售金融资产。

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无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 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	-	702.49

其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	702.49

7.4.7.6 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	7,837.02	16,283.68
其中：交易所市场	7,837.02	16,283.68
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
应退退补款	100,286.30	284,363.89
预提费用	170,000.00	175,000.00
应付指数使用费	315,525.71	68,813.60
可退替代款	-	554.10
其他	-	-
合计	593,649.03	545,015.27

注：1、应退退补款指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，替代价格与实际买入成本或强制退款成本之差乘以替代数量的金额；

2、可退替代款指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，替代价格与该替代证券市价之差乘以替代数量的金额。

7.4.7.7 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	317,777,775.00	317,777,775.00
本期申购	146,000,000.00	146,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-160,000,000.00	-160,000,000.00
基金拆分/份额折算前	-	-
基金份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	303,777,775.00	303,777,775.00

7.4.7.8 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	279,019,890.26	-42,785,211.53	236,234,678.73

本期利润	-30,016,773.97	-85,988,534.04	-116,005,308.01
本期基金份额交易产生的变动数	-10,563,999.35	14,457,067.63	3,893,068.28
其中：基金申购款	124,083,942.55	-45,667,383.24	78,416,559.31
基金赎回款	-134,647,941.90	60,124,450.87	-74,523,491.03
本期已分配利润	-	-	-
本期末	238,439,116.94	-114,316,677.94	124,122,439.00

7.4.7.9 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	7,423.93	8,689.36
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	10,844.04	22,901.64
其他	632.06	2,992.07
合计	18,900.03	34,583.07

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 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	-22,497,884.81	63,412,089.27
股票投资收益——赎回差价收入	-15,014,466.41	36,477,207.07
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	-37,512,351.22	99,889,296.34

7.4.7.10.2 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	170,182,077.29	583,271,424.58
减：卖出股票成本总额	192,418,630.29	519,859,335.31
减：交易费用	261,331.81	-
买卖股票差价收入	-22,497,884.81	63,412,089.27

注：上述交易费用（如有）包含股票买卖产生的交易费用。

7.4.7.10.3 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	234,523,491.03	894,253,580.42
减：现金支付赎回款总额	92,463,770.03	372,073,016.42
减：赎回股票成本总额	157,074,187.41	485,703,356.93
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	-15,014,466.41	36,477,207.07

7.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无股票申购差价收入。

7.4.7.10.5 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无证券出借差价收入。

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 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	231.71	-
债券投资收益——买卖债券（、 债转股及债券到期兑付）差价收 入	421,396.58	498,789.41
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	421,628.29	498,789.41

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 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
卖出债券（、债转股及债券 到期兑付）成交总额	2,668,474.21	5,689,519.11
减：卖出债券（、债转股及 债券到期兑付）成本总额	2,246,800.00	5,190,100.00
减：应计利息总额	250.40	629.70
减：交易费用	27.23	-
买卖债券差价收入	421,396.58	498,789.41

注：上述交易费用（如有）包含债券买卖产生的交易费用。

7.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无债券赎回差价收入。

7.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无债券申购差价收入。

7.4.7.11.5 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.12 贵金属投资收益**7.4.7.12.1 贵金属投资收益项目构成**

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.12.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无买卖贵金属差价收入。

7.4.7.12.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属赎回差价收入。

7.4.7.12.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属申购差价收入。

7.4.7.13 衍生工具收益**7.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具买卖权证差价收入。

7.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间收益金额 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
股指期货-投资收益	-708,956.78	823,294.76

7.4.7.14 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	10,832,366.27	9,364,925.47
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	10,832,366.27	9,364,925.47
----	---------------	--------------

7.4.7.15 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	-85,942,774.04	-83,056,506.40
——股票投资	-85,942,774.04	-83,056,506.40
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-45,760.00	-197,332.00
——权证投资	-	-
——期货投资	-45,760.00	-197,332.00
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-85,988,534.04	-83,253,838.40

注：本基金本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为 6.00 元(2021 年度：-6.00 元)。

7.4.7.16 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	312,177.57	1,780,245.43
其他	-	964,961.07
合计	312,177.57	2,745,206.50

注：替代损益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。

7.4.7.17 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	50,000.00	55,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
指数使用费	246,712.11	325,604.77

银行费用	4,847.12	10,864.31
交易费用	-	834,498.45
合计	421,559.23	1,345,967.53

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% 的季度费率计提，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美元 5,000 元。计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。

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

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金的基金管理人于 2023 年 1 月 12 日宣告 2022 年度第 1 次分红，向截至 2023 年 1 月 16 日止在本基金注册登记人中国证券登记结算有限责任公司登记在册的全体持有人，按每 10 份基金份额派发红利 2.9000 元。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理股份有限公司("南方基金")	基金管理人
中国银行股份有限公司("中国银行")	基金托管人
华泰证券股份有限公司("华泰证券")	基金管理人的股东、基金销售机构
兴业证券股份有限公司("兴业证券")	基金管理人的股东、基金销售机构
厦门国际信托有限公司("厦门国际信托")	基金管理人的股东
深圳市投资控股有限公司("深圳投资控股")	基金管理人的股东
厦门合泽吉企业管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
厦门合泽祥企业管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
厦门合泽益企业管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
厦门合泽盈企业管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
华泰联合证券有限责任公司("华泰联合")	基金管理人的股东华泰证券控制的公司
南方资本管理有限公司("南方资本")	基金管理人的子公司
南方东英资产管理有限公司("南方东英")	基金管理人的子公司
MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金("南方 MSCI 中国 A 股 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
华泰证券	10,059,096.18	3.00%	45,901,074.27	4.36%

7.4.10.1.2 债券交易

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	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
华泰证券	919,683.52	34.46%	2,589,087.10	45.51%

7.4.10.1.3 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.4 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
华泰证券	1,005.88	3.00%	236.73	3.02%
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
华泰证券	4,590.34	4.36%	594.23	3.65%

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

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	2,465,815.40	3,221,489.29
其中：支付销售机构的客户维护费	17,799.22	27,541.51

注：支付基金管理人南方基金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 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托管费	493,163.04	644,297.83

注：支付基金托管人中国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：

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

7.4.10.2.3 销售服务费

无。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间无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

本基金本报告期内及上年度可比期间无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。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间无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。

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固有资金投资本基金的情况

无。

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 2022 年 12 月 31 日	上年度末 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
MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	104,596,100.00	34.43%	112,723,100.00	35.47%
华泰证券股份有限公司	11,860,689.00	3.90%	8,485,389.00	2.67%

注：南方 MSCI 中国 A 股 ETF 联接基金、华泰证券投资本基金适用的认(申)购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

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
中国银行	1,663,538.70	7,423.93	2,512,242.66	8,689.36

注：本基金由基金托管人中国银行保管的银行存款，按银行约定利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

单位：人民币元

本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:股/张)	总金额
华泰联合	301327	华宝新能	网下申购	1,813	430,587.50
华泰联合	688048	长光华芯	网下申购	3,542	286,193.60
华泰联合	688046	药康生物	网下申购	12,070	271,937.10
华泰联合	301195	北路智控	网下申购	3,300	234,861.00
华泰联合	301207	华兰疫苗	网下申购	3,679	209,261.52
华泰联合	110085	通 22 转债	配债	1,580	158,000.00
华泰联合	301153	中科江南	网下申购	3,973	133,810.64
华泰联合	601377	兴业证券	配股	24,903	129,495.60
华泰联合	301277	新 天 地	网下申购	4,384	118,368.00
华泰联合	688420	美腾科技	网下申购	2,408	117,895.68
华泰联合	113055	成银转债	配债	1,050	105,000.00
华泰联合	601108	财通证券	配股	14,430	98,124.00
华泰联合	123145	药石转债	配债	138	13,800.00
华泰联合	001258	立新能源	网下申购	3,188	10,775.44
兴业证券	600030	中信证券	配股	19,995	288,527.85
兴业证券	301165	锐捷网络	网下申购	5,040	163,195.20
兴业证券	603280	南方路机	网下申购	363	8,621.25

