

中金 MSCI 中国 A 股国际价值指数发起式证 券投资基金 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：中金基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2021 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、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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 30 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 2021 年 1 月 1 日起至 2021 年 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
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	13
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	14
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.....	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17

6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告.....	40
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	40
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.....	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	47
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.....	48
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.....	48
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.....	48
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.....	48
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	49
7.12 投资组合报告附注.....	49
§8 基金份额持有人信息.....	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	51
8.3 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.....	51
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	51
§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.....	58

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	58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	58
§12 备查文件目录.....	59
12.1 备查文件目录.....	59
12.2 存放地点.....	59
12.3 查阅方式.....	59

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中金 MSCI 中国 A 股国际价值指数发起式证券投资基金	
基金简称	中金 MSCI 价值	
基金主代码	006349	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 1 月 25 日	
基金管理人	中金基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	12,757,335.21 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	中金 MSCI 价值 A	中金 MSCI 价值 C
下属分级基金的交易代码:	006349	006350
报告期末下属分级基金的份额总额	11,644,508.62 份	1,112,826.59 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，力争将本基金净值增长率与业绩比较基准收益率之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内，实现对标的指数的有效跟踪。
投资策略	本基金采用被动式指数化投资方法，按照标的指数的成份股及其权重构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。
业绩比较基准	MSCI 中国 A 股国际价值指数收益率*95%+银行活期存款利率（税后）*5%。
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型证券投资基金和混合型证券投资基金，具有与标的指数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	中金基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵璧
	联系电话	010-63211122
	电子邮箱	xxpl@ciccfund.com
客户服务电话	400-868-1166	95555
传真	010-66159121	0755-83195201
注册地址	北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸写字楼 2 座 26 层 05 室	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址	北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 B 座 43 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	100004	518040
法定代表人	胡长生	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.ciccfund.com/
基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中金基金管理有限公司	北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 B 座 43 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

基金级别	中金 MSCI 价值 A	中金 MSCI 价值 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年1月1日 - 2021年6月30日)	报告期(2021年1月1日 - 2021年6月30日)
本期已实现收益	564,979.36	51,395.41
本期利润	172,538.54	-43,164.18
加权平均基金份额本期利润	0.0147	-0.0322
本期加权平均净值利润率	1.16%	-2.56%
本期基金份额净值增长率	1.02%	0.90%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)	
期末可供分配利润	2,645,853.39	245,070.43
期末可供分配基金份额利润	0.2272	0.2202
期末基金资产净值	14,372,872.47	1,366,008.35
期末基金份额净值	1.2343	1.2275
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	23.43%	22.75%

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、本报告所列示的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、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孰低数；

4、本基金合同生效日为 2019 年 1 月 25 日，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

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

中金 MSCI 价值 A

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	-1.15%	0.59%	-2.24%	0.59%	1.09%	0.00%
过去三个月	-2.47%	0.59%	-3.27%	0.59%	0.80%	0.00%
过去六个月	1.02%	0.89%	0.81%	0.90%	0.21%	-0.01%
过去一年	8.00%	1.06%	7.39%	1.06%	0.61%	0.00%

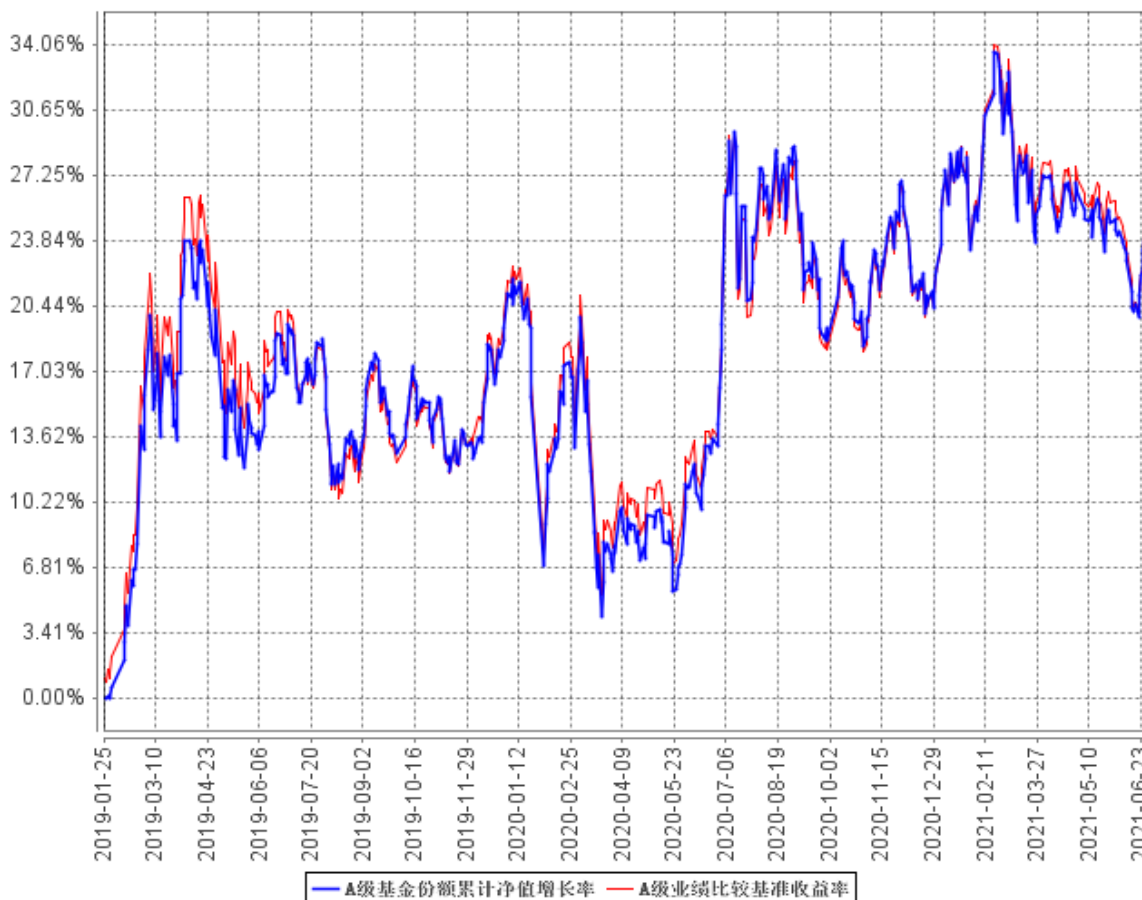
自基金合同生效起至今	23.43%	1.13%	23.09%	1.13%	0.34%	0.00%
------------	--------	-------	--------	-------	-------	-------

