

# MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金 2021 年中期报告

2021 年 06 月 30 日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 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.....	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介.....	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
§4 管理人报告.....	7
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	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.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	11
§5 托管人报告.....	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	12
§6 中期财务会计报告（未经审计）.....	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
§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.....	54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	56
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.....	56
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.....	56
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.....	57
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.....	57
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	57

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	57
7.12 投资组合报告附注 .....	57
§8 基金份额持有人信息 .....	59
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	59
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	59
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	59
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	60
§9 开放式基金份额变动 .....	60
§10 重大事件揭示 .....	60
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	60
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 .....	60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	60
10.4 基金投资策略的改变 .....	61
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	61
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 .....	61
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	61
10.8 其他重大事件 .....	62
§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....	64
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 .....	64
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	64
§12 备查文件目录 .....	64
12.1 备查文件目录 .....	64
12.2 存放地点 .....	64
12.3 查阅方式 .....	64

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	MSCI 中国 A 股国际通 ETF
场内简称	MSCI 基金（MSCI 中国 A 股 ETF）
基金主代码	512160
交易代码	512160
基金运作方式	交易型开放式（ETF）
基金合同生效日	2018 年 4 月 3 日
基金管理人	南方基金管理股份有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	367,777,775.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2018 年 4 月 27 日

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 基金”或“MSCI 中国 A 股 ETF”。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为被动式指数基金，采用完全复制法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。 当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数收益率。本基金标的指数为 MSCI China A Inclusion RMB Index（MSCI 中国 A 股国际通指数）及其未来可能发生的变更。
风险收益特征	本基金属股票型基金，一般而言，其风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称	南方基金管理股份有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	常克川
	联系电话	0755-82763888
	电子邮箱	manager@southernfund.com
客户服务电话	400-889-8899	95566
传真	0755-82763889	010-66594942
注册地址	深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	北京西城区复兴门内大街 1 号
办公地址	深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	北京西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	518017	100818
法定代表人	杨小松（代为履行法定代表人职责）	刘连舸

因南方基金管理股份有限公司（以下简称“公司”）董事长缺位，根据相关法律法规和公司章程，公司董事会决定由公司总经理杨小松先生代为履行公司董事长职务（包括代为履行公司法定代表人职责以及法定、公司章程和制度规定的公司董事长其他各项职责）。该决定自 2021 年 2 月 19 日起生效。

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

## 2.5 其他相关资料

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

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021 年 1 月 1 日 - 2021 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	85,478,137.69
本期利润	34,678,249.28

加权平均基金份额本期利润	0.0824
本期加权平均净值利润率	4.83%
本期基金份额净值增长率	5.80%
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	281,952,334.85
期末可供分配基金份额利润	0.7666
期末基金资产净值	649,730,109.85
期末基金份额净值	1.7666
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	76.66%

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

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

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

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.48%	0.85%	-0.55%	0.84%	1.03%	0.01%
过去三个月	8.94%	0.98%	6.84%	0.98%	2.10%	0.00%
过去六个月	5.80%	1.33%	3.38%	1.32%	2.42%	0.01%
过去一年	39.22%	1.33%	28.40%	1.33%	10.82%	0.00%
过去三年	87.48%	1.36%	59.85%	1.36%	27.63%	0.00%
自基金合同生效起至今	76.66%	1.34%	42.96%	1.34%	33.70%	0.00%

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

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



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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



截至本报告期末，南方基金管理股份有限公司（不含子公司）管理资产规模超过 1.4 万亿元，旗下管理 245 只开放式基金，多个全国社保、基本养老保险、企业年金、职业年金和专户组合。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
罗文杰	本基金基金经理	2018 年 4 月 3 日	-	16 年	女，美国南加州大学数学金融硕士、美国加州大学计算机科学硕士，具有基金从业资格。曾任职于摩根士丹利投资银行，从事量化分析工作。2008 年 9 月加入南方基金，曾任南方基金数量化投资部基金经理助理；现任指数投资部总经理。2013 年 5 月 17 日至 2015 年 6 月 16 日，任南方策略基金经理；2017 年 11 月 9 日至 2019 年 1 月 18 日，任南方策略、南方量化混合基金经理；2016 年 12 月 30 日至 2019 年 4 月 18 日，任南方安享绝对收益、南方卓享绝对收益基金经理；2018 年 2 月 8 日至 2020 年 3 月 27 日，任 H 股 ETF 基金经理；2018 年 2 月 12 日至 2020 年 3 月 27 日，任南方 H 股联接基金经理；2014 年 10 月 30 日至 2020 年 12 月 23 日，任 500 医药基金经理；2013 年 4 月 22 日至今，任南方 500、南方 500ETF 基金经理；2013 年 5 月 17 日至今，任南方 300、南方 300 联接基金经理；2015 年 2 月 16 日至今，任南方恒生 ETF 基金经理；2017 年 7 月 21 日至今，任恒生联接基金经理；2017 年 8 月 24 日至今，任南方房地产联接基金经理；2017 年 8 月 25 日至今，任南方房地产 ETF 基金经理；2018 年 4 月 3 日至今，任 MSCI 基金基金经理；2018 年 6 月 8 日至今，任 MSCI 联接基金经理；2020 年 7 月 24 日至今，兼任投资经理；2020 年 12 月 25 日至今，任南方策略基金经理；2021 年 3 月 12 日至今，任南方中证创新药产业 ETF 基金经理。

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

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

#### 4.1.3 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

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
罗文杰	公募基金	12	54,794,261,094.86	2013年4月22日
	私募资产管理计划	8	3,072,317,026.41	2020年8月7日
	其他组合	-	-	-
	合计	20	57,866,578,121.27	-

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价，未出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况。

#### 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

报告期内, MSCI 国际通指数涨 3.38%。期间我们通过自建的“指数化交易系统”、“日内择时交易模型”、“跟踪误差归因分析系统”、“ETF 现金流精算系统”等, 将本基金的跟踪误差指标控制在较好水平, 并通过严格的风险管理流程, 确保了本基金的安全运作。

我们对本基金报告期内跟踪误差归因分析如下:

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

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

(3) 股指期货和现货之间的基差波动带来的本基金与基准的偏离;

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

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末, 本基金份额净值为 1.7666 元, 报告期内, 份额净值增长率为 5.80%, 同期业绩基准增长率为 3.38%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年疫情影响逐渐消退, 全球经济继续恢复, 上市公司企业盈利高速增长。展望下半年, 通胀预期或减弱, 流动性将继续相对宽松, 中国经济增速在强势反弹后, 预期仍增长, 大中华地区权益市场仍具长期配置价值。

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

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定, 本基金管理人应严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定, 对基金所持有的投资品种进行估值。本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度, 明确基金估值的程序和技术; 建立了估值委员会, 组成人员包括副总经理、督察长、权益研究部总经理、指数投资部总经理、现金投资部总经理、风险管理部总经理及运作保障部总经理等。本基金管理人使用

可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在 0.25%以上的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况，本报告期本基金未有分配事项。

#### 4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

## § 6 中期财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金  
报告截止日：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	6.4.4.1	1,668,584.06	12,955,501.89
结算备付金		1,742,380.20	2,168,562.02
存出保证金		471,558.94	1,425,371.15
交易性金融资产	6.4.4.2	647,101,386.61	846,653,210.11
其中：股票投资		646,752,986.61	844,745,210.11
基金投资		-	-
债券投资		348,400.00	1,908,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.4.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.4.4	-	-
应收证券清算款		62,443.40	13,415,836.64
应收利息	6.4.4.5	722.42	1,388.70
应收股利		-	-

应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.4.6	-	-
资产总计		651,047,075.63	876,619,870.51
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	6.4.4.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1,609.66	3,118,855.29
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		266,093.35	556,202.25
应付托管费		53,218.68	111,240.47
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.4.7	17,962.83	58,758.66
应交税费		0.35	4,081.35
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.4.8	978,080.91	21,546,692.79
负债合计		1,316,965.78	25,395,830.81
所有者权益：			
实收基金	6.4.4.9	367,777,775.00	509,777,775.00
未分配利润	6.4.4.10	281,952,334.85	341,446,264.70
所有者权益合计		649,730,109.85	851,224,039.70
负债和所有者权益总计		651,047,075.63	876,619,870.51

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.7666 元，基金份额总额 367,777,775.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：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		37,670,707.79	44,221,642.97
1. 利息收入		23,731.29	35,429.60
其中：存款利息收入	6.4.4.11	23,309.58	35,369.83
债券利息收入		421.71	59.77
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		86,906,983.01	49,401,361.39
其中：股票投资收益	6.4.4.12	81,375,224.68	44,414,766.93
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.4.13	280,586.75	120,632.62
资产支持证券投资	6.4.4.14	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.4.15	-	-
衍生工具收益	6.4.4.16	751,354.76	1,036,330.10
股利收益	6.4.4.17	4,499,816.82	3,829,631.74
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.4.18	-50,799,888.41	-4,640,933.32
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.4.19	1,539,881.90	-574,214.70
减：二、费用		2,992,458.51	2,392,112.13
1. 管理人报酬	6.4.7.2.1	1,791,497.21	1,411,318.66

