

**新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金**  
**2021 年年度报告**  
**2021 年 12 月 31 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：二〇二二年三月三十日

## §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。本年度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 2022 年 3 月 29 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。

本报告中财务资料已经审计。致同会计师事务所为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	2
1.1 重要提示.....	2
<b>§2 基金简介</b> .....	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.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	10
<b>§4 管理人报告</b> .....	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
4.9 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.....	16
<b>§5 托管人报告</b> .....	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
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.....	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	17
<b>§6 审计报告</b> .....	17
6.1 审计意见.....	18
6.2 形成审计意见的基础.....	18
6.3 其他信息.....	18
6.4 管理层对财务报表的责任.....	18
6.5 注册会计师的责任.....	19
<b>§7 年度财务报表</b> .....	20
7.1 资产负债表.....	20
7.2 利润表.....	21
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	23
7.4 报表附注.....	24
<b>§8 投资组合报告</b> .....	47
8.1 期末基金资产组合情况.....	47
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	48
8.3 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.....	49
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	62

8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	63
8.6	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 .....	64
8.7	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 .....	64
8.8	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 .....	64
8.9	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 .....	64
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	64
8.12	本报告期投资基金情况 .....	64
8.13	投资组合报告附注 .....	65
<b>§9</b>	<b>基金份额持有人信息</b> .....	<b>66</b>
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	66
9.2	期末上市基金前十名持有人 .....	66
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	66
9.4	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 .....	67
<b>§10</b>	<b>开放式基金份额变动</b> .....	<b>67</b>
<b>§11</b>	<b>重大事件揭示</b> .....	<b>67</b>
11.1	基金份额持有人大会决议 .....	67
11.2	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 .....	67
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	67
11.4	基金投资策略的改变 .....	67
11.5	本报告期持有的基金发生的重大影响事件 .....	68
11.6	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	68
11.7	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	68
11.8	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	68
11.9	其他重大事件 .....	71
<b>12</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>73</b>
<b>§13</b>	<b>备查文件目录</b> .....	<b>75</b>
13.1	备查文件目录 .....	75
13.2	存放地点 .....	76
13.3	查阅方式 .....	76

## §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	7,092,640.00 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

## 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	<p>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。</p> <p>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</p>

	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。

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”。

### 2.3 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

注：中国农业银行股份有限公司法定代表人已于 2021 年 2 月 9 日变更为谷澍。

## 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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.ncfund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	致同会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市朝阳区建国门外大街 22 号赛特广场 5 层
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、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2021 年	2020 年	2019 年
本期已实现收益	12,147,171.38	17,578,387.54	7,248,848.24
本期利润	1,662,946.57	22,236,185.24	22,110,893.88
加权平均基金份额本期利润	0.0877	0.4288	0.3358
本期加权平均净值利润率	4.75%	29.40%	28.29%
本期基金份额净值增长率	1.95%	40.09%	38.80%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
期末可供分配利润	6,065,521.92	20,395,024.03	30,352,216.77
期末可供分配基金份额利润	0.8552	0.5812	0.2507
期末基金资产净值	13,158,161.92	63,862,054.06	157,298,957.83
期末基金份额净值	1.8552	1.8198	1.2990
3.1.3 累计期末指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
基金份额累计净值增长率	85.52%	81.98%	29.90%

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
过去三个月	1.24%	0.73%	1.54%	0.75%	-0.30%	-0.02%
过去六个月	-2.75%	0.94%	-3.62%	0.98%	0.87%	-0.04%
过去一年	1.95%	1.12%	-0.30%	1.16%	2.25%	-0.04%
过去三年	98.23%	1.25%	76.03%	1.28%	22.20%	-0.03%
自基金合同生效起至今	85.52%	1.23%	65.72%	1.27%	19.80%	-0.04%

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

自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
(2018 年 11 月 7 日至 2021 年 12 月 31 日)

