

---

# 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 2019 年半年度报告

2019 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：2019 年 8 月 23 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。本半年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 21 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 2019 年 1 月 1 日起至 2019 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	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	11
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	12
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	12
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>13</b>
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>33</b>
7.1 期末基金资产组合情况	33
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	33
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	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	42
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	42

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.....	42
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.....	43
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.....	43
7.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	43
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	43
7.12	投资组合报告附注.....	43
<b>§ 8</b>	<b>基金份额持有人信息.....</b>	<b>44</b>
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	44
8.2	期末上市基金前十名持有人.....	45
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	45
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.....	45
<b>§ 9</b>	<b>开放式基金份额变动.....</b>	<b>45</b>
<b>§ 10</b>	<b>重大事件揭示.....</b>	<b>45</b>
10.1	基金份额持有人大会决议.....	45
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.....	46
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	46
10.4	基金投资策略的改变.....	46
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	46
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.....	46
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	46
10.8	其他重大事件.....	51
<b>§ 11</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>52</b>
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.....	52
11.2	影响投资者决策的其他重要信息.....	53
<b>§ 12</b>	<b>备查文件目录.....</b>	<b>53</b>
12.1	备查文件目录.....	53
12.2	存放地点.....	53
12.3	查阅方式.....	53

## §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
基金主代码	512280
交易代码	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	548,005,740.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2018 年 5 月 25 日

### 2.2 基金产品说明

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

## 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
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.igwfm.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人的办公场所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
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(2019年1月1日-2019年6月30日)
本期已实现收益	105,037,245.12
本期利润	280,046,752.50
加权平均基金份额本期利润	0.3111
本期加权平均净值利润率	32.89%
本期基金份额净值增长率	26.62%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配利润	15,838,007.61
期末可供分配基金份额利润	0.0289
期末基金资产净值	563,843,747.61
期末基金份额净值	1.0289
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)
基金份额累计净值增长率	2.89%

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。

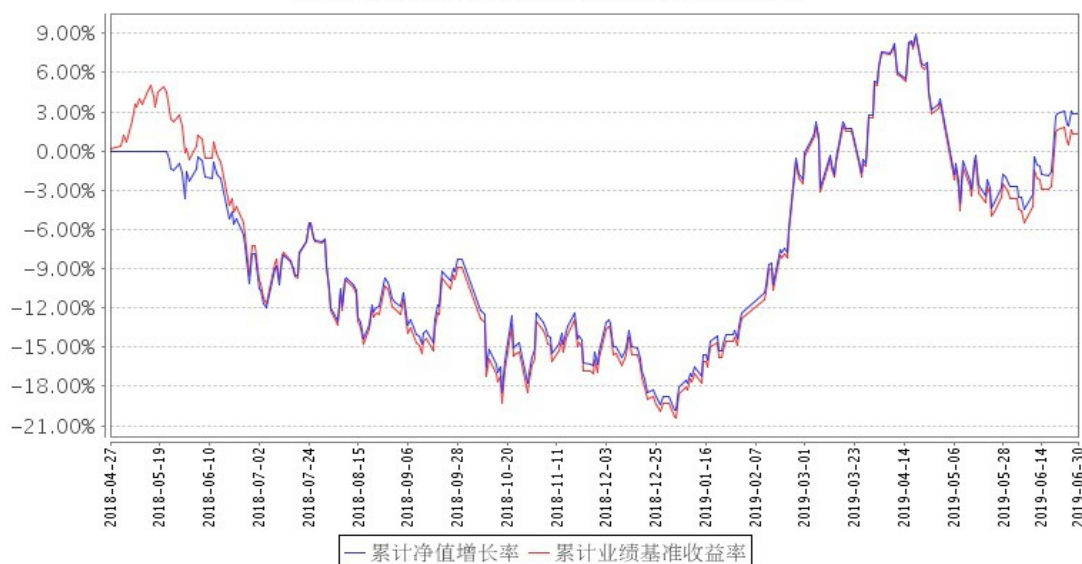
## 3.2 基金净值表现

### 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	5.80%	1.11%	5.11%	1.13%	0.69%	-0.02%
过去三个月	0.10%	1.45%	-1.25%	1.48%	1.35%	-0.03%
过去六个月	26.62%	1.48%	25.50%	1.51%	1.12%	-0.03%
过去一年	11.70%	1.47%	9.19%	1.51%	2.51%	-0.04%
自基金合同生效起至今	2.89%	1.41%	1.30%	1.45%	1.59%	-0.04%

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

景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通 ETF（场内简称：景顺 MSCI）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“公司”或“本公司”）是经中国证监会



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。

截至 2019 年 6 月 30 日，景顺长城基金管理有限公司旗下共管理 75 只开放式基金，包括景顺长城景系列开放式证券投资基金、景顺长城内需增长混合型证券投资基金、景顺长城鼎益混合型证券投资基金(LOF)、景顺长城资源垄断混合型证券投资基金(LOF)、景顺长城新兴成长混合型证券投资基金、景顺长城内需增长贰号混合型证券投资基金、景顺长城精选蓝筹混合型证券投资基金、景顺长城公司治理混合型证券投资基金、景顺长城能源基建混合型证券投资基金、景顺长城中小盘混合型证券投资基金、景顺长城稳定收益债券型证券投资基金、景顺长城大中华混合型证券投资基金、景顺长城核心竞争力混合型证券投资基金、景顺长城优信增利债券型证券投资基金、景顺长城支柱产业混合型证券投资基金、景顺长城品质投资混合型证券投资基金、景顺长城四季金利债券型证券投资基金、景顺长城策略精选灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景兴信用纯债债券型证券投资基金、景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金、景顺长城景颐双利债券型证券投资基金、景顺长城景益货币市场基金、景顺长城成长之星股票型证券投资基金、景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城优质成长股票型证券投资基金、景顺长城优势企业混合型证券投资基金、景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金、景顺长城中小板创业板精选股票型证券投资基金、景顺长城中证 TMT150 交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城研究精选股票型证券投资基金、景顺长城景丰货币市场基金、景顺长城中国回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城量化精选股票型证券投资基金、景顺长城稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城沪港深精选股票型证券投资基金、景顺长城领先回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城中证 TMT150 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、景顺长城安享回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、景顺长城泰和回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景瑞收益定期开放债券型证券投资基金、景顺长城改革机遇灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景颐宏利债券型证券投资基金、景顺长城景盛双息收益债券型证券投资基金、景顺长城低碳科技主题灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城环保优势股票型证券投资基金、景顺长城量化新动力股票型证券投资基金、景顺长城景盈双利债券型证券投资基金、景顺长城景泰汇利定期开放债券型证券投资基金、景顺长城顺益回报混合型证券投资基金、景顺长城泰安回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景泰丰利纯债债券型证券投资基金、景顺长城景颐丰利债券型证券投资基金、景顺长城政策性金融债债券型证券投资基金、景顺长城中证 500 行业中性低波动指