2. 托管费	6. 4. 7. 2. 2	358, 299. 46	282, 263. 76
3. 销售服务费	6. 4. 7. 2. 3	-	-
4. 交易费用	6. 4. 4. 20	547, 565. 02	451, 821. 14
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		3, 336. 32	3, 730. 99
7. 其他费用	6. 4. 4. 21	291, 760. 50	242, 977. 58
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		34, 678, 249. 28	41, 829, 530. 84
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		34, 678, 249. 28	41, 829, 530. 84

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：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）	509, 777, 775. 00	341, 446, 264. 70	851, 224, 039. 70
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	34, 678, 249. 28	34, 678, 249. 28
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）	-142, 000, 000. 00	-94, 172, 179. 13	-236, 172, 179. 13
其中：1. 基金申购款	224, 000, 000. 00	165, 660, 396. 37	389, 660, 396. 37
2. 基金赎回款	-366, 000, 000. 00	-259, 832, 575. 50	-625, 832, 575. 50
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）	367,777,775.00	281,952,334.85	649,730,109.85
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）	605,777,775.00	99,988,185.99	705,765,960.99
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	41,829,530.84	41,829,530.84
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-208,000,000.00	-34,847,754.54	-242,847,754.54
其中：1. 基金申购款	314,000,000.00	45,051,576.86	359,051,576.86
2. 基金赎回款	-522,000,000.00	-79,899,331.40	-601,899,331.40
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	397,777,775.00	106,969,962.29	504,747,737.29

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策，会计估计与最近一期年度报告相一致。

##### 6.4.2.1 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

#### 6.4.3 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.3.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.3.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.3.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.4 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.4.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	1,668,584.06
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	1,668,584.06

##### 6.4.4.2 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	588,031,451.41	646,752,986.61	58,721,535.20
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券   交易所市场	348,400.00	348,400.00	-

	银行间市场	-	-	-
	合计	348,400.00	348,400.00	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		588,379,851.41	647,101,386.61	58,721,535.20

注：于 2021 年 06 月 30 日，股票投资的公允价值和公允价值变动包含的可退替代款的估值增值为 0.00 元(2020 年 12 月 31 日：0.00 元)。

#### 6.4.4.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	1,506,900.00	-	-	-
一指期货	1,506,900.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	1,506,900.00	-	-	-

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。于 2021 年 06 月 30 日，本基金持有的股指期货合约情况如下：

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IF2109	IF2109	1.00	1,549,920.00	43,020.00
总额合计	-	1.00	1,549,920.00	43,020.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	43,020.00
股指期货投资净额	-	-	-	-

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

#### 6.4.4.4 买入返售金融资产

##### 6.4.4.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产。

##### 6.4.4.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.4.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	117.59
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	464.00
应收债券利息	25.18
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	115.65
合计	722.42

#### 6.4.4.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.4.4.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	17,962.83
银行间市场应付交易费用	-
合计	17,962.83

#### 6.4.4.8 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	-
应退替代款	444,729.14
预提费用	104,138.35
应付指数使用费	426,083.02
可退替代款	3,130.40
其他	-
合计	978,080.91

注：1. 可退替代款指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，替代价格与该替代证券市价之差乘以替代数量的金额。

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

#### 6.4.4.9 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	509,777,775.00	509,777,775.00
本期申购	224,000,000.00	224,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-366,000,000.00	-366,000,000.00
基金拆分/份额折算前	-	-
基金份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	367,777,775.00	367,777,775.00

#### 6.4.4.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	317,832,619.37	23,613,645.33	341,446,264.70
本期利润	85,478,137.69	-50,799,888.41	34,678,249.28
本期基金份额交易产生的变动数	-104,668,312.60	10,496,133.47	-94,172,179.13
其中：基金申购款	159,115,942.04	6,544,454.33	165,660,396.37
基金赎回款	-263,784,254.64	3,951,679.14	-259,832,575.50
本期已分配利润	-	-	-
本期末	298,642,444.46	-16,690,109.61	281,952,334.85

#### 6.4.4.11 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	5,482.43
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	15,537.98
其他	2,289.17
合计	23,309.58

#### 6.4.4.12 股票投资收益

##### 6.4.4.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 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	48,142,527.71
股票投资收益——赎回差价收入	33,232,696.97
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	81,375,224.68

#### 6.4.4.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	390,587,810.15
减：卖出股票成本总额	342,445,282.44
买卖股票差价收入	48,142,527.71

#### 6.4.4.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	625,832,575.50
减：现金支付赎回款总额	260,280,684.50
减：赎回股票成本总额	332,319,194.03
赎回差价收入	33,232,696.97

#### 6.4.4.12.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无股票申购差价收入。

#### 6.4.4.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无证券出借差价收入。

### 6.4.4.13 债券投资收益

#### 6.4.4.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 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	280,586.75
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	280,586.75

#### 6.4.4.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 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	4,680,934.82

减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	4,399,800.00
减：应收利息总额	548.07
买卖债券差价收入	280,586.75

#### 6.4.4.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

#### 6.4.4.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券申购差价收入。

#### 6.4.4.14 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.4.15 贵金属投资收益

##### 6.4.4.15.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

##### 6.4.4.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

##### 6.4.4.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无贵金属赎回差价收入。

##### 6.4.4.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无贵金属申购差价收入。

#### 6.4.4.16 衍生工具收益

##### 6.4.4.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具买卖权证差价收入。

##### 6.4.4.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股指期货-投资收益	751,354.76

#### 6.4.4.17 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	4,499,816.82
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	4,499,816.82

#### 6.4.4.18 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	-50,568,016.41
——股票投资	-50,568,016.41
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-231,872.00
——权证投资	-
——期货投资	-231,872.00
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-50,799,888.41

注：本基金本期公允价值变动损益-股票投资中包括可退替代款产生的公允价值变动损益为 0.00 元(2020 上半年度：0.00 元)。

#### 6.4.4.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	1,539,881.90
合计	1,539,881.90

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

#### 6.4.4.20 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	547,565.02
银行间市场交易费用	-
合计	547,565.02

#### 6.4.4.21 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	44,630.98
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
指数使用费	180,753.29
银行费用	6,868.86
合计	291,760.50

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% 的季度费率计提，逐日累计，按季支付。标的指数许可使用费的收取下限为每季度美元 5,000 元。计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。

## 6.4.5 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 6.4.5.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

### 6.4.5.2 资产负债表日后事项

无。

## 6.4.6 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.4.6.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.7.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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
华泰证券	29,214,314.58	4.15%	46,595,629.84	8.81%

#### 6.4.7.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 6.4.7.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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
华泰证券	2,921.61	4.15%	1,881.10	10.47%
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
华泰证券	4,660.16	8.81%	1,557.66	7.97%

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算。

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

#### 6.4.7.2 关联方报酬

##### 6.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 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	1,791,497.21	1,411,318.66
其中：支付销售机构的客户维护费	14,880.04	0.00

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

##### 6.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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	358,299.46	282,263.76

管费		
----	--	--

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

#### 6.4.7.2.3 销售服务费

无。

#### 6.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

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

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

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

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

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

#### 6.4.7.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.7.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	124,723,100.00	33.91%	273,193,100.00	53.59%
华泰证券股份有限公司	1,446,789.00	0.39%	3,944,089.00	0.77%

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

## 6.4.7.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 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
中国银行	1,668,584.06	5,482.43	3,491,963.39	11,749.74

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

## 6.4.7.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

单位：人民币元

本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
华泰联合证券	113050	南银转债	优先配售	2,920	292,000.00
兴业证券	605086	龙高股份	网下申购	443	5,696.98
华泰联合证券	605208	永茂泰	网下申购	801	10,733.40
兴业证券	605298	必得科技	网下申购	391	6,252.09
华泰联合证券	605389	长龄液压	网下申购	356	14,026.40
华泰联合证券	605499	东鹏饮料	网下申购	632	29,242.64
华泰联合证券	688083	中望软件	网下申购	1,837	276,468.50
华泰联合证券	688097	博众精工	网下申购	3,983	44,888.41
华泰联合证券	688161	威高骨科	网下申购	3,069	111,159.18
兴业证券	688195	腾景科技	网下申购	2,693	36,624.80
华泰联合证券	688260	昀冢科技	网下申购	2,990	28,793.70
华泰联合证券	688314	康拓医疗	网下申购	1,085	18,813.90
华泰联合证券	688350	富淼科技	网下申购	2,552	34,656.16
兴业证券	688597	煜邦电力	网下申购	3,907	22,973.16
华泰联合证券	688613	奥精医疗	网下申购	2,617	42,997.31
华泰联合证券	688633	星球石墨	网下申购	1,558	52,379.96
兴业证券	688639	华恒生物	网下申购	2,302	53,314.32

