

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
2024 年中期报告

2024 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：2024 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 2024 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 2024 年 01 月 01 日起至 2024 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	10
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 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 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	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48

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	48
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	49
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	49
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	49
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	49
7.12 投资组合报告附注	49
§ 8 基金份额持有人信息	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	50
8.2 期末上市基金前十名持有人	50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	51
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	51
§ 9 开放式基金份额变动	51
§ 10 重大事件揭示	51
10.1 基金份额持有人大会决议	51
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	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	51
10.4 基金投资策略的改变	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	52
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	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	52
10.8 其他重大事件	58
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	59
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	60
§ 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: MSCIA 股 ETF 景顺)
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	38,005,740.00 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 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 (MSCI China A Inclusion RMB Index (CNY))。
风险收益特征	本基金为股票型指数基金，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中预期风险较高、预期收益较高的品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	景顺长城基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 姓名	杨崑阳	任航

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

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金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(2024年1月1日-2024年6月30日)
本期已实现收益	-4,264,269.56
本期利润	963,665.95
加权平均基金份额本期利润	0.0229
本期加权平均净值利润率	1.76%
本期基金份额净值增长率	0.61%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)
期末可供分配利润	11,155,134.62
期末可供分配基金份额利润	0.2935
期末基金资产净值	49,160,874.62
期末基金份额净值	1.2935
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)
基金份额累计净值增长率	29.35%

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。

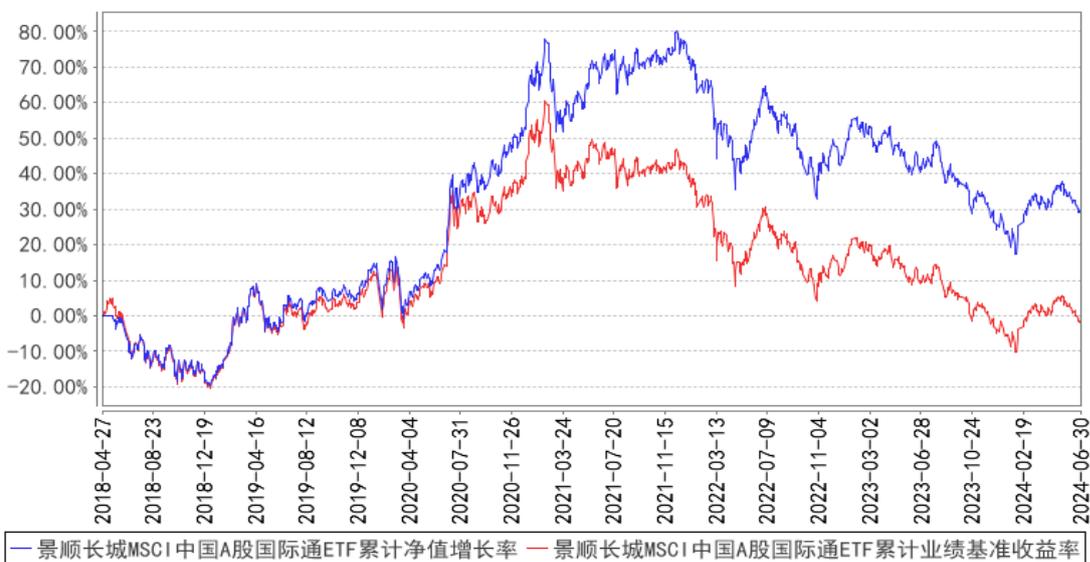
3.2 基金净值表现

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	-3.12%	0.50%	-3.88%	0.51%	0.76%	-0.01%
过去三个月	-1.67%	0.77%	-2.61%	0.79%	0.94%	-0.02%
过去六个月	0.61%	0.96%	0.00%	0.98%	0.61%	-0.02%
过去一年	-8.97%	0.89%	-10.40%	0.91%	1.43%	-0.02%
过去三年	-25.51%	1.02%	-33.59%	1.04%	8.08%	-0.02%
自基金合同生效起至今	29.35%	1.18%	-1.52%	1.21%	30.87%	-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2024年6月30日，本公司旗下共管理184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	-	10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10年证券、基金行业从业经验。
张晓南	本基金的基金助理	2023年9月13日	-	14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14年证券、基金行业从业经验。
龚丽丽	本基金的基金经理	2024年5月30日	-	13年	理学硕士。曾任华泰柏瑞基金管理有限公司指数投资部研究员、基金经理助理、基金经理，申万菱信基金管理有限公司指数投资部负责人、基金经理。2022年3月加

					入本公司，担任 ETF 与创新投资部副总经理，自 2023 年 11 月起担任 ETF 与创新投资部基金经理，现任 ETF 与创新投资部副总经理、基金经理，兼任投资经理。具有 13 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

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
龚丽丽	公募基金	7	8,498,427,458.84	2023 年 11 月 15 日
	私募资产管理计划	1	250,659,215.43	2023 年 12 月 27 日
	其他组合	-	-	-
	合计	8	8,749,086,674.27	-

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 9 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

上半年，A 股权益市场整体情绪分化较为明显，宽基指数涨跌幅及排序为：沪深 300(0.89%)>上证指数(-0.25%)>中小 100(-5.86%)>创业板指(-10.99%)>科创 50(-16.42%)。市值维度，总体表现出大盘占优特征，规模指数涨跌幅及排序为：沪深 300(0.89%)>中证 500(-8.96%)>中证 1000(-16.84%)。风格维度，中信风格指数涨跌幅及排序为：稳定(8.79%)>金融(2.77%)>周期(-1.21%)>消费(-13.24%)>成长(-14.76%)。行业维度，涨跌幅排前五行业为：银行(17.02%)、煤炭(11.96%)、公用事业(11.76%)、家用电器(8.48%)、石油石化(7.90%)，排后五行业为：综合(-33.34%)、计算机(-24.88%)、商贸零售(-24.59%)、社会服务(-24.05%)、传媒(-21.33%)。

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

2024 年上半年，本基金份额净值增长率为 0.61%，业绩比较基准收益率为 0.00%。

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：6 月工业增加值同比增长 5.3%，前值 5.6%，经季节调整后环比增长 0.42%；6 月 PMI49.5，5 月 49.5；6 月社会消费品零售总额同比增长 2.0%。通胀指标：6 月 PPI 同比-0.8%，前值-1.4%；6 月 CPI 同比 0.2%，前值 0.3%。货币金融指标：5 月 M2 同比增长 6.2%，前值 7.0%；6 月社会融资规模同比增长 8.1%，前值 8.4%。总体来看，增长斜率保持稳定，继续保持良好的复苏态势，同时通胀仍处在低位区间运行。