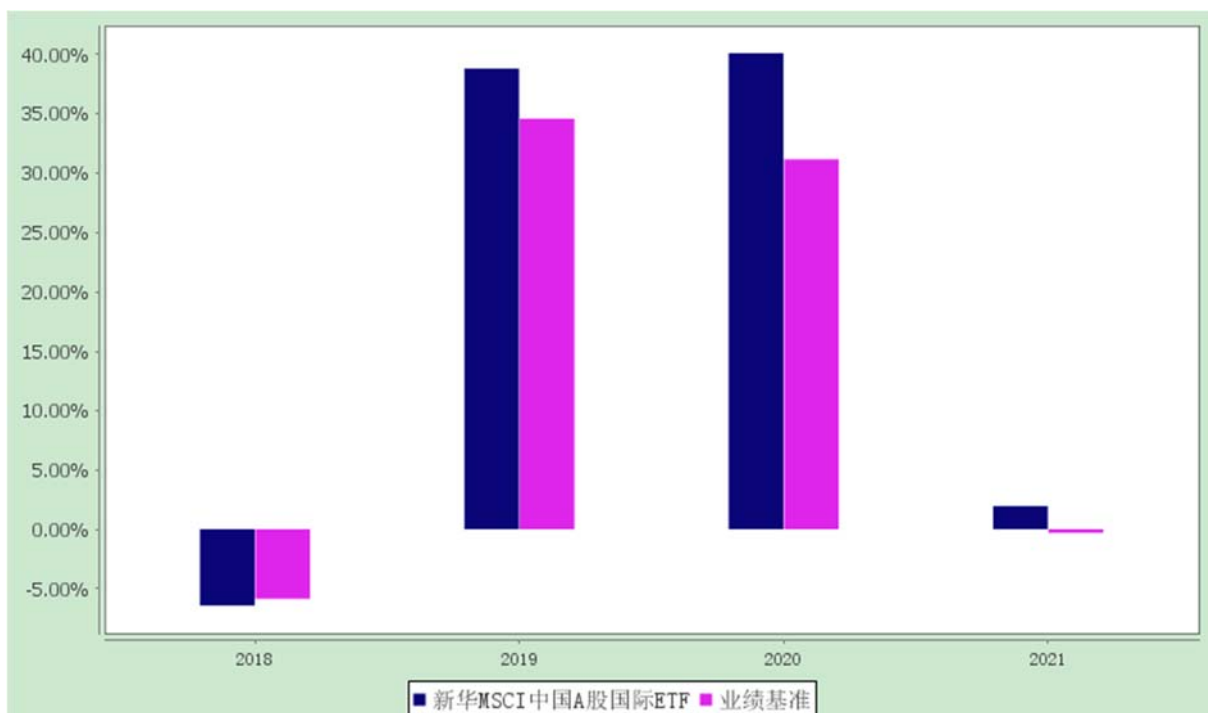




### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：1、本基金于 2018 年 11 月 07 日基金合同生效；

2、本报告期末本基金各项资产配置比例符合合同约定。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

过去三年本基金无利润分配。

## §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 12 月 31 日，新华基金管理股份有限公司旗下管理着五十四只开放式基金，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证券投资基金、新华

利率债债券型证券投资基金、新华行业龙头主题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、新华中证云计算 50 交易型开放式指数证券投资基金、新华中债 1-5 年农发行债券指数证券投资基金。

#### 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、新华中证云计算 50 交易型开放式指数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 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、新华恒益量化灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华万银多元策略灵活配置混合型证券投资	2021-01-05	-	7	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。

	基金基金经 理、新华中证 云计算 50 交 易型开放式指 数证券投资基金 基金基金经理 助理。				
熊俊杰	本基金基金经 理助理，新华 中证环保产业 指数证券投资 基金基金经理 助理、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 理助理、新华 沪深 300 指 数增强型证券 投资基金基金 经理助理、新 华中证云计算 50 交易型开 放式指数证券 投资基金基金 经理助理。	2021-12-2 2	-	5	美国伍斯特理工学院金融数学硕 士，历任金贝塔网络金融科技（深 圳）有限公司研究部量化研究员、 招商期货资产管理部量化研究 员。

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

本报告期末本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

本报告期末本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

#### 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 公平交易制度和控制方法

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办法》，以避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为。该办法规范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。

