

# 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 年年度报告

2019 年 12 月 31 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：2020 年 4 月 20 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 2020 年 4 月 17 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。

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，基金管理人本报告中对相关事项亦有详细说明，请投资者注意阅读。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 2019 年 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况</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 .....	8
3.4 过去三年基金的利润分配情况 .....	8
<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 .....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	11
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 .....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 .....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	15
4.9 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 .....	15
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	16
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 .....	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 .....	16
<b>§ 6 审计报告</b> .....	<b>16</b>
6.1 审计报告基本信息 .....	16
6.2 审计报告的基本内容 .....	16
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	<b>18</b>
7.1 资产负债表 .....	18
7.2 利润表 .....	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	20
7.4 报表附注 .....	21
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>42</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	42

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	43
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	44
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	55
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	57
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	57
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	57
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	57
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	57
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	57
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	57
8.12 投资组合报告附注 .....	58
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>59</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	59
9.2 期末上市基金前十名持有人 .....	60
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	60
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	60
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>60</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>61</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	61
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	61
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	61
11.4 基金投资策略的改变 .....	61
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	61
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	61
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	62
11.8 其他重大事件 .....	64
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>68</b>
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	68
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	69
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>69</b>
13.1 备查文件目录 .....	69
13.2 存放地点 .....	69
13.3 查阅方式 .....	69

## §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 (景顺 MSCIA 股 ETF)
基金主代码	512280
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2018 年 4 月 27 日
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	326,005,740.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2018 年 5 月 25 日

### 2.2 基金产品说明

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

### 2.3 基金管理人和基金托管人

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

负责人	联系电话	0755-82370388	010-66060069
	电子邮箱	investor@igwfm.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4008888606	95599
传真		0755-22381339	010-68121816
注册地址		深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		518048	100031
法定代表人		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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.igwfm.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2019 年	2018 年 4 月 27 日 (基金合同生效日) - 2018 年 12 月 31 日
本期已实现收益	138,671,790.17	-98,882,576.45
本期利润	315,356,103.47	-251,106,479.47
加权平均基金份额本期利润	0.4748	-0.1855
本期加权平均净值利润率	48.39%	-20.54%
本期基金份额净值增长率	37.29%	-18.74%
3.1.2 期末数据和指标	2019 年末	2018 年末
期末可供分配利润	37,702,172.31	-256,332,088.21
期末可供分配基金份额利润	0.1156	-0.1874
期末基金资产净值	363,707,912.31	1,111,673,651.79
期末基金份额净值	1.1156	0.8126
3.1.3 累计期末指标	2019 年末	2018 年末
基金份额累计净值增长率	11.56%	-18.74%

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。

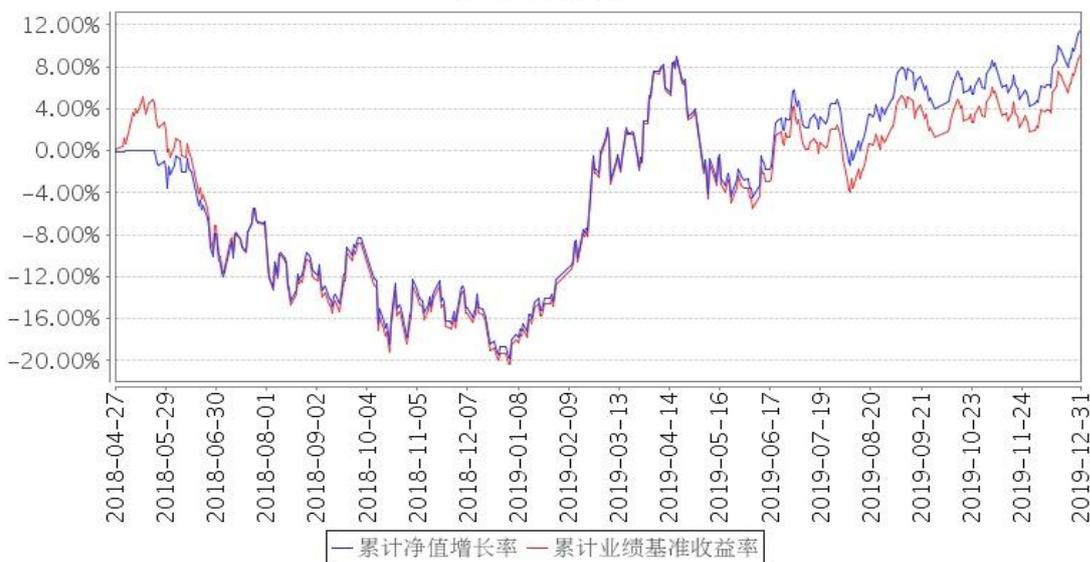
### 3.2 基金净值表现

#### 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
过去三个月	7.26%	0.69%	7.83%	0.72%	-0.57%	-0.03%
过去六个月	8.43%	0.81%	7.76%	0.84%	0.67%	-0.03%
过去一年	37.29%	1.19%	35.24%	1.21%	2.05%	-0.02%
自基金合同生效起至今	11.56%	1.26%	9.17%	1.29%	2.39%	-0.03%

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

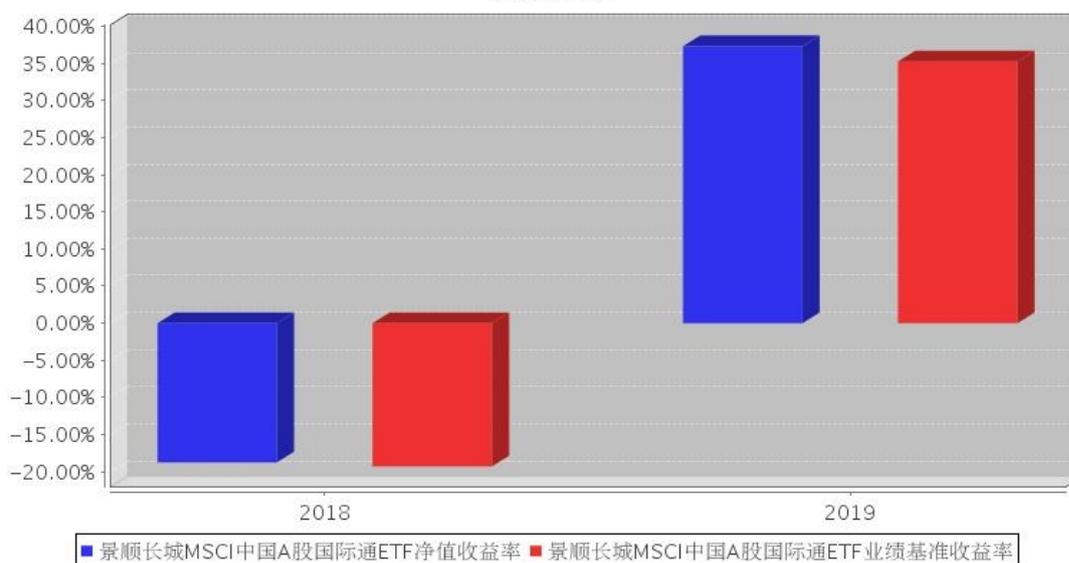
景顺长城MSCI中国A股国际通ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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



注:2018 年净值增长率与业绩比较基准收益率的实际计算期间是 2018 年 4 月 27 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日。

### 3.3 其他指标

无。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

本基金自合同生效日（2018年4月27日）至本报告期末未进行利润分配。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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12月31日，景顺长城基金管理有限公司旗下共管理83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 (QDII)、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、景顺长城绩优成长混合型证券投资基金、景顺长城中短债债券型证券投资基金、景顺长城中证沪港深红利成长低波动指数型证券投资基金、景顺长城稳健养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、景顺长城创新成长混合型证券投资基金、景顺长城景泰纯利债券型证券投资基金、景顺长城养老目标日期 2045 五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、景顺长城弘利 39 个月定期开放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，CFA。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。
曾理	本基金的基金经理	2019 年 11 月 19 日	-	5	工学硕士。曾任职于腾讯计算机系统有限公司信息安全部产品策略岗位。2014 年 8 月加入本公司，历任量化及 ETF 投资部量化程序员、量化及指数投资部基金经理助理，自 2018 年 10 月起担任量化及指数投资部基金经理。

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”指根据公司决定聘任后的公告日期，“离任日期”指根据公司决定的解聘日期（公告前一日）；

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

为了进一步规范和完善本基金管理人（以下简称“本公司”）投资和交易管理，严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011 年修订）》等法律法规，本公司制定了《景顺长城基金管理有限公司公平交易指引》，该《指引》涵盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时对授权、研究分析与投资决策、交易执行的内部控制、交易指令的分配执行、公平交易监控、报告措施及信息披露、利益冲突的防范和异常交易的监控等方面进行了全面规范。具体控制措施如下：

#### 1、授权、研究分析与投资决策的内部控制

建立投资授权制度，明确各投资决策主体的职责和权限划分；建立客观的研究方法，任何投资分析和建议均应有充分的事实和数据支持，避免主观臆断，严禁利用内幕信息作为投资依据；确保所有投资组合平等地享有研究成果；根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和投资限制等，建立不同投资组合的投资主题库和交易对手备选库，投资组合经理在此基础上根据投资授权构建具体的投资组合并独立进行投资决策。