数型证券投资基金、景顺长城沪港深领先科技股票型证券投资基金、景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金、景顺长城睿成灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景泰稳利定期开放债券型证券投资基金、景顺长城量化平衡灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城泰恒回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城量化小盘股票型证券投资基金、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、景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金、景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金、景顺长城量化先锋混合型证券投资基金、景顺长城景泰聚利纯债债券型证券投资基金、景顺长城景泰鑫利纯债债券型证券投资基金、景顺长城智能生活混合型证券投资基金、景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金、景顺长城集英成长两年定期开放混合型证券投资基金、景顺长城量化港股通股票型证券投资基金、景顺长城景泰盈利纯债债券型证券投资基金。其中景顺长城景系列开放式证券投资基金下设景顺长城优选混合型证券投资基金、景顺长城货币市场证券投资基金、景顺长城动力平衡证券投资基金。

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		
徐喻军	本基金的基金经理、量化及指数投资部总监助理	2018 年 4 月 27 日	-	9	理学硕士。曾担任安信证券风险管理部风险管理专员。2012 年 3 月加入本公司，担任量化及 ETF 投资部 ETF 专员；自 2014 年 4 月起担任量化及指数投资部基金经理，现担任量化及指数投资部总监助理兼基金经理。

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”为根据公司决定聘任后的公告日期，“离任日期”为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。

#### 4.2 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》、《证券投资基金销售管理办法》和《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% 的交易共有 57 次，为公司旗下管理的量化产品因申购赎回情况不一致依据产品合同约定进行的仓位调整，公司旗下指数基金因指数成份股调整，以及量化产品和指数增强基金根据产品合同约定通过量化模型交易从而与其他组合发生的反向交易。投资组合间虽然存在临近交易日同向交易行为，但结合交易时机及市场交易价格波动分析表明投资组合间不存在不公平交易和利益输送的可能性。投资组合间虽然存在相邻反向异常交易，经分析为投资组合开放期内投资者连续赎回导致的被动行为，非不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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

2019 年 6 月工业增加值累计增长 6.0%，增速持平。6 月 PMI 指数 49.4，经济经历短期企稳后再度显示出疲态。6 月 PPI 同比走平，环比下跌 0.3%；CPI 同比上涨 2.7%，环比下跌 0.1%，通胀预期维持平稳。6 月 M2 同比增速 8.5%，M1 同比增速回升至 4.4%，社会融资规模存量同比增长 10.9%，增速维持平稳。6 月末外汇储备 3.1 万亿美元，受贸易摩擦影响，汇率波动加大。年初在稳增长和宽信用的金融政策引导下，伴随着中美贸易摩擦预期改善以及“减税降费”等有利因素影响，市场迎来一波估值修复行情。2 季度开始，美国对华为等公司的禁令超出市场预期，引发投资者对贸易摩擦和科技竞争的担忧，市场在冲高后加速回落进入震荡调整阶段。上半年上证综指、沪深 300 和创业板指数分别上涨 19.45%，27.07% 和 20.87%。

本基金采用完全复制 MSCI 中国 A 股国际通指数的方法进行组合管理，通过控制跟踪误差和跟

踪偏离度，力争基金收益和指数收益基本一致。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2019 年上半年，本基金份额净值增长率为 26.62%，业绩比较基准收益率为 25.50%。报告期内，本基金相对于业绩比较基准的日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2% 以内，跟踪误差（年化）控制在 2% 以内。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2019 年下半年的宏观经济，全球经济面临增长放缓的风险，国内经济仍然存在下行压力。但随着中美贸易摩擦走向缓和，宽信用和稳增长货币政策延续，减税降费的实施，都会对经济基本面有一定支持。长期来看，改革创新是保持经济增长的根本动力，在供给侧改革和产业升级的背景下，我们对经济的长期健康发展持较为乐观的态度。目前市场整体估值仍然处于合理位置，具有较高成长性的行业和较强竞争力的公司，将具备较高的投资价值。

#### 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《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 2019 年 1 月 1 日至 2019 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《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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，景顺长城基金管理有限公司的信息披露事务符合《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半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关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：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：			

银行存款	6.4.7.1	16,897,196.53	21,916,248.40
结算备付金		2,184,320.91	630,477.38
存出保证金		363,206.49	162,531.40
交易性金融资产	6.4.7.2	550,487,007.85	1,091,714,162.51
其中: 股票投资		550,487,007.85	1,091,513,162.51
基金投资		-	-
债券投资		-	201,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		3,683,237.34	4,348,057.65
应收利息	6.4.7.5	4,185.73	5,047.60
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		573,619,154.85	1,118,776,524.94
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
		<b>2019年6月30日</b>	<b>2018年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		7,148,260.22	3,990,304.24
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		236,799.82	464,366.16
应付托管费		47,359.97	92,873.24
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	781,068.08	319,409.57
应交税费		-	0.46
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	1,561,919.15	2,235,919.48
负债合计		9,775,407.24	7,102,873.15
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	548,005,740.00	1,368,005,740.00
未分配利润	6.4.7.10	15,838,007.61	-256,332,088.21
所有者权益合计		563,843,747.61	1,111,673,651.79
负债和所有者权益总计		573,619,154.85	1,118,776,524.94

注: 报告截止日 2019 年 6 月 30 日, 基金份额净值 1.0289 元, 基金份额总额 548,005,740.00 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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 4 月 27 日（基金 合同生效日）至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		285,164,335.87	-109,601,955.06
1. 利息收入		96,743.11	2,332,945.61
其中：存款利息收入	6.4.7.11	96,635.28	2,332,945.61
债券利息收入		107.83	-
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）		107,874,225.32	357,975.28
其中：股票投资收益	6.4.7.12	102,966,273.04	-11,538,062.39
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	126,660.37	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	4,781,291.91	11,896,037.67
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	175,009,507.38	-113,278,519.40
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	2,183,860.06	985,643.45
减：二、费用		5,117,583.37	4,107,448.27
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,128,596.90	1,298,953.04
2. 托管费	6.4.10.2.2	425,719.39	259,790.64
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	2,196,086.12	2,327,076.47
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.08	-
7. 其他费用	6.4.7.19	367,180.88	221,628.12
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		280,046,752.50	-113,709,403.33
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号		280,046,752.50	-113,709,403.33