中金 MSCI 价值 C

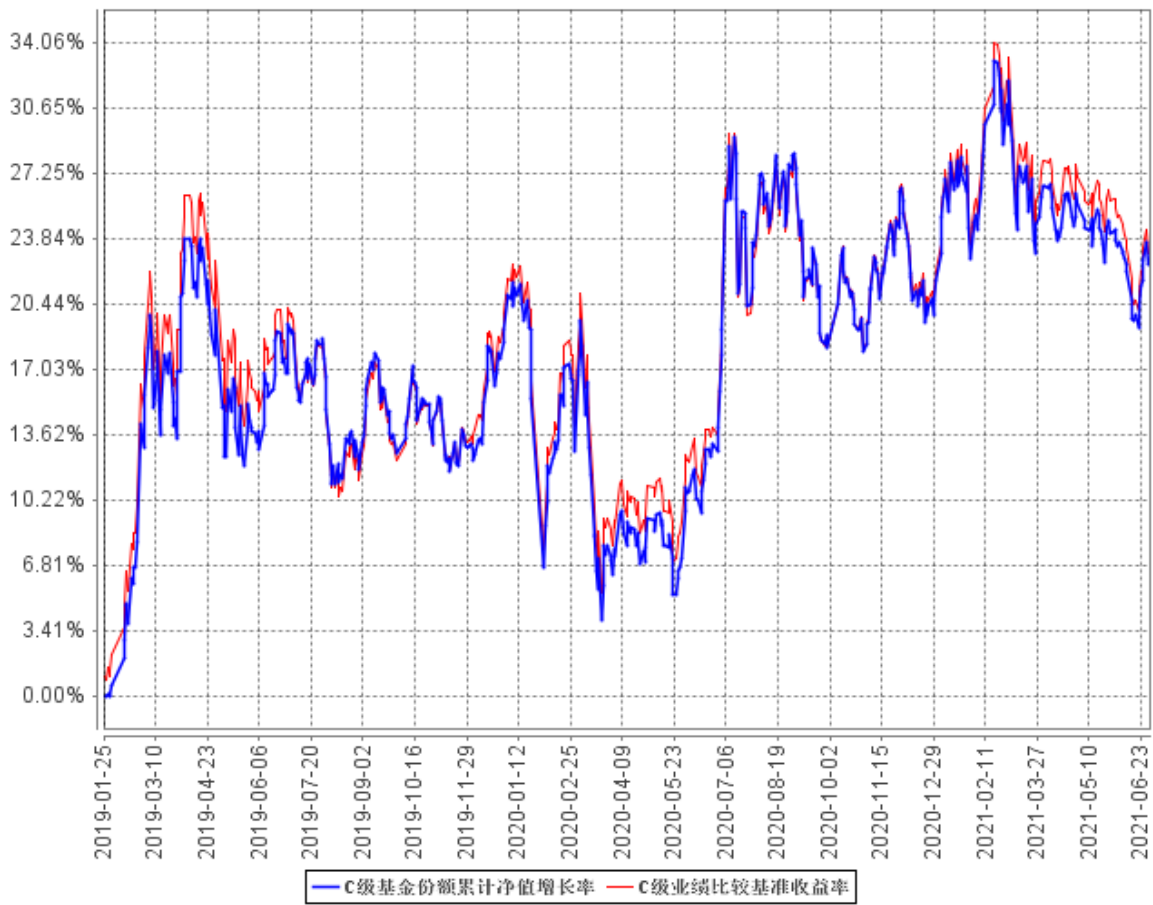
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-1.17%	0.59%	-2.24%	0.59%	1.07%	0.00%
过去三个月	-2.54%	0.59%	-3.27%	0.59%	0.73%	0.00%
过去六个月	0.90%	0.89%	0.81%	0.90%	0.09%	-0.01%
过去一年	7.72%	1.06%	7.39%	1.06%	0.33%	0.00%
自基金合同生效起至今	22.75%	1.13%	23.09%	1.13%	-0.34%	0.00%

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

A级基金份额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



C级基金份额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

中金基金管理有限公司（简称“中金基金”、“公司”）成立于 2014 年 2 月，由中国国际金融股份有限公司（简称“中金公司”）作为全资股东，是首家通过发起设立方式由单一股东持股的基金公司，注册资本 5 亿元人民币。母公司中金公司作为中国第一家中外合资投资银行，致力于为国内外机构及个人客户提供高品质的金融服务。中金基金充分发挥母公司品牌及资源优势，持续增强公司整体竞争实力。中金基金注册地址为北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸写字楼 2 座 26 层 05 室，办公地址为北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 B 座 43 层。

截至 2021 年 6 月 30 日，公司共管理 37 只公募基金，证券投资基金管理规模 680.27 亿元。

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		
刘重晋	本基金基金经理	2020 年 11 月 6 日	-	9 年	刘重晋先生，理学博士。历任松河投资咨询（深圳）有限公司副总经理、量化研究员。现任中金基金管理有限公司量化指数部基金经理。

注：1、上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2、证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3、本基金无基金经理助理。

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，本基金不存在基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情形。

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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》、基金合同和其他法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，

没有损害基金份额持有人利益的行为。

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

本基金管理人一直坚持公平对待旗下所有投资组合，严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，规范投资、研究和交易等各相关流程，通过系统控制和人工监控等方式在各环节严格控制，确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。

本报告期内，本基金运作符合法律法规和公司公平交易制度的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内，本公司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未超过该证券当日成交量的 5%。

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

本基金采用完全复制 MSCI 中国 A 股国际价值指数的策略，按照标的指数的成份股构成及其权重重建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。本基金按照基金合同约定保持较高仓位运作，力争使组合与基准收益率的跟踪偏离和跟踪误差保持在较低水平。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末中金 MSCI 价值 A 基金份额净值为 1.2343 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.02%；截至本报告期末中金 MSCI 价值 C 基金份额净值为 1.2275 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.90%；同期业绩比较基准收益率为 0.81%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

回顾上半年宏观经济运行和资本市场表现，伴随主要经济体短期增长高点在上半年的接连确认，全球资本市场关注点逐渐经历了从高度关注通胀到更加关注增长可持续性的转变；在此期间，周期/防御、价值/成长、大/小市值风格的阶段性表现差异明显。A 股市场在经历春节前快速上

涨和春节后明显调整的指数级别行情后，逐渐进入指数震荡、结构分化的行情阶段，不同风格、不同行业之间表现差异较大。整个上半年，沪深 300 指数上涨 0.24%，中证 500 指数上涨 6.93%，本基金所跟踪的 MSCI 中国 A 股国际价值指数下跌 1.67%。

展望下半年，为实现“宏观政策跨周期调节，保持经济运行在合理区间”等政策目标，国内宏观政策或将呈现“松货币、宽财政、紧信用”的组合。货币政策料将整体稳健，以保持流动性合理充裕，助力中小企业和困难行业持续恢复；财政及准财政政策有望发挥更积极高效的作用；信用条件在高基数背景下或将继续收敛。这一宏观背景下，市场对无风险收益率超预期上行的担忧或将得到明显缓解，市场整体风险偏好水平则有望保持稳定。行业景气程度较高、产业前景相对明确、估值和业绩匹配度好、具有中长期成长潜力的公司或更具配置价值。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值委员会，委员由公司总经理、分管运营领导、研究部、基金运营部、风险管理部、监察稽核部等相关人员组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员会和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。报告期内，基金经理参加估值委员会会议，但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定以及本基金基金合同对基金利润分配原则的约定，本报告期内未实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金为发起式基金，截止本报告期末，本基金成立未满三年。《公开募集证券投资基金运作管理办法》关于基金份额持有人数量及基金资产净值的限制性条款暂不适用于本基金。