#### 2、交易执行的内部控制

本公司实行集中交易制度，将投资管理职能和交易执行职能相隔离；建立公平的交易分配机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。同时严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。

#### 3、交易指令分配的控制

所有投资对象的投资指令必须经由交易管理部总监或其授权人审核后分配至交易员执行。

交易员对于接收到的交易指令依照时间优先、价格优先的顺序执行。在执行多个投资组合在

同一时点就同一证券下达的相同方向的投资指令时，需根据价格优先、比例分配的原则，经过公平性审核，公平对待多个不同投资组合的投资指令。

#### 4、公平交易监控

本公司建立异常交易行为日常监控和分析评估制度。交易管理部负责异常交易的日常实时监控，风险管理与绩效评估岗于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗内（如 1 日内、3 日、5 日内）公司管理的不同投资组合的同向交易的交易价差进行分析，对不同投资组合临近交易日的反向交易的交易价差进行分析。相关投资组合经理应对异常交易情况进行合理性解释，由投资组合经理、督察长、总经理签署后，妥善保存分析报告备查。如果在上述分析期间内，公司管理的所有投资组合同向交易价差出现异常情况，应重新核查公司投资决策和交易执行环节的内部控制，针对潜在问题完善公平交易制度，并在向中国证监会报送的监察稽核季度报告和年度报告中对此做专项说明。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（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投资组合。本报告期内本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011 年修订）》及《景顺长城基金管理有限公司公平交易指引》对本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现不公平交易现象。

#### 4.3.3 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 77 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和银行间债券 5 日内反向交易，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 年全年 GDP 增长 6.1%，工业增加值累计 5.7%。12 月 PMI 指数 50.2，连续两月扩张。12 月 PPI 同比-0.5%，环比持平；12 月 CPI 同比上涨 4.5%，环比持平。12 月 M2 同比增速 8.7%，M1 同比增速 4.4%，双双回升，社会融资规模存量同比增长 10.69%，增速维持平稳。12 月末外汇储备 3.1 万亿美元，汇率保持稳定。回顾全年，一季度随着超预期的社融规模、基建大力投入和市场对中美达成协议的强烈预期，市场进行了快速的估值修复。二季度，金融政策边际收敛，中美贸易摩擦反转，市场出现回调。三季度和四季度，经历了包商银行信用风险事件、科创板开板、LPR 报价机制改革和国务院常务会释放大力度保增长政策等等，市场并没有出现趋势性机会，整体处于窄幅震荡状态，局部板块走出较强行情。在此期间，上证综指、沪深 300 和创业板指数分别上涨 22.3%、36.07%和 43.79%。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2019 年，本基金份额净值增长率为 37.29%，业绩比较基准收益率为 35.24%。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 2020 年，全球经济依然面临下行风险，国内经济存在下行压力。随着各国央行陆续实行的宽松货币政策，中美之间达成第一阶段协议，贸易摩擦趋于缓和，对全球经济有提振作用。但年初突发的新冠疫情，进一步加剧了全球经济的悲观预期，预计后续国会加大宽松力度对冲疫情带来的不利影响。国内来看，地产投资韧性仍在，2019 年底提前下达了专项债加大对地方政府项目的支持力度，降息降准仍然有一定空间，LPR 定价机制改革后，央行对政策利率的引导将更为直接有效，实施宽货币以进一步降低实体经济的融资成本。2020 年是全面建成小康社会和十三五计划的收官之年，考虑到此次疫情负面影响，稳增长的政策会加大，因此我们预计全年 GDP 将大概率维持在 6%左右。长期来看，转型升级是中国经济的必然趋势，我们对经济的长期健康发展持较为乐观的态度。目前市场的整体估值处于较为合理水平，估值合理且盈利稳定的公司，具备较高投资价值。

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。

## 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人继续完善内部控制体系和内部控制制度，健全管理制度和业务规

章，依据国家相关法律法规、内部控制制度、内部管理制度和业务规章、基金合同以及基金招募说明书对本基金的投资、销售、运营等业务中的内部控制完善程度和执行情况进行持续的监察稽核，对监察稽核中发现的问题及时提示，督促改进并跟踪改进效果。定期编制监察稽核报告，及时报送上级监管部门。

为提高防范和化解经营风险的能力，确保经营业务稳健运行和受托资产安全完整，保障基金份额持有人利益，本基金管理人采取的主要措施包括：

1、进一步完善内部控制体系和内部控制制度。本公司已经建立了科学合理的层次分明的包括内控组织架构、控制程序和控制措施以及控制职责在内的运行高效、严密的内部控制体系。

2、进一步健全管理制度和业务规章。在已建立的基本管理制度、业务流程、规章等基础上，根据公司的业务发展和法律法规的颁布情况，对相关管理制度和业务流程规章进行全面修订及更新，从管理制度和业务流程上进行风险控制，进一步强化内部制度的执行力度。

3、坚持岗位分离、相互制衡的内控机制。在岗位设置上继续采取严格的分离制度，形成不同岗位之间的相互制衡机制，从岗位设置上减少和防范操作及操守风险。

4、持续地对基金经营业务的合法合规性进行监控。采取了实时监控、常规稽核、专项稽核和临时稽核等方式，对发现的问题及时提示并督促改进，防范各种违法违规行为的发生，切实保护基金份额持有人的合法权益。

5、执行以 KPI (Key Performance Indicator 主要绩效指标) 为风险控制主要手段和评估标准的风险评估、预警、报告、控制以及监督程序。并通过适当的控制流程，定期或实时对风险进行评估、预警和监督，从而确认、评估和预警与公司管理及基金运作有关的风险。通过顺畅的报告渠道，对风险问题进行层层监督、管理和控制，使部门和管理层及时把握风险状况并快速做出风险控制决策。

6、采用自动化监督控制系统。采用电子化投资交易系统，对投资比例进行限制，有效地防止合规性运作风险和操作风险。

7、按照法律法规的要求，认真做好旗下各只基金的信息披露工作，确保有关信息披露的真实、完整、准确、及时。

8、定期不定期地组织合规培训。通过结合外部律师培训、内部合规培训以及证券业协会的后继续教育课程，进一步加强对员工的合规教育，健全公司合规文化。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

#### 4.7 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。

#### 4.8 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。

截止本报告期末，根据相关法律法规和基金合同的要求以及本基金的实际运作情况，经本基金管理人研究决定暂不实施利润分配。

#### 4.9 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 12 月 31 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《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金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，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## §6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2020)第 21454 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	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全体基金份额持有人：
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“景顺长城 MSCI ETF”)的财务报表，包括 2019 年 12 月 31 日的资产负债表，2019 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务</p>

	<p>报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了景顺长城 MSCI ETF 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于景顺长城 MSCI ETF,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>景顺长城 MSCI ETF 的基金管理人景顺长城基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估景顺长城 MSCI ETF 的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算景顺长城 MSCI ETF、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督景顺长城 MSCI ETF 的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能对导致对景顺长城 MSCI ETF 持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致景顺长城 MSCI ETF 不能持续经营。</p>

	(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容,并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	单峰	陈薇瑶
会计师事务所的地址	中国·上海市	
审计报告日期	2020年4月17日	

## §7 年度财务报表

### 7.1 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 12 月 31 日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
<b>资产:</b>			
银行存款	7.4.7.1	8,704,955.38	21,916,248.40
结算备付金		961,447.69	630,477.38
存出保证金		168,930.11	162,531.40
交易性金融资产	7.4.7.2	354,756,142.68	1,091,714,162.51
其中: 股票投资		354,756,142.68	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		2,355,796.57	4,348,057.65
应收利息	7.4.7.5	3,325.41	5,047.60
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		366,950,597.84	1,118,776,524.94
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 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	7.4.7.3	-	-

卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		2,113,566.60	3,990,304.24
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		162,243.58	464,366.16
应付托管费		32,448.73	92,873.24
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	313,803.84	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	7.4.7.8	620,622.78	2,235,919.48
负债合计		3,242,685.53	7,102,873.15
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	326,005,740.00	1,368,005,740.00
未分配利润	7.4.7.10	37,702,172.31	-256,332,088.21
所有者权益合计		363,707,912.31	1,111,673,651.79
负债和所有者权益总计		366,950,597.84	1,118,776,524.94

注：报告截止日 2019 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.1156 元，基金份额总额 326,005,740.00 份。

## 7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 4 月 27 日（基金合 同生效日）至 2018 年 12 月 31 日
一、收入		323,262,861.12	-241,999,692.02
1. 利息收入		174,002.36	2,466,635.85
其中：存款利息收入	7.4.7.11	173,894.53	2,466,623.92
债券利息收入		107.83	11.93
资产支持证券利息 收入		-	-
买入返售金融资产 收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		143,071,616.02	-93,861,994.37
其中：股票投资收益	7.4.7.12	133,194,682.40	-120,577,621.25

