

新华 MSCI 中国 A 股国际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：新华基金管理股份有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二〇年八月二十七日

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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 26 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 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	错误!未定义书签。
2.2 基金产品说明.....	错误!未定义书签。
2.3 基金管理人和基金托管人.....	错误!未定义书签。
2.4 信息披露方式.....	错误!未定义书签。
2.5 其他相关资料.....	错误!未定义书签。
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	错误!未定义书签。
3.2 基金净值表现.....	错误!未定义书签。
4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	错误!未定义书签。
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	错误!未定义书签。
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	错误!未定义书签。
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.....	错误!未定义书签。
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	错误!未定义书签。
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	错误!未定义书签。
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	错误!未定义书签。
5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	错误!未定义书签。
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.....	错误!未定义书签。
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	错误!未定义书签。
6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表.....	错误!未定义书签。
6.2 利润表.....	错误!未定义书签。
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	错误!未定义书签。
6.4 报表附注.....	错误!未定义书签。
7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况.....	错误!未定义书签。
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	错误!未定义书签。
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.....	错误!未定义书签。
7.4 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.....	错误!未定义书签。
7.5 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.....	错误!未定义书签。
7.6 报告期内股票投资组合的重大变动.....	错误!未定义书签。
7.7 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	错误!未定义书签。
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	错误!未定义书签。
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	错误!未定义书签。
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细.....	错误!未定义书签。
7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	错误!未定义书签。
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	错误!未定义书签。
7.13 投资组合报告附注.....	错误!未定义书签。
8 基金份额持有人信息	53
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	错误!未定义书签。

8.2 期末上市基金前十名持有人	错误!未定义书签。
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	错误!未定义书签。
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	错误!未定义书签。
9 开放式基金份额变动	54
10 重大事件揭示	54
10.1 基金份额持有人大会决议	错误!未定义书签。
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	错误!未定义书签。
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	错误!未定义书签。
10.4 基金投资策略的改变	错误!未定义书签。
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况	错误!未定义书签。
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	错误!未定义书签。
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	错误!未定义书签。
10.8 其他重大事件	错误!未定义书签。
11 影响投资者决策的其他重要信息	58
12 备查文件目录	58
12.1 备查文件目录	错误!未定义书签。
12.2 存放地点	错误!未定义书签。
12.3 查阅方式	错误!未定义书签。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	新华 MSCI 中国 A 股国际交易型指数
场内简称	MSCI 新华
基金主代码	512920
交易代码	512920
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2018 年 11 月 7 日
基金管理人	新华基金管理股份有限公司
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	37,092,640.00 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 12 月 7 日

注：本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息披露场合下，可简称为“MSCI 新华”，扩位证券简称“MSCIETF 新华”。

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，实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。
投资策略	本基金投资策略包括股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、权证投资策略及融资及转融通证券出借。 本基金采用完全复制法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过正常范围的，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数收益率。本基金标的指数为 MSCI 中国 A 股国际指数。
风险收益特征	本基金属股票型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，属于较高风险、较高收益的基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		新华基金管理股份有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	齐岩	贺倩
	联系电话	010-68779688	010-66060069
	电子邮箱	qiyang@ncfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4008198866	95599
传真		010-68779528	010-68121816
注册地址		重庆市江北区聚贤岩广场6号 力帆中心2号楼19层	北京市东城区建国门内大街69 号
办公地址		重庆市江北区聚贤岩广场6号 力帆中心2号楼19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		400010	100031
法定代表人		张宗友	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.ncfund.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	新华基金管理股份有限公司	重庆市江北区聚贤岩广场 6 号力帆中心 2 号楼 19 层

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日至2020年6月30日）
本期已实现收益	10,685,257.83
本期利润	8,499,889.58
加权平均基金份额本期利润	0.1329
本期加权平均净值利润率	10.10%
本期基金份额净值增长率	11.57%
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	15,144,882.14

期末可供分配基金份额利润	0.4083
期末基金资产净值	53,759,220.58
期末基金份额净值	1.4493
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	44.93%

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、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3、所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	9.54%	0.83%	8.34%	0.87%	1.20%	-0.04%
过去三个月	16.88%	0.90%	14.50%	0.93%	2.38%	-0.03%
过去六个月	11.57%	1.49%	5.89%	1.53%	5.68%	-0.04%
过去一年	20.83%	1.19%	13.94%	1.22%	6.89%	-0.03%
自基金合同生效起至今	44.93%	1.26%	34.17%	1.31%	10.76%	-0.05%

注：1、本基金的业绩比较基准为标的指数收益率。本基金标的指数为 MSCI 中国 A 股国际指数。

2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

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

新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 （2018 年 11 月 7 日至 2020 年 6 月 30 日）



注：本报告期末本基金各项资产配置比例符合合同约定。

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

新华基金管理股份有限公司经中国证券监督管理委员会批复，于 2004 年 12 月 9 日注册成立。注册地为重庆市，是我国西部首家基金管理公司。

截至 2020 年 6 月 30 日，新华基金管理股份有限公司旗下管理着四十五只开放式基金，即新华优选分红混合型证券投资基金、新华优选成长混合型证券投资基金、新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金、新华钻石品质企业混合型证券投资基金、新华行业周期轮换混合型证券投资基金、新华中小市值优选混合型证券投资基金、新华灵活主题混合型证券投资基金、新华优选消费混合型证券投资基金、新华纯债添利债券型发起式证券投资基金、新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金、新华趋势领航混合型证券投资基金、新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金、新华壹诺宝货币市场基金、新华增怡债券型证券投资基金、新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金、新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金、新华中证环保产业指数分级证券投资基金、新华活期添利货币市场基金、新华增盈回报债券型证券投资基金、新华策略精选股票型证券投资基金、新华万银多元策略灵活配置混合型证券投资基金、新华稳健回报灵活配置混合型发起式证券投资基金、新华战略新

兴产业灵活配置混合型证券投资基金、新华鑫回报混合型证券投资基金、新华积极价值灵活配置混合型证券投资基金、新华科技创新主题灵活配置混合型证券投资基金、新华增强债券型证券投资基金、新华鑫动力灵活配置混合型证券投资基金、新华丰盈回报债券型证券投资基金、新华双利债券型证券投资基金、新华丰利债券型证券投资基金、新华鑫弘灵活配置混合型证券投资基金、新华外延增长主题灵活配置混合型证券投资基金、新华红利回报混合型证券投资基金、新华鑫泰灵活配置混合型证券投资基金、新华恒益量化灵活配置混合型证券投资基金、新华安享多裕定期开放灵活配置混合型证券投资基金、新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金、新华鑫日享中短债债券型证券投资基金、新华聚利债券型证券投资基金、新华鼎利债券型证券投资基金、新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金联接基金、新华沪深 300 指数增强型证券投资基金、新华安享惠泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金、新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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		
邓岳	本基金基金经理，新华中证环保产业指数分级证券投资基金基金经理、新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、新华沪深 300 指数增强型证券投资基金基金经理。	2018-11-07	-	12	信息与信号处理专业硕士，历任北京红色天时金融科技有限公司量化研究员，国信证券股份有限公司量化研究员，光大富尊投资有限公司量化研究员、投资经理，盈融达投资（北京）有限公司投资经理。
熊俊杰	本基金基金经理助理，新华沪深 300 指数增强型证券投资基金基金经理助理、新华 MSCI 中国 A 股国际交易型	2020-06-19	-	4	金融数学硕士，历任金贝塔网络金融科技（深圳）量化研究员，招商期货量化研究员，新华基金量化研究员，主要负责量化选股、择时、行业轮动、资产配置等领域研究。

	开放式指数证券投资基金联接基金基金经理助理、新华中证环保产业指数分级证券投资基金基金经理助理。				
--	---	--	--	--	--

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

本报告期末不存在基金经理同时兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

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，新华基金管理股份有限公司作为新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金的管理人按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金基金合同》以及其它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持有人谋求最大利益。运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。

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

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》（2011 年修订），公司制定了《新华基金管理股份有限公司公平交易管理制度》。制度的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动，同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动相关的各个环节。

场外交易中，对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等交易，交易部根据各投资组合经理申报的满足价格条件的数量进行比例分配。如有异议，由交易部报投资总监、督察长、金融工程部和监察稽核部，再次进行审核并确定最终分配结果。如果督察长认为有必要，可以召开风险管理委员会会议，对公平交易的结果进行评估和审议。对于银行间市场交易、固定收益平台、交易所大宗交易，投资组合经理以该投资组合的名义向交易部下达投资指令，交易部向银行间市场或交易对手询价、成交确认，并根据“时间优先、价格优先”的原则保证各投资组合获得公平的交易机会。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，基金管理人严格执行了《新华基金管理股份有限公司公平交易制度》的规定。

