

新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金

2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：新华基金管理股份有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年八月二十七日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
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遵规守信情况的说明.....	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.....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	9
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	10
5 托管人报告	10
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	10
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.....	10
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	10
6 半年度财务会计报告（未经审计）	10
6.1 资产负债表.....	10
6.2 利润表.....	12
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	16
7 投资组合报告	57
7.1 期末基金资产组合情况.....	57
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	59
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.....	65
7.4 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	65
7.5 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	66
7.6 报告期内股票投资组合的重大变动.....	66
7.7 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	67
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	69
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	69
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细.....	70
7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	70
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	71
7.13 投资组合报告附注.....	72
8 基金份额持有人信息	74
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	74

8.2 期末上市基金前十名持有人	76
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	77
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	78
9 开放式基金份额变动	80
10 重大事件揭示	81
10.1 基金份额持有人大会决议	81
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	81
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	81
10.4 基金投资策略的改变	81
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况	81
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	81
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	81
10.8 其他重大事件	82
11 影响投资者决策的其他重要信息	84
12 备查文件目录	84
12.1 备查文件目录	84
12.2 存放地点	84
12.3 查阅方式	85

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	新华 MSCI 中国 A 股国际 ETF
场内简称	MSCI 新华
基金主代码	512920
交易代码	512920
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2018 年 11 月 7 日
基金管理人	新华基金管理股份有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	25,092,640.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2018 年 12 月 7 日

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

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		新华基金管理股份有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	齐岩	秦一楠
	联系电话	010-68779688	010-66060069
	电子邮箱	qiyang@ncfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4008198866	95599
传真		010-68779528	010-68121816
注册地址		重庆市江北区聚贤岩广场6号 力帆中心2号楼19层	北京市东城区建国门内大街69 号
办公地址		重庆市江北区聚贤岩广场6号 力帆中心2号楼19层, 北京市海 淀区西三环北路11号海通时代 商务中心, 北京市海淀区西三 环北路11号海通时代商务中心 C1座	北京市西城区复兴门内大街28 号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码		400010	100031
法定代表人		翟晨曦	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.ncfund.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

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

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2021年1月1日至2021年6月30日）
本期已实现收益	5,961,255.90
本期利润	2,663,214.89

加权平均基金份额本期利润	0.0922
本期加权平均净值利润率	5.00%
本期基金份额净值增长率	4.82%
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	19,691,353.13
期末可供分配基金份额利润	0.7847
期末基金资产净值	47,867,309.38
期末基金份额净值	1.9076
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	90.76%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.20%	0.83%	-0.41%	0.84%	0.61%	-0.01%
过去三个月	8.29%	0.95%	7.18%	0.97%	1.11%	-0.02%
过去六个月	4.82%	1.28%	3.45%	1.32%	1.37%	-0.04%
过去一年	31.62%	1.30%	28.17%	1.33%	3.45%	-0.03%
自基金合同生效起至今	90.76%	1.27%	71.96%	1.32%	18.80%	-0.05%

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

2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

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

新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2018 年 11 月 7 日至 2021 年 6 月 30 日)



注：本报告期末本基金各项资产配置比例符合合同约定。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至 2021 年 6 月 30 日，新华基金管理股份有限公司旗下管理着五十二只开放式基金，即新华优选分红混合型证券投资基金、新华优选成长混合型证券投资基金、新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金、新华钻石品质企业混合型证券投资基金、新华行业周期轮换混合型证券投资基金、新华中小市值优选混合型证券投资基金、新华灵活主题混合型证券投资基金、新华优选消费混合型证券投资基金、新华纯债添利债券型发起式证券投资基金、新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金、新华趋势领航混合型证券投资基金、新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金、新华壹诺宝货币市场基金、新华增怡债券型证券投资基金、新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金、新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金、新华中证环保产业指数证券投资基金、新华活期添利货币市场基金、新华增盈回报债券型证券投资基金、新华策略精选股票型证券投资基金、新华万银多元策略灵

活配置混合型证券投资基金、新华稳健回报灵活配置混合型发起式证券投资基金、新华战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金、新华鑫回报混合型证券投资基金、新华积极价值灵活配置混合型证券投资基金、新华科技创新主题灵活配置混合型证券投资基金、新华增强债券型证券投资基金、新华鑫动力灵活配置混合型证券投资基金、新华丰盈回报债券型证券投资基金、新华双利债券型证券投资基金、新华丰利债券型证券投资基金、新华鑫弘灵活配置混合型证券投资基金、新华外延增长主题灵活配置混合型证券投资基金、新华红利回报混合型证券投资基金、新华鑫泰灵活配置混合型证券投资基金、新华恒益量化灵活配置混合型证券投资基金、新华安享多裕定期开放灵活配置混合型证券投资基金、新华恒稳添利债券型证券投资基金、新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金、新华鑫日享中短债债券型证券投资基金、新华聚利债券型证券投资基金、新华鼎利债券型证券投资基金、新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金联接基金、新华沪深 300 指数增强型证券投资基金、新华安享惠泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金、新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）、新华景气行业混合型证券投资基金、新华安享惠融 88 个月定期开放债券型证券投资基金、新华安康多元收益一年持有期混合型基金中基金、新华利率债债券型证券投资基金、新华行业龙头股票型证券投资基金、新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
邓岳	本基金基金经理，新华中证环保产业指数证券投资基金基金经理、新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、新华沪深 300 指数增强型证券投资基金基金经理。	2018-11-07	-	13	信息与信号处理专业硕士，历任北京红色天时金融科技有限公司量化研究员，国信证券股份有限公司量化研究员，光大富尊投资有限公司量化研究员、投资经理，盈融达投资（北京）有限公司投资经理。
武磊	本基金基金经理，新华 MSCI	2021-01-05	-	6	工商管理硕士，历任中信保诚人寿资产管理中心投资经理助理；曾任

	中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金联接基金经理、新华恒益量化灵活配置混合型证券投资基金基金经理。			职于嘉实基金管理有限公司人工智能研究部,从事智能量化投资策略研究工作。
--	---	--	--	-------------------------------------

注：1、首任基金经理，任职日期指基金合同生效日，离任日期指公司作出决定之日。

2、非首任基金经理，任职日期和离任日期均指公司作出决定之日。

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期末不存在基金经理同时兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期，新华基金管理股份有限公司作为新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金的管理人按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

易对手询价、成交确认，并根据“时间优先、价格优先”的原则保证各投资组合获得公平的交易机会。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

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

基金管理人原则上不允许同日反向交易行为的发生，本报告期内，未发生有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边成交量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金为指数基金，以对标的指数的有效跟踪为投资目标。

2021 年上半年，本基金采用完全复制的被动式指数投资方法，避免不必要的交易，产品紧密跟踪了指数的走势，保持了较小的跟踪误差。报告期内，标的指数发生二次成分股定期调整，本基金根据成份股及其权重的变动，在有效地控制了跟踪误差的情况下，平稳地完成了调整。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 06 月 30 日，本基金份额净值为 1.9076 元，本报告期份额净值增长率为 4.82%，同期比较基准的增长率为 3.45%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

有关参与估值流程各方及人员（或小组）的职责分工：

一、估值工作小组的职责分工

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

估值工作小组职责：

- ① 制定估值制度并在必要时修改；
- ② 确保估值方法符合现行法规；
- ③ 批准证券估值的步骤和方法；
- ④ 对异常情况做出决策。

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

估值决策由估值工作小组 2/3 或以上多数票通过。

二、基金会计的职责分工

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

基金会计职责：

- ① 获得独立、完整的证券价格信息；
- ② 每日证券估值；
- ③ 检查价格波动并进行一般准确性评估；
- ④ 向交易员或基金经理核实价格异常波动，并在必要时向估值工作小组报告；
- ⑤ 对每日证券价格信息和估值结果进行记录；
- ⑥ 对估值调整和人工估值进行记录；
- ⑦ 向估值工作小组报送月度估值报告。

基金会计认为必要，可以提议召开估值工作小组会议。

三、投资管理部门的职责分工

- ① 接受监察稽核部对所投资证券价格异常波动的问讯；
- ② 对停牌证券、价格异常波动证券、退市证券提出估值建议；
- ③ 评价并确认基金会计提供的估值报告；
- ④ 向估值工作小组报告任何他/她认为可能的估值偏差。

四、交易部的职责分工

- ① 对基金会计的证券价格信息需求做出即时回应；

- ② 通知基金会计关于证券停牌、价格突发性异常波动、退市等特定信息；
- ③ 评价并确认基金会计提供的估值报告。

五、监察稽核部的职责分工

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期本基金未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期本基金从 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日连续一百一十八个工作日基金持有人低于 200 人，从 2021 年 04 月 22 日至 2021 年 06 月 30 日连续四十六个工作日基金资产净值低于五千万元。

