

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 06 月 30 日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2020 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 27 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.....	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介.....	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
§4 管理人报告.....	8
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.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	11
§5 托管人报告.....	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	12
§6 中期财务会计报告（未经审计）.....	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	17
§7 投资组合报告.....	35
7.1 期末基金资产组合情况.....	35
7.2 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.....	36
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	51
7.12 投资组合报告附注	51
§8 基金份额持有人信息	52
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	53
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
§9 开放式基金份额变动	53
§10 重大事件揭示	54
10.1 基金份额持有人大会决议	54
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	54
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	55
§11 影响投资者决策的其他重要信息	56
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	56
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	56
§12 备查文件目录	56
12.1 备查文件目录	56
12.2 存放地点	57
12.3 查阅方式	57

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	MSCI 中国 A 股国际通 ETF
场内简称	MSCI 基金（MSCI 中国 A 股 ETF）
基金主代码	512160
交易代码	512160
基金运作方式	交易型开放式（ETF）
基金合同生效日	2018 年 4 月 3 日
基金管理人	南方基金管理股份有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	397,777,775.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2018 年 4 月 27 日

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 基金”或“MSCI 中国 A 股 ETF”。

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为被动式指数基金，采用完全复制法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。 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。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数收益率。本基金标的指数为 MSCI China A Inclusion RMB Index（MSCI 中国 A 股国际通指数）。
风险收益特征	本基金属股票型基金，一般而言，其风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	南方基金管理股份有限	中国银行股份有限公司

	公司	
信息披露负责人	姓名	常克川
	联系电话	0755-82763888
	电子邮箱	manager@southernfund.com
客户服务电话	400-889-8899	95566
传真	0755-82763889	010-66594942
注册地址	深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	北京西城区复兴门内大街 1 号
办公地址	深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	北京西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	518017	100818
法定代表人	张海波	刘连舸

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	http://www.nffund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人的住所、基金上市交易的证券交易所

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	46,470,464.16
本期利润	41,829,530.84
加权平均基金份额本期利润	0.0858
本期加权平均净值利润率	7.40%
本期基金份额净值增长率	8.91%
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	94,510,143.86
期末可供分配基金份额利润	0.2375
期末基金资产净值	504,747,737.29

期末基金份额净值	1.2689
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	26.89%

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

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

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

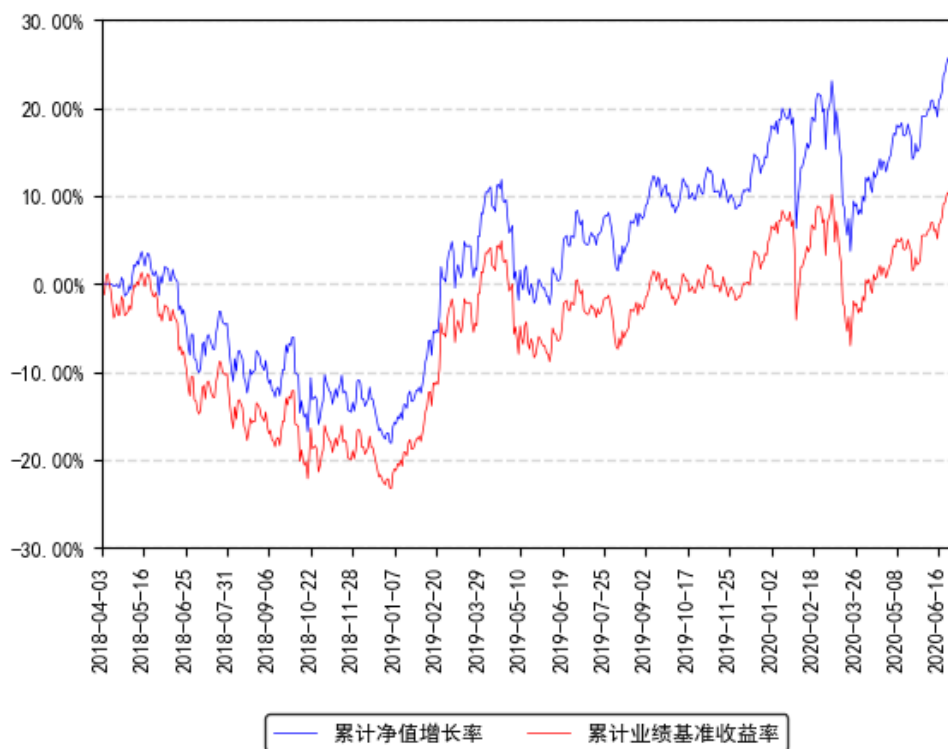
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	9.55%	0.88%	8.40%	0.87%	1.15%	0.01%
过去三个月	17.00%	0.94%	14.49%	0.92%	2.51%	0.02%
过去六个月	8.91%	1.55%	5.80%	1.53%	3.11%	0.02%
过去一年	20.51%	1.24%	14.01%	1.22%	6.50%	0.02%
自基金合同生效起至今	26.89%	1.34%	11.34%	1.34%	15.55%	0.00%

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

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



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

2018 年 1 月，公司整体变更设立为南方基金管理股份有限公司。2019 年 7 月，根据南方基金管理股份有限公司股东大会决议，并经中国证监会核准，本公司原股东及新增股东共同认购了本公司新增的注册资本，认购完成后注册资本为 36172 万元人民币。目前股权结构为：华泰证券股份有限公司 41.16%、深圳市投资控股有限公司 27.44%、厦门国际信托有限公司 13.72%、兴业证券股份有限公司 9.15%、厦门合泽吉企业管理合伙企业(有限合伙) 2.10%、厦门合泽祥企业管理合伙企业(有限合伙) 2.12%、厦门合泽益企业管理合伙企业(有限合伙) 2.11%、厦门合泽盈企业管理合伙企业(有限合伙) 2.20%。目前，公司总部设在深圳，在北京、上海、深圳、南京、成都、合肥等地设有分公司，在香港和深圳前海设有子公司——南方东英资产管理有限公司(香港子公司)和南方资本管理有限公司(深圳子公司)。其中，南方东英是境内基金公司获批成立的第一家境外分支机构。

截至报告期末，南方基金管理股份有限公司(不含子公司)管理资产规模超过 10000 亿元，旗下管理 220 只开放式基金，多个全国社保、基本养老保险、企业年金、职业年金和专户组合。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
罗文杰	本基金基金经理	2018 年 4 月 3 日	-	15 年	女，美国南加州大学数学金融硕士、美国加州大学计算机科学硕士，具有基金从业资格。曾任职于摩根士丹利投资银行，从事量化分析工作。2008 年 9 月加入南方基金，曾任南方基金数量化投资部基金经理助理；现任指数投资部总经理。2013 年 5 月 17 日至 2015 年 6 月 16 日，任南方策略基金经理；2017 年 11 月 9 日至 2019 年 1 月 18 日，任南方策略、南方量化混合基金经理；2016 年 12 月 30 日至 2019 年 4 月 18 日，任南方安享绝对收益、南方卓享绝对收益基金经理；2018 年 2 月 8 日至 2020 年 3 月 27

				日，任 H 股 ETF 基金经理；2018 年 2 月 12 日至 2020 年 3 月 27 日，任南方 H 股联接基金经理；2013 年 4 月 22 日至今，任南方 500、南方 500ETF 基金经理；2013 年 5 月 17 日至今，任南方 300、南方 300 联接基金经理；2014 年 10 月 30 日至今，任 500 医药基金经理；2015 年 2 月 16 日至今，任南方恒生 ETF 基金经理；2017 年 7 月 21 日至今，任恒生联接基金经理；2017 年 8 月 24 日至今，任南方房地产联接基金经理；2017 年 8 月 25 日至今，任南方房地产 ETF 基金经理；2018 年 4 月 3 日至今，任 MSCI 基金基金经理；2018 年 6 月 8 日至今，任 MSCI 联接基金经理。
--	--	--	--	---

