

# 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 06 月 30 日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

## 目录

§1 重要提示及目录.....	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介.....	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
§4 管理人报告.....	7
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
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.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	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的真实、准确和完整发表意见.....	12
§6 中期财务会计报告（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.....	38
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	38
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.....	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	53
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.....	53
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.....	53
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.....	54

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	54
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	54
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54
7.12	投资组合报告附注	54
§8	基金份额持有人信息	55
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
8.2	期末上市基金前十名持有人	56
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	56
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	56
§9	开放式基金份额变动	56
§10	重大事件揭示	57
10.1	基金份额持有人大会决议	57
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	57
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	57
10.4	基金投资策略的改变	57
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	57
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	57
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	58
10.8	其他重大事件	59
§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	MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	南方 MSCI 中国 A 股国际通 ETF
场内简称	MSCI 中国 A 股 ETF
基金主代码	512160
交易代码	512160
基金运作方式	交易型开放式 (ETF)
基金合同生效日	2018 年 4 月 3 日
基金管理人	南方基金管理股份有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	281,777,775.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2018 年 4 月 27 日

### 2.2 基金产品说明

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

### 2.3 基金管理人和基金托管人

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

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

## 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	<a href="http://www.nffund.com">http://www.nffund.com</a>
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人的住所、基金上市交易的证券交易所（如有）

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
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	-11,649,172.58
本期利润	5,167,951.08
加权平均基金份额本期利润	0.0176
本期加权平均净值利润率	1.69%
本期基金份额净值增长率	1.42%
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	12,023,071.39
期末可供分配基金份额利润	0.0426
期末基金资产净值	293,800,846.39
期末基金份额净值	1.0427
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	29.32%
-------------	--------

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

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

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

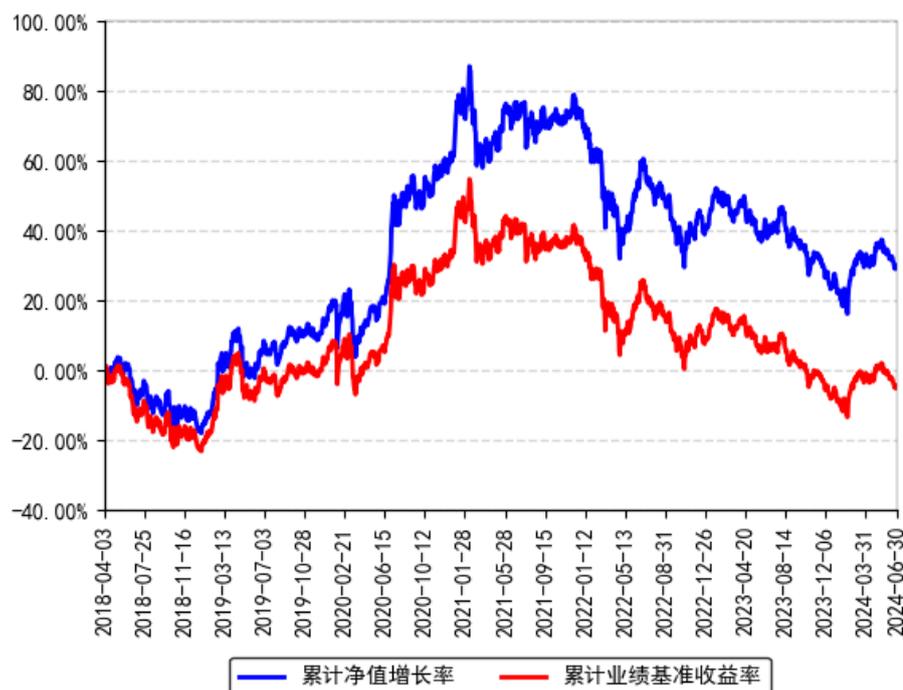
## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-2.89%	0.51%	-3.88%	0.51%	0.99%	0.00%
过去三个月	-1.27%	0.79%	-2.61%	0.79%	1.34%	0.00%
过去六个月	1.42%	0.98%	0.00%	0.98%	1.42%	0.00%
过去一年	-7.24%	0.91%	-10.40%	0.91%	3.16%	0.00%
过去三年	-26.80%	1.04%	-33.59%	1.04%	6.79%	0.00%
自基金合同生效起至今	29.32%	1.20%	-5.06%	1.21%	34.38%	-0.01%

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

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



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

2018年1月，公司整体变更设立为南方基金管理股份有限公司。目前，公司总部设在深圳，在北京、上海、深圳、南京、成都、合肥等地设有分公司，在香港和深圳前海设有子公司——南方东英资产管理有限公司（香港子公司）和南方资本管理有限公司（深圳子公司）。其中，南方东英是境内基金公司获批成立的第一家境外分支机构。

南方基金管理股份有限公司旗下管理公募基金、全国社保、基本养老保险、企业年金、职业年金和专户组合，已发展成为产品种类丰富、业务领域全面、经营业绩优秀、资产管理规模位居前列的基金管理公司之一。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
罗文杰	本基金	2018年4	-	19年	女，美国南加州大学数学金融硕士、美

	基金经 理	月 3 日		<p>国加州大学计算机科学硕士，具有基金从业资格。曾任职于摩根士丹利投资银行，从事量化分析工作。2008 年 9 月加入南方基金，曾任南方基金数量化投资部基金经理助理；现任指数投资部总经理。2013 年 5 月 17 日至 2015 年 6 月 16 日，任南方策略基金经理；2017 年 11 月 9 日至 2019 年 1 月 18 日，任南方策略、南方量化混合基金经理；2016 年 12 月 30 日至 2019 年 4 月 18 日，任南方安享绝对收益、南方卓享绝对收益基金经理；2018 年 2 月 8 日至 2020 年 3 月 27 日，任 H 股 ETF 基金经理；2018 年 2 月 12 日至 2020 年 3 月 27 日，任南方 H 股联接基金经理；2014 年 10 月 30 日至 2020 年 12 月 23 日，任 500 医药基金经理；2021 年 3 月 12 日至 2023 年 2 月 24 日，任南方中证创新药产业 ETF 基金经理；2021 年 10 月 22 日至 2023 年 2 月 24 日，任南方中证全指医疗保健 ETF 基金经理；2020 年 12 月 25 日至 2023 年 8 月 25 日，任南方策略基金经理；2021 年 7 月 2 日至 2023 年 8 月 25 日，任南方中证香港科技 ETF (QDII) 基金经理；2022 年 6 月 17 日至 2023 年 8 月 25 日，任南方恒生香港上市生物科技 ETF (QDII) 基金经理；2013 年 4 月 22 日至今，任南方 500、南方 500ETF 基金经理；2013 年 5 月 17 日至今，任南方 300、南方 300 联接基金经理；2015 年 2 月 16 日至今，任南方恒生 ETF 基金经理；2017 年 7 月 21 日至今，任恒生联接基金经理；2017 年 8 月 24 日至今，任南方房地产联接基金经理；2017 年 8 月 25 日至今，任南方房地产 ETF 基金经理；2018 年 4 月 3 日至今，任 MSCI 基金基金经理；2018 年 6 月 8 日至今，任 MSCI 联接基金经理；2020 年 7 月 24 日至今，兼任投资经理；2023 年 5 月 30 日至今，任南方恒生香港上市生物科技 ETF 发起联接(QDII) 基金经理；2024 年 6 月 26 日至今，任南方中证国新港股通央企红利 ETF 基金经理。</p>
--	----------	-------	--	--

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

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

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
罗文杰	公募基金	12	94,898,159,790.48	2013年04月22日
	私募资产管理计划	8	2,644,004,064.49	2020年08月07日
	其他组合	-	-	-
	合计	20	97,542,163,854.97	-

#### 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》等有关法律法规、中国证监会和本基金基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。公司每季度对旗下组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析。

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易次数为69次，是由于指数投资组合的投资策略导致。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024 年上半年，宏观经济复苏节奏相对平缓，A 股市场在政策持续加码和外部地缘扰动下呈现逐步筑底、震荡整固态势。

1. 沪深 300 指数上涨 0.89%，中证 500 下跌 8.96%，创业板指下跌 10.99%，科创 50 下跌 16.42%。

2. 行业方面，风险偏好下行，市场资金拥抱具有盈利确定性的泛公用事业和国央企资产，银行、电力及公用事业、交通运输等行业涨幅领先。综合、消费者服务、传媒等行业回调较大。