基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	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	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	9,750,273.25	26,715,626.88
3. 公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	7.4.7.16	176,684,313.30	-152,223,903.02
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	7.4.7.17	3,332,929.44	1,619,569.52
减：二、费用		7,906,757.65	9,106,787.45
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	3,287,075.38	4,156,108.22
2. 托管费	7.4.10.2.2	657,415.10	831,221.66
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	3,359,493.80	3,335,346.31
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	0.05
7. 其他费用	7.4.7.19	602,773.29	784,111.21
三、利润总额（亏损总额以 “-”号填列）		315,356,103.47	-251,106,479.47
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		315,356,103.47	-251,106,479.47

### 7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 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)	-	315,356,103.47	315,356,103.47
三、本期基金份额交 易产生的基金净值变	-1,042,000,000.00	-21,321,842.95	-1,063,321,842.95

动数 (净值减少以“-”号填列)			
其中: 1. 基金申购款	2,454,000,000.00	-13,195,883.40	2,440,804,116.60
2. 基金赎回款	-3,496,000,000.00	-8,125,959.55	-3,504,125,959.55
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)	326,005,740.00	37,702,172.31	363,707,912.31
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12月31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)	-	-251,106,479.47	-251,106,479.47
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)	-166,000,000.00	-5,225,608.74	-171,225,608.74
其中: 1. 基金申购款	1,508,000,000.00	-139,789,665.69	1,368,210,334.31
2. 基金赎回款	-1,674,000,000.00	134,564,056.95	-1,539,435,943.05
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)	1,368,005,740.00	-256,332,088.21	1,111,673,651.79

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国

证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2018]548号《关于准予景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》核准,由景顺长城基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式指数基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,533,998,240.00 元(含募集股票市值),业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2018)第 0283 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2018 年 4 月 27 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,534,005,740.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 7,500.00 份基金份额。本基金的基金管理人为景顺长城基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数 MSCI 中国 A 股国际通指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股,投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%,且不低于非现金基金资产的 80%。此外,为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于部分非成份股(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、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 2020 年 4 月 17 日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本

准则》、各项具体会计准则及相关规定(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<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《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 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2019 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 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。比较财务报表的实际编制期间为 2018 年 4 月 27 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

##### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认

金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。基金收益以现金形式分配。当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，本基金的基金管理人可进行收益分配；本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。本基金收益每年最多分配 12 次，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在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。

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

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

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

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

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
活期存款	8,704,955.38	21,916,248.40
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	8,704,955.38	21,916,248.40

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	330,295,732.40	354,756,142.68	24,460,410.28

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	330,295,732.40	354,756,142.68	24,460,410.28
项目	上年度末 2018年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,243,737,065.53	1,091,513,162.51	-152,223,903.02
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	201,000.00	201,000.00
	银行间市场	-	-
	合计	201,000.00	201,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,243,938,065.53	1,091,714,162.51	-152,223,903.02

注:于 2019 年 12 月 31 日,股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值 0.00 元(2018 年 12 月 31 日: 3,865.00 元)。

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位:人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
应收活期存款利息	2,816.81	4,678.46
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	432.60	283.70
应收债券利息	-	12.34
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	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	76.00	73.10
合计	3,325.41	5,047.60

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
交易所市场应付交易费用	313,803.84	319,409.57
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	313,803.84	319,409.57

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	190,000.00	295,000.00
应付指数使用费	115,847.81	285,715.53
应退替代款	314,774.97	1,591,514.00
可退替代款	-	63,689.95
合计	620,622.78	2,235,919.48

#### 7.4.7.9 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12月31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	2,454,000,000.00	2,454,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-3,496,000,000.00	-3,496,000,000.00
- 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	326,005,740.00	326,005,740.00

**7.4.7.10 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	138,671,790.17	176,684,313.30	315,356,103.47
本期基金份额交易产生的变动数	10,482,816.74	-31,804,659.69	-21,321,842.95
其中：基金申购款	79,173,921.93	-92,369,805.33	-13,195,883.40
基金赎回款	-68,691,105.19	60,565,145.64	-8,125,959.55
本期已分配利润	-	-	-
本期末	45,496,526.64	-7,794,354.33	37,702,172.31

**7.4.7.11 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12月31日	上年度可比期间 2018年4月27日（基金合同生效日）至2018年12月31日
活期存款利息收入	154,860.59	882,673.46
定期存款利息收入	-	1,555,833.33
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	14,623.99	23,609.43
其他	4,409.95	4,507.70
合计	173,894.53	2,466,623.92

**7.4.7.12 股票投资收益****7.4.7.12.1 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12月31日	上年度可比期间 2018年4月27日（基金合同生效日）至2018年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	49,015,046.13	-53,755,323.39
股票投资收益——赎回差价收入	84,179,636.27	-66,822,297.86
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	133,194,682.40	-120,577,621.25

**7.4.7.12.2 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12月31日	上年度可比期间 2018年4月27日（基金合同生效日）至2018年12月31日
卖出股票成交总额	1,168,188,371.65	611,848,085.77
减：卖出股票成本总额	1,119,173,325.52	665,603,409.16
买卖股票差价收入	49,015,046.13	-53,755,323.39

**7.4.7.12.3 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12月31日	上年度可比期间 2018年4月27日（基金合同生效日）至2018年12月31日
赎回基金份额对价总额	3,504,125,959.55	1,539,435,943.05
减：现金支付赎回款总额	996,128,144.55	436,806,143.05
减：赎回股票成本总额	2,423,818,178.73	1,169,452,097.86
赎回差价收入	84,179,636.27	-66,822,297.86

**7.4.7.13 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12月31日	上年度可比期间 2018年4月27日（基金合同生效日）至2018年12月31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	-

**7.4.7.14 衍生工具收益**

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益。

**7.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年4月27日（基金合同生效日）至2018年12月31日
股票投资产生的股利收益	9,750,273.25	26,715,626.88
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	9,750,273.25	26,715,626.88

**7.4.7.16 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12月31日	上年度可比期间 2018年4月27日（基金合同生效日）至2018年12月31日
1. 交易性金融资产	176,684,313.30	-152,223,903.02
股票投资	176,684,313.30	-152,223,903.02
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	176,684,313.30	-152,223,903.02

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-3,865.00元(上年度可比期间：3,865.00元)。

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年4月27日（基金合同生效日）至2018年12月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	3,332,929.44	1,619,569.52
合计	3,332,929.44	1,619,569.52

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。

#### 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年4月27日（基金合同生效日）至2018年12月31日
交易所市场交易费用	3,359,493.80	3,335,346.31
银行间市场交易费用	-	-
合计	3,359,493.80	3,335,346.31

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年4月27日（基金合同生效日）至2018年12月31日
审计费用	70,000.00	100,000.00
信息披露费	120,000.00	195,000.00
证券出借违约金	-	-
银行划款手续费	29,832.41	14,171.06
指数使用费	322,580.88	409,180.15
上市费	60,000.00	35,000.00
其他	360.00	760.00

上市初费	-	30,000.00
合计	602,773.29	784,111.21

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。

## 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

### 7.4.8.2 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。

## 7.4.9 关联方关系

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
景顺资产管理有限公司	基金管理人的股东
大连实德集团有限公司	基金管理人的股东
开滦（集团）有限责任公司	基金管理人的股东
景顺长城资产管理（深圳）有限公司	基金管理人的子公司
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（“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。

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年12月31日		上年度可比期间 2018年4月27日（基金合同生效日） 至2018年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 （%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 （%）
长城证券	-	-	476,961,807.01	17.86

#### 7.4.10.1.2 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。

#### 7.4.10.1.3 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12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
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12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
长城证券	444,195.89	17.86	-	-

注:1. 上述佣金按市场佣金率计算。

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

### 7.4.10.2 关联方报酬

#### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位: 人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12 月31日	上年度可比期间 2018年4月27日(基金合 同生效日)至2018年12月 31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,287,075.38	4,156,108.22
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。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位: 人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12 月31日	上年度可比期间 2018年4月27日(基金合 同生效日)至2018年12月 31日
当期发生的基金应支付的托管费	657,415.10	831,221.66

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。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期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。

**7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明****7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

**7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况****7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

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固有资金投资本基金。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2019年12月31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	84,000,000.00	25.77	434,000,000.00	31.73

**7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年12月31日		上年度可比期间 2018年4月27日(基金合同生效日)至2018年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	8,704,955.38	154,860.59	21,916,248.40	882,673.46

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。

**7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

**7.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

于2019年12月31日，本基金持有914,200.00股中国农业银行的A股普通股，成本总额为人民币3,281,602.97元，估值总额为人民币3,373,398.00元，占基金资产净值的比例为0.93%（2018年12月31日：持有5,171,900.00股中国农业银行的A股普通股，成本总额为人民币18,879,116.63元，估值总额为人民币18,618,840.00元，占基金资产净值的比例为1.67%）。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

#### 7.4.12 期末(2019年12月31日)本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	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
002466	天齐锂业	2019年12月26日	2020年1月3日	配股流通受限	8.75	30.18	4,494	39,322.50	135,628.92	-
002973	侨银环保	2019年12月27日	2020年1月6日	新股流通受限	5.74	5.74	1,146	6,578.04	6,578.04	-