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—景顺长城基金管理有限公司 2024 年 1 月 1 日至 2024 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：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	1,303,583.25	995,796.62
结算备付金		36,361.17	9,478.25
存出保证金		6,022.22	3,126.07
交易性金融资产	6.4.7.2	48,099,129.99	53,225,268.41
其中：股票投资		48,099,129.99	53,225,268.41
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		23,750.77	-
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		49,468,847.40	54,233,669.35
负债和净资产	附注号	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023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		124,042.28	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		20,460.44	23,641.45
应付托管费		4,092.07	4,728.29
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	159,377.99	199,237.21
负债合计		307,972.78	227,606.95
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	38,005,740.00	42,005,740.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	11,155,134.62	12,000,322.40
净资产合计		49,160,874.62	54,006,062.40
负债和净资产总计		49,468,847.40	54,233,669.35

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 1.2935 元，基金份额总额 38,005,740.00 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024年1月1日至2024 年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年6月30日
一、营业总收入		1,277,812.77	529,959.34
1. 利息收入		4,175.48	4,161.31
其中：存款利息收入	6.4.7.13	4,175.48	4,161.31
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息		-	-

收入			
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-3,988,518.51	-2,343,224.08
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-4,602,112.70	-3,066,248.72
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	6,509.99
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	613,594.19	716,514.65
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	5,227,935.51	2,865,966.74
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	34,220.29	3,055.37
减：二、营业总支出		314,146.82	373,633.46
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	136,322.09	180,503.40
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	27,264.42	36,100.72
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		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	150,560.31	157,029.34
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		963,665.95	156,325.88
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		963,665.95	156,325.88
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		963,665.95	156,325.88

6.3 净资产变动表

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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	42,005,740.00	-	12,000,322.40	54,006,062.40
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	42,005,740.00	-	12,000,322.40	54,006,062.40
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-4,000,000.00	-	-845,187.78	-4,845,187.78
（一）、综合收益总额	-	-	963,665.95	963,665.95
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-4,000,000.00	-	-1,808,853.73	-5,808,853.73
其中：1. 基金申购款	12,000,000.00	-	3,428,750.45	15,428,750.45
2. 基金赎回款	-16,000,000.00	-	-5,237,604.18	-21,237,604.18
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	38,005,740.00	-	11,155,134.62	49,160,874.62
项目	上年度可比期间 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	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	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净资产变动数(净资产减少以“-”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净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	42,005,740.00	-	17,685,693.14	59,691,433.14

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

基金管理人负责人

吴建军

主管会计工作负责人

邵媛媛

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(MSCIChinaAIInclusionRMBIndex(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 2024 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》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 2024 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 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年 1 月 1 日至 2024 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》、财税[2023]39 号《关于减半征收交易印花税的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，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。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
活期存款	1,303,583.25
等于：本金	1,303,361.78
加：应计利息	221.47
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	1,303,583.25

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	54,807,192.60	-	48,099,129.99	-6,708,062.61
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	54,807,192.60	-	48,099,129.99	-6,708,062.61

注：于2024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

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

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

本基金本报告期末债权投资余额为零。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末债权投资余额为零。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末其他债权投资余额为零。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末其他债权投资余额为零。

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

本基金本报告期末其他权益工具投资余额为零。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金本报告期末其他权益工具投资余额为零。

6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末其他资产余额为零。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024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	10,025.17
其中：交易所市场	10,025.17
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	77,077.00
应付指数使用费	72,275.82
合计	159,377.99

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	42,005,740.00	42,005,740.00
本期申购	12,000,000.00	12,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-16,000,000.00	-16,000,000.00
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	38,005,740.00	38,005,740.00

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	27,679,304.86	-15,678,982.46	12,000,322.40
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	27,679,304.86	-15,678,982.46	12,000,322.40

本期利润	-4,264,269.56	5,227,935.51	963,665.95
本期基金份额交易产生的变动数	-2,160,777.28	351,923.55	-1,808,853.73
其中：基金申购款	7,494,584.31	-4,065,833.86	3,428,750.45
基金赎回款	-9,655,361.59	4,417,757.41	-5,237,604.18
本期已分配利润	-	-	-
本期末	21,254,258.02	-10,099,123.40	11,155,134.62

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
活期存款利息收入		3,960.20
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		180.84
其他		34.44
合计		4,175.48

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	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
股票投资收益——买卖股票差价收入		-3,826,687.37
股票投资收益——赎回差价收入		-775,425.33
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		-4,602,112.70

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	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
卖出股票成交总额		12,412,535.18
减：卖出股票成本总额		16,209,897.39
减：交易费用		29,325.16
买卖股票差价收入		-3,826,687.37

6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
赎回基金份额对价总额		21,237,604.18

减：现金支付赎回款总额	7,731,422.18
减：赎回股票成本总额	14,281,607.33
减：交易费用	-
赎回差价收入	-775,425.33

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

无。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

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
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	613,594.19
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	613,594.19

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	5,227,935.51
股票投资	5,227,935.51
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	5,227,935.51

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 2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	34,220.29
合计	34,220.29

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申赎本基金时，补入（卖出）被替代成分券的实际买入（卖出）成本与申赎确认日估值的差额，或强制退款的被替代成分券在强制退款计算日与申赎确认日估值的差额。

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 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	17,404.66
信息披露费	59,672.34

证券出借违约金	-
银行划款手续费	847.49
指数使用费	72,275.82
其他	360.00
合计	150,560.31

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、申购赎回代理券商、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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

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 2024年1月1日至2024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	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 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	-	-

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 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	136,322.09
其中：应支付销售机构的客户维护费	32,702.55	-
应支付基金管理人的净管理费	103,619.54	180,503.40

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：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.50% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
	当期发生的基金应支付的托管费	27,264.42

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：

日托管费 = 前一日基金资产净值 \times 0.10% / 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未与关联方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未与关联方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自有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人于本报告期及上年度可比期间未运用自有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	1,303,583.25	3,960.20	1,345,533.82	3,962.58

注：本基金的活期银行存款由基金托管人保管，并按银行间同业利率计息。

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2024年6月30日，本基金持有5,500股长城证券的A股普通股，成本总额为人民币50,775.45元，估值总额为人民币36,850.00元，占基金净资产的比例为0.07%；本基金持有114,400股中国农业银行的A股普通股，成本总额为人民币392,037.86元，估值总额为人民币

498,784.00 元，占基金资产净值的比例为 1.01%(于 2023 年 12 月 31 日，本基金持有 5,900 股长城证券的 A 股普通股，成本总额为人民币 58,393.81 元，估值总额为人民币 47,200.00 元，占基金净资产的比例为 0.09%；本基金持有 123,600 股中国农业银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 389,176.68 元，估值总额为人民币 449,904.00 元，占基金资产净值的比例为 0.83%)。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配。