填列)			
-----	--	--	--

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

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

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,368,005,740.00	-256,332,088.21	1,111,673,651.79
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	280,046,752.50	280,046,752.50
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-820,000,000.00	-7,876,656.68	-827,876,656.68
其中：1. 基金申购款	1,750,000,000.00	-40,527,587.26	1,709,472,412.74
2. 基金赎回款	-2,570,000,000.00	32,650,930.58	-2,537,349,069.42
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	548,005,740.00	15,838,007.61	563,843,747.61
项目	上年度可比期间 2018 年 4 月 27 日（基金合同生效日）至 2018 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,534,005,740.00	-	1,534,005,740.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-113,709,403.33	-113,709,403.33
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-106,000,000.00	993,703.57	-105,006,296.43
其中：1. 基金申购款	592,000,000.00	-10,568,007.34	581,431,992.66
2. 基金赎回款	-698,000,000.00	11,561,710.91	-686,438,289.09
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基	-	-	-



金净值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	1,428,005,740.00	-112,715,699.76	1,315,290,040.24

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

康乐

吴建军

邵媛媛

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2018]548号《关于准予景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》核准，由景顺长城基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式指数基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,533,998,240.00 元（含募集股票市值），业经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）普华永道中天验字（2018）第 283 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]第 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）、股指期货、债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、现金资产以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相

关规定)。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。本基金的业绩比较基准为 MSCI 中国 A 股国际通指数(MSCI China A Inclusion RMB Index (CNY))。

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

本财务报表由本基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司于 2019 年 8 月 21 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》、各项具体会计准则及相关规定(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<年度报告和半年度报告>》、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》、《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 2019 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 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日期间的经营成果和基金净值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。

#### **6.4.5 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。

#### **6.4.6 税项**

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税

[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前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 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

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

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
活期存款	16,897,196.53

定期存款	
其中: 存款期限 1 个月以内	
存款期限 1-3 个月	
存款期限 3 个月至 1 年	
存款期限 1 年以上	
其他存款	
合计	16,897,196.53

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	527,701,403.49	550,487,007.85	22,785,604.36
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	527,701,403.49	550,487,007.85	22,785,604.36

注:于 2019 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-1,397.42 元。

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位: 人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	3,153.97
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	884.61
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-

应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	147.15
合计	4,185.73

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
交易所市场应付交易费用	781,068.08
银行间市场应付交易费用	-
合计	781,068.08

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应退替代款	1,178,991.01
预提费用	146,386.70
应付指数使用费	212,859.64
可退替代款	23,681.80
合计	1,561,919.15

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,368,005,740.00	1,368,005,740.00
本期申购	1,750,000,000.00	1,750,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-2,570,000,000.00	-2,570,000,000.00
- 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	548,005,740.00	548,005,740.00

#### 6.4.7.10 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	-103,658,080.27	-152,674,007.94	-256,332,088.21
本期利润	105,037,245.12	175,009,507.38	280,046,752.50
本期基金份额交易产生的变动数	34,230,698.00	-42,107,354.68	-7,876,656.68
其中：基金申购款	11,396,369.89	-51,923,957.15	-40,527,587.26
基金赎回款	22,834,328.11	9,816,602.47	32,650,930.58
本期已分配利润	-	-	-
本期末	35,609,862.85	-19,771,855.24	15,838,007.61

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
活期存款利息收入	85,964.01
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	8,774.01
其他	1,897.26
合计	96,635.28

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	31,288,501.11
股票投资收益——赎回差价收入	71,677,771.93
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	102,966,273.04

##### 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出股票成交总额	772,324,816.23
减：卖出股票成本总额	741,036,315.12
买卖股票差价收入	31,288,501.11

##### 6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
赎回基金份额对价总额	2,537,349,069.42
减：现金支付赎回款总额	695,848,205.42
减：赎回股票成本总额	1,769,823,092.07
赎回差价收入	71,677,771.93

**6.4.7.13 债券投资收益**

单位: 人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成交总额	1,251,781.20
减: 卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额	1,125,000.00
减: 应收利息总额	120.83
买卖债券差价收入	126,660.37

**6.4.7.14 衍生工具收益**

本基金本报告期内无衍生工具收益。

**6.4.7.15 股利收益**

单位: 人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	4,781,291.91
基金投资产生的股利收益	-
合计	4,781,291.91

**6.4.7.16 公允价值变动收益**

单位: 人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
1. 交易性金融资产	175,009,507.38
股票投资	175,009,507.38
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	175,009,507.38

注: 本基金本会计期间公允价值变动损益—股票投资中包括可退替代款产生的公允价值变动损益—5,262.42元。

**6.4.7.17 其他收入**

单位: 人民币元

项目	本期
----	----

	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	2,183,860.06
合计	2,183,860.06

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

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	2,196,086.12
银行间市场交易费用	-
合计	2,196,086.12

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
审计费用	49,588.57
信息披露费	67,045.35
银行划款手续费	19,085.77
指数使用费	201,348.41
上市费	29,752.78
其他	360.00
合计	367,180.88

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

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。



**6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方**

关联方名称	与本基金的关系
景顺长城基金管理有限公司	基金管理人
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人
长城证券股份有限公司（“长城证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 联接基金”）	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

**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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年4月27日（基金合同生效日） 至2018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	-	-	476,961,807.01	24.00

**6.4.10.1.2 权证交易**

本基金本报告期内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 2019年1月1日至2019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 2018年4月27日（基金合同生效日）至2018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	444,195.89	24.00	444,195.89	24.00

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。权证交易不计佣金。

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

**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 2019年1月1日至2019年6 月30日	上年度可比期间 2018年4月27日（基金合 同生效日）至2018年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,128,596.90	1,298,953.04
其中：支付销售机构的客户维护 费	-	-

注：支付基金管理人景顺长城基金管理有限公司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 2019年1月1日至2019年6 月30日	上年度可比期间 2018年4月27日（基金合 同生效日）至2018年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	425,719.39	259,790.64

注：支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.10% / 当年天数。

**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 各关联方投资本基金的情况****6.4.10.4.1 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。

**6.4.10.4.2 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 2019年6月30日		上年度末 2018年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份 额的比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份 额的比例 (%)
景顺长城MSCI 中国A股国际通 交易型开放式 指数证券投资 基金联接基金	160,000,000.00	29.20	434,000,000.00	31.73

**6.4.10.5 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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年4月27日（基金合同生效日）至 2018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	16,897,196.53	85,964.01	39,391,140.99	758,997.37

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

**6.4.10.6 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。

**6.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

**6.4.11 利润分配情况**

本基金本报告期内无利润分配。

**6.4.12 期末(2019年6月30日)本基金持有的流通受限证券****6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	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
300788	中信出版	2019年6月27日	2019年7月5日	新股流通受限	14.85	14.85	1,556	23,106.60	23,106.60	-
601236	红塔证券	2019年6月26日	2019年7月5日	新股流通受限	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-