§ 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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 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：中金 MSCI 中国 A 股国际价值指数发起式证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	228,843.98	177,150.22
结算备付金		56,473.36	40,164.43
存出保证金		2,110.17	2,595.16
交易性金融资产	6.4.7.2	15,955,647.50	16,412,594.74
其中：股票投资		14,953,407.50	15,465,924.74
基金投资		-	-
债券投资		1,002,240.00	946,670.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	348.22
应收利息	6.4.7.5	17,655.10	17,437.29
应收股利		-	-
应收申购款		1,365.32	19,813.97
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		16,262,095.43	16,670,104.03
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		300,000.00	300,000.00
应付证券清算款		124,349.74	12,497.57
应付赎回款		1,487.15	4,231.07
应付管理人报酬		8,988.00	9,665.86
应付托管费		1,925.99	2,071.26
应付销售服务费		272.63	175.65
应付交易费用	6.4.7.7	1,385.42	2,569.54
应交税费		-	0.20

应付利息		-	-108.49
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	84,805.68	66,192.58
负债合计		523,214.61	397,295.24
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	12,757,335.21	13,321,522.42
未分配利润	6.4.7.10	2,981,545.61	2,951,286.37
所有者权益合计		15,738,880.82	16,272,808.79
负债和所有者权益总计		16,262,095.43	16,670,104.03

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，中金 MSCI 价值 A 基金份额净值 1.2343 元，基金份额总额 11,644,508.62 份；中金 MSCI 价值 C 基金份额净值 1.2275 元，基金份额总额 1,112,826.59 份。中金 MSCI 价值份额总额合计为 12,757,335.21 份。

6.2 利润表

会计主体：中金 MSCI 中国 A 股国际价值指数发起式证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		303,255.12	-424,852.34
1.利息收入		13,730.53	15,562.23
其中：存款利息收入	6.4.7.11	770.15	1,104.53
债券利息收入		12,960.38	14,457.70
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）		775,789.93	208,721.57
其中：股票投资收益	6.4.7.12	565,456.05	46,901.21
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-79.26	125.70
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	210,413.14	161,694.66
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-487,000.41	-650,053.61
4.汇兑收益（损失以“-”号填		-	-

列)			
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	735.07	917.47
减：二、费用		173,880.76	212,605.78
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	57,298.95	51,447.12
2. 托管费	6.4.10.2.2	12,278.31	11,024.39
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	2,073.60	1,319.81
4. 交易费用	6.4.7.18	14,559.82	19,198.56
5. 利息支出		3,938.43	3,019.69
其中：卖出回购金融资产支出		3,938.43	3,019.69
6. 税金及附加		0.01	-
7. 其他费用	6.4.7.19	83,731.64	126,596.21
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		129,374.36	-637,458.12
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		129,374.36	-637,458.12

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中金 MSCI 中国 A 股国际价值指数发起式证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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）	13,321,522.42	2,951,286.37	16,272,808.79
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	129,374.36	129,374.36
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）	-564,187.21	-99,115.12	-663,302.33
其中：1.基金申购款	2,774,906.52	763,185.49	3,538,092.01
2.基金赎回款	-3,339,093.73	-862,300.61	-4,201,394.34
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)	12,757,335.21	2,981,545.61	15,738,880.82
项目	上年度可比期间 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)	13,651,294.23	2,628,606.71	16,279,900.94
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-637,458.12	-637,458.12
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)	-408,415.04	-101,899.83	-510,314.87
其中：1.基金申购款	3,020,978.23	351,207.24	3,372,185.47
2.基金赎回款	-3,429,393.27	-453,107.07	-3,882,500.34
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)	13,242,879.19	1,889,248.76	15,132,127.95

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：

<u>孙菁</u>	<u>-</u>	<u>白娜</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中金MSCI中国A股国际价值指数发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)依据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)于2018年6月22日证监许可[2018]1017号《关于准予中金MSCI中国A股国际价值指数发起式证券投资基金注册的批复》核准,由中金基金管理有限公司(以下简称“中金基金”)依照《中华人民共和国证券投资基金法》及配套规则和《中

金 MSCI 中国 A 股国际价值指数发起式证券投资基金基金合同》公开募集。本基金为契约型开放式指数型基金，存续期限为不定期。本基金的管理人为中金基金，托管人为招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）。

本基金通过中金基金直销中心和公司指定的其他销售机构公开发售，募集期为 2018 年 12 月 21 日至 2019 年 3 月 20 日。经向中国证监会备案，《中金 MSCI 中国 A 股国际价值指数发起式证券投资基金基金合同》于 2019 年 1 月 25 日正式生效，合同生效日基金实收份额为 10,561,944.88 份，发行价格为人民币 1.00 元。该资金已由毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）审验并出具验资报告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《中金 MSCI 中国 A 股国际价值指数发起式证券投资基金基金合同》和《中金 MSCI 中国 A 股国际价值指数发起式证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金为股票指数型发起式证券投资基金，跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，力争将本基金净值增长率与业绩比较基准收益率之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内，实现对标的指数的有效跟踪。本基金投资范围主要为标的指数成份股及其备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金还可投资于非成份股（包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债、公开发行的次级债、地方政府债、企业债、公司债、可转换债券（含分离交易可转换债券的纯债部分）、可交换债券、短期融资券、中期票据等）、债券回购、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、股票期权、同业存单、银行存款以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）。

本基金根据认购/申购费用、赎回费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购时收取认购、申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取认购/申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，称为 C 类基金份额。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础编制财务报表。本财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及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》编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况、2021 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税 [2002] 128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税 [2004] 78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2012] 85 号文《财政部、国家税务总局、证监会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《财政部、国家税务总局、证监会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》、《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》（财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号）、财税 [2005] 103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字 [2008] 16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2008] 1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2016] 36 号文《财政部、国家税务总局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 号文《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 号文《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》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

- (1) 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。
- (2) 自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试

点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

2018 年 1 月 1 日（含）以后，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，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 日以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，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(3) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(4) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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% 计入个人所得税应纳税所得额。对基金从全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息、红利所得，由挂牌公司代扣代缴 20% 的个人所得税。对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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，其股息红利所得暂减按 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。

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

(6) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(7) 对基金在 2018 年 1 月 1 日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

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 2021 年 6 月 30 日
活期存款	228,843.98
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：	228,843.98

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	15,336,156.50	14,953,407.50	-382,749.00
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	1,002,670.00	1,002,240.00
	银行间市场	-	-
	合计	1,002,670.00	1,002,240.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	16,338,826.50	15,955,647.50	-383,179.00