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
603799	华友钴业	2019年12月31日	重大事项停牌	39.39	2020年1月2日	40.43	13,210	339,592.33	520,341.90	-

注：本基金截至2019年12月31日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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。

###### 7.4.12.3.2 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。

##### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金管理人秉承全面风险管理的理念，将风险管理融入业务中，建立了以风险管理委员会为核心，由风险管理委员会、督察长、法律监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。各业务部门负责人为其所在部门的风险管理第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控和

及时报告的义务。员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。本基金管理人配备的风险管理人员对投资风险进行独立的监控并及时向管理层汇报。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券的发行人出现违约、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发行的证券，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和资产支持证券（上年末：0.02%）。

#### 7.4.13.3 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。

##### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（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 7.4.12。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 个工作日内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 个工作日内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。

#### **7.4.13.4 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。

##### **7.4.13.4.1 利率风险**

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量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。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月 -1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
<b>资产</b>							
银行存款	8,704,955.38	-	-	-	-	-	8,704,955.38
结算备付金	961,447.69	-	-	-	-	-	961,447.69
存出保证金	168,930.11	-	-	-	-	-	168,930.11
交易性金融资产	-	-	-	-	-	354,756,142.68	354,756,142.68
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	3,325.41	3,325.41
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	2,355,796.57	2,355,796.57
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
<b>资产总计</b>	<b>9,835,333.18</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>357,115,264.66</b>	<b>366,950,597.84</b>
<b>负债</b>							
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	162,243.58	162,243.58
应付托管费	-	-	-	-	-	32,448.73	32,448.73
应付证券清算款	-	-	-	-	-	2,113,566.60	2,113,566.60
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	313,803.84	313,803.84
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	620,622.78	620,622.78
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>3,242,685.53</b>	<b>3,242,685.53</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>9,835,333.18</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
<b>上年度末 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
应收证券清算款	-	-	-	-	-	4,348,057.65	4,348,057.65
应收利息	-	-	-	-	-	5,047.60	5,047.60

应收申购款	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	22,709,257.18	-	-	201,000.00	1,095,866,267.76	1,118,776,524.94
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
其他负债	-	-	-	-	2,235,919.48	2,235,919.48
应付证券清算款	-	-	-	-	3,990,304.24	3,990,304.24
应付利润	-	-	-	-	-	-
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	-	-

#### 7.4.13.4.1.2 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）。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金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。

#### 7.4.13.4.3 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：

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31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	354,756,142.68	97.54	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	354,756,142.68	97.54	1,091,513,162.51	98.19

#### 7.4.13.4.3.2 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		
	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 12 月 31 日）	上年度末（2018 年 12 月 31 日）
分析	沪深 300 指数上升 5%	17,282,216.89	51,976,269.05
	沪深 300 指数下降 5%	-17,282,216.89	-51,976,269.05

#### 7.4.14 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 12 月 31 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 354,093,593.82 元，属于第二层次的余额为 662,548.86 元，无属于第三层次的余额(2018 年 12 月 31 日：第一层次 1,080,758,730.71 元，第二层次 10,955,431.80 元，无第三层次)。

## (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 12 月 31 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 年度 本基金申购基金份额的对价总额为 2,440,804,116.60 元(2018 年 4 月 27 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日止期间：1,368,210,334.31 元)，其中包括以股票支付的申购款 1,646,196,237.17 元和以现金支付的申购款 794,607,879.43 元(2018 年 4 月 27 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日止期间：其中包括以股票支付的申购款 939,063,171.81 元和以现金支付的申购款 429,147,162.50 元)。

## (3) 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。

## §8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	354,756,142.68	96.68
	其中：股票	354,756,142.68	96.68
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	9,666,403.07	2.63
8	其他各项资产	2,528,052.09	0.69
9	合计	366,950,597.84	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 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	4,859,018.00	1.34
B	采矿业	10,211,784.05	2.81
C	制造业	164,561,553.39	45.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,704,124.02	2.67
E	建筑业	8,969,284.28	2.47
F	批发和零售业	6,088,328.88	1.67
G	交通运输、仓储和邮政业	10,483,323.18	2.88
H	住宿和餐饮业	481,932.00	0.13
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,404,589.42	4.24
J	金融业	93,126,867.20	25.60
K	房地产业	16,894,333.20	4.65
L	租赁和商务服务业	4,142,539.60	1.14
M	科学研究和技术服务业	2,305,824.00	0.63
N	水利、环境和公共设施管理业	456,764.00	0.13
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	3,468,651.04	0.95
R	文化、体育和娱乐业	3,015,004.90	0.83
S	综合	557,538.00	0.15
	合计	354,731,459.16	97.53

### 8.2.2 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	-	-
C	制造业	18,105.48	0.00
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	-	-
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	6,578.04	0.00
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	24,683.52	0.01

### 8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

#### 8.3.1 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	15,387	18,202,821.00	5.00
2	601318	中国平安	133,111	11,375,666.06	3.13
3	600036	招商银行	253,178	9,514,429.24	2.62
4	000858	五粮液	47,600	6,331,276.00	1.74
5	601166	兴业银行	255,100	5,050,980.00	1.39
6	600900	长江电力	270,112	4,964,658.56	1.37
7	600276	恒瑞医药	54,365	4,758,024.80	1.31
8	600000	浦发银行	360,300	4,456,911.00	1.23
9	601398	工商银行	661,700	3,890,796.00	1.07
10	000002	万科A	119,185	3,835,373.30	1.05
11	002415	海康威视	114,815	3,759,043.10	1.03
12	000001	平安银行	210,800	3,467,660.00	0.95
13	601288	农业银行	914,200	3,373,398.00	0.93
14	600030	中信证券	120,700	3,053,710.00	0.84
15	603288	海天味业	27,551	2,962,008.01	0.81
16	601601	中国太保	77,200	2,921,248.00	0.80
17	601668	中国建筑	515,460	2,896,885.20	0.80
18	300750	宁德时代	26,815	2,853,116.00	0.78
19	600016	民生银行	435,260	2,746,490.60	0.76
20	601328	交通银行	481,800	2,712,534.00	0.75

21	600585	海螺水泥	49,149	2,693,365.20	0.74
22	000333	美的集团	42,486	2,474,809.50	0.68
23	000651	格力电器	37,029	2,428,361.82	0.67
24	002475	立讯精密	65,762	2,400,313.00	0.66
25	600048	保利地产	146,100	2,363,898.00	0.65
26	600887	伊利股份	74,745	2,312,610.30	0.64
27	600104	上汽集团	95,595	2,279,940.75	0.63
28	600050	中国联通	381,100	2,244,679.00	0.62
29	300498	温氏股份	65,300	2,194,080.00	0.60
30	600309	万华化学	38,665	2,171,813.05	0.60
31	601818	光大银行	489,000	2,156,490.00	0.59
32	601766	中国中车	298,330	2,130,076.20	0.59
33	601888	中国国旅	23,800	2,117,010.00	0.58
34	002304	洋河股份	18,513	2,045,686.50	0.56
35	002142	宁波银行	69,200	1,947,980.00	0.54
36	001979	招商蛇口	97,200	1,931,364.00	0.53
37	002714	牧原股份	21,500	1,908,985.00	0.52
38	000725	京东方 A	415,500	1,886,370.00	0.52
39	601688	华泰证券	90,309	1,834,175.79	0.50
40	600031	三一重工	102,700	1,751,035.00	0.48
41	601211	国泰君安	92,228	1,705,295.72	0.47
42	603259	药明康德	18,000	1,658,160.00	0.46
43	601229	上海银行	174,404	1,655,093.96	0.46
44	600028	中国石化	312,800	1,598,408.00	0.44
45	601988	中国银行	431,000	1,590,390.00	0.44
46	000568	泸州老窖	18,035	1,563,273.80	0.43
47	600837	海通证券	99,324	1,535,549.04	0.42
48	300015	爱尔眼科	38,140	1,508,818.40	0.41
49	601006	大秦铁路	182,400	1,497,504.00	0.41
50	000063	中兴通讯	42,100	1,489,919.00	0.41
51	601169	北京银行	259,700	1,475,096.00	0.41
52	601989	中国重工	280,553	1,470,097.72	0.40
53	600690	海尔智家	74,700	1,456,650.00	0.40
54	601186	中国铁建	141,322	1,433,005.08	0.39
55	000166	申万宏源	277,000	1,418,240.00	0.39
56	000538	云南白药	15,700	1,404,051.00	0.39
57	601390	中国中铁	228,700	1,358,478.00	0.37
58	600019	宝钢股份	228,056	1,309,041.44	0.36
59	300059	东方财富	82,600	1,302,602.00	0.36
60	600999	招商证券	70,400	1,287,616.00	0.35
61	601336	新华保险	25,419	1,249,343.85	0.34
62	600015	华夏银行	157,318	1,206,629.06	0.33