3. 宏观经济数据结构性分化及外部扰动下市场风险偏好阶段承压，低估值低波动标的相对占优。

报告期内，MSCI 国际通指数涨幅为 0%。

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

我们对本基金报告期内跟踪误差归因分析如下：

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

(2) 股指期货和现货之间的基差波动带来的本基金与基准的偏离；

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

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.0427 元，报告期内，份额净值增长率为 1.42%，同期业绩基准增长率为 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

二季度开始，随着专项债项目和超长期特别国债项目加速释放，政府新项目投资明显改善。目前外需改善的趋势仍在，去年二三季度基数相对比较低，经济增速有望进一步反弹。目前的消费增速也相对稳定。价格变量有望触底反弹。4 月政治局会议定调“坚持乘势而上，避免前紧后松，切实巩固和增强经济回升向好态势”、“避免前紧后松”的表述释放了明确的政策信号，有利于缓解此前市场对于宏观政策持续性的担忧。MSCI 国际通指数市盈率及市净率现下位列全球主要市场末端，未来估值修复空间较大。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

#### 4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

## § 6 中期财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金  
报告截止日：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	6.4.3.1	2,092,476.50	1,929,139.39
结算备付金		724,352.71	737,165.99
存出保证金		370,863.38	266,066.16
交易性金融资产	6.4.3.2	290,719,676.34	303,559,470.46
其中：股票投资		290,719,676.34	303,559,470.46
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	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		380,263.60	151,971.91

应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.5	-	10,317.41
资产总计		294,287,632.53	306,654,131.32
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	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		123,124.12	128,706.82
应付托管费		24,624.82	25,741.37
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		10.65	844.39
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.6	339,026.55	347,551.08
负债合计		486,786.14	502,843.66
净资产：			
实收基金	6.4.3.7	281,777,775.00	297,777,775.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.3.8	12,023,071.39	8,373,512.66
净资产合计		293,800,846.39	306,151,287.66
负债和净资产总计		294,287,632.53	306,654,131.32

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0427 元，基金份额总额 281,777,775.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：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		6,245,475.98	2,973,162.37
1.利息收入		86,047.22	9,188.85

其中：存款利息收入	6.4.3.9	10,546.29	9,188.85
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		75,500.93	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-10,644,417.04	-11,542,475.77
其中：股票投资收益	6.4.3.10	-14,387,406.33	-15,721,039.00
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.11	5,889.18	35,135.72
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.3.12	71,026.48	85,900.12
股利收益	6.4.3.13	3,666,073.63	4,057,527.39
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）	6.4.3.14	16,817,123.66	14,424,370.97
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.15	-13,277.86	82,078.32
减：二、营业总支出		1,077,524.90	1,358,492.90
1.管理人报酬	6.4.6.2.1	762,180.62	935,943.42
其中：暂估管理人报酬		-	-
2.托管费	6.4.6.2.2	152,436.12	187,188.61
3.销售服务费	6.4.6.2.3	-	-
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.信用减值损失		-	-
7.税金及附加		734.23	723.36
8.其他费用	6.4.3.16	162,173.93	234,637.51
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		5,167,951.08	1,614,669.47
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”		5,167,951.08	1,614,669.47

号填列)			
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		5,167,951.08	1,614,669.47

### 6.3 净资产变动表

会计主体：MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：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	297,777,775.00	-	8,373,512.66	306,151,287.66
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	297,777,775.00	-	8,373,512.66	306,151,287.66
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-16,000,000.00	-	3,649,558.73	-12,350,441.27
（一）、综合收益总额	-	-	5,167,951.08	5,167,951.08
（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	-	-1,518,392.35	-17,518,392.35
其中：1.基金申购款	6,000,000.00	-	-107,471.44	5,892,528.56
2.基金赎回款	-22,000,000.00	-	-1,410,920.91	-23,410,920.91
（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	281,777,775.00	-	12,023,071.39	293,800,846.39
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	303,777,775.00	-	124,122,439.00	427,900,214.00
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	303,777,775.00	-	124,122,439.00	427,900,214.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	2,000,000.00	-	-86,160,692.66	-84,160,692.66
（一）、综合收益总额	-	-	1,614,669.47	1,614,669.47
（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）	2,000,000.00	-	-839,807.38	1,160,192.62
其中：1.基金申购款	82,000,000.00	-	14,945,390.54	96,945,390.54
2.基金赎回款	-80,000,000.00	-	-15,785,197.92	-95,785,197.92
（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）	-	-	-86,935,554.75	-86,935,554.75
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	305,777,775.00	-	37,961,746.34	343,739,521.34

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：

\_\_\_\_杨小松\_\_\_\_                      \_\_\_\_常克川\_\_\_\_                      \_\_\_\_徐超\_\_\_\_  
基金管理人负责人                      主管会计工作负责人                      会计机构负责人

## 6.4 报表附注

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

本报告期所采用的会计政策，会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 6.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.2.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 6.4.2.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 6.4.2.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 6.4.3 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.3.1 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	2,092,476.50
等于：本金	2,092,287.94
加：应计利息	188.56
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	2,092,476.50

#### 6.4.3.2 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	345,771,755.32	-	290,719,676.34	-55,052,078.98

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	345,771,755.32	-	-	290,719,676.34	-55,052,078.98

### 6.4.3.3 衍生金融资产/负债

#### 6.4.3.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	3,141,140.00	-	-	-
一指期货	3,141,140.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	3,141,140.00	-	-	-

#### 6.4.3.3.2 期末基金持有的期货合约情况

金额单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2412	IC2412	1.00	966,760.00	-73,960.00
IF2407	IF2407	2.00	2,062,200.00	-38,220.00
合计				-112,180.00
减：可抵销期货暂收款				-112,180.00
净额				-

注：1、买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

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

### 6.4.3.4 买入返售金融资产

#### 6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产。

**6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

**6.4.3.5 其他资产**

本基金本报告期末无其他资产。

**6.4.3.6 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	2,495.84
其中：交易所市场	2,495.84
银行间市场	-
应付利息	-
应退退补款	-
预提费用	84,535.36
应付指数使用费	251,995.35
可退替代款	-
合计	339,026.55

**6.4.3.7 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	297,777,775.00	297,777,775.00
本期申购	6,000,000.00	6,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-22,000,000.00	-22,000,000.00
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	281,777,775.00	281,777,775.00

注：红利再投及转入份额计入本期申购，转出份额计入本期赎回。

**6.4.3.8 未分配利润**

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	133,696,386.71	-125,322,874.05	8,373,512.66
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-

其他	-	-	-
本期期初	133,696,386.71	-125,322,874.05	8,373,512.66
本期利润	-11,649,172.58	16,817,123.66	5,167,951.08
本期基金份额交易产生的变动数	-6,566,526.17	5,048,133.82	-1,518,392.35
其中：基金申购款	2,687,509.20	-2,794,980.64	-107,471.44
基金赎回款	-9,254,035.37	7,843,114.46	-1,410,920.91
本期已分配利润	-	-	-
本期末	115,480,687.96	-103,457,616.57	12,023,071.39

### 6.4.3.9 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	3,650.44
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	6,842.18
其他	53.67
合计	10,546.29

### 6.4.3.10 股票投资收益

#### 6.4.3.10.1 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	-13,030,941.13
股票投资收益——赎回差价收入	-1,356,465.20
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	-14,387,406.33

#### 6.4.3.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	25,838,521.57
减：卖出股票成本总额	38,848,919.02
减：交易费用	20,543.68
买卖股票差价收入	-13,030,941.13

注：上述交易费用（如有）包含股票买卖产生的交易费用。

#### 6.4.3.10.3 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	23,410,920.91
减：现金支付赎回款总额	7,983,933.91
减：赎回股票成本总额	16,783,452.20
减：交易费用	-
赎回差价收入	-1,356,465.20

#### 6.4.3.10.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无股票申购差价收入。

#### 6.4.3.11 债券投资收益

##### 6.4.3.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	2.71
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	5,886.47
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	5,889.18

##### 6.4.3.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	23,890.17
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	18,000.00
减：应计利息总额	2.72
减：交易费用	0.98
买卖债券差价收入	5,886.47

注：上述交易费用（如有）包含债券买卖产生的交易费用。

##### 6.4.3.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

##### 6.4.3.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券申购差价收入。

#### 6.4.3.12 衍生工具收益

##### 6.4.3.12.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具买卖权证差价收入。

**6.4.3.12.2 衍生工具收益——其他投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股指期货-投资收益	71,026.48

**6.4.3.13 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	3,666,073.63
其中：证券出借权益补偿收入	3,440.40
基金投资产生的股利收益	-
合计	3,666,073.63

**6.4.3.14 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	16,952,653.66
——股票投资	16,952,653.66
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-135,530.00
——权证投资	-
——期货投资	-135,530.00
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	16,817,123.66