**6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本基金本报告期末无暂时停牌等流通受限的股票。

**6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

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

**6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

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

**6.4.13 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員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%。

于本期末，本基金未持有除国债、央行票据、政策性金融债及地方政府债券之外的债券（上年末：0.02%）。

#### **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 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上市公司发行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。

本基金管理人通过由风险管理人员定期监控组合中债券投资部分的利率风险, 及时调整投资组合久期等方法管理利率风险。

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的账面价值, 并按照合同约定的重新定价日或到期日进行了分类。

**6.4.13.4.1.1 利率风险敞口**

单位: 人民币元

本期末 2019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
<b>资产</b>							
银行存款	16,897,196.53	-	-	-	-	-	16,897,196.53
结算备付金	2,184,320.91	-	-	-	-	-	2,184,320.91
存出保证金	363,206.49	-	-	-	-	-	363,206.49
交易性金融资产	-	-	-	-	-	550,487,007.85	550,487,007.85
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	4,185.73	4,185.73
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	3,683,237.34	3,683,237.34
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
<b>资产总计</b>	<b>19,444,723.93</b>	-	-	-	-	<b>554,174,430.92</b>	<b>573,619,154.85</b>
<b>负债</b>							
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	236,799.82	236,799.82
应付托管费	-	-	-	-	-	47,359.97	47,359.97
应付证券清算款	-	-	-	-	-	7,148,260.22	7,148,260.22
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	781,068.08	781,068.08
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	1,561,919.15	1,561,919.15
<b>负债总计</b>	-	-	-	-	-	<b>9,775,407.24</b>	<b>9,775,407.24</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>19,444,723.93</b>	-	-	-	-	-	-
<b>上年度末</b>							
<b>2018年12月31日</b>	<b>1个月以内</b>	<b>1-3个月</b>	<b>3个月-1年</b>	<b>1-5年</b>	<b>5年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
<b>资产</b>							
银行存款	21,916,248.40	-	-	-	-	-	21,916,248.40

结算备付金	630,477.38	-	-	-	-	630,477.38
存出保证金	162,531.40	-	-	-	-	162,531.40
交易性金融资产				201,000.00	1,091,513,162.51	1,091,714,162.51
买入返售金融资产						
应收利息					5,047.60	5,047.60
应收股利						
应收申购款						
应收证券清算款					4,348,057.65	4,348,057.65
其他资产						
资产总计	22,709,257.18	-	-	-	201,000.00	1,095,866,267.76
负债						
卖出回购金融资产款						
应付赎回款						
应付管理人报酬					464,366.16	464,366.16
应付托管费					92,873.24	92,873.24
应付证券清算款					3,990,304.24	3,990,304.24
应付销售服务费						
应付交易费用					319,409.57	319,409.57
应付利息						
应交税费					0.46	0.46
应付利润						
其他负债					2,235,919.48	2,235,919.48
负债总计					7,102,873.15	7,102,873.15
利率敏感度缺口	22,709,257.18	-	-	-	201,000.00	-

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末，本基金持有的债券资产的账面价值占资产净值比例为 0.00%（上年末：0.02%），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。本基金持有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，所面临的重大价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。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。

经测算本基金面临的其他价格风险列示如下：

#### 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 2019年6月30日		上年度末 2018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	550,487,007.85	97.63	1,091,513,162.51	98.19
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
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	550,487,007.85	97.63	1,091,513,162.51	98.19

#### 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（2019年6月30日）	上年度末（2018年12月31日）
	沪深 300 指数上升 5%	26,867,128.33	51,976,269.05
	沪深 300 指数下降 5%	-26,867,128.33	-51,976,269.05

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 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。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2019 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 550,430,031.31 元，属于第二层次的余额为 56,976.54 元，无属于第三层次的余额（2018 年 12 月 31 日，第一层次的余额为 1,080,758,730.71 元，属于第二层次的余额为



10,955,431.80 元，无属于第三层次的余额。)

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2019 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2018 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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。

(2) 基金申购款

于 2019 年上半年度，本基金申购基金份额的对价总额为 1,709,472,412.74 元，其中包括以股票支付的申购款 1,169,015,989.73 元和以现金支付的申购款 540,456,423.01 元（于 2018 年上半年度，本基金申购基金份额的对价总额为 581,431,992.66 元，其中包括以股票支付的申购款 403,222,525.09 元和以现金支付的申购款 178,209,467.57 元）。

(3) 其他

除公允价值和基金申购款外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §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	550,487,007.85	95.97
	其中：股票	550,487,007.85	95.97
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	19,081,517.44	3.33
8	其他各项资产	4,050,629.56	0.71
9	合计	573,619,154.85	100.00

注: 本表权益投资股票项中, 含可退替代款估值增值-1,397.42 元, 而 7.2 中不含可退替代款估值增值, 因此二者存在差异。

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	7,238,955.00	1.28
B	采矿业	20,876,588.17	3.70
C	制造业	215,267,790.51	38.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	15,693,502.80	2.78
E	建筑业	16,298,249.90	2.89
F	批发和零售业	10,302,210.20	1.83
G	交通运输、仓储和邮政业	15,128,566.60	2.68
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	22,912,806.84	4.06
J	金融业	182,417,794.51	32.35
K	房地产业	27,698,431.51	4.91
L	租赁和商务服务业	7,702,747.40	1.37
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	455,094.00	0.08
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	4,500,491.00	0.80
R	文化、体育和娱乐业	3,358,258.00	0.60
S	综合	-	-
	合计	549,851,486.44	97.52

### 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

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	363,431.25	0.06

C	制造业	176,907.28	0.03
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	39,603.76	0.01
J	金融业	33,869.94	0.01
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	23,106.60	0.00
S	综合	-	-
	合计	636,918.83	0.11

### 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	34,120	33,574,080.00	5.95
2	601318	中国平安	289,711	25,671,291.71	4.55
3	600036	招商银行	549,478	19,770,218.44	3.51
4	000858	五粮液	103,600	12,219,620.00	2.17
5	601166	兴业银行	555,200	10,154,608.00	1.80
6	600000	浦发银行	779,600	9,105,728.00	1.61
7	601398	工商银行	1,433,200	8,441,548.00	1.50
8	600276	恒瑞医药	118,065	7,792,290.00	1.38
9	000002	万科A	258,585	7,191,248.85	1.28
10	601288	农业银行	1,977,500	7,119,000.00	1.26
11	600900	长江电力	385,612	6,902,454.80	1.22
12	002415	海康威视	245,915	6,782,335.70	1.20
13	601668	中国建筑	1,132,960	6,514,520.00	1.16