63	600406	国电南瑞	56,594	1,198,660.92	0.33
64	601628	中国人寿	34,150	1,190,810.50	0.33
65	000338	潍柴动力	73,500	1,167,180.00	0.32
66	601857	中国石油	198,549	1,157,540.67	0.32
67	600346	恒力石化	71,940	1,156,795.20	0.32
68	002024	苏宁易购	114,200	1,154,562.00	0.32
69	002027	分众传媒	180,260	1,128,427.60	0.31
70	601899	紫金矿业	241,200	1,107,108.00	0.30
71	601012	隆基股份	44,420	1,102,948.60	0.30
72	000776	广发证券	72,600	1,101,342.00	0.30
73	601155	新城控股	27,700	1,072,544.00	0.29
74	002594	比亚迪	22,320	1,063,994.40	0.29
75	600340	华夏幸福	36,977	1,061,239.90	0.29
76	600547	山东黄金	31,860	1,039,273.20	0.29
77	000876	新希望	51,901	1,035,424.95	0.28
78	601066	中信建投	34,000	1,033,600.00	0.28
79	603501	韦尔股份	7,200	1,032,480.00	0.28
80	600919	江苏银行	141,800	1,026,632.00	0.28
81	600741	华域汽车	38,500	1,000,615.00	0.28
82	601088	中国神华	54,030	986,047.50	0.27
83	000895	双汇发展	33,700	978,311.00	0.27
84	603160	汇顶科技	4,700	969,610.00	0.27
85	600809	山西汾酒	10,601	950,909.70	0.26
86	603993	洛阳钼业	216,900	945,684.00	0.26
87	000661	长春高新	2,100	938,700.00	0.26
88	600009	上海机场	11,800	929,250.00	0.26
89	300760	迈瑞医疗	5,100	927,690.00	0.26
90	002230	科大讯飞	26,900	927,512.00	0.26
91	600703	三安光电	50,100	919,836.00	0.25
92	601225	陕西煤业	102,300	919,677.00	0.25
93	601009	南京银行	104,066	912,658.82	0.25
94	601138	工业富联	48,757	890,790.39	0.24
95	601933	永辉超市	117,508	886,010.32	0.24
96	601901	方正证券	101,028	875,912.76	0.24
97	600588	用友网络	30,533	867,137.20	0.24
98	601939	建设银行	117,700	850,971.00	0.23
99	603986	兆易创新	4,000	819,560.00	0.23
100	300122	智飞生物	16,400	814,424.00	0.22
101	600383	金地集团	55,162	799,849.00	0.22
102	601985	中国核电	159,100	795,500.00	0.22
103	002241	歌尔股份	39,800	792,816.00	0.22
104	600436	片仔癀	7,204	791,503.48	0.22

105	000069	华侨城 A	101,000	786,790.00	0.22
106	600958	东方证券	73,000	785,480.00	0.22
107	600886	国投电力	83,500	766,530.00	0.21
108	002600	领益智造	70,200	761,670.00	0.21
109	600570	恒生电子	9,730	756,312.90	0.21
110	600029	南方航空	105,300	756,054.00	0.21
111	000100	TCL 集团	166,100	742,467.00	0.20
112	002352	顺丰控股	19,886	739,560.34	0.20
113	600010	包钢股份	558,700	737,484.00	0.20
114	002236	大华股份	36,800	731,584.00	0.20
115	300033	同花顺	6,700	731,037.00	0.20
116	300003	乐普医疗	22,000	727,760.00	0.20
117	601877	正泰电器	26,300	704,840.00	0.19
118	002311	海大集团	19,500	702,000.00	0.19
119	002624	完美世界	15,834	698,912.76	0.19
120	002555	三七互娱	25,800	694,794.00	0.19
121	600606	绿地控股	99,700	692,915.00	0.19
122	002466	天齐锂业	22,774	687,319.32	0.19
123	300601	康泰生物	7,800	684,762.00	0.19
124	002044	美年健康	45,876	683,093.64	0.19
125	601669	中国电建	156,700	680,078.00	0.19
126	600115	东方航空	114,600	665,826.00	0.18
127	000938	紫光股份	21,028	664,484.80	0.18
128	000596	古井贡酒	4,800	652,416.00	0.18
129	600196	复星医药	24,508	651,912.80	0.18
130	600061	国投资本	43,000	651,020.00	0.18
131	002493	荣盛石化	51,700	640,563.00	0.18
132	300413	芒果超媒	18,290	639,418.40	0.18
133	002736	国信证券	50,300	631,265.00	0.17
134	300124	汇川技术	20,525	628,886.00	0.17
135	601788	光大证券	47,927	627,843.70	0.17
136	600438	通威股份	47,668	625,880.84	0.17
137	601618	中国中冶	219,300	614,040.00	0.17
138	600332	白云山	17,226	613,417.86	0.17
139	300142	沃森生物	18,900	613,116.00	0.17
140	601872	招商轮船	74,100	612,066.00	0.17
141	002916	深南电路	4,300	611,030.00	0.17
142	002001	新和成	26,200	609,412.00	0.17
143	002120	韵达股份	18,231	607,092.30	0.17
144	002007	华兰生物	17,200	604,580.00	0.17
145	600018	上港集团	104,300	601,811.00	0.17
146	600893	航发动力	27,582	597,977.76	0.16

147	300014	亿纬锂能	11,800	591,888.00	0.16
148	002050	三花智控	34,100	590,953.00	0.16
149	600660	福耀玻璃	24,500	587,755.00	0.16
150	600183	生益科技	27,900	583,668.00	0.16
151	601377	兴业证券	82,100	581,268.00	0.16
152	600926	杭州银行	63,100	577,996.00	0.16
153	600352	浙江龙盛	39,800	575,906.00	0.16
154	300347	泰格医药	9,100	574,665.00	0.16
155	601600	中国铝业	160,100	566,754.00	0.16
156	600795	国电电力	241,100	564,174.00	0.16
157	000066	中国长城	35,900	558,604.00	0.15
158	000768	中航飞机	33,900	555,282.00	0.15
159	300144	宋城演艺	17,900	553,289.00	0.15
160	300433	蓝思科技	39,900	551,418.00	0.15
161	603899	晨光文具	11,200	545,888.00	0.15
162	002371	北方华创	6,100	536,800.00	0.15
163	300136	信维通信	11,800	535,484.00	0.15
164	600674	川投能源	54,300	534,855.00	0.15
165	600705	中航资本	110,100	533,985.00	0.15
166	601100	恒立液压	10,700	532,325.00	0.15
167	000786	北新建材	20,800	529,360.00	0.15
168	600271	航天信息	22,802	528,322.34	0.15
169	000157	中联重科	78,700	525,716.00	0.14
170	000425	徐工机械	96,000	525,120.00	0.14
171	000963	华东医药	21,517	524,584.46	0.14
172	002146	荣盛发展	53,300	523,939.00	0.14
173	601990	南京证券	40,500	522,855.00	0.14
174	002032	苏泊尔	6,800	522,104.00	0.14
175	603799	华友钴业	13,210	520,341.90	0.14
176	002456	欧菲光	33,300	519,480.00	0.14
177	000656	金科股份	65,700	504,576.00	0.14
178	002202	金风科技	42,184	504,098.80	0.14
179	603369	今世缘	15,400	503,888.00	0.14
180	002179	中航光电	12,800	499,968.00	0.14
181	601108	财通证券	43,800	496,692.00	0.14
182	601727	上海电气	99,700	496,506.00	0.14
183	601021	春秋航空	11,200	491,568.00	0.14
184	002157	正邦科技	30,000	486,000.00	0.13
185	000703	恒逸石化	34,900	485,808.00	0.13
186	000783	长江证券	67,800	484,092.00	0.13
187	600111	北方稀土	44,603	483,496.52	0.13
188	002271	东方雨虹	18,300	481,473.00	0.13

189	300450	先导智能	10,700	480,858.00	0.13
190	300454	深信服	4,200	480,438.00	0.13
191	000961	中南建设	45,500	480,025.00	0.13
192	000625	长安汽车	47,811	479,544.33	0.13
193	300408	三环集团	21,500	479,020.00	0.13
194	000977	浪潮信息	15,800	475,580.00	0.13
195	000723	美锦能源	50,300	474,329.00	0.13
196	000860	顺鑫农业	9,000	474,120.00	0.13
197	601111	中国国航	48,900	473,841.00	0.13
198	600085	同仁堂	16,805	473,564.90	0.13
199	002463	沪电股份	21,300	473,073.00	0.13
200	002410	广联达	13,800	468,924.00	0.13
201	600176	中国巨石	43,000	468,700.00	0.13
202	002460	赣锋锂业	13,350	464,980.50	0.13
203	002739	万达电影	25,350	460,102.50	0.13
204	002384	东山精密	19,800	458,370.00	0.13
205	300628	亿联网络	6,300	456,183.00	0.13
206	601198	东兴证券	33,900	445,446.00	0.12
207	600536	中国软件	6,200	444,478.00	0.12
208	600801	华新水泥	16,800	444,024.00	0.12
209	600004	白云机场	25,300	441,485.00	0.12
210	002353	杰瑞股份	11,700	432,432.00	0.12
211	600362	江西铜业	25,400	430,022.00	0.12
212	601607	上海医药	23,400	429,858.00	0.12
213	601998	中信银行	69,600	429,432.00	0.12
214	002180	纳思达	13,000	427,960.00	0.12
215	600600	青岛啤酒	8,382	427,482.00	0.12
216	300251	光线传媒	36,200	427,160.00	0.12
217	000627	天茂集团	60,600	426,624.00	0.12
218	002153	石基信息	10,827	422,253.00	0.12
219	000671	阳光城	49,600	421,600.00	0.12
220	002673	西部证券	42,942	420,831.60	0.12
221	601919	中远海控	79,202	417,394.54	0.11
222	002422	科伦药业	17,700	415,773.00	0.11
223	600763	通策医疗	4,000	410,120.00	0.11
224	603833	欧派家居	3,505	410,085.00	0.11
225	002812	恩捷股份	8,100	409,050.00	0.11
226	601018	宁波港	107,300	407,740.00	0.11
227	000050	深天马A	25,000	407,250.00	0.11
228	600516	方大炭素	33,453	406,788.48	0.11
229	002129	中环股份	34,300	405,083.00	0.11
230	600583	海油工程	54,300	400,734.00	0.11