我司将通过多方面的措施促进本基金的规模增长，具体经营计划如下：

- （一）与主要销售机构合作制定销售计划，以重点地区为主，将公司的资源向重点地区倾斜。
- （二）进一步加强与潜在销售机构的合作，拓宽渠道和客户资源。
- （三）采用新客户开发与老客户深入挖掘并重的客户开发方式。

（四）加强投资者教育，引导投资者充分认识产品的风险收益特点。综上所述，本基金为我司产品线主要组成部分。受市场环境的影响，本基金规模出现缩减。我司将在做好基金日常投资运营的同时，加大持续营销工作投入，同时探索其他方式和手段，尽力提升基金规模。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—新

华基金管理股份有限公司 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为,新华基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体:新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日: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	1,343,843.15	1,393,342.27
结算备付金		22,307.58	33,559.90
存出保证金		4,496.81	13,201.68
交易性金融资产	6.4.7.2	46,624,954.87	62,690,365.87
其中:股票投资		46,624,954.87	62,690,365.87
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-

买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		17,017.45	10,383.67
应收利息	6.4.7.5	259.74	402.82
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		48,012,879.60	64,141,256.21
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		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		19,389.01	27,182.30
应付托管费		3,877.81	5,436.43
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	36,906.91	37,882.17
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	85,396.49	208,701.25
负债合计		145,570.22	279,202.15
所有者权益:		-	-
实收基金	6.4.7.9	25,092,640.00	35,092,640.00
未分配利润	6.4.7.10	22,774,669.38	28,769,414.06
所有者权益合计		47,867,309.38	63,862,054.06
负债和所有者权益总计		48,012,879.60	64,141,256.21

注：报告截止 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.9076 元，基金份额总额 25,092,640.00 份。

6.2 利润表

会计主体：新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：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		2,951,657.75	8,984,972.52

1.利息收入		5,681.97	8,313.09
其中：存款利息收入	6.4.7.11	5,681.97	8,313.09
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		6,196,232.93	10,984,109.74
其中：股票投资收益	6.4.7.12	5,876,245.78	10,425,842.47
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益	6.4.7.17	319,987.15	558,267.27
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-3,298,041.01	-2,185,368.25
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	47,783.86	177,917.94
减：二、费用		288,442.86	485,082.94
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	132,869.11	211,013.47
2. 托管费	6.4.10.2.2	26,573.81	42,202.71
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.20	35,098.26	108,653.45
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.21	93,901.68	123,213.31
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,663,214.89	8,499,889.58
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,663,214.89	8,499,889.58

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：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）	35,092,640.00	28,769,414.06	63,862,054.06

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,663,214.89	2,663,214.89
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）	-10,000,000.00	-8,657,959.57	-18,657,959.57
其中：1.基金申购款	2,000,000.00	1,473,508.89	3,473,508.89
2.基金赎回款	-12,000,000.00	-10,131,468.46	-22,131,468.46
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）	25,092,640.00	22,774,669.38	47,867,309.38
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）	121,092,640.00	36,206,317.83	157,298,957.83
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	8,499,889.58	8,499,889.58
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-84,000,000.00	-28,039,626.83	-112,039,626.83
其中：1.基金申购款	3,000,000.00	1,077,967.54	4,077,967.54
2.基金赎回款	-87,000,000.00	-29,117,594.37	-116,117,594.37
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	37,092,640.00	16,666,580.58	53,759,220.58

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：翟晨曦，主管会计工作负责人：于春玲，会计机构负责人：徐端骞

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）系经中国证券

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

根据《新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》及《新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于国内依法发行上市的非标的指数成份股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、债券回购、银行存款、货币市场工具、同业存单、资产支持证券、权证、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可以在履行适当程序后，参与融资及转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，本基金可将其纳入投资范围，其投资原则及投资比例按法律法规或监管机构的相关规定执行。本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。本基金的业绩比较基准为标的指数收益率。本基金标的指数为 MSCI 中国 A 股国际指数。

本财务报表由本基金的基金管理人新华基金管理股份有限公司于 2021 年 8 月 26 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金编制的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金财务状况、经营

成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

1、印花税

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

2、增值税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》：资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

3、个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[1998]55 号《关于证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2015] 101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定：对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	1,343,843.15
定期存款	-
其他存款	-
合计	1,343,843.15

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	37,605,496.03	46,624,954.87	9,019,458.84
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	37,605,496.03	46,624,954.87	9,019,458.84

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末本基金无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本报告期末本基金无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末本基金无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应收活期存款利息	248.94
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	10.80
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	-
合计	259.74

注：应收结算备付金利息包含结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	36,906.91
银行间市场应付交易费用	-
合计	36,906.91

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	79,343.16
其他应付款	6,053.33
合计	85,396.49

注：其他应付款为指数许可使用费。

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	35,092,640.00	35,092,640.00
本期申购	2,000,000.00	2,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-12,000,000.00	-12,000,000.00
本期末	25,092,640.00	25,092,640.00

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	20,395,024.03	8,374,390.03	28,769,414.06

本期利润	5,961,255.90	-3,298,041.01	2,663,214.89
本期基金份额交易产生的变动数	-6,664,926.80	-1,993,032.77	-8,657,959.57
其中：基金申购款	1,368,767.13	104,741.76	1,473,508.89
基金赎回款	-8,033,693.93	-2,097,774.53	-10,131,468.46
本期已分配利润	-	-	-
本期末	19,691,353.13	3,083,316.25	22,774,669.38

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	5,493.17
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	188.80
其他	-
合计	5,681.97

注：结算备付金利息收入包含结算保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	3,803,354.36
股票投资收益——赎回差价收入	2,072,891.42
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	5,876,245.78

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	17,594,463.74
减：卖出股票成本总额	13,791,109.38
买卖股票差价收入	3,803,354.36

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	22,131,468.46
减：现金支付赎回款总额	9,497,753.46
减：赎回股票成本总额	10,560,823.58
赎回差价收入	2,072,891.42

6.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无申购差价收入。

6.4.7.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期无证券出借差价收入。

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资。

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资。

6.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资。

6.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具投资。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	319,987.15
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	319,987.15

6.4.7.18 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	-3,298,041.01
——股票投资	-3,298,041.01
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	-3,298,041.01

6.4.7.19 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	-
替代收益	47,783.86
合计	47,783.86

注：替代损益是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购日估值的差额。

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	35,098.26
银行间市场交易费用	-
合计	35,098.26

6.4.7.21 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	39,671.58
信息披露费	39,671.58

证券出借违约金	-
汇划手续费	1,154.35
指数使用费	13,404.17
合计	93,901.68

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.0125% 的季费率计提，逐日累计至每个季度季末，按季支付。基金合同生效日所在季度的指数使用费，根据实际天数按比例收取。自基金合同生效之日所在季度的下一个季度起，指数许可使用费的收取下限为每季度 5000 美金。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至 2021 年 6 月 30 日，本基金未发生需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报告签发日，本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内，本基金不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
新华基金管理股份有限公司	基金管理人、基金发起人
中国农业银行股份有限公司	基金托管人
恒泰证券股份有限公司	基金管理人股东

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	成交金额	占当期股票成交总

		额的比例		额的比例
恒泰证券股份有限 公司	696,388.06	2.61%	1,297,058.80	1.72%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内未通过关联交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内未通过关联交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内未通过关联交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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
恒泰证券股份有限公 司	648.51	4.28%	749.88	2.03%
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
恒泰证券股份有限公 司	1,192.04	3.36%	1,257.74	2.65%

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	132,869.11	211,013.47
其中：支付销售机构的客户维护费	437.45	307.24

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

2、客户维护费是指基金管理人与基金销售机构在基金销售协议中约定的依据销售机构销售基金

的保有量提取一定比例的客户维护费，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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托管费	26,573.81	42,202.71

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

6.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期内未发生关联方销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

报告期内，基金管理人未运用自有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期除基金管理人之外的其他关联方未有投资本基金的情况。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 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
中国农业银行股份有限公司	1,343,843.15	5,493.17	5,084,685.95	7,621.91

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期间本基金在承销期内未参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

2021 年 06 月 30 日，本基金持有 74,900.00 股中国农业银行股份有限公司的 A 股普通股，成本额为人民币 253,884.92 元，估值总额为人民币 226,947.00 元，占基金资产净值的比例为 0.47%。

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

本基金本报告期末持有本基金管理人以及管理人关联方所管理基金。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无收益分配事项。

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

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
605287	德才股份	2021-06-28	2021-07-06	网下中签	31.56	31.56	305.00	9,625.80	9,625.80	-

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(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600460	士兰微	2021-06-30	重大事项	56.35	2021-07-01	59.49	1,300.00	23,068.91	73,255.00	-