**6.4.3.15 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	-13,277.86
合计	-13,277.86

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购(赎回)本基金时，补入(卖出)被替代证券的实际买入成本(实际卖出金额)与申购(赎回)确认日估值的差额，或强制退款的被替代证券在强制退款计算日与申购(赎回)确认日估值的差额。

**6.4.3.16 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	24,863.02
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
指数使用费	76,636.83
银行费用	1,001.74
合计	162,173.93

#### 6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.4.1 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。

##### 6.4.4.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的重大资产负债表日后事项。

#### 6.4.5 关联方关系

##### 6.4.5.1 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。

##### 6.4.5.2 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
南方基金管理股份有限公司("南方基金")	基金管理人
中国银行股份有限公司("中国银行")	基金托管人
华泰证券股份有限公司("华泰证券")	基金管理人的股东、基金销售机构
兴业证券股份有限公司("兴业证券")	基金管理人的股东、基金销售机构
华泰联合证券有限责任公司("华泰联合")	基金管理人的股东华泰证券控制的公司
MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金("南方 MSCI 中国 A 股 ETF 联接基金")	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.6.1.1 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

华泰证券	1,287,542.42	2.77%	6,670,167.91	2.81%
------	--------------	-------	--------------	-------

#### 6.4.6.1.2 债券交易

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	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
华泰证券	8,505.48	35.60%	1,472.40	0.76%

#### 6.4.6.1.3 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 6.4.6.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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
华泰证券	128.76	2.77%	59.37	2.38%
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
华泰证券	667.02	2.81%	464.71	5.44%

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算。

2. 该类佣金协议的服务范围符合《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》（中国证券监督管理委员会公告（2024）3 号）相关规定。《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》生效后，被动股票型基金不再通过股票交易佣金支付研究服务等其他费用，其他类型基金可以通过股票交易佣金支付研究服务费用。

#### 6.4.6.2 关联方报酬

##### 6.4.6.2.1 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	762,180.62	935,943.42
其中：应支付销售机构的客户维护费	6,592.34	8,091.04
应支付基金管理人的净管理费	755,588.28	927,852.38

注：支付基金管理人南方基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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

#### 6.4.6.2.2 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	152,436.12	187,188.61

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值的 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：

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

#### 6.4.6.2.3 销售服务费

无。

#### 6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

#### 6.4.6.4 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

##### 6.4.6.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

##### 6.4.6.4.2 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

本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日						
关联方名称	交易金额	费率区间 (%)	加权平均费率 (%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
华泰证券	14,427,778.00	1.5~3.5	2.67	17,062.17	-	-

上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日						
关联方名称	交易金额	费率区间 (%)	加权平均费率 (%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额

-	-	-	-	-	-	-
---	---	---	---	---	---	---

#### 6.4.6.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.6.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
华泰证券股份有限公司	1,320,089.00	0.47%	3,022,789.00	1.02%
中国银行股份有限公司—MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	115,568,200.00	41.01%	118,369,800.00	39.75%

注：本基金其他关联方投资本基金适用的认（申）购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

##### 6.4.6.6 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
中国银行	2,092,476.50	3,650.44	1,670,048.77	3,218.66

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行约定利率计息。

##### 6.4.6.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

单位：人民币元

本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
华泰联合	688709	成都华微	网下申购	5,850	91,786.50
华泰联合	301587	中瑞股份	网下申购	3,056	66,406.88
华泰联合	603341	龙旗科技	网下申购	1,453	37,778.00
兴业证券	301392	汇成真空	网下申购	2,189	26,705.80

上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	

				数量（单位： 股/张）	总金额
华泰联合	688472	阿特斯	网下申购	14,468	160,594.80
华泰联合	688478	晶升股份	网下申购	4,013	130,502.76
华泰联合	688512	慧智微	网下申购	6,055	126,670.60
华泰联合	118031	天 23 转债	配债	860	86,000.00
华泰联合	688429	时创能源	网下申购	3,452	66,278.40
华泰联合	113066	平煤转债	配债	290	29,000.00
华泰联合	603291	联合水务	网下申购	536	3,140.96
兴业证券	301322	绿通科技	网下申购	1,167	153,005.37
兴业证券	301315	威士顿	网下申购	2,253	72,749.37
兴业证券,华 泰联合	688469	中芯集成	网下申购	43,192	245,762.48
兴业证券,华 泰联合	601916	浙商银行	配股	44,070	89,021.40

#### 6.4.6.8 其他关联交易事项的说明

于本期末，本基金持有关联方兴业证券、华泰证券、中国银行发行的普通股，成本总额为人民币 2,368,476.93 元，估值总额为人民币 2,397,991.70 元，占本基金基金资产净值的比例为 0.82%（于上期末，本基金持有关联方兴业证券、华泰证券、中国银行发行的普通股，成本总额为人民币 2,420,677.71 元，估值总额为人民币 2,423,367.41 元，占本基金基金资产净值的比例为 0.79%）。

#### 6.4.7 利润分配情况

##### 6.4.7.1 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.8 期末（2024 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.8.1 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

6.4.8.1.1 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
301589	诺瓦星云	2024 年 2 月 1 日	6 个月	新股锁定期	126.89	188.01	296	37,559.44	55,650.96	-
301589	诺瓦星云	2024 年 5 月 30 日	1-6 个月（含）	锁定期转增	-	188.01	237	-	44,558.37	-
603285	键邦股份	2024 年	1 个月	新股未	18.65	18.65	1,287	24,002.55	24,002.55	-

		6月28日	内(含)	上市						
603350	安乃达	2024年6月26日	1个月内(含)	新股未上市	20.56	20.56	1,051	21,608.56	21,608.56	-
688692	达梦数据	2024年6月4日	6个月	新股锁定期	86.96	174.93	112	9,739.52	19,592.16	-
301536	星宸科技	2024年3月20日	6个月	新股锁定期	16.16	32.27	481	7,772.96	15,521.87	-
301538	骏鼎达	2024年3月13日	6个月	新股锁定期	55.82	91.24	107	5,972.74	9,762.68	-
301538	骏鼎达	2024年5月22日	1-6个月(含)	锁定期转增	-	91.24	43	-	3,923.32	-
301565	中仑新材	2024年6月13日	6个月	新股锁定期	11.88	18.98	711	8,446.68	13,494.78	-
301580	爱迪特	2024年6月19日	6个月	新股锁定期	44.95	65.93	183	8,225.85	12,065.19	-
688709	成都华微	2024年1月31日	6个月	新股锁定期	15.69	18.79	585	9,178.65	10,992.15	-
688691	灿芯股份	2024年4月2日	6个月	新股锁定期	19.86	42.51	247	4,905.42	10,499.97	-
301566	达利凯普	2023年12月22日	6个月	新股锁定期	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	-
301392	汇成真空	2024年5月28日	6个月	新股锁定期	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-
301591	肯特股份	2024年2月20日	6个月	新股锁定期	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	-
301587	中瑞股份	2024年3月27日	6个月	新股锁定期	21.73	25.26	306	6,649.38	7,729.56	-
001389	广合科技	2024年3月26日	6个月	新股锁定期	17.43	34.56	222	3,869.46	7,672.32	-

688584	上海合晶	2024 年 2 月 1 日	6 个月	新股锁 定期	22.66	15.89	461	10,446.26	7,325.29	-
301539	宏鑫科技	2024 年 4 月 3 日	6 个月	新股锁 定期	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-
688695	中创股份	2024 年 3 月 6 日	6 个月	新股锁 定期	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-
688530	欧莱新材	2024 年 4 月 29 日	6 个月	新股锁 定期	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-
603341	龙旗科技	2024 年 2 月 23 日	6 个月	新股锁 定期	26.00	37.49	146	3,796.00	5,473.54	-
301588	美新科技	2024 年 3 月 6 日	6 个月	新股锁 定期	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-
301502	华阳智能	2024 年 1 月 26 日	6 个月	新股锁 定期	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-
603344	星德胜	2024 年 3 月 13 日	6 个月	新股锁 定期	19.18	22.66	179	3,433.22	4,056.14	-
001359	平安电工	2024 年 3 月 19 日	6 个月	新股锁 定期	17.39	20.60	184	3,199.76	3,790.40	-
603325	博隆技术	2024 年 1 月 3 日	6 个月	新股锁 定期	72.46	68.06	47	3,405.62	3,198.82	-
603082	北自科技	2024 年 1 月 23 日	6 个月	新股锁 定期	21.28	29.49	107	2,276.96	3,155.43	-
603381	永臻股份	2024 年 6 月 19 日	6 个月	新股锁 定期	23.35	25.13	125	2,918.75	3,141.25	-
001379	腾达科技	2024 年 1 月 11 日	6 个月	新股锁 定期	16.98	13.48	213	3,616.74	2,871.24	-
603375	盛景微	2024 年 1 月 17 日	6 个月	新股锁 定期	38.18	38.90	72	2,748.96	2,800.80	-

