

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
2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 08 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	7
§ 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	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产（基金净值）变动表	14
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况	34
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	35
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	50
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	50
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	50
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	50
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50
7.12 投资组合报告附注	50
§ 8 基金份额持有人信息	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	51
8.2 期末上市基金前十名持有人	52
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	52
§ 9 开放式基金份额变动	52
§ 10 重大事件揭示	53
10.1 基金份额持有人大会决议	53
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	53
10.4 基金投资策略的改变	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	53
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	53
10.8 其他重大事件	57
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	59
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	59
§ 12 备查文件目录	60
12.1 备查文件目录	60
12.2 存放地点	60
12.3 查阅方式	60

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	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	42,005,740.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2018 年 5 月 25 日

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	景顺长城基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨皞阳
	联系电话	0755-82370388
		秦一楠
		010-66060069

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

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.igwfm.com
基金中期报告备置地点	基金管理人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-2,709,640.86
本期利润	156,325.88
加权平均基金份额本期利润	0.0032
本期加权平均净值利润率	0.22%
本期基金份额净值增长率	-1.71%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	17,685,693.14
期末可供分配基金份额利润	0.4210
期末基金资产净值	59,691,433.14
期末基金份额净值	1.4210
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	42.10%

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。

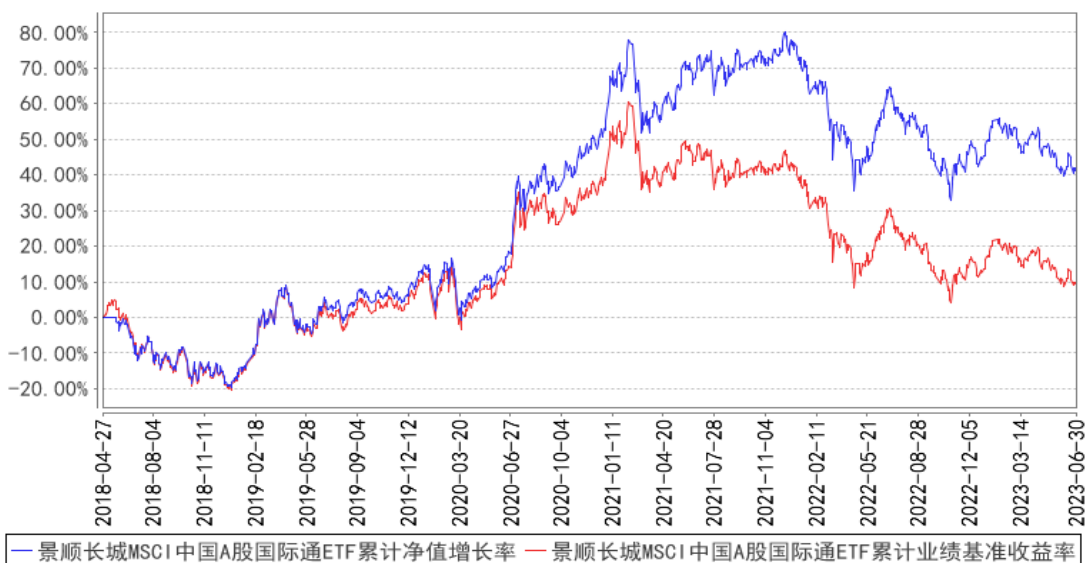
3.2 基金净值表现

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
过去一个月	1.23%	0.85%	0.44%	0.86%	0.79%	-0.01%
过去三个月	-5.34%	0.78%	-6.34%	0.79%	1.00%	-0.01%
过去六个月	-1.71%	0.78%	-2.71%	0.79%	1.00%	-0.01%
过去一年	-13.32%	0.93%	-15.40%	0.95%	2.08%	-0.02%
过去三年	18.75%	1.16%	-4.83%	1.19%	23.58%	-0.03%
自基金合同生效起至今	42.10%	1.23%	9.92%	1.26%	32.18%	-0.03%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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



注：基金的投资组合比例为：基金投资于标的指数成份股及备选成份股的资产不低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%。本基金的建仓期为自2018年4月27日基金合同生效日起6个月。建仓期结束时，本基金投资组合达到上述投资组合比例的要求。

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人景顺长城基金管理有限公司（以下简称“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2023年6月30日，本公司旗下共管理175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		
郑天行	本基金的基金经理	2023年6月20日	-	9年	理学硕士，CFA。曾任美国摩根斯坦利（纽约）对冲基金投资组合分析员，美国Aristeia基金（纽约）数据分析师，美国城堡基金（纽约）大数据研究员。2019年5月加入本公司，历任养老及资产配置部研究员、ETF投资部研究员、专户投资部投资经理，自2022年8月起担任ETF与创新投资部基金经理。具有9年证券、基金行业从业经验。
张晓南	本基金的基金经理	2020年7月3日	2023年6月19日	13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13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	-	7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 7 年证券、基金行业从业经验。
--	--	--	--	--	--

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 17 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

今年上半年，A 股权益市场整体表现较为平稳但结构上有所分化，主要宽基指数涨跌幅及排

序为：科创 50(4.71%)>上证指数(3.65%)>沪深 300(-0.75%)>中小 100(-1.84%)>创业板指(-5.61%)。市值维度，总体表现出小盘占优特征，规模指数涨跌幅及排序为：中证 1000(5.10%)>中证 500(2.29%)>沪深 300(-0.75%)。风格维度，中信风格指数涨跌幅及排序为：稳定(10.12%)>成长(7.80%)>周期(1.29%)>金融(-0.72%)>消费(-2.52%)。行业维度，涨跌幅排前五行业为：通信(50.66%)、传媒(42.75%)、计算机(27.57%)、机械设备(13.44%)、家用电器(13.29%)，排后五行业为：商贸零售(-23.44%)、房地产(-14.29%)、美容护理(-13.61%)、建筑材料(-10.52%)、综合(-9.62%)。

本基金采用复制标的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、标的指数成分调整情况定期或不定期调整投资组合，保持对标的指数的紧密跟踪。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2023 年上半年，本基金份额净值增长率为-1.71%，业绩比较基准收益率为-2.71%。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

宏观数据层面，主要经济活动指标：5 月工业增加值同比增长 3.5%，前值 5.6%，经季度调整后环比增长 0.63%；5 月 PMI48.8，6 月 PMI49；5 月社会消费品零售总额同比增长 12.7%，前值 18.40%。通胀指标：5 月 PPI 同比-4.6%，前值-3.6%；5 月 CPI 当月同比 0.2%，前值 0.1%。货币金融指标：5 月 M2 同比增长 11.6%，前值 12.4%；5 月社会融资规模同比增长 9.5%，前值 10.0%。总体来看，增长斜率有所放缓，但保持良好的复苏态势，同时通胀在高基数下保持稳步回落态势。

权益市场的长期趋势反映上市公司总体盈利能力的逐步提升，背后的驱动力是经济长期增长动能以及科技升级、产业升级带来的生产力提升。目前主要宽基指数估值水平处在历史低位，在经济复苏大背景下，权益市场配置价值凸显。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

基金日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行。基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以双方认可的方式报送给基金托管人，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、

程序进行复核，无误后返回给基金管理人，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—景顺长城基金管理有限公司 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