基金管理人旗下所有投资组合连续 4 个季度的日内、3 日内以及 5 日内股票和债券交易同向交易价差分析及相应情景分析表明：债券同向交易频率偏低；股票同向交易溢价率较高的因素主要是受到市场因素影响造成个股当日价格振幅较大或者是组合经理个人对交易时机的判断，即成交价格的日内变化较大以及投资组合的成交时间不一致而导致个别组合间的交易价差较大，结合通过对平均溢价率、买入/卖出溢价率以及利益输送金额等不同组合不同时间段的同向交易价差分析表明投资组合间不存在利益输送的可能性。

基金管理人原则上不允许同日反向交易行为的发生，本报告期内，未发生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成交量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

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

本基金为指数基金，以对标的指数的有效跟踪为投资目标。

2020 年上半年，本基金采用完全复制的被动式指数投资方法，避免不必要的交易，产品紧密跟踪了指数的走势，保持了较小的跟踪误差。报告期内，标的指数发生两次成分股调整，本基金根据成份股及其权重的变动，在有效地控制了跟踪误差的情况下，平稳地完成了调整。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2020 年 06 月 30 日，本基金份额净值为 1.4493 元，本报告期份额净值增长率为 11.57%，同期比较基准的增长率为 5.89%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

未来本基金将延续同样的被动投资策略，紧跟标的指数，争取维持与指数较小的偏离度。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

有关参与估值流程各方及人员（或小组）的职责分工：

一、估值工作小组的职责分工

公司建立估值工作小组对证券估值负责。估值工作小组由运作保障部负责人、基金会计、投资管理部门、交易部、监察稽核部人员组成。每个成员都可以指定一个临时或者长期的授权人员。

估值工作小组职责：

- ⊙ 制定估值制度并在必要时修改；
- ⊙ 确保估值方法符合现行法规；

③ 批准证券估值的步骤和方法；

④ 对异常情况做出决策。

运作保障部负责人是估值工作小组的组长，运作保障部负责人在基金会计或者其他两个估值小组成员的建议下，可以提议召集估值工作小组会议。

估值决策由估值工作小组 2/3 或以上多数票通过。

二、基金会计的职责分工

基金会计负责日常证券资产估值。基金会计和公司投资管理部门相互独立。在按照本估值制度和相关法规估值后，基金会计定期将证券估值表向估值工作小组报告，至少每月一次。

基金会计职责：

① 获得独立、完整的证券价格信息；

② 每日证券估值；

③ 检查价格波动并进行一般准确性评估；

④ 向交易员或基金经理核实价格异常波动，并在必要时向估值工作小组报告；

⑤ 对每日证券价格信息和估值结果进行记录；

⑥ 对估值调整和人工估值进行记录；

⑦ 向估值工作小组报送月度估值报告。

基金会计认为必要，可以提议召开估值工作小组会议。

三、投资管理部门的职责分工

① 接受监察稽核部对所投资证券价格异常波动的问讯；

② 对停牌证券、价格异常波动证券、退市证券提出估值建议；

③ 评价并确认基金会计提供的估值报告；

④ 向估值工作小组报告任何他/她认为可能的估值偏差。

四、交易部的职责分工

① 对基金会计的证券价格信息需求做出即时回应；

② 通知基金会计关于证券停牌、价格突发性异常波动、退市等特定信息；

③ 评价并确认基金会计提供的估值报告。

五、监察稽核部的职责分工

- ① 监督证券的整个估值过程；
- ② 确保估值工作小组制定的估值政策得到遵守；
- ③ 确保公司的估值制度和符合现行法律、法规的要求；
- ④ 评价现行估值方法是否恰当反应证券公允价格的风险；
- ⑤ 对于估值表中价格异常波动的证券向投资管理部门问讯；
- ⑥ 对于认为不合适或者不再合适的估值方法提交估值工作小组讨论。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期本基金未进行利润分配。

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

本报告期本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万的情形。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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—新华基金管理股份有限公司 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，新华基金管理股份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，新华基金管理股份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：新华 MSCI 中国 A 股国际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
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	5,084,685.95	5,511,981.58
结算备付金		49,678.34	158,599.92
存出保证金		21,902.58	30,388.72
交易性金融资产	6.4.7.2	52,583,594.43	154,841,550.73
其中：股票投资		52,583,594.43	154,841,550.73
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		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		80,084.61	35,070.32
应收利息	6.4.7.5	414.48	905.23
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		57,820,360.39	160,578,496.50
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
负债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		719,201.39	2,647,118.26
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		26,444.23	77,819.19

应付托管费		5,288.85	15,563.81
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	47,422.94	38,993.71
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	3,262,782.40	500,043.70
负债合计		4,061,139.81	3,279,538.67
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	37,092,640.00	121,092,640.00
未分配利润	6.4.7.10	16,666,580.58	36,206,317.83
所有者权益合计		53,759,220.58	157,298,957.83
负债和所有者权益总计		57,820,360.39	160,578,496.50

注：报告截止 2020 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.4493 元，基金份额总额 37,092,640.00 份。

6.2 利润表

会计主体：新华 MSCI 中国 A 股国际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 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
一、收入		8,984,972.52	12,719,064.31
1.利息收入		8,313.09	8,402.33
其中：存款利息收入	6.4.7.11	8,313.09	8,402.33
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		10,984,109.74	3,383,271.44
其中：股票投资收益	6.4.7.12	10,425,842.47	3,216,776.63
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益	6.4.7.17	558,267.27	166,494.81
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-2,185,368.25	9,185,517.14

4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	177,917.94	141,873.40
减：二、费用		485,082.94	285,286.85
1. 管理人报酬		211,013.47	84,187.62
2. 托管费		42,202.71	16,837.59
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.20	108,653.45	62,805.45
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.21	123,213.31	121,456.19
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		8,499,889.58	12,433,777.46
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		8,499,889.58	12,433,777.46

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：新华 MSCI 中国 A 股国际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）	121,092,640.00	36,206,317.83	157,298,957.83
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	8,499,889.58	8,499,889.58
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）	-84,000,000.00	-28,039,626.83	-112,039,626.83
其中：1. 基金申购款	3,000,000.00	1,077,967.54	4,077,967.54
2. 基金赎回款	-87,000,000.00	-29,117,594.37	-116,117,594.37
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）	37,092,640.00	16,666,580.58	53,759,220.58
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）	115,092,640.00	-7,383,016.87	107,709,623.13
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	12,433,777.46	12,433,777.46
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）	-102,000,000.00	-2,438,424.42	-104,438,424.42
其中：1.基金申购款	3,000,000.00	-170,292.81	2,829,707.19
2.基金赎回款	-105,000,000.00	-2,268,131.61	-107,268,131.61
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）	13,092,640.00	2,612,336.17	15,704,976.17

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：

基金管理人负责人：张宗友，主管会计工作负责人：刘全胜，会计机构负责人：徐端骞

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）系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】1019 号文《关于准予新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》注册募集，由新华基金管理股份有限公司发起募集的交易型开放式指数证券投资基金，存续期不限定。于 2018 年 09 月 26 日通过网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购 3 种方式公开发售，发行期限：2018 年 09 月 26 日至 2018 年 10 月 31 日。首次募集资金总额 280,092,640.00 元，其中募集资金产生利息 73,260.06 元，并经瑞华会计师事务所瑞华验字[2018]第 01360026 号验资报告予以验证。2018 年 11 月 07 日办理基金备案手续，基金合同正式生效。申请发行基金募集份额不少于 2 亿份，本基金管理人为新华基金管理股份有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》及《新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于国内依法发行上市的非标的指数成份股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、债券回购、银行存款、

货币市场工具、同业存单、资产支持证券、权证、股指期货及法律法规或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相关规定）。本基金可以在履行适当程序后，参与融资及转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，本基金可将其纳入投资范围，其投资原则及投资比例按法律法规或监管机构的相关规定执行。本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。本基金的业绩比较基准为标的指数收益率。本基金标的指数为 MSCI 中国 A 股国际指数。

本财务报表由本基金的基金管理人新华基金管理股份有限公司于 2020 年 8 月 26 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营假设为基础编制，根据实际发生的交易和事项，按照财政部发布的《企业会计准则——基本准则》（财政部令第 33 号发布、财政部令第 76 号修订）、于 2006 年 2 月 15 日及其后颁布和修订的 42 项具体会计准则、企业会计准则应用指南、企业会计准则解释及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注四所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金编制的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财务状况、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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