兴业证券	300941	创识科技	网下申购	3,989	85,005.59
华泰联合证 券	300975	商络电子	网下申购	4,917	26,945.16
兴业证券	300979	华利集团	网下申购	8,136	270,277.92

上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
华泰联合证 券	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-

#### 6.4.7.8 其他关联交易事项的说明

于 2021 年 06 月 30 日，本基金持有关联方兴业证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司发行的普通股，成本总额为人民币 2,850,257.71 元，估值总额为人民币 2,630,091.00 元，占本基金基金资产净值的比例为 0.40%（于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有关联方兴业证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司发行的普通股，成本总额为人民币 4,138,831.55 元，估值总额为人民币 3,894,115.08 元，占本基金基金资产净值的比例为 0.46%）。

#### 6.4.8 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.9 期末（2021 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认 购日	可流通 日	流通受 限类型	认购 价格	期末 估值 单价	数量（单 位：股）	期末成本 总额	期末估值 总额	备注
300614	百川畅银	2021 年 5 月 18 日	2021 年 11 月 25 日	创业板 新股锁 定期	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300930	屹通新材	2021 年 1 月 13 日	2021 年 7 月 21 日	创业板 新股锁 定期	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-
300933	中辰股份	2021 年 1 月 15 日	2021 年 7 月 22 日	创业板 新股锁 定期	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
300937	药易购	2021 年	2021 年	创业板	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-

		1月20日	7月27日	新股锁定期						
300941	创识科技	2021年2月2日	2021年8月9日	创业板新股锁定期	21.31	49.94	399	8,502.69	19,926.06	-
300942	易瑞生物	2021年2月2日	2021年8月9日	创业板新股锁定期	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300943	春晖智控	2021年2月3日	2021年8月10日	创业板新股锁定期	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300945	曼卡龙	2021年2月3日	2021年8月10日	创业板新股锁定期	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中生态	2021年6月4日	2021年8月25日	锁定期转增	-	27.42	108	-	2,961.36	-
300948	冠中生态	2021年2月18日	2021年8月25日	创业板新股锁定期	13.00	27.42	216	2,808.00	5,922.72	-
300955	嘉亨家化	2021年3月16日	2021年9月24日	创业板新股锁定期	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300958	建工修复	2021年3月18日	2021年9月29日	创业板新股锁定期	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300960	通业科技	2021年3月22日	2021年9月29日	创业板新股锁定期	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
300961	深水海纳	2021年3月23日	2021年9月30日	创业板新股锁定期	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300962	中金辐照	2021年3月29日	2021年10月11日	创业板新股锁定期	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300966	共同药业	2021年3月31日	2021年10月11日	创业板新股锁定期	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300975	商络电子	2021年4月14日	2021年10月21日	创业板新股锁定期	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300978	东箭科技	2021年4月15日	2021年10月26日	创业板新股锁定期	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-

300979	华利集团	2021 年 4 月 15 日	2021 年 10 月 26 日	创业板 新股锁 定期	33.22	87.50	814	27,041.08	71,225.00	-
300981	中红医疗	2021 年 4 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	创业板 新股锁 定期	48.59	90.39	511	24,829.49	46,189.29	-
300982	苏文电能	2021 年 4 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	创业板 新股锁 定期	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300985	致远新能	2021 年 4 月 21 日	2021 年 10 月 29 日	创业板 新股锁 定期	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	-
300987	川网传媒	2021 年 4 月 28 日	2021 年 11 月 11 日	创业板 新股锁 定期	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300992	泰福泵业	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 25 日	创业板 新股锁 定期	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
300993	玉马遮阳	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 24 日	创业板 新股锁 定期	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-
300995	奇德新材	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 26 日	创业板 新股锁 定期	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
300996	普联软件	2021 年 5 月 26 日	2021 年 12 月 3 日	创业板 新股锁 定期	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-
300997	欢乐家	2021 年 5 月 26 日	2021 年 12 月 2 日	创业板 新股锁 定期	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
300998	宁波方正	2021 年 5 月 25 日	2021 年 12 月 2 日	创业板 新股锁 定期	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301002	崧盛股份	2021 年 5 月 27 日	2021 年 12 月 7 日	创业板 新股锁 定期	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
301007	德迈仕	2021 年 6 月 4 日	2021 年 12 月 16 日	创业板 新股锁 定期	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
301009	可靠股份	2021 年 6 月 8 日	2021 年 12 月 17 日	创业板 新股锁 定期	12.54	27.89	801	10,044.54	22,339.89	-
301010	晶雪节能	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 20 日	创业板 新股锁	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-

		日	日	定期						
301011	华立科技	2021年 6月9 日	2021年 12月17 日	创业板 新股锁 定期	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
301012	扬电科技	2021年 6月15 日	2021年 12月22 日	创业板 新股锁 定期	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
301013	利和兴	2021年 6月21 日	2021年 12月29 日	创业板 新股锁 定期	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81	-
301015	百洋医药	2021年 6月22 日	2021年 12月30 日	创业板 新股锁 定期	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
301020	密封科技	2021年 6月28 日	2021年 7月6 日	新股未 上市	10.64	10.64	4,210	44,794.40	44,794.40	-
301021	英诺激光	2021年 6月28 日	2021年 7月6 日	新股未 上市	9.46	9.46	2,899	27,424.54	27,424.54	-
605162	新中港	2021年 6月29 日	2021年 7月7 日	新股未 上市	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
605287	德才股份	2021年 6月28 日	2021年 7月6 日	新股未 上市	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
688067	爱威科技	2021年 6月7 日	2021年 12月16 日	科创板 新股锁 定期	14.71	24.83	1,259	18,519.89	31,260.97	-
688087	英科再生	2021年 6月30 日	2021年 7月9 日	新股未 上市	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
688226	威腾电气	2021年 6月28 日	2021年 7月7 日	新股未 上市	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
688239	航宇科技	2021年 6月25 日	2021年 7月5 日	新股未 上市	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48	-
688315	诺禾致源	2021年 4月2 日	2021年 10月13 日	科创板 新股锁 定期	12.76	39.20	3,711	47,352.36	145,471.20	-
688425	铁建重工	2021年 6月11 日	2021年 12月22 日	科创板 新股锁 定期	2.87	4.75	85,150	244,380.50	404,462.50	-
688565	力源科技	2021年	2021年	科创板	9.39	14.00	2,464	23,136.96	34,496.00	-



		5月6日	11月15日	新股锁定期						
688601	力芯微	2021年6月18日	2021年12月28日	科创板新股锁定期	36.48	133.69	1,174	42,827.52	156,952.06	-
688625	呈和科技	2021年5月31日	2021年12月7日	科创板新股锁定期	16.48	42.63	2,672	44,034.56	113,907.36	-
300919	中伟股份	2020年12月15日	2021年7月2日	创业板新股锁定期	24.60	163.00	610	15,006.00	99,430.00	-

## 6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
127037	银轮转债	2021年6月10日	2021年7月9日	新债未上市	100.00	100.00	10	1,000.00	1,000.00	-
127038	国微转债	2021年6月10日	2021年7月14日	配债未上市	200.00	100.00	220	22,000.00	22,000.00	-
113049	长汽转债	2021年6月11日	2021年7月8日	配债未上市	100.00	100.00	190	19,000.00	19,000.00	-
113050	南银转债	2021年6月16日	2021年7月1日	配债未上市	100.00	100.00	2,920	292,000.00	292,000.00	-
123117	健帆转债	2021年6月23日	2021年7月12日	配债未上市	200.00	100.00	144	14,400.00	14,400.00	-

1、根据中国证监会《上市公司证券发行管理办法》、《创业板上市公司证券发行管理暂行办法》以及《上市公司非公开发行股票实施细则》，本基金作为特定投资者所认购的2020年2月14日前发行完毕的非公开发行股份，自发行结束之日起12个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金持有的上市公司非公开发行股份，采取集中竞价交易方式的，在任意连续90日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的1%，且自股份解除限售之日起12个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过本基金持有该次非公开发行股份数量的50%；采取大宗交易方式的，在任意连续90日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的2%。本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后6个月内，不得转让所受让的股份。

根据中国证监会《关于修改〈上市公司证券发行管理办法〉的决定》、《关于修改〈创业板上市公司证券发行管理暂行办法〉的决定》以及《关于修改〈上市公司非公开发行股票实施细则〉的决定》，本基金所认购的 2020 年 2 月 14 日(含)后发行完毕的非公开发行股份，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。此外，本基金减持上述非公开发行股份不适用《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》的有关规定。

2、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

3、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

4、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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	134,800	1,144,090.45	753,532.00	-
600460	士兰微	2021年6月30日	重大事项停牌	56.35	2021年7月1日	59.49	19,000	418,958.11	1,070,650.00	-

本基金截至 2021 年 06 月 30 日持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

#### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

#### 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.9.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

### 6.4.10 金融工具风险及管理

#### 6.4.10.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

#### 6.4.10.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金

在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于 2021 年 06 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.05% (2020 年 12 月 31 日：0.22%)。