上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位: 股/张)	总金额
华泰联合	688246	嘉和美康	网下申购	7,515	296,842.50
华泰联合	113050	南银转债	配债	2,920	292,000.00
华泰联合	688192	迪哲医药	网下申购	5,299	278,621.42
华泰联合	688083	中望软件	网下申购	1,837	276,468.50
华泰联合	688105	诺唯赞	网下申购	3,726	204,930.00
华泰联合	002142	宁波银行	配股	7,410	147,977.70
华泰联合	110081	闻泰转债	配债	1,250	125,000.00
华泰联合	688161	威高骨科	网下申购	3,069	111,159.18
华泰联合	600909	华安证券	配股	16,260	59,836.80
华泰联合	688633	星球石墨	网下申购	1,558	52,379.96
华泰联合	688097	博众精工	网下申购	3,983	44,888.41
华泰联合	301078	孩子王	网下申购	7,551	43,569.27
华泰联合	688613	奥精医疗	网下申购	2,617	42,997.31
华泰联合	688350	富淼科技	网下申购	2,552	34,656.16
华泰联合	605499	东鹏饮料	网下申购	632	29,242.64
华泰联合	688260	昀冢科技	网下申购	2,990	28,793.70
华泰联合	300975	商络电子	网下申购	4,917	26,945.16
华泰联合	688314	康拓医疗	网下申购	1,085	18,813.90
华泰联合	301033	迈普医学	网下申购	1,076	16,290.64
华泰联合	605389	长龄液压	网下申购	356	14,026.40
华泰联合	605208	永茂泰	网下申购	801	10,733.40
华泰联合	001234	泰慕士	网下申购	333	5,504.49
兴业证券	300979	华利集团	网下申购	8,136	270,277.92
兴业证券	300941	创识科技	网下申购	3,989	85,005.59
兴业证券	688639	华恒生物	网下申购	2,302	53,314.32
兴业证券	688195	腾景科技	网下申购	2,693	36,624.80
兴业证券	688597	煜邦电力	网下申购	3,907	22,973.16
兴业证券	605298	必得科技	网下申购	391	6,252.09
兴业证券	605086	龙高股份	网下申购	443	5,696.98
兴业证券, 华泰联合	113052	兴业转债	配债	6,110	611,000.00

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

于本年度末, 本基金持有关联方中国银行、华泰证券和兴业证券发行的普通股, 成本总额为人民币 3,400,605.37 元, 估值总额为人民币 2,879,112.34 元, 占基金资产净值的比例为 0.67%(上年度末: 本基金持有关联方中国银行、华泰证券、兴业证券发行的普通股, 成本总额为人民币 3,768,079.63 元, 估值总额为人民币 3,742,816.08 元, 占基金资产净值的比例为 0.68%)。

7.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
301095	广立微	2022年7月28日	6个月	新股锁定期	58.00	86.49	439	25,462.00	37,969.11	-
301165	锐捷网络	2022年11月14日	6个月	新股锁定期	32.38	31.61	504	16,319.52	15,931.44	-
301195	北路智控	2022年7月25日	6个月	新股锁定期	71.17	73.04	330	23,486.10	24,103.20	-
301267	华夏眼科	2022年10月26日	6个月	新股锁定期	50.88	66.20	366	18,622.08	24,229.20	-
301270	汉仪股份	2022年8月19日	6个月	新股锁定期	25.68	28.37	210	5,392.80	5,957.70	-
301277	新天地	2022年11月9日	6个月	新股锁定期	27.00	25.78	439	11,853.00	11,317.42	-
301280	珠城科技	2022年12月19日	6个月	新股锁定期	67.40	44.80	279	18,804.60	12,499.20	-
301283	聚胶股份	2022年8月26日	6个月	新股锁定期	52.69	51.41	235	12,382.15	12,081.35	-
301297	富乐德	2022年12月23日	6个月	新股锁定期	8.48	12.99	1,015	8,607.20	13,184.85	-
301306	西测测试	2022年7月19日	6个月	新股锁定期	43.23	42.29	255	11,023.65	10,783.95	-
301309	万得凯	2022年9月	6个月	新股锁定期	39.00	24.46	228	8,892.00	5,576.88	-

		8 日								
301318	维海德	2022 年 8 月 3 日	6 个月	新股锁定期	64.68	41.74	206	13,324.08	8,598.44	-
301319	唯特偶	2022 年 9 月 22 日	6 个月	新股锁定期	47.75	53.27	115	5,491.25	6,126.05	-
301327	华宝新能	2022 年 9 月 8 日	6 个月	新股锁定期	237.50	176.97	182	43,225.00	32,208.54	-
301356	天振股份	2022 年 11 月 3 日	6 个月	新股锁定期	63.00	43.33	374	23,562.00	16,205.42	-
301366	一博科技	2022 年 9 月 19 日	6 个月	新股锁定期	65.35	45.09	268	17,513.80	12,084.12	-
301367	怡和嘉业	2022 年 10 月 21 日	6 个月	新股锁定期	119.88	175.78	131	15,704.28	23,027.18	-
301377	鼎泰高科	2022 年 11 月 11 日	6 个月	新股锁定期	22.88	17.63	770	17,617.60	13,575.10	-
301388	欣灵电气	2022 年 10 月 26 日	6 个月	新股锁定期	25.88	21.60	292	7,556.96	6,307.20	-
301391	卡莱特	2022 年 11 月 24 日	6 个月	新股锁定期	96.00	80.97	183	17,568.00	14,817.51	-
688147	微导纳米	2022 年 12 月 16 日	6 个月	新股锁定期	24.21	23.91	6,293	152,353.53	150,465.63	-

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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。

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	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
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	3,570	408,070.36	190,209.60	-
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	6,700	346,064.41	310,947.00	-

本基金截至 2022 年 12 月 31 日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

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

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

本基金是指数型基金，紧密跟踪 MSCI 中国 A 股国际通指数，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风险较高、收益较高的品种。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。本基金采用完全复制法，跟踪 MSCI 中国 A 股国际通指数，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。但在因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时,基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代,力求与标的指数的跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设,建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规与风险管理委员会,负责制定风险管理的宏观政策,审议通过风险控制的总体措施等,在管理层层面设立风险控制委员会,讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施,在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责,协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估,督察长负责组织指导监察稽核工作。

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

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之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况,导致基金资产损失和收益变化的风险。

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

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程,通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险。信用等级评估以内部信用评级为主,外部信用评级为辅。内部债券信用评级主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险,以及信用产品的条款和担保人的情况等。此外,本基金的基金管理人根据信用产品的内部评级,通过单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制,通过分散化投资以分散信用风险。

于本年度末,本基金无债券投资(上年度末:本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券占基金资产净值的比例为 0.11%)。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的投资股指期货，以对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等，主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。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。

于本年度末，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息。本基金赎回基金份额采用一篮子股票形式，流动性风险相对较低。

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》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注“期末本基金持有的流通受限证券”。此外，如根据基金合同的规定，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于本年度末，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 0.22%。

同时，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逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，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

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

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受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险,其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控,并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息,因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和存出保证金等。

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 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,663,538.70	-	-	-	1,663,538.70
结算备付金	497,192.02	-	-	-	497,192.02
存出保证金	33,280.15	-	-	304,379.20	337,659.35
交易性金融资产	-	-	-	426,003,343.88	426,003,343.88
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
其他债权投资	-	-	-	-	-
其他权益工具投资	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	212,446.96	212,446.96
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	2,194,010.87	-	-	426,520,170.04	428,714,180.91
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-