6.4.12 期末（2024 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

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金于本报告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

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，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

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金无因从事证券交易所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的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

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

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金管理人通过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，并按照合约规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 2024年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	1,303,583.25	-	-	-	-	-	1,303,583.25
结算备付金	36,361.17	-	-	-	-	-	36,361.17
存出保证金	6,022.22	-	-	-	-	-	6,022.22
交易性金融资产	-	-	-	-	-	48,099,129.99	48,099,129.99
应收清算款	-	-	-	-	-	23,750.77	23,750.77
资产总计	1,345,966.64	-	-	-	-	48,122,880.76	49,468,847.40
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	20,460.44	20,460.44
应付托管费	-	-	-	-	-	4,092.07	4,092.07
应付清算款	-	-	-	-	-	124,042.28	124,042.28
其他负债	-	-	-	-	-	159,377.99	159,377.99
负债总计	-	-	-	-	-	307,972.78	307,972.78
利率敏感度缺口	1,345,966.64	-	-	-	-	-	-
上年度末 2023年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	995,796.62	-	-	-	-	-	995,796.62
结算备付金	9,478.25	-	-	-	-	-	9,478.25
存出保证金	3,126.07	-	-	-	-	-	3,126.07
交易性金融资产	-	-	-	-	-	53,225,268.41	53,225,268.41
资产总计	1,008,400.94	-	-	-	-	53,225,268.41	54,233,669.35
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	23,641.45	23,641.45
应付托管费	-	-	-	-	-	4,728.29	4,728.29
其他负债	-	-	-	-	-	199,237.21	199,237.21
负债总计	-	-	-	-	-	227,606.95	227,606.95
利率敏感度缺口	1,008,400.94	-	-	-	-	-	-

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 2024年6月30日		上年度末 2023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	48,099,129.99	97.84	53,225,268.41	98.55
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	48,099,129.99	97.84	53,225,268.41	98.55

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 (2024 年 6 月 30 日)	上年度末 (2023 年 12 月 31 日)
	沪深 300 指数上升 5%	2,522,033.70	2,550,718.12
	沪深 300 指数下降 5%	-2,522,033.70	-2,550,718.12

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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	48,099,129.99	53,225,268.41
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	48,099,129.99	53,225,268.41

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃、非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

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	48,099,129.99	97.23
	其中：股票	48,099,129.99	97.23
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	1,339,944.42	2.71
8	其他各项资产	29,772.99	0.06
9	合计	49,468,847.40	100.00

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	530,766.00	1.08
B	采矿业	3,206,458.60	6.52
C	制造业	25,598,802.08	52.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,547,737.98	5.18
E	建筑业	1,017,257.20	2.07
F	批发和零售业	327,468.18	0.67
G	交通运输、仓储和邮政业	2,037,368.97	4.14
H	住宿和餐饮业	29,874.00	0.06
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,693,995.93	3.45
J	金融业	9,690,789.10	19.71
K	房地产业	456,180.05	0.93
L	租赁和商务服务业	371,833.30	0.76
M	科学研究和技术服务业	201,133.60	0.41
N	水利、环境和公共设施管理业	47,334.00	0.10
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	148,755.40	0.30
R	文化、体育和娱乐业	164,511.60	0.33
S	综合	28,864.00	0.06
	合计	48,099,129.99	97.84

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	1,687	2,475,486.93	5.04
2	300750	宁德时代	5,907	1,063,437.21	2.16
3	600900	长江电力	32,912	951,815.04	1.94
4	600036	招商银行	27,778	949,729.82	1.93
5	000858	五粮液	5,172	662,222.88	1.35
6	002594	比亚迪	2,420	605,605.00	1.23
7	601318	中国平安	14,537	601,250.32	1.22
8	601288	农业银行	114,400	498,784.00	1.01
9	601166	兴业银行	28,000	493,360.00	1.00
10	601138	工业富联	17,857	489,281.80	1.00
11	601899	紫金矿业	27,700	486,689.00	0.99
12	601398	工商银行	84,600	482,220.00	0.98
13	300760	迈瑞医疗	1,600	465,456.00	0.95
14	601088	中国神华	8,930	396,224.10	0.81
15	601328	交通银行	52,800	394,416.00	0.80
16	002475	立讯精密	9,680	380,520.80	0.77
17	601816	京沪高铁	66,000	354,420.00	0.72
18	601225	陕西煤业	13,100	337,587.00	0.69
19	600309	万华化学	4,165	336,781.90	0.69
20	600276	恒瑞医药	8,634	332,063.64	0.68
21	600000	浦发银行	39,500	325,085.00	0.66
22	600809	山西汾酒	1,541	324,966.08	0.66
23	002714	牧原股份	7,422	323,599.20	0.66
24	600030	中信证券	16,550	301,706.50	0.61
25	601857	中国石油	29,049	299,785.68	0.61
26	601668	中国建筑	55,960	297,147.60	0.60
27	000333	美的集团	4,600	296,700.00	0.60
28	000568	泸州老窖	1,935	277,653.15	0.56
29	600028	中国石化	43,600	275,552.00	0.56
30	600406	国电南瑞	10,857	270,990.72	0.55
31	601985	中国核电	25,400	270,764.00	0.55
32	601919	中远海控	17,143	265,545.07	0.54
33	000001	平安银行	26,100	264,915.00	0.54
34	601601	中国太保	9,200	256,312.00	0.52
35	600150	中国船舶	6,100	248,331.00	0.51
36	601766	中国中车	32,700	245,577.00	0.50