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

重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

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

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	1,345,533.82	1,277,361.62
结算备付金		16,154.35	32,984.14
存出保证金		4,123.99	4,515.71
交易性金融资产	6.4.7.2	58,593,623.75	82,807,524.68
其中：股票投资		58,593,623.75	82,807,524.68
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		59,959,435.91	84,122,386.15

负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		16.35	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		25,399.12	35,963.55
应付托管费		5,079.84	7,192.70
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	237,507.46	218,528.34
负债合计		268,002.77	261,684.59
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	42,005,740.00	58,005,740.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	17,685,693.14	25,854,961.56
净资产合计		59,691,433.14	83,860,701.56
负债和净资产总计		59,959,435.91	84,122,386.15

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.4210 元，基金份额总额 42,005,740.00 份。

6.2 利润表

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

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		529,959.34	-20,063,462.74
1. 利息收入		4,161.31	11,561.58
其中：存款利息收入	6.4.7.13	4,161.31	11,561.58
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-

2. 投资收益（损失以“-”填列）		-2,343,224.08	-10,128,610.03
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-3,066,248.72	-11,062,294.76
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	6,509.99	71,691.04
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	716,514.65	861,993.69
以摊余成本计量的			
金融资产终止确认产生的			
收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	2,865,966.74	-9,698,479.75
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	3,055.37	-247,934.54
减：二、营业总支出		373,633.46	549,556.34
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	180,503.40	330,029.19
2. 托管费	6.4.10.2.2	36,100.72	66,005.86
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产			
支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	0.02
8. 其他费用	6.4.7.23	157,029.34	153,521.27
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		156,325.88	-20,613,019.08
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		156,325.88	-20,613,019.08
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		156,325.88	-20,613,019.08

6.3 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	58,005,740.00	-	25,854,961.56	83,860,701.56
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)	58,005,740.00	-	25,854,961.56	83,860,701.56
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-16,000,000.00	-	-8,169,268.42	-24,169,268.42
(一)、综合收益总额	-	-	156,325.88	156,325.88
(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)	-16,000,000.00	-	-8,325,594.30	-24,325,594.30
其中：1. 基金申购款	-	-	-	-
2. 基金赎回款	-16,000,000.00	-	-8,325,594.30	-24,325,594.30
(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)	42,005,740.00	-	17,685,693.14	59,691,433.14
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(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)	-36,000,000.00	-	-36,006,519.38	-72,006,519.38
(一)、综合收益总额	-	-	-20,613,019.08	-20,613,019.08
(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)	-36,000,000.00	-	-15,393,500.30	-51,393,500.30
其中：1. 基金申购款	12,000,000.00	-	8,021,298.47	20,021,298.47
2. 基金赎回款	-48,000,000.00	-	-23,414,798.77	-71,414,798.77
(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)	62,005,740.00	-	39,645,782.87	101,651,522.87

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

康乐

吴建军

邵媛媛

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2018]548 号《关于准予景顺长城 MSCI

中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》核准，由景顺长城基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式指数基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,533,998,240.00 元(含募集股票市值)，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2018)第 0283 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2018 年 4 月 27 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,534,005,740.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 7,500.00 份基金份额。本基金的基金管理人为景顺长城基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数 MSCI 中国 A 股国际通指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股，投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票及存托凭证)、股指期货、债券资产(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、现金资产以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。本基金的业绩比较基准为 MSCI 中国 A 股国际通指数(MSCI China A Inclusion RMB Index (CNY))。

本基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司以本基金为目标 ETF，募集成立了景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 联接基金”)。景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 联接基金为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

本财务报表由本基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司于 2023 年 8 月 28 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业

会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2023 年半年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本基金本报告期所采用的会计政策和会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	1,345,533.82
等于：本金	1,345,306.86
加：应计利息	226.96
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	1,345,533.82

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	67,256,067.51	-	58,593,623.75	-8,662,443.76
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	67,256,067.51	-	58,593,623.75	-8,662,443.76

注：于 2023 年 6 月 30 日，股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值 0.00 元。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末的衍生金融资产/负债余额为零。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产**6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

本基金本报告期末的买入返售金融资产余额为零。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末买断式逆回购交易中取得的债券余额为零。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资**6.4.7.5.1 债权投资情况**

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资**6.4.7.6.1 其他债权投资情况**

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资**6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况**

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末的其他资产余额为零。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-

应付证券出借违约金	-
应付交易费用	11,416.16
其中：交易所市场	11,416.16
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	86,780.45
应付指数使用费	139,310.85
合计	237,507.46

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	58,005,740.00	58,005,740.00
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-16,000,000.00	-16,000,000.00
本期末	42,005,740.00	42,005,740.00

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	45,161,857.87	-19,306,896.31	25,854,961.56
本期利润	-2,709,640.86	2,865,966.74	156,325.88
本期基金份额交易产生的变动数	-12,091,471.51	3,765,877.21	-8,325,594.30
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-12,091,471.51	3,765,877.21	-8,325,594.30
本期已分配利润	-	-	-
本期末	30,360,745.50	-12,675,052.36	17,685,693.14

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	活期存款利息收入	3,962.58
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	163.16	
其他	35.57	
合计	4,161.31	

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-2,245,396.99
股票投资收益——赎回差价收入	-820,851.73
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-3,066,248.72

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	17,810,523.29
减：卖出股票成本总额	20,011,987.56
减：交易费用	43,932.72
买卖股票差价收入	-2,245,396.99

6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
赎回基金份额对价总额	24,325,594.30
减：现金支付赎回款总额	9,754,085.30
减：赎回股票成本总额	15,392,360.73
减：交易费用	-
赎回差价收入	-820,851.73

6.4.7.14.4 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	6.35
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	6,503.64
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	6,509.99

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	37,711.52
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	31,200.00
减：应计利息总额	6.36
减：交易费用	1.52
买卖债券差价收入	6,503.64

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	716,514.65
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	716,514.65

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	2,865,966.74
股票投资	2,865,966.74
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
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	2,865,966.74

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。

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	3,055.37
合计	3,055.37

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

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	27,273.08
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	887.01
指数使用费	69,001.88
其他	360.00
合计	157,029.34

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

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
景顺长城基金管理有限公司	基金管理人
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人
长城证券股份有限公司（“长城证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
长城证券	55,265.00	0.21	302,479.40	0.40

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)

长城证券	51.49	0.21	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
长城证券	281.67	0.40	281.67	0.95

注：1. 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。

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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	180,503.40	330,029.19
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：

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	36,100.72	66,005.86

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：

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

6.4.10.2.3 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。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

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

本基金于本报告期及上年度可比期间均未发生转融通证券出借业务交易。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金于本报告期及上年度可比期间均未发生转融通证券出借业务交易。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

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固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金的其他关联方于本报告期末及上年度末均未持有本基金份额。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2023年1月1日至2023年6月30日	2022年1月1日至2022年6月30日	2022年1月1日至2022年6月30日	2022年1月1日至2022年6月30日
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行-活期	1,345,533.82	3,962.58	1,796,022.05	10,634.27

