

# 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 2020 年中期报告

2020 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：2020 年 8 月 24 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 20 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 2020 年 1 月 1 日起至 2020 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	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	10
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>14</b>
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>35</b>
7.1 期末基金资产组合情况	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	35
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	50
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	50
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	50
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	50
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	50
7.12 投资组合报告附注 .....	51
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>52</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	52
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	52
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	53
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 .....	53
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>53</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>53</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	53
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	54
10.4 基金投资策略的改变 .....	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	54
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 .....	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	54
10.8 其他重大事件 .....	60
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>62</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 .....	62
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	62
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>63</b>
12.1 备查文件目录 .....	63
12.2 存放地点 .....	63
12.3 查阅方式 .....	63

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通 ETF
场内简称	景顺 MSCI (扩位证券简称: 景顺 MSCIA 股 ETF)
基金主代码	512280
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2018 年 4 月 27 日
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	138,005,740.00 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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.igwfm.com
基金中期报告备置地点	基金管理人的办公场所

## 2.5 其他相关资料

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

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020年1月1日-2020年6月30日)
本期已实现收益	18,602,998.23
本期利润	11,741,514.00
加权平均基金份额本期利润	0.0608
本期加权平均净值利润率	5.50%
本期基金份额净值增长率	7.26%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)
期末可供分配利润	27,128,084.68
期末可供分配基金份额利润	0.1966
期末基金资产净值	165,133,824.68
期末基金份额净值	1.1966
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)
基金份额累计净值增长率	19.66%

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。

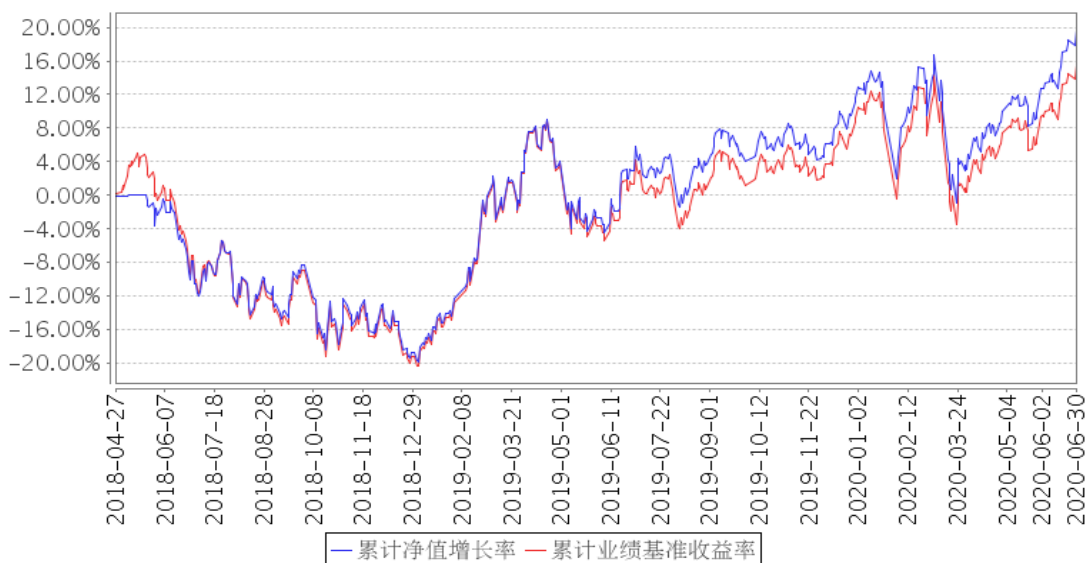
### 3.2 基金净值表现

#### 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	9.00%	0.84%	8.40%	0.87%	0.60%	-0.03%
过去三个月	15.61%	0.90%	14.49%	0.92%	1.12%	-0.02%
过去六个月	7.26%	1.49%	5.80%	1.53%	1.46%	-0.04%
过去一年	16.30%	1.18%	14.01%	1.22%	2.29%	-0.04%
自基金合同生效起至今	19.66%	1.31%	15.50%	1.35%	4.16%	-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 2020 年 6 月 30 日，景顺长城基金管理有限公司旗下共管理 96 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、景顺长城品质成长混合型证券投资基金、景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、景顺长城泰申回报混合型证券投资基金、景顺长城科技创新混合型证券投资基金、景顺长城价值领航两年持有期混合型证券投资基金、景顺长城景泰裕利纯债债券型证券投资基金、景顺长城核心优选一年持有期混合型证券投资基金、景顺长城中证红利低波动 100 交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城创业板综指增强型证券投资基金、景顺长城成长领航混合型证券投资基金、景顺长城景颐嘉利 6 个月持有期债券型证券投资基金、景顺长城中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、景顺长城科技创新

三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金。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	2020年3月10日	10	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	-	6	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”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。

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

无。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《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 18 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交易所证券临近交易日同向交易和银行间债券 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。

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

2020 年 5 月工业增加值当月同比 4.40%，前值 3.90%，复苏态势愈加明显。6 月 PMI 指数继续回升至 50.90，在 4 月、5 月下降后开始上升。5 月 PPI 同比-3.70%，环比-0.4%，跌幅扩大；5 月 CPI 同比上涨 2.40%，前值 3.30%，环比-0.8%，基本保持稳定。5 月 M2 同比增速 11.10%，M1 同比增速 6.80%，社会融资规模存量同比增长 3.24%，增速维持平稳。5 月末外汇储备 3.1 万亿美元。一季度受到新冠疫情的突发影响，A 股市场呈现出先跌后涨再跌的走势。二季度在“外防输入、内防反弹”的总体抗疫框架下，国内疫情基本得到控制，经济复苏态势明显。在此期间，上证综指、沪深 300、中证 500 和创业板指数收益率为 8.64%、13.33%、16.65%和 31.05%，行情分化较为明显。

随着新冠疫情在国内逐步得到控制，对国内经济冲击的影响也在逐渐减弱。从最近披露的各种宏观数据来看，基本经济形势已经开始逐渐好转，同时相关政策逐步发力，通过保障生产、促进消费等措施加快经济复苏。当前国外疫情仍未得到有效控制，且后续短期疫情消除的可能性不大，在严格防止疫情反弹并通过境外反向输入的考虑下，相关国家疫情对我国外需的冲击较大，部分加大了经济复苏的难度。今年《政府工作报告》未再提及 GDP 增长目标，取而代之的是把“六稳”、“六保”放在首位，尤其是将稳就业保民生放在首位，根本上也要求促进经济回稳、增长。同时叠加更为积极的财政政策和灵活适度的货币政策，全力为疫情后经济修复保驾护航。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2020 年上半年，本基金份额净值增长率为 7.26%，业绩比较基准收益率为 5.80%。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

展望下半年，短期疫情在全球蔓延的拐点暂未到来，外需的快速下落和部分产业链受外部较大冲击，对经济有较大影响。但随着《政府工作报告》的逐渐落实，积极财政政策的陆续出台和灵活货币政策的持续宽松，对经济有托底作用，稳就业保民生仍是政策底线。同时对资本市场的改革明确了目标，在科创板试点增量注册制改革的经验积累上，创业板试点存量市场的注册制改革，为全市场分阶段实现注册制改革目标迈出重要一步。中长期来看，虽然疫情对上半年全球经济基本面造成较负面的影响，但考虑到中国在世界产业链中的重要地位，及疫情在中国政府强有力的防控措施下已得到控制，难以对中国中长期经济发展趋势形成实质性影响。我们对市场仍保持乐观，在整体经济复苏加快的基础上，资本市场仍有强大的吸引力。我们继续看好成长股在市场复苏阶段的表现，后续现金流好、股息率高、行业稳定增长且公司地位明确的股票更有优势。