37	600690	海尔智家	8,534	242,194.92	0.49
38	002352	顺丰控股	6,650	237,338.50	0.48
39	300059	东方财富	21,253	224,431.68	0.46
40	002371	北方华创	700	223,923.00	0.46
41	600887	伊利股份	8,600	222,224.00	0.45
42	601988	中国银行	47,200	218,064.00	0.44
43	603288	海天味业	6,263	215,885.61	0.44
44	300308	中际旭创	1,500	206,820.00	0.42
45	688041	海光信息	2,937	206,529.84	0.42
46	000725	京东方 A	49,700	203,273.00	0.41
47	603993	洛阳钼业	23,800	202,300.00	0.41
48	600050	中国联通	42,800	201,160.00	0.41
49	601658	邮储银行	39,100	198,237.00	0.40
50	600019	宝钢股份	29,756	197,877.40	0.40
51	601818	光大银行	62,400	197,808.00	0.40
52	002142	宁波银行	8,966	197,789.96	0.40
53	600031	三一重工	11,400	188,100.00	0.38
54	600886	国投电力	10,100	184,224.00	0.37
55	600919	江苏银行	24,680	183,372.40	0.37
56	601127	赛力斯	2,000	182,240.00	0.37
57	600016	民生银行	47,660	180,631.40	0.37
58	601390	中国中铁	27,600	179,952.00	0.37
59	300498	温氏股份	8,940	177,190.80	0.36
60	600989	宝丰能源	9,900	171,567.00	0.35
61	300274	阳光电源	2,760	171,202.80	0.35
62	601006	大秦铁路	23,600	168,976.00	0.34
63	600905	三峡能源	38,500	167,860.00	0.34
64	600436	片仔癀	804	166,564.68	0.34
65	601169	北京银行	28,500	166,440.00	0.34
66	002304	洋河股份	2,013	162,529.62	0.33
67	601888	中国中免	2,600	162,474.00	0.33
68	000063	中兴通讯	5,500	153,835.00	0.31
69	603501	韦尔股份	1,535	152,532.95	0.31
70	000625	长安汽车	11,145	149,677.35	0.30
71	000338	潍柴动力	9,200	149,408.00	0.30
72	000651	格力电器	3,800	149,036.00	0.30
73	601009	南京银行	13,966	145,106.74	0.30
74	600104	上汽集团	10,395	144,074.70	0.29
75	600795	国电电力	24,000	143,760.00	0.29
76	601012	隆基绿能	10,239	143,550.78	0.29
77	600048	保利发展	16,100	141,036.00	0.29
78	600999	招商证券	10,020	139,378.20	0.28
79	601229	上海银行	19,104	138,695.04	0.28

80	002230	科大讯飞	3,200	137,440.00	0.28
81	601211	国泰君安	10,128	137,234.40	0.28
82	601600	中国铝业	17,800	135,814.00	0.28
83	603259	药明康德	3,440	134,813.60	0.27
84	600547	山东黄金	4,904	134,271.52	0.27
85	600346	恒力石化	9,540	133,083.00	0.27
86	002493	荣盛石化	13,650	131,859.00	0.27
87	600893	航发动力	3,582	130,922.10	0.27
88	000166	申万宏源	30,300	130,593.00	0.27
89	300015	爱尔眼科	12,570	129,722.40	0.26
90	601669	中国电建	23,200	129,688.00	0.26
91	600660	福耀玻璃	2,700	129,330.00	0.26
92	600585	海螺水泥	5,449	128,541.91	0.26
93	688111	金山办公	565	128,537.50	0.26
94	000792	盐湖股份	7,300	127,385.00	0.26
95	002938	鹏鼎控股	3,200	127,232.00	0.26
96	000538	云南白药	2,420	123,783.00	0.25
97	600674	川投能源	6,600	123,750.00	0.25
98	601688	华泰证券	9,909	122,772.51	0.25
99	300433	蓝思科技	6,700	122,275.00	0.25
100	600011	华能国际	12,387	119,162.94	0.24
101	600188	兖矿能源	5,200	118,196.00	0.24
102	002027	分众传媒	19,460	117,927.60	0.24
103	601628	中国人寿	3,750	116,437.50	0.24
104	600438	通威股份	6,068	115,959.48	0.24
105	601111	中国国航	15,700	115,866.00	0.24
106	688036	传音控股	1,510	115,575.40	0.24
107	600015	华夏银行	17,818	114,035.20	0.23
108	000425	徐工机械	15,900	113,685.00	0.23
109	601066	中信建投	5,900	113,516.00	0.23
110	000895	双汇发展	4,700	111,719.00	0.23
111	600837	海通证券	13,024	111,485.44	0.23
112	300014	亿纬锂能	2,785	111,177.20	0.23
113	688012	中微公司	785	110,889.10	0.23
114	000100	TCL 科技	25,230	108,993.60	0.22
115	002311	海大集团	2,300	108,215.00	0.22
116	600023	浙能电力	15,100	107,361.00	0.22
117	001979	招商蛇口	12,200	107,238.00	0.22
118	601881	中国银河	9,800	106,428.00	0.22
119	000596	古井贡酒	500	105,535.00	0.21
120	600926	杭州银行	8,000	104,400.00	0.21
121	688271	联影医疗	912	100,046.40	0.20
122	003816	中国广核	21,200	98,156.00	0.20

123	601995	中金公司	3,300	97,713.00	0.20
124	600489	中金黄金	6,600	97,680.00	0.20
125	000776	广发证券	8,000	97,360.00	0.20
126	601939	建设银行	12,900	95,460.00	0.19
127	600089	特变电工	6,867	95,245.29	0.19
128	300502	新易盛	900	94,995.00	0.19
129	002463	沪电股份	2,600	94,900.00	0.19
130	600845	宝信软件	2,954	94,321.22	0.19
131	300124	汇川技术	1,837	94,238.10	0.19
132	601872	招商轮船	11,000	92,950.00	0.19
133	601868	中国能建	43,600	92,432.00	0.19
134	603392	万泰生物	1,402	92,363.76	0.19
135	600115	中国东航	23,000	92,230.00	0.19
136	688256	寒武纪	463	91,984.21	0.19
137	300122	智飞生物	3,250	91,097.50	0.19
138	000002	万 科 A	13,085	90,679.05	0.18
139	002241	歌尔股份	4,600	89,746.00	0.18
140	600160	巨化股份	3,700	89,281.00	0.18
141	600029	南方航空	15,100	88,939.00	0.18
142	601825	沪农商行	13,000	87,360.00	0.18
143	601100	恒立液压	1,864	86,825.12	0.18
144	000938	紫光股份	3,879	86,695.65	0.18
145	605499	东鹏饮料	400	86,300.00	0.18
146	601633	长城汽车	3,400	86,020.00	0.17
147	601901	方正证券	11,100	85,803.00	0.17
148	601689	拓普集团	1,600	85,776.00	0.17
149	600010	包钢股份	61,000	85,400.00	0.17
150	601336	新华保险	2,819	84,654.57	0.17
151	600111	北方稀土	4,903	84,331.60	0.17
152	603986	兆易创新	880	84,145.60	0.17
153	002648	卫星化学	4,593	82,582.14	0.17
154	688008	澜起科技	1,412	80,709.92	0.16
155	002001	新 和 成	4,188	80,409.60	0.16
156	688223	晶科能源	11,323	80,393.30	0.16
157	601916	浙商银行	29,029	80,120.04	0.16
158	600027	华电国际	11,500	79,810.00	0.16
159	600703	三安光电	6,800	79,696.00	0.16
160	000983	山西焦煤	7,690	79,283.90	0.16
161	600584	长电科技	2,500	79,275.00	0.16
162	601838	成都银行	5,200	78,988.00	0.16
163	603369	今世缘	1,700	78,540.00	0.16
164	600426	华鲁恒升	2,940	78,321.60	0.16
165	601788	光大证券	5,327	77,880.74	0.16