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

2、证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易次数为 3 次，是由于接受投资者申赎后被动增减仓位所致。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，MSCI 国际通指数上涨 5.80%。

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

我们对本基金报告期内跟踪误差归因分析如下：

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

(2) 报告期内指数成份股（包括调出指数成份股）的长期停牌，引起的成份股权重偏离及基金整体仓位的微小偏离；

(3) 股指期货和现货之间的基差波动带来的本基金与基准的偏离；

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.2689 元，报告期内，份额净值增长率为 8.91%，同期业绩基准增长率为 5.80%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年受疫情影响，全球经济放缓，但 A 股显示较强韧性，境内外对 A 股配置关注度提升。展望下半年，海内外货币政策保持宽松，随着全球复工，经济逐渐回暖，国内资本市场加速开放，预期中长期资金持续流入。大中华地区权益市场不少优质资产，凸显长期配置价值。

本基金为指数基金，作为基金管理人，我们将通过严格的投资管理流程、精确的数量化计算、精益求精的工作态度、恪守指数化投资的宗旨，力求实现对标的指数的有效跟踪，为持有人提供与之相近的收益。投资者可以根据自身对证券市场的判断及投资风格，借助投资本基金参与市场。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金基金合同约定，当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，可进行收益分配。基金管理人根据基金份额净值增长率和标的指数同期增长率的计算方法参见《招募说明书》；本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值；在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，基金份额每次基金收益分配比例由基金管理人根据上述原则确定，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配采取现金分红方式；每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况，本报告期本基金未有分配事项。

4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 中期财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：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	6.4.4.1	3,491,963.39	2,203,762.30
结算备付金		2,957,206.84	2,972,742.92
存出保证金		1,337,204.58	824,894.57
交易性金融资产	6.4.4.2	497,034,084.56	702,310,788.08
其中：股票投资		496,967,984.56	702,234,988.08
基金投资		-	-
债券投资		66,100.00	75,800.00

资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.4.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.4.4	-	-
应收证券清算款		1,375,498.22	-
应收利息	6.4.4.5	1,299.91	2,035.63
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.4.6	-	-
资产总计		506,197,257.50	708,314,223.50
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	6.4.4.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		41,704.15	728,963.70
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		205,256.17	309,867.03
应付托管费		41,051.23	61,973.42
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.4.7	19,542.51	42,036.37
应交税费		3,706.57	9,115.84
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.4.8	1,138,259.58	1,396,306.15
负债合计		1,449,520.21	2,548,262.51
所有者权益：			
实收基金	6.4.4.9	397,777,775.00	605,777,775.00
未分配利润	6.4.4.10	106,969,962.29	99,988,185.99

所有者权益合计		504,747,737.29	705,765,960.99
负债和所有者权益总计		506,197,257.50	708,314,223.50

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.2689 元，基金份额总额 397,777,775.00 份。

6.2 利润表

会计主体：MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：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		44,221,642.97	261,938,697.09
1. 利息收入		35,429.60	22,265.79
其中：存款利息收入	6.4.4.11	35,369.83	22,151.09
债券利息收入		59.77	114.70
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		49,401,361.39	66,781,802.09
其中：股票投资收益	6.4.4.12	44,414,766.93	59,008,829.31
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.4.13	120,632.62	92,637.76
资产支持证券投资	6.4.4.14	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.4.15	-	-
衍生工具收益	6.4.4.16	1,036,330.10	83,366.22
股利收益	6.4.4.17	3,829,631.74	7,596,968.80
3. 公允价值变动收益（损	6.4.4.18	-4,640,933.32	194,303,402.21

失以“-”号填列)			
4. 汇兑收益 (损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入 (损失以“-”号填列)	6. 4. 4. 19	-574, 214. 70	831, 227. 00
减: 二、费用		2, 392, 112. 13	3, 626, 252. 71
1. 管理人报酬	6. 4. 7. 2. 1	1, 411, 318. 66	2, 275, 411. 44
2. 托管费	6. 4. 7. 2. 2	282, 263. 76	455, 082. 32
3. 销售服务费	6. 4. 7. 2. 3	-	-
4. 交易费用	6. 4. 4. 20	451, 821. 14	518, 906. 81
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		3, 730. 99	558. 89
7. 其他费用	6. 4. 4. 21	242, 977. 58	376, 293. 25
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)		41, 829, 530. 84	258, 312, 444. 38
减: 所得税费用		-	-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)		41, 829, 530. 84	258, 312, 444. 38

6.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体: MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金

本报告期: 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)	605, 777, 775. 00	99, 988, 185. 99	705, 765, 960. 99
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	41, 829, 530. 84	41, 829, 530. 84
三、本期基金份额交	-208, 000, 000. 00	-34, 847, 754. 54	-242, 847, 754. 54

易产生的基金净值变动数（净值减少以“—”号填列）			
其中：1. 基金申购款	314,000,000.00	45,051,576.86	359,051,576.86
2. 基金赎回款	-522,000,000.00	-79,899,331.40	-601,899,331.40
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）	397,777,775.00	106,969,962.29	504,747,737.29
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）	1,269,777,775.00	-215,326,004.20	1,054,451,770.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	258,312,444.38	258,312,444.38
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）	-524,000,000.00	-3,518,412.39	-527,518,412.39
其中：1. 基金申购款	558,000,000.00	8,479,977.93	566,479,977.93
2. 基金赎回款	-1,082,000,000.00	-11,998,390.32	-1,093,998,390.32
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）	745,777,775.00	39,468,027.79	785,245,802.79

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

____ 杨小松 ____	____ 徐超 ____	____ 徐超 ____
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.2 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。

6.4.3 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.3.1 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。

6.4.3.2 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。

6.4.3.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.4 重要财务报表项目的说明

6.4.4.1 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	3,491,963.39
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 个月以上	-
其他存款	-
合计	3,491,963.39

6.4.4.2 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	438,179,438.39	496,967,984.56	58,788,546.17

贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	66,100.00	66,100.00	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	66,100.00	66,100.00	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		438,245,538.39	497,034,084.56	58,788,546.17

注:于 2020 年 06 月 30 日, 股票投资的公允价值和公允价值变动包含的可退替代款的估值增值为 0.00 元(2019 年 12 月 31 日: 591.00 元)。

6.4.4.3 衍生金融资产/负债

单位: 人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	11,969,980.00	-	-	-
一指期货	11,969,980.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	11,969,980.00	-	-	-

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

6.4.4.4 买入返售金融资产

6.4.4.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产。

6.4.4.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.4.5 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	315.00
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	943.32
应收债券利息	5.50
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	36.09
合计	1,299.91

6.4.4.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.4.7 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	19,542.51
银行间市场应付交易费用	-
合计	19,542.51

6.4.4.8 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	-
应退替代款	378,949.52
预提费用	94,978.52
应付指数使用费	558,355.24
可退替代款	105,976.30
其他	-
合计	1,138,259.58

1. 应退替代款指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，替代价格与实际买入成本或强制退款成本之差乘以替代数量的金额。

2. 可退替代款指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，替代价格与该替代证券市价之差乘以替代数量的金额。

6.4.4.9 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	605,777,775.00	605,777,775.00
本期申购	314,000,000.00	314,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-522,000,000.00	-522,000,000.00
基金拆分/份额折算前	-	-
基金份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	397,777,775.00	397,777,775.00

6.4.4.10 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	86,673,509.31	13,314,676.68	99,988,185.99
本期利润	46,470,464.16	-4,640,933.32	41,829,530.84
本期基金份额交易产生的变动数	-38,633,829.61	3,786,075.07	-34,847,754.54
其中：基金申购款	59,826,873.00	-14,775,296.14	45,051,576.86
基金赎回款	-98,460,702.61	18,561,371.21	-79,899,331.40
本期已分配利润	-	-	-
本期末	94,510,143.86	12,459,818.43	106,969,962.29

6.4.4.11 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	11,749.74
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	23,008.73
其他	611.36
合计	35,369.83