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

于本报告期末，本基金持有 6,000 股长城证券的 A 股普通股，成本总额为人民币 60,974.20 元，估值总额为人民币 48,780.00 元，占基金资产净值的比例为 0.08%；本基金持有 127,400 股中国农业银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 391,369.15 元，估值总额为人民币 449,722.00 元，占基金资产净值的比例为 0.75% (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%)。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

6.4.12 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601916	浙商银行	2023 年 6 月 27 日	1 个月内（含）	配股流通受限	2.02	2.64	7,853	15,863.06	20,731.92	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

于本报告期末，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：同）。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金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，不得超过该上市公司可流通股票的 30% (完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人对其管理的所有开放式基金于开放期内，对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。

本基金管理人通过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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

资产							
银行存款	1,345,533.82	-	-	-	-	-	1,345,533.82
结算备付金	16,154.35	-	-	-	-	-	16,154.35
存出保证金	4,123.99	-	-	-	-	-	4,123.99
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-58,593,623.75	58,593,623.75
资产总计	1,365,812.16	-	-	-	-	-58,593,623.75	59,959,435.91
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	25,399.12	25,399.12
应付托管费	-	-	-	-	-	5,079.84	5,079.84
应付证券清算款	-	-	-	-	-	16.35	16.35
其他负债	-	-	-	-	-	237,507.46	237,507.46
负债总计	-	-	-	-	-	268,002.77	268,002.77
利率敏感度缺口	1,365,812.16	-	-	-	-	-	-
上年度末 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							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	35,963.55	35,963.55
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	-	-	-	-	-	-

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期末，本基金未持有债券资产（上年度末：同），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）。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022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	58,593,623.75	98.16	82,807,524.68	98.74
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	58,593,623.75	98.16	82,807,524.68	98.74

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
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 (2023年6月30日)	上年度末 (2022年12月31日)
	沪深 300 指数上升 5%	2,850,725.18	3,864,562.53
	沪深 300 指数下降 5%	-2,850,725.18	-3,864,562.53

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	58,572,891.83	82,715,602.28
第二层次	20,731.92	91,922.40
第三层次	-	-
合计	58,593,623.75	82,807,524.68

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2022 年 12 月 31 日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	58,593,623.75	97.72
	其中：股票	58,593,623.75	97.72
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	1,361,688.17	2.27
8	其他各项资产	4,123.99	0.01
9	合计	59,959,435.91	100.00

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

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	623,579.30	1.04
B	采矿业	2,573,515.95	4.31
C	制造业	33,153,604.36	55.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,253,885.14	3.78
E	建筑业	1,321,330.80	2.21
F	批发和零售业	631,655.60	1.06
G	交通运输、仓储和邮政业	1,961,223.30	3.29
H	住宿和餐饮业	85,362.00	0.14
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,914,767.50	4.88
J	金融业	10,445,196.12	17.50
K	房地产业	887,250.72	1.49
L	租赁和商务服务业	548,359.60	0.92
M	科学研究和技术服务业	385,993.60	0.65
N	水利、环境和公共设施管理业	76,815.00	0.13
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	43,240.00	0.07
Q	卫生和社会工作	391,804.86	0.66
R	文化、体育和娱乐业	217,728.90	0.36
S	综合	78,311.00	0.13
	合计	58,593,623.75	98.16

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	1,887	3,190,917.00	5.35
2	300750	宁德时代	6,607	1,511,615.53	2.53
3	600036	招商银行	30,878	1,011,563.28	1.69
4	000858	五粮液	5,872	960,483.04	1.61
5	600900	长江电力	35,412	781,188.72	1.31
6	601318	中国平安	16,237	753,396.80	1.26
7	002594	比亚迪	2,720	702,494.40	1.18
8	300760	迈瑞医疗	1,900	569,620.00	0.95
9	601166	兴业银行	31,100	486,715.00	0.82
10	000568	泸州老窖	2,235	468,388.95	0.78
11	600276	恒瑞医药	9,534	456,678.60	0.77
12	601398	工商银行	94,100	453,562.00	0.76
13	601288	农业银行	127,400	449,722.00	0.75
14	600309	万华化学	4,765	418,557.60	0.70
15	601138	工业富联	14,857	374,396.40	0.63
16	600030	中信证券	18,350	362,963.00	0.61
17	688111	金山办公	765	361,248.30	0.61
18	601668	中国建筑	62,760	360,242.40	0.60
19	601899	紫金矿业	30,800	350,196.00	0.59
20	002475	立讯精密	10,680	346,566.00	0.58
21	002714	牧原股份	8,222	346,557.30	0.58
22	600809	山西汾酒	1,841	340,713.87	0.57
23	601328	交通银行	58,700	340,460.00	0.57
24	300059	东方财富	23,753	337,292.60	0.57
25	601888	中国中免	3,000	331,590.00	0.56
26	002352	顺丰控股	7,350	331,411.50	0.56
27	603288	海天味业	6,963	326,216.55	0.55
28	000001	平安银行	29,000	325,670.00	0.55
29	601012	隆基绿能	11,339	325,089.13	0.54
30	600000	浦发银行	43,900	317,836.00	0.53
31	601088	中国神华	9,930	305,347.50	0.51
32	002304	洋河股份	2,313	303,812.55	0.51
33	600028	中国石化	47,400	301,464.00	0.51
34	600406	国电南瑞	12,057	278,516.70	0.47
35	000063	中兴通讯	6,000	273,240.00	0.46
36	600887	伊利股份	9,600	271,872.00	0.46
37	300274	阳光电源	2,300	268,249.00	0.45
38	601601	中国太保	10,300	267,594.00	0.45
39	601225	陕西煤业	14,500	263,755.00	0.44

40	300015	爱尔眼科	13,970	259,143.50	0.43
41	600436	片仔癀	904	258,869.44	0.43
42	601816	京沪高铁	48,900	257,214.00	0.43
43	002371	北方华创	800	254,120.00	0.43
44	002142	宁波银行	9,866	249,609.80	0.42
45	601857	中国石油	32,249	240,900.03	0.40
46	603259	药明康德	3,840	239,270.40	0.40
47	002230	科大讯飞	3,500	237,860.00	0.40
48	601766	中国中车	36,400	236,600.00	0.40
49	600048	保利发展	17,900	233,237.00	0.39
50	601390	中国中铁	30,700	232,706.00	0.39
51	600438	通威股份	6,768	232,210.08	0.39
52	600905	三峡能源	42,800	229,836.00	0.39
53	000725	京东方 A	56,100	229,449.00	0.38
54	600050	中国联通	47,600	228,480.00	0.38
55	600690	海尔智家	9,434	221,510.32	0.37
56	600150	中国船舶	6,700	220,497.00	0.37
57	601818	光大银行	69,400	213,058.00	0.36
58	601658	邮储银行	43,500	212,715.00	0.36
59	600031	三一重工	12,700	211,201.00	0.35
60	002459	晶澳科技	4,988	207,999.60	0.35
61	601988	中国银行	52,600	205,666.00	0.34
62	000002	万科 A	14,485	203,079.70	0.34
63	002129	TCL 中环	6,075	201,690.00	0.34
64	600016	民生银行	53,060	198,975.00	0.33
65	601985	中国核电	28,200	198,810.00	0.33
66	688036	传音控股	1,305	191,835.00	0.32
67	600019	宝钢股份	33,256	186,898.72	0.31
68	300014	亿纬锂能	3,085	186,642.50	0.31
69	603501	韦尔股份	1,835	179,903.40	0.30
70	601919	中远海控	19,043	179,004.20	0.30
71	300498	温氏股份	9,740	178,729.00	0.30
72	300896	爱美客	400	177,980.00	0.30
73	300308	中际旭创	1,200	176,940.00	0.30
74	002493	荣盛石化	15,150	176,346.00	0.30
75	000596	古井贡酒	700	173,166.00	0.29
76	600893	航发动力	3,982	168,279.32	0.28
77	601006	大秦铁路	22,200	164,946.00	0.28
78	600104	上汽集团	11,595	164,301.15	0.28
79	600919	江苏银行	22,080	162,288.00	0.27
80	000625	长安汽车	12,345	159,620.85	0.27
81	601211	国泰君安	11,228	157,079.72	0.26
82	300122	智飞生物	3,550	156,910.00	0.26