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有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 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	18.53
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	25.40
应收债券利息	17,610.27
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	0.90
合计	17,655.10

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 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	1,385.42
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,385.42

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-

预提费用	14,876.39
指数使用费	69,929.29
合计	84,805.68

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

中金 MSCI 价值 A		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	12,642,149.40	12,642,149.40
本期申购	758,404.35	758,404.35
本期赎回(以“-”号填列)	-1,756,045.13	-1,756,045.13
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	11,644,508.62	11,644,508.62

金额单位：人民币元

中金 MSCI 价值 C		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	679,373.02	679,373.02
本期申购	2,016,502.17	2,016,502.17
本期赎回(以“-”号填列)	-1,583,048.60	-1,583,048.60
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	1,112,826.59	1,112,826.59

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

中金 MSCI 价值 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,262,825.48	541,344.26	2,804,169.74

本期利润	564,979.36	-392,440.82	172,538.54
本期基金份额交易产生的变动数	-181,951.45	-66,392.98	-248,344.43
其中：基金申购款	147,807.03	65,121.91	212,928.94
基金赎回款	-329,758.48	-131,514.89	-461,273.37
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,645,853.39	82,510.46	2,728,363.85

单位：人民币元

中金 MSCI 价值 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	118,034.80	29,081.83	147,116.63
本期利润	51,395.41	-94,559.59	-43,164.18
本期基金份额交易产生的变动数	75,640.22	73,589.09	149,229.31
其中：基金申购款	377,979.85	172,276.70	550,256.55
基金赎回款	-302,339.63	-98,687.61	-401,027.24
本期已分配利润	-	-	-
本期末	245,070.43	8,111.33	253,181.76

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	358.86
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	393.14
其他	18.15
合计	770.15

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	8,990,388.09
减：卖出股票成本总额	8,424,932.04

买卖股票差价收入	565,456.05
----------	------------

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021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	-79.26
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	-79.26

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	785,390.55
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	769,840.00
减：应收利息总额	15,629.81
买卖债券差价收入	-79.26

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

基金本报告期无申购差价收入。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益**6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期无买卖权证差价收入。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无其他衍生工具投资收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	210,413.14
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	210,413.14

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-487,000.41
——股票投资	-487,780.41
——债券投资	780.00
——资产支持证券投资	-
——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	-487,000.41

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

基金赎回费收入	727.41
基金转换费收入	7.66
合计	735.07

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	14,559.82
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	14,559.82

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	14,876.39
信息披露费	-
证券出借违约金	-
指数使用费	68,289.32
汇划手续费	565.93
律师费用	-
公证费	-
合计	83,731.64

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中金基金管理有限公司（“中金基金”）	基金管理人、基金发起人、基金注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人、基金销售机构
中国国际金融股份有限公司（“中金公司”）	基金管理人的股东、基金销售机构
中国中金财富证券有限公司（“中金财富证券”原“中国中投证券有限责任公司”）	基金管理人股东的一级全资子公司、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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
中金公司	17,390,583.30	100.00%	23,101,441.40	100.00%

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	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 成交总额的比例
中金公司	1,572,400.00	100.00%	1,592,988.10	100.00%

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
中金公司	40,300,000.00	100.00%	31,800,000.00	100.00%

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021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
中金公司	4,022.47	100.00%	1,385.42	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 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
中金公司	5,340.50	100.00%	3,157.26	100.00%

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险金后的净额列示。

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服务信息。

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 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	57,298.95	51,447.12
其中：支付销售机构的客	4,782.96	5,285.66

户维护费		
------	--	--

注：支付基金管理人中金基金管理有限公司的基本管理费按前一日基金资产净值 0.70%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日基本管理费=前一日基金资产净值×0.70%/当年天数。

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
	2021年1月1日至2021年6月30日	2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	12,278.31	11,024.39

注：支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2021年1月1日至2021年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中金 MSCI 价值 A	中金 MSCI 价值 C	合计
招商银行	-	59.97	59.97
中金财富证券	-	7.24	7.24
合计	-	67.21	67.21
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2020年1月1日至2020年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中金 MSCI 价值 A	中金 MSCI 价值 C	合计
招商银行	-	181.28	181.28
中金财富证券	-	0.00	0.00
合计	-	181.28	181.28

注：1、本基金 A 类基金份额不收取销售服务费；本基金 C 类基金份额收取销售服务费；
2、支付基金销售机构的 C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.25%的年费率计提，自基金合同生效之日起每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：C 类基金份额每日应计提的销售服务费=C 类基金份额前一日基金资产净值×0.25% / 当年天数；

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末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

本基金本报告期末与关联方进行转融通证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	中金 MSCI 价值 A	中金 MSCI 价值 C
基金合同生效日（2019 年 1 月 25 日）持有的基金份额	10,000,000.00	-
报告期初持有的基金份额	10,000,000.00	-
报告期间申购/买入总份额	0.00	-
报告期间因拆分变动份额	0.00	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	-
报告期末持有的基金份额	10,000,000.00	-
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	85.8774%	-

项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	中金 MSCI 价值 A	中金 MSCI 价值 C
基金合同生效日（2019 年 1 月 25 日）持有的基金份额	10,000,000.00	-
报告期初持有的基金份额	10,000,000.00	-
报告期间申购/买入总份额	0.00	-
报告期间因拆分变动份额	0.00	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	-
报告期末持有的基金份额	10,000,000.00	-
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	81.6805%	-

注：1、报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额、基金总赎回份额含转换出份额；

2、基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

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

本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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
招商银行	228,843.98	358.86	211,886.34	782.22

注：1、本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率或约定利率计息。

2、本基金用于证券交易结算的资金通过托管人托管结算资金专用存款账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间在承销期内未参与认购关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

6.4.12 期末（2021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**

根据中国证监会相关规定，证券投资基金参与网下配售，可与发行人、承销商自主约定网下配售股票的持有期限并公开披露。持有期自公开发行的股票上市之日起计算。在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。证券投资基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期根据交易所相关规定执行。证券投资基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起在法规规定的限售期内不得转让。证券投资基金对上述非公开发行股票的减持还需根据交易所相关规定执行。

于2021年6月30日，本基金未持有因认购新发/增发证券而受上述规定约束的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002024	苏宁易购	2021年6月16日	重大事项停牌	5.59	2021年7月6日	6.15	5,500	37,737.00	30,745.00	-

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

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 300,000.00 元，于 2021 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末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

本基金属于股票指数型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型证券投资基金、混合型证券投资基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金投资风险主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险等。对于上述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对相应风险进行控制，从而控制风险，实现本基金的投资目标。

本基金的基金管理人风险管理的目标为在有效控制风险的前提下，实现基金份额持有人利益最大化；建立并完善风险控制体系，实现从公司决策、执行到监督的有效运作，从而将各种风险控制合理水平，保障业务稳健运行。

本基金管理人建立科学严密的风险管理体系和职责清晰的五道内部控制防线，采用“自上而下”和“自下而上”相结合的方式进行风险管理。“自上而下”是指通过董事会、风控与合规委员会、公司下设的风险管理委员会和风险管理部、各业务部门以及每个业务环节和岗位自上而下形