6.4.4.12 股票投资收益

6.4.4.12.1 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	37,231,210.95
股票投资收益——赎回差价收入	7,183,555.98
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	44,414,766.93

6.4.4.12.2 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	300,591,519.13
减：卖出股票成本总额	263,360,308.18
买卖股票差价收入	37,231,210.95

6.4.4.12.3 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	601,899,331.40
减：现金支付赎回款总额	224,645,311.40
减：赎回股票成本总额	370,070,464.02
赎回差价收入	7,183,555.98

6.4.4.12.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无股票申购差价收入。

6.4.4.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无证券出借差价收入。

6.4.4.13 债券投资收益**6.4.4.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	120,632.62
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	120,632.62

6.4.4.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 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	552,498.57
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	431,800.00
减：应收利息总额	65.95
买卖债券差价收入	120,632.62

6.4.4.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

6.4.4.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券申购差价收入。

6.4.4.14 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收益。

6.4.4.15 贵金属投资收益

6.4.4.15.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.4.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

6.4.4.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无贵金属赎回差价收入。

6.4.4.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无贵金属申购差价收入。

6.4.4.16 衍生工具收益

6.4.4.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具买卖权证差价收入。

6.4.4.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
股指期货-投资收益	1,036,330.10

6.4.4.17 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	3,829,631.74
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	3,829,631.74

6.4.4.18 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	-4,720,093.32
——股票投资	-4,720,093.32
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	79,160.00
——权证投资	-
——期货投资	79,160.00
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-4,640,933.32

注：本基金本期公允价值变动损益-股票投资中包括可退替代款产生的公允价值变动损益为-591.00 元(2019 上半年度：0.00 元)。

6.4.4.19 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	-574,214.70
合计	-574,214.70

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。

6.4.4.20 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	451,821.14
银行间市场交易费用	-
合计	451,821.14

6.4.4.21 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	35,306.18
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
指数使用费	141,907.32
银行费用	6,091.74

合计	242,977.58
----	------------

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% 的季度费率计提，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美元 5,000 元。计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。

6.4.5 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.5.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.5.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.6 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.6.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理股份有限公司(“南方基金”)	基金管理人
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
兴业证券股份有限公司(“兴业证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(“南方 MSCI 中国 A 股 ETF 联接基金”)	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.7.1.1 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
华泰证券	46,595,629.84	8.81%	25,283,944.32	3.80%

6.4.7.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.7.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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
华泰证券	4,660.16	8.81%	1,557.66	7.97%
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
华泰证券	2,528.37	3.80%	1,861.27	4.70%

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算。

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

6.4.7.2 关联方报酬

6.4.7.2.1 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	1,411,318.66	2,275,411.44
其中：支付销售机构的客户维护费	0.00	0.00

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

6.4.7.2.2 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
当期发生的基金应支付的托管费	282,263.76	455,082.32

支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.10% / 当年天数。

6.4.7.2.3 销售服务费

无。

6.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

6.4.7.4 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**6.4.7.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

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

6.4.7.4.2 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

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

6.4.7.5 各关联方投资本基金的情况**6.4.7.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

无。

6.4.7.5.2 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
中国银行股份有限公司-MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式	214,614,700.00	53.95%	268,614,700.00	44.34%
华泰证券股份有限公司	6,781,200.00	1.70%	5,623,800.00	0.93%

注：南方 MSCI 中国 A 股 ETF 联接基金、华泰证券投资本基金适用的申购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

6.4.7.6 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
中国银行	3,491,963.39	11,749.74	3,216,426.66	13,298.72

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行股份有限公司保管，按银行约定利率计息。

6.4.7.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

单位：人民币元

本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
兴业证券股份有限公司	000750	国海证券	网上申购	30,780	100,035.00

上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-

6.4.8 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.9 期末（2020 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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	增发未上市	5.00	6.54	14,820	74,100.00	96,922.80	-
300840	酷特智能	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 8 日	新股未上市	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-
300845	捷安高科	2020 年 6 月 24 日	2020 年 7 月 3 日	新股未上市	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	新股未上市	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	新股未上市	6.94	6.94	1,421	9,861.74	9,861.74	-

688027	国盾量子	2020年 6月30 日	2020年 7月9 日	新股未 上市	36.18	36.18	2,830	102,389.40	102,389.40	-
688086	紫晶存储	2020年 2月19 日	2020年 8月26 日	科创板 新股锁 定期	21.49	64.54	9,361	201,167.89	604,158.94	-
688096	京源环保	2020年 3月31 日	2020年 10月9 日	科创板 新股锁 定期	14.34	21.42	4,485	64,314.90	96,068.70	-
688158	优刻得	2020年 1月10 日	2020年 7月20 日	科创板 新股锁 定期	33.23	68.38	20,700	687,861.00	1,415,466.00	-
688178	万德斯	2020年 1月6 日	2020年 7月14 日	科创板 新股锁 定期	25.20	39.90	3,704	93,340.80	147,789.60	-
688266	泽璟制药	2020年 1月16 日	2020年 7月23 日	科创板 新股锁 定期	33.76	81.66	38,770	1,308,875.20	3,165,958.20	-
688277	天智航	2020年 6月24 日	2020年 7月7 日	新股未 上市	12.04	12.04	8,810	106,072.40	106,072.40	-
688568	中科星图	2020年 6月30 日	2020年 7月8 日	新股未 上市	16.21	16.21	11,020	178,634.20	178,634.20	-
688600	皖仪科技	2020年 6月23 日	2020年 7月3 日	新股未 上市	15.50	15.50	5,468	84,754.00	84,754.00	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

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：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
128112	歌尔转2	2020年 6月12 日	2020年 7月13 日	配债未 上市	100.00	100.00	661	66,100.00	66,100.00	-

注：1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起6个月。

2、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.9.4 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。

6.4.10 金融工具风险及管理

6.4.10.1 风险管理政策和组织架构

本基金是指数型基金，紧密跟踪 MSCI 中国 A 股国际通指数，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。本基金采用完全复制法，跟踪 MSCI 中国 A 股国际通指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代，力求与标的指数的跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。

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

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

6.4.10.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。内部债券信用评级主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险，以及信用产品的条款和担保人的情况等。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的内部评级，通过单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制，通过分散化投资以分散信用风险。

于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.01% (2019 年 12 月 31 日：0.01%)。

6.4.10.3 流动性风险

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

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的投资股指期货，以对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等，主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，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。

于 2020 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息。本基金赎回基金份额采用一篮子股票形式，流动性风险相对较低。

6.4.10.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注“期末本基金持有的流通受限证券”。此外，如根据基金合同的规定，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%。

同时，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逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，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。

6.4.10.4 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。

6.4.10.4.1 利率风险

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

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

本基金持有及承担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。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金和债券投资等。

6.4.10.4.1.1 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	3,491,963.39	-	-	-	3,491,963.39
结算备付金	2,957,206.84	-	-	-	2,957,206.84
存出保证金	89,182.98	-	-	1,248,021.60	1,337,204.58
交易性金融资产	-	-	66,100.00	496,967,984.56	497,034,084.56

买入返售金 融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	1,299.91	1,299.91
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收证券清 算款	-	-	-	1,375,498.22	1,375,498.22
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	6,538,353.21	-	66,100.00	499,592,804. 29	506,197,257. 50
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人 报酬	-	-	-	205,256.17	205,256.17
应付托管费	-	-	-	41,051.23	41,051.23
应付证券清 算款	-	-	-	41,704.15	41,704.15
卖出回购金 融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服 务费	-	-	-	-	-
应付交易费 用	-	-	-	19,542.51	19,542.51
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	3,706.57	3,706.57
其他负债	-	-	-	1,138,259.58	1,138,259.58
负债总计	-	-	-	1,449,520.21	1,449,520.21
利率敏感度 缺口	6,538,353.21	-	66,100.00	498,143,284. 08	504,747,737. 29
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	2,203,762.30	-	-	-	2,203,762.30
结算备付金	2,972,742.92	-	-	-	2,972,742.92
存出保证金	83,586.17	-	-	741,308.40	824,894.57
交易性金融 资产	-	-	75,800.00	702,234,988. 08	702,310,788. 08
买入返售金 融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	2,035.63	2,035.63
应收股利	-	-	-	-	-