166	600039	四川路桥	9,840	77,637.60	0.16
167	000999	华润三九	1,820	77,495.60	0.16
168	600066	宇通客车	3,000	77,400.00	0.16
169	600958	东方证券	10,112	76,851.20	0.16
170	300408	三环集团	2,600	75,894.00	0.15
171	002736	国信证券	8,700	75,603.00	0.15
172	000977	浪潮信息	2,056	74,776.72	0.15
173	601618	中国中冶	24,000	74,400.00	0.15
174	601699	潞安环能	4,100	74,333.00	0.15
175	601360	三六零	9,611	73,812.48	0.15
176	000157	中联重科	9,600	73,728.00	0.15
177	600233	圆通速递	4,700	73,555.00	0.15
178	001965	招商公路	6,200	73,532.00	0.15
179	600026	中远海能	4,700	73,367.00	0.15
180	601021	春秋航空	1,300	73,229.00	0.15
181	600522	中天科技	4,600	72,910.00	0.15
182	600803	新奥股份	3,500	72,800.00	0.15
183	601607	上海医药	3,800	72,618.00	0.15
184	600085	同仁堂	1,900	72,599.00	0.15
185	300033	同花顺	700	72,590.00	0.15
186	002916	深南电路	680	71,923.60	0.15
187	000301	东方盛虹	8,900	70,933.00	0.14
188	600741	华域汽车	4,300	70,434.00	0.14
189	002252	上海莱士	9,000	70,380.00	0.14
190	600875	东方电气	3,800	70,110.00	0.14
191	002236	大华股份	4,500	69,570.00	0.14
192	601117	中国化学	8,300	68,392.00	0.14
193	000786	北新建材	2,300	68,218.00	0.14
194	002600	领益智造	9,500	67,640.00	0.14
195	300832	新产业	1,000	67,440.00	0.14
196	600183	生益科技	3,200	67,392.00	0.14
197	000963	华东医药	2,417	67,216.77	0.14
198	002028	思源电气	1,000	66,900.00	0.14
199	002422	科伦药业	2,200	66,726.00	0.14
200	601567	三星医疗	1,900	66,500.00	0.14
201	600362	江西铜业	2,800	66,304.00	0.13
202	601319	中国人保	12,800	65,920.00	0.13
203	002128	电投能源	3,100	65,410.00	0.13
204	600161	天坛生物	2,660	64,904.00	0.13
205	300628	亿联网络	1,764	64,862.28	0.13
206	002460	赣锋锂业	2,250	64,462.50	0.13
207	600196	复星医药	2,908	64,383.12	0.13
208	600600	青岛啤酒	882	64,183.14	0.13

209	603195	公牛集团	825	63,624.00	0.13
210	000807	云铝股份	4,700	63,497.00	0.13
211	601727	上海电气	17,100	63,270.00	0.13
212	601058	赛轮轮胎	4,500	63,000.00	0.13
213	000617	中油资本	11,400	62,928.00	0.13
214	000933	神火股份	3,100	62,713.00	0.13
215	000708	中信特钢	4,600	62,422.00	0.13
216	688396	华润微	1,663	62,262.72	0.13
217	600985	淮北矿业	3,700	61,938.00	0.13
218	300394	天孚通信	700	61,894.00	0.13
219	000630	铜陵有色	17,100	61,731.00	0.13
220	002601	龙佰集团	3,300	61,281.00	0.12
221	000975	山金国际	3,760	61,250.40	0.12
222	002049	紫光国微	1,160	61,016.00	0.12
223	002920	德赛西威	700	60,963.00	0.12
224	600733	北汽蓝谷	7,500	60,600.00	0.12
225	600176	中国巨石	5,473	60,476.65	0.12
226	600219	南山铝业	15,800	60,198.00	0.12
227	300999	金龙鱼	2,200	60,170.00	0.12
228	600398	海澜之家	6,500	60,060.00	0.12
229	002466	天齐锂业	2,000	59,820.00	0.12
230	601077	渝农商行	11,900	59,738.00	0.12
231	600256	广汇能源	8,900	59,630.00	0.12
232	600221	海航控股	58,100	59,262.00	0.12
233	601168	西部矿业	3,300	59,235.00	0.12
234	601377	兴业证券	11,650	58,949.00	0.12
235	688009	中国通号	9,732	58,392.00	0.12
236	600642	申能股份	6,600	58,278.00	0.12
237	601878	浙商证券	5,300	56,816.00	0.12
238	000876	新希望	6,201	56,677.14	0.12
239	600332	白云山	1,926	56,489.58	0.11
240	601179	中国西电	6,900	55,476.00	0.11
241	601877	正泰电器	2,900	55,274.00	0.11
242	300896	爱美客	320	55,072.00	0.11
243	600415	小商品城	7,400	54,908.00	0.11
244	600009	上海机场	1,700	54,825.00	0.11
245	300418	昆仑万维	1,700	54,808.00	0.11
246	600018	上港集团	9,400	54,332.00	0.11
247	300413	芒果超媒	2,590	54,131.00	0.11
248	605117	德业股份	728	54,119.52	0.11
249	600487	亨通光电	3,400	53,618.00	0.11
250	688126	沪硅产业	3,875	53,513.75	0.11
251	600918	中泰证券	9,400	53,298.00	0.11