1、印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局决定从 2008 年 9 月 19 日起，调整证券（股票）交易印花税征收方式，将对买卖、继承、赠与所书立的 A 股、B 股股权转让书据按 0.1% 的税率对双方当事人征收证券（股票）交易印花税，调整为单边征税，即对买卖、继承、赠与所书立的 A 股、B 股股权转让书据的出让按 0.1% 的税率征收证券（股票）交易印花税，对受让方不再征税。

2、增值税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[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》：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。

本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3% 和 2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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，股权的股息、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、个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[1998]55 号《关于证券投资基金有关税收问题的通知》、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》的规定：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。

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	5,084,685.95
定期存款	-
其他存款	-
合计	5,084,685.95

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	47,109,260.53	52,583,594.43	5,474,333.90
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	47,109,260.53	52,583,594.43	5,474,333.90

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末本基金无衍生金融资产/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

本报告期末本基金无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末本基金无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	385.59
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	28.89
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	-
合计	414.48

注：应收结算备付金利息包含结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

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	47,422.94
银行间市场应付交易费用	-
合计	47,422.94

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	-
其他应付款	-
预提费用	99,453.90
应付替代款	3,154,621.14
指数许可使用费	8,707.36
合计	3,262,782.40

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	121,092,640.00	121,092,640.00
本期申购	3,000,000.00	3,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-87,000,000.00	-87,000,000.00
本期末	37,092,640.00	37,092,640.00

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	30,352,216.77	5,854,101.06	36,206,317.83
本期利润	10,685,257.83	-2,185,368.25	8,499,889.58
本期基金份额交易产生的变动数	-25,892,592.46	-2,147,034.37	-28,039,626.83
其中：基金申购款	1,052,471.27	25,496.27	1,077,967.54
基金赎回款	-26,945,063.73	-2,172,530.64	-29,117,594.37
本期已分配利润	-	-	-
本期末	15,144,882.14	1,521,698.44	16,666,580.58

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	7,621.91
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	691.18

其他	-
合计	8,313.09

注：结算备付金利息收入包含结算保证金利息收入。

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	9,032,480.27
股票投资收益——赎回差价收入	1,393,362.20
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	10,425,842.47

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	59,497,697.79
减：卖出股票成本总额	50,465,217.52
买卖股票差价收入	9,032,480.27

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	116,117,594.37
减：现金支付赎回款总额	42,778,783.37
减：赎回股票成本总额	71,945,448.80
赎回差价收入	1,393,362.20

6.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无申购差价收入。

6.4.7.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期无证券出借差价收入。

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）成交总额	0.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	-
减：应收利息总额	-
买卖债券差价收入	-

注：本基金本报告期内无债券投资。

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资。

6.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资。

6.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具投资。

6.4.7.17 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	558,267.27
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	558,267.27

6.4.7.18 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	-2,185,368.25
——股票投资	-2,185,368.25
——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	-2,185,368.25

6.4.7.19 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	177,917.94
合计	177,917.94

注：替代损益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日估值的差额。

6.4.7.20 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	108,653.45
银行间市场交易费用	-
合计	108,653.45

6.4.7.21 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	39,781.56
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
汇划手续费	2,542.13
指数使用费	21,217.28
其他	-
合计	123,213.31

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.0125%

的季费率计提，逐日累计至每个季度季末，按季支付。基金合同生效日所在季度的指数使用费，根据实际天数按比例收取。自基金合同生效之日所在季度的下一个季度起，指数许可使用费的收取下限为每季度 5000 美金。

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 2020 年 6 月 30 日，本基金未发生需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报告签发日，本基金未发生需要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

本报告期内，本基金不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。

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
新华基金管理股份有限公司	基金管理人、基金发起人
中国农业银行股份有限公司	基金托管人
恒泰证券股份有限公司	基金管理人股东

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	
	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
恒泰证券股份有限公司	1,297,058.80	1.72%	339,283.66	0.69%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内未通过关联交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内未通过关联交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内未通过关联交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日			
	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
恒泰证券股份有限公 司	1,192.04	3.36%	1,257.74	2.65%
关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
恒泰证券	273.15	1.40%	273.15	0.16%

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	211,013.47	84,187.62
其中：支付销售机构的客户维护费	307.24	6,842.21

注：1、基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50% 的年费率逐日计提确认。计算公式为：每日基金管理费 = 前一日基金资产净值 × (0.50% ÷ 当年天数)；

2、客户维护费是指基金管理人与基金销售机构在基金销售协议中约定的依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	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
当期发生的基金应支付的托管费	42,202.71	16,837.59

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法为：每日基金托管费=前一日基金资产净值×（0.10%÷当年天数）。

6.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期内未发生关联方销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4.2 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发生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

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

报告期内，基金管理人未运用自有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期除基金管理人之外的其他关联方未有投资本基金的情况。

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		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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	5,084,685.95	7,621.91	367,312.41	2,464.71

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行股份有限公司保管，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

本报告期及上年度可比期间本基金在承销期内未参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

2020 年 06 月 30 日，本基金持有 116,900 股中国农业银行股份有限公司的 A 股普通股，成本额为人民币 407,837.04 元，估值总额为人民币 395,122.00 元，占基金资产净值的比例为 0.73%。

6.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

本基金本报告期末持有本基金管理人以及管理人关联方所管理基金。

6.4.11 利润分配情况

报告截至 2020 年 06 月 30 日止无收益分配事项。

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
300845	捷安高科	2020-06-24	2020-07-03	网下中签	17.63	17.63	470.00	8,286.10	8,286.10	-
300843	胜蓝股份	2020-06-23	2020-07-02	网下中签	10.01	10.01	751.00	7,517.51	7,517.51	-
300846	首都在线	2020-06-22	2020-07-01	网下中签	3.37	3.37	1,131.00	3,811.47	3,811.47	-
002500	山西证券	2020-06-29	2020-07-10	战略配售锁定	5.00	6.54	1,650.00	8,250.00	10,791.00	-
688278	特宝生物	2020-01-09	2020-07-17	战略配售锁定	8.24	67.73	8,636.00	71,160.64	584,916.28	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金期末未持有银行间市场债券正回购。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金期末未持有交易所市场债券正回购。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期期末未持有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涉及的财务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。

本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、监察稽核部、相关职能部门和业务部门构成的四级风险管理架构体系。

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之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金管理人通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险。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；在银行间同业市场进行的交易通过交易对手库管理控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本报告期末及上年度期末，本基金未持有按短期信用评级的债券投资。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

本报告期末及上年度期末，本基金未持有按长期信用评级的债券投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份

额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另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。

本基金采用分散投资、控制流通受限证券比例等方式防范流动性风险。本基金所持大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。

除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

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按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金组合的流动性指标进行持续的监测和分析。本报告期内，本基金资产的投资比例符合基金流动性风险管理的相关规定，流动性风险较低。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。

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年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	5,084,685.95	-	-	-	5,084,685.95
结算备付金	49,678.34	-	-	-	49,678.34
存出保证金	21,902.58	-	-	-	21,902.58
交易性金融资产	-	-	-	52,583,594.43	52,583,594.43
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-

应收证券清算款	-	-	-	80,084.61	80,084.61
应收利息	-	-	-	414.48	414.48
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	5,156,266.87	-	-	52,664,093.52	57,820,360.39
负债	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	719,201.39	719,201.39
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	26,444.23	26,444.23
应付托管费	-	-	-	5,288.85	5,288.85
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	47,422.94	47,422.94
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	3,262,782.40	3,262,782.40
负债总计	-	-	-	4,061,139.81	4,061,139.81
利率敏感度缺口	5,156,266.87	-	-	48,602,953.71	53,759,220.58
上年度末					
2019 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	5,511,981.58	-	-	-	5,511,981.58
结算备付金	158,599.92	-	-	-	158,599.92
存出保证金	30,388.72	-	-	-	30,388.72
交易性金融资产	-	-	-	154,841,550.73	154,841,550.73
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-

应收证券清算款	-	-	-	35,070.32	35,070.32
应收利息	-	-	-	905.23	905.23
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	5,700,970.22	-	-	154,877,526.28	160,578,496.50
负债	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	2,647,118.26	2,647,118.26
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	77,819.19	77,819.19
应付托管费	-	-	-	15,563.81	15,563.81
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	38,993.71	38,993.71
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	500,043.70	500,043.70
负债总计	-	-	-	3,279,538.67	3,279,538.67
利率敏感度缺口	5,700,970.22	-	-	151,597,987.61	157,298,957.83

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本报告期末及上年度末，本基金无债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产与负债均以人民币计价,因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