公司通过合理设置各类资产管理业务之间以及各类资产管理业务内部的组织结构，在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，使各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会，并重视交易执行环节的公平交易措施，以“价格优先、时间优先、综合平衡、比例实施”作为交易执行的公平原则，保证交易在各投资组合间的公正实施，保证各投资组合间的利益公平对待。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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管理办法》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。

本报告期内，公平交易管理执行情况良好。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

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，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，标的指数共发生 4 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 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.8552 元，本报告期份额净值增长率为 1.95%，同期比较基准的增长率为-0.30%。

#### 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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人在开展内部监察稽核工作时本着合规运作、防范风险、保障基金份额持有人利益的宗旨，由独立于各业务部门的督察长和监察稽核部对公司的经营管理、基金的投资运作、基金的销售等公司所有业务及员工行为规范等方面进行定期和不定期检查，及时发现问题并督促相关部门进行整改，并定期制作监察稽核报告报中国证监会、董事会和公司管理层。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核工作的重点包括以下几个方面：

一、督察长和监察稽核部督促、协助各业务部门按照法律法规和监管机构规定的要求，完善各项内部管理制度和业务流程，明确风险控制职责并具体落实相应措施，提高全体员工的风险意识，有效保障基金份额持有人的利益。

二、督察长和监察稽核部针对各部门具体业务建立了相应的检查指标及检查重点，通过现场检查、电脑监控、人员询问、重点抽查等一系列方法，定期对公司和基金日常运作的各项业务进行合法合规检查，并对基金投资交易行为过程实施实时监控，督促业务部门不断改进内部控制和风险管理，并按规定定期出具监察稽核报告报送监管机关、董事会和公司管理层。

三、根据中国证监会的规定，督察长和监察稽核部及时准确地向监管机关报送各项报告，并对公司所有对外信息，包括基金法定信息披露、基金产品宣传推介材料和媒体稿件等的合法合规情况进行事前审阅，确保其内容真实、准确、完整并符合中国证监会的相关规定。督察长和监察稽核部组织、协调各相关部门及时完成信息披露，确保公司的信息披露工作严格按照中国证监会规定的时间和方式进行。

四、在全公司范围内开展持续的学习和培训。督察长和监察稽核部对公司员工进行了法律法规

的专项培训，并组织员工开展学习、讨论，提高和加深了公司员工对基金法律法规的认识和理解，明确风险控制职责，树立全员内控意识。

通过上述工作，在本报告期内，公司对本基金的管理始终都能按照法律法规、基金合同、招募说明书和公司制度进行，充分维护和保障了基金持有人的合法权益。本基金管理人将一如既往地本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运用资金资产，以风险控制为核心，进一步提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

##### 4.7.1 有关参与估值流程各方及人员（或小组）的职责分工

###### 4.7.1.1 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、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。

###### 4.7.1.2 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。

#### 4.7.1.3 投资管理部的职责分工

- 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。

#### 4.7.1.4 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。

#### 4.7.1.5 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部问讯；
- 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。

### 4.8 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。

### 4.9 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 12 月 31 日连续二百四十三个工作日基金持有人低于 200 人，从 2021 年 04 月 22 日至 2021 年 12 月 31 日连续一百七十一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 12 月 31 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 托管人对本年度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年度报告中的财务指标、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 审计报告

致同审字(2022)第 110A004848 号

新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人:

我们审计了新华 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“新华 MSCI 中国 A 股国际 ETF 基金”）财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表、2021 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。

## 6.1 审计意见

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的有关规定编制，公允反映了新华 MSCI 中国 A 股国际 ETF 基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。

## 6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于新华 MSCI 中国 A 股国际 ETF 基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

## 6.3 其他信息

新华 MSCI 中国 A 股国际 ETF 基金的基金管理人新华基金管理股份有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括新华 MSCI 中国 A 股国际 ETF 基金 2021 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

## 6.4 管理层对财务报表的责任

基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估新华 MSCI 中国 A 股国际 ETF 基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清

算新华 MSCI 中国 A 股国际 ETF 基金、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督新华 MSCI 中国 A 股国际 ETF 基金的财务报告过程。

## 6.5 注册会计师的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据所获取的审计证据，就可能导致对新华 MSCI 中国 A 股国际 ETF 基金的持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致新华 MSCI 中国 A 股国际 ETF 基金不能持续经营。