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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

基金日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行。基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以双方认可的方式报送给基金托管人，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，无误后返回给基金管理人，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

当发生了影响估值方法和程序的有效性、适用性的情况时，通过会议方式启动估值委员会的运作。研究人员凭借其丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究，综合宏观经济、行业发展及个券状况等各方面因素，从价值投资的角度进行理论分析，并根据分析的结果向基金估值委员会提出有关估值方法或估值模型的建议。风险管理人员根据研究人员提出的估值方法或估

值模型进行计算及验证，并根据计算和验证的结果与投资人员共同确定估值方法并提交估值委员会。基金事务部基金会计负责与基金托管人沟通，必要时应就所采用的估值技术、假设及输入值得适当性等咨询会计师事务所的专业意见。法律、监察稽核部相关人员负责监察执行估值政策及程序的合规性，控制执行中可能发生的风险。估值委员会共同讨论通过后，基金事务部基金会计根据估值委员会确认的估值方法对各基金进行估值核算并与基金托管行核对，法律、监察稽核部负责对外进行信息披露。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《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 2020 年 1 月 1 日至 2020 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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

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

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	5,388,010.18	8,704,955.38
结算备付金		214,002.97	961,447.69
存出保证金		60,535.73	168,930.11
交易性金融资产	6.4.7.2	160,355,404.06	354,756,142.68
其中：股票投资		160,355,404.06	354,756,142.68
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		26,063.50	2,355,796.57
应收利息	6.4.7.5	1,006.35	3,325.41
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		166,045,022.79	366,950,597.84
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2019 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		-	2,113,566.60
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		68,301.97	162,243.58
应付托管费		13,660.36	32,448.73
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	57,197.96	313,803.84
应交税费		-	-
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	772,037.82	620,622.78
负债合计		911,198.11	3,242,685.53
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	138,005,740.00	326,005,740.00
未分配利润	6.4.7.10	27,128,084.68	37,702,172.31
所有者权益合计		165,133,824.68	363,707,912.31
负债和所有者权益总计		166,045,022.79	366,950,597.84

注：报告截止日 2020 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.1966 元，基金份额总额 138,005,740.00 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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		12,885,841.46	285,164,335.87
1. 利息收入		27,379.66	96,743.11
其中：存款利息收入	6.4.7.11	27,362.98	96,635.28
债券利息收入		16.68	107.83
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）		19,568,418.32	107,874,225.32
其中：股票投资收益	6.4.7.12	18,048,819.51	102,966,273.04
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	37,459.04	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	1,482,139.77	4,781,291.91
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-6,861,484.23	175,009,507.38
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	151, 527. 71	2, 183, 860. 06
减: 二、费用		1, 144, 327. 46	5, 117, 583. 37
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	535, 452. 66	2, 128, 596. 90
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	107, 090. 46	425, 719. 39
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6. 4. 7. 18	331, 175. 52	2, 196, 086. 12
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0. 06	0. 08
7. 其他费用	6. 4. 7. 19	170, 608. 76	367, 180. 88
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)		11, 741, 514. 00	280, 046, 752. 50
减: 所得税费用		-	-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)		11, 741, 514. 00	280, 046, 752. 50

### 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: 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 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)	326, 005, 740. 00	37, 702, 172. 31	363, 707, 912. 31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	11, 741, 514. 00	11, 741, 514. 00
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)	-188, 000, 000. 00	-22, 315, 601. 63	-210, 315, 601. 63
其中: 1. 基金申购款	60, 000, 000. 00	5, 305, 841. 25	65, 305, 841. 25
2. 基金赎回款	-248, 000, 000. 00	-27, 621, 442. 88	-275, 621, 442. 88
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）	138,005,740.00	27,128,084.68	165,133,824.68
项目	上年度可比期间 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

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

康乐

吴建军

邵媛媛

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

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

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

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数 MSCI 中国 A 股国际通指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股,投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%,且不低于非现金基金资产的 80%。此外,为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于部分非成份股(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、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 8 月 20 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 2020 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 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 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[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。

#### 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 2020 年 6 月 30 日
活期存款	5,388,010.18
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	5,388,010.18

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	142,756,478.01	160,355,404.06	17,598,926.05
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债   交易所市场	-	-	-

券	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		142,756,478.01	160,355,404.06	17,598,926.05

注：于 2020 年 6 月 30 日，股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值 0 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 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	895.20
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	86.67
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	-
应收出借证券利息	-
其他	24.48
合计	1,006.35

#### 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 2020 年 6 月 30 日

交易所市场应付交易费用	57,197.96
银行间市场应付交易费用	-
合计	57,197.96

## 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	214,481.66
应付指数使用费	187,084.42
应退替代款	370,471.74
合计	772,037.82

## 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	326,005,740.00	326,005,740.00
本期申购	60,000,000.00	60,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-248,000,000.00	-248,000,000.00
- 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	138,005,740.00	138,005,740.00

## 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	45,496,526.64	-7,794,354.33	37,702,172.31
本期利润	18,602,998.23	-6,861,484.23	11,741,514.00
本期基金份额交易产生的变动数	-32,662,243.05	10,346,641.42	-22,315,601.63
其中：基金申购款	11,769,073.87	-6,463,232.62	5,305,841.25
基金赎回款	-44,431,316.92	16,809,874.04	-27,621,442.88
本期已分配利润	-	-	-
本期末	31,437,281.82	-4,309,197.14	27,128,084.68

## 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日

活期存款利息收入	24,871.60
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	1,685.72
其他	805.66
合计	27,362.98

#### 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 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	15,080,482.96
股票投资收益——赎回差价收入	2,968,336.55
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	18,048,819.51

##### 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 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出股票成交总额	132,051,021.66
减：卖出股票成本总额	116,970,538.70
买卖股票差价收入	15,080,482.96

##### 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 2020年1月1日至2020年6月30日
赎回基金份额对价总额	275,621,442.88
减：现金支付赎回款总额	104,211,836.88
减：赎回股票成本总额	168,441,269.45
赎回差价收入	2,968,336.55

#### 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交	115,876.22

总额	
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	78,400.00
减：应收利息总额	17.18
买卖债券差价收入	37,459.04

#### 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 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,482,139.77
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	1,482,139.77

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
1. 交易性金融资产	-6,861,484.23
股票投资	-6,861,484.23
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	-6,861,484.23

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0元。

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	151,527.71



合计	151,527.71
----	------------

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 2020年1月1日至2020年6月30日
交易所市场交易费用	331,175.52
银行间市场交易费用	-
合计	331,175.52

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	34,809.32
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行划款手续费	4,530.49
指数使用费	71,236.61
其他	360.00
合计	170,608.76

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

本基金于本报告期及上年度可比区间未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 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

本基金于本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

##### 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 2020年1月1日至2020年6 月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	535,452.66	2,128,596.90
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 2020年1月1日至2020年6 月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 6月30日
----	--------------------------------	-------------------------------------

	月 30 日	6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	107,090.46	425,719.39

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：

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

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金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。