002024	苏宁易购	2021-06-16	重大事项	5.59	2021-07-06	61.50	9,400.00	94,508.76	52,546.00	-
--------	------	------------	------	------	------------	-------	----------	-----------	-----------	---

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

本基金期末未持有银行间市场债券正回购。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金期末未持有交易所市场债券正回购。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金管理人通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；在银行间同业市场进行的交易通过交易对手库管理控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本报告期末及上年度期末，本基金未持有按短期信用评级的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本报告期末及上年度期末，本基金未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本报告期末及上年度期末，本基金未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本报告期末及上年度期末，本基金未持有按长期信用评级的债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本报告期末及上年度期末，本基金未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本报告期末及上年度期末，本基金未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金采用分散投资、控制流通受限证券比例等方式防范流动性风险。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易。

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大

部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021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	1,343,843.15	-	-	-	1,343,843.15
结算备付金	22,307.58	-	-	-	22,307.58
存出保证金	4,496.81	-	-	-	4,496.81
交易性金融资产	-	-	-	46,624,954.87	46,624,954.87
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	17,017.45	17,017.45
应收利息	-	-	-	259.74	259.74
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,370,647.54	-	-	46,642,232.06	48,012,879.60
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	19,389.01	19,389.01
应付托管费	-	-	-	3,877.81	3,877.81
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	36,906.91	36,906.91
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	85,396.49	85,396.49

负债总计	-	-	-	145,570.22	145,570.22
利率敏感度缺口	1,370,647.54	-	-	46,496,661.84	47,867,309.38
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	1,393,342.27	-	-	-	1,393,342.27
结算备付金	33,559.90	-	-	-	33,559.90
存出保证金	13,201.68	-	-	-	13,201.68
交易性金融资产	-	-	-	62,690,365.87	62,690,365.87
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	10,383.67	10,383.67
应收利息	-	-	-	402.82	402.82
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,440,103.85	-	-	62,701,152.36	64,141,256.21
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	27,182.30	27,182.30
应付托管费	-	-	-	5,436.43	5,436.43
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	37,882.17	37,882.17
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	208,701.25	208,701.25
负债总计	-	-	-	279,202.15	279,202.15
利率敏感度缺口	1,440,103.85	-	-	62,421,950.21	63,862,054.06

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产与负债均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	46,624,954.87	97.40	62,690,365.87	98.17
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	46,624,954.87	97.40	62,690,365.87	98.17

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	其他市场变量不变,沪深 300 指数上升或下降 1%		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额(单位:人民币元)	
		本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	沪深 300 指数上升 1%	480,940.84	642,782.39
	沪深 300 指数下降 1%	-480,940.84	-642,782.39

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	46,624,954.87	97.11
	其中:股票	46,624,954.87	97.11
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,366,150.73	2.85
8	其他各项资产	21,774.00	0.05
9	合计	48,012,879.60	100.00

注:上表中的股票投资项含可退替代款估值增值,而 7.2 的合计项中不含可退替代款估值增值。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	509,253.52	1.06
B	采矿业	1,172,222.85	2.45
C	制造业	27,425,023.75	57.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,064,047.14	2.22
E	建筑业	571,680.00	1.19
F	批发和零售业	607,093.06	1.27
G	交通运输、仓储和邮政业	1,424,460.30	2.98
H	住宿和餐饮业	51,255.00	0.11
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,515,576.68	3.17
J	金融业	8,596,608.95	17.96
K	房地产业	971,329.40	2.03
L	租赁和商务服务业	817,235.00	1.71
M	科学研究和技术服务业	655,539.80	1.37
N	水利、环境和公共设施管理业	49,839.00	0.10
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	48,047.00	0.10
Q	卫生和社会工作	813,020.18	1.70
R	文化、体育和娱乐业	274,691.00	0.57
S	综合	-	-
	合计	46,566,922.63	97.28

7.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-

B	采矿业	-	-
C	制造业	11,386.29	0.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,498.72	0.01
E	建筑业	9,625.80	0.02
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	8,313.60	0.02
J	金融业	25,207.83	0.05
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	58,032.24	0.12

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票投资组合。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	1,300	2,673,710.00	5.59
2	300750	宁德时代	2,300	1,230,040.00	2.57
3	000858	五粮液	3,900	1,161,771.00	2.43

4	600036	招商银行	20,600	1,116,314.00	2.33
5	601318	中国平安	10,800	694,224.00	1.45
6	601888	中国中免	2,000	600,200.00	1.25
7	300760	迈瑞医疗	1,200	576,060.00	1.20
8	600900	长江电力	22,723	469,002.72	0.98
9	601012	隆基股份	5,278	468,897.52	0.98
10	300015	爱尔眼科	6,531	463,570.38	0.97
11	603288	海天味业	3,540	456,483.00	0.95
12	002594	比亚迪	1,800	451,800.00	0.94
13	000001	平安银行	19,400	438,828.00	0.92
14	600276	恒瑞医药	6,427	436,843.19	0.91
15	601166	兴业银行	20,800	427,440.00	0.89
16	600809	山西汾酒	900	403,200.00	0.84
17	603259	药明康德	2,520	394,606.80	0.82
18	000568	泸州老窖	1,500	353,910.00	0.74
19	300059	东方财富	10,376	340,229.04	0.71
20	600309	万华化学	3,100	337,342.00	0.70
21	601398	工商银行	63,000	325,710.00	0.68
22	002475	立讯精密	6,984	321,264.00	0.67
23	002714	牧原股份	5,236	318,453.52	0.67
24	002352	顺丰控股	4,600	311,420.00	0.65
25	002304	洋河股份	1,500	310,800.00	0.65
26	300122	智飞生物	1,600	298,768.00	0.62
27	601919	中远海控	9,700	296,238.00	0.62
28	600000	浦发银行	29,430	294,300.00	0.61
29	603501	韦尔股份	900	289,800.00	0.61
30	600436	片仔癀	600	268,980.00	0.56
31	600030	中信证券	10,700	266,858.00	0.56
32	000333	美的集团	3,500	249,795.00	0.52
33	600031	三一重工	8,500	247,095.00	0.52
34	002142	宁波银行	6,000	233,820.00	0.49
35	000002	万科 A	9,700	230,957.00	0.48
36	601288	农业银行	74,900	226,947.00	0.47
37	600887	伊利股份	6,100	224,663.00	0.47
38	601816	京沪高铁	41,100	217,419.00	0.45
39	000725	京东方 A	34,000	212,160.00	0.44
40	601601	中国太保	6,900	199,893.00	0.42
41	002812	恩捷股份	840	196,644.00	0.41
42	300014	亿纬锂能	1,892	196,635.56	0.41
43	601668	中国建筑	42,200	196,230.00	0.41
44	600438	通威股份	4,500	194,715.00	0.41
45	601328	交通银行	39,500	193,550.00	0.40
46	601899	紫金矿业	19,800	191,862.00	0.40
47	300124	汇川技术	2,550	189,363.00	0.40

48	002493	荣盛石化	10,100	174,427.00	0.36
49	300274	阳光电源	1,500	172,590.00	0.36
50	600104	上汽集团	7,800	171,366.00	0.36
51	600019	宝钢股份	22,400	171,136.00	0.36
52	600585	海螺水泥	4,000	164,200.00	0.34
53	600016	民生银行	37,200	164,052.00	0.34
54	600690	海尔智家	6,300	163,233.00	0.34
55	601818	光大银行	41,600	157,248.00	0.33
56	600346	恒力石化	5,920	155,340.80	0.32
57	300782	卓胜微	288	154,800.00	0.32
58	000661	长春高新	400	154,800.00	0.32
59	300759	康龙化成	700	151,893.00	0.32
60	600905	三峡能源	23,800	151,368.00	0.32
61	000538	云南白药	1,300	150,436.00	0.31
62	002230	科大讯飞	2,200	148,676.00	0.31
63	300433	蓝思科技	5,000	147,050.00	0.31
64	002241	歌尔股份	3,400	145,316.00	0.30
65	600048	保利地产	12,000	144,480.00	0.30
66	600196	复星医药	2,000	144,260.00	0.30
67	600703	三安光电	4,500	144,225.00	0.30
68	600893	航发动力	2,700	143,613.00	0.30
69	300896	爱美客	180	141,998.40	0.30
70	600999	招商证券	7,400	140,748.00	0.29
71	600028	中国石化	32,000	139,520.00	0.29
72	002311	海大集团	1,700	138,720.00	0.29
73	002371	北方华创	500	138,690.00	0.29
74	002027	分众传媒	14,700	138,327.00	0.29
75	601066	中信建投	4,300	135,149.00	0.28
76	601658	邮储银行	26,700	134,034.00	0.28
77	603799	华友钴业	1,168	133,385.60	0.28
78	002460	赣锋锂业	1,100	133,199.00	0.28
79	000063	中兴通讯	3,900	129,597.00	0.27
80	601088	中国神华	6,600	128,832.00	0.27
81	600406	国电南瑞	5,539	128,726.36	0.27
82	601211	国泰君安	7,500	128,550.00	0.27
83	600760	中航沈飞	2,080	125,424.00	0.26
84	600763	通策医疗	300	123,300.00	0.26
85	300413	芒果超媒	1,780	122,108.00	0.26
86	000338	潍柴动力	6,800	121,516.00	0.25
87	601225	陕西煤业	10,000	118,500.00	0.25
88	688111	金山办公	300	118,440.00	0.25
89	000625	长安汽车	4,500	118,260.00	0.25
90	603986	兆易创新	628	118,001.20	0.25
91	601229	上海银行	14,310	117,342.00	0.25