(5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

致同会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

范晓红 刘蕾

北京市朝阳区建国门外大街 22 号赛特广场 5 层

2022 年 3 月 29 日

## §7 年度财务报表

## 7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	7.4.7.1	665,772.70	1,393,342.27
结算备付金		9,587.55	33,559.90
存出保证金		3,405.92	13,201.68
交易性金融资产	7.4.7.2	12,660,970.56	62,690,365.87
其中：股票投资		12,660,970.56	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	10,383.67
应收利息	7.4.7.5	139.24	402.82
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>13,339,875.97</b>	<b>64,141,256.21</b>
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 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		5,612.09	27,182.30
应付托管费		1,122.42	5,436.43
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	10,556.19	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	7.4.7.8	164,423.35	208,701.25
<b>负债合计</b>		<b>181,714.05</b>	<b>279,202.15</b>
<b>所有者权益：</b>		-	-
实收基金	7.4.7.9	7,092,640.00	35,092,640.00
未分配利润	7.4.7.10	6,065,521.92	28,769,414.06
<b>所有者权益合计</b>		<b>13,158,161.92</b>	<b>63,862,054.06</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>13,339,875.97</b>	<b>64,141,256.21</b>

注：报告截止 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.8552 元，基金份额总额 7,092,640.00 份。

## 7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

一、收入		<b>2,123,708.80</b>	<b>23,090,509.60</b>
1.利息收入		9,136.33	15,287.83
其中：存款利息收入	7.4.7.11	9,136.33	15,287.83
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		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		12,421,269.48	18,173,531.77
其中：股票投资收益	7.4.7.12	11,919,855.78	17,116,022.11
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	7.4.7.17	501,413.70	1,057,509.66
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-10,484,224.81	4,657,797.70
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	177,527.80	243,892.30
<b>减：二、费用</b>		<b>460,762.23</b>	<b>854,324.36</b>
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	177,466.80	381,801.26
2. 托管费	7.4.10.2.2	35,493.32	76,360.25
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.20	67,408.90	153,007.02
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	7.4.7.21	180,393.21	243,155.83
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>1,662,946.57</b>	<b>22,236,185.24</b>

减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>1,662,946.57</b>	<b>22,236,185.24</b>

### 7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 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）	-	1,662,946.57	1,662,946.57
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）	-28,000,000.00	-24,366,838.71	-52,366,838.71
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	-30,000,000.00	-25,840,347.60	-55,840,347.60
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）	7,092,640.00	6,065,521.92	13,158,161.92
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 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）	-	22,236,185.24	22,236,185.24
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）	-86,000,000.00	-29,673,089.01	-115,673,089.01
其中：1.基金申购款	19,000,000.00	11,747,564.87	30,747,564.87
2.基金赎回款	-105,000,000.00	-41,420,653.88	-146,420,653.88
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）	35,092,640.00	28,769,414.06	63,862,054.06

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从 7.1 至 7.4，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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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，存续期不特定。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 2022 年 3 月 29 日批准报出。

#### 7.4.2 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,按照财政部颁布的企业会计准则及其应用指南、解释及其他有关规定(统称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)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》和财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。

本基金以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

##### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。

本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

除衍生工具所产生的金融负债外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融负债在资产负债表中以交易性金融负债列示。衍生工具所产生的金融负债在资产负债表中以衍生金融负债列示。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。贷款及应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，贷款及应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3)

该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基

金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部

分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、基金投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场交易的固定收益品种，按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无会计差错更正。

## 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、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》、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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对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，股票的股息、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) 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。

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

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
活期存款	665,772.70	1,393,342.27
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	665,772.70	1,393,342.27

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2021 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	10,827,695.52	12,660,970.56	1,833,275.04
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	10,827,695.52	12,660,970.56	1,833,275.04
项目	上年度末		
	2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	50,372,866.02	62,690,365.87	12,317,499.85
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	50,372,866.02	62,690,365.87	12,317,499.85

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末及上年度末，本基金未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本报告期末及上年度末，本基金未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末及上年度末，本基金未持有买断式逆回购交易中取得的债券。



## 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	133.34	381.72
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	5.90	21.10
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	-	-
其他	-	-
合计	139.24	402.82