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

本基金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。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人于本报告期及上年度可比期间未运用自有资金投资本基金。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2020年6月30日		上年度末 2019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	40,000,000.00	28.98	84,000,000.00	25.77

## 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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
农业银行	5,388,010.18	24,871.60	16,897,196.53	85,964.01

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

## 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

## 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

于2020年6月30日，本基金持有372,400.00股中国农业银行的A股普通股，成本总额为人民币1,314,528.70元，估值总额为人民币1,258,712.00元，占基金资产净值的比例为0.76%（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%）。

## 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(2020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
002500	山西证券	2020年6月29日	2020年7月10日	配股流通受限	5.00	6.54	4,440	22,200.00	29,037.60	-
300840	酷特智能	2020年6月30日	2020年7月8日	新股流通受限	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-
300843	胜蓝股份	2020年6月23日	2020年7月2日	新股流通受限	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-
300845	捷安高科	2020年6月24日	2020年7月3日	新股流通受限	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-
300846	首都在线	2020年6月22日	2020年7月1日	新股流通受限	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-
300847	中船汉光	2020年6月29日	2020年7月9日	新股流通受限	6.94	6.94	1,421	9,861.74	9,861.74	-

## 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。

### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

### 6.4.13.2 信用风险

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

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

本基金管理人还通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不

超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，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：同）。

### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司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 2020年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	5,388,010.18	-	-	-	-	-	5,388,010.18
结算备付金	214,002.97	-	-	-	-	-	214,002.97
存出保证金	60,535.73	-	-	-	-	-	60,535.73
交易性金融资产	-	-	-	-	-	160,355,404.06	160,355,404.06
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	1,006.35	1,006.35
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	26,063.50	26,063.50

其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	5,662,548.88	-	-	-	-	-160,382,473.91	166,045,022.79
负债							
应付赎回款							
应付管理人报酬						68,301.97	68,301.97
应付托管费						13,660.36	13,660.36
应付证券清算款							
卖出回购金融资产款							
应付销售服务费							
应付交易费用						57,197.96	57,197.96
应付利息							
应付利润							
应交税费							
其他负债						772,037.82	772,037.82
负债总计						911,198.11	911,198.11
利率敏感度缺口	5,662,548.88	-	-	-	-	-	-
上年度末 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
资产							
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							
资产总计	9,835,333.18	-	-	-	-	-357,115,264.66	366,950,597.84
负债							
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



负债总计	-	-	-	-	3,242,685.53	3,242,685.53
利率敏感度缺口	9,835,333.18	-	-	-	-	-

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末，本基金未持有债券资产（上年末：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年末：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 2020年6月30日		上年度末 2019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	160,355,404.06	97.11	354,756,142.68	97.54
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	160,355,404.06	97.11	354,756,142.68	97.54

## 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		
	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（2020 年 6 月 30 日）	上年度末（2019 年 12 月 31 日）
分析	沪深 300 指数上升 5%	8,042,339.31	17,282,216.89
	沪深 300 指数下降 5%	-8,042,339.31	-17,282,216.89

## 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 2020 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 160,289,850.74 元，属于第二层次的余额为 65,553.32 元，无属于第三层次的余额(2019 年 12 月 31 日：第一层次 354,093,593.82 元，第二层次 662,548.86 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 2020 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(2019 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 2020 年上半年，本基金申购基金份额的对价总额为 65,305,841.25 元，其中包括以股票支付的申购款 33,652,125.17 元和以现金支付的申购款 31,653,716.08 元(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)。

(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。

## § 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	160,355,404.06	96.57
	其中：股票	160,355,404.06	96.57
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	5,602,013.15	3.37
8	其他各项资产	87,605.58	0.05
9	合计	166,045,022.79	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	2,662,952.00	1.61
B	采矿业	3,951,883.55	2.39
C	制造业	82,487,050.82	49.95
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,933,444.22	2.38

E	建筑业	3,259,854.56	1.97
F	批发和零售业	2,584,149.14	1.56
G	交通运输、仓储和邮政业	4,272,663.64	2.59
H	住宿和餐饮业	182,001.00	0.11
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,904,265.79	5.39
J	金融业	34,530,367.36	20.91
K	房地产业	5,855,626.52	3.55
L	租赁和商务服务业	2,295,732.20	1.39
M	科学研究和技术服务业	1,382,111.00	0.84
N	水利、环境和公共设施管理业	128,296.00	0.08
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	230,325.00	0.14
Q	卫生和社会工作	2,022,271.56	1.22
R	文化、体育和娱乐业	1,407,756.50	0.85
S	综合	104,341.00	0.06
	合计	160,195,091.86	97.01

### 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	-	-
C	制造业	135,448.31	0.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,766.32	0.01
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	12,097.57	0.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-

Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	160,312.20	0.10

### 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	6,187	9,050,838.56	5.48
2	601318	中国平安	53,346	3,808,904.40	2.31
3	600036	招商银行	103,178	3,479,162.16	2.11
4	000858	五粮液	19,400	3,319,728.00	2.01
5	600276	恒瑞医药	26,118	2,410,691.40	1.46
6	600900	长江电力	110,012	2,083,627.28	1.26
7	300750	宁德时代	11,015	1,920,575.40	1.16
8	002475	立讯精密	34,980	1,796,223.00	1.09
9	603288	海天味业	13,261	1,649,668.40	1.00
10	601166	兴业银行	103,800	1,637,964.00	0.99
11	300760	迈瑞医疗	5,200	1,589,640.00	0.96
12	600000	浦发银行	146,800	1,553,144.00	0.94
13	002714	牧原股份	18,730	1,535,860.00	0.93
14	601888	中国中免	9,400	1,447,882.00	0.88
15	002415	海康威视	46,715	1,417,800.25	0.86
16	601398	工商银行	269,700	1,343,106.00	0.81
17	000002	万科A	48,685	1,272,625.90	0.77
18	601288	农业银行	372,400	1,258,712.00	0.76
19	000001	平安银行	96,900	1,240,320.00	0.75
20	600030	中信证券	47,900	1,154,869.00	0.70
21	600585	海螺水泥	19,949	1,055,501.59	0.64
22	601328	交通银行	196,300	1,007,019.00	0.61
23	600016	民生银行	177,260	1,005,064.20	0.61
24	601668	中国建筑	210,060	1,001,986.20	0.61
25	603259	药明康德	10,100	975,660.00	0.59
26	600887	伊利股份	30,445	947,752.85	0.57
27	000661	长春高新	2,100	914,130.00	0.55
28	600048	保利地产	59,700	882,366.00	0.53
29	300015	爱尔眼科	20,112	873,866.40	0.53
30	000651	格力电器	15,129	855,847.53	0.52