债					
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	-	-	-	183,598.16	183,598.16
应付托管费	-	-	-	36,719.65	36,719.65
应付销售服 务费	-	-	-	-	-
应付投资顾 问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	0.07	0.07
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税 负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	593,649.03	593,649.03
负债总计	-	-	-	813,966.91	813,966.91
利率敏感度 缺口	2,194,010.87	-	-	425,706,203. 13	427,900,214. 00
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,512,242.66	-	-	-	2,512,242.66
结算备付金	1,038,445.33	-	-	-	1,038,445.33
存出保证金	55,698.86	-	-	769,369.60	825,068.46
交易性金融 资产	-	-	620,000.00	549,764,990. 46	550,384,990. 46
衍生金融资 产	-	-	-	-	-
买入返售金 融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
其他债权投 资	-	-	-	-	-
其他权益工 具投资	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	72,088.99	72,088.99
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税 资产	-	-	-	-	-

其他资产	-	-	-	702.49	702.49
资产总计	3,606,386.85	-	620,000.00	550,607,151.54	554,833,538.39
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
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	-	-	-	230,057.83	230,057.83
应付托管费	-	-	-	46,011.56	46,011.56
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	-	-	-	545,015.27	545,015.27
负债总计	-	-	-	821,084.66	821,084.66
利率敏感度缺口	3,606,386.85	-	620,000.00	549,786,066.88	554,012,453.73

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022年12月31日）	上年度末（2021年12月31日）
	1.市场利率平行上升25个基点	0.00	-8,846.89
2.市场利率平行下降25个基点	0.00	8,998.05	

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

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市交易的股票，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。

本基金采用完全复制法，跟踪 MSCI 中国 A 股国际通指数，以完全按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合为原则，通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金投资组合中，投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

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	426,003,343.88	99.56	549,764,990.46	99.23
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	426,003,343.88	99.56	549,764,990.46	99.23

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

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022 年 12 月 31 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
	1.组合自身基准上升 5%	21,339,765.92	27,667,684.44
	2.组合自身基准下降 5%	-21,339,765.92	-27,667,684.44

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	425,045,137.79	548,017,043.21
第二层次	501,156.60	625,504.49
第三层次	457,049.49	1,742,442.76
合计	426,003,343.88	550,384,990.46

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

单位:人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票	
期初余额	-	1,742,442.76	1,742,442.76
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	964,621.36	964,621.36
转出第三层次	-	1,952,021.36	1,952,021.36
当期利得或损失总额	-	-297,993.27	-297,993.27
其中:计入损益的利得或损失	-	-297,993.27	-297,993.27

计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	457,049.49	457,049.49
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-17,712.11	-17,712.11
项目	上年度可比同期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	561,068.94	561,068.94
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	1,181,373.82	1,181,373.82
其中：计入损益的利得或损失	-	1,181,373.82	1,181,373.82
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,742,442.76	1,742,442.76
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	1,181,373.82	1,181,373.82

于本年度末，本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。于本年度，本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资。

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

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

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	457,049.49	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.2127~1.65	负相关

项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平	与公允价值

				均值	之间的关系
限售股票	1,742,442.76	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.3138~2.7417	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本年度末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(上年度末：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

于本年度，本基金申购基金份额的对价总额为 224,416,559.31 元(上年度：572,154,337.13 元)，其中包括以股票支付的申购款 133,952,216.90 元和以现金支付的申购款 90,464,342.41 元(上年度：其中包括以股票支付的申购款 309,078,104.30 元和以现金支付的申购款 263,076,232.83 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(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	426,003,343.88	99.37
	其中：股票	426,003,343.88	99.37
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	2,160,730.72	0.50
8	其他资产	550,106.31	0.13
9	合计	428,714,180.91	100.00

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而下表中的合计项中不含可退替代款估值增值。

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	5,270,237.90	1.23
B	采矿业	16,896,852.18	3.95
C	制造业	248,045,847.29	57.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,539,106.24	3.16
E	建筑业	8,044,929.88	1.88
F	批发和零售业	4,096,124.54	0.96
G	交通运输、仓储和邮政业	12,892,158.98	3.01
H	住宿和餐饮业	916,840.00	0.21
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,691,795.32	3.43
J	金融业	76,715,770.08	17.93
K	房地产业	7,333,346.53	1.71
L	租赁和商务服务业	6,213,890.62	1.45
M	科学研究和技术服务业	4,320,959.92	1.01
N	水利、环境和公共设施管理业	794,459.00	0.19
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	3,693,300.11	0.86
R	文化、体育和娱乐业	1,364,091.00	0.32
S	综合	641,385.00	0.15
	合计	425,471,094.59	99.43

8.2.2 期末积极投资按行业分类境内股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	416,021.28	0.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	68,030.01	0.02

J	金融业	-	-
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	23,968.80	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	24,229.20	0.01
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	532,249.29	0.12

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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 报告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	14,242	24,595,934.00	5.75
2	300750	宁德时代	27,746	10,915,831.32	2.55
3	600036	招商银行	234,043	8,720,442.18	2.04
4	000858	五粮液	44,044	7,958,310.36	1.86
5	601318	中国平安	122,908	5,776,676.00	1.35
6	600900	长江电力	257,954	5,417,034.00	1.27
7	002594	比亚迪	20,600	5,293,582.00	1.24
8	601888	中国中免	22,194	4,794,569.82	1.12
9	300760	迈瑞医疗	13,800	4,360,386.00	1.02
10	601166	兴业银行	235,700	4,145,963.00	0.97
11	600809	山西汾酒	13,844	3,945,401.56	0.92
12	000568	泸州老窖	16,700	3,745,476.00	0.88
13	601012	隆基绿能	86,073	3,637,444.98	0.85
14	603288	海天味业	43,826	3,488,549.60	0.82
15	600309	万华化学	35,580	3,296,487.00	0.77
16	002352	顺丰控股	55,600	3,211,456.00	0.75
17	601398	工商银行	713,600	3,097,024.00	0.72
18	002714	牧原股份	60,414	2,945,182.50	0.69

19	300059	东方财富	149,922	2,908,486.80	0.68
20	000001	平安银行	220,200	2,897,832.00	0.68
21	601288	农业银行	965,800	2,810,478.00	0.66
22	600276	恒瑞医药	72,433	2,790,843.49	0.65
23	600030	中信证券	138,895	2,765,399.45	0.65
24	002304	洋河股份	17,099	2,744,389.50	0.64
25	601668	中国建筑	475,760	2,583,376.80	0.60
26	002475	立讯精密	80,373	2,551,842.75	0.60
27	300015	爱尔眼科	79,621	2,473,824.47	0.58
28	002142	宁波银行	75,010	2,434,074.50	0.57
29	600000	浦发银行	332,978	2,424,079.84	0.57
30	603259	药明康德	29,101	2,357,181.00	0.55
31	601899	紫金矿业	233,700	2,337,000.00	0.55
32	600887	伊利股份	72,388	2,244,028.00	0.52
33	601328	交通银行	445,300	2,110,722.00	0.49
34	300124	汇川技术	29,900	2,078,050.00	0.49
35	601088	中国神华	74,878	2,068,130.36	0.48
36	600048	保利发展	135,800	2,054,654.00	0.48
37	601225	陕西煤业	109,930	2,042,499.40	0.48
38	300014	亿纬锂能	23,224	2,041,389.60	0.48
39	000002	万科 A	110,300	2,007,460.00	0.47
40	600436	片仔癀	6,919	1,995,854.74	0.47
41	600438	通威股份	51,000	1,967,580.00	0.46
42	601601	中国太保	77,658	1,904,174.16	0.45
43	300274	阳光电源	16,800	1,878,240.00	0.44
44	600406	国电南瑞	75,924	1,852,545.60	0.43
45	600905	三峡能源	324,000	1,830,600.00	0.43
46	600690	海尔智家	71,281	1,743,533.26	0.41
47	002459	晶澳科技	26,720	1,605,604.80	0.38
48	300122	智飞生物	18,100	1,589,723.00	0.37
49	600028	中国石化	361,314	1,575,329.04	0.37
50	600050	中国联通	351,300	1,573,824.00	0.37
51	688599	天合光能	24,627	1,570,217.52	0.37
52	600031	三一重工	96,063	1,517,795.40	0.35
53	601919	中远海控	144,560	1,487,522.40	0.35
54	300498	温氏股份	74,280	1,458,116.40	0.34
55	601818	光大银行	469,900	1,442,593.00	0.34
56	000725	京东方 A	425,500	1,438,190.00	0.34
57	600019	宝钢股份	252,419	1,411,022.21	0.33
58	601766	中国中车	276,000	1,410,360.00	0.33
59	002493	荣盛石化	114,404	1,407,169.20	0.33
60	000792	盐湖股份	61,600	1,397,704.00	0.33
61	601658	邮储银行	301,700	1,393,854.00	0.33