252	002078	太阳纸业	3,800	53,010.00	0.11
253	000408	藏格矿业	2,200	52,954.00	0.11
254	300782	卓胜微	680	52,863.20	0.11
255	002180	纳思达	2,000	52,840.00	0.11
256	601233	桐昆股份	3,300	52,668.00	0.11
257	002223	鱼跃医疗	1,400	52,640.00	0.11
258	688599	天合光能	3,097	52,401.24	0.11
259	688303	大全能源	2,566	52,320.74	0.11
260	601865	福莱特	2,600	52,260.00	0.11
261	603799	华友钴业	2,353	52,071.89	0.11
262	601238	广汽集团	6,700	51,858.00	0.11
263	300316	晶盛机电	1,800	51,714.00	0.11
264	603806	福斯特	3,510	51,597.00	0.10
265	603260	合盛硅业	1,100	51,381.00	0.10
266	002532	天山铝业	6,300	51,093.00	0.10
267	002625	光启技术	2,900	50,315.00	0.10
268	601991	大唐发电	16,700	50,267.00	0.10
269	002459	晶澳科技	4,488	50,265.60	0.10
270	000423	东阿阿胶	800	50,080.00	0.10
271	002050	三花智控	2,600	49,608.00	0.10
272	300765	新诺威	1,960	49,450.80	0.10
273	600061	国投资本	8,700	49,155.00	0.10
274	002353	杰瑞股份	1,400	49,112.00	0.10
275	603606	东方电缆	1,000	48,810.00	0.10
276	600096	云天化	2,500	48,550.00	0.10
277	300866	安克创新	680	48,422.80	0.10
278	600515	海南机场	15,400	48,356.00	0.10
279	600348	华阳股份	4,850	48,306.00	0.10
280	002064	华峰化学	6,700	48,039.00	0.10
281	600745	闻泰科技	1,700	48,025.00	0.10
282	300661	圣邦股份	580	48,012.40	0.10
283	300442	润泽科技	2,000	47,900.00	0.10
284	688188	柏楚电子	258	47,613.90	0.10
285	002384	东山精密	2,300	47,610.00	0.10
286	301236	软通动力	1,350	47,533.50	0.10
287	600418	江淮汽车	3,000	47,520.00	0.10
288	002129	TCL 中环	5,475	47,358.75	0.10
289	603568	伟明环保	2,300	47,334.00	0.10
290	002156	通富微电	2,100	47,019.00	0.10
291	000027	深圳能源	6,420	46,866.00	0.10
292	600570	恒生电子	2,643	46,675.38	0.09
293	600588	用友网络	4,622	46,220.00	0.09
294	002709	天赐材料	2,620	46,007.20	0.09

295	603198	迎驾贡酒	800	46,000.00	0.09
296	002074	国轩高科	2,400	45,960.00	0.09
297	000661	长春高新	500	45,885.00	0.09
298	601958	金钼股份	4,400	45,804.00	0.09
299	603979	金诚信	900	45,477.00	0.09
300	601577	长沙银行	5,500	44,990.00	0.09
301	600177	雅戈尔	6,300	44,856.00	0.09
302	600060	海信视像	1,800	44,532.00	0.09
303	002812	恩捷股份	1,400	44,310.00	0.09
304	002340	格林美	6,900	43,953.00	0.09
305	600970	中材国际	3,600	43,416.00	0.09
306	688072	拓荆科技	351	42,158.61	0.09
307	002294	信立泰	1,580	42,075.40	0.09
308	601216	君正集团	11,400	42,066.00	0.09
309	002444	巨星科技	1,700	41,990.00	0.09
310	002595	豪迈科技	1,100	41,987.00	0.09
311	000921	海信家电	1,300	41,912.00	0.09
312	000988	华工科技	1,400	41,902.00	0.09
313	601108	财通证券	6,260	41,378.60	0.08
314	600282	南钢股份	8,300	41,334.00	0.08
315	603160	汇顶科技	600	41,250.00	0.08
316	600566	济川药业	1,300	41,223.00	0.08
317	000932	华菱钢铁	9,300	41,199.00	0.08
318	600038	中直股份	1,000	41,110.00	0.08
319	002281	光迅科技	1,100	41,107.00	0.08
320	300751	迈为股份	344	41,101.12	0.08
321	603659	璞泰来	2,906	41,061.78	0.08
322	300919	中伟股份	1,320	40,906.80	0.08
323	688187	时代电气	824	40,689.12	0.08
324	603939	益丰药房	1,657	40,679.35	0.08
325	603899	晨光股份	1,300	40,664.00	0.08
326	600460	士兰微	2,300	40,273.00	0.08
327	601231	环旭电子	2,500	40,125.00	0.08
328	002032	苏泊尔	800	40,080.00	0.08
328	600873	梅花生物	4,000	40,080.00	0.08
329	601555	东吴证券	6,759	39,878.10	0.08
330	603338	浙江鼎力	660	39,877.20	0.08
331	688777	中控技术	1,057	39,848.90	0.08
332	600546	山煤国际	2,700	39,474.00	0.08
333	300207	欣旺达	2,600	39,442.00	0.08
334	002007	华兰生物	2,490	39,317.10	0.08
335	002555	三七互娱	3,000	39,150.00	0.08
336	600895	张江高科	2,100	38,808.00	0.08

337	300003	乐普医疗	2,600	38,584.00	0.08
337	600582	天地科技	5,600	38,584.00	0.08
338	000066	中国长城	4,400	38,500.00	0.08
339	601990	南京证券	5,000	38,400.00	0.08
340	002085	万丰奥威	2,900	38,396.00	0.08
341	601928	凤凰传媒	3,500	38,360.00	0.08
342	603156	养元饮品	1,800	38,286.00	0.08
343	601666	平煤股份	3,400	38,080.00	0.08
344	000831	中国稀土	1,500	38,025.00	0.08
345	688120	华海清科	200	37,916.00	0.08
346	600968	海油发展	9,200	37,904.00	0.08
347	601966	玲珑轮胎	2,060	37,842.20	0.08
348	600352	浙江龙盛	4,400	37,796.00	0.08
349	600079	人福医药	2,200	37,774.00	0.08
350	600109	国金证券	5,000	37,750.00	0.08
351	002409	雅克科技	600	37,746.00	0.08
352	603486	科沃斯	800	37,744.00	0.08
353	600021	上海电力	3,800	37,582.00	0.08
353	600988	赤峰黄金	2,300	37,582.00	0.08
354	002966	苏州银行	5,000	37,500.00	0.08
355	002673	西部证券	6,042	37,399.98	0.08
356	300759	康龙化成	2,000	37,160.00	0.08
357	603658	安图生物	800	36,856.00	0.07
358	002939	长城证券	5,500	36,850.00	0.07
359	600497	驰宏锌锗	6,900	36,846.00	0.07
360	603833	欧派家居	687	36,795.72	0.07
361	600153	建发股份	4,090	36,523.70	0.07
362	600132	重庆啤酒	600	36,420.00	0.07
363	002739	万达电影	3,000	36,270.00	0.07
364	000783	长江证券	7,500	36,225.00	0.07
365	603816	顾家家居	1,120	36,164.80	0.07
366	000738	航发控制	1,800	36,126.00	0.07
367	000728	国元证券	5,960	36,117.60	0.07
368	600536	中国软件	1,200	35,904.00	0.07
369	002185	华天科技	4,400	35,860.00	0.07
370	000960	锡业股份	2,300	35,627.00	0.07
371	688728	格科微	2,939	35,591.29	0.07
372	002152	广电运通	3,400	35,564.00	0.07
373	000703	恒逸石化	5,010	35,520.90	0.07
374	600583	海油工程	6,000	35,460.00	0.07
375	600157	永泰能源	29,900	35,282.00	0.07
376	603589	口子窖	900	35,271.00	0.07
377	000683	远兴能源	5,100	35,241.00	0.07