31	601601	中国太保	31,400	855,650.00	0.52
32	300059	东方财富	40,320	814,464.00	0.49
33	002352	顺丰控股	14,786	808,794.20	0.49
34	300122	智飞生物	8,000	801,200.00	0.49
35	002304	洋河股份	7,613	800,430.82	0.48
36	000725	京东方 A	169,300	790,631.00	0.48
37	600031	三一重工	42,100	789,796.00	0.48
38	002142	宁波银行	29,900	785,473.00	0.48
39	600309	万华化学	15,565	778,094.35	0.47
40	000063	中兴通讯	19,200	770,496.00	0.47
41	601012	隆基股份	18,520	754,319.60	0.46
42	600588	用友网络	16,323	719,844.30	0.44
43	601818	光大银行	198,900	712,062.00	0.43
44	300498	温氏股份	31,840	694,112.00	0.42
45	601688	华泰证券	36,609	688,249.20	0.42
46	601766	中国中车	121,730	678,036.10	0.41
47	000568	泸州老窖	7,335	668,365.20	0.40
48	600104	上汽集团	38,895	660,826.05	0.40
49	002594	比亚迪	9,120	654,816.00	0.40
50	601211	国泰君安	37,528	647,733.28	0.39
51	000895	双汇发展	13,800	636,042.00	0.39
52	000876	新希望	21,101	628,809.80	0.38
53	600999	招商证券	28,600	627,770.00	0.38
54	600050	中国联通	129,400	626,296.00	0.38
55	601988	中国银行	175,700	611,436.00	0.37
56	600809	山西汾酒	4,201	609,145.00	0.37
57	603501	韦尔股份	3,000	605,850.00	0.37
58	600745	闻泰科技	4,800	604,560.00	0.37
59	000538	云南白药	6,400	600,384.00	0.36
60	300413	芒果超媒	8,990	586,148.00	0.35
61	601229	上海银行	69,804	579,373.20	0.35
62	000166	申万宏源	112,600	568,630.00	0.34
63	600570	恒生电子	5,229	563,163.30	0.34
64	600690	海尔智家	31,500	557,550.00	0.34
65	603986	兆易创新	2,300	542,593.00	0.33
66	001979	招商蛇口	33,000	542,520.00	0.33
67	600436	片仔癀	3,104	528,456.00	0.32
68	601066	中信建投	13,400	527,692.00	0.32
69	601006	大秦铁路	74,400	523,776.00	0.32
70	601169	北京银行	105,500	516,950.00	0.31
71	603160	汇顶科技	2,300	512,670.00	0.31
72	601390	中国中铁	101,900	511,538.00	0.31

73	600703	三安光电	20,400	510,000.00	0.31
74	600837	海通证券	40,424	508,533.92	0.31
75	300601	康泰生物	3,100	502,696.00	0.30
76	600028	中国石化	127,600	498,916.00	0.30
77	002555	三七互娱	10,500	491,400.00	0.30
78	601186	中国铁建	57,422	481,196.36	0.29
79	002241	歌尔股份	16,300	478,568.00	0.29
80	600547	山东黄金	12,960	474,595.20	0.29
81	600406	国电南瑞	22,894	463,603.50	0.28
82	002007	华兰生物	9,190	460,510.90	0.28
83	601989	中国重工	113,853	455,412.00	0.28
84	601138	工业富联	29,857	452,333.55	0.27
85	601857	中国石油	107,749	451,468.31	0.27
86	601933	永辉超市	47,808	448,439.04	0.27
87	601336	新华保险	10,119	448,069.32	0.27
88	300014	亿纬锂能	9,285	444,287.25	0.27
89	000938	紫光股份	10,128	435,301.44	0.26
90	601899	紫金矿业	97,900	430,760.00	0.26
91	002371	北方华创	2,500	427,275.00	0.26
92	000100	TCL 科技	67,700	419,740.00	0.25
93	000776	广发证券	29,700	419,364.00	0.25
94	600019	宝钢股份	91,456	417,039.36	0.25
95	002916	深南电路	2,480	415,449.60	0.25
96	600346	恒力石化	29,340	410,760.00	0.25
97	002027	分众传媒	73,460	409,172.20	0.25
98	000338	潍柴动力	29,800	408,856.00	0.25
99	002230	科大讯飞	10,900	407,987.00	0.25
100	002024	苏宁易购	46,500	407,805.00	0.25
101	300142	沃森生物	7,700	403,172.00	0.24
102	300433	蓝思科技	14,200	398,168.00	0.24
103	601088	中国神华	27,530	395,330.80	0.24
104	002050	三花智控	17,870	391,353.00	0.24
105	600015	华夏银行	63,918	391,178.16	0.24
106	002410	广联达	5,600	390,320.00	0.24
107	300347	泰格医药	3,700	376,956.00	0.23
108	601628	中国人寿	13,850	376,858.50	0.23
109	002311	海大集团	7,900	375,961.00	0.23
110	300033	同花顺	2,800	372,624.00	0.23
111	002624	完美世界	6,434	370,855.76	0.22
112	601009	南京银行	49,866	365,517.78	0.22
113	601155	新城控股	11,200	349,888.00	0.21
114	601100	恒立液压	4,300	344,860.00	0.21

115	600340	华夏幸福	15,077	344,660.22	0.21
116	600438	通威股份	19,368	336,615.84	0.20
117	600196	复星医药	9,908	335,385.80	0.20
118	600009	上海机场	4,600	331,522.00	0.20
119	300124	汇川技术	8,725	331,462.75	0.20
120	300003	乐普医疗	9,000	328,680.00	0.20
121	300676	华大基因	2,100	327,411.00	0.20
122	600919	江苏银行	57,600	326,592.00	0.20
123	600183	生益科技	11,100	324,897.00	0.20
124	600741	华域汽车	15,600	324,324.00	0.20
125	002493	荣盛石化	26,300	323,490.00	0.20
126	002271	东方雨虹	7,900	320,977.00	0.19
127	603993	洛阳钼业	86,900	318,923.00	0.19
128	002841	视源股份	3,200	318,464.00	0.19
129	002602	世纪华通	20,700	316,917.00	0.19
130	601788	光大证券	19,527	313,603.62	0.19
131	002129	中环股份	13,900	312,194.00	0.19
132	002001	新和成	10,700	311,370.00	0.19
133	600383	金地集团	22,362	306,359.40	0.19
134	002600	领益智造	28,600	304,018.00	0.18
135	601939	建设银行	48,100	303,511.00	0.18
136	601225	陕西煤业	41,800	301,378.00	0.18
137	000596	古井贡酒	2,000	300,480.00	0.18
138	300558	贝达药业	2,100	293,958.00	0.18
139	002120	韵达股份	12,010	293,644.50	0.18
140	002460	赣锋锂业	5,450	291,956.50	0.18
141	002821	凯莱英	1,200	291,600.00	0.18
142	601901	方正证券	41,128	291,186.24	0.18
143	002236	大华股份	15,100	290,071.00	0.18
144	300454	深信服	1,400	288,344.00	0.17
145	300529	健帆生物	4,130	287,035.00	0.17
146	000977	浪潮信息	7,256	284,290.08	0.17
147	600763	通策医疗	1,700	283,509.00	0.17
148	002044	美年健康	19,576	282,090.16	0.17
149	600958	东方证券	29,600	280,904.00	0.17
150	601877	正泰电器	10,500	276,675.00	0.17
151	600886	国投电力	34,000	267,240.00	0.16
152	300628	亿联网络	3,900	266,214.00	0.16
153	601985	中国核电	64,800	265,032.00	0.16
154	600926	杭州银行	29,700	264,924.00	0.16
155	601669	中国电建	76,500	264,690.00	0.16
156	002812	恩捷股份	4,000	263,200.00	0.16