62	600016	民生银行	401,900	1,386,555.00	0.32
63	002129	TCL 中环	36,700	1,382,122.00	0.32
64	688111	金山办公	5,218	1,380,108.82	0.32
65	300896	爱美客	2,408	1,363,770.80	0.32
66	002371	北方华创	6,000	1,351,800.00	0.32
67	002812	恩捷股份	10,200	1,339,158.00	0.31
68	002466	天齐锂业	16,800	1,327,032.00	0.31
69	601390	中国中铁	232,000	1,289,920.00	0.30
70	601985	中国核电	213,800	1,282,800.00	0.30
71	600893	航发动力	30,226	1,277,955.28	0.30
72	002049	紫光国微	9,680	1,276,017.60	0.30
73	600104	上汽集团	88,212	1,271,134.92	0.30
74	002460	赣锋锂业	18,260	1,269,252.60	0.30
75	601988	中国银行	397,700	1,256,732.00	0.29
76	000596	古井贡酒	4,700	1,254,430.00	0.29
77	600585	海螺水泥	45,400	1,243,052.00	0.29
78	600919	江苏银行	167,824	1,223,436.96	0.29
79	601009	南京银行	116,900	1,218,098.00	0.28
80	601857	中国石油	244,942	1,217,361.74	0.28
81	601669	中国电建	171,800	1,216,344.00	0.28
82	601628	中国人寿	31,500	1,169,280.00	0.27
83	000063	中兴通讯	45,200	1,168,872.00	0.27
84	601066	中信建投	49,100	1,166,125.00	0.27
85	002311	海大集团	18,800	1,160,524.00	0.27
86	000625	长安汽车	94,273	1,160,500.63	0.27
87	601211	国泰君安	84,769	1,152,010.71	0.27
88	601006	大秦铁路	169,300	1,130,924.00	0.26
89	600150	中国船舶	50,700	1,129,596.00	0.26
90	600999	招商证券	83,641	1,112,425.30	0.26
91	000538	云南白药	20,320	1,104,595.20	0.26
92	001979	招商蛇口	87,132	1,100,477.16	0.26
93	002027	分众传媒	163,760	1,093,916.80	0.26
94	601688	华泰证券	83,028	1,057,776.72	0.25
95	000776	广发证券	67,141	1,040,014.09	0.24
96	000651	格力电器	32,100	1,037,472.00	0.24
97	603501	韦尔股份	13,438	1,035,935.42	0.24
98	601169	北京银行	239,860	1,033,796.60	0.24
99	600346	恒力石化	66,465	1,032,201.45	0.24
100	601138	工业富联	111,800	1,026,324.00	0.24
101	600111	北方稀土	40,850	1,023,292.50	0.24
102	000895	双汇发展	39,310	1,019,308.30	0.24
103	000166	申万宏源	255,782	1,018,012.36	0.24
104	603799	华友钴业	18,064	1,004,900.32	0.23

105	603806	福斯特	15,076	1,001,649.44	0.23
106	600010	宝钢股份	517,300	993,216.00	0.23
107	600029	南方航空	127,500	969,000.00	0.23
108	600188	兖矿能源	28,700	963,746.00	0.23
109	002709	天赐材料	21,900	960,534.00	0.22
110	600837	海通证券	110,300	958,507.00	0.22
111	601229	上海银行	161,112	952,171.92	0.22
112	600588	用友网络	38,976	942,049.92	0.22
113	300316	晶盛机电	14,800	940,688.00	0.22
114	601100	恒立液压	14,832	936,640.80	0.22
115	000963	华东医药	19,860	929,448.00	0.22
116	603993	洛阳钼业	200,300	911,365.00	0.21
117	600926	杭州银行	67,320	880,545.60	0.21
118	603392	万泰生物	6,940	879,298.00	0.21
119	600570	恒生电子	21,602	874,016.92	0.20
120	600600	青岛啤酒	8,110	871,825.00	0.20
121	600795	国电电力	202,400	864,248.00	0.20
122	600089	特变电工	42,800	859,424.00	0.20
123	002230	科大讯飞	26,050	855,221.50	0.20
124	600196	复星医药	24,100	849,284.00	0.20
125	601868	中国能建	367,600	841,804.00	0.20
126	002180	纳思达	16,200	840,618.00	0.20
127	600989	宝丰能源	68,900	831,623.00	0.19
128	603659	璞泰来	16,020	831,277.80	0.19
129	601633	长城汽车	28,000	829,360.00	0.19
130	600009	上海机场	14,100	813,711.00	0.19
131	688008	澜起科技	12,968	811,796.80	0.19
132	601111	中国国航	75,800	803,480.00	0.19
133	600011	华能国际	105,200	800,572.00	0.19
134	600426	华鲁恒升	24,140	800,241.00	0.19
135	600660	福耀玻璃	22,800	799,596.00	0.19
136	300751	迈为股份	1,940	798,969.60	0.19
137	000338	潍柴动力	77,500	788,950.00	0.18
138	600547	山东黄金	40,852	782,724.32	0.18
139	603986	兆易创新	7,588	777,542.36	0.18
140	600233	圆通速递	38,500	773,465.00	0.18
141	300759	康龙化成	11,300	768,400.00	0.18
142	000661	长春高新	4,600	765,670.00	0.18
143	600015	华夏银行	145,852	756,971.88	0.18
144	300763	锦浪科技	4,200	756,210.00	0.18
145	605117	德业股份	2,280	755,136.00	0.18
146	600958	东方证券	84,252	753,212.88	0.18
147	600845	宝信软件	16,688	747,622.40	0.17