14	601328	交通银行	1,043,800	6,388,056.00	1.13
15	603288	海天味业	60,151	6,315,855.00	1.12
16	000001	平安银行	449,000	6,187,220.00	1.10
17	600030	中信证券	256,600	6,109,646.00	1.08
18	601601	中国太保	164,700	6,013,197.00	1.07
19	600016	民生银行	920,160	5,843,016.00	1.04
20	600887	伊利股份	156,845	5,240,191.45	0.93
21	600104	上汽集团	201,300	5,133,150.00	0.91
22	601766	中国中车	630,630	5,101,796.70	0.90
23	300498	温氏股份	141,700	5,081,362.00	0.90
24	600050	中国联通	814,100	5,014,856.00	0.89
25	002304	洋河股份	38,813	4,718,108.28	0.84
26	000333	美的集团	90,486	4,692,603.96	0.83
27	601888	中国国旅	50,000	4,432,500.00	0.79
28	000651	格力电器	78,429	4,313,595.00	0.77
29	600585	海螺水泥	103,800	4,307,700.00	0.76
30	600048	保利地产	319,800	4,080,648.00	0.72
31	601818	光大银行	1,037,500	3,952,875.00	0.70
32	601688	华泰证券	168,809	3,767,816.88	0.67
33	600028	中国石化	665,100	3,638,097.00	0.65
34	601211	国泰君安	198,028	3,633,813.80	0.64
35	001979	招商蛇口	170,500	3,563,450.00	0.63
36	601229	上海银行	286,426	3,394,148.10	0.60
37	601988	中国银行	895,000	3,347,300.00	0.59
38	002142	宁波银行	136,200	3,301,488.00	0.59
39	601169	北京银行	553,400	3,270,594.00	0.58
40	601989	中国重工	585,553	3,255,674.68	0.58
41	600019	宝钢股份	485,256	3,154,164.00	0.56
42	000568	泸州老窖	38,935	3,147,116.05	0.56
43	601006	大秦铁路	387,100	3,131,639.00	0.56
44	000725	京东方 A	892,900	3,071,576.00	0.54
45	601186	中国铁建	305,422	3,038,948.90	0.54
46	000063	中兴通讯	93,000	3,025,290.00	0.54
47	600837	海通证券	213,124	3,024,229.56	0.54
48	601336	新华保险	54,955	3,024,173.65	0.54
49	601857	中国石油	418,449	2,878,929.12	0.51
50	002024	苏宁易购	246,900	2,834,412.00	0.50
51	600690	青岛海尔	156,400	2,704,156.00	0.48
52	002475	立讯精密	108,740	2,695,664.60	0.48
53	600031	三一重工	203,100	2,656,548.00	0.47
54	601933	永辉超市	255,708	2,610,778.68	0.46

55	600015	华夏银行	335,118	2,580,408.60	0.46
56	600340	华夏幸福	77,400	2,520,918.00	0.45
57	300015	爱尔眼科	80,940	2,506,711.80	0.44
58	600999	招商证券	144,800	2,474,632.00	0.44
59	000166	申万宏源	489,100	2,450,391.00	0.43
60	002594	比亚迪	47,720	2,420,358.40	0.43
61	000538	云南白药	28,500	2,377,470.00	0.42
62	300059	东方财富	172,900	2,342,795.00	0.42
63	601088	中国神华	114,330	2,330,045.40	0.41
64	601155	新城控股	57,000	2,269,170.00	0.40
65	600406	国电南瑞	120,094	2,238,552.16	0.40
66	601012	隆基股份	96,020	2,219,022.20	0.39
67	600919	江苏银行	302,200	2,193,972.00	0.39
68	002714	牧原股份	36,700	2,157,593.00	0.38
69	000776	广发证券	156,300	2,147,562.00	0.38
70	600009	上海机场	25,100	2,102,878.00	0.37
71	601628	中国人寿	72,900	2,064,528.00	0.37
72	600010	包钢股份	1,217,600	2,057,744.00	0.36
73	601225	陕西煤业	220,700	2,039,268.00	0.36
74	002027	分众传媒	385,260	2,038,025.40	0.36
75	000876	新希望	113,601	1,973,249.37	0.35
76	000338	潍柴动力	159,200	1,956,568.00	0.35
77	600547	山东黄金	47,400	1,951,458.00	0.35
78	300760	迈瑞医疗	11,600	1,893,120.00	0.34
79	601985	中国核电	339,500	1,887,620.00	0.33
80	601009	南京银行	226,566	1,871,435.16	0.33
81	601939	建设银行	250,600	1,864,464.00	0.33
82	002230	科大讯飞	55,400	1,841,496.00	0.33
83	600741	华域汽车	84,200	1,818,720.00	0.32
84	603993	洛阳钼业	459,000	1,817,640.00	0.32
85	000895	双汇发展	71,500	1,779,635.00	0.32
86	600436	片仔癀	15,304	1,763,020.80	0.31
87	600588	用友网络	65,483	1,760,183.04	0.31
88	601669	中国电建	328,400	1,737,236.00	0.31
89	600029	南方航空	224,500	1,733,140.00	0.31
90	600958	东方证券	157,900	1,686,372.00	0.30
91	601899	紫金矿业	447,100	1,685,567.00	0.30
92	600115	东方航空	257,800	1,616,406.00	0.29
93	600809	山西汾酒	22,700	1,567,435.00	0.28
94	600018	上港集团	227,100	1,548,822.00	0.27
95	600332	白云山	37,526	1,537,440.22	0.27