157	600893	航发动力	11,182	262,553.36	0.16
158	600600	青岛啤酒	3,382	258,723.00	0.16
159	002127	南极电商	12,200	258,274.00	0.16
160	300136	信维通信	4,800	254,496.00	0.15
161	603939	益丰药房	2,760	251,160.00	0.15
162	603899	晨光文具	4,600	251,160.00	0.15
163	600606	绿地控股	40,600	250,908.00	0.15
164	002456	欧菲光	13,600	250,104.00	0.15
165	000069	华侨城 A	41,000	248,460.00	0.15
166	600521	华海药业	7,310	248,028.30	0.15
167	601881	中国银河	21,600	247,752.00	0.15
168	603369	今世缘	6,200	246,698.00	0.15
169	000768	中航飞机	13,900	246,586.00	0.15
170	600010	包钢股份	227,900	246,132.00	0.15
171	300661	圣邦股份	800	244,040.00	0.15
172	300408	三环集团	8,800	243,760.00	0.15
173	603658	安图生物	1,500	243,660.00	0.15
174	002384	东山精密	8,100	242,595.00	0.15
175	603019	中科曙光	6,300	241,920.00	0.15
176	300253	卫宁健康	10,520	241,328.80	0.15
177	600845	宝信软件	4,000	236,320.00	0.14
178	002414	高德红外	8,000	234,240.00	0.14
179	601990	南京证券	16,400	234,028.00	0.14
180	300308	中际旭创	3,700	233,100.00	0.14
181	000425	徐工机械	39,200	231,672.00	0.14
182	002736	国信证券	20,500	231,650.00	0.14
183	600161	天坛生物	5,100	231,183.00	0.14
184	002607	中公教育	8,300	230,325.00	0.14
185	600332	白云山	7,026	227,150.58	0.14
186	300144	宋城演艺	13,120	226,976.00	0.14
187	603659	璞泰来	2,200	226,644.00	0.14
188	601377	兴业证券	33,000	226,050.00	0.14
189	002179	中航光电	5,500	225,555.00	0.14
190	002049	紫光国微	3,100	225,525.00	0.14
191	600872	中炬高新	3,849	225,281.97	0.14
192	600061	国投资本	17,594	223,971.62	0.14
193	601618	中国中冶	89,200	223,892.00	0.14
194	000963	华东医药	8,817	223,070.10	0.14
195	603444	吉比特	400	219,604.00	0.13
196	603517	绝味食品	3,100	219,294.00	0.13
197	601111	中国国航	33,100	218,791.00	0.13
198	002157	正邦科技	12,500	218,500.00	0.13

199	600029	南方航空	42,200	218,174.00	0.13
200	002463	沪电股份	8,700	217,326.00	0.13
201	000656	金科股份	26,600	217,056.00	0.13
202	300595	欧普康视	3,100	214,954.00	0.13
203	000625	长安汽车	19,511	214,621.00	0.13
204	603799	华友钴业	5,510	214,118.60	0.13
205	002252	上海莱士	24,800	209,808.00	0.13
206	600352	浙江龙盛	16,400	209,756.00	0.13
207	000157	中联重科	32,300	207,689.00	0.13
208	600660	福耀玻璃	9,900	206,613.00	0.13
209	600536	中国软件	2,600	205,920.00	0.12
210	603882	金域医学	2,300	205,850.00	0.12
211	601360	三六零	11,211	205,273.41	0.12
212	000860	顺鑫农业	3,600	205,128.00	0.12
213	600674	川投能源	22,100	204,867.00	0.12
214	601727	上海电气	40,600	204,624.00	0.12
215	601162	天风证券	33,300	201,798.00	0.12
216	300383	光环新网	7,700	200,739.00	0.12
217	603707	健友股份	3,100	200,167.00	0.12
218	002032	苏泊尔	2,800	198,800.00	0.12
219	300450	先导智能	4,300	198,703.00	0.12
220	600298	安琪酵母	4,000	197,920.00	0.12
221	600115	东方航空	46,700	197,074.00	0.12
222	002065	东华软件	15,700	196,564.00	0.12
223	601872	招商轮船	33,700	196,471.00	0.12
224	600018	上港集团	46,200	194,040.00	0.12
225	000066	中国长城	14,600	192,720.00	0.12
226	002385	大北农	21,000	191,310.00	0.12
227	601319	中国人保	29,600	190,624.00	0.12
228	300482	万孚生物	1,800	187,200.00	0.11
229	002603	以岭药业	6,000	187,140.00	0.11
230	600760	中航沈飞	5,696	186,942.72	0.11
231	002185	华天科技	13,800	186,714.00	0.11
232	000783	长江证券	27,700	186,698.00	0.11
233	603338	浙江鼎力	2,460	186,394.20	0.11
234	002439	启明星辰	4,400	185,108.00	0.11
235	600085	同仁堂	6,805	184,551.60	0.11
236	600132	重庆啤酒	2,500	182,500.00	0.11
237	601108	财通证券	17,800	182,450.00	0.11
238	600795	国电电力	98,400	182,040.00	0.11
239	002223	鱼跃医疗	5,000	182,000.00	0.11
240	600118	中国卫星	5,900	181,897.00	0.11

241	000786	北新建材	8,500	181,305.00	0.11
242	601600	中国铝业	65,500	180,780.00	0.11
243	603605	珀莱雅	1,000	180,020.00	0.11
244	002373	千方科技	7,500	179,925.00	0.11
245	002299	圣农发展	6,200	179,800.00	0.11
246	601607	上海医药	9,700	178,286.00	0.11
247	601799	星宇股份	1,400	177,800.00	0.11
248	002146	荣盛发展	21,900	177,390.00	0.11
249	600998	九州通	9,500	176,890.00	0.11
250	600522	中天科技	15,400	176,330.00	0.11
251	600867	通化东宝	10,105	176,130.15	0.11
252	002180	纳思达	5,300	174,423.00	0.11
253	600705	中航资本	44,000	174,240.00	0.11
254	002773	康弘药业	3,500	173,600.00	0.11
255	002690	美亚光电	3,300	173,580.00	0.11
256	600109	国金证券	15,200	173,432.00	0.11
257	002153	石基信息	4,427	172,785.81	0.10
258	601800	中国交建	23,400	171,756.00	0.10
259	002202	金风科技	17,184	171,324.48	0.10
260	600111	北方稀土	18,203	169,651.96	0.10
261	300699	光威复材	2,700	169,371.00	0.10
262	002466	天齐锂业	7,374	169,233.30	0.10
263	601919	中远海控	48,602	168,648.94	0.10
264	000703	恒逸石化	18,410	168,083.30	0.10
265	300357	我武生物	2,700	168,075.00	0.10
266	600498	烽火通信	5,800	167,678.00	0.10
267	000961	中南建设	18,500	164,650.00	0.10
268	300496	中科创达	2,100	163,170.00	0.10
269	001914	招商积余	5,300	162,869.00	0.10
270	603833	欧派家居	1,405	162,839.50	0.10
271	000021	深科技	7,400	161,542.00	0.10
272	600801	华新水泥	6,800	161,228.00	0.10
273	300285	国瓷材料	4,800	160,848.00	0.10
274	600637	东方明珠	16,650	160,672.50	0.10
275	300251	光线传媒	14,700	160,377.00	0.10
276	002405	四维图新	9,700	159,953.00	0.10
277	603858	步长制药	5,531	159,569.35	0.10
278	600176	中国巨石	17,400	159,210.00	0.10
279	300316	晶盛机电	6,400	158,336.00	0.10
280	600487	亨通光电	9,620	157,864.20	0.10
281	603589	口子窖	3,100	157,790.00	0.10
282	601231	环旭电子	7,219	157,662.96	0.10