148	600745	闻泰科技	14,100	741,378.00	0.17
149	688036	传音控股	9,224	733,492.48	0.17
150	601689	拓普集团	12,500	732,250.00	0.17
151	300142	沃森生物	18,174	730,413.06	0.17
152	603369	今世缘	14,300	727,870.00	0.17
153	300999	金龙鱼	16,702	727,539.12	0.17
154	000100	TCL 科技	193,700	720,564.00	0.17
155	600115	中国东航	129,500	716,135.00	0.17
156	601336	新华保险	23,729	713,768.32	0.17
157	600132	重庆啤酒	5,502	700,844.76	0.16
158	300782	卓胜微	6,104	697,687.20	0.16
159	603833	欧派家居	5,740	697,582.20	0.16
160	300661	圣邦股份	4,025	694,715.00	0.16
161	600085	同仁堂	15,300	683,604.00	0.16
162	688012	中微公司	6,945	680,679.45	0.16
163	000425	徐工机械	134,000	679,380.00	0.16
164	601877	正泰电器	24,448	677,209.60	0.16
165	002920	德赛西威	6,400	674,176.00	0.16
166	601600	中国铝业	150,500	672,735.00	0.16
167	600256	广汇能源	74,400	671,088.00	0.16
168	601788	光大证券	45,053	669,938.11	0.16
169	300408	三环集团	21,800	669,478.00	0.16
170	688396	华润微	12,597	663,232.05	0.15
171	000733	振华科技	5,800	662,534.00	0.15
172	600875	东方电气	31,500	662,130.00	0.15
173	603290	斯达半导	2,000	658,600.00	0.15
174	000876	新希望	51,000	658,410.00	0.15
175	002001	新和成	35,024	656,700.00	0.15
176	600039	四川路桥	58,900	654,968.00	0.15
177	002241	歌尔股份	38,808	653,138.64	0.15
178	601865	福莱特	19,600	652,876.00	0.15
179	002736	国信证券	73,500	652,680.00	0.15
180	601618	中国中冶	204,400	649,992.00	0.15
181	000938	紫光股份	33,302	649,722.02	0.15
182	300413	芒果超媒	21,150	634,923.00	0.15
183	600176	中国巨石	46,151	632,730.21	0.15
184	601825	沪农商行	107,600	632,688.00	0.15
185	600741	华域汽车	36,333	629,650.89	0.15
186	601838	成都银行	40,900	625,770.00	0.15
187	601939	建设银行	111,100	625,493.00	0.15
188	300628	亿联网络	10,300	624,077.00	0.15
189	600522	中天科技	38,400	620,160.00	0.14
190	000301	东方盛虹	47,000	612,880.00	0.14

191	601238	广汽集团	55,500	612,165.00	0.14
192	300033	同花顺	6,200	611,382.00	0.14
193	600754	锦江酒店	10,400	606,840.00	0.14
194	601615	明阳智能	23,900	603,714.00	0.14
195	002938	鹏鼎控股	22,000	603,680.00	0.14
196	300433	蓝思科技	56,972	599,915.16	0.14
197	002648	卫星化学	38,294	593,557.00	0.14
198	603899	晨光股份	10,500	577,290.00	0.13
199	601727	上海电气	146,518	577,280.92	0.13
200	601699	潞安环能	34,178	575,899.30	0.13
201	601607	上海医药	32,226	574,589.58	0.13
202	600018	上港集团	107,392	573,473.28	0.13
203	002603	以岭药业	18,920	566,843.20	0.13
204	002821	凯莱英	3,820	565,360.00	0.13
205	601377	兴业证券	98,363	564,603.62	0.13
206	601916	浙商银行	191,700	563,598.00	0.13
207	000983	山西焦煤	47,540	553,841.00	0.13
208	002074	国轩高科	19,200	553,536.00	0.13
209	601319	中国人保	105,600	551,232.00	0.13
210	600763	通策医疗	3,600	550,764.00	0.13
211	601117	中国化学	69,182	549,305.08	0.13
212	688063	派能科技	1,721	543,233.65	0.13
213	600027	华电国际	92,218	542,241.84	0.13
214	688180	君实生物	8,602	538,485.20	0.13
215	603606	东方电缆	7,900	535,857.00	0.13
216	600460	士兰微	16,300	534,477.00	0.12
217	601360	三六零	81,700	534,318.00	0.12
218	603345	安井食品	3,300	534,204.00	0.12
219	600383	金地集团	52,059	532,563.57	0.12
220	300454	深信服	4,700	528,985.00	0.12
221	603939	益丰药房	8,244	526,296.96	0.12
222	000999	华润三九	11,210	524,740.10	0.12
223	601155	新城控股	25,300	518,650.00	0.12
224	600674	川投能源	41,900	512,437.00	0.12
225	300496	中科创达	5,100	511,530.00	0.12
226	000799	酒鬼酒	3,700	510,378.00	0.12
227	002601	龙佰集团	26,915	509,231.80	0.12
228	688777	中控技术	5,600	508,648.00	0.12
229	688122	西部超导	5,356	507,159.64	0.12
230	601872	招商轮船	90,400	505,336.00	0.12
231	601995	中金公司	13,200	503,316.00	0.12
232	603613	国联股份	5,635	498,359.40	0.12
233	000786	北新建材	19,138	495,291.44	0.12

234	000069	华侨城 A	92,700	494,091.00	0.12
235	002007	华兰生物	21,600	488,808.00	0.11
236	002120	韵达股份	33,885	487,266.30	0.11
237	603737	三棵树	4,256	484,460.48	0.11
238	688363	华熙生物	3,578	484,031.84	0.11
239	002252	上海莱士	76,100	482,474.00	0.11
240	603486	科沃斯	6,600	481,404.00	0.11
241	300957	贝泰妮	3,200	477,568.00	0.11
242	600584	长电科技	20,700	477,135.00	0.11
243	603198	迎驾贡酒	7,600	477,128.00	0.11
244	600332	白云山	15,968	475,686.72	0.11
245	600026	中远海能	39,400	474,770.00	0.11
246	600160	巨化股份	30,500	473,055.00	0.11
247	603260	合盛硅业	5,700	472,758.00	0.11
248	600803	新奥股份	29,300	471,730.00	0.11
249	002384	东山精密	19,000	469,870.00	0.11
250	002841	视源股份	7,939	468,718.56	0.11
251	603185	上机数控	4,400	465,740.00	0.11
252	000408	藏格矿业	17,900	464,863.00	0.11
253	600153	建发股份	34,048	464,755.20	0.11
254	600779	水井坊	5,493	463,719.06	0.11
255	000629	钒钛股份	97,800	462,594.00	0.11
256	600079	人福医药	19,300	461,077.00	0.11
257	300003	乐普医疗	20,000	459,400.00	0.11
258	300769	德方纳米	2,000	459,180.00	0.11
259	300146	汤臣倍健	20,100	458,682.00	0.11
260	601881	中国银河	48,900	454,281.00	0.11
261	300832	新产业	9,000	451,260.00	0.11
262	002555	三七互娱	24,900	450,690.00	0.11
263	600298	安琪酵母	9,936	449,305.92	0.11
264	002013	中航机电	44,700	449,235.00	0.10
265	000723	美锦能源	49,800	449,196.00	0.10
266	000157	中联重科	82,300	447,712.00	0.10
267	002568	百润股份	11,940	446,078.40	0.10
268	600884	杉杉股份	24,500	445,900.00	0.10
269	300347	泰格医药	4,250	445,400.00	0.10
270	300724	捷佳伟创	3,900	444,678.00	0.10
271	600096	云天化	21,100	443,944.00	0.10
272	688187	时代电气	8,128	443,544.96	0.10
273	002430	杭氧股份	11,200	440,832.00	0.10
274	600219	南山铝业	134,600	440,142.00	0.10
275	000807	云铝股份	39,400	438,128.00	0.10
276	600536	中国软件	7,500	437,475.00	0.10