成的风险管理和监督体系。“自下而上”是指每个业务环节和岗位，各业务部门以及风险管理部对相关风险进行监控并逐级上报从而形成的风险控制和反馈体系。通过这种上下结合的风险控制体系，实现风险控制的有效性和全面性。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中发生交收违约，或者基金所投资的债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的债券投资。（上年度末：同）

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。（上年度末：同）

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的同业存单投资。（上年度末：同）

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	-	47,000.00
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	47,000.00

注：以上按长期信用评级列示的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。（上年度末：同）

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的同业存单投资。（上年度末：同）

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。基金管理人制定了《中金基金管理有限公司流动性风险管理办法》，对基金组合的流动性管理的组织架构和职责分工、流动性风险的流程管理、流动性压力测试、流动性风险预警、指标超标及危机的处理、流动性风险管理工具、各类资产的流动性风险管理指标与措施等方面进行了规定，并遵守《中金基金管理有限公司风险控制指标管理办法》中对风险控制的相关规定，对本基金组合的各项流动性指标进行监控。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的流动性风险主要来自两个方面：一是基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，二是基金投资品种所处的交易市场不活跃而造成变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。首先，本基金保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，以备支付基金份额持有人的赎回款项，可以满足短期少量赎回的流动性需要；其次，本基金的投资市场主要为证券交易所、全国银行间债券市场等流动性较好的规范型交易场所，主要投资对象为具有良好流动性的金融工具，且本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过该基金资产净值的 15%，正常市场环境下，大部分资产可以较快变现应对赎回。因此在正常市场环境下本基金的流动性风险适中。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指证券市场中各种证券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，导致基金收益的不确定性。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

利率风险是指由于市场利率变动导致金融工具的公允价值或现金流量发生波动，由此带来基金收益的不确定性。利率敏感性金融工具面临因市场利率上升而导致公允价值下降的风险。市场利率的变化还将带来票息的再投资风险，对基金的收益造成影响。本基金管理人在利率风险管理方面，定期监控本基金面临的利率风险敞口，并通过调整基金投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
-----	-------	-------	-------	-----	----

2021年6月30日					
资产					
银行存款	228,843.98	-	-	-	228,843.98
结算备付金	56,473.36	-	-	-	56,473.36
存出保证金	2,110.17	-	-	-	2,110.17
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	14,953,407.50	14,953,407.50
交易性金融资产-债券投资、资产支持证券	1,002,240.00	-	-	-	1,002,240.00
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	17,655.10	17,655.10
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	1,365.32	1,365.32
资产总计	1,289,667.51	-	-	14,972,427.92	16,262,095.43
负债					
卖出回购金融资产款	300,000.00	-	-	-	300,000.00
应付证券清算款	-	-	-	124,349.74	124,349.74
应付赎回款	-	-	-	1,487.15	1,487.15
应付管理人报酬	-	-	-	8,988.00	8,988.00
应付托管费	-	-	-	1,925.99	1,925.99
应付交易费用	-	-	-	1,385.42	1,385.42
应付销售服务费	-	-	-	272.63	272.63
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	84,805.68	84,805.68
负债总计	300,000.00	-	-	223,214.61	523,214.61
利率敏感度缺口	989,667.51	-	-	14,749,213.31	15,738,880.82
上年度末 2020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	177,150.22	-	-	-	177,150.22
结算备付金	40,164.43	-	-	-	40,164.43
存出保证金	2,595.16	-	-	-	2,595.16
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	15,465,924.74	15,465,924.74
交易性金融资产-债券投资、资产支持证券	899,670.00	-	47,000.00	-	946,670.00
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	348.22	348.22

应收利息	-	-	17,437.29	17,437.29
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	19,813.97	19,813.97
资产总计	1,119,579.81	47,000.00	15,503,524.22	16,670,104.03
负债				
卖出回购金融资产款	300,000.00	-	-	300,000.00
应付证券清算款	-	-	12,497.57	12,497.57
应付赎回款	-	-	4,231.07	4,231.07
应付管理人报酬	-	-	9,665.86	9,665.86
应付托管费	-	-	2,071.26	2,071.26
应付交易费用	-	-	2,569.54	2,569.54
应付销售服务费	-	-	175.65	175.65
应交税费	-	-	0.20	0.20
应付利息	-	-	-108.49	-108.49
其他负债	-	-	66,192.58	66,192.58
负债总计	300,000.00	-	97,295.24	397,295.24
利率敏感度缺口	819,579.81	47,000.00	15,406,228.98	16,272,808.79

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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1、该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有固定收益类资产的利率风险状况测算的理论变动值对基金资产净值的影响金额。		
	2、假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。		
	3、此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
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（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个基点	838.24	318.82
	市场利率上升 25 个基点	-838.24	-318.82

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金面临的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。

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 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	14,953,407.50	95.01	15,465,924.74	95.04
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	14,953,407.50	95.01	15,465,924.74	95.04

6.4.13.4.3.2 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（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	785,538.87	814,368.91
业绩比较基准下降 5%	-785,538.87	-814,368.91	

6.4.14 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	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	14,953,407.50	91.95
	其中：股票	14,953,407.50	91.95
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,002,240.00	6.16
	其中：债券	1,002,240.00	6.16
	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	285,317.34	1.75
8	其他各项资产	21,130.59	0.13
9	合计	16,262,095.43	100.00

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

金额单位：人民币元

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	1,310,949.28	8.33
B	采矿业	269,911.80	1.71
C	制造业	7,002,657.02	44.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	303,146.00	1.93
E	建筑业	1,058,928.00	6.73
F	批发和零售业	908,242.00	5.77
G	交通运输、仓储和邮政业	337,182.00	2.14
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	217,926.00	1.38
J	金融业	2,892,842.40	18.38
K	房地产业	546,865.00	3.47
L	租赁和商务服务业	23,130.00	0.15

M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	19,006.00	0.12
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	62,622.00	0.40
S	综合	-	-
	合计	14,953,407.50	95.01

7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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 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	002714	牧原股份	11,694	711,229.08	4.52
2	300498	温氏股份	30,260	434,836.20	2.76
3	601668	中国建筑	90,500	420,825.00	2.67
4	000725	京东方A	64,800	404,352.00	2.57
5	601166	兴业银行	18,400	378,120.00	2.40
6	600000	浦发银行	35,800	358,000.00	2.27
7	600104	上汽集团	15,400	338,338.00	2.15
8	600438	通威股份	7,800	337,506.00	2.14
9	601012	隆基股份	3,320	294,948.80	1.87
10	600019	宝钢股份	37,400	285,736.00	1.82
11	601398	工商银行	54,700	282,799.00	1.80
12	601607	上海医药	12,300	259,899.00	1.65
13	000876	新希望	17,700	259,659.00	1.65
14	601328	交通银行	52,800	258,720.00	1.64
15	600585	海螺水泥	6,200	254,510.00	1.62
16	601288	农业银行	83,700	253,611.00	1.61
17	000069	华侨城A	29,700	220,968.00	1.40