378	002465	海格通信	3,400	35,224.00	0.07
379	601198	东兴证券	4,400	35,024.00	0.07
380	002603	以岭药业	2,280	34,952.40	0.07
381	601696	中银证券	3,800	34,504.00	0.07
382	600549	厦门钨业	2,000	34,500.00	0.07
383	002602	世纪华通	10,020	34,368.60	0.07
384	002456	欧菲光	4,400	34,364.00	0.07
385	601866	中远海发	13,300	34,314.00	0.07
386	600521	华海药业	2,010	34,270.50	0.07
387	603596	伯特利	880	34,232.00	0.07
388	002414	高德红外	5,761	33,932.29	0.07
389	002372	伟星新材	2,200	33,924.00	0.07
390	600511	国药股份	1,100	33,869.00	0.07
391	300251	光线传媒	4,000	33,640.00	0.07
392	601799	星宇股份	300	33,612.00	0.07
393	000729	燕京啤酒	3,800	33,554.00	0.07
394	600298	安琪酵母	1,200	33,516.00	0.07
395	000513	丽珠集团	900	33,489.00	0.07
396	002831	裕同科技	1,300	33,267.00	0.07
397	300223	北京君正	600	33,264.00	0.07
398	002262	恩华药业	1,400	33,236.00	0.07
399	000733	振华科技	800	33,224.00	0.07
400	600998	九州通	6,792	33,144.96	0.07
401	688065	凯赛生物	729	33,089.31	0.07
402	603885	吉祥航空	3,000	32,970.00	0.07
403	000800	一汽解放	4,200	32,886.00	0.07
404	603529	爱玛科技	1,200	32,796.00	0.07
405	688363	华熙生物	570	32,244.90	0.07
406	600369	西南证券	9,000	32,220.00	0.07
407	000937	冀中能源	4,800	32,160.00	0.07
408	300496	中科创达	700	31,913.00	0.06
409	601456	国联证券	3,300	31,812.00	0.06
410	600378	昊华科技	1,100	31,790.00	0.06
411	002202	金风科技	4,684	31,476.48	0.06
412	300037	新宙邦	1,100	31,416.00	0.06
413	300487	蓝晓科技	750	31,320.00	0.06
414	000629	钒钛股份	12,500	31,250.00	0.06
415	300146	汤臣倍健	2,300	31,165.00	0.06
416	002430	杭氧股份	1,400	31,150.00	0.06
417	601880	辽港股份	25,300	31,119.00	0.06
418	688538	和辉光电	15,706	31,097.88	0.06
419	301269	华大九天	400	30,820.00	0.06
420	002841	视源股份	1,034	30,534.02	0.06

421	600704	物产中大	7,000	30,380.00	0.06
422	600004	白云机场	3,200	30,336.00	0.06
423	300454	深信服	600	30,318.00	0.06
424	002120	韵达股份	3,910	30,263.40	0.06
425	000009	中国宝安	3,500	30,100.00	0.06
426	600848	上海临港	3,300	30,063.00	0.06
427	603000	人民网	1,500	29,985.00	0.06
428	600598	北大荒	2,400	29,976.00	0.06
429	600754	锦江酒店	1,300	29,874.00	0.06
430	002080	中材科技	2,300	29,670.00	0.06
431	603893	瑞芯微	500	29,585.00	0.06
432	600486	扬农化工	520	29,354.00	0.06
433	300699	光威复材	1,180	29,299.40	0.06
434	300347	泰格医药	600	29,160.00	0.06
435	600380	健康元	2,600	29,042.00	0.06
436	002797	第一创业	5,700	29,013.00	0.06
437	300957	贝泰妮	600	28,992.00	0.06
438	002756	永兴材料	810	28,981.80	0.06
439	002821	凯莱英	440	28,952.00	0.06
440	600673	东阳光	4,100	28,864.00	0.06
441	002508	老板电器	1,300	28,730.00	0.06
442	600072	中船科技	2,100	28,392.00	0.06
443	600839	四川长虹	6,300	28,287.00	0.06
444	300144	宋城演艺	3,520	28,265.60	0.06
445	600699	均胜电子	1,900	28,158.00	0.06
446	000723	美锦能源	5,900	28,084.00	0.06
447	600977	中国电影	2,600	27,976.00	0.06
448	600637	东方明珠	4,600	27,968.00	0.06
449	000987	越秀资本	5,621	27,880.16	0.06
450	002517	恺英网络	2,900	27,695.00	0.06
451	688122	西部超导	719	27,552.08	0.06
452	002056	横店东磁	2,200	27,434.00	0.06
453	002738	中矿资源	1,020	27,336.00	0.06
454	600655	豫园股份	5,300	27,295.00	0.06
455	000709	河钢股份	13,900	26,966.00	0.05
456	600705	中航产融	11,900	26,418.00	0.05
457	600779	水井坊	700	26,341.00	0.05
458	600872	中炬高新	1,149	26,070.81	0.05
459	000825	太钢不锈	7,700	26,026.00	0.05
460	600170	上海建工	12,000	25,800.00	0.05
461	601162	天风证券	11,700	25,506.00	0.05
462	600884	杉杉股份	3,100	25,172.00	0.05
463	300142	沃森生物	2,203	25,070.14	0.05

464	300601	康泰生物	1,560	24,351.60	0.05
465	600166	福田汽车	10,800	24,300.00	0.05
466	603728	鸣志电器	600	24,138.00	0.05
467	603290	斯达半导	280	24,110.80	0.05
468	002850	科达利	300	22,914.00	0.05
469	300763	锦浪科技	550	22,902.00	0.05
470	688099	晶晨股份	386	22,897.52	0.05
471	600563	法拉电子	300	22,854.00	0.05
472	600702	舍得酒业	400	22,668.00	0.05
473	600732	爱旭股份	2,500	22,625.00	0.05
474	603345	安井食品	300	22,293.00	0.05
475	603233	大参林	1,557	22,265.10	0.05
476	688082	盛美上海	263	22,226.13	0.05
477	603688	石英股份	750	22,207.50	0.05
478	688114	华大智造	465	22,045.65	0.04
479	002271	东方雨虹	1,700	20,978.00	0.04
480	603077	和邦生物	11,900	19,635.00	0.04
481	603882	金域医学	700	19,033.00	0.04