277	002756	永兴材料	4,700	433,199.00	0.10
278	600918	中泰证券	67,400	432,034.00	0.10
279	601878	浙商证券	43,500	431,955.00	0.10
280	002422	科伦药业	16,200	431,082.00	0.10
281	300144	宋城演艺	29,420	429,532.00	0.10
282	002202	金风科技	38,886	427,746.00	0.10
283	603233	大参林	10,748	425,620.80	0.10
284	603517	绝味食品	6,948	424,453.32	0.10
285	002916	深南电路	5,840	421,356.00	0.10
286	688390	固德威	1,300	420,017.00	0.10
287	300919	中伟股份	6,400	419,904.00	0.10
288	002385	大北农	46,900	417,410.00	0.10
289	002294	信立泰	12,700	417,195.00	0.10
290	688385	复旦微电	5,975	417,114.75	0.10
291	600563	法拉电子	2,600	415,688.00	0.10
292	600362	江西铜业	23,700	413,091.00	0.10
293	688301	奕瑞科技	900	412,092.00	0.10
294	002625	光启技术	24,200	411,884.00	0.10
295	300699	光威复材	5,700	411,825.00	0.10
296	002414	高德红外	37,300	410,300.00	0.10
297	601799	星宇股份	3,200	407,584.00	0.10
298	300438	鹏辉能源	5,200	405,548.00	0.09
299	600487	亨通光电	26,900	405,114.00	0.09
300	300207	欣旺达	19,100	403,965.00	0.09
301	002372	伟星新材	18,800	401,192.00	0.09
302	603816	顾家家居	9,390	401,046.90	0.09
303	002080	中材科技	18,700	400,741.00	0.09
304	300601	康泰生物	12,700	400,431.00	0.09
305	603882	金域医学	5,100	398,820.00	0.09
306	603589	口子窖	6,900	397,923.00	0.09
307	603456	九洲药业	9,300	394,599.00	0.09
308	002340	格林美	53,100	394,533.00	0.09
309	601233	桐昆股份	26,800	387,260.00	0.09
310	002236	大华股份	34,200	386,802.00	0.09
311	600348	华阳股份	27,100	386,175.00	0.09
312	002240	盛新锂能	10,300	386,147.00	0.09
313	002518	科士达	6,700	385,920.00	0.09
314	601216	君正集团	96,000	383,040.00	0.09
315	688009	中国通号	79,924	382,835.96	0.09
316	600183	生益科技	26,400	380,424.00	0.09
317	000738	航发控制	14,800	379,472.00	0.09
318	688188	柏楚电子	1,744	378,587.52	0.09
319	000933	神火股份	25,200	376,992.00	0.09

320	002064	华峰化学	55,400	376,720.00	0.09
321	603596	伯特利	4,700	375,060.00	0.09
322	300390	天华超净	6,700	374,396.00	0.09
323	002791	坚朗五金	3,600	374,220.00	0.09
324	300223	北京君正	5,300	373,332.00	0.09
325	600521	华海药业	17,010	371,838.60	0.09
326	002600	领益智造	81,500	370,010.00	0.09
327	000066	中国长城	36,273	369,984.60	0.09
328	000630	铜陵有色	118,400	369,408.00	0.09
329	300037	新宙邦	8,460	367,756.20	0.09
330	601108	财通证券	51,630	367,605.60	0.09
331	000932	华菱钢铁	78,200	367,540.00	0.09
332	603568	伟明环保	19,800	366,894.00	0.09
333	601555	东吴证券	56,020	365,810.60	0.09
334	002223	鱼跃医疗	11,400	363,204.00	0.08
335	300595	欧普康视	10,170	363,069.00	0.08
336	600141	兴发集团	12,500	362,500.00	0.08
337	688516	奥特维	1,800	361,800.00	0.08
338	601058	赛轮轮胎	35,900	359,718.00	0.08
339	600985	淮北矿业	28,100	359,680.00	0.08
340	000831	中国稀土	10,900	358,392.00	0.08
341	688536	思瑞浦	1,300	358,033.00	0.08
342	000977	浪潮信息	16,560	356,371.20	0.08
343	600486	扬农化工	3,400	353,260.00	0.08
344	601077	渝农商行	99,000	349,470.00	0.08
345	000009	中国宝安	28,900	349,401.00	0.08
346	002078	太阳纸业	30,300	349,056.00	0.08
347	002176	江特电机	20,000	349,000.00	0.08
348	000975	银泰黄金	31,480	347,539.20	0.08
349	002831	裕同科技	10,500	347,235.00	0.08
350	601880	辽港股份	214,200	347,004.00	0.08
351	601966	玲珑轮胎	16,911	346,337.28	0.08
352	603707	健友股份	19,149	345,447.96	0.08
353	601636	旗滨集团	30,300	345,117.00	0.08
354	688005	容百科技	4,996	343,475.00	0.08
355	000027	深圳能源	53,540	340,514.40	0.08
356	002056	横店东磁	18,100	339,194.00	0.08
357	002299	圣农发展	14,300	338,767.00	0.08
358	002738	中矿资源	5,040	335,966.40	0.08
359	002532	天山铝业	43,300	334,276.00	0.08
360	000783	长江证券	62,600	333,658.00	0.08
361	000729	燕京啤酒	31,400	333,468.00	0.08
362	601696	中银证券	31,500	332,955.00	0.08

363	600655	豫园股份	43,700	332,557.00	0.08
364	002028	思源电气	8,700	332,514.00	0.08
365	603885	吉祥航空	20,500	331,690.00	0.08
366	688099	晶晨股份	4,700	331,397.00	0.08
367	600872	中炬高新	8,983	331,203.21	0.08
368	000591	太阳能	45,100	330,583.00	0.08
369	605358	立昂微	7,700	328,020.00	0.08
370	600705	中航产融	99,900	327,672.00	0.08
371	600415	小商品城	62,100	325,404.00	0.08
372	002531	天顺风能	21,500	325,295.00	0.08
373	600177	雅戈尔	51,120	323,589.60	0.08
374	300073	当升科技	5,700	321,480.00	0.08
375	000683	远兴能源	40,900	320,656.00	0.07
376	600848	上海临港	26,840	319,932.80	0.07
377	002966	苏州银行	41,000	318,980.00	0.07
378	002353	杰瑞股份	11,400	318,174.00	0.07
379	002602	世纪华通	83,240	317,144.40	0.07
380	002939	长城证券	38,200	316,296.00	0.07
381	600549	厦门钨业	16,100	314,755.00	0.07
382	000728	国元证券	49,710	314,664.30	0.07
383	600021	上海电力	31,400	314,314.00	0.07
384	300357	我武生物	5,700	314,070.00	0.07
385	300395	菲利华	5,700	313,500.00	0.07
386	300568	星源材质	14,683	312,160.58	0.07
387	600038	中直股份	6,700	310,947.00	0.07
388	000519	中兵红箭	15,800	310,312.00	0.07
389	600258	首旅酒店	12,500	310,000.00	0.07
390	002850	科达利	2,600	308,906.00	0.07
391	002673	西部证券	50,516	307,642.44	0.07
392	300604	长川科技	6,900	307,602.00	0.07
393	603712	七一二	8,800	307,296.00	0.07
394	601577	长沙银行	45,400	306,904.00	0.07
395	002032	苏泊尔	6,200	306,652.00	0.07
396	600583	海油工程	50,547	306,314.82	0.07
397	002244	滨江集团	34,600	305,518.00	0.07
398	600499	科达制造	21,500	305,515.00	0.07
399	000423	东阿阿胶	7,500	305,250.00	0.07
400	300373	扬杰科技	5,800	305,080.00	0.07
401	002185	华天科技	36,600	303,414.00	0.07
402	601456	国联证券	26,900	302,625.00	0.07
403	002153	石基信息	20,116	301,538.84	0.07
404	603077	和邦生物	98,800	300,352.00	0.07
405	002508	老板电器	10,800	299,808.00	0.07