83	000166	申万宏源	33,700	155,694.00	0.26
84	000792	盐湖股份	8,100	155,277.00	0.26
85	601066	中信建投	6,400	154,880.00	0.26
86	002466	天齐锂业	2,200	153,802.00	0.26
87	000651	格力电器	4,200	153,342.00	0.26
88	601688	华泰证券	11,009	151,593.93	0.25
89	688012	中微公司	960	150,192.00	0.25
90	001979	招商蛇口	11,500	149,845.00	0.25
91	600346	恒力石化	10,440	149,605.20	0.25
92	600999	招商证券	11,020	149,541.40	0.25
93	002460	赣锋锂业	2,450	149,352.00	0.25
94	601669	中国电建	25,700	147,518.00	0.25
95	002027	分众传媒	21,560	146,823.60	0.25
96	601169	北京银行	31,600	146,308.00	0.25
97	601628	中国人寿	4,150	145,084.00	0.24
98	002812	恩捷股份	1,500	144,525.00	0.24
99	000538	云南白药	2,720	142,745.60	0.24
100	300316	晶盛机电	2,000	141,800.00	0.24
101	600585	海螺水泥	5,949	141,229.26	0.24
102	603993	洛阳钼业	26,400	140,712.00	0.24
103	600886	国投电力	11,100	140,415.00	0.24
104	002920	德赛西威	900	140,229.00	0.23
105	300033	同花顺	800	140,224.00	0.23
106	688223	晶科能源	9,933	139,657.98	0.23
107	600989	宝丰能源	10,900	137,449.00	0.23
108	601689	拓普集团	1,700	137,190.00	0.23
109	000938	紫光股份	4,279	136,286.15	0.23
110	688599	天合光能	3,196	136,181.56	0.23
111	600845	宝信软件	2,662	135,256.22	0.23
112	601360	三六零	10,611	133,061.94	0.22
113	600837	海通证券	14,424	132,989.28	0.22
114	300124	汇川技术	2,037	130,795.77	0.22
115	600111	北方稀土	5,403	129,563.94	0.22
116	000776	广发证券	8,800	129,448.00	0.22
117	600089	特变电工	5,744	128,033.76	0.21
118	600703	三安光电	7,400	127,576.00	0.21
119	600547	山东黄金	5,404	126,885.92	0.21
120	600011	华能国际	13,687	126,741.62	0.21
121	601100	恒立液压	1,964	126,344.12	0.21
122	600570	恒生电子	2,843	125,916.47	0.21
123	000338	潍柴动力	10,100	125,846.00	0.21
124	000895	双汇发展	5,100	124,899.00	0.21
125	601009	南京银行	15,466	123,728.00	0.21

126	600010	包钢股份	68,200	122,078.00	0.20
127	601229	上海银行	21,204	121,923.00	0.20
128	000425	徐工机械	17,600	119,152.00	0.20
129	002049	紫光国微	1,260	117,495.00	0.20
130	002311	海大集团	2,500	117,100.00	0.20
131	688256	寒武纪	618	116,184.00	0.19
132	002709	天赐材料	2,820	116,155.80	0.19
133	600085	同仁堂	2,000	115,120.00	0.19
134	002555	三七互娱	3,300	115,104.00	0.19
135	603659	璞泰来	3,006	114,889.32	0.19
136	601336	新华保险	3,119	114,685.63	0.19
137	600188	兖矿能源	3,800	113,696.00	0.19
138	000963	华东医药	2,617	113,499.29	0.19
139	601868	中国能建	48,500	113,490.00	0.19
140	600600	青岛啤酒	1,082	112,127.66	0.19
141	000100	TCL 科技	28,030	110,438.20	0.19
142	000301	东方盛虹	9,200	108,744.00	0.18
143	601600	中国铝业	19,700	108,153.00	0.18
144	688396	华润微	2,063	108,121.83	0.18
145	603799	华友钴业	2,353	108,026.23	0.18
146	600958	东方证券	11,112	107,786.40	0.18
147	600660	福耀玻璃	3,000	107,550.00	0.18
148	600015	华夏银行	19,818	107,215.38	0.18
149	600039	四川路桥	10,840	106,340.40	0.18
150	601618	中国中冶	26,700	105,999.00	0.18
151	688032	禾迈股份	298	105,834.70	0.18
152	600588	用友网络	5,122	105,001.00	0.18
153	688303	大全能源	2,587	104,644.15	0.18
154	000977	浪潮信息	2,156	104,566.00	0.18
155	603986	兆易创新	980	104,125.00	0.17
156	600926	杭州银行	8,800	103,400.00	0.17
157	601995	中金公司	2,900	103,008.00	0.17
158	600795	国电电力	26,600	101,878.00	0.17
159	600029	南方航空	16,800	101,304.00	0.17
160	600221	海航控股	64,100	101,278.00	0.17
161	603806	福斯特	2,707	100,673.33	0.17
162	603369	今世缘	1,900	100,320.00	0.17
163	688008	澜起科技	1,735	99,623.70	0.17
164	600674	川投能源	6,600	99,330.00	0.17
165	002236	大华股份	4,900	96,775.00	0.16
166	601865	福莱特	2,500	96,275.00	0.16
167	600426	华鲁恒升	3,140	96,178.20	0.16
168	600196	复星医药	3,108	96,037.20	0.16