### 6.4.10.3 流动性风险

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

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

于 2021 年 06 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息。本基金赎回基金份额采用一篮子股票形式，流动性风险相对较低。

#### 6.4.10.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注“期末本基金持有的流通受限证券”。此外，如根据基金合同的规定，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

同时，基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 6.4.10.4 市场风险

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

##### 6.4.10.4.1 利率风险

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

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

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金和债券投资等。

##### 6.4.10.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	1,668,584.06	-	-	-	1,668,584.06
结算备付金	1,742,380.20	-	-	-	1,742,380.20
存出保证金	285,568.54	-	-	185,990.40	471,558.94
交易性金融资产	-	-	348,400.00	646,752,986.61	647,101,386.61
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	722.42	722.42
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-

应收证券清算款	-	-	-	62,443.40	62,443.40
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	3,696,532.80	-	348,400.00	647,002,142.83	651,047,075.63
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	266,093.35	266,093.35
应付托管费	-	-	-	53,218.68	53,218.68
应付证券清算款	-	-	-	1,609.66	1,609.66
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	17,962.83	17,962.83
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	0.35	0.35
其他负债	-	-	-	978,080.91	978,080.91
负债总计	-	-	-	1,316,965.78	1,316,965.78
利率敏感度缺口	3,696,532.80	-	348,400.00	645,685,177.05	649,730,109.85
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	12,955,501.89	-	-	-	12,955,501.89
结算备付金	2,168,562.02	-	-	-	2,168,562.02
存出保证金	308,828.75	-	-	1,116,542.40	1,425,371.15
交易性金融资产	-	-	1,908,000.00	844,745,210.11	846,653,210.11
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	1,388.70	1,388.70
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	13,415,836.64	13,415,836.64
其他资产	-	-	-	-	-

资产总计	15,432,892.66	-	1,908,000.00	859,278,977.85	876,619,870.51
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	556,202.25	556,202.25
应付托管费	-	-	-	111,240.47	111,240.47
应付证券清算款	-	-	-	3,118,855.29	3,118,855.29
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	58,758.66	58,758.66
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	4,081.35	4,081.35
其他负债	-	-	-	21,546,692.79	21,546,692.79
负债总计	-	-	-	25,395,830.81	25,395,830.81
利率敏感度缺口	15,432,892.66	-	1,908,000.00	833,883,147.04	851,224,039.70

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

#### 6.4.10.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率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）
	1.市场利率平行上升25个基点	-4,982.65	-27,034.03
2.市场利率平行下降25个基点	5,067.93	27,493.45	

#### 6.4.10.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.10.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市交易的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

#### 6.4.10.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 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	646,752,986.61	99.54	844,745,210.11	99.24
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	646,752,986.61	99.54	844,745,210.11	99.24

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

#### 6.4.10.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位：人民币元)	
		本期末(2021年6月30日)	上年度末(2020年12月31日)
	1.组合自身基准上升 5%	32,053,953.11	42,323,512.23
	2.组合自身基准下降 5%	-32,053,953.11	-42,323,512.23

#### 6.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项



无。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	646,752,986.61	99.34
	其中：股票	646,752,986.61	99.34
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	348,400.00	0.05
	其中：债券	348,400.00	0.05
	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	3,410,964.26	0.52
8	其他资产	534,724.76	0.08
9	合计	651,047,075.63	100.00

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

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	7,106,745.08	1.09
B	采矿业	16,212,174.60	2.50
C	制造业	381,636,922.79	58.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,742,311.88	1.81
E	建筑业	7,724,784.00	1.19
F	批发和零售业	8,433,949.88	1.30
G	交通运输、仓储和邮政业	18,666,186.69	2.87
H	住宿和餐饮业	751,740.00	0.12
I	信息传输、软件和信息技术服务业	19,066,324.11	2.93
J	金融业	123,760,287.50	19.05

K	房地产业	13,677,728.12	2.11
L	租赁和商务服务业	11,651,455.78	1.79
M	科学研究和技术服务业	9,272,277.59	1.43
N	水利、环境和公共设施管理业	723,055.00	0.11
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	683,103.00	0.11
Q	卫生和社会工作	10,169,147.14	1.57
R	文化、体育和娱乐业	3,106,172.00	0.48
S	综合	-	-
	合计	644,384,365.16	99.18

### 7.2.2 期末积极投资按行业分类境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,732,296.62	0.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00
E	建筑业	28,336.72	0.00
F	批发和零售业	286,119.06	0.04
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	46,807.09	0.01
J	金融业	34,721.10	0.01
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	145,471.20	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	81,849.27	0.01
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	2,368,621.45	0.36

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	18,242	37,518,321.40	5.77
2	300750	宁德时代	33,846	18,100,840.80	2.79
3	000858	五粮液	56,444	16,814,103.16	2.59
4	600036	招商银行	300,143	16,264,749.17	2.50
5	601318	中国平安	157,508	10,124,614.24	1.56
6	601888	中国中免	28,394	8,521,039.40	1.31
7	300760	迈瑞医疗	17,700	8,496,885.00	1.31
8	600900	长江电力	330,554	6,822,634.56	1.05
9	601012	隆基股份	76,752	6,818,647.68	1.05
10	002594	比亚迪	26,300	6,601,300.00	1.02
11	603288	海天味业	51,018	6,578,771.10	1.01
12	000001	平安银行	282,300	6,385,626.00	0.98
13	600276	恒瑞医药	93,033	6,323,453.01	0.97
14	601166	兴业银行	302,100	6,208,155.00	0.96
15	603259	药明康德	37,301	5,840,963.59	0.90
16	600809	山西汾酒	12,603	5,646,144.00	0.87
17	300015	爱尔眼科	77,747	5,518,482.06	0.85
18	000568	泸州老窖	21,300	5,025,522.00	0.77
19	600309	万华化学	45,580	4,960,015.60	0.76
20	300059	东方财富	150,268	4,927,287.72	0.76
21	601398	工商银行	913,700	4,723,829.00	0.73
22	002475	立讯精密	101,773	4,681,558.00	0.72
23	002714	牧原股份	76,514	4,653,581.48	0.72
24	002304	洋河股份	21,999	4,558,192.80	0.70
25	002352	顺丰控股	66,100	4,474,970.00	0.69
26	300122	智飞生物	23,300	4,350,809.00	0.67
27	601919	中远海控	140,700	4,296,978.00	0.66
28	600000	浦发银行	426,478	4,264,780.00	0.66
29	603501	韦尔股份	12,632	4,067,504.00	0.63
30	600436	片仔癀	8,719	3,908,727.70	0.60
31	600030	中信证券	154,600	3,855,724.00	0.59
32	000333	美的集团	51,100	3,647,007.00	0.56
33	600031	三一重工	123,063	3,577,441.41	0.55
34	002142	宁波银行	87,200	3,398,184.00	0.52
35	000002	万科 A	141,400	3,366,734.00	0.52
36	601288	农业银行	1,081,100	3,275,733.00	0.50
37	600887	伊利股份	88,288	3,251,647.04	0.50
38	601816	京沪高铁	595,300	3,149,137.00	0.48
39	000725	京东方 A	492,100	3,070,704.00	0.47
40	002812	恩捷股份	12,900	3,019,890.00	0.46
41	601601	中国太保	99,558	2,884,195.26	0.44

42	300014	亿纬锂能	27,424	2,850,176.32	0.44
43	601668	中国建筑	609,160	2,832,594.00	0.44
44	600438	通威股份	65,300	2,825,531.00	0.43
45	601328	交通银行	569,300	2,789,570.00	0.43
46	300124	汇川技术	37,500	2,784,750.00	0.43
47	601899	紫金矿业	286,300	2,774,247.00	0.43
48	300782	卓胜微	4,940	2,655,250.00	0.41
49	002493	荣盛石化	147,104	2,540,486.08	0.39
50	600104	上汽集团	113,112	2,485,070.64	0.38
51	600019	宝钢股份	323,119	2,468,629.16	0.38
52	300274	阳光电源	21,200	2,439,272.00	0.38
53	600585	海螺水泥	58,100	2,385,005.00	0.37
54	600690	海尔智家	91,681	2,375,454.71	0.37
55	000661	长春高新	6,000	2,322,000.00	0.36
56	600016	民生银行	514,800	2,270,268.00	0.35
57	601818	光大银行	599,700	2,266,866.00	0.35
58	600346	恒力石化	85,165	2,234,729.60	0.34
59	002230	科大讯飞	32,450	2,192,971.00	0.34
60	000538	云南白药	18,600	2,152,392.00	0.33
61	300433	蓝思科技	72,272	2,125,519.52	0.33
62	002241	歌尔股份	49,608	2,120,245.92	0.33
63	600196	复星医药	29,100	2,098,983.00	0.32
64	600703	三安光电	65,300	2,092,865.00	0.32
65	600048	保利地产	173,600	2,090,144.00	0.32
66	300759	康龙化成	9,600	2,083,104.00	0.32
67	600893	航发动力	38,826	2,065,154.94	0.32
68	002371	北方华创	7,400	2,052,612.00	0.32
69	600999	招商证券	107,841	2,051,135.82	0.32
70	600028	中国石化	462,414	2,016,125.04	0.31
71	603799	华友钴业	17,626	2,012,889.20	0.31
72	002027	分众传媒	213,160	2,005,835.60	0.31
73	002311	海大集团	24,200	1,974,720.00	0.30
74	600763	通策医疗	4,800	1,972,800.00	0.30
75	601066	中信建投	62,700	1,970,661.00	0.30
76	002460	赣锋锂业	16,200	1,961,658.00	0.30
77	601658	邮储银行	386,300	1,939,226.00	0.30
78	600406	国电南瑞	80,720	1,875,932.80	0.29
79	601088	中国神华	95,978	1,873,490.56	0.29
80	601211	国泰君安	109,169	1,871,156.66	0.29
81	000063	中兴通讯	56,100	1,864,203.00	0.29
82	603986	兆易创新	9,588	1,801,585.20	0.28
83	300413	芒果超媒	25,950	1,780,170.00	0.27
84	000338	潍柴动力	98,700	1,763,769.00	0.27