406	000155	川能动力	16,800	299,712.00	0.07
407	300251	光线传媒	34,600	299,636.00	0.07
408	603127	昭衍新药	5,092	297,423.72	0.07
409	002497	雅化集团	12,700	295,275.00	0.07
410	600056	中国医药	17,100	294,633.00	0.07
411	002405	四维图新	26,600	293,132.00	0.07
412	002268	电科网安	9,600	293,088.00	0.07
413	600673	东阳光	33,600	291,984.00	0.07
414	000987	越秀资本	48,726	291,868.74	0.07
415	600392	盛和资源	20,800	291,200.00	0.07
416	600598	北大荒	21,100	290,336.00	0.07
417	002407	多氟多	8,700	289,884.00	0.07
418	000703	恒逸石化	40,880	287,386.40	0.07
419	000825	太钢不锈	66,300	286,416.00	0.07
420	300529	健帆生物	9,200	284,924.00	0.07
421	002192	融捷股份	2,900	283,910.00	0.07
422	002156	通富微电	17,200	283,456.00	0.07
423	601198	东兴证券	36,600	282,552.00	0.07
424	000739	普洛药业	13,100	282,174.00	0.07
425	000800	一汽解放	36,400	281,372.00	0.07
426	601666	平煤股份	26,000	281,060.00	0.07
427	600704	物产中大	58,400	280,904.00	0.07
428	600369	西南证券	74,900	280,875.00	0.07
429	000960	锡业股份	19,800	279,180.00	0.07
430	301035	润丰股份	3,200	278,720.00	0.07
431	000893	亚钾国际	10,200	277,236.00	0.06
432	002152	广电运通	27,700	275,338.00	0.06
433	601016	节能风电	72,200	275,082.00	0.06
434	600566	济川药业	10,100	274,922.00	0.06
435	601168	西部矿业	26,900	274,380.00	0.06
436	002624	完美世界	21,450	272,844.00	0.06
437	002409	雅克科技	5,400	271,998.00	0.06
438	603605	珀莱雅	1,620	271,317.60	0.06
439	000709	河钢股份	119,600	270,296.00	0.06
440	002044	美年健康	44,028	269,891.64	0.06
441	002797	第一创业	47,700	268,551.00	0.06
442	000830	鲁西化工	21,600	267,624.00	0.06
443	600998	九州通	20,500	267,320.00	0.06
444	603338	浙江鼎力	5,580	267,003.00	0.06
445	601866	中远海发	110,300	266,926.00	0.06
446	603858	步长制药	12,640	265,566.40	0.06
447	002487	大金重工	6,400	264,768.00	0.06
448	603267	鸿远电子	2,600	263,016.00	0.06

449	600516	方大炭素	42,587	260,632.44	0.06
450	600170	上海建工	99,700	259,220.00	0.06
451	002128	电投能源	21,000	259,140.00	0.06
452	300363	博腾股份	6,300	257,355.00	0.06
453	601991	大唐发电	92,200	257,238.00	0.06
454	002463	沪电股份	21,570	256,683.00	0.06
455	600688	上海石化	81,947	254,855.17	0.06
456	000937	冀中能源	39,800	253,128.00	0.06
457	002507	涪陵榨菜	9,800	252,546.00	0.06
458	300034	钢研高纳	5,500	252,120.00	0.06
459	603444	吉比特	800	250,272.00	0.06
460	000401	冀东水泥	30,300	249,369.00	0.06
461	002030	达安基因	15,928	247,839.68	0.06
462	300308	中际旭创	9,120	246,513.60	0.06
463	300676	华大基因	4,700	242,943.00	0.06
464	002138	顺络电子	9,200	240,856.00	0.06
465	603866	桃李面包	15,608	240,363.20	0.06
466	601992	金隅集团	94,400	239,776.00	0.06
467	300776	帝尔激光	1,900	239,400.00	0.06
468	000998	隆平高科	14,800	237,836.00	0.06
469	000050	深天马 A	27,400	237,284.00	0.06
470	002266	浙富控股	60,600	236,946.00	0.06
471	603218	日月股份	11,600	235,480.00	0.06
472	600380	健康元	20,800	234,832.00	0.05
473	002408	齐翔腾达	33,100	233,024.00	0.05
474	000513	丽珠集团	7,100	230,608.00	0.05
475	002541	鸿路钢构	7,870	230,512.30	0.05
476	600338	西藏珠峰	10,000	229,200.00	0.05
477	600801	华新水泥	15,400	228,228.00	0.05
478	300558	贝达药业	4,600	226,642.00	0.05
479	600699	均胜电子	16,100	226,205.00	0.05
480	002926	华西证券	29,500	222,135.00	0.05
481	688006	杭可科技	5,000	218,850.00	0.05
482	002326	永太科技	10,000	218,300.00	0.05
483	600711	盛屯矿业	36,900	217,341.00	0.05
484	002092	中泰化学	28,900	215,594.00	0.05
485	002145	中核钛白	34,915	215,076.40	0.05
486	000750	国海证券	64,180	213,719.40	0.05
487	002500	山西证券	39,920	211,576.00	0.05
488	688202	美迪西	980	209,612.20	0.05
489	002465	海格通信	25,500	207,060.00	0.05
490	688002	睿创微纳	5,533	205,772.27	0.05
491	600295	鄂尔多斯	13,200	200,508.00	0.05

492	002065	东华软件	35,400	200,364.00	0.05
493	300726	宏达电子	4,500	198,630.00	0.05
494	600885	宏发股份	5,863	195,882.83	0.05
495	300070	碧水源	40,300	190,619.00	0.04
496	002506	协鑫集成	65,400	190,314.00	0.04
497	300850	新强联	3,570	190,209.60	0.04
498	000988	华工科技	11,200	183,792.00	0.04
499	002456	欧菲光	35,700	168,147.00	0.04
500	002557	洽洽食品	3,100	155,000.00	0.04

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

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	688147	微导纳米	6,293	150,465.63	0.04
2	001301	尚太科技	1,164	68,722.56	0.02
3	301095	广立微	439	37,969.11	0.01
4	301327	华宝新能	182	32,208.54	0.01
5	301267	华夏眼科	366	24,229.20	0.01
6	301195	北路智控	330	24,103.20	0.01
7	301367	怡和嘉业	131	23,027.18	0.01
8	301356	天振股份	374	16,205.42	0.00
9	301165	锐捷网络	504	15,931.44	0.00
10	301391	卡莱特	183	14,817.51	0.00
11	301377	鼎泰高科	770	13,575.10	0.00
12	301297	富乐德	1,015	13,184.85	0.00
13	301280	珠城科技	279	12,499.20	0.00
14	301366	一博科技	268	12,084.12	0.00
15	301283	聚胶股份	235	12,081.35	0.00
16	301277	新天地	439	11,317.42	0.00
17	301306	西测测试	255	10,783.95	0.00
18	301318	维海德	206	8,598.44	0.00
19	688298	东方生物	84	6,477.24	0.00
20	301388	欣灵电气	292	6,307.20	0.00
21	301319	唯特偶	115	6,126.05	0.00
22	301270	汉仪股份	210	5,957.70	0.00
23	301309	万得凯	228	5,576.88	0.00

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	8,613,090.70	1.55
2	000858	五粮液	4,372,620.00	0.79
3	002594	比亚迪	2,858,793.00	0.52
4	600905	三峡能源	2,666,495.00	0.48
5	300760	迈瑞医疗	2,554,905.00	0.46
6	688599	天合光能	2,234,382.61	0.40
7	002466	天齐锂业	2,219,538.00	0.40
8	000792	盐湖股份	2,032,308.00	0.37
9	300059	东方财富	1,955,452.00	0.35
10	002812	恩捷股份	1,918,805.00	0.35
11	000568	泸州老窖	1,814,365.00	0.33
12	000651	格力电器	1,797,623.00	0.32
13	002714	牧原股份	1,769,441.00	0.32
14	002049	紫光国微	1,754,832.00	0.32
15	000001	平安银行	1,716,961.00	0.31
16	002352	顺丰控股	1,711,906.00	0.31
17	300014	亿纬锂能	1,662,042.00	0.30
18	002475	立讯精密	1,553,530.80	0.28
19	600519	贵州茅台	1,462,259.00	0.26
20	002142	宁波银行	1,378,722.38	0.25