169	601111	中国国航	11,600	95,584.00	0.16
170	300413	芒果超媒	2,790	95,445.90	0.16
171	605117	德业股份	620	92,721.00	0.16
172	601788	光大证券	5,827	92,591.03	0.16
173	601607	上海医药	4,100	91,881.00	0.15
174	000999	华润三九	1,500	90,990.00	0.15
175	601633	长城汽车	3,600	90,612.00	0.15
176	002241	歌尔股份	5,100	90,525.00	0.15
177	601939	建设银行	14,300	89,518.00	0.15
178	601877	正泰电器	3,200	88,480.00	0.15
179	600745	闻泰科技	1,800	88,020.00	0.15
180	300433	蓝思科技	7,400	87,024.00	0.15
181	600741	华域汽车	4,700	86,762.00	0.15
182	601727	上海电气	18,900	86,373.00	0.14
183	601916	浙商银行	32,429	85,612.56	0.14
184	688126	沪硅产业	4,075	85,167.50	0.14
185	600023	浙能电力	16,700	84,669.00	0.14
186	600176	中国巨石	5,973	84,577.68	0.14
187	002602	世纪华通	11,120	84,400.80	0.14
188	603260	合盛硅业	1,200	84,024.00	0.14
189	300999	金龙鱼	2,100	83,979.00	0.14
190	600732	爱旭股份	2,700	83,025.00	0.14
191	002736	国信证券	9,500	82,935.00	0.14
192	601319	中国人保	14,100	82,344.00	0.14
193	300408	三环集团	2,800	82,180.00	0.14
194	000661	长春高新	600	81,780.00	0.14
195	600009	上海机场	1,800	81,756.00	0.14
196	600027	华电国际	12,200	81,618.00	0.14
197	600522	中天科技	5,100	81,141.00	0.14
198	600584	长电科技	2,600	81,042.00	0.14
199	600115	中国东航	17,000	80,920.00	0.14
200	601127	赛力斯	2,200	80,894.00	0.14
201	601021	春秋航空	1,400	80,458.00	0.13
202	601901	方正证券	12,300	80,442.00	0.13
203	603392	万泰生物	1,202	80,257.54	0.13
204	688063	派能科技	400	79,300.00	0.13
205	688301	奕瑞科技	280	79,080.40	0.13
206	002050	三花智控	2,600	78,676.00	0.13
207	601377	兴业证券	12,850	78,642.00	0.13
208	601825	沪农商行	14,400	78,480.00	0.13
209	000876	新希望	6,701	78,267.68	0.13
210	000983	山西焦煤	8,490	77,259.00	0.13
211	000733	振华科技	800	76,680.00	0.13

212	600875	东方电气	4,100	76,465.00	0.13
213	601238	广汽集团	7,300	76,066.00	0.13
214	603833	欧派家居	787	75,394.60	0.13
215	300782	卓胜微	780	75,371.40	0.13
216	601117	中国化学	9,100	75,348.00	0.13
217	300751	迈为股份	444	75,204.72	0.13
218	002252	上海莱士	10,000	75,100.00	0.13
219	002648	卫星化学	4,993	74,695.28	0.13
220	600489	中金黄金	7,200	74,376.00	0.12
221	601881	中国银河	6,400	74,304.00	0.12
222	600233	圆通速递	5,100	74,256.00	0.12
223	603345	安井食品	500	73,400.00	0.12
224	002600	领益智造	10,500	72,555.00	0.12
225	600803	新奥股份	3,800	72,124.00	0.12
226	002180	纳思达	2,100	71,925.00	0.12
227	600918	中泰证券	10,400	71,864.00	0.12
228	002074	国轩高科	2,600	71,812.00	0.12
229	601699	潞安环能	4,400	71,808.00	0.12
230	000157	中联重科	10,600	71,550.00	0.12
231	002001	新和成	4,588	70,655.20	0.12
232	601872	招商轮船	12,100	70,059.00	0.12
233	600415	小商品城	8,200	69,946.00	0.12
234	600515	海南机场	17,100	69,426.00	0.12
235	002841	视源股份	1,034	69,112.56	0.12
236	300418	昆仑万维	1,700	68,476.00	0.11
237	688363	华熙生物	768	68,474.88	0.11
238	600061	国投资本	9,600	68,352.00	0.11
239	002938	鹏鼎控股	2,800	68,012.00	0.11
240	300454	深信服	600	67,950.00	0.11
241	300496	中科创达	700	67,445.00	0.11
242	600256	广汇能源	9,800	67,228.00	0.11
243	601838	成都银行	5,500	67,155.00	0.11
244	688777	中控技术	1,066	66,923.48	0.11
245	000066	中国长城	4,800	66,384.00	0.11
246	600026	中远海能	5,200	65,728.00	0.11
247	300628	亿联网络	1,864	65,370.48	0.11
248	002422	科伦药业	2,200	65,296.00	0.11
249	600161	天坛生物	2,400	65,160.00	0.11
250	000807	云铝股份	5,100	64,923.00	0.11
251	300832	新产业	1,100	64,900.00	0.11
252	002384	东山精密	2,500	64,750.00	0.11
253	600079	人福医药	2,400	64,656.00	0.11
254	600332	白云山	2,026	64,588.88	0.11

255	603290	斯达半导	300	64,560.00	0.11
256	600132	重庆啤酒	700	64,512.00	0.11
257	688169	石头科技	200	64,136.00	0.11
258	603198	迎驾贡酒	1,000	63,800.00	0.11
259	002603	以岭药业	2,480	63,711.20	0.11
260	002821	凯莱英	540	63,644.40	0.11
261	600460	士兰微	2,100	63,567.00	0.11
262	300142	沃森生物	2,403	63,559.35	0.11
263	300003	乐普医疗	2,800	63,308.00	0.11
264	603486	科沃斯	800	62,216.00	0.10
265	600702	舍得酒业	500	61,975.00	0.10
266	300223	北京君正	700	61,817.00	0.10
267	000786	北新建材	2,500	61,275.00	0.10
268	688009	中国通号	10,564	61,271.20	0.10
269	002007	华兰生物	2,690	60,282.90	0.10
270	300146	汤臣倍健	2,500	59,950.00	0.10
271	600362	江西铜业	3,100	58,838.00	0.10
272	002916	深南电路	780	58,788.60	0.10
273	002463	沪电股份	2,800	58,632.00	0.10
274	688516	奥特维	311	58,592.40	0.10
275	603899	晨光股份	1,300	58,032.00	0.10
276	002601	龙佰集团	3,500	57,750.00	0.10
277	601615	明阳智能	3,400	57,392.00	0.10
278	601878	浙商证券	5,800	57,304.00	0.10
279	300763	锦浪科技	550	57,255.00	0.10
280	300037	新宙邦	1,100	57,079.00	0.10
281	000988	华工科技	1,500	57,015.00	0.10
282	603688	石英股份	500	56,920.00	0.10
283	002568	百润股份	1,552	56,415.20	0.09
284	600536	中国软件	1,200	56,256.00	0.09
285	300724	捷佳伟创	500	56,175.00	0.09
286	688521	芯原股份	780	56,097.60	0.09
287	300661	圣邦股份	680	55,848.40	0.09
288	688561	奇安信	1,072	55,540.32	0.09
289	600160	巨化股份	4,000	55,120.00	0.09
290	600754	锦江酒店	1,300	55,042.00	0.09
291	603939	益丰药房	1,481	54,797.00	0.09
292	600018	上港集团	10,400	54,600.00	0.09
293	002202	金风科技	5,084	53,992.08	0.09
294	002223	鱼跃医疗	1,500	53,985.00	0.09
295	002558	巨人网络	3,000	53,790.00	0.09
296	000069	华侨城 A	12,200	53,680.00	0.09
297	300759	康龙化成	1,400	53,592.00	0.09