应收申购款	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	5,260,091.39	-	75,800.00	702,978,332.11	708,314,223.50
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	309,867.03	309,867.03
应付托管费	-	-	-	61,973.42	61,973.42
应付证券清算款	-	-	-	728,963.70	728,963.70
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	42,036.37	42,036.37
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	9,115.84	9,115.84
其他负债	-	-	-	1,396,306.15	1,396,306.15
负债总计	-	-	-	2,548,262.51	2,548,262.51
利率敏感度缺口	5,260,091.39	-	75,800.00	700,430,069.60	705,765,960.99

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

6.4.10.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2020 年 06 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.01% (2019 年 12 月 31 日：0.01%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2019 年 12 月 31 日：同)。

6.4.10.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.10.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市交易

的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

6.4.10.4.3.1 其他价格风险敞口

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	496,967,984.56	98.46	702,234,988.08	99.50
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	496,967,984.56	98.46	702,234,988.08	99.50

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

6.4.10.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2020 年 6 月 30 日）	上年度末（2019 年 12 月 31 日）
	1.组合自身基准上升 5%	25,439,521.33	34,924,828.58
	2.组合自身基准下降 5%	-25,439,521.33	-34,924,828.58

6.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	496,967,984.56	98.18
	其中：股票	496,967,984.56	98.18
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	66,100.00	0.01
	其中：债券	66,100.00	0.01
	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	6,449,170.23	1.27
8	其他资产	2,714,002.71	0.54
9	合计	506,197,257.50	100.00

上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而下表合计项中不含可退替代款估值增值。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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	8,158,676.00	1.62
B	采矿业	12,046,241.98	2.39
C	制造业	252,869,757.37	50.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,033,561.03	2.38
E	建筑业	9,928,789.20	1.97
F	批发和零售业	7,917,800.40	1.57
G	交通运输、仓储和邮政业	13,126,726.53	2.60
H	住宿和餐饮业	553,887.81	0.11
I	信息传输、软件和信息技术服务业	27,211,827.16	5.39
J	金融业	105,649,665.21	20.93
K	房地产业	17,917,715.57	3.55
L	租赁和商务服务业	7,164,666.08	1.42

M	科学研究和技术服务业	4,266,126.00	0.85
N	水利、环境和公共设施管理业	389,760.00	0.08
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	710,400.00	0.14
Q	卫生和社会工作	6,216,068.18	1.23
R	文化、体育和娱乐业	4,350,736.66	0.86
S	综合	346,882.00	0.07
	合计	490,859,287.18	97.25

7.2.2 期末积极投资按行业分类境内股票投资组合

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	4,341,943.69	0.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,766.32	0.00
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	1,606,197.77	0.32
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	147,789.60	0.03
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	6,108,697.38	1.21

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

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	19,242	28,148,736.96	5.58
2	601318	中国平安	164,608	11,753,011.20	2.33
3	600036	招商银行	314,307	10,598,432.04	2.10
4	000858	五粮液	59,344	10,154,945.28	2.01
5	600276	恒瑞医药	80,779	7,455,901.70	1.48
6	600900	长江电力	334,454	6,334,558.76	1.25
7	300750	宁德时代	33,846	5,901,388.56	1.17
8	002475	立讯精密	106,373	5,462,253.55	1.08
9	603288	海天味业	41,268	5,133,739.20	1.02
10	601166	兴业银行	315,900	4,984,902.00	0.99
11	300760	迈瑞医疗	15,500	4,738,350.00	0.94
12	600000	浦发银行	445,878	4,717,389.24	0.93
13	002714	牧原股份	57,296	4,698,272.00	0.93
14	601888	中国中免	29,732	4,579,619.96	0.91
15	002415	海康威视	143,091	4,342,811.85	0.86
16	601398	工商银行	819,700	4,082,106.00	0.81
17	000002	万科A	148,400	3,879,176.00	0.77
18	601288	农业银行	1,134,100	3,833,258.00	0.76
19	000001	平安银行	297,200	3,804,160.00	0.75
20	600030	中信证券	149,400	3,602,034.00	0.71
21	600585	海螺水泥	60,900	3,222,219.00	0.64
22	601328	交通银行	597,700	3,066,201.00	0.61
23	600016	民生银行	540,000	3,061,800.00	0.61
24	601668	中国建筑	639,260	3,049,270.20	0.60
25	603259	药明康德	31,240	3,017,784.00	0.60
26	600887	伊利股份	92,688	2,885,377.44	0.57
27	000661	长春高新	6,500	2,829,450.00	0.56
28	600048	保利地产	180,400	2,666,312.00	0.53
29	300015	爱尔眼科	61,326	2,664,614.70	0.53
30	601601	中国太保	95,658	2,606,680.50	0.52
31	000651	格力电器	45,991	2,601,710.87	0.52
32	002352	顺丰控股	45,300	2,477,910.00	0.49
33	300059	东方财富	122,540	2,475,308.00	0.49
34	300122	智飞生物	24,700	2,473,705.00	0.49
35	002304	洋河股份	23,199	2,439,142.86	0.48
36	002142	宁波银行	91,800	2,411,586.00	0.48
37	600031	三一重工	128,063	2,402,461.88	0.48
38	000725	京东方A	512,800	2,394,776.00	0.47
39	600309	万华化学	47,000	2,349,530.00	0.47
40	000063	中兴通讯	58,500	2,347,605.00	0.47
41	601012	隆基股份	56,823	2,314,400.79	0.46
42	600588	用友网络	49,176	2,168,661.60	0.43
43	601818	光大银行	600,600	2,150,148.00	0.43

44	300498	温氏股份	96,780	2,109,804.00	0.42
45	601688	华泰证券	111,928	2,104,246.40	0.42
46	000568	泸州老窖	22,500	2,050,200.00	0.41
47	601766	中国中车	366,800	2,043,076.00	0.40
48	002594	比亚迪	28,000	2,010,400.00	0.40
49	600104	上汽集团	117,712	1,999,926.88	0.40
50	601211	国泰君安	113,169	1,953,296.94	0.39
51	000895	双汇发展	42,210	1,945,458.90	0.39
52	600809	山西汾酒	13,203	1,914,435.00	0.38
53	000876	新希望	64,200	1,913,160.00	0.38
54	600050	中国联通	389,400	1,884,696.00	0.37
55	600999	招商证券	85,301	1,872,356.95	0.37
56	601988	中国银行	529,200	1,841,616.00	0.36
57	000538	云南白药	19,400	1,819,914.00	0.36
58	300413	芒果超媒	27,450	1,789,740.00	0.35
59	601229	上海银行	214,356	1,779,154.80	0.35
60	600745	闻泰科技	14,000	1,763,300.00	0.35
61	603501	韦尔股份	8,685	1,753,935.75	0.35
62	603986	兆易创新	7,420	1,750,452.20	0.35
63	000166	申万宏源	341,082	1,722,464.10	0.34
64	600690	海尔智家	95,881	1,697,093.70	0.34
65	600570	恒生电子	15,667	1,687,335.90	0.33
66	001979	招商蛇口	102,032	1,677,406.08	0.33
67	603160	汇顶科技	7,500	1,671,750.00	0.33
68	601066	中信建投	42,000	1,653,960.00	0.33
69	601006	大秦铁路	223,622	1,574,298.88	0.31
70	600837	海通证券	124,800	1,569,984.00	0.31
71	601169	北京银行	318,160	1,558,984.00	0.31
72	300601	康泰生物	9,600	1,556,736.00	0.31
73	600703	三安光电	62,200	1,555,000.00	0.31
74	600028	中国石化	394,714	1,543,331.74	0.31
75	601390	中国中铁	306,900	1,540,638.00	0.31
76	600436	片仔癀	9,032	1,537,698.00	0.30
77	002555	三七互娱	31,900	1,492,920.00	0.30
78	601186	中国铁建	174,400	1,461,472.00	0.29
79	600547	山东黄金	39,280	1,438,433.60	0.28
80	002241	歌尔股份	48,908	1,435,938.88	0.28
81	002007	华兰生物	28,200	1,413,102.00	0.28
82	600406	国电南瑞	69,600	1,409,400.00	0.28
83	300014	亿纬锂能	29,224	1,398,368.40	0.28
84	601336	新华保险	31,329	1,387,248.12	0.27
85	002371	北方华创	8,100	1,384,371.00	0.27
86	601989	中国重工	343,500	1,374,000.00	0.27