## 6.4.8.1.2 受限证券类别：债券

证券代	证券名称	成功认	受限期	流通受	认购	期末	数量	期末成本总	期末估值总	备
-----	------	-----	-----	-----	----	----	----	-------	-------	---

码		购日		限类型	价格	估值 单价	(单 位:张)	额	额	注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

注：本基金持有的上述流通受限证券，根据中国证监会、证券交易所发布的相关规定，在受限期内不得转让：

1. 基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股中需要限售的部分或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

2. 基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

3. 基金作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

4. 基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后 6 个月内不得转让。

#### 6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

##### 6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.8.4 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。

### 6.4.9 金融工具风险及管理

#### 6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

本基金是指数型基金，紧密跟踪 MSCI 中国 A 股国际通指数，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。本基金采用完全复制法，跟踪 MSCI 中国 A 股国际通指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足

够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代，力求与标的指数的跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。

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

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

#### 6.4.9.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人开立的托管账户或其他大中型商业银行开立的存款账户，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，本基金以非约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司出借证券，本基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近 1 年的分类结果为 A 类，违约可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。内部债券信用评级主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险，以及信用产品的条款和担保人的情况等。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的内部评级，通过单只信用产

品投资占基金净资产的比例及占发行量的比例进行控制，通过分散化投资以分散信用风险。

### 6.4.9.3 流动性风险

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

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的进行期货投资，以对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等，主要采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金力争利用期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

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

#### 6.4.9.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短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。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注“期末本基金持有的流通受限证券”。此外，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超过基金资产净值的 15%。于本期末，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合该要求。

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。

#### 6.4.9.4 市场风险

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

##### 6.4.9.4.1 利率风险

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

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

##### 6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	2,092,476.50	-	-	-	2,092,476.50
结算备付金	724,352.71	-	-	-	724,352.71
存出保证金	7,388.18	-	-	363,475.20	370,863.38
交易性金融资产	-	-	-	290,719,676.34	290,719,676.34
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
其他债权投资	-	-	-	-	-
其他权益工具投资	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	380,263.60	380,263.60
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	2,824,217.39	-	-	291,463,415.14	294,287,632.53

负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融 负债	-	-	-	-	-
衍生金融负 债	-	-	-	-	-
卖出回购金 融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人 报酬	-	-	-	123,124.12	123,124.12
应付托管费	-	-	-	24,624.82	24,624.82
应付销售服 务费	-	-	-	-	-
应付投资顾 问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	10.65	10.65
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税 负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	339,026.55	339,026.55
负债总计	-	-	-	486,786.14	486,786.14
利率敏感度 缺口	2,824,217.39	-	-	290,976,629. 00	293,800,846. 39
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,929,139.39	-	-	-	1,929,139.39
结算备付金	737,165.99	-	-	-	737,165.99
存出保证金	12,282.96	-	-	253,783.20	266,066.16
交易性金融 资产	-	-	-	303,559,470. 46	303,559,470. 46
衍生金融资 产	-	-	-	-	-
买入返售金 融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
其他债权投 资	-	-	-	-	-
其他权益工 具投资	-	-	-	-	-

应收清算款	-	-	-	151,971.91	151,971.91
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	10,317.41	10,317.41
资产总计	2,678,588.34	-	-	303,975,542.98	306,654,131.32
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	128,706.82	128,706.82
应付托管费	-	-	-	25,741.37	25,741.37
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	844.39	844.39
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	347,551.08	347,551.08
负债总计	-	-	-	502,843.66	502,843.66
利率敏感度缺口	2,678,588.34	-	-	303,472,699.32	306,151,287.66

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

#### 6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	1.市场利率平行上升25个基点	0.00	0.00

	2.市场利率平行下降 25 个基点	0.00	0.00
--	-------------------	------	------

#### 6.4.9.4.2 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。

#### 6.4.9.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市交易的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金采用完全复制法，跟踪 MSCI 中国 A 股国际通指数，以完全按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合为原则，通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金投资组合中，投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

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	290,719,676.34	98.95	303,559,470.46	99.15
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	290,719,676.34	98.95	303,559,470.46	99.15

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

#### 6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变
----	----------------------

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	1.组合自身基准上升 5%	14,635,681.22	15,215,143.21
	2.组合自身基准下降 5%	-14,635,681.22	-15,215,143.21

## 6.4.10 公允价值

### 6.4.10.1 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。

### 6.4.10.2 持续的以公允价值计量的金融工具

#### 6.4.10.2.1 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
第一层次	290,370,548.60
第二层次	45,611.11
第三层次	303,516.63
合计	290,719,676.34

#### 6.4.10.2.2 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，确定相关金融工具的公允价值应属第二层次还是第三层次。

### 6.4.10.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

### 6.4.10.4 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。

### 6.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	290,719,676.34	98.79
	其中：股票	290,719,676.34	98.79
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,816,829.21	0.96
8	其他各项资产	751,126.98	0.26
9	合计	294,287,632.53	100.00

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

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	3,174,119.00	1.08
B	采矿业	19,141,412.15	6.52
C	制造业	155,350,810.49	52.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	15,301,357.60	5.21
E	建筑业	6,088,687.88	2.07
F	批发和零售业	1,924,234.60	0.65
G	交通运输、仓储和邮政业	12,213,312.06	4.16
H	住宿和餐饮业	165,456.00	0.06

I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,416,517.35	3.55
J	金融业	58,130,397.10	19.79
K	房地产业	2,735,335.68	0.93
L	租赁和商务服务业	2,240,834.30	0.76
M	科学研究和技术服务业	1,178,555.19	0.40
N	水利、环境和公共设施管理业	284,004.00	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	888,229.60	0.30
R	文化、体育和娱乐业	965,509.60	0.33
S	综合	171,776.00	0.06
	合计	290,370,548.60	98.83

### 7.2.2 期末积极投资按行业分类境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	313,167.31	0.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	35,960.43	0.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	349,127.74	0.12

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	10,142	14,882,269.38	5.07
2	300750	宁德时代	35,683	6,424,010.49	2.19
3	600900	长江电力	198,254	5,733,505.68	1.95
4	600036	招商银行	167,043	5,711,200.17	1.94
5	000858	五粮液	31,444	4,026,089.76	1.37
6	002594	比亚迪	14,700	3,678,675.00	1.25
7	601318	中国平安	87,108	3,602,786.88	1.23
8	601288	农业银行	689,900	3,007,964.00	1.02
9	601166	兴业银行	168,400	2,967,208.00	1.01
10	601138	工业富联	107,200	2,937,280.00	1.00
11	601899	紫金矿业	166,900	2,932,433.00	1.00
12	601398	工商银行	509,800	2,905,860.00	0.99
13	300760	迈瑞医疗	9,800	2,850,918.00	0.97
14	601088	中国神华	53,478	2,372,818.86	0.81
15	601328	交通银行	317,500	2,371,725.00	0.81
16	002475	立讯精密	58,173	2,286,780.63	0.78
17	601816	京沪高铁	397,600	2,135,112.00	0.73
18	600809	山西汾酒	9,844	2,075,902.72	0.71
19	600309	万华化学	25,480	2,060,312.80	0.70
20	601225	陕西煤业	78,430	2,021,141.10	0.69
21	600276	恒瑞医药	51,733	1,989,651.18	0.68
22	600000	浦发银行	237,678	1,956,089.94	0.67
23	002714	牧原股份	44,314	1,932,090.40	0.66
24	000333	美的集团	28,200	1,818,900.00	0.62
25	600030	中信证券	99,095	1,806,501.85	0.61
26	601857	中国石油	174,742	1,803,337.44	0.61
27	601668	中国建筑	336,960	1,789,257.60	0.61
28	000568	泸州老窖	11,900	1,707,531.00	0.58
29	600028	中国石化	262,714	1,660,352.48	0.57
30	601985	中国核电	152,900	1,629,914.00	0.55
31	600406	国电南瑞	65,129	1,625,619.84	0.55
32	601919	中远海控	103,360	1,601,046.40	0.54
33	000001	平安银行	157,300	1,596,595.00	0.54
34	601601	中国太保	55,458	1,545,059.88	0.53
35	601766	中国中车	196,600	1,476,466.00	0.50
36	600150	中国船舶	36,100	1,469,631.00	0.50