96	300122	智飞生物	35,300	1,521,430.00	0.27
97	000069	华侨城 A	215,000	1,494,250.00	0.27
98	600606	绿地控股	212,600	1,452,058.00	0.26
99	600570	恒生电子	21,230	1,446,824.50	0.26
100	600438	通威股份	101,768	1,430,858.08	0.25
101	002736	国信证券	108,700	1,430,492.00	0.25
102	601618	中国中冶	466,400	1,417,856.00	0.25
103	601901	方正证券	199,000	1,414,890.00	0.25
104	300033	同花顺	14,100	1,386,876.00	0.25
105	600886	国投电力	177,400	1,378,398.00	0.24
106	600352	浙江龙盛	86,900	1,370,413.00	0.24
107	601600	中国铝业	344,600	1,350,832.00	0.24
108	600383	金地集团	112,962	1,347,636.66	0.24
109	600893	航发动力	59,082	1,341,752.22	0.24
110	600196	复星医药	52,504	1,328,351.20	0.24
111	601877	正泰电器	56,600	1,306,894.00	0.23
112	600795	国电电力	511,200	1,298,448.00	0.23
113	300750	宁德时代	18,515	1,275,313.20	0.23
114	600705	中航资本	234,000	1,268,280.00	0.22
115	600061	国投资本	90,100	1,262,301.00	0.22
116	600111	北方稀土	96,403	1,237,814.52	0.22
117	601138	工业富联	102,457	1,234,606.85	0.22
118	600703	三安光电	109,200	1,231,776.00	0.22
119	000100	TCL 集团	359,400	1,196,802.00	0.21
120	600660	福耀玻璃	52,600	1,195,598.00	0.21
121	601788	光大证券	104,100	1,188,822.00	0.21
122	601377	兴业证券	176,100	1,186,914.00	0.21
123	000963	华东医药	44,717	1,160,853.32	0.21
124	002202	金风科技	91,884	1,142,118.12	0.20
125	000783	长江证券	145,800	1,138,698.00	0.20
126	002422	科伦药业	38,300	1,138,659.00	0.20
127	002236	大华股份	78,300	1,136,916.00	0.20
128	000768	中航飞机	72,100	1,135,575.00	0.20
129	600926	杭州银行	134,400	1,119,552.00	0.20
130	600271	航天信息	48,202	1,111,056.10	0.20
131	601727	上海电气	205,700	1,106,666.00	0.20
132	300142	沃森生物	38,400	1,089,024.00	0.19
133	002146	荣盛发展	114,400	1,074,216.00	0.19
134	300003	乐普医疗	46,100	1,061,222.00	0.19
135	002352	顺丰控股	31,086	1,055,680.56	0.19
136	600085	同仁堂	36,105	1,047,045.00	0.19

137	601021	春秋航空	23,000	1,035,000.00	0.18
138	000157	中联重科	171,300	1,029,513.00	0.18
139	600674	川投能源	115,600	1,028,840.00	0.18
140	002044	美年健康	82,180	1,022,319.20	0.18
141	000703	恒逸石化	74,100	1,012,206.00	0.18
142	601108	财通证券	90,800	996,984.00	0.18
143	600482	中国动力	42,038	992,937.56	0.18
144	601111	中国国航	103,700	992,409.00	0.18
145	300124	汇川技术	43,125	987,993.75	0.18
146	600346	恒力石化	79,960	972,313.60	0.17
147	300347	泰格医药	12,600	971,460.00	0.17
148	600297	广汇汽车	215,600	961,576.00	0.17
149	600637	东方明珠	91,150	960,721.00	0.17
150	600489	中金黄金	90,815	932,670.05	0.17
151	002673	西部证券	91,742	924,759.36	0.16
152	002493	荣盛石化	76,600	923,796.00	0.16
153	000425	徐工机械	205,100	914,746.00	0.16
154	601607	上海医药	49,900	905,685.00	0.16
155	300144	宋城演艺	39,000	902,460.00	0.16
156	300408	三环集团	45,800	890,810.00	0.16
157	600516	方大炭素	72,253	887,989.37	0.16
158	600600	青岛啤酒	17,782	887,855.26	0.16
159	601998	中信银行	148,200	884,754.00	0.16
160	000656	金科股份	144,800	873,144.00	0.15
161	603833	欧派家居	8,105	872,260.10	0.15
162	601919	中远海控	172,802	867,466.04	0.15
163	300601	康泰生物	16,500	866,250.00	0.15
164	601198	东兴证券	72,600	862,488.00	0.15
165	600362	江西铜业	54,100	851,534.00	0.15
166	002153	石基信息	23,127	836,966.13	0.15
167	600688	上海石化	161,046	830,997.36	0.15
168	601992	金隅集团	220,800	830,208.00	0.15
169	600867	通化东宝	53,900	830,060.00	0.15
170	000709	河钢股份	276,500	826,735.00	0.15
171	000728	国元证券	90,000	825,300.00	0.15
172	601838	成都银行	92,900	820,307.00	0.15
173	601555	东吴证券	79,630	816,207.50	0.14
174	601800	中国交建	72,100	816,172.00	0.14
175	600875	东方电气	74,300	789,066.00	0.14
176	600109	国金证券	79,900	776,628.00	0.14
177	601117	中国化学	129,000	776,580.00	0.14

178	300450	先导智能	23,100	776,160.00	0.14
179	600011	华能国际	124,300	774,389.00	0.14
180	601360	三六零	36,011	769,915.18	0.14
181	002241	歌尔股份	86,600	769,874.00	0.14
182	002466	天齐锂业	30,380	768,006.40	0.14
183	600066	宇通客车	58,600	762,972.00	0.14
184	002555	三七互娱	56,200	761,510.00	0.14
185	601216	君正集团	231,300	760,977.00	0.13
186	300413	芒果超媒	18,400	755,320.00	0.13
187	000999	华润三九	25,700	754,038.00	0.13
188	600068	葛洲坝	120,600	751,338.00	0.13
189	000413	东旭光电	145,300	746,842.00	0.13
190	000050	深天马 A	55,400	744,576.00	0.13
191	601997	贵阳银行	84,855	733,995.75	0.13
192	002081	金螳螂	70,200	723,762.00	0.13
193	600487	亨通光电	42,700	715,652.00	0.13
194	002926	华西证券	67,500	708,750.00	0.13
195	600760	中航沈飞	24,396	708,215.88	0.13
196	600398	海澜之家	78,000	707,460.00	0.13
197	600642	申能股份	117,400	705,574.00	0.13
198	600089	特变电工	97,144	704,294.00	0.12
199	600188	兖州煤业	64,600	702,202.00	0.12
200	600208	新湖中宝	223,500	701,790.00	0.12
201	300017	网宿科技	65,100	701,778.00	0.12
202	600118	中国卫星	31,100	701,305.00	0.12
203	000627	天茂集团	107,400	697,026.00	0.12
204	002460	赣锋锂业	29,550	692,356.50	0.12
205	601238	广汽集团	63,180	690,557.40	0.12
206	000938	紫光股份	25,328	690,188.00	0.12
207	000625	长安汽车	103,611	686,940.93	0.12
208	000423	东阿阿胶	17,100	680,922.00	0.12
209	600816	安信信托	134,500	679,225.00	0.12
210	002508	老板电器	25,000	678,500.00	0.12
211	000630	铜陵有色	274,600	675,516.00	0.12
212	600027	华电国际	178,700	673,699.00	0.12
213	600583	海油工程	119,700	670,320.00	0.12
214	600153	建发股份	74,290	659,695.20	0.12
215	002558	巨人网络	36,100	655,937.00	0.12
216	002180	纳思达	28,500	644,100.00	0.11
217	002010	传化智联	85,400	643,062.00	0.11
218	600256	广汇能源	180,100	641,156.00	0.11