298	601958	金钼股份	4,800	53,520.00	0.09
299	300957	贝泰妮	600	53,328.00	0.09
300	600219	南山铝业	17,500	52,850.00	0.09
300	603882	金域医学	700	52,850.00	0.09
301	688188	柏楚电子	280	52,796.80	0.09
302	600487	亨通光电	3,600	52,776.00	0.09
303	002340	格林美	7,600	52,516.00	0.09
304	000729	燕京啤酒	4,200	52,374.00	0.09
305	002738	中矿资源	1,020	51,958.80	0.09
306	000408	藏格矿业	2,300	51,911.00	0.09
307	688122	西部超导	931	51,884.63	0.09
308	601555	东吴证券	7,459	51,765.46	0.09
309	601216	君正集团	12,600	51,660.00	0.09
310	002028	思源电气	1,100	51,392.00	0.09
311	002080	中材科技	2,500	51,300.00	0.09
312	603737	三棵树	784	51,289.28	0.09
313	601058	赛轮轮胎	4,500	51,255.00	0.09
314	600642	申能股份	7,300	51,027.00	0.09
315	002409	雅克科技	700	51,016.00	0.09
316	603885	吉祥航空	3,300	50,919.00	0.09
317	002064	华峰化学	7,400	50,764.00	0.09
318	600705	中航产融	13,200	50,556.00	0.08
319	600004	白云机场	3,500	50,190.00	0.08
320	000629	钒钛股份	12,800	50,048.00	0.08
321	600884	杉杉股份	3,300	49,962.00	0.08
322	600970	中材国际	3,900	49,725.00	0.08
323	002156	通富微电	2,200	49,720.00	0.08
324	601108	财通证券	6,860	49,666.40	0.08
325	601799	星宇股份	400	49,440.00	0.08
326	002414	高德红外	6,361	49,424.97	0.08
327	688099	晶晨股份	586	49,411.52	0.08
328	688220	翱捷科技	654	49,305.06	0.08
329	002294	信立泰	1,580	49,280.20	0.08
330	000932	华菱钢铁	10,300	49,131.00	0.08
331	603444	吉比特	100	49,111.00	0.08
332	603606	东方电缆	1,000	49,030.00	0.08
333	600153	建发股份	4,490	48,985.90	0.08
334	002625	光启技术	3,200	48,832.00	0.08
335	002939	长城证券	6,000	48,780.00	0.08
336	600183	生益科技	3,400	48,280.00	0.08
337	000723	美锦能源	6,400	48,256.00	0.08
338	300919	中伟股份	800	48,200.00	0.08
339	002624	完美世界	2,851	48,153.39	0.08

340	600606	绿地控股	17,500	48,125.00	0.08
341	000423	东阿阿胶	900	48,105.00	0.08
342	002430	杭氧股份	1,400	48,104.00	0.08
343	600383	金地集团	6,662	48,033.02	0.08
344	601966	玲珑轮胎	2,160	47,995.20	0.08
345	601233	桐昆股份	3,600	47,700.00	0.08
346	600109	国金证券	5,500	47,685.00	0.08
347	000783	长江证券	8,200	47,560.00	0.08
348	603596	伯特利	600	47,556.00	0.08
349	601155	新城控股	3,300	47,553.00	0.08
350	000975	银泰黄金	4,060	47,502.00	0.08
351	601077	渝农商行	13,200	47,388.00	0.08
352	300144	宋城演艺	3,820	47,368.00	0.08
353	002372	伟星新材	2,300	47,242.00	0.08
354	600157	永泰能源	33,200	47,144.00	0.08
355	600298	安琪酵母	1,300	47,073.00	0.08
356	000027	深圳能源	7,120	46,920.80	0.08
357	300487	蓝晓科技	750	46,815.00	0.08
358	688390	固德威	280	46,720.80	0.08
359	002153	石基信息	3,332	46,648.00	0.08
360	601577	长沙银行	6,000	46,560.00	0.08
361	603816	顾家家居	1,220	46,543.00	0.08
362	603233	大参林	1,657	46,412.57	0.08
363	000738	航发控制	1,900	46,360.00	0.08
364	600096	云天化	2,700	46,089.00	0.08
365	000032	深桑达 A	1,400	46,060.00	0.08
366	000021	深科技	2,300	45,977.00	0.08
367	000009	中国宝安	3,800	45,866.00	0.08
368	000630	铜陵有色	15,700	45,373.00	0.08
369	600021	上海电力	4,200	45,234.00	0.08
370	601990	南京证券	5,500	44,990.00	0.08
371	600352	浙江龙盛	4,800	44,880.00	0.08
372	603156	养元饮品	1,800	44,460.00	0.07
373	002756	永兴材料	710	44,453.10	0.07
374	300207	欣旺达	2,700	44,064.00	0.07
375	601880	辽港股份	28,100	43,836.00	0.07
376	002078	太阳纸业	4,100	43,829.00	0.07
377	603568	伟明环保	2,500	43,775.00	0.07
378	601696	中银证券	4,100	43,706.00	0.07
379	002056	横店东磁	2,400	43,704.00	0.07
380	002128	电投能源	3,300	43,626.00	0.07
381	688536	思瑞浦	200	43,600.00	0.07
382	300118	东方日升	1,700	43,571.00	0.07

383	600177	雅戈尔	6,900	43,539.00	0.07
384	002152	广电运通	3,700	43,364.00	0.07
385	002185	华天科技	4,700	43,240.00	0.07
385	002607	中公教育	9,200	43,240.00	0.07
386	603185	弘元绿能	580	43,239.00	0.07
387	688187	时代电气	1,029	43,073.94	0.07
388	300390	天华新能	1,200	42,960.00	0.07
389	000933	神火股份	3,300	42,900.00	0.07
390	600998	九州通	4,118	42,744.84	0.07
391	300604	长川科技	900	42,741.00	0.07
392	600511	国药股份	1,100	42,735.00	0.07
393	600985	淮北矿业	3,700	42,624.00	0.07
394	600348	华阳股份	5,350	42,318.50	0.07
395	600872	中炬高新	1,149	42,271.71	0.07
396	601933	永辉超市	13,500	42,255.00	0.07
397	002673	西部证券	6,642	42,176.70	0.07
398	300601	康泰生物	1,660	42,147.40	0.07
399	000728	国元证券	6,460	42,119.20	0.07
400	600546	山煤国际	2,900	41,963.00	0.07
401	300769	德方纳米	380	41,887.40	0.07
402	600848	上海临港	3,500	41,825.00	0.07
403	688180	君实生物	1,081	41,661.74	0.07
404	000831	中国稀土	1,400	41,440.00	0.07
405	002240	盛新锂能	1,300	41,431.00	0.07
406	600378	昊华科技	1,100	41,404.00	0.07
407	603658	安图生物	800	41,384.00	0.07
408	002532	天山铝业	6,900	41,331.00	0.07
409	600779	水井坊	700	41,293.00	0.07
410	002120	韵达股份	4,310	41,203.60	0.07
411	600563	法拉电子	300	41,190.00	0.07
412	002044	美年健康	5,776	41,067.36	0.07
413	601991	大唐发电	12,300	40,713.00	0.07
414	600521	华海药业	2,210	40,686.10	0.07
415	002244	滨江集团	4,600	40,572.00	0.07
416	002405	四维图新	3,500	40,530.00	0.07
417	601231	环旭电子	2,700	40,392.00	0.07
418	002385	大北农	6,100	40,260.00	0.07
419	002739	万达电影	3,200	40,128.00	0.07
420	002032	苏泊尔	800	40,000.00	0.07
421	600549	厦门钨业	2,100	39,963.00	0.07
422	600655	豫园股份	5,800	39,788.00	0.07
423	002850	科达利	300	39,675.00	0.07
424	002531	天顺风能	2,600	39,598.00	0.07