注：应收结算备付金利息包含结算保证金利息。

## 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

## 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	10,556.19	37,882.17
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	10,556.19	37,882.17

## 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
预提费用	160,000.00	200,000.00
指数许可使用费	4,423.35	8,701.25
合计	164,423.35	208,701.25

## 7.4.7.9 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 12 月 31 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）	-30,000,000.00	-30,000,000.00
本期末	7,092,640.00	7,092,640.00

## 7.4.7.10 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	12,147,171.38	-10,484,224.81	1,662,946.57
本期基金份额交易产生的变动数	-23,989,788.79	-377,049.92	-24,366,838.71
其中：基金申购款	1,368,767.13	104,741.76	1,473,508.89
基金赎回款	-25,358,555.92	-481,791.68	-25,840,347.60
本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,552,406.62	-2,486,884.70	6,065,521.92

## 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	8,836.73	14,140.40
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	299.60	1,147.43
其他	-	-
合计	9,136.33	15,287.83

注：结算备付金利息收入包含结算保证金利息收入。

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	7,749,774.06	13,837,217.98
股票投资收益——赎回差价收入	4,170,081.72	3,278,804.13
股票投资收益——申购差价收入	-	-
合计	11,919,855.78	17,116,022.11

##### 7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	36,582,142.31	80,981,547.02
减：卖出股票成本总额	28,832,368.25	67,144,329.04
买卖股票差价收入	7,749,774.06	13,837,217.98

##### 7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
赎回基金份额对价总额	55,840,347.60	146,420,653.88

减：现金支付赎回款总额	24,594,467.60	55,781,151.88
减：赎回股票成本总额	27,075,798.28	87,360,697.87
赎回差价收入	4,170,081.72	3,278,804.13

#### 7.4.7.13 基金投资收益

本报告期及上年度可比期间，本基金无基金投资收益。

#### 7.4.7.14 债券投资收益

##### 7.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

本报告期及上年度可比期间，本基金无债券投资收益。

##### 7.4.7.14.2 资产支持证券投资收益

本报告期及上年度可比期间，本基金无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.15 贵金属投资收益

本报告期及上年度可比期间，本基金无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.16 衍生工具收益

本报告期及上年度可比期间，本基金无衍生工具收益。

#### 7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	501,413.70	1,057,509.66
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	501,413.70	1,057,509.66

#### 7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
1.交易性金融资产	-10,484,224.81	4,657,797.70

——股票投资	-10,484,224.81	4,657,797.70
——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	-10,484,224.81	4,657,797.70

#### 7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	177,527.80	243,892.30
合计	177,527.80	243,892.30

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。

#### 7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
交易所市场交易费用	67,408.90	153,007.02
银行间市场交易费用	-	-
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-

赎回费	-	-
合计	67,408.90	153,007.02

#### 7.4.7.20.1 持有基金产生的费用

本基金本报告期及上年度可比期间未持有基金投资。

#### 7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月 31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
审计费用	80,000.00	80,000.00
信息披露费	80,000.00	120,000.00
汇划手续费	2,565.69	4,952.62
指数使用费	17,827.52	38,203.21
合计	180,393.21	243,155.83

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。

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至 2021 年 12 月 31 日，本基金未发生需要披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截止本报告签发日，本基金未发生资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

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

新华信托股份有限公司	基金管理人股东
杭州永原网络科技有限公司	基金管理人股东
北京新华富时资产管理有限公司	基金管理人的控股子公司
恒泰长财证券有限责任公司	基金管理人股东的全资子公司
中央汇金投资有限责任公司	基金托管人股东

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

1、下述佣金按合同约定的佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。

2、下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

##### 7.4.10.1.1 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12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
恒泰证券股份有限公司	696,388.06	1.39%	7,528,047.13	6.37%

##### 7.4.10.1.2 权证交易

本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行权证交易。

##### 7.4.10.1.3 债券交易

本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行债券交易。

##### 7.4.10.1.4 债券回购交易

本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行债券回购交易。

##### 7.4.10.1.5 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12月31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	2.46%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31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	6,529.73	11.93%	101.37	0.27%