219	600977	中国电影	40,900	640,494.00	0.11
220	600535	天士力	38,600	638,830.00	0.11
221	600909	华安证券	95,900	627,186.00	0.11
222	002384	东山精密	42,700	622,139.00	0.11
223	601699	潞安环能	77,800	617,732.00	0.11
224	000402	金融街	78,000	611,520.00	0.11
225	300433	蓝思科技	87,600	610,572.00	0.11
226	002500	山西证券	74,400	602,640.00	0.11
227	600998	九州通	48,600	600,696.00	0.11
228	002385	大北农	113,500	600,415.00	0.11
229	002797	第一创业	94,300	597,862.00	0.11
230	603799	华友钴业	28,008	596,850.48	0.11
231	002195	二三四五	153,261	596,185.29	0.11
232	002624	完美世界	23,034	594,507.54	0.11
233	603858	步长制药	22,990	592,452.30	0.11
234	600372	中航电子	39,900	592,116.00	0.11
235	002465	海格通信	61,800	589,572.00	0.10
236	600415	小商品城	143,000	589,160.00	0.10
237	601098	中南传媒	46,100	582,704.00	0.10
238	002065	东华软件	82,400	575,976.00	0.10
239	601866	中远海发	209,200	569,024.00	0.10
240	600739	辽宁成大	39,100	568,514.00	0.10
241	002456	欧菲光	72,400	567,616.00	0.10
242	000027	深圳能源	87,900	544,980.00	0.10
243	601966	玲珑轮胎	31,900	542,300.00	0.10
244	002563	森马服饰	48,100	531,986.00	0.09
245	600808	马钢股份	155,500	530,255.00	0.09
246	000898	鞍钢股份	139,480	528,629.20	0.09
247	600820	隧道股份	82,700	521,837.00	0.09
248	000046	泛海控股	92,900	518,382.00	0.09
249	002294	信立泰	22,680	507,578.40	0.09
250	000983	西山煤电	83,200	504,192.00	0.09
251	000883	湖北能源	115,000	499,100.00	0.09
252	600373	中文传媒	38,000	477,280.00	0.08
253	601333	广深铁路	147,400	476,102.00	0.08
254	601958	金铂股份	69,748	467,311.60	0.08
255	000826	启迪桑德	38,600	455,094.00	0.08
256	000060	中金岭南	93,100	436,639.00	0.08
257	000559	万向钱潮	72,500	433,550.00	0.08
258	000839	中信国安	106,400	427,728.00	0.08
259	000039	中集集团	39,723	424,241.64	0.08

260	000581	威孚高科	22,053	409,303.68	0.07
-----	--------	------	--------	------------	------

### 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	600968	海油发展	102,375	363,431.25	0.06
2	300782	卓胜微	743	80,927.56	0.01
3	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.01
4	603863	松炆资源	1,612	37,204.96	0.01
5	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.01
6	300594	朗进科技	721	31,803.31	0.01
7	603867	新化股份	1,045	26,971.45	0.00
8	300788	中信出版	1,556	23,106.60	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	000858	五粮液	32,836,823.77	2.95
2	002415	海康威视	26,601,823.27	2.39
3	000002	万科 A	24,831,996.60	2.23
4	600036	招商银行	22,331,870.00	2.01
5	002304	洋河股份	21,377,989.71	1.92
6	000001	平安银行	19,621,500.93	1.77
7	000333	美的集团	14,632,135.75	1.32
8	000651	格力电器	13,051,880.81	1.17
9	001979	招商蛇口	12,744,655.10	1.15
10	000568	泸州老窖	11,249,706.48	1.01
11	000725	京东方 A	10,781,127.00	0.97
12	002024	苏宁易购	10,326,449.70	0.93
13	000063	中兴通讯	10,124,591.00	0.91
14	002142	宁波银行	9,547,100.52	0.86
15	002594	比亚迪	9,292,491.90	0.84
16	002714	牧原股份	9,202,554.84	0.83
17	300498	温氏股份	8,929,707.21	0.80
18	000166	申万宏源	8,748,408.14	0.79
19	000776	广发证券	7,857,472.45	0.71
20	002475	立讯精密	7,685,619.18	0.69

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	000858	五 粮 液	46,843,680.07	4.21
2	002415	海康威视	40,712,026.99	3.66
3	000002	万 科 A	37,283,458.79	3.35
4	000333	美的集团	32,398,740.46	2.91
5	002304	洋河股份	29,233,184.95	2.63
6	000001	平安银行	29,209,497.37	2.63
7	000651	格力电器	19,471,968.05	1.75
8	001979	招商蛇口	19,282,384.28	1.73
9	000725	京东方 A	16,601,858.00	1.49
10	002024	苏宁易购	15,357,050.00	1.38
11	000568	泸州老窖	15,027,066.64	1.35
12	000063	中兴通讯	14,610,885.38	1.31
13	002714	牧原股份	14,121,978.97	1.27
14	002142	宁波银行	14,004,757.44	1.26
15	002594	比亚迪	13,681,644.84	1.23
16	000166	申万宏源	13,328,942.67	1.20
17	600519	贵州茅台	13,003,319.39	1.17
18	000776	广发证券	11,977,672.06	1.08
19	002475	立讯精密	11,814,609.07	1.06
20	002027	分众传媒	10,600,125.00	0.95

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	625,807,755.42
卖出股票收入(成交)总额	772,324,816.23

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。

**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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 7.10.2 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 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

1、上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“浦发银行”，股票代码：600000）于 2018 年 7 月 26 日收到中国人民银行出具的行政处罚决定书（银反洗罚决字[2018]3 号）。其因未按照规定履行客户身份识别义务、未按照规定保存客户身份资料和交易记录、未按照规定报送大额交易报告或者可疑交易报告、与身份不明的客户进行交易等事项，违反了《中华人民共和国反洗钱法》第三十二条、第三十二条的规定，被人民银行处以 170 万元罚款。

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浦发银行进行了投资。

2、其余九名证券的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

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	363,206.49
2	应收证券清算款	3,683,237.34
3	应收股利	-
4	应收利息	4,185.73
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,050,629.56

#### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	601236	红塔证券	33,869.94	0.01	新股流通受限

#### 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

#### 8.1.1 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 (%)
5,041	108,709.73	148,002,507.00	27.01	240,003,233.00	43.80

#### 8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额 (份)	占总份额比例 (%)
景顺长城 MSCI 中国 A 股国际 通交易型开放式指数证券投资 基金联接基金	160,000,000.00	29.20