85	600745	闻泰科技	18,100	1,753,890.00	0.27
86	601225	陕西煤业	145,330	1,722,160.50	0.27
87	002129	中环股份	44,100	1,702,260.00	0.26
88	000625	长安汽车	64,711	1,700,605.08	0.26
89	601688	华泰证券	107,028	1,691,042.40	0.26
90	601229	上海银行	206,212	1,690,938.40	0.26
91	603486	科沃斯	7,400	1,687,792.00	0.26
92	601857	中国石油	313,742	1,659,695.18	0.26
93	601100	恒立液压	18,932	1,626,637.44	0.25
94	600660	福耀玻璃	29,100	1,625,235.00	0.25
95	600837	海通证券	140,200	1,612,300.00	0.25
96	300454	深信服	6,100	1,582,828.00	0.24
97	600588	用友网络	47,576	1,582,377.76	0.24
98	601988	中国银行	510,500	1,572,340.00	0.24
99	300999	金龙鱼	18,402	1,563,433.92	0.24
100	000100	TCL 科技	203,900	1,559,835.00	0.24
101	601390	中国中铁	296,000	1,551,040.00	0.24
102	000166	申万宏源	327,282	1,531,679.76	0.24
103	601009	南京银行	145,400	1,529,608.00	0.24
104	600919	江苏银行	214,524	1,523,120.40	0.23
105	601169	北京银行	307,160	1,495,869.20	0.23
106	300601	康泰生物	9,900	1,475,100.00	0.23
107	002709	天赐材料	13,450	1,433,501.00	0.22
108	600760	中航沈飞	23,740	1,431,522.00	0.22
109	600132	重庆啤酒	7,202	1,425,635.90	0.22
110	600570	恒生电子	15,267	1,423,647.75	0.22
111	603806	福斯特	13,440	1,412,947.20	0.22
112	601633	长城汽车	32,400	1,412,316.00	0.22
113	601336	新华保险	30,229	1,387,813.39	0.21
114	300142	沃森生物	22,374	1,380,475.80	0.21
115	603659	璞泰来	10,060	1,374,196.00	0.21
116	601628	中国人寿	40,400	1,369,156.00	0.21
117	000596	古井贡酒	5,700	1,365,150.00	0.21
118	601989	中国重工	331,200	1,364,544.00	0.21
119	601155	新城控股	32,700	1,360,320.00	0.21
120	002049	紫光国微	8,800	1,356,872.00	0.21
121	002821	凯莱英	3,600	1,341,360.00	0.21
122	000895	双汇发展	41,910	1,332,738.00	0.21
123	300498	温氏股份	92,680	1,331,811.60	0.20
124	603993	洛阳钼业	255,500	1,318,380.00	0.20
125	601138	工业富联	105,300	1,306,773.00	0.20
126	000776	广发证券	85,541	1,295,090.74	0.20
127	300595	欧普康视	12,370	1,280,913.50	0.20

128	600926	杭州银行	85,720	1,264,370.00	0.19
129	002179	中航光电	16,000	1,264,320.00	0.19
130	001979	招商蛇口	115,232	1,261,790.40	0.19
131	002050	三花智控	51,900	1,244,562.00	0.19
132	000799	酒鬼酒	4,800	1,226,880.00	0.19
133	600989	宝丰能源	88,400	1,209,312.00	0.19
134	002841	视源股份	9,709	1,206,731.61	0.19
135	600741	华域汽车	45,533	1,196,151.91	0.18
136	600600	青岛啤酒	10,310	1,192,351.50	0.18
137	000963	华东医药	25,460	1,171,414.60	0.18
138	600015	华夏银行	185,452	1,147,947.88	0.18
139	603899	晨光文具	13,400	1,133,104.00	0.17
140	002601	龙佰集团	32,515	1,124,368.70	0.17
141	601901	方正证券	119,200	1,115,712.00	0.17
142	300408	三环集团	26,200	1,111,404.00	0.17
143	300628	亿联网络	13,100	1,097,780.00	0.17
144	688185	康希诺	1,400	1,088,878.00	0.17
145	600111	北方稀土	52,550	1,087,785.00	0.17
146	603882	金域医学	6,800	1,086,436.00	0.17
147	300347	泰格医药	5,550	1,072,815.00	0.17
148	600460	士兰微	19,000	1,070,650.00	0.16
149	002001	新和成	37,320	1,070,337.60	0.16
150	600150	中国船舶	64,600	1,066,546.00	0.16
151	601985	中国核电	210,700	1,066,142.00	0.16
152	000768	中航西飞	40,200	1,056,456.00	0.16
153	603833	欧派家居	7,440	1,056,182.40	0.16
154	002568	百润股份	11,100	1,052,169.00	0.16
155	601877	正泰电器	31,048	1,036,382.24	0.16
156	600010	宝钢股份	659,600	1,022,380.00	0.16
157	601788	光大证券	56,653	1,013,522.17	0.16
158	601600	中国铝业	189,600	1,004,880.00	0.15
159	600547	山东黄金	52,252	1,004,283.44	0.15
160	300529	健帆生物	11,600	1,001,776.00	0.15
161	002736	国信证券	92,700	996,525.00	0.15
162	603737	三棵树	5,656	995,456.00	0.15
163	300496	中科创达	6,300	989,478.00	0.15
164	603369	今世缘	18,200	985,712.00	0.15
165	002648	卫星石化	25,040	981,317.60	0.15
166	600584	长电科技	26,000	979,680.00	0.15
167	600886	国投电力	101,160	972,147.60	0.15
168	000301	东方盛虹	46,500	971,850.00	0.15
169	002007	华兰生物	26,400	968,352.00	0.15
170	000786	北新建材	24,638	967,041.50	0.15

171	601916	浙商银行	242,200	961,534.00	0.15
172	000876	新希望	65,100	955,017.00	0.15
173	002064	华峰化学	67,000	951,400.00	0.15
174	600426	华鲁恒升	30,540	945,213.00	0.15
175	300316	晶盛机电	18,700	944,350.00	0.15
176	000157	中联重科	102,200	944,328.00	0.15
177	601377	兴业证券	97,210	939,048.60	0.14
178	002600	领益智造	102,100	938,299.00	0.14
179	002414	高德红外	33,900	934,962.00	0.14
180	002791	坚朗五金	4,800	931,440.00	0.14
181	601799	星宇股份	4,100	925,452.00	0.14
182	601939	建设银行	138,700	922,355.00	0.14
183	600779	水井坊	7,293	921,470.55	0.14
184	002236	大华股份	43,600	919,960.00	0.14
185	603345	安井食品	3,600	914,472.00	0.14
186	000938	紫光股份	41,602	910,251.76	0.14
187	300033	同花顺	8,000	902,240.00	0.14
188	600176	中国巨石	58,051	900,371.01	0.14
189	600029	南方航空	148,100	891,562.00	0.14
190	000069	华侨城 A	118,900	884,616.00	0.14
191	603160	汇顶科技	6,800	881,484.00	0.14
192	300661	圣邦股份	3,450	871,918.50	0.13
193	601966	玲珑轮胎	19,911	870,907.14	0.13
194	600958	东方证券	86,356	862,696.44	0.13
195	601669	中国电建	221,700	857,979.00	0.13
196	601360	三六零	68,900	841,269.00	0.13
197	300003	乐普医疗	25,900	831,908.00	0.13
198	600845	宝信软件	16,260	827,634.00	0.13
199	600115	中国东航	162,300	824,484.00	0.13
200	300146	汤臣倍健	24,800	815,920.00	0.13
201	002074	国轩高科	18,600	810,216.00	0.12
202	002916	深南电路	7,240	804,581.20	0.12
203	002938	鹏鼎控股	22,400	803,712.00	0.12
204	601233	桐昆股份	33,100	797,379.00	0.12
205	600061	国投资本	93,232	791,539.68	0.12
206	600143	金发科技	37,300	778,078.00	0.12
207	601995	中金公司	12,600	774,900.00	0.12
208	600183	生益科技	33,100	774,871.00	0.12
209	601618	中国中冶	258,800	771,224.00	0.12
210	002459	晶澳科技	15,400	754,600.00	0.12
211	002024	苏宁易购	134,800	753,532.00	0.12
212	600754	锦江酒店	13,200	751,740.00	0.12
213	601021	春秋航空	13,200	751,080.00	0.12