37	600690	海尔智家	51,081	1,449,678.78	0.49
38	002352	顺丰控股	39,600	1,413,324.00	0.48
39	002371	北方华创	4,300	1,375,527.00	0.47
40	300059	东方财富	127,546	1,346,885.76	0.46
41	600887	伊利股份	51,588	1,333,033.92	0.45
42	688041	海光信息	18,922	1,330,595.04	0.45
43	601988	中国银行	283,800	1,311,156.00	0.45
44	603288	海天味业	37,431	1,290,246.57	0.44
45	300308	中际旭创	9,128	1,258,568.64	0.43
46	000725	京东方 A	298,600	1,221,274.00	0.42
47	603993	洛阳钼业	142,700	1,212,950.00	0.41
48	600050	中国联通	256,900	1,207,430.00	0.41
49	601658	邮储银行	234,900	1,190,943.00	0.41
50	600019	宝钢股份	178,719	1,188,481.35	0.40
51	601818	光大银行	374,900	1,188,433.00	0.40
52	002142	宁波银行	53,310	1,176,018.60	0.40
53	600031	三一重工	68,563	1,131,289.50	0.39
54	601127	赛力斯	12,200	1,111,664.00	0.38
55	600919	江苏银行	148,224	1,101,304.32	0.37
56	600886	国投电力	60,300	1,099,872.00	0.37
57	600016	民生银行	286,900	1,087,351.00	0.37
58	601390	中国中铁	166,000	1,082,320.00	0.37
59	300498	温氏股份	53,780	1,065,919.60	0.36
60	300274	阳光电源	16,860	1,045,825.80	0.36
61	600989	宝丰能源	59,300	1,027,669.00	0.35
62	600436	片仔癀	4,919	1,019,069.23	0.35
63	601006	大秦铁路	142,100	1,017,436.00	0.35
64	600905	三峡能源	231,200	1,008,032.00	0.34
65	601169	北京银行	171,060	998,990.40	0.34
66	601888	中国中免	15,794	986,967.06	0.34
67	002304	洋河股份	12,199	984,947.26	0.34
68	603501	韦尔股份	9,838	977,602.06	0.33
69	000063	中兴通讯	32,500	909,025.00	0.31
70	000625	长安汽车	66,873	898,104.39	0.31
71	000338	潍柴动力	54,900	891,576.00	0.30
72	000651	格力电器	22,700	890,294.00	0.30
73	601009	南京银行	83,700	869,643.00	0.30
74	688111	金山办公	3,804	865,410.00	0.29
75	600795	国电电力	144,300	864,357.00	0.29
76	600104	上汽集团	62,312	863,644.32	0.29
77	601012	隆基绿能	61,373	860,449.46	0.29
78	600048	保利发展	96,800	847,968.00	0.29
79	600999	招商证券	60,041	835,170.31	0.28

80	601229	上海银行	114,912	834,261.12	0.28
81	601211	国泰君安	60,869	824,774.95	0.28
82	601600	中国铝业	106,900	815,647.00	0.28
83	603259	药明康德	20,501	803,434.19	0.27
84	002230	科大讯飞	18,650	801,017.50	0.27
85	600547	山东黄金	29,252	800,919.76	0.27
86	600346	恒力石化	56,965	794,661.75	0.27
87	002493	荣盛石化	81,904	791,192.64	0.27
88	600893	航发动力	21,526	786,775.30	0.27
89	000166	申万宏源	182,382	786,066.42	0.27
90	300015	爱尔眼科	75,530	779,469.60	0.27
91	601669	中国电建	139,400	779,246.00	0.27
92	600660	福耀玻璃	16,200	775,980.00	0.26
93	000792	盐湖股份	44,000	767,800.00	0.26
94	600585	海螺水泥	32,500	766,675.00	0.26
95	002938	鹏鼎控股	18,700	743,512.00	0.25
96	000538	云南白药	14,520	742,698.00	0.25
97	600674	川投能源	39,500	740,625.00	0.25
98	300433	蓝思科技	40,372	736,789.00	0.25
99	601688	华泰证券	59,228	733,834.92	0.25
100	688271	联影医疗	6,684	733,234.80	0.25
101	600011	华能国际	74,200	713,804.00	0.24
102	002027	分众传媒	116,960	708,777.60	0.24
103	688036	传音控股	9,183	702,866.82	0.24
104	688012	中微公司	4,964	701,214.64	0.24
105	600188	兖矿能源	30,800	700,084.00	0.24
106	601628	中国人寿	22,500	698,625.00	0.24
107	000596	古井贡酒	3,300	696,531.00	0.24
108	600438	通威股份	36,400	695,604.00	0.24
109	601111	中国国航	94,200	695,196.00	0.24
110	600015	华夏银行	107,352	687,052.80	0.23
111	000425	徐工机械	95,700	684,255.00	0.23
112	688256	寒武纪	3,393	674,087.31	0.23
113	601066	中信建投	35,000	673,400.00	0.23
114	600837	海通证券	78,200	669,392.00	0.23
115	000895	双汇发展	28,110	668,174.70	0.23
116	300014	亿纬锂能	16,524	659,638.08	0.22
117	000100	TCL 科技	151,990	656,596.80	0.22
118	001979	招商蛇口	73,332	644,588.28	0.22
119	600023	浙能电力	90,500	643,455.00	0.22
120	601881	中国银河	58,700	637,482.00	0.22
121	002311	海大集团	13,500	635,175.00	0.22
122	600926	杭州银行	47,820	624,051.00	0.21

123	300502	新易盛	5,800	612,190.00	0.21
124	003816	中国广核	127,500	590,325.00	0.20
125	601995	中金公司	19,700	583,317.00	0.20
126	605499	东鹏饮料	2,700	582,525.00	0.20
127	000776	广发证券	47,841	582,224.97	0.20
128	600489	中金黄金	39,300	581,640.00	0.20
129	601939	建设银行	77,700	574,980.00	0.20
130	600089	特变电工	40,920	567,560.40	0.19
131	603392	万泰生物	8,536	562,351.68	0.19
132	002463	沪电股份	15,370	561,005.00	0.19
133	601872	招商轮船	66,000	557,700.00	0.19
134	601868	中国能建	262,800	557,136.00	0.19
135	600115	中国东航	138,700	556,187.00	0.19
136	600845	宝信软件	17,383	555,039.19	0.19
137	300124	汇川技术	10,800	554,040.00	0.19
138	000002	万科 A	78,800	546,084.00	0.19
139	300122	智飞生物	19,350	542,380.50	0.18
140	002241	歌尔股份	27,508	536,681.08	0.18
141	600029	南方航空	90,200	531,278.00	0.18
142	688008	澜起科技	9,258	529,187.28	0.18
143	600160	巨化股份	21,900	528,447.00	0.18
144	601825	沪农商行	78,200	525,504.00	0.18
145	000938	紫光股份	23,202	518,564.70	0.18
146	601901	方正证券	66,700	515,591.00	0.18
147	603986	兆易创新	5,388	515,200.56	0.18
148	600010	包钢股份	368,000	515,200.00	0.18
149	601633	长城汽车	20,100	508,530.00	0.17
150	601336	新华保险	16,929	508,377.87	0.17
151	600111	北方稀土	29,450	506,540.00	0.17
152	601100	恒立液压	10,832	504,554.56	0.17
153	601689	拓普集团	9,400	503,934.00	0.17
154	002648	卫星化学	27,094	487,150.12	0.17
155	002001	新和成	25,024	480,460.80	0.16
156	688223	晶科能源	67,571	479,754.10	0.16
157	601916	浙商银行	173,170	477,949.20	0.16
158	600027	华电国际	68,318	474,126.92	0.16
159	000983	山西焦煤	45,840	472,610.40	0.16
160	603369	今世缘	10,200	471,240.00	0.16
161	600703	三安光电	40,000	468,800.00	0.16
162	601838	成都银行	30,800	467,852.00	0.16
163	300033	同花顺	4,500	466,650.00	0.16
164	601788	光大证券	31,653	462,766.86	0.16
165	600039	四川路桥	58,440	461,091.60	0.16