87	601857	中国石油	326,242	1,366,953.98	0.27
88	601933	永辉超市	145,500	1,364,790.00	0.27
89	601138	工业富联	89,600	1,357,440.00	0.27
90	002916	深南电路	7,840	1,313,356.80	0.26
91	000938	紫光股份	30,544	1,312,781.12	0.26
92	601899	紫金矿业	295,900	1,301,960.00	0.26
93	000776	广发证券	91,041	1,285,498.92	0.25
94	000338	潍柴动力	92,900	1,274,588.00	0.25
95	600019	宝钢股份	279,019	1,272,326.64	0.25
96	000100	TCL 科技	204,400	1,267,280.00	0.25
97	002024	苏宁易购	143,200	1,255,864.00	0.25
98	600346	恒力石化	88,865	1,244,110.00	0.25
99	002230	科大讯飞	33,150	1,240,804.50	0.25
100	300142	沃森生物	23,674	1,239,570.64	0.25
101	002027	分众传媒	222,060	1,236,874.20	0.25
102	300433	蓝思科技	43,872	1,230,170.88	0.24
103	002410	广联达	17,200	1,198,840.00	0.24
104	601088	中国神华	83,478	1,198,744.08	0.24
105	002050	三花智控	54,300	1,189,170.00	0.24
106	300033	同花顺	8,900	1,184,412.00	0.23
107	600015	华夏银行	193,500	1,184,220.00	0.23
108	002311	海大集团	24,400	1,161,196.00	0.23
109	300347	泰格医药	11,350	1,156,338.00	0.23
110	601628	中国人寿	42,200	1,148,262.00	0.23
111	002624	完美世界	19,600	1,129,744.00	0.22
112	601009	南京银行	150,600	1,103,898.00	0.22
113	601155	新城控股	34,200	1,068,408.00	0.21
114	601100	恒立液压	13,200	1,058,640.00	0.21
115	300124	汇川技术	27,800	1,056,122.00	0.21
116	600340	华夏幸福	45,876	1,048,725.36	0.21
117	600009	上海机场	14,400	1,037,808.00	0.21
118	600196	复星医药	30,500	1,032,425.00	0.20
119	300676	华大基因	6,600	1,029,006.00	0.20
120	600438	通威股份	58,600	1,018,468.00	0.20
121	600183	生益科技	34,500	1,009,815.00	0.20
122	300003	乐普医疗	27,500	1,004,300.00	0.20
123	600919	江苏银行	174,226	987,861.42	0.20
124	600741	华域汽车	47,333	984,053.07	0.19
125	002271	东方雨虹	24,200	983,246.00	0.19
126	002602	世纪华通	64,000	979,840.00	0.19
127	002493	荣盛石化	79,636	979,522.80	0.19
128	603993	洛阳钼业	266,200	976,954.00	0.19
129	002841	视源股份	9,609	956,287.68	0.19

130	002129	中环股份	42,500	954,550.00	0.19
131	002001	新 和 成	32,600	948,660.00	0.19
132	601788	光大证券	59,053	948,391.18	0.19
133	000596	古井贡酒	6,300	946,512.00	0.19
134	300454	深 信 服	4,500	926,820.00	0.18
135	300558	贝达药业	6,600	923,868.00	0.18
136	002821	凯 莱 英	3,800	923,400.00	0.18
137	002600	领益智造	86,300	917,369.00	0.18
138	601939	建设银行	144,600	912,426.00	0.18
139	600383	金地集团	66,559	911,858.30	0.18
140	601225	陕西煤业	125,930	907,955.30	0.18
141	601901	方正证券	127,100	899,868.00	0.18
142	002120	韵达股份	36,585	894,503.25	0.18
143	002460	赣锋锂业	16,600	889,262.00	0.18
144	002236	大华股份	46,100	885,581.00	0.18
145	600958	东方证券	91,756	870,764.44	0.17
146	000977	浪潮信息	22,160	868,228.80	0.17
147	600763	通策医疗	5,200	867,204.00	0.17
148	601877	正泰电器	32,500	856,375.00	0.17
149	002044	美年健康	58,828	847,711.48	0.17
150	600886	国投电力	106,700	838,662.00	0.17
151	600926	杭州银行	92,320	823,494.40	0.16
152	600893	航发动力	34,526	810,670.48	0.16
153	300529	健帆生物	11,600	806,200.00	0.16
154	002127	南极电商	38,000	804,460.00	0.16
155	601669	中国电建	232,400	804,104.00	0.16
156	601985	中国核电	195,700	800,413.00	0.16
157	603939	益丰药房	8,780	798,980.00	0.16
158	600600	青岛啤酒	10,410	796,365.00	0.16
159	002456	欧 菲 光	43,300	796,287.00	0.16
160	300661	圣邦股份	2,600	793,130.00	0.16
161	600010	包钢股份	721,600	779,328.00	0.15
162	002812	恩捷股份	11,800	776,440.00	0.15
163	300136	信维通信	14,600	774,092.00	0.15
164	000069	华侨城 A	126,200	764,772.00	0.15
165	600606	绿地控股	123,700	764,466.00	0.15
166	603658	安图生物	4,700	763,468.00	0.15
167	601881	中国银河	66,100	758,167.00	0.15
168	603369	今 世 缘	19,000	756,010.00	0.15
169	603019	中科曙光	19,660	754,944.00	0.15
170	603899	晨光文具	13,800	753,480.00	0.15
171	600845	宝信软件	12,700	750,316.00	0.15
172	600521	华海药业	22,110	750,192.30	0.15

173	000768	中航飞机	42,200	748,628.00	0.15
174	300408	三环集团	27,000	747,900.00	0.15
175	300253	卫宁健康	32,530	746,238.20	0.15
176	002384	东山精密	24,800	742,760.00	0.15
177	603659	璞泰来	7,200	741,744.00	0.15
178	300628	亿联网络	10,800	737,208.00	0.15
179	600161	天坛生物	15,912	721,290.96	0.14
180	601990	南京证券	50,400	719,208.00	0.14
181	002607	中公教育	25,600	710,400.00	0.14
182	002736	国信证券	62,500	706,250.00	0.14
183	000425	徐工机械	119,000	703,290.00	0.14
184	002414	高德红外	23,900	699,792.00	0.14
185	600029	南方航空	134,800	696,916.00	0.14
186	600872	中炬高新	11,883	695,511.99	0.14
187	601377	兴业证券	101,210	693,288.50	0.14
188	600332	白云山	21,400	691,862.00	0.14
189	002179	中航光电	16,800	688,968.00	0.14
190	300144	宋城演艺	39,720	687,156.00	0.14
191	000963	华东医药	27,160	687,148.00	0.14
192	600061	国投资本	53,500	681,055.00	0.13
193	603882	金域医学	7,600	680,200.00	0.13
194	601618	中国中冶	269,200	675,692.00	0.13
195	002157	正邦科技	38,400	671,232.00	0.13
196	002463	沪电股份	26,700	666,966.00	0.13
197	601111	中国国航	100,900	666,949.00	0.13
198	000656	金科股份	81,300	663,408.00	0.13
199	000157	中联重科	103,100	662,933.00	0.13
200	603444	吉比特	1,200	658,812.00	0.13
201	000625	长安汽车	59,211	651,321.00	0.13
202	300308	中际旭创	10,320	650,160.00	0.13
203	603799	华友钴业	16,728	650,050.08	0.13
204	600536	中国软件	8,200	649,440.00	0.13
205	002049	紫光国微	8,800	640,200.00	0.13
206	002032	苏泊尔	9,000	639,000.00	0.13
207	002252	上海莱士	75,200	636,192.00	0.13
208	600352	浙江龙盛	49,072	627,630.88	0.12
209	601727	上海电气	124,518	627,570.72	0.12
210	600660	福耀玻璃	30,000	626,100.00	0.12
211	000860	顺鑫农业	10,900	621,082.00	0.12
212	300595	欧普康视	8,950	620,593.00	0.12
213	601360	三六零	33,800	618,878.00	0.12
214	300383	光环新网	23,700	617,859.00	0.12
215	601162	天风证券	101,900	617,514.00	0.12