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	000333	美的集团	420,392.00	0.78
2	300750	宁德时代	335,065.00	0.62
3	600519	贵州茅台	313,199.00	0.58
4	000858	五粮液	280,071.00	0.52
5	300760	迈瑞医疗	208,142.00	0.39
6	300308	中际旭创	153,710.00	0.28
7	002594	比亚迪	141,588.00	0.26
8	000568	泸州老窖	115,885.00	0.21
9	002352	顺丰控股	109,216.00	0.20
10	002714	牧原股份	107,134.00	0.20
11	300059	东方财富	95,533.00	0.18
12	002475	立讯精密	95,486.00	0.18
13	000001	平安银行	95,050.00	0.18
14	001965	招商公路	80,380.00	0.15
15	002230	科大讯飞	78,502.00	0.15
16	688041	海光信息	77,221.30	0.14
17	300832	新产业	76,973.00	0.14

18	002142	宁波银行	74,898.00	0.14
19	000708	中信特钢	68,950.00	0.13
20	600436	片仔癀	68,015.00	0.13

注：买入金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	435,197.00	0.81
2	000858	五粮液	350,863.00	0.65
3	300760	迈瑞医疗	240,414.00	0.45
4	002594	比亚迪	182,994.00	0.34
5	300308	中际旭创	166,341.00	0.31
6	600519	贵州茅台	164,416.00	0.30
7	000568	泸州老窖	155,396.00	0.29
8	002714	牧原股份	141,895.00	0.26
9	000333	美的集团	133,408.00	0.25
10	002352	顺丰控股	127,834.00	0.24
11	000001	平安银行	121,394.00	0.22
12	300059	东方财富	118,747.00	0.22
13	002475	立讯精密	116,365.00	0.22
14	002142	宁波银行	94,578.00	0.18
15	300832	新产业	90,532.00	0.17
16	000725	京东方 A	88,639.00	0.16
17	002230	科大讯飞	87,689.00	0.16
18	300498	温氏股份	83,411.00	0.15
19	300274	阳光电源	81,905.00	0.15
20	688169	石头科技	81,006.00	0.15

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	10,474,344.79
卖出股票收入（成交）总额	12,412,535.18

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国家金融监督管理总局地方分局的处罚。

中国农业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。

本基金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	6,022.22
2	应收清算款	23,750.77

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	29,772.99

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 户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		-	
		持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总份 额比例 (%)
974	39,020.27	3,955,693.00	10.41	34,050,047.00	89.59	-	-

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	6.76
2	于凌	2,305,500	6.07
3	张红	1,790,400	4.71
4	林李丽琴	1,600,000	4.21
5	广发证券股份有限公司	1,397,662	3.68
6	中信证券股份有限公司	1,290,370	3.40

7	郑时昭	650,000	1.71
8	中信建投证券股份有限公司	640,300	1.68
9	方正证券股份有限公司	606,700	1.60
10	黄敏琪	500,000	1.32

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	42,005,740.00
本报告期基金总申购份额	12,000,000.00
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	38,005,740.00

§ 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	12,195,946.48	53.29	11,536.22	53.28	未变更
长江证券股份有限公司	2	4,638,718.68	20.27	4,388.02	20.27	未变更
光大证券股份有限公司	2	2,193,672.21	9.58	2,075.75	9.59	未变更
川财证券有限责任公司	1	1,610,110.74	7.04	1,523.22	7.04	未变更
西南证券股份有限公司	1	1,393,915.53	6.09	1,318.60	6.09	未变更
方正证券股份有限公司	2	779,982.83	3.41	737.99	3.41	未变更
东北证券股份有限公司	2	74,533.50	0.33	70.48	0.33	未变更
长城证券	1	-	-	-	-	未变

股份有限 公司							更
诚通证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-	未变 更
东方证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-	未变 更
东兴证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-	未变 更
广发证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-	未变 更
国金证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-	未变 更
国盛证券 有限责任 公司	1	-	-	-	-	-	未变 更
国泰君安 证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-	未变 更
国投证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-	未变 更
国信证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-	未变 更
海通证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-	未变 更
恒泰证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-	未变 更
华创证券 有限责任 公司	1	-	-	-	-	-	未变 更
华福证券 有限责任 公司	1	-	-	-	-	-	未变 更
华泰证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-	未变 更

民生证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
平安证券股份有限公司	2	-	-	-	-	未变更
瑞银证券有限责任公司	1	-	-	-	-	未变更
申万宏源证券有限公司	1	-	-	-	-	未变更
天风证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
兴业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
招商证券股份有限公司	2	-	-	-	-	未变更
中国银河证券股份有限公司	2	-	-	-	-	未变更
中泰证券股份有限公司	2	-	-	-	-	未变更
中信建投证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
中信证券股份有限公司	6	-	-	-	-	未变更

注：基金专用交易单元的选择标准和程序如下：

1) 选择标准

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

告、个股分析报告及其他专门报告以及全面的信息服务。并能根据基金管理人的特定要求，提供专门研究报告。

2) 选择程序

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

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	-	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
川财证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
西南证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长城证	-	-	-	-	-	-

券股份 有限公司						
诚通证 券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证 券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
东兴证 券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证 券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
国金证 券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
国盛证 券有限 责任公 司	-	-	-	-	-	-
国泰君 安证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
国投证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
国信证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
海通证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
恒泰证 券股份	-	-	-	-	-	-

有限公司						
华创证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
华福证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
民生证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
瑞银证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	-	-	-	-	-	-
天风证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有	-	-	-	-	-	-

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	景顺长城基金管理有限公司关于调整适用“养老金客户费率优惠”的养老金客户范围的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024年1月10日
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 2023 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2024年1月22日
3	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2023 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2024年1月22日
4	景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2024年3月20日
5	关于景顺长城 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金变更场内扩位简称的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024年3月20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	2024年3月22日
7	关于警惕假冒景顺长城基金 APP 开展诈骗活动的声明	中国证监会指定报刊及网站	2024年3月27日
8	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增国金证券为一级交易商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024年3月27日
9	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 年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2024年3月29日
10	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2023 年年度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2024年3月29日
11	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	2024年4月13日

12	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	2024 年 4 月 15 日
13	景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 4 月 22 日
14	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2024 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 4 月 22 日
15	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增渤海证券为一级交易商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 5 月 20 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	2024 年 5 月 24 日
17	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	2024 年 5 月 30 日
18	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 5 月 31 日
19	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	2024 年 6 月 4 日
20	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 2024 年第 1 号更新招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 6 月 4 日
21	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增东方财富证券为一级交易商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 6 月 18 日
22	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增联储证券为一级交易商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 6 月 20 日
23	景顺长城基金管理有限公司旗下基金调整持有停牌股票估值价格的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 6 月 21 日
24	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增爱建证券为一级交易商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 6 月 21 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	2024 年 6 月 29 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

无。

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

2024 年 8 月 30 日