214	601111	中国国航	96,400	749,992.00	0.12
215	300207	欣旺达	23,000	748,880.00	0.12
216	002920	德赛西威	6,800	748,544.00	0.12
217	603517	绝味食品	8,848	745,797.92	0.11
218	601878	浙商证券	56,300	736,404.00	0.11
219	603185	上机数控	4,100	733,695.00	0.11
220	002252	上海莱士	97,900	733,271.00	0.11
221	002555	三七互娱	30,500	732,610.00	0.11
222	000425	徐工机械	113,700	724,269.00	0.11
223	601636	旗滨集团	39,000	723,840.00	0.11
224	300676	华大基因	6,100	723,460.00	0.11
225	300285	国瓷材料	14,500	706,875.00	0.11
226	300223	北京君正	7,000	706,440.00	0.11
227	603816	顾家家居	9,100	703,248.00	0.11
228	002602	世纪华通	108,040	693,616.80	0.11
229	600332	白云山	20,468	692,841.80	0.11
230	600089	特变电工	53,900	692,615.00	0.11
231	688008	澜起科技	11,100	692,418.00	0.11
232	600161	天坛生物	19,954	683,424.50	0.11
233	002607	中公教育	32,700	683,103.00	0.11
234	300751	迈为股份	1,500	682,050.00	0.10
235	601881	中国银河	63,100	680,218.00	0.10
236	600079	人福医药	23,800	672,826.00	0.10
237	600885	宏发股份	10,716	671,893.20	0.10
238	600362	江西铜业	30,000	671,400.00	0.10
239	002624	完美世界	28,050	670,675.50	0.10
240	600383	金地集团	65,359	669,276.16	0.10
241	600009	上海机场	13,900	669,007.00	0.10
242	601838	成都银行	52,300	661,072.00	0.10
243	300558	贝达药业	6,100	660,264.00	0.10
244	688002	睿创微纳	6,600	658,878.00	0.10
245	600674	川投能源	53,300	657,189.00	0.10
246	601727	上海电气	154,518	655,156.32	0.10
247	601933	永辉超市	137,839	651,978.47	0.10
248	300677	英科医疗	5,200	648,960.00	0.10
249	601865	福莱特	16,400	648,292.00	0.10
250	002340	格林美	69,300	647,955.00	0.10
251	002625	光启技术	31,100	647,191.00	0.10
252	600352	浙江龙盛	47,072	646,769.28	0.10
253	600298	安琪酵母	11,836	643,641.68	0.10
254	600018	上港集团	134,692	642,480.84	0.10
255	600606	绿地控股	117,700	641,465.00	0.10
256	002080	中材科技	24,500	641,165.00	0.10



257	300144	宋城演艺	38,020	638,736.00	0.10
258	000703	恒逸石化	53,380	637,891.00	0.10
259	002508	老板电器	13,700	637,050.00	0.10
260	603658	安图生物	8,380	634,952.60	0.10
261	600219	南山铝业	174,200	627,120.00	0.10
262	600862	中航高科	20,300	624,834.00	0.10
263	603127	昭衍新药	3,400	624,750.00	0.10
264	300450	先导智能	10,380	624,253.20	0.10
265	601216	君正集团	122,300	622,507.00	0.10
266	601117	中国化学	71,000	621,960.00	0.10
267	000066	中国长城	42,573	621,565.80	0.10
268	000825	太钢不锈	82,600	618,674.00	0.10
269	002353	杰瑞股份	13,800	616,860.00	0.09
270	002185	华天科技	39,900	614,061.00	0.09
271	601162	天风证券	125,700	610,902.00	0.09
272	300037	新宙邦	6,100	610,610.00	0.09
273	600489	中金黄金	70,400	606,848.00	0.09
274	002202	金风科技	49,786	605,397.76	0.09
275	300724	捷佳伟创	5,200	603,252.00	0.09
276	600704	物产中大	76,000	598,120.00	0.09
277	000977	浪潮信息	21,160	595,230.80	0.09
278	601689	拓普集团	15,900	595,137.00	0.09
279	688009	中国通号	103,883	591,094.27	0.09
280	603605	珀莱雅	3,000	590,130.00	0.09
281	000783	长江证券	80,500	589,260.00	0.09
282	601607	上海医药	27,826	587,963.38	0.09
283	000932	华菱钢铁	88,900	586,740.00	0.09
284	603233	大参林	11,473	586,385.03	0.09
285	300699	光威复材	7,700	584,815.00	0.09
286	600315	上海家化	9,700	583,358.00	0.09
287	603444	吉比特	1,100	583,000.00	0.09
288	603456	九洲药业	12,000	582,960.00	0.09
289	603589	口子窖	8,600	582,134.00	0.09
290	002120	韵达股份	42,185	570,763.05	0.09
291	603939	益丰药房	10,144	568,976.96	0.09
292	002013	中航机电	56,400	567,948.00	0.09
293	002444	巨星科技	16,600	565,728.00	0.09
294	601990	南京证券	53,500	562,820.00	0.09
295	002409	雅克科技	6,900	558,900.00	0.09
296	600109	国金证券	43,883	556,875.27	0.09
297	600188	兖州煤业	36,100	554,496.00	0.09
298	002223	鱼跃医疗	14,500	552,885.00	0.09
299	601108	财通证券	52,100	546,529.00	0.08

300	601696	中银证券	26,500	545,635.00	0.08
301	600655	豫园股份	46,900	543,571.00	0.08
302	601872	招商轮船	117,440	542,572.80	0.08
303	002690	美亚光电	9,707	541,262.32	0.08
304	000807	云铝股份	45,300	539,070.00	0.08
305	002673	西部证券	65,016	536,382.00	0.08
306	002294	信立泰	16,200	532,980.00	0.08
307	002157	正邦科技	44,500	531,775.00	0.08
308	000027	深圳能源	57,640	528,558.80	0.08
309	002511	中顺洁柔	19,100	526,205.00	0.08
310	600486	扬农化工	4,700	525,319.00	0.08
311	002044	美年健康	56,928	518,614.08	0.08
312	002032	苏泊尔	8,100	516,699.00	0.08
313	603638	艾迪精密	12,020	515,297.40	0.08
314	002384	东山精密	24,700	514,748.00	0.08
315	601699	潞安环能	43,578	514,656.18	0.08
316	000728	国元证券	64,510	514,144.70	0.08
317	000830	鲁西化工	27,400	513,202.00	0.08
318	601077	渝农商行	128,400	512,316.00	0.08
319	002078	太阳纸业	38,200	509,970.00	0.08
320	603613	国联股份	5,100	509,847.00	0.08
321	601319	中国人保	85,800	508,794.00	0.08
322	600699	均胜电子	19,900	507,848.00	0.08
323	002603	以岭药业	17,400	507,384.00	0.08
324	000050	深天马 A	35,700	506,226.00	0.08
325	300253	卫宁健康	30,930	503,231.10	0.08
326	000739	普洛药业	17,100	502,740.00	0.08
327	002180	纳思达	15,600	502,320.00	0.08
328	600705	中航产融	129,600	501,552.00	0.08
329	688006	杭可科技	5,900	501,500.00	0.08
330	300357	我武生物	7,800	500,136.00	0.08
331	000983	山西焦煤	59,640	495,608.40	0.08
332	000800	一汽解放	44,900	485,818.00	0.07
333	600872	中炬高新	11,483	482,515.66	0.07
334	002405	四维图新	32,800	482,160.00	0.07
335	002507	涪陵榨菜	12,800	482,048.00	0.07
336	002430	杭氧股份	13,900	480,801.00	0.07
337	002372	伟星新材	23,200	479,544.00	0.07
338	600827	百联股份	23,400	471,510.00	0.07
339	600369	西南证券	96,700	470,929.00	0.07
340	601555	东吴证券	56,400	470,376.00	0.07
341	000723	美锦能源	62,200	470,232.00	0.07
342	603707	健友股份	11,230	468,852.50	0.07