在其他价格风险分析中，本基金管理人主要分析市场价格风险的影响。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场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市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	52,583,594.43	97.81	154,841,550.73	98.44
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	52,583,594.43	97.81	154,841,550.73	98.44

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	其他市场变量不变,沪深 300 指数上升或下降 1%			
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位: 人民币元)		
		本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日	
		沪深 300 指数上升 1%	535,313.46	1,540,442.44
		沪深 300 指数下降 1%	-535,313.46	-1,540,442.44

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	52,583,594.43	90.94
	其中：股票	52,583,594.43	90.94
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	5,134,364.29	8.88
8	其他各项资产	102,401.67	0.18
9	合计	57,820,360.39	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	866,515.00	1.61
B	采矿业	1,291,912.17	2.40
C	制造业	26,769,191.17	49.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,305,974.44	2.43

E	建筑业	1,018,355.00	1.89
F	批发和零售业	867,959.00	1.61
G	交通运输、仓储和邮政业	1,426,070.50	2.65
H	住宿和餐饮业	59,591.10	0.11
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,982,389.56	5.55
J	金融业	11,056,287.35	20.57
K	房地产业	1,837,336.40	3.42
L	租赁和商务服务业	785,952.00	1.46
M	科学研究和技术服务业	438,014.00	0.81
N	水利、环境和公共设施管理业	40,600.00	0.08
O	居民服务、修理和其他服务业	0.00	-
P	教育	72,150.00	0.13
Q	卫生和社会工作	626,507.20	1.17
R	文化、体育和娱乐业	439,329.00	0.82
S	综合	31,786.00	0.06
	合计	51,915,919.89	96.57

7.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	646,384.01	1.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,192.96	0.02
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	0.02
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	667,674.54	1.24

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票投资组合。

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	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	2,000	2,925,760.00	5.44
2	601318	中国平安	17,000	1,213,800.00	2.26
3	600036	招商银行	32,400	1,092,528.00	2.03
4	000858	五粮液	6,100	1,043,832.00	1.94
5	600276	恒瑞医药	8,356	771,258.80	1.43
6	600900	长江电力	34,523	653,865.62	1.22
7	300750	宁德时代	3,500	610,260.00	1.14
8	002475	立讯精密	10,984	564,028.40	1.05
9	603288	海天味业	4,260	529,944.00	0.99
10	601166	兴业银行	32,600	514,428.00	0.96
11	300760	迈瑞医疗	1,600	489,120.00	0.91
12	600000	浦发银行	46,030	486,997.40	0.91
13	002714	牧原股份	5,840	478,880.00	0.89
14	601888	中国中免	3,100	477,493.00	0.89
15	002415	海康威视	14,637	444,232.95	0.83
16	601398	工商银行	84,600	421,308.00	0.78
17	000002	万科A	15,300	399,942.00	0.74

18	601288	农业银行	116,900	395,122.00	0.73
19	000001	平安银行	30,400	389,120.00	0.72
20	600030	中信证券	15,400	371,294.00	0.69
21	600585	海螺水泥	6,300	333,333.00	0.62
22	603259	药明康德	3,300	318,780.00	0.59
23	601328	交通银行	61,600	316,008.00	0.59
24	600016	民生银行	55,600	315,252.00	0.59
25	601668	中国建筑	65,900	314,343.00	0.58
26	600887	伊利股份	9,600	298,848.00	0.56
27	600048	保利地产	18,700	276,386.00	0.51
28	300015	爱尔眼科	6,312	274,256.40	0.51
29	601601	中国太保	9,900	269,775.00	0.50
30	000651	格力电器	4,700	265,879.00	0.49
31	000661	长春高新	600	261,180.00	0.49
32	300059	东方财富	12,680	256,136.00	0.48
33	002304	洋河股份	2,400	252,336.00	0.47
34	002352	顺丰控股	4,600	251,620.00	0.47
35	300122	智飞生物	2,500	250,375.00	0.47
36	000725	京东方 A	53,100	247,977.00	0.46
37	600031	三一重工	13,200	247,632.00	0.46
38	002142	宁波银行	9,400	246,938.00	0.46
39	600309	万华化学	4,900	244,951.00	0.46
40	000063	中兴通讯	6,000	240,780.00	0.45
41	601012	隆基股份	5,870	239,085.10	0.44
42	600588	用友网络	5,097	224,777.70	0.42
43	601818	光大银行	62,500	223,750.00	0.42
44	300498	温氏股份	10,000	218,000.00	0.41
45	601688	华泰证券	11,500	216,200.00	0.40
46	601766	中国中车	38,200	212,774.00	0.40
47	000568	泸州老窖	2,300	209,576.00	0.39
48	600104	上汽集团	12,200	207,278.00	0.39
49	601211	国泰君安	11,800	203,668.00	0.38
50	600809	山西汾酒	1,400	203,000.00	0.38
51	002594	比亚迪	2,800	201,040.00	0.37
52	000895	双汇发展	4,300	198,187.00	0.37
53	600999	招商证券	9,000	197,550.00	0.37
54	000876	新希望	6,600	196,680.00	0.37
55	600050	中国联通	40,600	196,504.00	0.37
56	601988	中国银行	55,100	191,748.00	0.36
57	600745	闻泰科技	1,500	188,925.00	0.35
58	000538	云南白药	2,000	187,620.00	0.35
59	601229	上海银行	22,310	185,173.00	0.34
60	603501	韦尔股份	900	181,755.00	0.34
61	300413	芒果超媒	2,780	181,256.00	0.34

62	000166	申万宏源	35,400	178,770.00	0.33
63	600570	恒生电子	1,636	176,197.20	0.33
64	600690	海尔智家	9,900	175,230.00	0.33
65	603986	兆易创新	720	169,855.20	0.32
66	601066	中信建投	4,300	169,334.00	0.31
67	001979	招商蛇口	10,300	169,332.00	0.31
68	601006	大秦铁路	23,300	164,032.00	0.31
69	601169	北京银行	33,200	162,680.00	0.30
70	300601	康泰生物	1,000	162,160.00	0.30
71	601390	中国中铁	31,900	160,138.00	0.30
72	600703	三安光电	6,400	160,000.00	0.30
73	600837	海通证券	12,700	159,766.00	0.30
74	600028	中国石化	40,000	156,400.00	0.29
75	603160	汇顶科技	700	156,030.00	0.29
76	002555	三七互娱	3,330	155,844.00	0.29
77	600436	片仔癀	900	153,225.00	0.29
78	601186	中国铁建	17,900	150,002.00	0.28
79	002241	歌尔股份	5,100	149,736.00	0.28
80	600547	山东黄金	4,061	148,713.82	0.28
81	600406	国电南瑞	7,216	146,124.00	0.27
82	601336	新华保险	3,300	146,124.00	0.27
83	300782	卓胜微	360	146,077.20	0.27
84	002007	华兰生物	2,890	144,817.90	0.27
85	601989	中国重工	35,800	143,200.00	0.27
86	601857	中国石油	33,900	142,041.00	0.26
87	601138	工业富联	9,300	140,895.00	0.26
88	601933	永辉超市	15,000	140,700.00	0.26
89	300014	亿纬锂能	2,892	138,382.20	0.26
90	000938	紫光股份	3,216	138,223.68	0.26
91	002371	北方华创	800	136,728.00	0.25
92	601899	紫金矿业	30,800	135,520.00	0.25
93	600019	宝钢股份	29,000	132,240.00	0.25
94	000100	TCL 科技	21,200	131,440.00	0.24
95	000776	广发证券	9,300	131,316.00	0.24
96	002916	深南电路	776	129,995.52	0.24
97	600346	恒力石化	9,220	129,080.00	0.24
98	000338	潍柴动力	9,400	128,968.00	0.24
99	002024	苏宁易购	14,600	128,042.00	0.24
100	002027	分众传媒	22,900	127,553.00	0.24
101	002230	科大讯飞	3,400	127,262.00	0.24
102	300142	沃森生物	2,400	125,664.00	0.23
103	002410	广联达	1,800	125,460.00	0.23
104	002050	三花智控	5,676	124,304.40	0.23
105	601088	中国神华	8,600	123,496.00	0.23