283	600489	中金黄金	17,215	157,345.10	0.10
284	002601	龙蟒佰利	8,500	157,250.00	0.10
285	601018	宁波港	44,000	157,080.00	0.10
286	600895	张江高科	7,700	156,849.00	0.09
287	300212	易华录	2,800	156,800.00	0.09
288	601555	东吴证券	19,199	156,663.84	0.09
289	002739	万达电影	10,250	156,517.50	0.09
290	600779	水井坊	2,500	156,050.00	0.09
291	600380	健康元	9,600	155,904.00	0.09
292	300146	汤臣倍健	7,900	155,551.00	0.09
293	000050	深天马 A	10,100	155,136.00	0.09
294	601021	春秋航空	4,400	155,056.00	0.09
295	002212	南洋股份	5,800	154,164.00	0.09
296	002152	广电运通	11,900	153,986.00	0.09
297	600011	华能国际	36,487	153,975.14	0.09
298	600004	白云机场	10,100	153,924.00	0.09
299	000975	银泰黄金	9,800	153,664.00	0.09
300	002294	信立泰	5,180	153,638.80	0.09
301	600315	上海家化	3,200	153,280.00	0.09
302	600201	生物股份	5,500	153,120.00	0.09
303	002422	科伦药业	7,200	151,200.00	0.09
304	600271	航天信息	9,302	151,064.48	0.09
305	600511	国药股份	3,700	150,479.00	0.09
306	002074	国轩高科	5,600	150,304.00	0.09
307	603883	老百姓	1,500	150,060.00	0.09
308	600177	雅戈尔	25,100	149,596.00	0.09
309	601198	东兴证券	13,700	149,330.00	0.09
310	300207	欣旺达	7,900	149,310.00	0.09
311	002465	海格通信	11,500	148,810.00	0.09
312	002558	巨人网络	8,500	147,900.00	0.09
313	601689	拓普集团	5,300	147,870.00	0.09
314	600699	均胜电子	6,200	147,622.00	0.09
315	601998	中信银行	28,500	146,775.00	0.09
316	002508	老板电器	4,700	146,217.00	0.09
317	603712	七一二	3,800	145,844.00	0.09
318	600739	辽宁成大	7,700	145,761.00	0.09
319	002353	杰瑞股份	4,700	145,700.00	0.09
320	600426	华鲁恒升	8,200	144,976.00	0.09
321	002511	中顺洁柔	6,500	144,950.00	0.09
322	600885	宏发股份	3,600	144,432.00	0.09
323	600655	豫园股份	16,300	144,418.00	0.09
324	600642	申能股份	24,400	144,204.00	0.09

325	000513	丽珠集团	3,000	144,030.00	0.09
326	600598	北大荒	8,900	143,290.00	0.09
327	601838	成都银行	18,000	143,280.00	0.09
328	000999	华润三九	4,900	143,031.00	0.09
329	002156	通富微电	5,700	142,785.00	0.09
330	603866	桃李面包	2,800	142,492.00	0.09
331	002673	西部证券	17,442	142,326.72	0.09
332	300418	昆仑万维	5,700	142,272.00	0.09
333	002013	中航机电	18,000	142,200.00	0.09
334	000728	国元证券	16,800	141,120.00	0.09
335	002557	洽洽食品	2,600	140,894.00	0.09
336	002507	涪陵榨菜	3,900	140,439.00	0.09
337	002926	华西证券	13,200	140,316.00	0.08
338	002019	亿帆医药	6,100	140,117.00	0.08
339	002925	盈趣科技	2,400	139,056.00	0.08
340	600362	江西铜业	10,300	138,638.00	0.08
341	002242	九阳股份	3,700	137,899.00	0.08
342	601878	浙商证券	13,900	137,749.00	0.08
343	600068	葛洲坝	23,100	137,445.00	0.08
344	000739	普洛药业	5,900	137,411.00	0.08
345	600170	上海建工	44,500	136,615.00	0.08
346	002075	沙钢股份	10,900	136,250.00	0.08
347	300088	长信科技	12,100	135,520.00	0.08
348	601117	中国化学	24,700	135,356.00	0.08
349	600066	宇通客车	11,000	134,200.00	0.08
350	600486	扬农化工	1,600	132,000.00	0.08
351	002131	利欧股份	33,800	130,468.00	0.08
352	600369	西南证券	28,200	129,438.00	0.08
353	000671	阳光城	20,300	128,702.00	0.08
354	000627	天茂集团	24,700	128,687.00	0.08
355	601992	金隅集团	42,000	128,520.00	0.08
356	600208	新湖中宝	43,100	128,438.00	0.08
357	300070	碧水源	15,800	128,296.00	0.08
358	300168	万达信息	5,800	128,006.00	0.08
359	000723	美锦能源	20,400	127,704.00	0.08
360	002399	海普瑞	5,100	127,704.00	0.08
361	002939	长城证券	10,300	126,896.00	0.08
362	002500	山西证券	19,240	125,829.60	0.08
363	600089	特变电工	18,444	124,865.88	0.08
364	002468	申通快递	7,600	124,716.00	0.08
365	600221	海航控股	82,600	123,900.00	0.08
366	600875	东方电气	14,000	123,900.00	0.08

367	002078	太阳纸业	13,000	123,760.00	0.07
368	600038	中直股份	3,000	123,210.00	0.07
369	002958	青农商行	27,800	123,154.00	0.07
370	600667	太极实业	10,400	122,928.00	0.07
371	000988	华工科技	5,000	122,150.00	0.07
372	600909	华安证券	17,800	121,574.00	0.07
373	600219	南山铝业	59,400	120,582.00	0.07
374	002797	第一创业	17,400	120,408.00	0.07
375	601966	玲珑轮胎	5,960	120,392.00	0.07
376	600516	方大炭素	18,914	118,779.92	0.07
377	002683	宏大爆破	3,400	118,660.00	0.07
378	002340	格林美	23,800	118,286.00	0.07
379	000750	国海证券	27,140	117,787.60	0.07
380	002030	达安基因	4,310	117,576.80	0.07
381	601233	桐昆股份	9,200	117,392.00	0.07
382	600153	建发股份	14,290	115,749.00	0.07
383	000932	华菱钢铁	30,700	115,739.00	0.07
384	600027	华电国际	33,800	115,596.00	0.07
385	002174	游族网络	4,400	114,752.00	0.07
386	000423	东阿阿胶	3,200	114,592.00	0.07
387	000540	中天金融	35,000	112,700.00	0.07
388	600026	中远海能	17,200	111,112.00	0.07
389	000547	航天发展	8,100	110,727.00	0.07
390	600167	联美控股	7,700	110,418.00	0.07
391	300271	华宇软件	3,900	110,019.00	0.07
392	000998	隆平高科	6,600	109,890.00	0.07
393	002572	索菲亚	4,500	108,765.00	0.07
394	600188	兖州煤业	12,400	108,624.00	0.07
395	002281	光迅科技	3,300	108,438.00	0.07
396	601099	太平洋	34,200	108,414.00	0.07
397	600754	锦江酒店	3,900	108,225.00	0.07
398	300024	机器人	7,900	107,993.00	0.07
399	000709	河钢股份	52,700	107,508.00	0.07
400	000401	冀东水泥	6,700	107,468.00	0.07
401	601216	君正集团	42,000	106,680.00	0.06
402	600704	物产中大	25,300	106,513.00	0.06
403	002081	金螳螂	13,500	106,110.00	0.06
404	002396	星网锐捷	3,000	105,990.00	0.06
405	000688	国城矿业	5,700	105,621.00	0.06
406	600688	上海石化	30,330	105,548.40	0.06
407	600673	东阳光	15,100	104,341.00	0.06
408	601128	常熟银行	13,800	103,638.00	0.06