166	600584	长电科技	14,500	459,795.00	0.16
167	600426	华鲁恒升	17,240	459,273.60	0.16
168	600066	宇通客车	17,800	459,240.00	0.16
169	600958	东方证券	60,352	458,675.20	0.16
170	300408	三环集团	15,500	452,445.00	0.15
171	688169	石头科技	1,138	446,778.80	0.15
172	002736	国信证券	51,400	446,666.00	0.15
173	601618	中国中冶	143,700	445,470.00	0.15
174	601021	春秋航空	7,900	445,007.00	0.15
175	000999	华润三九	10,415	443,470.70	0.15
176	600522	中天科技	27,900	442,215.00	0.15
177	601360	三六零	57,500	441,600.00	0.15
178	601699	潞安环能	24,278	440,160.14	0.15
179	000157	中联重科	57,100	438,528.00	0.15
180	002916	深南电路	4,140	437,887.80	0.15
181	600026	中远海能	28,000	437,080.00	0.15
182	000977	浪潮信息	11,960	434,985.20	0.15
183	600803	新奥股份	20,900	434,720.00	0.15
184	600233	圆通速递	27,700	433,505.00	0.15
185	001965	招商公路	36,400	431,704.00	0.15
186	300832	新产业	6,400	431,616.00	0.15
187	601607	上海医药	22,526	430,471.86	0.15
188	000301	东方盛虹	53,100	423,207.00	0.14
189	600085	同仁堂	11,000	420,310.00	0.14
190	300896	爱美客	2,431	418,375.10	0.14
191	600741	华域汽车	25,533	418,230.54	0.14
192	002252	上海莱士	53,400	417,588.00	0.14
193	600600	青岛啤酒	5,710	415,516.70	0.14
194	600875	东方电气	22,500	415,125.00	0.14
195	002028	思源电气	6,200	414,780.00	0.14
196	300394	天孚通信	4,620	408,500.40	0.14
197	002236	大华股份	26,400	408,144.00	0.14
198	000786	北新建材	13,738	407,469.08	0.14
199	601117	中国化学	48,982	403,611.68	0.14
200	002600	领益智造	56,600	402,992.00	0.14
201	688396	华润微	10,734	401,880.96	0.14
202	603195	公牛集团	5,210	401,795.20	0.14
203	600183	生益科技	19,000	400,140.00	0.14
204	601567	三星医疗	11,300	395,500.00	0.13
205	002422	科伦药业	13,000	394,290.00	0.13
206	601319	中国人保	76,500	393,975.00	0.13
207	000963	华东医药	14,160	393,789.60	0.13
208	600362	江西铜业	16,600	393,088.00	0.13

209	002920	德赛西威	4,500	391,905.00	0.13
210	600161	天坛生物	15,960	389,424.00	0.13
211	000807	云铝股份	28,400	383,684.00	0.13
212	002128	电投能源	18,000	379,800.00	0.13
213	601727	上海电气	102,218	378,206.60	0.13
214	600196	复星医药	17,000	376,380.00	0.13
215	000617	中油资本	67,800	374,256.00	0.13
216	300628	亿联网络	10,120	372,112.40	0.13
217	002460	赣锋锂业	12,960	371,304.00	0.13
218	601058	赛轮轮胎	26,400	369,600.00	0.13
219	000630	铜陵有色	102,300	369,303.00	0.13
220	000708	中信特钢	27,000	366,390.00	0.12
221	000975	山金国际	22,480	366,199.20	0.12
222	000933	神火股份	18,100	366,163.00	0.12
223	600985	淮北矿业	21,800	364,932.00	0.12
224	600733	北汽蓝谷	45,100	364,408.00	0.12
225	002049	紫光国微	6,880	361,888.00	0.12
226	605117	德业股份	4,858	361,143.72	0.12
227	601077	渝农商行	71,500	358,930.00	0.12
228	002466	天齐锂业	12,000	358,920.00	0.12
229	600176	中国巨石	32,451	358,583.55	0.12
230	600219	南山铝业	94,100	358,521.00	0.12
231	300999	金龙鱼	13,102	358,339.70	0.12
232	002601	龙佰集团	19,215	356,822.55	0.12
233	600398	海澜之家	38,500	355,740.00	0.12
234	600221	海航控股	347,300	354,246.00	0.12
235	600256	广汇能源	52,700	353,090.00	0.12
236	601377	兴业证券	69,763	353,000.78	0.12
237	300782	卓胜微	4,504	350,140.96	0.12
238	688009	中国通号	58,120	348,720.00	0.12
239	600642	申能股份	39,300	347,019.00	0.12
240	601168	西部矿业	19,200	344,640.00	0.12
241	601878	浙商证券	31,400	336,608.00	0.11
242	601179	中国西电	41,400	332,856.00	0.11
243	000876	新希望	36,400	332,696.00	0.11
244	600332	白云山	11,268	330,490.44	0.11
245	600415	小商品城	44,400	329,448.00	0.11
246	601877	正泰电器	17,248	328,746.88	0.11
247	300661	圣邦股份	3,962	327,974.36	0.11
248	600018	上港集团	56,392	325,945.76	0.11
249	600009	上海机场	10,100	325,725.00	0.11
250	000423	东阿阿胶	5,200	325,520.00	0.11
251	600918	中泰证券	56,300	319,221.00	0.11

252	300413	芒果超媒	15,150	316,635.00	0.11
253	688188	柏楚电子	1,711	315,765.05	0.11
254	300866	安克创新	4,420	314,748.20	0.11
255	600487	亨通光电	19,900	313,823.00	0.11
256	000408	藏格矿业	13,000	312,910.00	0.11
257	300418	昆仑万维	9,700	312,728.00	0.11
258	002078	太阳纸业	22,400	312,480.00	0.11
259	000661	长春高新	3,400	312,018.00	0.11
260	603806	福斯特	21,184	311,404.80	0.11
261	603198	迎驾贡酒	5,400	310,500.00	0.11
262	601233	桐昆股份	19,400	309,624.00	0.11
263	601865	福莱特	15,300	307,530.00	0.10
264	601238	广汽集团	39,600	306,504.00	0.10
265	603799	华友钴业	13,764	304,597.32	0.10
266	002180	纳思达	11,500	303,830.00	0.10
267	688126	沪硅产业	21,967	303,364.27	0.10
268	002532	天山铝业	37,400	303,314.00	0.10
269	300316	晶盛机电	10,500	301,665.00	0.10
270	002223	鱼跃医疗	8,000	300,800.00	0.10
271	002625	光启技术	17,300	300,155.00	0.10
272	601991	大唐发电	99,500	299,495.00	0.10
273	603260	合盛硅业	6,400	298,944.00	0.10
274	688599	天合光能	17,662	298,841.04	0.10
275	002459	晶澳科技	26,628	298,233.60	0.10
276	688303	大全能源	14,442	294,472.38	0.10
277	600061	国投资本	51,600	291,540.00	0.10
278	002353	杰瑞股份	8,300	291,164.00	0.10
279	688187	时代电气	5,895	291,095.10	0.10
280	600348	华阳股份	29,200	290,832.00	0.10
281	600515	海南机场	92,200	289,508.00	0.10
282	600096	云天化	14,900	289,358.00	0.10
283	002050	三花智控	15,100	288,108.00	0.10
284	002064	华峰化学	40,100	287,517.00	0.10
285	002384	东山精密	13,800	285,660.00	0.10
286	600745	闻泰科技	10,100	285,325.00	0.10
287	300765	新诺威	11,280	284,594.40	0.10
288	603568	伟明环保	13,800	284,004.00	0.10
289	603606	东方电缆	5,800	283,098.00	0.10
290	002129	TCL 中环	32,325	279,611.25	0.10
291	000027	深圳能源	38,240	279,152.00	0.10
292	688072	拓荆科技	2,313	277,814.43	0.09
293	002074	国轩高科	14,500	277,675.00	0.09
294	300751	迈为股份	2,324	277,671.52	0.09