216	600674	川投能源	66,600	617,382.00	0.12
217	601872	招商轮船	105,100	612,733.00	0.12
218	603517	绝味食品	8,648	611,759.52	0.12
219	300450	先导智能	13,200	609,972.00	0.12
220	601319	中国人保	94,000	605,360.00	0.12
221	603338	浙江鼎力	7,980	604,644.60	0.12
222	000783	长江证券	89,200	601,208.00	0.12
223	002065	东华软件	47,900	599,708.00	0.12
224	600298	安琪酵母	12,100	598,708.00	0.12
225	600115	东方航空	141,800	598,396.00	0.12
226	603605	珀莱雅	3,300	594,066.00	0.12
227	300482	万孚生物	5,700	592,800.00	0.12
228	600018	上港集团	141,092	592,586.40	0.12
229	000066	中国长城	44,873	592,323.60	0.12
230	601799	星宇股份	4,600	584,200.00	0.12
231	600132	重庆啤酒	8,000	584,000.00	0.12
232	002373	千方科技	24,300	582,957.00	0.12
233	002385	大北农	63,900	582,129.00	0.12
234	002603	以岭药业	18,600	580,134.00	0.11
235	600760	中航沈飞	17,600	577,632.00	0.11
236	002185	华天科技	42,200	570,966.00	0.11
237	600705	中航资本	143,800	569,448.00	0.11
238	002439	启明星辰	13,500	567,945.00	0.11
239	600795	国电电力	306,485	566,997.25	0.11
240	601108	财通证券	55,200	565,800.00	0.11
241	600085	同仁堂	20,800	564,096.00	0.11
242	603707	健友股份	8,700	561,759.00	0.11
243	002223	鱼跃医疗	15,400	560,560.00	0.11
244	002773	康弘药业	11,300	560,480.00	0.11
245	000786	北新建材	26,138	557,523.54	0.11
246	002466	天齐锂业	24,281	557,248.95	0.11
247	601600	中国铝业	201,700	556,692.00	0.11
248	600118	中国卫星	18,000	554,940.00	0.11
249	002299	圣农发展	18,900	548,100.00	0.11
250	600522	中天科技	47,700	546,165.00	0.11
251	300357	我武生物	8,600	535,350.00	0.11
252	300699	光威复材	8,500	533,205.00	0.11
253	603833	欧派家居	4,600	533,140.00	0.11
254	600867	通化东宝	30,532	532,172.76	0.11
255	002180	纳思达	16,100	529,851.00	0.10
256	002690	美亚光电	10,007	526,368.20	0.10
257	600109	国金证券	46,100	526,001.00	0.10
258	002153	石基信息	13,400	523,002.00	0.10

259	000961	中南建设	58,700	522,430.00	0.10
260	601800	中国交建	71,100	521,874.00	0.10
261	300251	光线传媒	47,800	521,498.00	0.10
262	600111	北方稀土	55,950	521,454.00	0.10
263	002146	荣盛发展	63,900	517,590.00	0.10
264	002202	金风科技	51,886	517,303.42	0.10
265	600998	九州通	27,600	513,912.00	0.10
266	300496	中科创达	6,600	512,820.00	0.10
267	000703	恒逸石化	55,780	509,271.40	0.10
268	600498	烽火通信	17,600	508,816.00	0.10
269	601919	中远海控	146,400	508,008.00	0.10
270	601607	上海医药	27,526	505,927.88	0.10
271	600779	水井坊	8,093	505,165.06	0.10
272	300212	易华录	8,900	498,400.00	0.10
273	000021	深科技	22,800	497,724.00	0.10
274	601018	宁波港	138,700	495,159.00	0.10
275	600801	华新水泥	20,700	490,797.00	0.10
276	001914	招商积余	15,945	489,989.85	0.10
277	300316	晶盛机电	19,700	487,378.00	0.10
278	600004	白云机场	31,900	486,156.00	0.10
279	600011	华能国际	115,100	485,722.00	0.10
280	002152	广电运通	37,500	485,250.00	0.10
281	600895	张江高科	23,800	484,806.00	0.10
282	601021	春秋航空	13,700	482,788.00	0.10
283	601231	环旭电子	22,100	482,664.00	0.10
284	300285	国瓷材料	14,400	482,544.00	0.10
285	300207	欣旺达	25,500	481,950.00	0.10
286	002601	龙蟠佰利	26,015	481,277.50	0.10
287	601555	东吴证券	58,900	480,624.00	0.10
288	600637	东方明珠	49,788	480,454.20	0.10
289	300146	汤臣倍健	24,400	480,436.00	0.10
290	002739	万达电影	31,400	479,478.00	0.09
291	002405	四维图新	29,000	478,210.00	0.09
292	600176	中国巨石	52,200	477,630.00	0.09
293	603858	步长制药	16,540	477,179.00	0.09
294	000975	银泰黄金	30,300	475,104.00	0.09
295	000050	深天马 A	30,900	474,624.00	0.09
296	603883	老百姓	4,700	470,188.00	0.09
297	600487	亨通光电	28,555	468,587.55	0.09
298	002212	南洋股份	17,600	467,808.00	0.09
299	600380	健康元	28,800	467,712.00	0.09
300	002294	信立泰	15,700	465,662.00	0.09
301	600489	中金黄金	50,800	464,312.00	0.09

302	603866	桃李面包	9,100	463,099.00	0.09
303	002422	科伦药业	22,000	462,000.00	0.09
304	600271	航天信息	28,200	457,968.00	0.09
305	601198	东兴证券	41,900	456,710.00	0.09
306	600511	国药股份	11,200	455,504.00	0.09
307	002557	洽洽食品	8,400	455,196.00	0.09
308	002926	华西证券	42,800	454,964.00	0.09
309	600177	雅戈尔	76,300	454,748.00	0.09
310	600201	生物股份	16,288	453,457.92	0.09
311	002558	巨人网络	26,000	452,400.00	0.09
312	600642	申能股份	76,300	450,933.00	0.09
313	600315	上海家化	9,400	450,260.00	0.09
314	002511	中顺洁柔	20,100	448,230.00	0.09
315	002465	海格通信	34,400	445,136.00	0.09
316	600739	辽宁成大	23,404	443,037.72	0.09
317	600699	均胜电子	18,600	442,866.00	0.09
318	603589	口子窖	8,700	442,830.00	0.09
319	600426	华鲁恒升	25,000	442,000.00	0.09
320	002019	亿帆医药	19,200	441,024.00	0.09
321	601689	拓普集团	15,800	440,820.00	0.09
322	002925	盈趣科技	7,600	440,344.00	0.09
323	002074	国轩高科	16,400	440,176.00	0.09
324	600598	北大荒	27,300	439,530.00	0.09
325	002156	通富微电	17,500	438,375.00	0.09
326	600170	上海建工	142,700	438,089.00	0.09
327	002013	中航机电	55,400	437,660.00	0.09
328	601838	成都银行	54,600	434,616.00	0.09
329	300418	昆仑万维	17,400	434,304.00	0.09
330	600655	豫园股份	48,900	433,254.00	0.09
331	002673	西部证券	52,716	430,162.56	0.09
332	600885	宏发股份	10,716	429,925.92	0.09
333	601998	中信银行	83,450	429,767.50	0.09
334	002508	老板电器	13,800	429,318.00	0.09
335	002353	杰瑞股份	13,800	427,800.00	0.08
336	000513	丽珠集团	8,900	427,289.00	0.08
337	603712	七一二	11,100	426,018.00	0.08
338	002500	山西证券	64,520	421,960.80	0.08
339	002507	涪陵榨菜	11,700	421,317.00	0.08
340	600362	江西铜业	31,300	421,298.00	0.08
341	600486	扬农化工	5,100	420,750.00	0.08
342	000999	华润三九	14,410	420,627.90	0.08
343	601878	浙商证券	42,200	418,202.00	0.08
344	002075	沙钢股份	33,400	417,500.00	0.08