106	300433	蓝思科技	4,400	123,376.00	0.23
107	600015	华夏银行	20,100	123,012.00	0.23
108	601628	中国人寿	4,400	119,724.00	0.22
109	002311	海大集团	2,500	118,975.00	0.22
110	300347	泰格医药	1,150	117,162.00	0.22
111	002624	完美世界	2,000	115,280.00	0.21
112	601009	南京银行	15,600	114,348.00	0.21
113	601100	恒立液压	1,400	112,280.00	0.21
114	601155	新城控股	3,500	109,340.00	0.20
115	600196	复星医药	3,200	108,320.00	0.20
116	600009	上海机场	1,500	108,105.00	0.20
117	600340	华夏幸福	4,700	107,442.00	0.20
118	300033	同花顺	800	106,464.00	0.20
119	600438	通威股份	6,100	106,018.00	0.20
120	600183	生益科技	3,600	105,372.00	0.20
121	300124	汇川技术	2,700	102,573.00	0.19
122	688111	金山办公	300	102,474.00	0.19
123	300003	乐普医疗	2,800	102,256.00	0.19
124	600919	江苏银行	18,000	102,060.00	0.19
125	600741	华域汽车	4,900	101,871.00	0.19
126	002271	东方雨虹	2,500	101,575.00	0.19
127	603993	洛阳钼业	27,500	100,925.00	0.19
128	002493	荣盛石化	8,200	100,860.00	0.19
129	002841	视源股份	1,000	99,520.00	0.19
130	002602	世纪华通	6,500	99,515.00	0.19
131	002001	新 和 成	3,400	98,940.00	0.18
132	002129	中环股份	4,400	98,824.00	0.18
133	601788	光大证券	6,100	97,966.00	0.18
134	600383	金地集团	7,100	97,270.00	0.18
135	002821	凯莱英	400	97,200.00	0.18
136	601939	建设银行	15,100	95,281.00	0.18
137	002600	领益智造	8,900	94,607.00	0.18
138	601225	陕西煤业	13,100	94,451.00	0.18
139	300676	华大基因	600	93,546.00	0.17
140	002120	韵达股份	3,770	92,176.50	0.17
141	601901	方正证券	12,900	91,332.00	0.17
142	002460	赣锋锂业	1,700	91,069.00	0.17
143	002236	大华股份	4,711	90,498.31	0.17
144	000596	古井贡酒	600	90,144.00	0.17
145	601877	正泰电器	3,400	89,590.00	0.17
146	600958	东方证券	9,400	89,206.00	0.17
147	002044	美年健康	6,180	89,053.80	0.17
148	000977	浪潮信息	2,272	89,016.96	0.17
149	300529	健帆生物	1,220	84,790.00	0.16

150	600600	青岛啤酒	1,100	84,150.00	0.16
151	300558	贝达药业	600	83,988.00	0.16
152	600763	通策医疗	500	83,385.00	0.16
153	600886	国投电力	10,600	83,316.00	0.15
154	601985	中国核电	20,200	82,618.00	0.15
155	002127	南极电商	3,900	82,563.00	0.15
156	300454	深信服	400	82,384.00	0.15
157	601669	中国电建	23,800	82,348.00	0.15
158	600893	航发动力	3,500	82,180.00	0.15
159	600926	杭州银行	9,200	82,064.00	0.15
160	002812	恩捷股份	1,240	81,592.00	0.15
161	603939	益丰药房	880	80,080.00	0.15
162	601816	京沪高铁	12,800	79,744.00	0.15
163	603369	今世缘	2,000	79,580.00	0.15
164	300136	信维通信	1,500	79,530.00	0.15
165	002456	欧菲光	4,300	79,077.00	0.15
166	300628	亿联网络	1,150	78,499.00	0.15
167	600606	绿地控股	12,700	78,486.00	0.15
168	600584	长电科技	2,500	78,175.00	0.15
169	000069	华侨城 A	12,900	78,174.00	0.15
170	600845	宝信软件	1,320	77,985.60	0.15
171	603019	中科曙光	2,024	77,721.60	0.14
172	600521	华海药业	2,290	77,699.70	0.14
173	600010	包钢股份	71,500	77,220.00	0.14
174	601881	中国银河	6,700	76,849.00	0.14
175	603899	晨光文具	1,400	76,440.00	0.14
176	000768	中航飞机	4,300	76,282.00	0.14
177	600872	中炬高新	1,300	76,089.00	0.14
178	300253	卫宁健康	3,300	75,702.00	0.14
179	600029	南方航空	14,500	74,965.00	0.14
180	002384	东山精密	2,500	74,875.00	0.14
181	300408	三环集团	2,700	74,790.00	0.14
182	601990	南京证券	5,200	74,204.00	0.14
183	002049	紫光国微	1,000	72,750.00	0.14
184	000425	徐工机械	12,300	72,693.00	0.14
185	600161	天坛生物	1,600	72,528.00	0.13
186	002414	高德红外	2,470	72,321.60	0.13
187	002736	国信证券	6,400	72,320.00	0.13
188	002607	中公教育	2,600	72,150.00	0.13
189	603659	璞泰来	700	72,114.00	0.13
190	002179	中航光电	1,750	71,767.50	0.13
191	300144	宋城演艺	4,140	71,622.00	0.13
192	601377	兴业证券	10,400	71,240.00	0.13
193	600332	白云山	2,200	71,126.00	0.13

194	603517	绝味食品	1,000	70,740.00	0.13
195	000963	华东医药	2,780	70,334.00	0.13
196	600061	国投资本	5,500	70,015.00	0.13
197	300595	欧普康视	1,000	69,340.00	0.13
198	300308	中际旭创	1,100	69,300.00	0.13
199	601618	中国中冶	27,600	69,276.00	0.13
200	601111	中国国航	10,400	68,744.00	0.13
201	603799	华友钴业	1,768	68,704.48	0.13
202	000656	金科股份	8,400	68,544.00	0.13
203	002157	正邦科技	3,900	68,172.00	0.13
204	002463	沪电股份	2,700	67,446.00	0.13
205	000625	长安汽车	6,100	67,100.00	0.12
206	002252	上海莱士	7,800	65,988.00	0.12
207	000157	中联重科	10,200	65,586.00	0.12
208	600352	浙江龙盛	5,100	65,229.00	0.12
209	603658	安图生物	400	64,976.00	0.12
210	600660	福耀玻璃	3,100	64,697.00	0.12
211	300450	先导智能	1,400	64,694.00	0.12
212	600298	安琪酵母	1,300	64,324.00	0.12
213	601360	三六零	3,500	64,085.00	0.12
214	601727	上海电气	12,700	64,008.00	0.12
215	002032	苏泊尔	900	63,900.00	0.12
216	000860	顺鑫农业	1,120	63,817.60	0.12
217	601162	天风证券	10,500	63,630.00	0.12
218	600536	中国软件	800	63,360.00	0.12
219	600674	川投能源	6,800	63,036.00	0.12
220	603882	金城医学	700	62,650.00	0.12
221	300383	光环新网	2,400	62,568.00	0.12
222	601872	招商轮船	10,600	61,798.00	0.11
223	002065	东华软件	4,900	61,348.00	0.11
224	300661	圣邦股份	200	61,010.00	0.11
225	600115	东方航空	14,400	60,768.00	0.11
226	000066	中国长城	4,600	60,720.00	0.11
227	600018	上港集团	14,300	60,060.00	0.11
228	601319	中国人保	9,300	59,892.00	0.11
229	600085	同仁堂	2,200	59,664.00	0.11
230	002603	以岭药业	1,900	59,261.00	0.11
231	002385	大北农	6,500	59,215.00	0.11
232	600760	中航沈飞	1,800	59,076.00	0.11
233	002773	康弘药业	1,190	59,024.00	0.11
234	002439	启明星辰	1,400	58,898.00	0.11
235	600118	中国卫星	1,900	58,577.00	0.11
236	600132	重庆啤酒	800	58,400.00	0.11
237	002223	鱼跃医疗	1,600	58,240.00	0.11