343	002156	通富微电	19,300	463,972.00	0.07
344	600372	中航电子	27,900	461,745.00	0.07
345	600233	圆通速递	45,800	458,458.00	0.07
346	600739	辽宁成大	22,004	457,903.24	0.07
347	601615	明阳智能	28,200	456,558.00	0.07
348	300251	光线传媒	42,200	456,182.00	0.07
349	002152	广电运通	35,000	456,050.00	0.07
350	002541	鸿路钢构	7,800	455,130.00	0.07
351	600011	华能国际	107,700	454,494.00	0.07
352	600803	新奥股份	27,400	452,374.00	0.07
353	000656	金科股份	77,700	449,883.00	0.07
354	002138	顺络电子	11,600	449,732.00	0.07
355	600038	中直股份	8,500	448,290.00	0.07
356	000860	顺鑫农业	10,600	447,108.00	0.07
357	601058	赛轮轮胎	44,600	445,554.00	0.07
358	000513	丽珠集团	8,900	445,178.00	0.07
359	600875	东方电气	40,500	444,285.00	0.07
360	600177	雅戈尔	67,220	442,979.80	0.07
361	600521	华海药业	21,210	442,864.80	0.07
362	600642	申能股份	71,700	440,238.00	0.07
363	000021	深科技	23,000	440,220.00	0.07
364	600522	中天科技	44,000	440,000.00	0.07
365	600392	盛和资源	25,300	439,208.00	0.07
366	300482	万孚生物	6,760	437,304.40	0.07
367	002797	第一创业	61,200	436,968.00	0.07
368	000547	航天发展	23,100	435,897.00	0.07
369	603267	鸿远电子	3,400	434,928.00	0.07
370	600039	四川路桥	69,300	434,511.00	0.07
371	603338	浙江鼎力	7,380	433,132.20	0.07
372	601198	东兴证券	39,600	432,828.00	0.07
373	300136	信维通信	14,000	432,320.00	0.07
374	002299	圣农发展	18,100	432,228.00	0.07
375	603866	桃李面包	13,720	428,064.00	0.07
376	002030	达安基因	20,128	427,518.72	0.07
377	600536	中国软件	7,500	426,975.00	0.07
378	600549	厦门钨业	20,400	424,932.00	0.07
379	600998	九州通	27,100	416,527.00	0.06
380	600848	上海临港	23,240	415,996.00	0.06
381	002422	科伦药业	20,700	412,965.00	0.06
382	002939	长城证券	37,000	411,810.00	0.06
383	600516	方大炭素	55,287	411,335.28	0.06
384	600415	小商品城	79,800	410,970.00	0.06
385	000630	铜陵有色	150,800	410,176.00	0.06

386	002385	大北农	60,200	409,360.00	0.06
387	600895	张江高科	22,300	407,421.00	0.06
388	002429	兆驰股份	67,000	406,690.00	0.06
389	600066	宇通客车	32,357	404,138.93	0.06
390	603712	七一二	11,100	400,710.00	0.06
391	002563	森马服饰	33,200	396,740.00	0.06
392	300308	中际旭创	10,220	393,674.40	0.06
393	002266	浙富控股	78,100	389,719.00	0.06
394	600380	健康元	28,300	388,559.00	0.06
395	600909	华安证券	69,660	388,006.20	0.06
396	600598	北大荒	25,800	385,968.00	0.06
397	002463	沪电股份	24,900	385,203.00	0.06
398	002373	千方科技	22,800	380,760.00	0.06
399	000975	银泰黄金	39,880	379,258.80	0.06
400	603218	日月股份	14,000	379,120.00	0.06
401	000999	华润三九	14,110	377,442.50	0.06
402	000709	河钢股份	152,500	375,150.00	0.06
403	603858	步长制药	16,540	371,984.60	0.06
404	002010	传化智联	47,318	364,821.78	0.06
405	002925	盈趣科技	9,360	364,197.60	0.06
406	002926	华西证券	37,600	362,088.00	0.06
407	600988	赤峰黄金	24,000	359,760.00	0.06
408	002146	荣盛发展	63,700	359,268.00	0.06
409	600867	通化东宝	30,032	358,582.08	0.06
410	002065	东华软件	45,100	357,643.00	0.06
411	002242	九阳股份	11,000	357,390.00	0.06
412	601456	国联证券	23,200	357,280.00	0.05
413	600511	国药股份	10,800	357,048.00	0.05
414	601231	环旭电子	21,200	356,372.00	0.05
415	000738	航发控制	17,000	354,110.00	0.05
416	300463	迈克生物	8,400	353,556.00	0.05
417	002075	沙钢股份	32,400	353,484.00	0.05
418	002958	青农商行	82,500	353,100.00	0.05
419	600170	上海建工	127,300	351,348.00	0.05
420	002127	南极电商	35,700	348,789.00	0.05
421	600027	华电国际	101,318	348,533.92	0.05
422	601099	太平洋	101,800	345,102.00	0.05
423	002212	天融信	17,400	343,998.00	0.05
424	002500	山西证券	51,220	343,686.20	0.05
425	000988	华工科技	14,600	343,392.00	0.05
426	002456	欧菲光	38,600	342,768.00	0.05
427	600801	华新水泥	19,500	342,615.00	0.05
428	600160	巨化股份	38,700	342,108.00	0.05

429	002153	石基信息	14,440	339,484.40	0.05
430	000750	国海证券	79,980	339,115.20	0.05
431	600256	广汇能源	101,700	338,661.00	0.05
432	000423	东阿阿胶	9,400	337,554.00	0.05
433	000987	越秀金控	26,500	335,490.00	0.05
434	600688	上海石化	88,847	334,064.72	0.05
435	300070	碧水源	45,600	333,336.00	0.05
436	600153	建发股份	41,148	333,298.80	0.05
437	002151	北斗星通	7,700	331,639.00	0.05
438	603883	老百姓	6,280	330,830.40	0.05
439	300773	拉卡拉	11,700	330,291.00	0.05
440	601598	中国外运	64,600	326,230.00	0.05
441	601992	金隅集团	121,100	325,759.00	0.05
442	600859	王府井	11,200	323,456.00	0.05
443	002557	洽洽食品	7,500	323,250.00	0.05
444	002558	巨人网络	24,300	323,190.00	0.05
445	000961	中南建设	54,000	319,680.00	0.05
446	300383	光环新网	22,200	319,458.00	0.05
447	600026	中远海能	51,700	318,472.00	0.05
448	002705	新宝股份	12,000	315,000.00	0.05
449	600340	华夏幸福	59,929	314,027.96	0.05
450	002019	亿帆医药	18,000	310,500.00	0.05
451	002465	海格通信	32,800	310,288.00	0.05
452	000671	阳光城	59,100	307,320.00	0.05
453	002506	协鑫集成	88,100	306,588.00	0.05
454	603027	千禾味业	11,580	304,438.20	0.05
455	002081	金螳螂	38,400	304,128.00	0.05
456	000998	隆平高科	18,900	303,156.00	0.05
457	002683	宏大爆破	10,900	302,693.00	0.05
458	600498	烽火通信	16,100	299,943.00	0.05
459	300088	长信科技	35,700	294,882.00	0.05
460	300296	利亚德	37,700	294,814.00	0.05
461	600879	航天电子	39,000	293,280.00	0.05
462	000729	燕京啤酒	40,500	293,220.00	0.05
463	600583	海油工程	64,847	291,811.50	0.04
464	000402	金融街	42,998	290,236.50	0.04
465	000629	攀钢钒钛	126,600	289,914.00	0.04
466	600529	山东药玻	8,500	288,575.00	0.04
467	002727	一心堂	8,500	281,435.00	0.04
468	000686	东北证券	33,300	281,385.00	0.04
469	000540	中天金融	101,700	277,641.00	0.04
470	300418	昆仑万维	16,700	273,546.00	0.04
471	000627	天茂集团	72,500	262,450.00	0.04

472	001914	招商积余	15,245	261,909.10	0.04
473	000623	吉林敖东	16,900	261,781.00	0.04
474	000581	威孚高科	12,350	257,250.50	0.04
475	300212	易华录	9,400	252,954.00	0.04
476	601128	常熟银行	39,300	243,660.00	0.04
477	000401	冀东水泥	19,300	238,355.00	0.04
478	002399	海普瑞	14,800	235,764.00	0.04
479	601098	中南传媒	26,200	231,084.00	0.04
480	002131	利欧股份	96,900	226,746.00	0.03
481	002572	索菲亚	6,800	164,560.00	0.03

注：对于同时在 A+H 股上市的股票，合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688425	铁建重工	85,150	404,462.50	0.06
2	688161	威高骨科	3,069	325,467.45	0.05
3	301015	百洋医药	4,614	251,115.78	0.04
4	688601	力芯微	1,174	156,952.06	0.02
5	688315	诺禾致源	3,711	145,471.20	0.02
6	688625	呈和科技	2,672	113,907.36	0.02
7	300919	中伟股份	693	112,959.00	0.02
8	300979	华利集团	836	73,730.80	0.01
9	300981	中红医疗	603	56,572.41	0.01
10	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.01
11	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.01
12	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.01
13	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.01
14	688565	力源科技	2,464	34,496.00	0.01
15	688067	爱威科技	1,259	31,260.97	0.00
16	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
17	300941	创识科技	489	24,552.06	0.00
18	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
19	301009	可靠股份	807	22,541.97	0.00
20	300937	药易购	334	18,057.04	0.00
21	300982	苏文电能	370	17,322.28	0.00
22	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
23	300614	百川畅银	383	16,272.30	0.00
24	300942	易瑞生物	528	15,159.71	0.00
25	300955	嘉亨家化	314	14,830.88	0.00