231	600208	新湖中宝	105,900	400,302.00	0.11
232	601838	成都银行	44,100	399,987.00	0.11
233	600426	华鲁恒升	20,000	397,400.00	0.11
234	603589	口子窖	7,200	395,352.00	0.11
235	600498	烽火通信	14,400	395,280.00	0.11
236	600637	东方明珠	42,150	394,524.00	0.11
237	002065	东华软件	38,200	394,224.00	0.11
238	601360	三六零	16,711	392,875.61	0.11
239	002508	老板电器	11,600	392,196.00	0.11
240	601117	中国化学	60,600	390,264.00	0.11
241	600170	上海建工	109,700	388,338.00	0.11
242	600066	宇通客车	27,200	387,600.00	0.11
243	002405	四维图新	24,000	386,400.00	0.11
244	000728	国元证券	41,300	382,851.00	0.11
245	002601	龙蟠佰利	24,800	381,672.00	0.10
246	300383	光环新网	19,000	381,330.00	0.10
247	600673	东阳光	37,200	380,928.00	0.10
248	601878	浙商证券	34,200	380,646.00	0.10
249	601992	金隅集团	101,900	380,087.00	0.10
250	600872	中炬高新	9,649	379,688.15	0.10
251	600487	亨通光电	23,220	377,557.20	0.10
252	000999	华润三九	11,900	376,992.00	0.10
253	603019	中科曙光	10,900	376,922.00	0.10
254	600068	葛洲坝	56,400	376,752.00	0.10
255	002821	凯莱英	2,900	375,550.00	0.10
256	601997	贵阳银行	39,155	374,321.80	0.10
257	300529	健帆生物	5,200	373,568.00	0.10
258	002049	紫光国微	7,300	371,132.00	0.10
259	300207	欣旺达	19,000	370,880.00	0.10
260	300308	中际旭创	7,100	370,265.00	0.10
261	002506	协鑫集成	62,400	368,784.00	0.10
262	002439	启明星辰	10,900	368,420.00	0.10
263	601555	东吴证券	36,830	367,931.70	0.10
264	600369	西南证券	69,400	360,186.00	0.10
265	600760	中航沈飞	11,396	360,113.60	0.10
266	600489	中金黄金	42,315	358,831.20	0.10
267	002926	华西证券	32,400	356,724.00	0.10
268	002797	第一创业	43,000	356,040.00	0.10
269	600161	天坛生物	12,700	354,838.00	0.10
270	603939	益丰药房	4,800	351,456.00	0.10
271	600642	申能股份	60,400	350,924.00	0.10
272	600109	国金证券	37,300	346,890.00	0.10

273	601231	环旭电子	17,900	344,217.00	0.09
274	300676	华大基因	5,000	343,500.00	0.09
275	601238	广汽集团	29,180	341,114.20	0.09
276	601233	桐昆股份	22,600	338,774.00	0.09
277	600038	中直股份	7,100	338,741.00	0.09
278	603658	安图生物	3,500	337,330.00	0.09
279	601966	玲珑轮胎	14,660	336,153.80	0.09
280	000709	河钢股份	130,200	335,916.00	0.09
281	600845	宝信软件	10,200	335,580.00	0.09
282	600219	南山铝业	147,400	330,176.00	0.09
283	002373	千方科技	18,300	330,132.00	0.09
284	002127	南极电商	30,200	329,482.00	0.09
285	000975	银泰黄金	24,200	329,362.00	0.09
286	300558	贝达药业	5,000	328,500.00	0.09
287	600704	物产中大	62,500	328,125.00	0.09
288	600297	广汇汽车	100,600	327,956.00	0.09
289	600011	华能国际	58,387	325,799.46	0.09
290	002773	康弘药业	8,800	325,336.00	0.09
291	600998	九州通	22,900	324,035.00	0.09
292	601216	君正集团	103,300	323,329.00	0.09
293	601799	星宇股份	3,400	322,932.00	0.09
294	600909	华安证券	44,200	322,660.00	0.09
295	002690	美亚光电	8,200	320,620.00	0.09
296	603517	绝味食品	6,900	320,505.00	0.09
297	600188	兖州煤业	30,300	319,968.00	0.09
298	601099	太平洋	84,000	318,360.00	0.09
299	300146	汤臣倍健	19,500	317,655.00	0.09
300	600132	重庆啤酒	6,100	316,956.00	0.09
301	600779	水井坊	6,100	315,675.00	0.09
302	600867	通化东宝	24,905	315,048.25	0.09
303	002078	太阳纸业	32,000	314,880.00	0.09
304	600522	中天科技	37,900	314,570.00	0.09
305	600528	中铁工业	27,200	312,800.00	0.09
306	600153	建发股份	34,790	312,762.10	0.09
307	600118	中国卫星	14,600	312,002.00	0.09
308	600875	东方电气	33,900	311,541.00	0.09
309	600885	宏发股份	9,000	310,050.00	0.09
310	601800	中国交建	33,800	309,608.00	0.09
311	600655	豫园股份	39,400	308,896.00	0.08
312	601128	常熟银行	33,800	307,918.00	0.08
313	603338	浙江鼎力	4,300	307,450.00	0.08
314	600027	华电国际	83,700	307,179.00	0.08

315	600298	安琪酵母	10,000	306,700.00	0.08
316	002013	中航机电	44,100	306,054.00	0.08
317	000629	攀钢钒钛	104,800	306,016.00	0.08
318	002299	圣农发展	12,700	305,816.00	0.08
319	002465	海格通信	28,200	305,406.00	0.08
320	603885	吉祥航空	20,300	304,500.00	0.08
321	300012	华测检测	20,400	304,164.00	0.08
322	000630	铜陵有色	130,000	302,900.00	0.08
323	600089	特变电工	45,544	302,867.60	0.08
324	002558	巨人网络	16,600	299,796.00	0.08
325	300253	卫宁健康	20,000	299,600.00	0.08
326	000402	金融街	36,600	297,192.00	0.08
327	600816	安信信托	66,900	297,036.00	0.08
328	603707	健友股份	7,100	294,508.00	0.08
329	300070	碧水源	38,600	293,360.00	0.08
330	600895	张江高科	19,100	292,421.00	0.08
331	600977	中国电影	19,200	292,224.00	0.08
332	603882	金城医学	5,700	291,954.00	0.08
333	300699	光威复材	6,400	291,200.00	0.08
334	600688	上海石化	75,030	290,366.10	0.08
335	000031	大悦城	40,300	289,354.00	0.08
336	603858	步长制药	14,031	289,319.22	0.08
337	002081	金螳螂	32,800	289,296.00	0.08
338	603866	桃李面包	6,800	288,592.00	0.08
339	002500	山西证券	34,800	288,492.00	0.08
340	000415	渤海租赁	75,900	288,420.00	0.08
341	600535	天士力	18,700	288,354.00	0.08
342	300357	我武生物	6,500	286,975.00	0.08
343	000825	太钢不锈	70,100	286,709.00	0.08
344	600699	均胜电子	16,000	286,400.00	0.08
345	600739	辽宁成大	18,800	286,324.00	0.08
346	002152	广电运通	29,500	283,495.00	0.08
347	300017	网宿科技	29,700	283,041.00	0.08
348	000401	冀东水泥	16,600	282,366.00	0.08
349	600521	华海药业	16,300	281,338.00	0.08
350	002110	三钢闽光	30,000	280,800.00	0.08
351	000423	东阿阿胶	7,900	279,423.00	0.08
352	002010	传化智联	40,000	279,200.00	0.08
353	600398	海澜之家	36,300	278,784.00	0.08
354	600256	广汇能源	83,900	277,709.00	0.08
355	000750	国海证券	51,800	276,612.00	0.08
356	600466	蓝光发展	37,000	272,690.00	0.07