345	002242	九阳股份	11,200	417,424.00	0.08
346	000739	普洛药业	17,900	416,891.00	0.08
347	300088	长信科技	37,200	416,640.00	0.08
348	601117	中国化学	75,600	414,288.00	0.08
349	000728	国元证券	49,100	412,440.00	0.08
350	600875	东方电气	46,300	409,755.00	0.08
351	600068	葛洲坝	68,500	407,575.00	0.08
352	000627	天茂集团	77,500	403,775.00	0.08
353	002078	太阳纸业	42,200	401,744.00	0.08
354	002131	利欧股份	103,900	401,054.00	0.08
355	600208	新潮中宝	134,001	399,322.98	0.08
356	002399	海普瑞	15,800	395,632.00	0.08
357	600089	特变电工	58,200	394,014.00	0.08
358	000750	国海证券	90,580	393,117.20	0.08
359	300168	万达信息	17,800	392,846.00	0.08
360	000723	美锦能源	62,400	390,624.00	0.08
361	000671	阳光城	61,600	390,544.00	0.08
362	300070	碧水源	48,000	389,760.00	0.08
363	002468	申通快递	23,700	388,917.00	0.08
364	600066	宇通客车	31,857	388,655.40	0.08
365	601992	金隅集团	126,800	388,008.00	0.08
366	600369	西南证券	84,200	386,478.00	0.08
367	002939	长城证券	31,100	383,152.00	0.08
368	002958	青农商行	85,600	379,208.00	0.08
369	600909	华安证券	55,500	379,065.00	0.08
370	600221	海航控股	251,600	377,400.00	0.07
371	600219	南山铝业	185,600	376,768.00	0.07
372	600667	太极实业	31,500	372,330.00	0.07
373	601966	玲珑轮胎	18,372	371,114.40	0.07
374	000988	华工科技	15,100	368,893.00	0.07
375	002797	第一创业	52,800	365,376.00	0.07
376	000998	隆平高科	21,800	362,970.00	0.07
377	600516	方大炭素	57,687	362,274.36	0.07
378	000401	冀东水泥	22,500	360,900.00	0.07
379	002683	宏大爆破	10,200	355,980.00	0.07
380	002030	达安基因	12,930	352,730.40	0.07
381	600153	建发股份	43,348	351,118.80	0.07
382	600027	华电国际	102,618	350,953.56	0.07
383	601233	桐昆股份	27,500	350,900.00	0.07
384	000932	华菱钢铁	92,600	349,102.00	0.07
385	002081	金螳螂	44,200	347,412.00	0.07
386	600673	东阳光	50,200	346,882.00	0.07
387	600026	中远海能	53,600	346,256.00	0.07

388	600038	中直股份	8,400	344,988.00	0.07
389	000540	中天金融	106,400	342,608.00	0.07
390	000547	航天发展	25,000	341,750.00	0.07
391	600704	物产中大	81,000	341,010.00	0.07
392	601128	常熟银行	45,400	340,954.00	0.07
393	600188	兖州煤业	38,600	338,136.00	0.07
394	600167	联美控股	23,529	337,405.86	0.07
395	002340	格林美	67,800	336,966.00	0.07
396	002572	索菲亚	13,900	335,963.00	0.07
397	000423	东阿阿胶	9,300	333,033.00	0.07
398	300271	华宇软件	11,800	332,878.00	0.07
399	000709	河钢股份	162,800	332,112.00	0.07
400	601216	君正集团	130,200	330,708.00	0.07
401	600688	上海石化	94,647	329,371.56	0.07
402	002396	星网锐捷	9,300	328,569.00	0.07
403	002387	维信诺	23,000	328,440.00	0.07
404	601099	太平洋	103,600	328,412.00	0.07
405	300024	机器人	24,000	328,080.00	0.06
406	002281	光迅科技	9,897	325,215.42	0.06
407	000729	燕京啤酒	47,400	324,690.00	0.06
408	600754	锦江酒店	11,700	324,675.00	0.06
409	300017	网宿科技	37,800	320,922.00	0.06
410	002174	游族网络	12,300	320,784.00	0.06
411	000688	国城矿业	17,249	319,623.97	0.06
412	000630	铜陵有色	164,300	317,099.00	0.06
413	600021	上海电力	42,700	315,980.00	0.06
414	600460	士兰微	21,500	315,620.00	0.06
415	600977	中国电影	23,882	313,570.66	0.06
416	600160	巨化股份	45,400	312,806.00	0.06
417	600566	济川药业	12,100	308,066.00	0.06
418	000402	金融街	45,698	303,434.72	0.06
419	000686	东北证券	35,700	301,665.00	0.06
420	000028	国药一致	6,600	297,066.00	0.06
421	600372	中航电子	22,300	297,036.00	0.06
422	601098	中南传媒	27,700	293,066.00	0.06
423	000415	渤海租赁	97,900	291,742.00	0.06
424	600583	海油工程	64,047	291,413.85	0.06
425	601699	潞安环能	51,978	289,517.46	0.06
426	600879	航天电子	44,700	287,868.00	0.06
427	600256	广汇能源	106,400	287,280.00	0.06
428	600733	北汽蓝谷	44,200	284,206.00	0.06
429	000825	太钢不锈	85,600	284,192.00	0.06
430	002372	伟星新材	24,200	281,446.00	0.06

431	600549	厦门钨业	23,500	278,240.00	0.06
432	601958	金钼股份	44,400	274,392.00	0.05
433	600466	蓝光发展	50,900	274,351.00	0.05
434	000623	吉林敖东	17,400	273,702.00	0.05
435	000629	攀钢钒钛	135,300	271,953.00	0.05
436	600967	内蒙一机	26,100	271,179.00	0.05
437	600820	隧道股份	47,500	268,375.00	0.05
438	600675	中华企业	65,704	267,415.28	0.05
439	000027	深圳能源	57,540	266,985.60	0.05
440	600373	中文传媒	22,600	266,228.00	0.05
441	300026	红日药业	46,600	257,232.00	0.05
442	002110	三钢闽光	38,600	257,076.00	0.05
443	002010	传化智联	46,318	251,969.92	0.05
444	000046	泛海控股	66,500	250,705.00	0.05
445	002268	卫士通	11,600	247,544.00	0.05
446	600446	金证股份	12,700	246,380.00	0.05
447	600376	首开股份	41,900	245,534.00	0.05
448	300296	利亚德	40,200	244,014.00	0.05
449	002195	二三四五	86,296	242,491.76	0.05
450	600572	康恩贝	43,500	239,250.00	0.05
451	000581	威孚高科	11,550	238,854.00	0.05
452	600808	马钢股份	91,800	236,844.00	0.05
453	601866	中远海发	128,300	236,072.00	0.05
454	002217	合力泰	44,800	235,200.00	0.05
455	000031	大悦城	46,200	235,158.00	0.05
456	000598	兴蓉环境	51,000	234,600.00	0.05
457	000997	新大陆	14,500	231,710.00	0.05
458	603885	吉祥航空	25,200	229,320.00	0.05
459	600258	首旅酒店	14,913	229,212.81	0.05
460	000738	航发控制	16,400	223,860.00	0.04
461	000413	东旭光电	83,100	221,877.00	0.04
462	000883	湖北能源	62,900	221,408.00	0.04
463	300012	华测检测	11,100	219,336.00	0.04
464	002563	森马服饰	31,000	218,550.00	0.04
465	000983	西山煤电	57,640	216,150.00	0.04
466	000898	鞍钢股份	87,950	215,477.50	0.04
467	000089	深圳机场	28,100	215,246.00	0.04
468	002506	协鑫集成	81,900	213,759.00	0.04
469	600863	内蒙华电	86,000	211,560.00	0.04
470	601598	中国外运	64,800	209,304.00	0.04
471	600056	中国医药	14,600	206,590.00	0.04
472	002085	万丰奥威	31,700	205,416.00	0.04
473	600260	凯乐科技	13,300	179,816.00	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