295	600418	江淮汽车	17,500	277,200.00	0.09
296	600588	用友网络	27,676	276,760.00	0.09
297	300442	润泽科技	11,500	275,425.00	0.09
298	002709	天赐材料	15,600	273,936.00	0.09
299	002156	通富微电	12,200	273,158.00	0.09
300	601958	金钼股份	26,100	271,701.00	0.09
301	601799	星宇股份	2,400	268,896.00	0.09
302	603160	汇顶科技	3,900	268,125.00	0.09
303	301236	软通动力	7,600	267,596.00	0.09
304	600570	恒生电子	15,102	266,701.32	0.09
305	002340	格林美	41,600	264,992.00	0.09
306	600177	雅戈尔	37,120	264,294.40	0.09
307	601577	长沙银行	32,100	262,578.00	0.09
308	600060	海信视像	10,600	262,244.00	0.09
309	603338	浙江鼎力	4,280	258,597.60	0.09
310	600970	中材国际	21,100	254,466.00	0.09
311	603979	金诚信	5,000	252,650.00	0.09
312	688777	中控技术	6,699	252,552.30	0.09
313	601216	君正集团	68,300	252,027.00	0.09
314	002409	雅克科技	4,000	251,640.00	0.09
315	600132	重庆啤酒	4,102	248,991.40	0.08
316	002595	豪迈科技	6,500	248,105.00	0.08
317	601108	财通证券	37,530	248,073.30	0.08
318	000932	华菱钢铁	55,900	247,637.00	0.08
319	002812	恩捷股份	7,800	246,870.00	0.08
320	600038	中直股份	6,000	246,660.00	0.08
321	688120	华海清科	1,300	246,454.00	0.08
322	600282	南钢股份	49,400	246,012.00	0.08
323	603659	璞泰来	17,114	241,820.82	0.08
324	603939	益丰药房	9,826	241,228.30	0.08
325	300919	中伟股份	7,780	241,102.20	0.08
326	000988	华工科技	8,000	239,440.00	0.08
327	301269	华大九天	3,100	238,855.00	0.08
328	000921	海信家电	7,400	238,576.00	0.08
329	600873	梅花生物	23,800	238,476.00	0.08
330	600566	济川药业	7,500	237,825.00	0.08
331	601555	东吴证券	40,220	237,298.00	0.08
332	002444	巨星科技	9,600	237,120.00	0.08
333	002294	信立泰	8,900	237,007.00	0.08
334	600460	士兰微	13,500	236,385.00	0.08
335	688363	华熙生物	4,169	235,840.33	0.08
336	002281	光迅科技	6,300	235,431.00	0.08
337	601231	环旭电子	14,600	234,330.00	0.08

338	002007	华兰生物	14,800	233,692.00	0.08
339	603833	欧派家居	4,340	232,450.40	0.08
340	002555	三七互娱	17,800	232,290.00	0.08
341	603899	晨光股份	7,400	231,472.00	0.08
342	603486	科沃斯	4,900	231,182.00	0.08
343	600895	张江高科	12,500	231,000.00	0.08
344	600546	山煤国际	15,800	230,996.00	0.08
345	002032	苏泊尔	4,600	230,460.00	0.08
346	600021	上海电力	23,300	230,437.00	0.08
347	603658	安图生物	5,000	230,350.00	0.08
348	600582	天地科技	33,300	229,437.00	0.08
349	000066	中国长城	26,073	228,138.75	0.08
350	300223	北京君正	4,100	227,304.00	0.08
351	688065	凯赛生物	5,000	226,950.00	0.08
352	600079	人福医药	13,200	226,644.00	0.08
353	002085	万丰奥威	17,100	226,404.00	0.08
354	600352	浙江龙盛	26,300	225,917.00	0.08
355	601928	凤凰传媒	20,600	225,776.00	0.08
356	601990	南京证券	29,300	225,024.00	0.08
357	300207	欣旺达	14,800	224,516.00	0.08
358	600968	海油发展	54,400	224,128.00	0.08
359	601666	平煤股份	20,000	224,000.00	0.08
360	600109	国金证券	29,600	223,480.00	0.08
361	002673	西部证券	35,916	222,320.04	0.08
362	300759	康龙化成	11,950	222,031.00	0.08
363	300003	乐普医疗	14,900	221,116.00	0.08
364	600988	赤峰黄金	13,500	220,590.00	0.08
365	600497	驰宏锌锗	41,300	220,542.00	0.08
366	601966	玲珑轮胎	11,911	218,805.07	0.07
367	002966	苏州银行	29,100	218,250.00	0.07
368	000831	中国稀土	8,600	218,010.00	0.07
369	603816	顾家家居	6,690	216,020.10	0.07
370	002939	长城证券	32,200	215,740.00	0.07
371	600153	建发股份	24,148	215,641.64	0.07
372	603156	养元饮品	10,100	214,827.00	0.07
373	000728	国元证券	35,210	213,372.60	0.07
374	688099	晶晨股份	3,592	213,077.44	0.07
375	600157	永泰能源	180,100	212,518.00	0.07
376	000783	长江证券	43,900	212,037.00	0.07
377	002739	万达电影	17,500	211,575.00	0.07
378	688082	盛美上海	2,500	211,275.00	0.07
379	600583	海油工程	35,747	211,264.77	0.07
380	002185	华天科技	25,900	211,085.00	0.07

381	000738	航发控制	10,500	210,735.00	0.07
382	002152	广电运通	20,100	210,246.00	0.07
383	600536	中国软件	7,010	209,739.20	0.07
384	688728	格科微	17,242	208,800.62	0.07
385	601198	东兴证券	26,200	208,552.00	0.07
386	688122	西部超导	5,426	207,924.32	0.07
387	002603	以岭药业	13,520	207,261.60	0.07
388	603893	瑞芯微	3,500	207,095.00	0.07
389	601866	中远海发	80,100	206,658.00	0.07
390	002456	欧菲光	26,400	206,184.00	0.07
391	000703	恒逸石化	29,080	206,177.20	0.07
392	000683	远兴能源	29,700	205,227.00	0.07
393	002465	海格通信	19,800	205,128.00	0.07
394	600521	华海药业	12,010	204,770.50	0.07
395	002602	世纪华通	59,240	203,193.20	0.07
396	601696	中银证券	22,300	202,484.00	0.07
397	603596	伯特利	5,180	201,502.00	0.07
398	000960	锡业股份	13,000	201,370.00	0.07
399	002414	高德红外	33,970	200,083.30	0.07
400	603589	口子窖	5,100	199,869.00	0.07
401	000729	燕京啤酒	22,600	199,558.00	0.07
402	300251	光线传媒	23,700	199,317.00	0.07
403	002372	伟星新材	12,800	197,376.00	0.07
404	600549	厦门钨业	11,400	196,650.00	0.07
405	600298	安琪酵母	7,036	196,515.48	0.07
406	600998	九州通	40,213	196,239.44	0.07
407	000800	一汽解放	25,000	195,750.00	0.07
408	603885	吉祥航空	17,800	195,622.00	0.07
409	000733	振华科技	4,700	195,191.00	0.07
410	002262	恩华药业	8,200	194,668.00	0.07
411	000513	丽珠集团	5,200	193,492.00	0.07
412	600369	西南证券	53,900	192,962.00	0.07
413	600486	扬农化工	3,410	192,494.50	0.07
414	002821	凯莱英	2,920	192,136.00	0.07
415	603529	爱玛科技	7,000	191,310.00	0.07
416	600511	国药股份	6,200	190,898.00	0.06
417	002831	裕同科技	7,400	189,366.00	0.06
418	601880	辽港股份	152,600	187,698.00	0.06
419	000937	冀中能源	28,000	187,600.00	0.06
420	300146	汤臣倍健	13,800	186,990.00	0.06
421	601456	国联证券	19,300	186,052.00	0.06
422	603345	安井食品	2,500	185,775.00	0.06
423	688538	和辉光电	93,583	185,294.34	0.06

424	000629	钒钛股份	73,800	184,500.00	0.06
425	002202	金风科技	27,286	183,361.92	0.06
426	600704	物产中大	42,100	182,714.00	0.06
427	300454	深信服	3,600	181,908.00	0.06
428	002120	韵达股份	23,485	181,773.90	0.06
429	600004	白云机场	19,100	181,068.00	0.06
430	300487	蓝晓科技	4,300	179,568.00	0.06
431	600378	昊华科技	6,200	179,180.00	0.06
432	300496	中科创达	3,900	177,801.00	0.06
433	000009	中国宝安	20,600	177,160.00	0.06
434	600848	上海临港	19,340	176,187.40	0.06
435	600598	北大荒	14,100	176,109.00	0.06
436	300037	新宙邦	6,160	175,929.60	0.06
437	603000	人民网	8,800	175,912.00	0.06
438	002850	科达利	2,300	175,674.00	0.06
439	002080	中材科技	13,600	175,440.00	0.06
440	002841	视源股份	5,939	175,378.67	0.06
441	600699	均胜电子	11,800	174,876.00	0.06
442	300957	贝泰妮	3,600	173,952.00	0.06
443	002430	杭氧股份	7,800	173,550.00	0.06
444	600673	东阳光	24,400	171,776.00	0.06
445	002797	第一创业	33,600	171,024.00	0.06
446	300144	宋城演艺	21,120	169,593.60	0.06
447	603290	斯达半导	1,960	168,775.60	0.06
448	600839	四川长虹	37,400	167,926.00	0.06
449	600380	健康元	15,000	167,550.00	0.06
450	688114	华大智造	3,525	167,120.25	0.06
451	300699	光威复材	6,720	166,857.60	0.06
452	000723	美锦能源	35,000	166,600.00	0.06
453	000987	越秀资本	33,426	165,792.96	0.06
454	002508	老板电器	7,500	165,750.00	0.06
455	600754	锦江酒店	7,200	165,456.00	0.06
456	002517	恺英网络	17,300	165,215.00	0.06
457	600072	中船科技	12,200	164,944.00	0.06
458	002056	横店东磁	13,200	164,604.00	0.06
459	002738	中矿资源	6,136	164,444.80	0.06
460	600637	东方明珠	27,000	164,160.00	0.06
461	002756	永兴材料	4,570	163,514.60	0.06
462	600655	豫园股份	31,000	159,650.00	0.05
463	600977	中国电影	14,800	159,248.00	0.05
464	600702	舍得酒业	2,800	158,676.00	0.05
465	000709	河钢股份	81,700	158,498.00	0.05
466	600705	中航产融	69,800	154,956.00	0.05