238	002185	华天科技	4,300	58,179.00	0.11
239	603707	健友股份	900	58,113.00	0.11
240	002299	圣农发展	2,000	58,000.00	0.11
241	000783	长江证券	8,600	57,964.00	0.11
242	002690	美亚光电	1,100	57,860.00	0.11
243	000786	北新建材	2,700	57,591.00	0.11
244	601108	财通证券	5,600	57,400.00	0.11
245	600079	人福医药	2,100	57,162.00	0.11
246	600795	国电电力	30,800	56,980.00	0.11
247	601600	中国铝业	20,500	56,580.00	0.11
248	002180	纳思达	1,700	55,947.00	0.10
249	600867	通化东宝	3,200	55,776.00	0.10
250	688396	华润微	1,280	55,603.20	0.10
251	002373	千方科技	2,300	55,177.00	0.10
252	601607	上海医药	3,000	55,140.00	0.10
253	600705	中航资本	13,900	55,044.00	0.10
254	600522	中天科技	4,800	54,960.00	0.10
255	603444	吉比特	100	54,901.00	0.10
256	002153	石基信息	1,400	54,642.00	0.10
257	603338	浙江鼎力	720	54,554.40	0.10
258	002202	金风科技	5,461	54,446.17	0.10
259	002146	荣盛发展	6,700	54,270.00	0.10
260	603605	珀莱雅	300	54,006.00	0.10
261	600998	九州通	2,900	53,998.00	0.10
262	600109	国金证券	4,700	53,627.00	0.10
263	601800	中国交建	7,300	53,582.00	0.10
264	000703	恒逸石化	5,820	53,136.60	0.10
265	600111	北方稀土	5,700	53,124.00	0.10
266	600637	东方明珠	5,500	53,075.00	0.10
267	002466	天齐锂业	2,310	53,014.50	0.10
268	600315	上海家化	1,100	52,690.00	0.10
269	600143	金发科技	4,000	52,680.00	0.10
270	603858	步长制药	1,820	52,507.00	0.10
271	001914	招商积余	1,700	52,241.00	0.10
272	601919	中远海控	15,000	52,050.00	0.10
273	600498	烽火通信	1,800	52,038.00	0.10
274	300482	万孚生物	500	52,000.00	0.10
275	000961	中南建设	5,800	51,620.00	0.10
276	002405	四维图新	3,100	51,119.00	0.10
277	601799	星宇股份	400	50,800.00	0.09
278	600801	华新水泥	2,140	50,739.40	0.09
279	002739	万达电影	3,300	50,391.00	0.09
280	300285	国瓷材料	1,500	50,265.00	0.09
281	601231	环旭电子	2,300	50,232.00	0.09

282	000021	深科技	2,300	50,209.00	0.09
283	300251	光线传媒	4,600	50,186.00	0.09
284	300699	光威复材	800	50,184.00	0.09
285	600201	生物股份	1,800	50,112.00	0.09
286	600380	健康元	3,080	50,019.20	0.09
287	002601	龙蟠佰利	2,700	49,950.00	0.09
288	600779	水井坊	800	49,936.00	0.09
289	300357	我武生物	800	49,800.00	0.09
290	600023	浙能电力	14,100	49,491.00	0.09
291	300316	晶盛机电	2,000	49,480.00	0.09
292	600390	五矿资本	7,000	49,420.00	0.09
293	600489	中金黄金	5,400	49,356.00	0.09
294	601021	春秋航空	1,400	49,336.00	0.09
295	601018	宁波港	13,800	49,266.00	0.09
296	600487	亨通光电	3,000	49,230.00	0.09
297	300146	汤臣倍健	2,500	49,225.00	0.09
298	002152	广电运通	3,800	49,172.00	0.09
299	000050	深天马 A	3,200	49,152.00	0.09
300	600176	中国巨石	5,362	49,062.30	0.09
301	600895	张江高科	2,400	48,888.00	0.09
302	601555	东吴证券	5,990	48,878.40	0.09
303	600511	国药股份	1,200	48,804.00	0.09
304	600004	白云机场	3,200	48,768.00	0.09
305	002500	山西证券	7,450	48,723.00	0.09
306	000975	银泰黄金	3,100	48,608.00	0.09
307	600011	华能国际	11,461	48,365.42	0.09
308	002074	国轩高科	1,800	48,312.00	0.09
309	002422	科伦药业	2,300	48,300.00	0.09
310	600885	宏发股份	1,200	48,144.00	0.09
311	601658	邮储银行	10,500	47,985.00	0.09
312	002212	南洋股份	1,800	47,844.00	0.09
313	000513	丽珠集团	990	47,529.90	0.09
314	002294	信立泰	1,600	47,456.00	0.09
315	601689	拓普集团	1,700	47,430.00	0.09
316	300207	欣旺达	2,500	47,250.00	0.09
317	603345	安井食品	400	47,200.00	0.09
318	600271	航天信息	2,900	47,096.00	0.09
319	600150	中国船舶	2,700	47,088.00	0.09
320	600177	雅戈尔	7,880	46,964.80	0.09
321	601198	东兴证券	4,300	46,870.00	0.09
322	002511	中顺洁柔	2,100	46,830.00	0.09
323	002508	老板电器	1,500	46,665.00	0.09
324	300496	中科创达	600	46,620.00	0.09
325	002465	海格通信	3,600	46,584.00	0.09

326	002353	杰瑞股份	1,500	46,500.00	0.09
327	603833	欧派家居	400	46,360.00	0.09
328	002558	巨人网络	2,659	46,266.60	0.09
329	600655	豫园股份	5,200	46,072.00	0.09
330	603712	七一二	1,200	46,056.00	0.09
331	600426	华鲁恒升	2,600	45,968.00	0.09
332	601998	中信银行	8,900	45,835.00	0.09
333	603589	口子窖	900	45,810.00	0.09
334	603866	桃李面包	900	45,801.00	0.09
335	600642	申能股份	7,700	45,507.00	0.08
336	600739	辽宁成大	2,400	45,432.00	0.08
337	601838	成都银行	5,700	45,372.00	0.08
338	000728	国元证券	5,400	45,360.00	0.08
339	600699	均胜电子	1,900	45,239.00	0.08
340	000999	华润三九	1,547	45,156.93	0.08
341	002156	通富微电	1,800	45,090.00	0.08
342	600598	北大荒	2,800	45,080.00	0.08
343	002013	中航机电	5,700	45,030.00	0.08
344	300418	昆仑万维	1,800	44,928.00	0.08
345	002673	西部证券	5,500	44,880.00	0.08
346	300212	易华录	800	44,800.00	0.08
347	002242	九阳股份	1,200	44,724.00	0.08
348	002019	亿帆医药	1,935	44,446.95	0.08
349	600362	江西铜业	3,300	44,418.00	0.08
350	002075	沙钢股份	3,500	43,750.00	0.08
351	601878	浙商证券	4,400	43,604.00	0.08
352	002926	华西证券	4,100	43,583.00	0.08
353	002557	洽洽食品	800	43,352.00	0.08
354	002507	涪陵榨菜	1,200	43,212.00	0.08
355	600170	上海建工	14,000	42,980.00	0.08
356	601117	中国化学	7,800	42,744.00	0.08
357	600066	宇通客车	3,500	42,700.00	0.08
358	300088	长信科技	3,800	42,560.00	0.08
359	600482	中国动力	2,700	42,390.00	0.08
360	600068	葛洲坝	7,100	42,245.00	0.08
361	000739	普洛药业	1,800	41,922.00	0.08
362	600415	小商品城	8,500	41,395.00	0.08
363	600486	扬农化工	500	41,250.00	0.08
364	600369	西南证券	8,900	40,851.00	0.08
365	000723	美锦能源	6,500	40,690.00	0.08
366	000627	天茂集团	7,800	40,638.00	0.08
367	300070	碧水源	5,000	40,600.00	0.08
368	000671	阳光城	6,400	40,576.00	0.08
369	002925	盈趣科技	700	40,558.00	0.08

370	002131	利欧股份	10,500	40,530.00	0.08
371	600297	广汇汽车	12,700	40,513.00	0.08
372	601992	金隅集团	13,100	40,086.00	0.07
373	002399	海普瑞	1,600	40,064.00	0.07
374	603883	老百姓	400	40,016.00	0.07
375	300168	万达信息	1,800	39,726.00	0.07
376	600208	新湖中宝	13,300	39,634.00	0.07
377	002939	长城证券	3,200	39,424.00	0.07
378	002468	申通快递	2,400	39,384.00	0.07
379	600089	特变电工	5,800	39,266.00	0.07
380	000988	华工科技	1,600	39,088.00	0.07
381	002078	太阳纸业	4,100	39,032.00	0.07
382	600667	太极实业	3,300	39,006.00	0.07
383	600875	东方电气	4,400	38,940.00	0.07
384	600535	天士力	2,400	38,928.00	0.07
385	601179	中国西电	8,000	38,720.00	0.07
386	002683	宏大爆破	1,100	38,390.00	0.07
387	601966	玲珑轮胎	1,900	38,380.00	0.07
388	600909	华安证券	5,600	38,248.00	0.07
389	002958	青农商行	8,600	38,098.00	0.07
390	002797	第一创业	5,500	38,060.00	0.07
391	600219	南山铝业	18,700	37,961.00	0.07
392	600221	海航控股	25,200	37,800.00	0.07
393	002174	游族网络	1,442	37,607.36	0.07
394	002340	格林美	7,500	37,275.00	0.07
395	601233	桐昆股份	2,900	37,004.00	0.07
396	600038	中直股份	900	36,963.00	0.07
397	601997	贵阳银行	5,160	36,945.60	0.07
398	600516	方大炭素	5,875	36,895.00	0.07
399	002030	达安基因	1,350	36,828.00	0.07
400	300271	华宇软件	1,300	36,673.00	0.07
401	000750	国海证券	8,400	36,456.00	0.07
402	002281	光迅科技	1,100	36,146.00	0.07
403	603156	养元饮品	1,680	36,120.00	0.07
404	600754	锦江酒店	1,300	36,075.00	0.07
405	000423	东阿阿胶	1,000	35,810.00	0.07
406	600027	华电国际	10,400	35,568.00	0.07
407	000932	华菱钢铁	9,420	35,513.40	0.07
408	000998	隆平高科	2,100	34,965.00	0.07
409	600153	建发股份	4,300	34,830.00	0.06
410	000540	中天金融	10,800	34,776.00	0.06
411	600167	联美控股	2,400	34,416.00	0.06
412	600100	同方股份	4,700	34,263.00	0.06
413	600026	中远海能	5,300	34,238.00	0.06