425	000987	越秀资本	6,221	39,503.35	0.07
426	603589	口子窖	800	39,480.00	0.07
427	000591	太阳能	5,800	39,324.00	0.07
428	600873	梅花生物	4,400	39,292.00	0.07
429	688385	复旦微电	776	38,877.60	0.07
430	000683	远兴能源	5,400	38,826.00	0.07
431	600763	通策医疗	400	38,744.00	0.06
432	300595	欧普康视	1,280	38,643.20	0.06
433	600583	海油工程	6,600	38,610.00	0.06
434	000800	一汽解放	4,600	38,502.00	0.06
435	601198	东兴证券	4,800	38,496.00	0.06
436	688728	格科微	2,407	38,078.74	0.06
437	600704	物产中大	7,700	38,038.00	0.06
438	600566	济川药业	1,300	37,752.00	0.06
439	600481	双良节能	2,700	37,746.00	0.06
440	603613	国联股份	1,022	37,742.46	0.06
441	002353	杰瑞股份	1,500	37,695.00	0.06
442	000960	锡业股份	2,400	37,320.00	0.06
443	603338	浙江鼎力	660	36,966.60	0.06
444	601168	西部矿业	3,500	36,785.00	0.06
445	301236	软通动力	1,350	36,733.50	0.06
446	605358	立昂微	1,000	36,730.00	0.06
447	000703	恒逸石化	5,410	36,679.80	0.06
448	601866	中远海发	14,800	36,556.00	0.06
449	603893	瑞芯微	500	36,425.00	0.06
450	300699	光威复材	1,180	36,403.00	0.06
451	000519	中兵红箭	2,000	36,180.00	0.06
452	600369	西南证券	9,900	36,135.00	0.06
453	000799	酒鬼酒	400	36,060.00	0.06
454	300676	华大基因	600	35,994.00	0.06
455	600170	上海建工	13,300	35,777.00	0.06
456	603456	九洲药业	1,300	35,594.00	0.06
457	600380	健康元	2,800	35,588.00	0.06
458	600141	兴发集团	1,600	35,552.00	0.06
459	002797	第一创业	6,200	35,464.00	0.06
460	002508	老板电器	1,400	35,406.00	0.06
461	002966	苏州银行	5,400	35,370.00	0.06
462	600699	均胜电子	2,000	35,280.00	0.06
463	601016	节能风电	9,600	35,232.00	0.06
464	300073	当升科技	700	35,231.00	0.06
465	002465	海格通信	3,400	35,156.00	0.06
466	000513	丽珠集团	900	35,019.00	0.06
467	600486	扬农化工	400	34,968.00	0.06

468	600516	方大炭素	5,614	34,806.80	0.06
469	000709	河钢股份	15,400	34,804.00	0.06
470	300251	光线传媒	4,300	34,787.00	0.06
471	600598	北大荒	2,600	34,658.00	0.06
472	601636	旗滨集团	4,000	34,480.00	0.06
473	002299	圣农发展	1,800	34,470.00	0.06
474	300395	菲利华	700	34,440.00	0.06
475	600688	上海石化	10,930	33,992.30	0.06
476	002145	中核钛白	5,705	33,602.45	0.06
477	603858	步长制药	1,631	33,582.29	0.06
478	600392	盛和资源	2,600	33,462.00	0.06
479	002268	电科网安	1,200	33,444.00	0.06
480	603517	绝味食品	900	33,435.00	0.06
481	603712	七一二	1,100	33,231.00	0.06
482	002065	东华软件	4,700	33,182.00	0.06
483	000937	冀中能源	5,200	33,176.00	0.06
484	000050	深天马 A	3,600	33,048.00	0.06
485	002266	浙富控股	8,000	33,040.00	0.06
486	600499	科达制造	2,900	32,944.00	0.06
487	000825	太钢不锈	8,500	32,895.00	0.06
488	603707	健友股份	2,419	32,656.50	0.05
489	300568	星源材质	1,896	32,592.24	0.05
490	600673	东阳光	4,500	32,445.00	0.05
491	002926	华西证券	3,900	32,409.00	0.05
492	600988	赤峰黄金	2,400	32,304.00	0.05
493	300347	泰格医药	500	32,270.00	0.05
494	603529	爱玛科技	1,000	32,220.00	0.05
495	603077	和邦生物	13,200	32,076.00	0.05
496	002518	科士达	800	32,008.00	0.05
497	600559	老白干酒	1,300	31,863.00	0.05
498	600038	中直股份	800	31,856.00	0.05
499	601456	国联证券	3,500	31,850.00	0.05
500	002831	裕同科技	1,300	31,707.00	0.05
501	000155	川能动力	2,200	31,680.00	0.05
502	002407	多氟多	1,580	31,378.80	0.05
503	002507	涪陵榨菜	1,690	30,943.90	0.05
504	688005	容百科技	566	30,575.32	0.05
505	600258	首旅酒店	1,600	30,320.00	0.05
506	688779	长远锂科	2,690	30,316.30	0.05
507	002497	雅化集团	1,700	30,226.00	0.05
508	000739	普洛药业	1,700	30,158.00	0.05
509	300212	易华录	900	29,907.00	0.05
510	000893	亚钾国际	1,300	29,822.00	0.05

511	002176	江特电机	2,500	29,800.00	0.05
512	002500	山西证券	5,340	29,797.20	0.05
513	000830	鲁西化工	2,800	29,568.00	0.05
514	000998	隆平高科	1,900	29,165.00	0.05
515	300438	鹏辉能源	600	28,824.00	0.05
516	300558	贝达药业	600	28,818.00	0.05
517	000401	冀东水泥	3,900	28,743.00	0.05
518	002138	顺络电子	1,200	28,692.00	0.05
519	600056	中国医药	2,200	28,556.00	0.05
520	603218	日月股份	1,500	28,485.00	0.05
521	300373	扬杰科技	700	28,399.00	0.05
522	002487	大金重工	900	27,756.00	0.05
523	002541	鸿路钢构	960	27,657.60	0.05
524	601992	金隅集团	12,400	27,032.00	0.05
525	002408	齐翔腾达	4,200	26,754.00	0.04
526	300529	健帆生物	1,130	26,193.40	0.04
527	002791	坚朗五金	400	25,884.00	0.04
528	601666	平煤股份	3,400	25,636.00	0.04
529	688002	睿创微纳	558	24,998.40	0.04
530	603127	昭衍新药	608	24,867.20	0.04
531	600885	宏发股份	780	24,843.00	0.04
532	600801	华新水泥	2,000	24,700.00	0.04
533	002092	中泰化学	3,800	24,510.00	0.04
534	603866	桃李面包	2,349	23,771.88	0.04
535	600338	西藏珠峰	1,300	23,738.00	0.04
536	300363	博腾股份	800	23,672.00	0.04
537	300357	我武生物	700	23,541.00	0.04
538	002030	达安基因	2,076	20,697.72	0.03
539	002192	融捷股份	300	20,049.00	0.03