467	600779	水井坊	4,093	154,019.59	0.05
468	000825	太钢不锈	45,500	153,790.00	0.05
469	300347	泰格医药	3,150	153,090.00	0.05
470	600170	上海建工	70,300	151,145.00	0.05
471	601162	天风证券	68,500	149,330.00	0.05
472	600884	杉杉股份	18,200	147,784.00	0.05
473	603728	鸣志电器	3,600	144,828.00	0.05
474	600563	法拉电子	1,900	144,742.00	0.05
475	300142	沃森生物	12,674	144,230.12	0.05
476	300763	锦浪科技	3,400	141,576.00	0.05
477	600166	福田汽车	62,900	141,525.00	0.05
478	600872	中炬高新	6,193	140,519.17	0.05
479	300601	康泰生物	8,900	138,929.00	0.05
480	603688	石英股份	4,650	137,686.50	0.05
481	600732	爱旭股份	14,500	131,225.00	0.04
482	002271	东方雨虹	10,600	130,804.00	0.04
483	603233	大参林	9,038	129,243.40	0.04
484	603077	和邦生物	69,900	115,335.00	0.04
485	603882	金域医学	4,000	108,760.00	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

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	301589	诺瓦星云	533	100,209.33	0.03
2	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.01
3	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.01
4	688692	达梦数据	112	19,592.16	0.01
5	301536	星辰科技	481	15,521.87	0.01
6	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.00
7	301565	中仑新材	711	13,494.78	0.00
8	301580	爱迪特	183	12,065.19	0.00
9	688709	成都华微	585	10,992.15	0.00
10	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
11	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
12	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
13	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
14	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
15	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
16	688584	上海合晶	461	7,325.29	0.00
17	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
18	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00

19	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
20	603341	龙旗科技	146	5,473.54	0.00
21	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
22	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
23	603344	星德胜	179	4,056.14	0.00
24	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
25	603325	博隆技术	47	3,198.82	0.00
26	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
27	603381	永臻股份	125	3,141.25	0.00
28	001379	腾达科技	213	2,871.24	0.00
29	603375	盛景微	72	2,800.80	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000333	美的集团	1,878,922.00	0.61
2	600519	贵州茅台	1,000,742.00	0.33
3	300750	宁德时代	505,370.88	0.17
4	001965	招商公路	422,249.00	0.14
5	000708	中信特钢	414,003.00	0.14
6	688041	海光信息	336,718.63	0.11
7	601567	三星医疗	324,459.00	0.11
8	000921	海信家电	308,285.00	0.10
9	603979	金诚信	283,795.00	0.09
10	601881	中国银河	276,000.00	0.09
11	300760	迈瑞医疗	262,453.00	0.09
12	601666	平煤股份	262,438.00	0.09
13	600282	南钢股份	259,829.00	0.08
14	002085	万丰奥威	258,773.00	0.08
15	688114	华大智造	251,259.68	0.08
16	600582	天地科技	240,902.00	0.08
17	600968	海油发展	231,732.00	0.08
18	000858	五粮液	217,960.00	0.07
19	600036	招商银行	212,881.00	0.07
20	600900	长江电力	198,181.00	0.06

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

### 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	645,892.00	0.21
2	300760	迈瑞医疗	322,903.00	0.11
3	000858	五粮液	319,259.00	0.10
4	301565	中仑新材	303,429.00	0.10
5	688692	达梦数据	301,551.40	0.10
6	002594	比亚迪	232,473.00	0.08
7	002244	滨江集团	220,074.00	0.07
8	000568	泸州老窖	208,824.00	0.07
9	601155	新城控股	198,372.00	0.06
10	301536	星宸科技	196,228.92	0.06
11	603737	三棵树	195,089.82	0.06
12	300724	捷佳伟创	194,022.00	0.06
13	601933	永辉超市	192,720.00	0.06
14	002568	百润股份	192,704.60	0.06
15	601615	明阳智能	191,512.00	0.06
16	002138	顺络电子	187,285.00	0.06
17	000069	华侨城 A	184,849.00	0.06
18	002299	圣农发展	176,701.00	0.06
19	600606	绿地控股	176,156.00	0.06
20	000021	深科技	175,726.00	0.06

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

### 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	21,988,845.44
卖出股票收入（成交）总额	25,838,521.57

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

### 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。

### 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。

### 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，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等，主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

## 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

无。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。如是，还应对相关证券的投资决策程序做出说明

本基金投资的前十名证券的发行主体中，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；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的处罚。除上述证券的发行主体外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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

### 7.12.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。如是，

## 还应对相关股票的投资决策程序做出说明

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

### 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（元）
1	存出保证金	370,863.38
2	应收清算款	380,263.60
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	751,126.98

### 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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	301589	诺瓦星云	100,209.33	0.03	新股锁定期
2	603285	键邦股份	24,002.55	0.01	新股未上市
3	603350	安乃达	21,608.56	0.01	新股未上市
4	688692	达梦数据	19,592.16	0.01	新股锁定期
5	301536	星辰科技	15,521.87	0.01	新股锁定期

## § 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	MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证

						券投资基金发起式联接基金	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
2,939	95,875.39	65,240,771.00	23.15%	100,968,804.00	35.83%	115,568,200.00	41.01%

## 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	上海浦东发展银行股份有限公司-兴证全球积极配置三年封闭运作混合型基金中基金(FOF)	50,277,900.00	17.84%
2	广发证券股份有限公司	3,082,901.00	1.09%
3	中国民生银行股份有限公司-兴证全球优选平衡三个月持有期混合型基金中基金(FOF)	2,602,400.00	0.92%
4	周诣鑫	2,295,300.00	0.81%
5	余开胜	2,000,000.00	0.71%
6	中信证券股份有限公司	1,972,081.00	0.70%
7	刘曙峰	1,938,800.00	0.69%
8	吴美兰	1,933,100.00	0.69%
9	杨敏锋	1,538,500.00	0.55%
10	王少云	1,500,000.00	0.53%
11	中国银行股份有限公司—MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	115,568,200.00	41.01%

注：持有人名称与注册登记机构持有人名册保持一致。

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

## 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

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

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2018 年 4 月 3 日)基金份额总额	1,309,777,775.00
本报告期期初基金份额总额	297,777,775.00
本报告期基金总申购份额	6,000,000.00
减：报告期基金总赎回份额	22,000,000.00
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	281,777,775.00

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期本基金无基金份额持有人大会决议。

### 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

本报告期内，本基金的基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，经中国银行股份有限公司研究决定，郭德秋先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 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，无涉及基金管理人主营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 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	
中泰证券	2	33,015,351.63	71.08%	3,301.37	71.08%	-
国投证券	1	12,142,435.73	26.14%	1,214.62	26.15%	-
华泰证券	2	1,287,542.42	2.77%	128.76	2.77%	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-

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

#### A：选择标准

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

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

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

#### C：报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

新增交易单元：

无

减少交易单元：

无

### 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
中泰证券	15,384.69	64.40%	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	8,505.48	35.60%	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

## 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	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-02-02
2	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-02-24
3	南方基金管理股份有限公司旗下部分ETF增加联储证券为一级交易商的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-03-13
4	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-03-29
5	南方基金管理股份有限公司旗下部分ETF增加国金证券为一级交易商的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-04-16
6	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-05-30
7	南方基金管理股份有限公司关于终止北京中期时代基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-06-20

## § 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
联接基金	1	20240101-20240630	118,369,800.00	-	2,801,600.00	115,568,200.00	41.01%

#### 产品特有风险

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

注：申购份额包含红利再投资和份额折算。

## 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、中国证监会批准设立 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金的文件；
- 2、《MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告；
- 6、《MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金 2024 年中期报告》原文。

### 12.2 存放地点

深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼。

### 12.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>