92	601688	华泰证券	7,400	116,920.00	0.24
93	600745	闻泰科技	1,200	116,280.00	0.24
94	002129	中环股份	3,000	115,800.00	0.24
95	601857	中国石油	21,700	114,793.00	0.24
96	603486	科沃斯	500	114,040.00	0.24
97	600660	福耀玻璃	2,000	111,700.00	0.23
98	600837	海通证券	9,700	111,550.00	0.23
99	300999	金龙鱼	1,300	110,448.00	0.23
100	600588	用友网络	3,287	109,325.62	0.23
101	601100	恒立液压	1,272	109,290.24	0.23
102	601988	中国银行	35,300	108,724.00	0.23
103	000100	TCL 科技	14,100	107,865.00	0.23
104	601390	中国中铁	20,500	107,420.00	0.22
105	000166	申万宏源	22,700	106,236.00	0.22
106	601009	南京银行	10,000	105,200.00	0.22
107	600919	江苏银行	14,810	105,151.00	0.22
108	300601	康泰生物	700	104,300.00	0.22
109	300454	深信服	400	103,792.00	0.22
110	601169	北京银行	21,300	103,731.00	0.22
111	600132	重庆啤酒	500	98,975.00	0.21
112	603806	福斯特	940	98,822.20	0.21
113	002709	天赐材料	920	98,053.60	0.20
114	601006	大秦铁路	14,900	98,042.00	0.20
115	600570	恒生电子	1,036	96,607.00	0.20
116	601336	新华保险	2,100	96,411.00	0.20
117	601633	长城汽车	2,200	95,898.00	0.20
118	000596	古井贡酒	400	95,800.00	0.20
119	601155	新城控股	2,300	95,680.00	0.20
120	603659	璞泰来	700	95,620.00	0.20
121	601628	中国人寿	2,800	94,892.00	0.20
122	601989	中国重工	22,900	94,348.00	0.20
123	002466	天齐锂业	1,510	93,650.20	0.20
124	300142	沃森生物	1,500	92,550.00	0.19
125	002049	紫光国微	600	92,514.00	0.19
126	000895	双汇发展	2,900	92,220.00	0.19
127	300498	温氏股份	6,400	91,968.00	0.19
128	603993	洛阳钼业	17,800	91,848.00	0.19
129	002179	中航光电	1,150	90,873.00	0.19
130	601138	工业富联	7,300	90,593.00	0.19
131	000776	广发证券	5,900	89,326.00	0.19
132	688396	华润微	980	89,199.60	0.19
133	600926	杭州银行	5,900	87,025.00	0.18
134	002841	视源股份	700	87,003.00	0.18
135	300595	欧普康视	840	86,982.00	0.18

136	001979	招商蛇口	7,900	86,505.00	0.18
137	002050	三花智控	3,576	85,752.48	0.18
138	600741	华域汽车	3,200	84,064.00	0.18
139	600989	宝丰能源	6,100	83,448.00	0.17
140	000963	华东医药	1,780	81,897.80	0.17
141	600600	青岛啤酒	700	80,955.00	0.17
142	603882	金域医学	500	79,885.00	0.17
143	600015	华夏银行	12,900	79,851.00	0.17
144	300628	亿联网络	950	79,610.00	0.17
145	601901	方正证券	8,300	77,688.00	0.16
146	000799	酒鬼酒	300	76,680.00	0.16
147	300408	三环集团	1,800	76,356.00	0.16
148	603899	晨光文具	900	76,104.00	0.16
149	002601	龙蟠佰利	2,200	76,076.00	0.16
150	002821	凯莱英	200	74,520.00	0.16
151	600111	北方稀土	3,600	74,520.00	0.16
152	600150	中国船舶	4,500	74,295.00	0.16
153	603737	三棵树	420	73,920.00	0.15
154	601985	中国核电	14,600	73,876.00	0.15
155	000768	中航西飞	2,800	73,584.00	0.15
156	601877	正泰电器	2,200	73,436.00	0.15
157	601127	小康股份	1,100	73,337.00	0.15
158	600460	士兰微	1,300	73,255.00	0.15
159	002001	新 和 成	2,540	72,847.20	0.15
160	600010	包钢股份	45,800	70,990.00	0.15
161	300529	健帆生物	820	70,815.20	0.15
162	603369	今世缘	1,300	70,408.00	0.15
163	601600	中国铝业	13,200	69,960.00	0.15
164	601788	光大证券	3,900	69,771.00	0.15
165	600547	山东黄金	3,585	68,903.70	0.14
166	002736	国信证券	6,400	68,800.00	0.14
167	600886	国投电力	7,100	68,231.00	0.14
168	600584	长电科技	1,800	67,824.00	0.14
169	601799	星宇股份	300	67,716.00	0.14
170	300347	泰格医药	350	67,655.00	0.14
171	000301	东方盛虹	3,200	66,880.00	0.14
172	000786	北新建材	1,700	66,725.00	0.14
173	601916	浙商银行	16,800	66,696.00	0.14
174	002568	百润股份	700	66,353.00	0.14
175	000876	新 希 望	4,500	66,015.00	0.14
176	002648	卫星石化	1,680	65,839.20	0.14
177	002007	华兰生物	1,790	65,657.20	0.14
178	300316	晶盛机电	1,300	65,650.00	0.14
179	000157	中联重科	7,100	65,604.00	0.14

180	002064	华峰化学	4,600	65,320.00	0.14
181	600426	华鲁恒升	2,110	65,304.50	0.14
182	603833	欧派家居	460	65,301.60	0.14
183	002600	领益智造	7,100	65,249.00	0.14
184	603160	汇顶科技	500	64,815.00	0.14
185	601377	兴业证券	6,700	64,722.00	0.14
186	002414	高德红外	2,338	64,482.04	0.13
187	603290	斯达半导	200	64,000.00	0.13
188	601939	建设银行	9,600	63,840.00	0.13
189	002236	大华股份	3,011	63,532.10	0.13
190	600779	水井坊	500	63,175.00	0.13
191	688036	传音控股	300	62,850.00	0.13
192	300496	中科创达	400	62,824.00	0.13
193	000938	紫光股份	2,842	62,182.96	0.13
194	600029	南方航空	10,300	62,006.00	0.13
195	600176	中国巨石	3,986	61,822.86	0.13
196	601966	玲珑轮胎	1,400	61,236.00	0.13
197	000069	华侨城 A	8,200	61,008.00	0.13
198	600958	东方证券	6,000	59,940.00	0.13
199	601669	中国电建	15,400	59,598.00	0.12
200	601360	三六零	4,800	58,608.00	0.12
201	002791	坚朗五金	300	58,215.00	0.12
202	600733	北汽蓝谷	4,300	57,964.00	0.12
203	300003	乐普医疗	1,800	57,816.00	0.12
204	600115	中国东航	11,300	57,404.00	0.12
205	600085	同仁堂	1,400	57,190.00	0.12
206	002074	国轩高科	1,300	56,628.00	0.12
207	300033	同花顺	500	56,390.00	0.12
208	300146	汤臣倍健	1,700	55,930.00	0.12
209	601233	桐昆股份	2,300	55,407.00	0.12
210	601995	中金公司	900	55,350.00	0.12
211	002920	德赛西威	500	55,040.00	0.11
212	600845	宝信软件	1,066	54,259.40	0.11
213	600143	金发科技	2,600	54,236.00	0.11
214	600061	国投资本	6,384	54,200.16	0.11
215	002459	晶澳科技	1,100	53,900.00	0.11
216	600183	生益科技	2,300	53,843.00	0.11
217	002938	鹏鼎控股	1,500	53,820.00	0.11
218	603185	上机数控	300	53,685.00	0.11
219	601618	中国中冶	17,900	53,342.00	0.11
220	603444	吉比特	100	53,000.00	0.11
221	002916	深南电路	476	52,897.88	0.11
222	002024	苏宁易购	9,400	52,546.00	0.11
223	601111	中国国航	6,700	52,126.00	0.11