409	600977	中国电影	7,800	102,414.00	0.06
410	000630	铜陵有色	52,800	101,904.00	0.06
411	300017	网宿科技	12,000	101,880.00	0.06
412	600566	济川药业	4,000	101,840.00	0.06
413	600583	海油工程	22,000	100,100.00	0.06
414	000402	金融街	15,000	99,600.00	0.06
415	000686	东北证券	11,700	98,865.00	0.06
416	600372	中航电子	7,400	98,568.00	0.06
417	000729	燕京啤酒	14,200	97,270.00	0.06
418	002387	维信诺	6,800	97,104.00	0.06
419	600021	上海电力	13,000	96,200.00	0.06
420	601098	中南传媒	9,000	95,220.00	0.06
421	000825	太钢不锈	28,600	94,952.00	0.06
422	600160	巨化股份	13,700	94,393.00	0.06
423	600460	士兰微	6,400	93,952.00	0.06
424	600733	北汽蓝谷	14,500	93,235.00	0.06
425	000027	深圳能源	19,920	92,428.80	0.06
426	600256	广汇能源	34,100	92,070.00	0.06
427	002372	伟星新材	7,900	91,877.00	0.06
428	000623	吉林敖东	5,800	91,234.00	0.06
429	000415	渤海租赁	30,600	91,188.00	0.06
430	600820	隧道股份	15,800	89,270.00	0.05
431	002010	传化智联	16,400	89,216.00	0.05
432	600967	内蒙一机	8,500	88,315.00	0.05
433	600879	航天电子	13,700	88,228.00	0.05
434	002268	卫士通	4,100	87,494.00	0.05
435	000629	攀钢钒钛	43,300	87,033.00	0.05
436	000028	国药一致	1,900	85,519.00	0.05
437	601699	潞安环能	15,100	84,107.00	0.05
438	000581	威孚高科	4,053	83,816.04	0.05
439	601958	金钼股份	13,448	83,108.64	0.05
440	000997	新大陆	5,200	83,096.00	0.05
441	600549	厦门钨业	7,000	82,880.00	0.05
442	300026	红日药业	15,000	82,800.00	0.05
443	600675	中华企业	20,300	82,621.00	0.05
444	002217	合力泰	15,700	82,425.00	0.05
445	600446	金证股份	4,200	81,480.00	0.05
446	000046	泛海控股	21,600	81,432.00	0.05
447	002195	二三四五	28,961	81,380.41	0.05
448	002110	三钢闽光	12,200	81,252.00	0.05
449	600466	蓝光发展	15,000	80,850.00	0.05
450	600373	中文传媒	6,800	80,104.00	0.05

451	300012	华测检测	4,000	79,040.00	0.05
452	002563	森马服饰	11,200	78,960.00	0.05
453	000089	深圳机场	10,200	78,132.00	0.05
454	000738	航发控制	5,700	77,805.00	0.05
455	000983	西山煤电	20,590	77,212.50	0.05
456	300296	利亚德	12,700	77,089.00	0.05
457	600808	马钢股份	29,500	76,110.00	0.05
458	000883	湖北能源	21,600	76,032.00	0.05
459	603885	吉祥航空	8,200	74,620.00	0.05
460	600376	首开股份	12,600	73,836.00	0.04
461	600258	首旅酒店	4,800	73,776.00	0.04
462	600572	康恩贝	13,400	73,700.00	0.04
463	600056	中国医药	5,200	73,580.00	0.04
464	000413	东旭光电	27,300	72,891.00	0.04
465	600863	内蒙华电	29,400	72,324.00	0.04
466	000031	大悦城	14,200	72,278.00	0.04
467	601866	中远海发	39,200	72,128.00	0.04
468	601598	中国外运	22,000	71,060.00	0.04
469	002085	万丰奥威	10,900	70,632.00	0.04
470	000598	兴蓉环境	15,100	69,460.00	0.04
471	600260	凯乐科技	5,000	67,600.00	0.04
472	002506	协鑫集成	25,600	66,816.00	0.04
473	000898	鞍钢股份	26,780	65,611.00	0.04

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	603087	甘李药业	538	53,961.40	0.03
2	300824	北鼎股份	1,954	26,789.34	0.02
3	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.01
4	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.01
5	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.01
6	300847	中船汉光	1,421	9,861.74	0.01
7	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.01
8	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
9	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
10	300846	首都在线	1,131	3,811.47	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	1,335,902.00	0.37
2	300750	宁德时代	1,276,108.00	0.35
3	600519	贵州茅台	1,242,378.00	0.34
4	002714	牧原股份	1,061,964.00	0.29
5	600745	闻泰科技	1,060,523.44	0.29
6	300760	迈瑞医疗	1,044,284.00	0.29
7	300601	康泰生物	867,394.00	0.24
8	000001	平安银行	865,101.00	0.24
9	000002	万 科 A	828,847.00	0.23
10	002415	海康威视	733,150.00	0.20
11	000063	中兴通讯	708,767.00	0.19
12	600436	片仔癀	648,170.00	0.18
13	002475	立讯精密	586,771.00	0.16
14	300347	泰格医药	533,564.00	0.15
15	601888	中国中免	502,252.00	0.14
16	002812	恩捷股份	483,143.00	0.13
17	002352	顺丰控股	482,705.00	0.13
18	002049	紫光国微	439,671.00	0.12
19	603288	海天味业	418,342.00	0.12
20	300498	温氏股份	418,339.00	0.12

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	5,095,355.47	1.40
2	300750	宁德时代	3,425,273.00	0.94
3	002415	海康威视	3,061,176.00	0.84
4	000002	万 科 A	2,883,142.00	0.79
5	000001	平安银行	2,592,802.00	0.71
6	000333	美的集团	2,450,571.00	0.67
7	002475	立讯精密	2,307,580.00	0.63
8	002714	牧原股份	2,144,674.07	0.59
9	000651	格力电器	1,740,174.96	0.48
10	300498	温氏股份	1,705,257.19	0.47
11	000063	中兴通讯	1,593,932.00	0.44
12	000725	京东方 A	1,546,265.00	0.43
13	001979	招商蛇口	1,471,563.00	0.40
14	002304	洋河股份	1,464,365.82	0.40
15	002142	宁波银行	1,434,312.00	0.39
16	300601	康泰生物	1,365,431.00	0.38
17	300015	爱尔眼科	1,270,689.00	0.35

18	000568	泸州老窖	1,148,783.76	0.32
19	300059	东方财富	1,107,080.00	0.30
20	000538	云南白药	1,096,228.00	0.30

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。

#### 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	64,220,428.59
卖出股票收入（成交）总额	132,051,021.66

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 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、其余八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 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

#### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	60,535.73
2	应收证券清算款	26,063.50
3	应收股利	-
4	应收利息	1,006.35
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	87,605.58