414	000547	航天发展	2,500	34,175.00	0.06
415	600188	兖州煤业	3,900	34,164.00	0.06
416	000709	河钢股份	16,600	33,864.00	0.06
417	002572	索菲亚	1,400	33,838.00	0.06
418	603000	人民网	1,700	33,711.00	0.06
419	000401	冀东水泥	2,100	33,684.00	0.06
420	601099	太平洋	10,600	33,602.00	0.06
421	000688	国城矿业	1,800	33,354.00	0.06
422	600704	物产中大	7,900	33,259.00	0.06
423	300017	网宿科技	3,900	33,111.00	0.06
424	601216	君正集团	13,000	33,020.00	0.06
425	002081	金螳螂	4,200	33,012.00	0.06
426	600566	济川药业	1,291	32,868.86	0.06
427	300024	机器人	2,400	32,808.00	0.06
428	600688	上海石化	9,362	32,579.76	0.06
429	600155	华创阳安	2,700	32,373.00	0.06
430	601128	常熟银行	4,300	32,293.00	0.06
431	002396	星网锐捷	900	31,797.00	0.06
432	600673	东阳光	4,600	31,786.00	0.06
433	601118	海南橡胶	6,500	31,590.00	0.06
434	600977	中国电影	2,400	31,512.00	0.06
435	000402	金融街	4,700	31,208.00	0.06
436	000686	东北证券	3,691	31,188.95	0.06
437	000630	铜陵有色	16,000	30,880.00	0.06
438	600460	士兰微	2,100	30,828.00	0.06
439	600372	中航电子	2,300	30,636.00	0.06
440	600583	海油工程	6,700	30,485.00	0.06
441	600021	上海电力	4,100	30,340.00	0.06
442	300598	诚迈科技	160	30,304.00	0.06
443	000729	燕京啤酒	4,400	30,140.00	0.06
444	601106	中国一重	10,700	30,067.00	0.06
445	002387	维信诺	2,100	29,988.00	0.06
446	600528	中铁工业	3,400	29,988.00	0.06
447	000825	太钢不锈	9,000	29,880.00	0.06
448	601098	中南传媒	2,800	29,624.00	0.06
449	600733	北汽蓝谷	4,600	29,578.00	0.06
450	600959	江苏有线	7,800	29,328.00	0.05
451	000415	渤海租赁	9,800	29,204.00	0.05
452	600160	巨化股份	4,200	28,938.00	0.05
453	002372	伟星新材	2,460	28,609.80	0.05
454	000027	深圳能源	6,160	28,582.40	0.05
455	000623	吉林敖东	1,800	28,314.00	0.05
456	600256	广汇能源	10,400	28,080.00	0.05
457	600967	内蒙一机	2,700	28,053.00	0.05

458	002010	传化智联	5,100	27,744.00	0.05
459	002268	卫士通	1,300	27,742.00	0.05
460	600879	航天电子	4,300	27,692.00	0.05
461	600820	隧道股份	4,900	27,685.00	0.05
462	600497	驰宏锌锗	8,000	27,520.00	0.05
463	600008	首创股份	9,100	27,391.00	0.05
464	600446	金证股份	1,400	27,160.00	0.05
465	000028	国药一致	600	27,006.00	0.05
466	600675	中华企业	6,620	26,943.40	0.05
467	000581	威孚高科	1,300	26,884.00	0.05
468	600398	海澜之家	4,600	26,772.00	0.05
469	000629	攀钢钒钛	13,300	26,733.00	0.05
470	600549	厦门钨业	2,200	26,048.00	0.05
471	601958	金钼股份	4,200	25,956.00	0.05
472	300026	红日药业	4,700	25,944.00	0.05
473	601699	潞安环能	4,655	25,928.35	0.05
474	002217	合力泰	4,900	25,725.00	0.05
475	300012	华测检测	1,300	25,688.00	0.05
476	600737	中粮糖业	3,300	25,674.00	0.05
477	002110	三钢闽光	3,850	25,641.00	0.05
478	000046	泛海控股	6,800	25,636.00	0.05
479	000997	新大陆	1,600	25,568.00	0.05
480	600466	蓝光发展	4,700	25,333.00	0.05
481	002195	二三四五	9,010	25,318.10	0.05
482	300296	利亚德	4,100	24,887.00	0.05
483	600373	中文传媒	2,100	24,738.00	0.05
484	000738	航发控制	1,800	24,570.00	0.05
485	603885	吉祥航空	2,700	24,570.00	0.05
486	000983	西山煤电	6,540	24,525.00	0.05
487	000089	深圳机场	3,200	24,512.00	0.05
488	600056	中国医药	1,700	24,055.00	0.04
489	600376	首开股份	4,100	24,026.00	0.04
490	600968	海油发展	10,300	23,999.00	0.04
491	600808	马钢股份	9,300	23,994.00	0.04
492	002563	森马服饰	3,400	23,970.00	0.04
493	000883	湖北能源	6,800	23,936.00	0.04
494	002221	东华能源	2,700	23,733.00	0.04
495	600258	首旅酒店	1,530	23,516.10	0.04
496	000413	东旭光电	8,600	22,962.00	0.04
497	000031	大悦城	4,500	22,905.00	0.04
498	600572	康恩贝	4,150	22,825.00	0.04
499	601866	中远海发	12,400	22,816.00	0.04
500	600776	东方通信	1,500	22,635.00	0.04
501	002085	万丰奥威	3,400	22,032.00	0.04

502	601718	际华集团	6,600	21,912.00	0.04
503	600260	凯乐科技	1,620	21,902.40	0.04
504	600718	东软集团	1,900	21,850.00	0.04
505	600863	内蒙华电	8,700	21,402.00	0.04
506	601598	中国外运	6,600	21,318.00	0.04
507	000598	兴蓉环境	4,600	21,160.00	0.04
508	002506	协鑫集成	7,800	20,358.00	0.04
509	000898	鞍钢股份	8,150	19,967.50	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	占基金资产净值比例(%)
1	688278	特宝生物	8,636.00	584,916.28	1.09
2	603087	甘李药业	236.00	23,670.80	0.04
3	300842	帝科股份	455.00	18,527.60	0.03
4	300839	博汇股份	502.00	11,751.82	0.02
5	600956	新天绿能	1,824.00	9,192.96	0.02
6	300845	捷安高科	470.00	8,286.10	0.02
7	300843	胜蓝股份	751.00	7,517.51	0.01
8	300846	首都在线	1,131.00	3,811.47	0.01

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	600519	贵州茅台	1,293,680.00	0.82
2	300760	迈瑞医疗	605,340.64	0.38
3	688266	泽璟制药	294,488.48	0.19
4	603160	汇顶科技	241,612.00	0.15
5	688396	华润微	217,550.40	0.14
6	000596	古井贡酒	205,071.00	0.13
7	601816	京沪高铁	199,576.00	0.13
8	002714	牧原股份	191,511.00	0.12
9	688158	优刻得	183,429.60	0.12
10	600036	招商银行	172,587.00	0.11
11	000001	平安银行	167,938.00	0.11
12	002352	顺丰控股	163,206.00	0.10
13	601318	中国平安	160,091.00	0.10

14	002371	北方华创	160,025.00	0.10
15	000858	五 粮 液	158,904.00	0.10
16	300750	宁德时代	158,135.00	0.10
17	601888	中国中免	152,265.00	0.10
18	002841	视源股份	139,683.00	0.09
19	002252	上海莱士	130,506.00	0.08
20	603501	韦尔股份	128,647.00	0.08