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	688266	泽璟制药	38,770	3,165,958.20	0.63
2	688158	优刻得	20,700	1,415,466.00	0.28
3	688086	紫晶存储	9,361	604,158.94	0.12
4	688568	中科星图	11,020	178,634.20	0.04
5	688178	万德斯	3,704	147,789.60	0.03
6	603087	甘李药业	1,076	107,922.80	0.02
7	688277	天智航	8,810	106,072.40	0.02
8	688027	N 国盾	2,830	102,389.40	0.02
9	688096	京源环保	4,485	96,068.70	0.02
10	688600	皖仪科技	5,468	84,754.00	0.02
11	300824	北鼎股份	1,954	26,789.34	0.01
12	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.00
13	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.00
14	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.00
15	300847	N 中船	1,421	9,861.74	0.00
16	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
17	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
18	300846	首都在线	1,131	3,811.47	0.00
19	605166	聚合顺	41	649.85	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	6,262,038.20	0.89
2	300760	迈瑞医疗	5,951,068.00	0.84
3	300750	宁德时代	4,879,367.43	0.69
4	002415	海康威视	4,482,507.06	0.64
5	000001	平安银行	4,216,242.22	0.60
6	002714	牧原股份	4,145,561.00	0.59
7	600519	贵州茅台	3,925,343.12	0.56
8	000002	万科 A	3,788,798.97	0.54
9	600745	闻泰科技	3,052,235.96	0.43
10	002475	立讯精密	2,836,319.00	0.40
11	000063	中兴通讯	2,500,229.00	0.35
12	002142	宁波银行	2,373,996.00	0.34
13	300015	爱尔眼科	2,266,184.75	0.32

14	600036	招商银行	2,208,354.00	0.31
15	300498	温氏股份	2,082,357.80	0.30
16	000651	格力电器	2,010,587.00	0.28
17	000725	京东方 A	1,955,348.00	0.28
18	300601	康泰生物	1,943,532.00	0.28
19	601318	中国平安	1,893,159.00	0.27
20	002352	顺丰控股	1,695,654.20	0.24

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000858	五 粮 液	10,932,424.07	1.55
2	300750	宁德时代	7,633,898.35	1.08
3	002415	海康威视	7,202,242.15	1.02
4	000002	万 科 A	6,170,969.90	0.87
5	000001	平安银行	5,859,246.52	0.83
6	002714	牧原股份	5,158,050.30	0.73
7	002475	立讯精密	5,100,407.14	0.72
8	000333	美的集团	4,850,848.50	0.69
9	300760	迈瑞医疗	4,724,269.23	0.67
10	000651	格力电器	3,673,091.16	0.52
11	300498	温氏股份	3,607,371.53	0.51
12	000063	中兴通讯	3,514,706.30	0.50
13	002142	宁波银行	3,487,555.38	0.49
14	300015	爱尔眼科	3,454,613.80	0.49
15	000725	京东方 A	3,337,721.00	0.47
16	001979	招商蛇口	3,210,753.00	0.45
17	002304	洋河股份	2,985,269.03	0.42
18	300601	康泰生物	2,708,410.73	0.38
19	300059	东方财富	2,488,884.00	0.35
20	600519	贵州茅台	2,449,309.52	0.35

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	238,091,584.86
卖出股票收入（成交）总额	300,591,519.13

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	66,100.00	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	66,100.00	0.01

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	128112	歌尔转 2	661	66,100.00	0.01

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

金额单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IC2007	IC2007	1	1,159,880.00	33,240.00	-
IF2007	IF2007	7	8,647,800.00	185,740.00	-
IF2009	IF2009	2	2,440,560.00	59,280.00	-
公允价值变动总额合计（元）					278,260.00
股指期货投资本期收益（元）					1,036,330.10
股指期货投资本期公允价值变动（元）					79,160.00

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

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

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

7.12.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。如是，还应对相关股票的投资决策程序做出说明

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,337,204.58
2	应收证券清算款	1,375,498.22
3	应收股利	-
4	应收利息	1,299.91
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,714,002.71

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说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688266	泽璟制药	3,165,958.20	0.63	科创板新股锁定期
2	688158	优刻得	1,415,466.00	0.28	科创板新股锁定期
3	688086	紫晶存储	604,158.94	0.12	科创板新股锁定期
4	688568	中科星图	178,634.20	0.04	新股未上市
5	688178	万德斯	147,789.60	0.03	科创板新股锁定期

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构		MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金
		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	持有份额	占总份额比例
3,941	100,933.21	31,224,513.00	7.85%	151,938,562.00	38.20%	214,614,700.00	53.95%

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	华泰证券股份有限公司	6,781,200.00	1.70%
2	招商证券股份有限公司	6,029,453.00	1.52%
3	广发证券股份有限公司	4,159,385.00	1.05%
4	中信证券股份有限公司	3,832,965.00	0.96%
5	吴美兰	3,000,000.00	0.75%
6	于淑杰	3,000,000.00	0.75%
7	杭州弘论投资管理有限公司-致和一号私募基金	2,931,100.00	0.74%
8	亚豪控股(北京)有限公司	2,331,600.00	0.59%
9	方正证券股份有限公司	2,162,010.00	0.54%
10	罗魁	2,160,000.00	0.54%
11	中国银行股份有限公司-MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式	214,614,700.00	53.95%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2018年4月3日)基金份额总额	1,309,777,775.00
本报告期期初基金份额总额	605,777,775.00
本报告期基金总申购份额	314,000,000.00
减：报告期基金总赎回份额	522,000,000.00

本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	397,777,775.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期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

本报告期内，本基金的基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人主营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总	佣金	占当期佣金总量的比例	

			额的比例			
安信证券	1	359,203,725.19	67.93%	35,926.27	67.93%	-
中泰证券	2	122,988,522.67	23.26%	12,298.71	23.26%	-
华泰证券	1	46,595,629.84	8.81%	4,660.16	8.81%	-
广发证券	1	-	-	-	-	-

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

A：选择标准

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

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

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

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
安信证券	320,125.17	57.94%	-	-	-	-
中泰证券	80,079.60	14.49%	-	-	-	-
华泰证券	152,293.80	27.56%	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
----	------	--------	--------

1	南方基金管理股份有限公司关于旗下完全被动型指数基金认购关联方承销证券的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-01-13
2	南方基金管理股份有限公司关于旗下部分 ETF 调整申赎结算模式的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-01-17
3	南方基金管理股份有限公司旗下全部基金 2019 年第四季度报告提示性公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-01-20
4	关于南方基金管理股份有限公司旗下部分基金新增扩位证券简称的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-03-16

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
联接基金	1	20200101-20200630	268,614,700.00	4,000,000.00	58,000,000.00	214,614,700.00	53.95%
产品特有风险							
本基金存在持有基金份额超过 20% 的基金份额持有人，在特定赎回比例及市场条件下，若基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产，将会导致流动性风险和基金净值波动风险。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金的文件；
- 2、《MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；

- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告；
- 6、《MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金 2020 年中期报告》原文。

12.2 存放地点

深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼。

12.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>