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

##### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

#### 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 (%)
2,021	68,285.87	23,524,164.00	17.05	74,481,576.00	53.97

#### 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	40,000,000.00	28.98

### 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	40,000,000	28.98
2	全球人寿保险股份有限公司—自有资金	10,000,000	7.25
3	广发证券股份有限公司	3,909,149	2.83
4	张云珠	3,303,300	2.39

5	廖晔	3,000,000	2.17
6	中信证券股份有限公司	2,876,002	2.08
7	马春杰	2,000,000	1.45
8	张晓川	2,000,000	1.45
9	中信建投证券股份有限公司	1,902,510	1.38
10	张红	1,790,400	1.30
11	方正证券股份有限公司	1,788,817	1.30

### 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	326,005,740.00
本报告期基金总申购份额	60,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	248,000,000.00
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	138,005,740.00

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

在本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人重大人事变动：

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。

3、本基金管理人于2020年5月28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，同意吴建军先生辞去本公司首席信息官一职，聘任张明先生担任本公司首席信息官。

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：

报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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。

### 10.4 基金投资策略的改变

在本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本期本基金未变更会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。

### 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	124,436,073.75	63.75%	115,888.53	63.75%	-
中泰证券股份有限公司	2	15,979,328.40	8.19%	14,882.23	8.19%	-
光大证券股份有限公司	2	10,836,845.74	5.55%	10,092.39	5.55%	-
中信建投证	1	9,586,657.62	4.91%	8,928.25	4.91%	-

券股份有限 公司						
申万宏源证 券有限公司	1	8,774,961.60	4.50%	8,172.31	4.50%	-
华泰证券股 份有限公司	1	8,464,198.61	4.34%	7,883.16	4.34%	-
国盛证券有 限责任公司	1	5,845,291.10	2.99%	5,443.71	2.99%	-
国金证券股 份有限公司	1	4,266,957.68	2.19%	3,973.71	2.19%	-
瑞银证券有 限责任公司	1	2,187,460.17	1.12%	2,037.29	1.12%	-
天风证券股 份有限公司	1	1,884,384.69	0.97%	1,754.91	0.97%	-
恒泰证券股 份有限公司	1	1,454,647.99	0.75%	1,354.77	0.75%	-
东北证券股 份有限公司	1	1,186,289.64	0.61%	1,104.74	0.61%	-
方正证券股 份有限公司	2	175,935.30	0.09%	163.85	0.09%	-
东兴证券股 份有限公司	1	61,700.07	0.03%	57.46	0.03%	-
国泰君安证 券股份有限 公司	1	59,711.77	0.03%	55.62	0.03%	-
长城证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
长江证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-

川财证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
大同证券有 限责任公司	2	-	-	-	-	-
东方证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
广发证券股 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	-	-	-	-	-
华创证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
华福证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
民生证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
平安证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
申港证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	本期 新增
西南证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
新时代证券 股份有限公 司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-



招商证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	4	-	-	-	-	-

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。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

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

光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	115,876.22	100.00%	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
瑞银证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
天风证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
恒泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股份有限	-	-	-	-	-	-

公司						
川财证券 有限责任 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	-	-	-	-	-	-
国信证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
海通证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
华创证券 有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
华福证券 有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
民生证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
平安证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
申港证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
西南证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
新时代证 券股份有 限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

股份有限 公司						
中国银河 证券股份 有限公司						
中信证券 股份有限 公司						

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	景顺长城基金管理有限公司关于旗下沪市跨市场 ETF 调整申赎结算模式的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 1 月 15 日
2	景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金 2020 年第 1 号更新招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 1 月 15 日
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 2020 年第 1 号更新招募说明书摘要	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 1 月 15 日
4	景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金 2019 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 1 月 21 日
5	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2019 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 1 月 21 日
6	景顺长城基金管理有限公司关于董事长离任及总经理代行董事长职务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 1 月 22 日
7	景顺长城基金管理有限公司关于可对旗下交易型开放式指数证券投资基金设置赎回上限的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 1 月 22 日
8	景顺长城基金管理有限公司关于调整旗下基金申购、赎回等业务安排的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 1 月 30 日
9	景顺长城基金管理有限公司关于调整旗下基金申购、赎回等业务安排的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 1 月 31 日
10	景顺长城基金管理有限公司关于调整旗下基金申购、赎回等业务安排的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 2 月 3 日
11	景顺长城基金管理有限公司及全资子公司投资旗下基金相关事宜的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 2 月 6 日
12	景顺长城基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 3 月 6 日
13	景顺长城基金管理有限公司关于景顺	中国证监会指定报刊及	2020 年 3 月 11 日

	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	网站	
14	景顺长城基金管理有限公司关于旗下上海证券交易所上市基金增加扩位证券简称的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 3 月 12 日
15	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 2020 年第 2 号更新招募说明书摘要	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 3 月 13 日
16	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 2020 年第 2 号更新招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 3 月 13 日
17	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	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 3 月 19 日
18	关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金持有停牌股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 3 月 20 日
19	景顺长城基金管理有限公司关于推迟披露旗下基金 2019 年年度报告的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 3 月 30 日
20	景顺长城基金管理有限公司关于信息技术突发事件发生时投资者可替代交易方式的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 4 月 7 日
21	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2019 年年度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 4 月 20 日
22	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 年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 4 月 20 日
23	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 2020 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 4 月 22 日
24	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2020 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 4 月 22 日
25	景顺长城基金管理有限公司关于直销网上交易系统农业银行渠道暂停支付的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 4 月 29 日
26	景顺长城基金管理有限公司关于直销网上交易系统农业银行渠道恢复支付的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 4 月 30 日
27	景顺长城基金管理有限公司关于持续完善客户身份信息的提示	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 5 月 15 日
28	景顺长城基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员（首席信息官）变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 5 月 28 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
本基金的联接基金	1	20200101-20200630	84,000,000.00	-	44,000,000.00	40,000,000.00	28.98

#### 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

1、根据《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则（2020 年修订）》和《中国证券登记结算有限责任公司关于交易所交易型开放式证券投资基金登记结算业务实施细则》及相关规定，本公司决定于 2020 年 1 月 20 日起对本基金申购赎回的结算模式进行调整。有关详细信

息参见本基金管理人于 2020 年 1 月 15 日发布的《景顺长城基金管理有限公司关于旗下沪市跨市场 ETF 调整申赎结算模式的提示性公告》。

2、自 2020 年 2 月 3 日起，本基金可根据基金运作情况、市场变化、投资者需求等设置基金赎回上限，申购、赎回规则参照中国证券登记结算有限责任公司的规定，具体信息以基金管理人在证券交易所公告的申购赎回清单为准。有关详细信息参见本基金管理人于 2020 年 1 月 22 日发布的《景顺长城基金管理有限公司关于可对旗下交易型开放式指数证券投资基金设置赎回上限的公告》。

3、本公司根据上海证券交易所于 2020 年 2 月 19 日发布的《关于上海证券交易所上市基金增加扩位证券简称相关事项的通知》（上证函[2020]268 号）的相关要求及规范，为本基金在原有证券简称的基础上，向上海证券交易所申请增加扩位证券简称：景顺 MSCIA 股 ETF。有关详细信息参见本基金管理人于 2020 年 3 月 12 日发布的《景顺长城基金管理有限公司关于旗下上海证券交易所上市基金增加扩位证券简称的公告》。

## § 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

2020 年 8 月 24 日