18	601390	中国中铁	41,100	215,364.00	1.37
19	600016	民生银行	48,100	212,121.00	1.35
20	000002	万科A	8,500	202,385.00	1.29
21	002157	正邦科技	14,900	178,055.00	1.13
22	601818	光大银行	45,800	173,124.00	1.10
23	600196	复星医药	2,300	165,899.00	1.05
24	601006	大秦铁路	24,600	161,868.00	1.03
25	300433	蓝思科技	5,100	149,991.00	0.95
26	000623	吉林敖东	9,000	139,410.00	0.89
27	000963	华东医药	3,000	138,030.00	0.88
28	002001	新和成	4,700	134,796.00	0.86
29	601169	北京银行	27,400	133,438.00	0.85
30	601988	中国银行	43,000	132,440.00	0.84
31	600031	三一重工	4,300	125,001.00	0.79
32	601229	上海银行	15,100	123,820.00	0.79
33	600332	白云山	3,500	118,475.00	0.75
34	002299	圣农发展	4,900	117,012.00	0.74
35	603156	养元饮品	3,980	113,748.40	0.72
36	600741	华域汽车	4,300	112,961.00	0.72
37	300677	英科医疗	900	112,320.00	0.71
38	600015	华夏银行	17,700	109,563.00	0.70
39	600919	江苏银行	15,080	107,068.00	0.68
40	000932	华菱钢铁	15,780	104,148.00	0.66
41	600380	健康元	7,400	101,602.00	0.65
42	601669	中国电建	25,500	98,685.00	0.63
43	601117	中国化学	10,600	92,856.00	0.59
44	601618	中国中冶	30,900	92,082.00	0.59
45	601138	工业富联	7,400	91,834.00	0.58
46	600637	东方明珠	10,800	88,452.00	0.56
47	000100	TCL 科技	11,300	86,445.00	0.55
48	000338	潍柴动力	4,800	85,776.00	0.54
49	002385	大北农	12,100	82,280.00	0.52
50	600998	九州通	5,300	81,461.00	0.52
51	600028	中国石化	18,600	81,096.00	0.52
52	601009	南京银行	7,700	81,004.00	0.51
53	603858	步长制药	3,600	80,964.00	0.51
54	000050	深天马A	5,700	80,826.00	0.51
55	600642	申能股份	13,100	80,434.00	0.51
56	000709	河钢股份	32,500	79,950.00	0.51

57	600795	国电电力	32,500	78,975.00	0.50
58	600703	三安光电	2,400	76,920.00	0.49
59	000063	中兴通讯	2,300	76,429.00	0.49
60	600704	物产中大	9,400	73,978.00	0.47
61	601233	桐昆股份	3,000	72,270.00	0.46
62	000999	华润三九	2,700	72,225.00	0.46
63	000625	长安汽车	2,700	70,956.00	0.45
64	601658	邮储银行	14,100	70,782.00	0.45
65	600219	南山铝业	19,400	69,840.00	0.44
66	600737	中粮糖业	6,900	69,069.00	0.44
67	600745	闻泰科技	700	67,830.00	0.43
68	603589	口子窖	1,000	67,690.00	0.43
69	000825	太钢不锈	8,900	66,661.00	0.42
70	002236	大华股份	3,100	65,410.00	0.42
71	000938	紫光股份	2,980	65,202.40	0.41
72	600655	豫园股份	5,600	64,904.00	0.41
73	600023	浙能电力	17,300	63,491.00	0.40
74	601098	中南传媒	7,100	62,622.00	0.40
75	002129	中环股份	1,600	61,760.00	0.39
76	600068	葛洲坝	8,100	60,669.00	0.39
77	600511	国药股份	1,800	59,508.00	0.38
78	000157	中联重科	6,400	59,136.00	0.38
79	000729	燕京啤酒	8,000	57,920.00	0.37
80	600297	广汇汽车	19,900	57,312.00	0.36
81	601857	中国石油	10,500	55,545.00	0.35
82	600352	浙江龙盛	4,000	54,960.00	0.35
83	000860	顺鑫农业	1,300	54,834.00	0.35
84	688396	华润微	600	54,612.00	0.35
85	601939	建设银行	8,200	54,530.00	0.35
86	600079	人福医药	1,900	53,713.00	0.34
87	600535	天士力	3,600	53,316.00	0.34
88	601088	中国神华	2,700	52,704.00	0.33
89	002422	科伦药业	2,600	51,870.00	0.33
90	002602	世纪华通	7,900	50,718.00	0.32
91	600153	建发股份	6,200	50,220.00	0.32
92	000513	丽珠集团	1,000	50,020.00	0.32
93	600598	北大荒	3,200	47,872.00	0.30
94	000425	徐工机械	7,400	47,138.00	0.30
95	688009	中国通号	8,278	47,101.82	0.30

96	601992	金隅集团	17,300	46,537.00	0.30
97	600089	特变电工	3,500	44,975.00	0.29
98	600027	华电国际	12,900	44,376.00	0.28
99	000703	恒逸石化	3,700	44,215.00	0.28
100	600362	江西铜业	1,900	42,522.00	0.27
101	601916	浙商银行	10,600	42,082.00	0.27
102	600018	上港集团	8,800	41,976.00	0.27
103	600029	南方航空	6,900	41,538.00	0.26
104	002019	亿帆医药	2,400	41,400.00	0.26
105	002459	晶澳科技	800	39,200.00	0.25
106	600487	亨通光电	3,400	38,760.00	0.25
107	600801	华新水泥	2,200	38,654.00	0.25
108	002600	领益智造	4,200	38,598.00	0.25
109	600170	上海建工	13,800	38,088.00	0.24
110	002384	东山精密	1,800	37,512.00	0.24
111	601111	中国国航	4,700	36,566.00	0.23
112	000423	东阿阿胶	1,000	35,910.00	0.23
113	600011	华能国际	8,500	35,870.00	0.23
114	600271	航天信息	2,700	35,181.00	0.22
115	002078	太阳纸业	2,500	33,375.00	0.21
116	601838	成都银行	2,600	32,864.00	0.21
117	002202	金风科技	2,700	32,832.00	0.21
118	601077	渝农商行	8,200	32,718.00	0.21
119	600115	中国东航	6,300	32,004.00	0.20
120	601225	陕西煤业	2,700	31,995.00	0.20
121	600739	辽宁成大	1,500	31,215.00	0.20
122	601997	贵阳银行	4,340	31,074.40	0.20
123	000401	冀东水泥	2,500	30,875.00	0.20
124	002024	苏宁易购	5,500	30,745.00	0.20
125	601933	永辉超市	6,500	30,745.00	0.20
126	600699	均胜电子	1,200	30,624.00	0.19
127	600827	百联股份	1,500	30,225.00	0.19
128	600522	中天科技	3,000	30,000.00	0.19
129	600606	绿地控股	5,500	29,975.00	0.19
130	000581	威孚高科	1,400	29,162.00	0.19
131	601727	上海电气	6,700	28,408.00	0.18
132	002563	森马服饰	2,300	27,485.00	0.17
133	300296	利亚德	3,500	27,370.00	0.17
134	600688	上海石化	6,900	25,944.00	0.16