**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	中国农业银行股份有限公司—景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金	160,000,000.00	29.20
2	中信证券股份有限公司	20,597,129.00	3.76
3	中信建投证券股份有限公司	18,954,699.00	3.46
4	同方全球人寿保险有限公司	12,848,700.00	2.34
5	招商证券股份有限公司	11,448,073.00	2.09
6	广发证券股份有限公司	11,024,599.00	2.01
7	华泰人寿保险股份有限公司—分红—一个险分红	10,237,200.00	1.87
8	全球人寿保险股份有限公司—自有资金	9,348,600.00	1.71
9	全球人寿保险股份有限公司—自有资金	8,879,400.00	1.62
10	中国国际金融股份有限公司	7,949,690.00	1.45
11	江苏昆山农村商业银行股份有限公司—同心—定开系列理财产品	6,651,000.00	1.21

**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	1,368,005,740.00
本报告期基金总申购份额	1,750,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	2,570,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	548,005,740.00

**§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

<p>基金管理人重大人事变动：</p> <p>报告期内本基金管理人无重大人事变动。</p> <p>基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：</p> <p>2019 年 1 月，中国农业银行总行决定免去史静欣托管业务部副总裁职务。</p> <p>2019 年 4 月，中国农业银行总行决定免去马曙光托管业务部总裁职务。</p>
----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

## 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

<p>报告期内无涉及本基金财产、基金托管业务的诉讼，报告期内基金管理人无涉及基金财产的诉讼。</p>
----------------------------------------------------

## 10.4 基金投资策略的改变

<p>在本报告期内，本基金投资策略未发生改变。</p>
-----------------------------

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

<p>本期本基金未变更会计师事务所。</p>
------------------------

## 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

<p>本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员、托管人托管业务部门及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。</p>
---------------------------------------------------------------

## 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	1,149,732,822.87	82.37%	1,070,754.55	82.37%	-
中泰证券股份有限公司	2	87,630,454.02	6.28%	81,609.65	6.28%	-

方正证券股份 有限公司	2	71,332,535.79	5.11%	66,431.74	5.11%	-
东兴证券股份 有限公司	1	50,485,500.97	3.62%	47,018.04	3.62%	-
川财证券有限 责任公司	1	22,255,398.46	1.59%	20,726.49	1.59%	-
天风证券股份 有限公司	1	7,380,858.84	0.53%	6,873.97	0.53%	-
平安证券股份 有限公司	2	4,074,958.65	0.29%	3,795.01	0.29%	-
瑞银证券有限 责任公司	1	2,098,985.00	0.15%	1,954.79	0.15%	-
华泰证券股份 有限公司	1	562,666.00	0.04%	524.43	0.04%	-
东北证券股份 有限公司	1	235,218.00	0.02%	219.06	0.02%	-
华创证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	本期新 增
兴业证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
上海华信证券 有限责任公司	1	-	-	-	-	-
民生证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
大同证券有限 责任公司	2	-	-	-	-	-
东方证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	本期新 增一个
广发证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
长江证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
国泰君安证券 股份有限公司	1	-	-	-	-	-
光大证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
长城证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
国盛证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
国金证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-



恒泰证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
海通证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
中信建投证券 股份有限公司	1	-	-	-	-	-
西南证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	本期新 增
中国银河证券 股份有限公司	2	-	-	-	-	本期新 增一个
中信证券股份 有限公司	4	-	-	-	-	本期新 增一个
国信证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券 有限公司	1	-	-	-	-	-
华福证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-

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况况稳定；
- c、经营行为规范，最近两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	成交金额	占当期权 证 成交总额

				比例		的比例
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
川财证券有限责任公司	1,019,264.40	81.43%	-	-	-	-
天风证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
瑞银证券有限责任公司	232,516.80	18.57%	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
上海华信证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
民生证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

大同证券 有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
东方证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
广发证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
长江证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安 证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
光大证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
长城证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
国盛证券 有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
招商证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
国金证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
恒泰证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
海通证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
中信建投 证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
西南证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
中国银河 证券股份	-	-	-	-	-	-

有限公司						
中信证券 股份有限 公司		-	-	-	-	-
国信证券 股份有限 公司		-	-	-	-	-
申万宏源 证券有限 公司		-	-	-	-	-
华福证券 有限责任 公司		-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金 2018 年第 4 季度报告	证券时报	2019-01-21
2	关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金调整持有停牌股票估值价格的公告	证券时报	2019-02-01
3	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新增广发证券为一级交易商的公告	证券时报	2019-02-19
4	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	证券时报	2019-02-23
5	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 2018 年年度报告摘要	证券时报	2019-03-26
6	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 2018 年年度报告	证券时报	2019-03-26
7	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	证券时报	2019-04-03
8	关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金调整持有停牌股票估值价格的公告	证券时报	2019-04-04
9	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	证券时报	2019-04-08
10	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	证券时报	2019-04-11
11	关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金调整持有停牌股票估值价格的公告	证券时报	2019-04-16
12	景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金 2019 年第 1 季度报告	证券时报	2019-04-20
13	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	证券时报	2019-05-09
14	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	证券时报	2019-05-13
15	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	证券时报	2019-05-20
16	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	证券时报	2019-06-04
17	景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金 2019 年第 1 号更新招募说明书	证券时报	2019-06-11
18	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	证券时报	2019-06-11

	2019 年第 1 号更新招募说明书摘要		
19	景顺长城基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	证券时报	2019-06-15
20	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票的公告	证券时报	2019-06-21
21	关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金调整持有停牌股票估值价格的公告	证券时报	2019-06-25
22	景顺长城基金管理有限公司关于直销网上交易系统中国工商银行渠道暂停服务的公告	证券时报	2019-06-26

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
本基金的联接基金	1	20190101-20190630	434,000,000.00	8,000,000.00	282,000,000.00	160,000,000.00	29.20

#### 产品特有风险

本基金由于存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20% 的情况，可能会出现如下风险：

#### 1、大额申购风险

在出现投资者大额申购时，如本基金所投资的标的资产未及时准备，则可能降低基金净值涨幅。

#### 2、如面临大额赎回的情况，可能导致以下风险：

- (1) 基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；
- (2) 如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20% 的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回，如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；
- (3) 基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；
- (4) 因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，导致基金净值出现较大波动；
- (5) 基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略；
- (6) 大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。

本基金管理人将建立完善的风险管理机制，以有效防止和化解上述风险，最大限度地保护基金份额持有人的合法权益。投资者在投资本基金前，请认真阅读本风险提示及基金合同等信息披露文件，全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，获得基金投资收益，亦自行承担基金投资中出现

的各类风险。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

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

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

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

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

5、景顺长城基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程；

6、其他在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、定期报告及临时公告。

### 12.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

### 12.3 查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅。

景顺长城基金管理有限公司

2019 年 8 月 23 日