224	300207	欣旺达	1,600	52,096.00	0.11
225	688126	沪硅产业	1,776	51,823.68	0.11
226	600754	锦江酒店	900	51,255.00	0.11
227	601021	春秋航空	900	51,210.00	0.11
228	002555	三七互娱	2,130	51,162.60	0.11
229	601878	浙商证券	3,900	51,012.00	0.11
230	002252	上海莱士	6,800	50,932.00	0.11
231	603345	安井食品	200	50,804.00	0.11
232	603517	绝味食品	600	50,574.00	0.11
233	300661	圣邦股份	200	50,546.00	0.11
234	300223	北京君正	500	50,460.00	0.11
235	000425	徐工机械	7,900	50,323.00	0.11
236	601636	旗滨集团	2,700	50,112.00	0.10
237	688002	睿创微纳	500	49,915.00	0.10
238	688008	澜起科技	800	49,904.00	0.10
239	300285	国瓷材料	1,000	48,750.00	0.10
240	600161	天坛生物	1,420	48,635.00	0.10
241	688005	容百科技	400	48,480.00	0.10
242	002602	世纪华通	7,520	48,278.40	0.10
243	600009	上海机场	1,000	48,130.00	0.10
244	600795	国电电力	19,800	48,114.00	0.10
245	002607	中公教育	2,300	48,047.00	0.10
246	600089	特变电工	3,700	47,545.00	0.10
247	300676	华大基因	400	47,440.00	0.10
248	600332	白云山	1,400	47,390.00	0.10
249	600362	江西铜业	2,100	46,998.00	0.10
250	002624	完美世界	1,950	46,624.50	0.10
251	002508	老板电器	1,000	46,500.00	0.10
252	603816	顾家家居	600	46,368.00	0.10
253	601881	中国银河	4,300	46,354.00	0.10
254	600383	金地集团	4,500	46,080.00	0.10
255	002625	光启技术	2,200	45,782.00	0.10
256	600674	川投能源	3,700	45,621.00	0.10
257	601838	成都银行	3,600	45,504.00	0.10
258	300751	迈为股份	100	45,470.00	0.09
259	601933	永辉超市	9,600	45,408.00	0.09
260	601727	上海电气	10,700	45,368.00	0.09
261	600352	浙江龙盛	3,300	45,342.00	0.09
262	600079	人福医药	1,600	45,232.00	0.09
263	002340	格林美	4,800	44,880.00	0.09
264	603658	安图生物	590	44,704.30	0.09
265	002353	杰瑞股份	1,000	44,700.00	0.09
266	600606	绿地控股	8,200	44,690.00	0.09
267	601872	招商轮船	9,660	44,629.20	0.09

268	002080	中材科技	1,700	44,489.00	0.09
269	000703	恒逸石化	3,720	44,454.00	0.09
270	600018	上港集团	9,300	44,361.00	0.09
271	300144	宋城演艺	2,640	44,352.00	0.09
272	600885	宏发股份	700	43,890.00	0.09
273	601117	中国化学	5,000	43,800.00	0.09
274	300677	英科医疗	350	43,680.00	0.09
275	600298	安琪酵母	800	43,504.00	0.09
276	601865	福莱特	1,100	43,483.00	0.09
277	300558	贝达药业	400	43,296.00	0.09
278	601216	君正集团	8,500	43,265.00	0.09
279	000516	国际医学	2,300	43,263.00	0.09
280	600219	南山铝业	12,000	43,200.00	0.09
281	600862	中航高科	1,400	43,092.00	0.09
282	603233	大参林	840	42,932.40	0.09
283	000825	太钢不锈	5,700	42,693.00	0.09
284	000066	中国长城	2,900	42,340.00	0.09
285	601162	天风证券	8,700	42,282.00	0.09
286	600489	中金黄金	4,900	42,238.00	0.09
287	600315	上海家化	700	42,098.00	0.09
288	300450	先导智能	700	42,098.00	0.09
289	002202	金风科技	3,461	42,085.76	0.09
290	300363	博腾股份	500	42,060.00	0.09
291	002185	华天科技	2,700	41,553.00	0.09
292	000977	浪潮信息	1,472	41,407.36	0.09
293	601689	拓普集团	1,100	41,173.00	0.09
294	000783	长江证券	5,600	40,992.00	0.09
295	688009	中国通号	7,200	40,968.00	0.09
296	603589	口子窖	600	40,614.00	0.08
297	002409	雅克科技	500	40,500.00	0.08
298	000932	华菱钢铁	6,120	40,392.00	0.08
299	601607	上海医药	1,900	40,147.00	0.08
300	600704	物产中大	5,100	40,137.00	0.08
301	300037	新宙邦	400	40,040.00	0.08
302	603605	珀莱雅	200	39,342.00	0.08
303	002013	中航机电	3,900	39,273.00	0.08
304	601696	中银证券	1,900	39,121.00	0.08
305	002690	美亚光电	700	39,032.00	0.08
306	603613	国联股份	390	38,988.30	0.08
307	601990	南京证券	3,700	38,924.00	0.08
308	603456	九洲药业	800	38,864.00	0.08
309	002120	韵达股份	2,870	38,831.10	0.08
310	600188	兖州煤业	2,500	38,400.00	0.08
311	600482	中国动力	2,200	38,324.00	0.08

312	002223	鱼跃医疗	1,000	38,130.00	0.08
313	600109	国金证券	3,000	38,070.00	0.08
314	300699	光威复材	500	37,975.00	0.08
315	601108	财通证券	3,600	37,764.00	0.08
316	002444	巨星科技	1,100	37,488.00	0.08
317	002673	西部证券	4,500	37,125.00	0.08
318	600655	豫园股份	3,200	37,088.00	0.08
319	002157	正邦科技	3,100	37,045.00	0.08
320	000807	云铝股份	3,100	36,890.00	0.08
321	603127	昭衍新药	200	36,750.00	0.08
322	603939	益丰药房	654	36,682.86	0.08
323	002739	万达电影	2,300	36,317.00	0.08
324	000027	深圳能源	3,960	36,313.20	0.08
325	002294	信立泰	1,100	36,190.00	0.08
326	603638	艾迪精密	840	36,010.80	0.08
327	002511	中顺洁柔	1,300	35,815.00	0.07
328	600699	均胜电子	1,400	35,728.00	0.07
329	000830	鲁西化工	1,900	35,587.00	0.07
330	601077	渝农商行	8,900	35,511.00	0.07
331	000050	深天马 A	2,500	35,450.00	0.07
332	002384	东山精密	1,700	35,428.00	0.07
333	002180	纳思达	1,100	35,420.00	0.07
334	002044	美年健康	3,880	35,346.80	0.07
335	000739	普洛药业	1,200	35,280.00	0.07
336	600705	中航资本	9,100	35,217.00	0.07
337	002603	以岭药业	1,200	34,992.00	0.07
338	601319	中国人保	5,900	34,987.00	0.07
339	601699	潞安环能	2,955	34,898.55	0.07
340	300724	捷佳伟创	300	34,803.00	0.07
341	002078	太阳纸业	2,600	34,710.00	0.07
342	000728	国元证券	4,350	34,669.50	0.07
343	002430	杭氧股份	1,000	34,590.00	0.07
344	600068	葛洲坝	4,600	34,454.00	0.07
345	000983	山西焦煤	4,140	34,403.40	0.07
346	300253	卫宁健康	2,100	34,167.00	0.07
347	688006	杭可科技	400	34,000.00	0.07
348	002507	涪陵榨菜	900	33,894.00	0.07
349	002405	四维图新	2,300	33,810.00	0.07
350	603678	火炬电子	500	33,750.00	0.07
351	688099	晶晨股份	300	33,660.00	0.07
352	600872	中炬高新	800	33,616.00	0.07
353	600369	西南证券	6,900	33,603.00	0.07
354	000800	一汽解放	3,100	33,542.00	0.07
355	600486	扬农化工	300	33,531.00	0.07