135	000540	中天金融	9,400	25,662.00	0.16
136	002938	鹏鼎控股	700	25,116.00	0.16
137	002456	欧菲光	2,800	24,864.00	0.16
138	000671	阳光城	4,700	24,440.00	0.16
139	002152	广电运通	1,800	23,454.00	0.15
140	002030	达安基因	1,100	23,364.00	0.15
141	002603	以岭药业	800	23,328.00	0.15
142	601598	中国外运	4,600	23,230.00	0.15
143	601360	三六零	1,900	23,199.00	0.15
144	002010	传化智联	3,000	23,130.00	0.15
145	600482	中国动力	1,300	22,646.00	0.14
146	002081	金螳螂	2,800	22,176.00	0.14
147	002373	千方科技	1,300	21,710.00	0.14
148	300088	长信科技	2,600	21,476.00	0.14
149	600516	方大炭素	2,840	21,129.60	0.13
150	000830	鲁西化工	1,100	20,603.00	0.13
151	601231	环旭电子	1,200	20,172.00	0.13
152	600160	巨化股份	2,200	19,448.00	0.12
153	600528	中铁工业	2,400	19,440.00	0.12
154	002180	纳思达	600	19,320.00	0.12
155	300070	碧水源	2,600	19,006.00	0.12
156	600066	宇通客车	1,500	18,735.00	0.12
157	000961	中南建设	3,100	18,352.00	0.12
158	600039	四川路桥	2,900	18,183.00	0.12
159	300418	昆仑万维	1,100	18,018.00	0.11
160	601699	潞安环能	1,500	17,715.00	0.11
161	002463	沪电股份	1,100	17,017.00	0.11
162	601058	赛轮轮胎	1,700	16,983.00	0.11
163	600188	兖州煤业	1,100	16,896.00	0.11
164	600498	烽火通信	900	16,767.00	0.11
165	300383	光环新网	1,100	15,829.00	0.10
166	000656	金科股份	2,700	15,633.00	0.10
167	600390	五矿资本	2,600	15,548.00	0.10
168	600166	福田汽车	4,300	14,835.00	0.09
169	000983	山西焦煤	1,680	13,960.80	0.09
170	600100	同方股份	2,200	13,442.00	0.09
171	002399	海普瑞	800	12,744.00	0.08
172	300115	长盈精密	600	12,360.00	0.08
173	002465	海格通信	1,000	9,460.00	0.06

174	000402	金融街	1,400	9,450.00	0.06
175	002958	青农商行	2,200	9,416.00	0.06

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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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	002714	牧原股份	495,702.00	3.05
2	000725	京东方 A	294,209.00	1.81
3	601012	隆基股份	261,238.00	1.61
4	601166	兴业银行	215,423.00	1.32
5	000876	新希望	210,695.00	1.29
6	300498	温氏股份	210,582.00	1.29
7	600438	通威股份	209,160.00	1.29
8	600104	上汽集团	192,542.00	1.18
9	601668	中国建筑	178,405.00	1.10
10	600585	海螺水泥	177,847.39	1.09
11	600019	宝钢股份	168,570.00	1.04
12	300677	英科医疗	145,217.00	0.89
13	002157	正邦科技	131,558.55	0.81
14	600000	浦发银行	119,805.00	0.74
15	601390	中国中铁	108,518.00	0.67
16	601288	农业银行	94,631.00	0.58
17	601398	工商银行	90,390.00	0.56
18	000002	万科 A	90,246.00	0.55
19	000069	华侨城 A	86,790.00	0.53
20	300433	蓝思科技	86,286.00	0.53

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	000725	京东方 A	612,584.00	3.76
2	002714	牧原股份	516,955.00	3.18
3	601012	隆基股份	373,969.00	2.30
4	601166	兴业银行	325,482.00	2.00
5	000001	平安银行	279,617.00	1.72
6	600438	通威股份	221,887.00	1.36
7	600050	中国联通	215,205.00	1.32
8	601186	中国铁建	185,283.00	1.14
9	300498	温氏股份	178,858.00	1.10
10	600000	浦发银行	169,582.00	1.04
11	600690	海尔智家	167,921.00	1.03
12	600019	宝钢股份	164,963.00	1.01
13	000876	新希望	154,887.00	0.95
14	601288	农业银行	124,405.00	0.76
15	600585	海螺水泥	123,421.00	0.76
16	002157	正邦科技	121,211.00	0.74
17	600016	民生银行	109,227.00	0.67
18	300433	蓝思科技	108,092.00	0.66
19	601766	中国中车	102,864.00	0.63
20	601328	交通银行	102,694.00	0.63

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	8,400,195.21
卖出股票收入（成交）总额	8,990,388.09

注：7.4.1 项“买入金额”、7.4.2 项“卖出金额”及 7.4.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额（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	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	1,002,240.00	6.37
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,002,240.00	6.37

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	占基金资产净值比例（%）
1	019645	20 国债 15	7,000	702,170.00	4.46
2	019640	20 国债 10	2,000	200,000.00	1.27
3	019649	21 国债 01	1,000	100,070.00	0.64

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

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

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本基金本报告期投资的前十名证券的发行主体，除上海浦东发展银行股份有限公司（浦发银行）、兴业银行股份有限公司（兴业银行）外，本报告期没有出现被监管部门立案调查的情形，也没有出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2021 年 4 月 30 日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局发布行政处罚决定书（沪银保监银罚决字〔2021〕29 号），对上海浦东发展银行股份有限公司 2016 年 5 月至 2019 年 1 月未按规定开展代销业务的违法违规事实进行处罚。2020 年 8 月 11 日，中国保险监督管理委员会上海监管局发布行政处罚决定书（沪银保监银罚决字〔2020〕12 号），对上海浦东发展银行股份有限公司 2013 年至 2018 年未按专营部门制规定开展同业业务、同业投资资金违规投向“四证”不全的房地产项目、延迟支付同业投资资金吸收存款等违法违规事实进行处罚。

2020 年 9 月 11 日，中国人民银行福州中心支行发布行政处罚决定书（福银罚字〔2020〕35 号），对兴业银行股份有限公司为无证机构提供转接清算服务、为支付机构超范围（超业务、超地域）经营提供支付服务等违法违规事实进行处罚。2020 年 9 月 4 日，中国银行保险监督管理委员会福建监管局发布行政处罚决定书（闽银保监罚决字〔2020〕24 号），对兴业银行股份有限公司同业投资用途不合规、授信管理不尽职、采用不正当手段吸收存款等违法违规事实进行处罚。