357	300024	机器人	19,300	270,200.00	0.07
358	300285	国瓷材料	11,800	269,630.00	0.07
359	603444	吉比特	900	268,641.00	0.07
360	601699	潞安环能	36,900	267,894.00	0.07
361	600486	扬农化工	3,900	267,657.00	0.07
362	002387	维信诺	16,800	267,120.00	0.07
363	601958	金铂股份	33,248	266,316.48	0.07
364	601098	中南传媒	22,300	266,262.00	0.07
365	000686	东北证券	28,500	265,050.00	0.07
366	002268	卫士通	10,200	263,058.00	0.07
367	002385	大北农	52,500	261,450.00	0.07
368	600021	上海电力	32,300	260,015.00	0.07
369	600201	生物股份	13,800	258,336.00	0.07
370	002507	涪陵榨菜	9,600	256,608.00	0.07
371	600372	中航电子	18,000	256,320.00	0.07
372	002372	伟星新材	19,300	254,181.00	0.07
373	002174	游族网络	10,900	253,643.00	0.07
374	600376	首开股份	31,800	253,446.00	0.07
375	601866	中远海发	97,300	252,007.00	0.07
376	600315	上海家化	8,100	250,614.00	0.07
377	600733	北汽蓝谷	42,900	250,536.00	0.07
378	002223	鱼跃医疗	12,300	249,936.00	0.07
379	000027	深圳能源	40,200	249,642.00	0.07
380	600258	首旅酒店	12,100	249,381.00	0.07
381	000513	丽珠集团	7,400	249,380.00	0.07
382	002340	格林美	51,200	249,344.00	0.07
383	000932	华菱钢铁	52,000	248,560.00	0.07
384	600511	国药股份	9,100	248,339.00	0.07
385	002399	海普瑞	12,700	247,777.00	0.07
386	600160	巨化股份	34,000	247,520.00	0.07
387	600460	士兰微	16,000	247,520.00	0.07
388	000089	深圳机场	25,200	246,204.00	0.07
389	002019	亿帆医药	15,100	245,375.00	0.07
390	600380	健康元	23,700	245,295.00	0.07
391	002281	光迅科技	8,200	244,196.00	0.07
392	300595	欧普康视	5,100	241,383.00	0.07
393	300296	利亚德	31,400	240,838.00	0.07
394	002414	高德红外	11,400	239,400.00	0.07
395	600566	济川药业	9,900	239,382.00	0.07
396	000983	西山煤电	38,700	237,231.00	0.07
397	000998	隆平高科	16,100	236,831.00	0.07
398	000623	吉林敖东	14,300	236,379.00	0.06

399	600754	锦江酒店	8,100	232,551.00	0.06
400	002572	索菲亚	11,100	232,545.00	0.06
401	600820	隧道股份	38,500	232,540.00	0.06
402	600675	中华企业	50,000	232,500.00	0.06
403	603883	老百姓	3,600	230,688.00	0.06
404	601598	中国外运	54,000	230,040.00	0.06
405	600373	中文传媒	16,900	230,009.00	0.06
406	002195	二三四五	70,761	228,558.03	0.06
407	000729	燕京啤酒	34,900	227,548.00	0.06
408	600549	厦门钨业	17,400	226,896.00	0.06
409	000413	东旭光电	67,300	226,128.00	0.06
410	600808	马钢股份	73,000	224,110.00	0.06
411	600967	内蒙一机	21,000	223,230.00	0.06
412	000883	湖北能源	53,100	221,427.00	0.06
413	000898	鞍钢股份	65,980	221,033.00	0.06
414	002563	森马服饰	22,300	220,101.00	0.06
415	600446	金证股份	10,500	216,090.00	0.06
416	000960	锡业股份	20,600	215,064.00	0.06
417	601333	广深铁路	69,900	213,894.00	0.06
418	600026	中远海能	33,500	213,730.00	0.06
419	002217	合力泰	38,500	213,675.00	0.06
420	600598	北大荒	21,900	213,306.00	0.06
421	000028	国药一致	4,700	213,192.00	0.06
422	002294	信立泰	10,680	212,959.20	0.06
423	600567	山鹰纸业	56,400	212,628.00	0.06
424	000778	新兴铸管	49,400	205,998.00	0.06
425	000997	新大陆	12,800	203,264.00	0.06
426	002074	国轩高科	13,800	200,790.00	0.06
427	600782	新钢股份	39,100	200,583.00	0.06
428	600572	康恩贝	32,600	200,490.00	0.06
429	600879	航天电子	33,400	199,732.00	0.05
430	600273	嘉化能源	17,700	199,125.00	0.05
431	600392	盛和资源	21,700	196,819.00	0.05
432	000581	威孚高科	10,253	195,319.65	0.05
433	000046	泛海控股	42,800	194,740.00	0.05
434	600863	内蒙华电	70,700	194,425.00	0.05
435	601880	大连港	95,200	193,256.00	0.05
436	000830	鲁西化工	18,100	190,231.00	0.05
437	600643	爱建集团	19,800	190,080.00	0.05
438	002583	海能达	22,600	190,066.00	0.05
439	000060	中金岭南	44,200	190,060.00	0.05
440	601000	唐山港	72,500	188,500.00	0.05

441	600282	南钢股份	54,600	188,370.00	0.05
442	000732	泰禾集团	30,500	187,575.00	0.05
443	002085	万丰奥威	26,600	186,200.00	0.05
444	000738	航发控制	14,100	184,287.00	0.05
445	002603	以岭药业	14,800	183,964.00	0.05
446	000039	中集集团	18,723	183,859.86	0.05
447	000559	万向钱潮	33,900	182,043.00	0.05
448	300072	三聚环保	28,600	180,752.00	0.05
449	002124	天邦股份	14,200	178,210.00	0.05
450	600777	新潮能源	84,100	176,610.00	0.05
451	002092	中泰化学	26,000	176,540.00	0.05
452	600500	中化国际	33,200	175,960.00	0.05
453	600056	中国医药	13,100	170,955.00	0.05
454	000839	中信国安	48,100	170,274.00	0.05
455	000598	兴蓉环境	36,500	168,995.00	0.05
456	600062	华润双鹤	12,900	168,345.00	0.05
457	600260	凯乐科技	12,300	166,911.00	0.05
458	600835	上海机电	9,900	164,043.00	0.05
459	002038	双鹭药业	12,450	163,717.50	0.05
460	000826	启迪环境	17,800	163,404.00	0.04
461	600582	天地科技	50,700	161,733.00	0.04
462	600648	外高桥	9,300	161,541.00	0.04
463	603077	和邦生物	107,200	158,656.00	0.04
464	002424	贵州百灵	17,300	150,683.00	0.04
465	000681	视觉中国	8,500	146,540.00	0.04

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

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	603109	神驰机电	684	18,105.48	0.00
2	002973	侨银环保	1,146	6,578.04	0.00

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000858	五粮液	51,700,956.79	4.65
2	002415	海康威视	36,420,690.87	3.28
3	000002	万科A	34,471,022.60	3.10
4	600036	招商银行	30,991,571.00	2.79

5	002304	洋河股份	28,779,927.99	2.59
6	000001	平安银行	28,770,757.81	2.59
7	000333	美的集团	20,379,714.75	1.83
8	000651	格力电器	19,115,831.81	1.72
9	001979	招商蛇口	17,643,189.10	1.59
10	300498	温氏股份	15,879,172.21	1.43
11	000725	京东方 A	15,293,141.00	1.38
12	000568	泸州老窖	14,823,220.10	1.33
13	002142	宁波银行	13,846,492.94	1.25
14	002714	牧原股份	13,709,720.60	1.23
15	002024	苏宁易购	13,661,558.69	1.23
16	000063	中兴通讯	13,524,111.79	1.22
17	002594	比亚迪	12,789,593.85	1.15
18	000166	申万宏源	12,630,148.14	1.14
19	002475	立讯精密	12,090,193.18	1.09
20	000776	广发证券	10,739,650.45	0.97

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。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000858	五粮液	73,051,615.54	6.57
2	002415	海康威视	54,775,945.99	4.93
3	000002	万科 A	50,790,080.12	4.57
4	000001	平安银行	41,986,642.59	3.78
5	000333	美的集团	40,770,446.92	3.67
6	002304	洋河股份	38,798,922.17	3.49
7	000651	格力电器	27,961,556.06	2.52
8	001979	招商蛇口	25,633,340.02	2.31
9	600519	贵州茅台	23,351,243.39	2.10
10	000725	京东方 A	22,978,955.00	2.07
11	000568	泸州老窖	20,405,922.84	1.84
12	002024	苏宁易购	20,077,781.41	1.81
13	002142	宁波银行	20,001,356.04	1.80
14	002714	牧原股份	19,932,359.96	1.79
15	000063	中兴通讯	19,639,884.38	1.77
16	002475	立讯精密	18,428,042.67	1.66
17	002594	比亚迪	18,414,175.84	1.66
18	000166	申万宏源	18,226,120.17	1.64
19	000776	广发证券	16,009,288.06	1.44
20	002027	分众传媒	14,455,842.00	1.30

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。

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票成本(成交)总额	983,353,933.95
卖出股票收入(成交)总额	1,168,188,371.65

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。

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 8.10.1 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。

#### 8.10.2 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。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.11.1 本期国债期货投资政策