356	600023	浙能电力	9,100	33,397.00	0.07
357	000723	美锦能源	4,400	33,264.00	0.07
358	601555	东吴证券	3,890	32,442.60	0.07
359	601615	明阳智能	2,000	32,380.00	0.07
360	002372	伟星新材	1,560	32,245.20	0.07
361	600827	百联股份	1,600	32,240.00	0.07
362	603707	健友股份	770	32,147.50	0.07
363	300357	我武生物	500	32,060.00	0.07
364	600233	圆通速递	3,200	32,032.00	0.07
365	002032	苏泊尔	500	31,895.00	0.07
366	600038	中直股份	600	31,644.00	0.07
367	600372	中航电子	1,900	31,445.00	0.07
368	600803	新奥股份	1,900	31,369.00	0.07
369	300251	光线传媒	2,900	31,349.00	0.07
370	002152	广电运通	2,400	31,272.00	0.07
371	002156	通富微电	1,300	31,252.00	0.07
372	600392	盛和资源	1,800	31,248.00	0.07
373	600739	辽宁成大	1,500	31,215.00	0.07
374	600521	华海药业	1,490	31,111.20	0.06
375	600011	华能国际	7,361	31,063.42	0.06
376	002138	顺络电子	800	31,016.00	0.06
377	600522	中天科技	3,100	31,000.00	0.06
378	601058	赛轮轮胎	3,100	30,969.00	0.06
379	300136	信维通信	1,000	30,880.00	0.06
380	603156	养元饮品	1,080	30,866.40	0.06
381	600177	雅戈尔	4,680	30,841.20	0.06
382	600875	东方电气	2,800	30,716.00	0.06
383	002797	第一创业	4,300	30,702.00	0.06
384	000656	金科股份	5,300	30,687.00	0.06
385	000021	深科技	1,600	30,624.00	0.06
386	601198	东兴证券	2,800	30,604.00	0.06
387	603338	浙江鼎力	520	30,518.80	0.06
388	000860	顺鑫农业	720	30,369.60	0.06
389	000547	航天发展	1,600	30,192.00	0.06
390	002030	达安基因	1,420	30,160.80	0.06
391	600039	四川路桥	4,800	30,096.00	0.06
392	600642	申能股份	4,900	30,086.00	0.06
393	000513	丽珠集团	590	29,511.80	0.06
394	603866	桃李面包	940	29,328.00	0.06
395	002385	大北农	4,300	29,240.00	0.06
396	600895	张江高科	1,600	29,232.00	0.06
397	600998	九州通	1,900	29,203.00	0.06
398	002541	鸿路钢构	500	29,175.00	0.06
399	600549	厦门钨业	1,400	29,162.00	0.06

400	002939	长城证券	2,600	28,938.00	0.06
401	603712	七一二	800	28,880.00	0.06
402	600415	小商品城	5,600	28,840.00	0.06
403	000630	铜陵有色	10,600	28,832.00	0.06
404	600516	方大炭素	3,875	28,830.00	0.06
405	002299	圣农发展	1,200	28,656.00	0.06
406	601168	西部矿业	2,400	28,632.00	0.06
407	600536	中国软件	500	28,465.00	0.06
408	002422	科伦药业	1,400	27,930.00	0.06
409	600848	上海临港	1,560	27,924.00	0.06
410	600637	东方明珠	3,400	27,846.00	0.06
411	600390	五矿资本	4,600	27,508.00	0.06
412	002563	森马服饰	2,300	27,485.00	0.06
413	600066	宇通客车	2,200	27,478.00	0.06
414	600487	亨通光电	2,400	27,360.00	0.06
415	002429	兆驰股份	4,500	27,315.00	0.06
416	600380	健康元	1,980	27,185.40	0.06
417	300482	万孚生物	420	27,169.80	0.06
418	603218	日月股份	1,000	27,080.00	0.06
419	300308	中际旭创	700	26,964.00	0.06
420	600316	洪都航空	700	26,936.00	0.06
421	600598	北大荒	1,800	26,928.00	0.06
422	600004	白云机场	2,400	26,832.00	0.06
423	002626	金达威	600	26,820.00	0.06
424	000975	银泰黄金	2,820	26,818.20	0.06
425	002373	千方科技	1,600	26,720.00	0.06
426	600511	国药股份	800	26,448.00	0.06
427	002266	浙富控股	5,300	26,447.00	0.06
428	000709	河钢股份	10,700	26,322.00	0.05
429	002463	沪电股份	1,700	26,299.00	0.05
430	601997	贵阳银行	3,660	26,205.60	0.05
431	600208	新潮中宝	8,600	26,144.00	0.05
432	600909	华安证券	4,680	26,067.60	0.05
433	002926	华西证券	2,700	26,001.00	0.05
434	002242	九阳股份	800	25,992.00	0.05
435	603267	鸿远电子	200	25,584.00	0.05
436	600988	赤峰黄金	1,700	25,483.00	0.05
437	002010	传化智联	3,300	25,443.00	0.05
438	002146	荣盛发展	4,500	25,380.00	0.05
439	000999	华润三九	947	25,332.25	0.05
440	002925	盈趣科技	650	25,291.50	0.05
441	300463	迈克生物	600	25,254.00	0.05
442	601231	环旭电子	1,500	25,215.00	0.05
443	603858	步长制药	1,120	25,188.80	0.05

444	000423	东阿阿胶	700	25,137.00	0.05
445	003035	南网能源	2,500	24,850.00	0.05
446	002958	青农商行	5,800	24,824.00	0.05
447	600271	航天信息	1,900	24,757.00	0.05
448	300115	长盈精密	1,200	24,720.00	0.05
449	601456	国联证券	1,600	24,640.00	0.05
450	002065	东华软件	3,100	24,583.00	0.05
451	600170	上海建工	8,900	24,564.00	0.05
452	002127	南极电商	2,500	24,425.00	0.05
453	601106	中国一重	7,100	24,069.00	0.05
454	002075	沙钢股份	2,200	24,002.00	0.05
455	002456	欧菲光	2,700	23,976.00	0.05
456	600688	上海石化	6,362	23,921.12	0.05
457	600867	通化东宝	2,000	23,880.00	0.05
458	600160	巨化股份	2,700	23,868.00	0.05
459	002500	山西证券	3,550	23,820.50	0.05
460	600977	中国电影	1,900	23,807.00	0.05
461	000750	国海证券	5,600	23,744.00	0.05
462	002212	天融信	1,200	23,724.00	0.05
463	600535	天士力	1,600	23,696.00	0.05
464	600297	广汇汽车	8,200	23,616.00	0.05
465	600801	华新水泥	1,340	23,543.80	0.05
466	000988	华工科技	1,000	23,520.00	0.05
467	600153	建发股份	2,900	23,490.00	0.05
468	600027	华电国际	6,800	23,392.00	0.05
469	300070	碧水源	3,200	23,392.00	0.05
470	601099	太平洋	6,900	23,391.00	0.05
471	600859	王府井	800	23,104.00	0.05
472	002153	石基信息	980	23,039.80	0.05
473	000738	航发控制	1,100	22,913.00	0.05
474	000987	越秀金控	1,800	22,788.00	0.05
475	600166	福田汽车	6,600	22,770.00	0.05
476	600256	广汇能源	6,800	22,644.00	0.05
477	300773	拉卡拉	800	22,584.00	0.05
478	000961	中南建设	3,800	22,496.00	0.05
479	601118	海南橡胶	4,400	22,396.00	0.05
480	601992	金隅集团	8,300	22,327.00	0.05
481	601598	中国外运	4,400	22,220.00	0.05
482	002683	宏大爆破	800	22,216.00	0.05
483	600008	首创环保	7,380	22,213.80	0.05
484	002081	金螳螂	2,800	22,176.00	0.05
485	603027	千禾味业	840	22,083.60	0.05
486	002558	巨人网络	1,659	22,064.70	0.05
487	600497	驰宏锌锗	5,100	21,981.00	0.05

488	002465	海格通信	2,300	21,758.00	0.05
489	300383	光环新网	1,500	21,585.00	0.05
490	600026	中远海能	3,500	21,560.00	0.05
491	002557	洽洽食品	500	21,550.00	0.05
492	002151	北斗星通	500	21,535.00	0.04
493	601179	中国西电	5,200	21,424.00	0.04
494	000671	阳光城	4,100	21,320.00	0.04
495	002019	亿帆医药	1,235	21,303.75	0.04
496	603883	老百姓	400	21,072.00	0.04
497	000686	东北证券	2,491	21,048.95	0.04
498	600737	中粮糖业	2,100	21,021.00	0.04
499	002705	新宝股份	800	21,000.00	0.04
500	000998	隆平高科	1,300	20,852.00	0.04
501	300088	长信科技	2,500	20,650.00	0.04
502	000629	攀钢钒钛	9,000	20,610.00	0.04
503	002506	协鑫集成	5,900	20,532.00	0.04
504	600498	烽火通信	1,100	20,493.00	0.04
505	600340	华夏幸福	3,910	20,488.40	0.04
506	600529	山东药玻	600	20,370.00	0.04
507	600879	航天电子	2,700	20,304.00	0.04
508	000729	燕京啤酒	2,800	20,272.00	0.04
509	600583	海油工程	4,500	20,250.00	0.04
510	000402	金融街	3,000	20,250.00	0.04
511	002727	一心堂	600	19,866.00	0.04
512	300418	昆仑万维	1,200	19,656.00	0.04
513	300296	利亚德	2,500	19,550.00	0.04
514	600201	生物股份	1,100	19,195.00	0.04
515	000540	中天金融	7,000	19,110.00	0.04
516	600100	同方股份	3,100	18,941.00	0.04
517	603000	人民网	1,100	18,909.00	0.04
518	001914	招商积余	1,100	18,898.00	0.04
519	300212	易华录	700	18,837.00	0.04
520	000623	吉林敖东	1,200	18,588.00	0.04
521	600528	中铁工业	2,200	17,820.00	0.04
522	000627	天茂集团	4,900	17,738.00	0.04
523	601128	常熟银行	2,800	17,360.00	0.04
524	601098	中南传媒	1,900	16,758.00	0.04
525	000581	威孚高科	800	16,664.00	0.03
526	002131	利欧股份	7,100	16,614.00	0.03
527	000401	冀东水泥	1,300	16,055.00	0.03
528	002399	海普瑞	1,000	15,930.00	0.03
529	002572	索菲亚	500	12,100.00	0.03