26	300996	普联软件	310	14,068.34	0.00
27	301013	利和兴	504	13,986.51	0.00
28	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
29	300997	欢乐家	979	13,067.16	0.00
30	300966	共同药业	358	12,311.56	0.00
31	300933	中辰股份	1,117	11,662.18	0.00
32	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
33	300962	中金辐照	657	11,373.12	0.00
34	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
35	300958	建工修复	393	10,879.74	0.00
36	300948	冠中生态	379	10,474.13	0.00
37	300930	屹通新材	420	10,321.78	0.00
38	300993	玉马遮阳	497	10,079.55	0.00
39	300945	曼卡龙	531	10,073.73	0.00
40	300961	深水海纳	436	9,727.10	0.00
41	301011	华立科技	250	9,424.50	0.00
42	300985	致远新能	345	8,763.45	0.00
43	300978	东箭科技	630	8,741.53	0.00
44	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
45	300987	川网传媒	304	8,186.69	0.00
46	300943	春晖智控	342	7,925.10	0.00
47	300960	通业科技	332	7,806.84	0.00
48	300992	泰福泵业	298	6,885.42	0.00
49	300975	商络电子	517	6,872.51	0.00
50	301010	晶雪节能	272	5,127.96	0.00
51	300995	奇德新材	209	5,008.52	0.00
52	301012	扬电科技	191	4,854.16	0.00
53	301007	德迈仕	322	4,766.15	0.00
54	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
55	300998	宁波方正	203	4,347.24	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000858	五粮液	11,121,535.98	1.31
2	300750	宁德时代	10,028,738.50	1.18
3	300760	迈瑞医疗	7,633,889.97	0.90
4	000333	美的集团	7,424,449.00	0.87
5	002594	比亚迪	6,713,904.74	0.79
6	002352	顺丰控股	5,213,175.52	0.61

7	000001	平安银行	4,423,877.74	0.52
8	002475	立讯精密	3,870,569.00	0.45
9	002714	牧原股份	3,611,977.43	0.42
10	300015	爱尔眼科	3,355,628.00	0.39
11	601888	中国中免	3,243,850.00	0.38
12	000568	泸州老窖	3,183,281.13	0.37
13	300059	东方财富	2,961,920.00	0.35
14	300014	亿纬锂能	2,961,224.30	0.35
15	000002	万科 A	2,911,748.00	0.34
16	300601	康泰生物	2,906,572.00	0.34
17	600519	贵州茅台	2,767,432.00	0.33
18	601816	京沪高铁	2,627,639.00	0.31
19	002304	洋河股份	2,556,156.78	0.30
20	002142	宁波银行	2,533,505.53	0.30

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

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000858	五粮液	17,566,205.58	2.06
2	300750	宁德时代	14,493,109.38	1.70
3	002415	海康威视	10,745,638.06	1.26
4	300760	迈瑞医疗	8,005,373.08	0.94
5	002594	比亚迪	7,943,437.67	0.93
6	000001	平安银行	6,857,452.92	0.81
7	002352	顺丰控股	6,171,223.42	0.72
8	002714	牧原股份	5,772,818.60	0.68
9	002475	立讯精密	5,490,680.97	0.65
10	000568	泸州老窖	5,352,866.48	0.63
11	300015	爱尔眼科	5,070,052.19	0.60
12	000002	万科 A	4,720,791.99	0.55
13	300059	东方财富	4,516,171.88	0.53
14	002304	洋河股份	4,472,870.32	0.53
15	002271	东方雨虹	4,014,794.46	0.47
16	300122	智飞生物	3,967,948.00	0.47
17	002142	宁波银行	3,923,523.00	0.46
18	300014	亿纬锂能	3,584,246.00	0.42
19	600519	贵州茅台	3,489,041.00	0.41
20	000725	京东方 A	3,483,270.00	0.41



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

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	319,859,217.68
卖出股票收入（成交）总额	390,587,810.15

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

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	348,400.00	0.05
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	348,400.00	0.05

### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	113050	南银转债	2,920	292,000.00	0.04
2	127038	国微转债	220	22,000.00	0.00
3	113049	长汽转债	190	19,000.00	0.00
4	123117	健帆转债	144	14,400.00	0.00
5	127037	银轮转债	10	1,000.00	0.00

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

金额单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IF2109	IF2109	1	1,549,920.00	43,020.00	-
公允价值变动总额合计（元）					43,020.00
股指期货投资本期收益（元）					751,354.76
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-231,872.00

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

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

报告期内基金投资的前十名证券除招商银行（证券代码 600036）外其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

招商银行 2021 年 5 月 21 日公告称，为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产等原因，中国银行保险监督管理委员会对公司罚款 7170 万元。

对上述证券的投资决策程序的说明：本基金为指数型基金，因复制指数被动持有，上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

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

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

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	471,558.94
2	应收证券清算款	62,443.40
3	应收股利	-
4	应收利息	722.42
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	534,724.76

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688425	铁建重工	404,462.50	0.06	科创板新股锁定期
2	688601	力芯微	156,952.06	0.02	科创板新股锁定期

3	688315	诺禾致源	145,471.20	0.02	科创板新股锁定期
4	301015	百洋医药	17,939.46	0.00	新股锁定期

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
4,559	80,670.71	101,311,872.00	27.55%	141,742,803.00	38.54%	124,723,100.00	33.91%

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	华夏基金-中央汇金资产管理有限责任公司-华夏基金-汇金资管单一资产管理计划	41,000,000.00	11.15%
2	伦敦市投资管理有限公司	21,600,000.00	5.87%
3	广发证券股份有限公司	9,889,117.00	2.69%
4	方正证券股份有限公司	6,174,300.00	1.68%
5	招商证券股份有限公司	5,255,790.00	1.43%
6	安建军	3,404,100.00	0.93%
7	吴美兰	3,000,000.00	0.82%
8	长盛基金-东兴证券股份有限公司-长盛-长兴优选 1 号单一资产管理计划	2,888,000.00	0.79%
9	李耀荣	2,620,000.00	0.71%
10	中航安盟财产保险有限公司-自有资金	2,508,100.00	0.68%
11	中国银行股份有限公司-MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	124,723,100.00	33.91%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

#### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

### § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2018年4月3日)基金份额总额	1,309,777,775.00
本报告期期初基金份额总额	509,777,775.00
本报告期基金总申购份额	224,000,000.00
减：报告期基金总赎回份额	366,000,000.00
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	367,777,775.00

### § 10 重大事件揭示

#### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期未召开基金份额持有人大会。

#### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

因南方基金管理股份有限公司（以下简称“公司”）董事长病逝缺位，根据相关法律法规和公司章程，公司董事会决定由公司总经理杨小松先生代为履行公司董事长职务。该决定自 2021 年 2 月 19 日起生效。

2021 年 5 月 19 日，公司副总经理常克川兼任首席信息官。

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

#### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人主营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼。

## 10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

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

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
安信证券	1	430,628,830.46	61.19%	43,066.79	61.19%	-
中泰证券	2	243,913,859.03	34.66%	24,392.51	34.66%	-
华泰证券	1	29,214,314.58	4.15%	2,921.61	4.15%	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-

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

#### A：选择标准

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

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

1、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座；

2、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实，投资建议是否准确；

3、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
安信证券	256,144.45	5.47%	-	-	-	-
中泰证券	2,238,728.97	47.83%	-	-	-	-
华泰证券	2,186,061.40	46.70%	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-01-25
2	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-02-04
3	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-02-23
4	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-03-02
5	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-03-08
6	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-03-16

7	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-03-19
8	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-03-22
9	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-03-29
10	南方基金管理股份有限公司关于旗下部分指数基金修订基金合同有关条款的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-03-30
11	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-04-13
12	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方兴业证券承销证券的关联交易公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-04-16
13	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方华泰联合证券承销证券的关联交易公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-04-16
14	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-04-19
15	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-05-01
16	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-05-13
17	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-05-15
18	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-05-21
19	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-06-11
20	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销可转换公司债券的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-06-18
21	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会	2021-06-25



		基金电子披露网站	
22	南方基金关于旗下部分基金增加中金财富为申购赎回代理券商的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-06-28

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
联接基金	1	20210101-20210630	273,193,100.00	55,530,000.00	204,000,000.00	124,723,100.00	33.91%
产品特有风险							
本基金存在持有基金份额超过 20%的基金份额持有人，在特定赎回比例及市场条件下，若基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产，将会导致流动性风险和基金净值波动风险。							

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金的文件；
- 2、《MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告；
- 6、《MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金 2021 年中期报告》原文。

### 12.2 存放地点

深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼。

### 12.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>