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。

#### 8.11.2 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。

#### 8.11.3 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。

## 8.12 投资组合报告附注

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

1、招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”，股票代码：600036）于 2019 年 7 月 17 日收到中国银行保险监督管理委员会上海监管局出具的行政处罚决定书（沪银保监银罚决字（2019）51 号）。其信用卡中心因在为部分客户办理信用卡业务时，未遵守总授信额度管理制度问题，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第（五）项的相关规定，被处以罚款人民币 20 万元。

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招商银行进行了投资。

2、兴业银行股份有限公司（以下简称“兴业银行”，股票代码：601166）于 2019 年 7 月 17 日收到上海银保监局出具的行政处罚决定书（沪银保监银罚决字（2019）50 号）。其信用卡中心在 2016 年 1 月至 2018 年 1 月，为部分客户办理信用卡业务时，未遵守总授信额度管理制度；在 2016 年至 2018 年 8 月，对部分信用卡申请人资信水平调查严重不尽职，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第（五）项的规定，被处以 40 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兴业银行进行了投资。

3、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 2019 年 12 月 11 日收到中国银行保险监督管理委员会上海监管局出具的行政处罚决定书（沪银保监银罚决字（2019）87 号）。其信用卡中心信用卡催收外包管理严重违反审慎经营规则，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第（五）项的相关规定，被处以罚款人民币 50 万元。

2019 年 7 月 17 日，浦发银行信用卡中心因在为部分客户办理信用卡业务时，对申请人收入核定严重不审慎的问题，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第（五）项的相关规定，收到中国银行保险监督管理委员会上海监管局出具的行政处罚决定书（沪银保监银罚决字（2019）53 号），被处以罚款人民币 30 万元。

2019 年 6 月 24 日，浦发银行因对成都分行授信业务及整改情况严重失察；重大审计发现未向监管部门报告；轮岗制度执行不力的问题，违反了《中华人民共和国商业银行法》第六十条，《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关内控管理的规定，收到中国银行保险监督管理委员会出具的行政处罚决定书（银保监罚决字（2019）7 号），被处以 130 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。

4、其余七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。

### 8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	168,930.11
2	应收证券清算款	2,355,796.57
3	应收股利	-
4	应收利息	3,325.41
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,528,052.09

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

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。

#### 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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	002973	侨银环保	6,578.04	0.00	新股流通受限

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

#### 9.1.1 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 (%)
3,245	100,464.02	103,906,373.00	31.87	138,099,367.00	42.36

### 9.1.2 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	84,000,000.00	25.77

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额 比例 (%)
1	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	84,000,000.00	25.77
2	中国国际金融股份有限公司	39,642,040.00	12.16
3	全球人寿保险股份有限公司—自有资金	10,848,600.00	3.33
4	华泰人寿保险股份有限公司—分红—一个险分红	10,237,200.00	3.14
5	中信证券股份有限公司	6,921,558.00	2.12
6	全球人寿保险股份有限公司—自有资金	6,291,400.00	1.93
7	中信建投证券股份有限公司	5,506,960.00	1.69
8	方正证券股份有限公司	5,129,591.00	1.57
9	广发证券股份有限公司	4,902,185.00	1.50
10	招商证券股份有限公司	4,242,035.00	1.30
11	张云珠	3,303,300.00	1.01

### 9.3 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。

### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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。

## §10 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	2,454,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	3,496,000,000.00

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	326,005,740.00

## §11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人重大人事变动：

1、本基金管理人于 2020 年 1 月 22 日发布公告，因丁益董事长退休，由本公司总经理康乐先生代为履行本公司董事长一职。

2、本基金管理人于 2020 年 3 月 6 日发布公告，经景顺长城基金管理有限公司董事会审议通过，聘任李黎女士担任本公司副总经理。

上述事项已按规定向中国证券投资基金业协会备案，同时抄送中国证券监督管理委员会深圳监管局。有关公告已在中国证监会指定的全国性报刊及指定互联网网站等媒介披露。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

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。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。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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。

### 11.4 基金投资策略的改变

在本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）第二年为本基金提供审计服务，本年度应支付给会计师事务所的报酬为人民币 70,000.00 元。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

## 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中国国际金融股份有限公司	2	1,672,554,159.68	77.86%	1,557,661.02	77.86%	-
中泰证券股份有限公司	2	94,987,192.64	4.42%	88,461.08	4.42%	-
华创证券有限责任公司	1	94,008,851.25	4.38%	87,550.42	4.38%	本期新增一个
方正证券股份有限公司	2	85,494,959.53	3.98%	79,621.40	3.98%	-
东兴证券股份有限公司	1	64,682,190.94	3.01%	60,239.56	3.01%	-
恒泰证券股份有限公司	1	62,491,370.70	2.91%	58,198.65	2.91%	-
川财证券有限责任公司	1	54,094,970.05	2.52%	50,376.98	2.52%	-
天风证券股份有限公司	1	7,380,858.84	0.34%	6,873.97	0.34%	-
平安证券股份有限公司	2	4,779,091.71	0.22%	4,451.01	0.22%	-
西南证券股份有限公司	1	2,429,866.19	0.11%	2,262.89	0.11%	本期新增一个
瑞银证券有限责任公司	1	2,208,244.10	0.10%	2,056.56	0.10%	-
兴业证券股份有限公司	1	1,920,067.21	0.09%	1,787.94	0.09%	-
华泰证券股份有限公司	1	562,666.00	0.03%	524.43	0.03%	-
国盛证券有限责任公司	1	322,190.48	0.01%	300.06	0.01%	-
东北证券股份有限公司	1	235,218.00	0.01%	219.06	0.01%	-
国泰君安证券股份有限公司	1	67,344.86	0.00%	62.72	0.00%	-
华福证券有限责任公司	1	16,974.30	0.00%	15.79	0.00%	-
长城证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
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
光大证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

国金证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
民生证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	1	-	-	-	-	-
新时代证券股份有限公司	1	-	-	-	-	本期新增一个
招商证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	2	-	-	-	-	本期新增一个
中信建投证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	4	-	-	-	-	本期新增一个

注：基金专用交易单元的选择标准和程序如下：

1) 选择标准

- a、资金实力雄厚，信誉良好；
- b、财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- c、经营行为规范，最近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。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-

中泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
恒泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
西南证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
瑞银证券有限责任公司	232,516.80	18.57%	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华福证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
大同证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
民生证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	-	-	-	-	-	-
新时代证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	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、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-01-21
2	关于景顺长城基金管理有限公司旗下	证券时报、基金管理人	2019-02-01

	基金调整持有停牌股票估值价格的公告	网站、证监会基金电子披露网站	
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、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	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、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	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、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	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、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	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、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	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、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	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、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	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、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	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、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	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、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	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、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	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、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	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、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	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、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	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、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	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 2019 年第 1 号更新招募说明书摘要	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-06-11
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、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	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、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	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、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	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、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-06-26
23	关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金调整持有股票估值价格的公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-07-05
24	关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金调整持有股票估值价格的公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-07-09
25	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 2 季度报告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-07-17
26	景顺长城基金管理有限公司澄清公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-08-06
27	景顺长城基金管理有限公司关于提醒直销网上交易系统个人投资者及时上传身份证件影印件并完善、更新身份信息以免影响业务办理的公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-08-16
28	景顺长城基金管理有限公司关于提醒直销网上交易系统个人投资者及时上传身份证件影印件并完善、更新身份信息以免影响业务办理的公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-08-17
29	景顺长城基金管理有限公司关于提醒直销网上交易系统个人投资者及时上传身份证件影印件并完善、更新身份信息以免影响业务办理的公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-08-19
30	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	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子	2019-08-23

	年度报告	披露网站	
31	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 年半年度报告摘要	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-08-23
32	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、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-08-30
33	景顺长城基金管理有限公司关于直销网上交易系统中国农业银行渠道暂停服务的公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-09-20
34	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2019 年第 3 季度报告提示性公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-10-22
35	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 3 季度报告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-10-22
36	关于景顺长城基金管理有限公司旗下 80 只基金修改基金合同、托管协议并更新招募说明书的提示性公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-11-05
37	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	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-11-05
38	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 2 号更新招募说明书	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-11-05
39	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 2 号更新招募说明书摘要	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-11-05
40	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	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-11-05
41	景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金经理变更公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-11-19
42	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 3 号更新招募说明书	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-11-21
43	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 3 号更新招募说明书摘要	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-11-21
44	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、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-12-03

45	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、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-12-05
46	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、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-12-05
47	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、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-12-12
48	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、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-12-13
49	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、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-12-24

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
本基金的联接基金	1	20190101-20191231	434,000,000.00	8,000,000.00	358,000,000.00	84,000,000.00	25.77

#### 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。

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的要求，景顺长城基金管理有限公司对包括本基金在内的旗下 80 只公开募集开放式证券投资基金基金合同及托管协议中与“信息披露”相关的条款进行了修订。修订后的基金合同、托管协议已于 2019 年 11 月 5 日起生效。有关详细信息参见本公司于 2019 年 11 月 5 日发布的《关于景顺长城基金管理有限公司旗下 80 只基金修改基金合同、托管协议并更新招募说明书的提示性公告》。

## §13 备查文件目录

### 13.1 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。

### 13.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

### 13.3 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

2020 年 4 月 20 日