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601528	瑞丰银行	1,619.00	25,207.83	0.05
2	001208	华菱线缆	1,473.00	11,386.29	0.02
3	605287	德才股份	305.00	9,625.80	0.02
4	603171	税友股份	433.00	8,313.60	0.02
5	605011	杭州热电	394.00	3,498.72	0.01

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000333	美的集团	450,796.00	0.71
2	600519	贵州茅台	205,473.00	0.32
3	600905	三峡能源	179,393.00	0.28
4	601816	京沪高铁	171,586.00	0.27
5	000858	五粮液	162,431.00	0.25
6	600809	山西汾酒	146,790.00	0.23
7	002352	顺丰控股	144,648.00	0.23
8	300759	康龙化成	129,495.00	0.20
9	300760	迈瑞医疗	127,596.00	0.20
10	601658	邮储银行	123,941.00	0.19
11	300015	爱尔眼科	121,444.00	0.19
12	601888	中国中免	120,616.00	0.19
13	002594	比亚迪	116,926.00	0.18
14	300750	宁德时代	103,074.00	0.16
15	600436	片仔癀	93,052.00	0.15
16	600989	宝丰能源	90,821.00	0.14
17	300896	爱美客	84,697.00	0.13
18	601963	重庆银行	80,921.76	0.13
19	300059	东方财富	76,341.00	0.12
20	601995	中金公司	74,262.00	0.12

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002415	海康威视	746,353.01	1.17
2	000858	五 粮 液	693,722.00	1.09
3	300750	宁德时代	514,705.00	0.81
4	002594	比亚迪	269,214.00	0.42
5	000001	平安银行	257,046.00	0.40
6	300760	迈瑞医疗	252,579.72	0.40
7	002714	牧原股份	220,951.00	0.35
8	002271	东方雨虹	219,359.00	0.34
9	600519	贵州茅台	214,686.00	0.34
10	300059	东方财富	207,690.00	0.33
11	601766	中国中车	196,626.00	0.31
12	002352	顺丰控股	194,870.00	0.31
13	000568	泸州老窖	194,363.00	0.30
14	002475	立讯精密	192,085.00	0.30
15	300015	爱尔眼科	185,746.00	0.29
16	688981	中芯国际	180,669.44	0.28
17	300122	智飞生物	177,736.00	0.28
18	002304	洋河股份	175,707.00	0.28
19	000002	万 科 A	168,962.00	0.26
20	600050	中国联通	165,822.00	0.26

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	9,673,188.97
卖出股票的收入（成交）总额	17,594,463.74

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”与“卖出股票的收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券投资。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金合同无国债期货投资政策。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 本报告期投资基金情况

7.12.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金投资。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1“招商银行”发行人招商银行股份有限公司，因违规协助无衍生产品交易业务资格的银行发行结构性衍生产品、理财资金池化运作等违规行为，中国银保监会依据《中华人民共和国银行业监督管理

理法》对该行罚款 7170 万元。（银保监罚决字〔2021〕16 号，2021 年 5 月 17 日）

本公司对以上证券的投资决策符合法律法规及公司制度的相关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期末本基金投资的其他前十名证券没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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

7.13.3 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	4,496.81
2	应收证券清算款	17,017.45
3	应收股利	-
4	应收利息	259.74
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	21,774.00

7.13.4 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。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.13.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.13.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值	占基金资产净 值比例(%)	流通受限情 况说明
1	605287	德才股份	9,625.80	0.02	网下新股中 签

7.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
99	253,461.01	22,413,840.00	89.32%	2,678,800.00	10.68%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中国农业银行股份有限公司—新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金联接基金	18,325,700.00	73.03%
2	中信证券股份有限公司	4,075,140.00	16.24%
3	苗惠	600,000.00	2.39%
4	孙楠	490,000.00	1.95%
5	高建隆	300,000.00	1.20%
6	钱中明	148,300.00	0.59%
7	陈鹏	100,000.00	0.40%
8	孙曦	100,000.00	0.40%
9	颜琼端	100,000.00	0.40%
10	段增恩	90,000.00	0.36%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2018 年 11 月 7 日）基金份额总额	280,092,640.00
本报告期期初基金份额总额	35,092,640.00
本报告期基金总申购份额	2,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	12,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	25,092,640.00

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2021 年 4 月 9 日，翟晨曦女士担任本基金基金管理人董事长职务，张宗友先生担任本基金基金管理人联席董事长职务。

2021 年 5 月 26 日，于春玲女士担任本基金基金管理人总经理职务。

2021 年 5 月，中国农业银行总行决定谭敦宇任托管业务部总裁。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内本基金未有涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

自 2021 年 1 月 8 日，本基金投资策略增加存托凭证的投资策略。

10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本报告期本基金未持有基金。

10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

为进一步维护基金持有人利益，促进会计师事务所提供更优质的服务，2021 年 2 月 1 日本基金会计师事务所由瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）变更为致同会计师事务所（特殊普通合伙）。本次变更事项经本基金管理人董事会审议通过，经基金托管人同意，并已向中国证券监督管理委员会及其派出机构报备。

10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人本报告期收到重庆证监局出具的行政监管措施，目前已采取措施改进。

本基金托管人及其高级管理人员未有受稽查或处罚的情况。

10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.8.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
川财证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中银国际证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
新时代证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	3	9,644,472.32	36.21%	1,748.57	11.55%	-
国盛证券	2	4,296,535.32	16.13%	3,141.83	20.75%	-
东方财富证券	2	4,258,346.81	15.99%	3,114.42	20.57%	-

华西证券	1	3,416,349.91	12.83%	3,181.76	21.02%	-
天风证券	1	1,198,011.80	4.50%	876.06	5.79%	-
中泰证券	2	1,149,622.25	4.32%	872.23	5.76%	-
浙商证券	1	1,105,223.00	4.15%	808.22	5.34%	-
恒泰证券	2	696,388.06	2.61%	648.51	4.28%	-
国泰君安	1	315,272.20	1.18%	293.53	1.94%	-
华创证券	2	159,387.22	0.60%	116.56	0.77%	-
国金证券	1	108,119.84	0.41%	100.70	0.67%	-
渤海证券	1	73,678.66	0.28%	53.89	0.36%	-
兴业证券	1	66,928.64	0.25%	62.34	0.41%	-
光大证券	1	65,495.53	0.25%	61.00	0.40%	-
银河证券	1	55,531.55	0.21%	40.62	0.27%	-
安信证券	1	14,956.93	0.06%	10.95	0.07%	-
申万宏源	1	9,503.70	0.04%	8.85	0.06%	-

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

一、交易席位的分配依据

交易席位的分配以券商实力及其所提供的研究支持为基础，主要考察点包括：

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

二、交易席位的选择流程

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

三、交易量的分配

交易量的分配以券商所提供的服务及研究支持为基础，主要考察点包括：

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

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

考核的内容包括上一季度经纪交易执行情况、提供研究报告数量、研究报告质量和及时性、受

邀讲解次数及效果、主动推介次数及效果等。考核结果将作为当期交易量分配的依据，交易量大小和评分高低成正比。

3、交易部负责落实交易量的实际分配工作。

10.8.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		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
川财证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