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601816	京沪高铁	286,191.00	0.34
2	688256	寒武纪	192,998.32	0.23
3	600886	国投电力	151,026.00	0.18
4	600703	三安光电	147,447.00	0.18
5	688223	晶科能源	129,339.55	0.15
6	688303	大全能源	115,232.59	0.14
7	600221	海航控股	110,733.00	0.13

8	603688	石英股份	110,063.00	0.13
9	300418	昆仑万维	106,654.00	0.13
10	688032	禾迈股份	101,260.00	0.12
11	603658	安图生物	100,697.00	0.12
12	600732	爱旭股份	95,860.00	0.11
13	600061	国投资本	95,717.00	0.11
14	688126	沪硅产业	94,024.95	0.11
15	600436	片仔癀	91,872.00	0.11
16	603260	合盛硅业	90,215.00	0.11
17	600023	浙能电力	88,677.00	0.11
18	601901	方正证券	88,140.00	0.11
19	600489	中金黄金	84,659.00	0.10
20	601021	春秋航空	83,030.00	0.10

注：买入金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	758,180.00	0.90
2	000858	五粮液	525,899.00	0.63
3	002594	比亚迪	343,234.00	0.41
4	300760	迈瑞医疗	310,164.00	0.37
5	000568	泸州老窖	260,760.00	0.31
6	300124	汇川技术	251,937.00	0.30
7	002352	顺丰控股	207,806.00	0.25
8	300059	东方财富	198,357.14	0.24
9	000001	平安银行	193,925.00	0.23
10	002304	洋河股份	180,189.00	0.21
11	002714	牧原股份	178,271.00	0.21
12	300015	爱尔眼科	169,330.00	0.20
13	688111	金山办公	166,399.42	0.20
14	002475	立讯精密	164,096.00	0.20
15	600519	贵州茅台	163,699.00	0.20
16	300014	亿纬锂能	143,584.00	0.17
17	002142	宁波银行	137,509.00	0.16
18	000002	万科 A	119,909.00	0.14
19	002129	TCL 中环	119,126.00	0.14
20	300782	卓胜微	115,869.00	0.14

注：卖出金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	8,324,480.62
卖出股票收入（成交）总额	17,810,523.29

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

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人民银行、中国银行保险监督管理委员会的处罚。

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深圳市分局的处罚。

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及其分支机构的处罚。

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上述主体所发行证券进行了投资。

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。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	4,123.99
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	4,123.99

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人	户均持有的	持有人结构
-----	-------	-------

户数 (户)	基金份额	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 (%)
1,101	38,152.35	6,465,825.00	15.39	35,539,915.00	84.61	0.00	0

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	唐崇霖	2,568,000.00	6.11
2	中信证券股份有限公司	2,352,970.00	5.60
3	广发证券股份有限公司	2,170,062.00	5.17
4	张红	1,790,400.00	4.26
5	林李丽琴	1,600,000.00	3.81
6	中信建投证券股份有限公司	1,206,728.00	2.87
7	于凌	963,500.00	2.29
8	方正证券股份有限公司	709,104.00	1.69
9	郑时昭	650,000.00	1.55
10	李林晖	530,000.00	1.26

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本期末基金管理人的所有从业人员未持有本基金。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2018 年 4 月 27 日) 基金份额总额	1,534,005,740.00
本报告期期初基金份额总额	58,005,740.00
本报告期基金总申购份额	-
减：本报告期基金总赎回份额	16,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	42,005,740.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

在本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人重大人事变动：

报告期内本基金管理人未发生重大人事变动。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

在本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期末更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 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。

10.6.2 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，本基金的托管人及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中国国际金融股份有限公司	2	11,633,411.76	44.98	10,834.58	44.98	-
方正证券股份有限公司	2	5,657,275.30	21.88	5,268.86	21.88	-
长江证券股份	2	3,259,362.00	12.60	3,035.58	12.60	-

有限公司						
国信证券股份 有限公司	1	1,652,173.00	6.39	1,538.86	6.39	-
东北证券股份 有限公司	2	949,813.00	3.67	884.60	3.67	-
光大证券股份 有限公司	2	612,482.26	2.37	570.52	2.37	-
中国银河证券 股份有限公司	2	573,562.10	2.22	534.29	2.22	-
川财证券有限 责任公司	1	465,970.61	1.80	434.02	1.80	-
民生证券股份 有限公司	1	459,150.03	1.78	427.55	1.78	-
海通证券股份 有限公司	1	417,194.88	1.61	388.64	1.61	-
东方证券股份 有限公司	2	77,317.00	0.30	72.03	0.30	-
长城证券股份 有限公司	1	55,265.00	0.21	51.49	0.21	-
恒泰证券股份 有限公司	1	29,864.46	0.12	27.82	0.12	-
招商证券股份 有限公司	2	17,916.40	0.07	16.70	0.07	-
安信证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
诚通证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
大同证券有限 责任公司	2	-	-	-	-	-
东兴证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
广发证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
国金证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
国盛证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券 股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华创证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
华福证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股份	1	-	-	-	-	-

有限公司						
平安证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
瑞银证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
申港证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券 有限公司	1	-	-	-	-	-
天风证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
西南证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
中信建投证券 股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中信证券股份 有限公司	6	-	-	-	-	-

注：1. 基金专用交易单元的选择标准和程序如下：

1) 选择标准

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

2) 选择程序

基金管理人根据以上标准进行考察后，确定证券经营机构的选择。基金管理人与被选择的证券经营机构签订协议。

2. 本基金本报告期交易单元未发生变更。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	5,219.34	13.84	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	22,255.84	59.02	-	-	-	-
川财证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
民生证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	5,893.84	15.63	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
恒泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
诚通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
大同证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	4,342.50	11.52	-	-	-	-
国金证券股份	-	-	-	-	-	-

有限公司						
国盛证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券 股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华创证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
华福证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
平安证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
瑞银证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
申港证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券 有限公司	-	-	-	-	-	-
天风证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
西南证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券 股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	景顺长城 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 4 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 1 月 20 日
2	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2022 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 1 月 20 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	2023 年 2 月 10 日
4	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华安证券为一级交易商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 2 月 22 日

5	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 2 月 24 日
6	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	2023 年 3 月 25 日
7	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	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 3 月 28 日
8	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2022 年年度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 3 月 28 日
9	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增东海证券为一级交易商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 3 日
10	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 8 日
11	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	2023 年 4 月 18 日
12	景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 21 日
13	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2023 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 21 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	2023 年 4 月 22 日
15	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	2023 年 5 月 6 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	2023 年 5 月 13 日
17	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	2023 年 5 月 27 日
18	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增东方证券为一级交易商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 5 月 29 日
19	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增东北证券为一级交易商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 6 月 9 日
20	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 6 月 10 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	2023 年 6 月 17 日
22	景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 6 月 20 日
23	景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型	中国证监会指定报刊及	2023 年 6 月 22 日

	开放式指数证券投资基金 2023 年第 1 号更新招募说明书	网站	
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	2023 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	2023 年 6 月 22 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	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	20230101-20230301	11,890,600.00	0.00	11,890,600.00	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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

2、《景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；

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

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

5、景顺长城基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程；

6、其他在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、定期报告及临时公告。

12.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅。

景顺长城基金管理有限公司

2023 年 8 月 30 日