注：本项“买入金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000858	五 粮 液	2,027,884.00	1.29
2	300750	宁德时代	1,225,377.00	0.78
3	002415	海康威视	1,217,718.00	0.77
4	601916	浙商银行	1,132,650.75	0.72
5	000002	万 科 A	1,123,855.00	0.71
6	000001	平安银行	1,048,970.00	0.67
7	000333	美的集团	965,718.76	0.61
8	002475	立讯精密	943,101.00	0.60
9	000651	格力电器	748,344.00	0.48
10	002714	牧原股份	746,325.34	0.47
11	300760	迈瑞医疗	709,329.00	0.45
12	300498	温氏股份	673,887.00	0.43
13	002304	洋河股份	628,789.00	0.40
14	000725	京东方 A	621,203.00	0.39
15	002142	宁波银行	612,468.00	0.39
16	688266	泽璟制药	588,976.96	0.37
17	001979	招商蛇口	581,631.00	0.37
18	000063	中兴通讯	575,977.00	0.37
19	300015	爱尔眼科	522,701.00	0.33
20	000538	云南白药	512,231.00	0.33

注：本项“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	19,809,103.27
卖出股票的收入（成交）总额	59,497,697.79

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”与“卖出股票的收入（成交）总额”均按买卖成交金额

(成交单价乘以数量) 填列, 不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券投资。

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投资。

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金合同无国债期货投资政策。

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。

7.12 市场中性策略执行情况

截至本报告期末，本基金持有股票资产 52,583,594.43 元，占基金资产净值的比例为 97.81%；运用股指期货进行对冲的空头合约市值 0.00 元，占基金资产净值的比例为 0.00%，空头合约市值占股票资产的比例为 0.00%。

7.13 本报告期投资基金情况

7.13.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金投资。

7.14 投资组合报告附注

7.14.1 本报告期末本基金投资的前十名证券没有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。

7.14.2 本报告期，本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.14.3 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	21,902.58
2	应收证券清算款	80,084.61
3	应收股利	-
4	应收利息	414.48
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	102,401.67

7.14.4 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。

7.14.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.14.5.1 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情况。

7.14.5.2 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	688278	特宝生物	584,916.28	1.09	战略配售锁 定

7.14.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
96	386,381.67	34,986,740.00	94.32%	2,105,900.00	5.68%

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—新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金联接基金	33,180,800.00	89.45%

2	中信证券股份有限公司	1,792,940.00	4.83%
3	孙楠	490,000.00	1.32%
4	薛良正	150,000.00	0.40%
5	李之余	100,000.00	0.27%
6	颜琼端	100,000.00	0.27%
7	孙曦	100,000.00	0.27%
8	陈鹏	100,000.00	0.27%
9	段增恩	90,000.00	0.24%
10	杨金成	50,000.00	0.13%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	0.00	0.00%

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的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2018年11月7日）基金份额总额	280,092,640.00
本报告期期初基金份额总额	121,092,640.00
本报告期基金总申购份额	3,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	87,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	37,092,640.00

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期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

本报告期，本基金基金管理人聘任翟晨曦女士担任公司董事职务，胡湘先生、刘成伟先生担任公司独立董事职务，副总经理崔建波、晏益民离任。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内本基金未有涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本报告期本基金未持有基金。

10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未有改聘会计师事务所的情况。

10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金不存在管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况。

10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.8.1 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	
天风证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中银国际证券	2	-	-	-	-	-
新时代证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	3	45,357,934.62	58.93%	8,490.12	23.90%	-

国泰君安	1	8,732,661.11	11.35%	8,133.31	22.90%	-
国盛证券	2	5,722,868.50	7.44%	4,185.26	11.78%	-
中泰证券	2	4,771,035.48	6.20%	3,924.41	11.05%	-
中金公司	1	3,527,829.34	4.58%	3,285.58	9.25%	-
东吴证券	1	2,367,706.71	3.08%	1,731.59	4.87%	-
兴业证券	1	1,476,176.70	1.92%	1,374.69	3.87%	-
恒泰证券	2	1,297,058.80	1.69%	1,192.04	3.36%	-
招商证券	1	1,086,900.10	1.41%	1,012.31	2.85%	-
东兴证券	2	1,043,013.20	1.36%	762.74	2.15%	-
中信证券	2	740,028.19	0.96%	689.26	1.94%	-
国金证券	1	434,975.94	0.57%	405.10	1.14%	-
银河证券	1	201,711.10	0.26%	147.52	0.42%	-
华西证券	1	134,250.79	0.17%	125.02	0.35%	-
光大证券	1	32,635.00	0.04%	30.39	0.09%	-
民生证券	2	27,125.00	0.04%	19.83	0.06%	-
信达证券	1	15,682.86	0.02%	11.47	0.03%	-

注：本基金根据中国证券监督管理委员会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》（证监基金字[1998]29号）以及《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，本基金共租用 45 个交易席位，其中报告期内新增 0 个交易席位，退租 0 个交易席位。

一、交易席位的分配依据

交易席位的分配以券商实力及其所提供的研究支持为基础，主要考察点包括：

- 1、经营行为稳健规范，内控制度健全。
- 2、具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要。
- 3、具有较强的全方位金融服务能力和水平。

二、交易席位的选择流程

- 1、研究部根据上述标准考察后确定选用交易席位的券商。
- 2、与被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

三、交易量的分配

交易量的分配以券商所提供的服务及研究支持为基础，主要考察点包括：

1、券商提供独立的或第三方研究报告及服务，包括宏观经济、行业分析、公司研发、市场数据、财经信息、行业期刊、组合分析软件、绩效评估、研讨会、统计信息、交易评估等，用以支持投资决策。

2、以季度为单位对经纪商通过评分的方式进行考核，由基金经理、研究员和交易员分别打分，根据经纪商给投资带来的增值确定经纪商的排名。

考核的内容包括上一季度经纪交易执行情况、提供研究报告数量、研究报告质量和及时性、受邀讲解次数及效果、主动推介次数及效果等。考核结果将作为当期交易量分配的依据，交易量大小和评分高低成正比。

3、交易部负责落实交易量的实际分配工作。

10.8.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期末租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

10.9 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	新华基金管理股份有限公司旗下全部基金 2019 年第 4 季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2020-01-20
2	新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金 2019 年第 4 季度报告	公司网站、电子信披网站	2020-01-20
3	新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）全文	公司网站、电子信披网站	2020-01-23
4	新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）摘要	证券时报、公司网站、电子信披网站	2020-01-23
5	关于新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金增加扩位证券简称的公告	证券时报、公司网站、电子信披网站	2020-03-13
6	新华基金管理股份有限公司旗下全部基金 2019 年年度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2020-03-26
7	新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金 2019 年年度报告	公司网站、电子信披网站	2020-03-26
8	新华基金管理股份有限公司关于董事及独立董事变更的公告	中国证券报、公司网站、电子信披网站	2020-03-27
9	新华基金管理股份有限公司关于参加恒泰证券股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2020-04-08
10	新华基金管理股份有限公司旗下全部基金 2020 年第 1 季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2020-04-21
11	新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金 2020 年第 1 季度报告	公司网站、电子信披网站	2020-04-21
12	新华基金管理股份有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证券报、公司网站、电子信披网站	2020-06-06
13	新华基金管理股份有限公司关于取消武汉市	中国证券报、上海证券	2020-06-20

	伯嘉基金销售有限公司为销售机构的公告的公告	报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	
14	新华基金管理股份有限公司关于取消厦门市鑫鼎盛控股有限公司为销售机构的公告的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2020-06-30

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
其他	1	20200101-20200630	113,580,800.00	3,600,000.00	84,000,000.00	33,180,800.00	89.45%
产品特有风险							
<p>1、赎回申请延期办理的风险 机构投资者大额赎回时易构成本基金发生巨额赎回，中小投资者可能面临小额赎回，中小投资者可能面临小额赎回申请也需要与机构投资者按同比例部分延期办理的风险；</p> <p>2、基金净值大幅波动的风险 机构投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动；</p> <p>3、提前终止基金合同的风险 机构投资者赎回后，可能出现基金资产净值低于5000万元的情形，若连续六十个工作日出现基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人可能提前终止基金合同，基金财产将进行清算；</p> <p>4、基金规模过小导致的风险 机构投资者赎回后，可能导致基金规模过小。基金可能会面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形。</p>							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会批准新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金基金募集的文件
- (二) 关于申请募集新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金之法律意见书
- (三) 新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金托管协议
- (四) 新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金基金合同

- (五) 新华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则
- (六) 更新的《新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》
- (七) 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- (八) 基金托管人业务资格批件及营业执照
- (九) 中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间内免费查阅，也可按工本费购买复印件，或通过本基金管理人网站查阅。

新华基金管理股份有限公司

二〇二〇年八月二十七日