本基金采用完全复制 MSCI 价值 Smart Beta 指数的策略，浦发银行、兴业银行是 MSCI 价值 Smart Beta 指数的前十大成分股，我们判断所列处罚对其投资价值不会产生重大影响，故依然按照完全复制指数的投资策略持有该股。

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,110.17
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	17,655.10
5	应收申购款	1,365.32
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	21,130.59

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限的情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极股票投资。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，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

份额级别	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
中金 MSCI 价值 A	376	30,969.44	10,405,717.98	89.36%	1,238,790.64	10.64%
中金 MSCI 价值 C	337	3,302.16	0.00	0.00%	1,112,826.59	100.00%
合计	713	17,892.48	10,405,717.98	81.57%	2,351,617.23	18.43%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	中金 MSCI 价值 A	21,598.31	0.1855%
	中金 MSCI 价值 C	0.00	0.0000%
	合计	21,598.31	0.1693%

8.3 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	份额级别	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	中金 MSCI 价值 A	0
	中金 MSCI 价值 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	中金 MSCI 价值 A	0
	中金 MSCI 价值 C	0
	合计	0

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限

基金管理人固有资金	10,000,000.00	78.39	10,000,000.00	78.39	自基金合同生效之日起不少于三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,000.00	78.39	10,000,000.00	78.39	-

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中金 MSCI 价值 A	中金 MSCI 价值 C
基金合同生效日（2019 年 1 月 25 日）基金份额总额	10,386,809.21	175,135.67
本报告期期初基金份额总额	12,642,149.40	679,373.02
本报告期基金总申购份额	758,404.35	2,016,502.17
减：本报告期基金总赎回份额	1,756,045.13	1,583,048.60
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	11,644,508.62	1,112,826.59

注：报告期期间基金总申购份额含转换入份额；基金总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内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

(1) 基金管理人的重大人事变动情况

2021 年 3 月 5 日，本基金管理人发布公告，赵璧先生自 2021 年 3 月 3 日担任公司督察长；李虹女士同日起不再担任公司督察长。同日，本基金管理人发布公告，公司股东中金公司于 2021 年 3 月作出股东决定，赵璧先生不再担任公司第三届董事会董事，任命邱延冰先生担任公司第三届董事会董事。

2021 年 6 月 2 日，本基金管理人发布公告，杨毓莹女士自 2021 年 6 月 1 日起担任公司独立董事；王元先生同日起不再担任公司独立董事。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金的审计机构为毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙），该审计机构自基金合同生效日起向本基金提供审计服务，无改聘情况。

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

本基金管理人、托管人及其高级管理人员在本报告期内未受到任何稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

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

			例			
中金公司	2	17,390,583.30	100.00%	4,022.47	100.00%	-

注：1、本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。基金交易单元的选择标准如下：

- (1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (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，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面的向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金交易单元的选择程序如下：

- (1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。
- (2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中金公司	1,572,400.00	100.00%	40,300,000.00	100.00%	-	-

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	中金基金管理有限公司关于设立上海分公司的公告	中国证监会规定媒介	2021年1月16日
2	中金基金管理有限公司旗下基金2020年第4季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2021年1月22日
3	中金 MSCI 中国 A 股国际价值指数发起式证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2021年1月22日

4	中金 MSCI 中国 A 股国际价值指数发起式证券投资基金更新招募说明书(2021 年第 1 号)	中国证监会规定媒介	2021 年 2 月 3 日
5	中金 MSCI 中国 A 股国际价值指数发起式证券投资基金基金产品资料概要(更新)	中国证监会规定媒介	2021 年 2 月 3 日
6	中金基金管理有限公司关于终止包商银行股份有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证监会规定媒介	2021 年 2 月 8 日
7	中金基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定媒介	2021 年 3 月 5 日
8	中金基金管理有限公司关于董事变更的公告	中国证监会规定媒介	2021 年 3 月 5 日
9	中金基金管理有限公司关于设立厦门分公司的公告	中国证监会规定媒介	2021 年 3 月 6 日
10	中金基金管理有限公司关于旗下部分基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》修改基金合同部分条款的公告	中国证监会规定媒介	2021 年 3 月 30 日
11	中金基金管理有限公司中金 MSCI 中国 A 股国际价值指数发起式证券投资基金基金合同	中国证监会规定媒介	2021 年 3 月 30 日
12	中金 MSCI 中国 A 股国际价值指数发起式证券投资基金更新招募说明书(2021 年第 2 号)	中国证监会规定媒介	2021 年 3 月 30 日
13	中金 MSCI 中国 A 股国际价值指数发起式证券投资基金基金产品资料概要(更新)	中国证监会规定媒介	2021 年 3 月 30 日
14	中金基金管理有限公司旗下全部基金 2020 年年度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2021 年 3 月 31 日
15	中金 MSCI 中国 A 股国际价值指数发起式证券投资基金 2020 年年度报告及摘要	中国证监会规定媒介	2021 年 3 月 31 日
16	中金基金管理有限公司旗下全部基金 2021 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2021 年 4 月 22 日
17	中金 MSCI 中国 A 股国际价值指数发起式证券投资基金	中国证监会规定媒介	2021 年 4 月 22 日

	2021 年第 1 季度报告		
18	关于不法分子假冒“中金基金”名义进行诈骗的风险提示	中国证监会规定媒介	2021 年 5 月 26 日
19	关于不法分子假冒“中金基金”名义虚构“中金基金静态战略投资项目”进行诈骗活动的风险提示	中国证监会规定媒介	2021 年 5 月 27 日
20	中金基金管理有限公司关于公司独立董事变更的公告	中国证监会规定媒介	2021 年 6 月 2 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
自有资金	1	2021年01月01日-2021年06月30日	10,000,000.00	0.00	0.00	10,000,000.00	78.39%
产品特有风险							
<p>本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额 20%的情形。如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产，有可能对基金净值产生一定的影响；极端情况下可能引发基金的流动性风险，发生暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形；在特定情况下，若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平，从而可能面临基金合同终止等基金合同中约定的情形。</p>							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金不存在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

- 1、中国证监会批准中金 MSCI 中国 A 股国际价值指数发起式证券投资基金募集注册文件
- 2、《中金 MSCI 中国 A 股国际价值指数发起式证券投资基金基金合同》
- 3、《中金 MSCI 中国 A 股国际价值指数发起式证券投资基金托管协议》
- 4、关于申请募集中金 MSCI 中国 A 股国际价值指数发起式证券投资基金之法律意见书
- 5、《中金 MSCI 中国 A 股国际价值指数发起式证券投资基金招募说明书》及其更新
- 6、基金管理人业务资格批复和营业执照
- 7、基金托管人业务资格批复和营业执照
- 8、报告期内中金 MSCI 中国 A 股国际价值指数发起式证券投资基金在指定媒介上发布的各项公告
- 9、中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

投资者营业时间内可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件和复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人。

咨询电话：(86) 010-63211122 400-868-1166

传真：(86) 010-66159121

中金基金管理有限公司

2021 年 8 月 31 日