注：买入包括二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，买入金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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	8,691,291.00	1.57
2	000858	五粮液	4,675,958.00	0.84
3	002594	比亚迪	3,367,253.00	0.61
4	300760	迈瑞医疗	2,837,176.00	0.51
5	600519	贵州茅台	2,323,173.00	0.42
6	601816	京沪高铁	2,307,260.00	0.42
7	002812	恩捷股份	2,048,456.27	0.37
8	000568	泸州老窖	1,989,108.00	0.36
9	002714	牧原股份	1,976,678.00	0.36
10	002049	紫光国微	1,921,669.00	0.35
11	002352	顺丰控股	1,854,931.00	0.33
12	300059	东方财富	1,835,567.00	0.33
13	000001	平安银行	1,826,265.00	0.33

14	300014	亿纬锂能	1,656,346.00	0.30
15	002475	立讯精密	1,652,110.00	0.30
16	002304	洋河股份	1,520,074.60	0.27
17	002142	宁波银行	1,469,234.00	0.27
18	300015	爱尔眼科	1,332,037.34	0.24
19	002371	北方华创	1,330,600.00	0.24
20	002129	TCL 中环	1,259,393.00	0.23

注：卖出包括二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，卖出金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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	177,721,728.26
卖出股票收入（成交）总额	170,182,077.29

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

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。

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。

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，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等，主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。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

无。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 声明本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。如是，还应对相关证券的投资决策程序做出说明

本基金投资的前十名证券的发行主体中，兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会、中国人民银行的处罚；招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会、中国人民银行的处罚；中国平安保险(集团)股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局的处罚。除上述证券的发行主体外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

对上述证券的投资决策程序的说明：本基金为指数型基金，因复制指数被动持有，上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

8.12.2 声明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。如是，还应对相关股票的投资决策程序做出说明

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

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（元）
1	存出保证金	337,659.35
2	应收清算款	212,446.96
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	550,106.31

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688147	微导纳米	150,465.63	0.04	新股锁定期
2	301095	广立微	37,969.11	0.01	新股锁定期
3	301327	华宝新能	32,208.54	0.01	新股锁定期
4	301267	华夏眼科	24,229.20	0.01	新股锁定期

§ 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		MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	
		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
3,401	89,320.13	88,403,072.00	29.10%	110,778,603.00	36.47%	104,596,100.00	34.43%

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	上海浦东发展银行股份有限公司-兴证全球积极配置三年封闭运作混合型基金中基金(FOF)	52,924,100.00	17.42%

2	华泰证券股份有限公司	11,860,689.00	3.90%
3	广发证券股份有限公司	5,181,600.00	1.71%
4	招商证券股份有限公司	4,868,489.00	1.60%
5	吴美兰	3,000,000.00	0.99%
6	中国民生银行股份有限公司-兴证全球优选平衡三个月持有期混合型基金中基金(FOF)	2,739,400.00	0.90%
7	中信证券股份有限公司	2,663,682.00	0.88%
8	安建军	2,594,600.00	0.85%
9	方正证券股份有限公司	2,267,901.00	0.75%
10	李耀荣	2,068,000.00	0.68%
11	中国银行股份有限公司—MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	104,596,100.00	34.43%

注：持有人名称与注册登记机构持有人名册保持一致。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本公司的所有从业人员(包含高级管理人员、基金投资和研究部门负责人和本基金基金经理)均未持有本基金份额。

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

本公司的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人和本基金基金经理均未持有本基金份额。

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的情况

基金经理姓名	产品类型	持有本人管理的基金份额总量的数量区间（万份）
罗文杰	公募基金	50~100
	私募资产管理计划	0
	合计	50~100

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2018年4月3日)基金份额总额	1,309,777,775.00
本报告期期初基金份额总额	317,777,775.00
本报告期基金总申购份额	146,000,000.00

减：报告期基金总赎回份额	160,000,000.00
本报告期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	303,777,775.00

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末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

2022 年 5 月 27 日，周易先生任南方基金管理股份有限公司董事长（法定代表人）。

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人主营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金的审计事务所无变化，目前普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）已为本基金提供审计服务 5 年，本报告期应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为人民币 50,000.00 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

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人
受到稽查或处罚等措施的时间	2022 年 1 月 29 日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证监会深圳监管局
受到的具体措施类型	责令改正行政监管措施
受到稽查或处罚等措施的原因	个别基金内部控制不完善
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意	基金管理人已及时按要求改正并报告

见)	
其他	/

11.6.2 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，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

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	
安信证券	1	188,105,209.26	56.07%	18,813.07	56.07%	-
中泰证券	2	137,304,322.49	40.93%	13,731.19	40.93%	-
华泰证券	2	10,059,096.18	3.00%	1,005.88	3.00%	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-

注：交易单元的选择标准和程序根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，我公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序：

A：选择标准

- 1、公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；
- 2、公司具有较强的研究能力，能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告；
- 3、公司内部管理规范，能满足基金操作的保密要求；
- 4、建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯服务。

B：选择流程 公司研究部门定期对券商服务质量从以下几方面进行量化评比，并根据评比的结果选择席位：

- 1、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座；
- 2、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实，投资建议是否准确；
- 3、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

C：报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

新增交易单元：

招商证券

申万宏源

退租交易单元：

申万宏源

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
安信证券	41,344.63	1.55%	-	-	-	-
中泰证券	1,707,436.40	63.99%	-	-	-	-
华泰证券	919,683.52	34.46%	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-

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	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-01-01
2	南方基金管理股份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准则的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-01-01
3	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金参与中信证券股份有限公司配股的关联交易公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-01-28
4	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-02-12
5	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销可转换公司债券的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-02-27
6	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销可转换公司债券的关联交易公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-03-05
7	南方基金关于 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金增加长城证券为申购赎回	证券时报、基金管理人网站、中国证监会	2022-03-18

	回代理券商的公告	基金电子披露网站	
8	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-03-26
9	南方基金关于旗下部分基金增加华安证券为申购赎回代理券商的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-03-30
10	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金参与财通证券股份有限公司配股的关联交易公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-04-14
11	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-04-16
12	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销可转换公司债券的关联交易公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-04-22
13	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-05-12
14	南方基金管理股份有限公司关于调整旗下基金大额申购等业务安排的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-05-27
15	南方基金管理股份有限公司关于董事长变更的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-05-28
16	南方基金管理股份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	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-06-18
17	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-07-16
18	关于注意防范冒用南方基金及子公司、南方基金投研人员名义从事诈骗活动的风险提示	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-07-20
19	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-07-27
20	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金参与兴业证券股份有限公司配股的关联交易公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-08-27
21	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-09-09
22	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资	证券时报、基金管理	2022-11-02

	关联方承销证券的关联交易公告	人网站、中国证监会 基金电子披露网站	
23	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资 关联方承销证券的关联交易公告	证券时报、基金管理 人网站、中国证监会 基金电子披露网站	2022-11-11
24	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资 关联方承销证券的关联交易公告	证券时报、基金管理 人网站、中国证监会 基金电子披露网站	2022-11-16
25	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资 关联方承销证券的关联交易公告	证券时报、基金管理 人网站、中国证监会 基金电子披露网站	2022-12-03
26	南方基金关于电子直销平台相关业务费率优惠 的公告	证券时报、基金管理 人网站、中国证监会 基金电子披露网站	2022-12-16
27	关于注意防范冒用南方基金及子公司、南方基 金投研人员名义从事诈骗活动的风险提示	证券时报、基金管理 人网站、中国证监会 基金电子披露网站	2022-12-16

§ 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
联接基 金	1	20220101- 20221231	112,723,100.00	20,684,700.00	28,811,700.00	104,596,100.00	34.43%

产品特有风险

本基金存在持有基金份额超过 20%的基金份额持有人，在特定赎回比例及市场条件下，若基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产，将会导致流动性风险和基金净值波动风险。

注：申购份额包含红利再投资和份额折算。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金的文件；
- 2、《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、《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》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告；
- 6、《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》原文。

13.2 存放地点

深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼。

13.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>