安信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-

10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	新华基金管理股份有限公司关于调整网上直销汇款交易优惠费率的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2021-01-04
2	新华基金管理股份有限公司新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金基金经理变更公告	证券时报、公司网站、电子信披网站	2021-01-06
3	新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）	公司网站、电子信披网站	2021-01-07
4	新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要	公司网站、电子信披网站	2021-01-07
5	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金修订基金合同及托管协议的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2021-01-08
6	新华基金管理股份有限公司关于调整直销柜台交易优惠费率的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2021-01-08
7	新华基金管理股份有限公司关于调整旗下基金在恒泰证券股份有限公司定期定额投资业务起点金额的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2021-01-16
8	新华基金管理股份有限公司旗下全部基金 2020 年第 4 季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2021-01-21
9	新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	公司网站、电子信披网站	2021-01-21
10	新华基金管理股份有限公司基金改聘会计师事务所公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2021-02-03
11	新华基金管理股份有限公司关于调整旗下基金在天风证券股份有限公司定期定额投资业务起点金额的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2021-02-26
12	新华基金管理股份有限公司旗下全部基金 2020 年年度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2021-03-30
13	新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金 2020 年年度报告	公司网站、电子信披网站	2021-03-30

14	新华基金管理股份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	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2021-03-31
15	新华基金管理股份有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证券报、公司网站、电子信披网站	2021-04-10
16	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加阳光人寿保险股份有限公司为代销机构并开通相关业务及参加网上费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2021-04-16
17	新华基金管理股份有限公司旗下基金 2021 年第 1 季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2021-04-21
18	新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	公司网站、电子信披网站	2021-04-21
19	新华基金管理股份有限公司关于法定代表人变更的公告	中国证券报、公司网站、电子信披网站	2021-05-08
20	新华基金管理股份有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2021-05-27

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
其他	1	20210101-20210630	30,638,700.00	808,800.00	13,121,800.00	18,325,700.00	73.03%
产品特有风险							
<p>1、标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险：标的指数并不能完全代表整个股票市场。标的指数成份股的平均回报率与整个股票市场的平均回报率可能存在偏离。</p> <p>2、标的指数波动的风险：标的指数成份股的价格可能受到政治因素、经济因素、上市公司经营状况、投资者心理和交易制度等各种因素的影响而波动，导致指数波动，从而使基金收益水平发生变化，产生风险。</p> <p>3、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险：作为完全跟踪标的指数表现的指数化投资，ETF 的投资风险主要是基金份额净值增长率与标的指数增长率偏离的风险，以下因素可能使基金投资组合的收益率与标的指数的收益率发生偏离。</p> <p>1) 由于标的指数调整成份股或变更编制方法，使本基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度与跟踪误差；</p> <p>2) 由于标的指数成份股发生配股、增发等行为导致成份股在标的指数中的权重发生变化，使本基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度和跟踪误差；</p>							

- 3) 由于成份股停牌、摘牌或流动性差等原因使本基金无法及时调整投资组合或承担冲击成本而产生跟踪偏离度和跟踪误差;
- 4) 由于基金投资过程中的证券交易成本, 以及基金管理费和托管费的存在, 使基金投资组合与标的指数产生跟踪偏离度和跟踪误差;
- 5) 在本基金指数化投资过程中, 基金管理人的管理能力, 例如跟踪指数的水平、技术手段、买入卖出的时机选择等, 都会对本基金的收益产生影响, 从而影响本基金对标的指数的跟踪程度;
- 6) 其他因素产生的偏离。如因受到最低买入股数的限制, 基金投资组合中个别股票的持有比例与标的指数中该股票的权重可能不完全相同; 因缺乏卖空、对冲机制及其他工具造成的指数跟踪成本较大; 因基金申购与赎回带来的现金变动; 因指数发布机构指数编制错误等, 由此产生跟踪偏离度与跟踪误差。
- 4、标的指数变更的风险: 尽管可能性很小, 但根据基金合同规定, 如出现变更标的指数的情形, 本基金将变更标的指数。基于原标的指数的投资政策将会改变, 投资组合将随之调整, 基金的收益风险特征将与新的标的指数保持一致, 投资者须承担此项调整带来的风险与成本。
- 5、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险: 尽管本基金将通过有效的套利机制使基金份额二级市场交易价格的折溢价控制在一定范围内, 但基金份额在证券交易所的交易价格受诸多因素影响, 存在不同于基金份额净值的情形, 即存在价格折溢价的风险。
- 6、参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险: 中证指数公司计算并通过上海证券交易所发布基金份额参考净值 (IOPV), 供投资人交易、申购、赎回基金份额时参考。IOPV 与实时的基金份额净值可能存在差异, IOPV 计算也可能出现错误。投资人若参考 IOPV 进行投资决策可能导致损失, 需投资人自行承担。
- 7、退市风险: 因本基金不再符合证券交易所上市条件被终止上市, 或被基金份额持有人大会决议提前终止上市, 导致基金份额不能继续进行二级市场交易的风险。
- 8、投资人申购失败的风险: 如果投资者申购时未能提供符合要求的申购对价, 或者基金管理人根据基金合同的规定拒绝投资者的申购申请, 则投资者的申购申请失败。
- 9、投资人赎回失败的风险: 如果投资人提出场内份额赎回申请时持有的符合要求的基金份额不足或未能根据要求准备足额的现金, 或者基金投资组合中不具备足额的符合要求的赎回对价, 或者基金管理人根据基金合同的规定拒绝投资者的场内份额赎回申请, 则投资者的场内份额赎回申请失败。基金管理人可能根据成份股市值规模变化等因素调整最小申购、赎回单位, 由此可能导致投资人按原最小申购、赎回单位申购并持有的基金份额, 可能无法按照新的最小申购、赎回单位全部赎回。
- 10、退补现金替代方式的风险: 本基金“退补现金替代”方式不同于其他现金替代方式, 可能给申购和赎回投资人带来价格的不确定性, 从而间接影响本基金二级市场价格的折溢价水平。极端情况下, 如果使用“退补现金替代”证券的权重增加, 该方式带来的不确定性可能导致本基金二级市场价格折溢价处于相对较高水平。基金管理人不对“时间优先、实时申报”原则的执行效率做出任何承诺和保证, 现金替代退补款的计算以实际成交价格 and 基金招募说明书的约定为准。若因技术系统、通讯联络或其他原因导致基金管理人无法遵循“时间优先、实时申报”原则对“退补现金替代”的证券进行处理, 投资人的利益可能受到影响。
- 11、基金份额赎回对价的变现风险: 本基金赎回对价包括组合证券、现金替代、现金差额等。在组合证券变现过程中, 由于市场变化、部分成份股流动性差等因素, 导致投资人变现后的价值与赎回时赎回对价的价值有差异, 存在变现风险。
- 12、第三方机构服务的风险: 本基金的多项服务委托第三方机构办理, 存在以下风险: 1) 申购赎回代理券商因多种原因, 导致代理申购、赎回业务受到限制、暂停或终止, 由此影响对投资者申购赎回服务的风险。2) 登记机构可能调整结算制度, 如实施货银对付制度, 对投资者基金份额、组合证券及资金的结算方式发生变化, 制度调整可能给投资者带来理解偏差的风险。同样的风险还可能来自于证券交易所及其他代理机构。3) 证券交易所、登记机构、基金托管人、申购赎回代理机

构及其他代理机构可能违约，导致基金或投资者利益受损的风险。

13、投资股指期货的风险：本基金投资于股指期货，因此存在因投资股指期货而带来的风险：1）基差风险：在使用股指期货对冲市场风险的过程中，基金财产可能因为股指期货合约与标的指数价格波动不一致而遭受基差风险。2）系统性风险：组合现货的 β 可能不足或者过高，组合风险敞口过大，股指期货空头头寸不能完全对冲现货的风险，组合存在系统性暴露的风险。3）保证金风险：产品的期货头寸，如果未预留足够现金，在市场出现极端情况时，可能遭遇保证金不足而被强制平仓的风险。4）合约展期风险：组合持有的主力合约交割日临近，需要更换合约进行展期，如果合约的基差不利或流动性不足，展期会面临风险。

14、基金收益分配后基金份额净值低于面值的风险：基金收益分配数额的确定原则为：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。

15、基金参与融资与转融通业务的风险：本基金可根据法律法规和基金合同的约定参与融资及转融通业务，可能存在杠杆投资风险和对手方交易风险等融资及转融通业务特有风险。

16、基金参与存托凭证投资的风险

本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与中国存托凭证发行机制相关的风险，包括存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险；存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险；存托协议自动约束存托凭证持有人的风险；因多地上市造成存托凭证价格差异以及波动的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；存托凭证退市的风险；已在境外上市的基础证券发行人，在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险；境内外法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

（一）中国证监会批准新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金基金募集的文件

（二）关于申请募集新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金之法律意见书

（三）新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金托管协议

（四）新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金基金合同

（五）新华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则

（六）《新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》（更新）

（七）《新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金产品资料概要》（更新）

（八）基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

(九) 基金托管人业务资格批件及营业执照

(十) 中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

12.3 查阅方式

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

新华基金管理股份有限公司

二〇二一年八月二十七日