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12 月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	177,466.80	381,801.26
其中：支付销售机构的客户维护费	863.17	884.73

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。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12 月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12 月31日
当期发生的基金应支付的托管费	35,493.32	76,360.25



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)。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期及上期可比期间未发生关联方销售服务费。

#### 7.4.10.3 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。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

报告期内，基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

##### 7.4.10.4.2 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。

#### 7.4.10.5 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12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31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	665,772.70	8,836.73	1,393,342.27	14,140.40

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。

#### 7.4.10.6 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。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

##### 7.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

2021 年 12 月 31 日，本基金持有 20,000.00 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 67,339.46 元，估值总额为人民币 58,800.00 元，占基金资产净值的比例为 0.45%。

##### 7.4.10.7.2 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

本基金本报告期及上年度可比期间未持有本基金管理人以及管理人关联方所管理基金。

#### 7.4.11 利润分配情况

报告截至 2021 年 12 月 31 日止无收益分配事项。

#### 7.4.12 期末（2021 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无持有流通受限证券。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末无持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购。

###### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购。

##### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 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。

##### 7.4.13.2 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。

#### **7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

本报告期末及上年度末，本基金未持有按短期信用评级的债券投资。

#### **7.4.13.2.2 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末，本基金未持有按短期信用评级的资产支持证券投资。

#### **7.4.13.2.3 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末，本基金未持有按短期信用评级的同业存单投资。

#### **7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

本报告期末及上年度末，本基金未持有按长期信用评级的债券投资。

#### **7.4.13.2.5 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末，本基金未持有按长期信用评级的资产支持证券投资。

#### **7.4.13.2.6 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末，本基金未持有按长期信用评级的同业存单投资。

### **7.4.13.3 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。

#### **7.4.13.3.1 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。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在流动性良好的证券交易所或者银行间同业市场交易，期末除本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节中所列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，其余均能及时变现。评估结果显示组合高流动性资产比重较高，组合变现比例能力较好。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 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	665,772.70	-	-	-	665,772.70
结算备付金	9,587.55	-	-	-	9,587.55
存出保证金	3,405.92	-	-	-	3,405.92
交易性金融资产	-	-	-	12,660,970.56	12,660,970.56
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	139.24	139.24
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	678,766.17	-	-	12,661,109.80	13,339,875.97
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	-	-	-	5,612.09	5,612.09
应付托管费	-	-	-	1,122.42	1,122.42
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	10,556.19	10,556.19
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	164,423.35	164,423.35
负债总计	-	-	-	181,714.05	181,714.05
利率敏感度缺口	678,766.17	-	-	12,479,395.75	13,158,161.92
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，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 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。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。

本基金的所有资产与负债均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 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，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。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 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	12,660,970.56	96.22	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	-	-	-	-
合计	12,660,970.56	96.22	62,690,365.87	98.17

#### 7.4.13.4.3.2 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 1%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 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	沪深 300 指数上升 1%	增加约 25,403.12	增加约 642,782.39
	沪深 300 指数下降 1%	减少约 25,403.12	减少约 642,782.39

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

根据《企业会计准则第 22 号-金融工具确认和计量》(财会〔2017〕7 号)、《企业会计准则第 23 号-金融资产转移》(财会〔2017〕8 号)、《企业会计准则第 24 号-套期会计》(财会〔2017〕9 号)、《企业会计准则第 37 号-金融工具列报》(财会〔2017〕14 号)(统称“新金融工具准则”)和《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》(财会〔2020〕22 号)等相关规定,自 2022 年 1 月 1 日起,本基金开始执行新金融工具准则,新金融工具准则预期不会对本基金的财务状况和经营成果产生重大影响。

## §8 投资组合报告

### 8.1 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	12,660,970.56	94.91
	其中：股票	12,660,970.56	94.91
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	675,360.25	5.06
8	其他各项资产	3,545.16	0.03
9	合计	13,339,875.97	100.00

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而 8.2 的合计项中不含可退替代款估值增值。

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 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	147,265.96	1.12
B	采矿业	353,716.15	2.69
C	制造业	7,642,965.26	58.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	384,039.99	2.92
E	建筑业	217,277.30	1.65
F	批发和零售业	143,887.34	1.09
G	交通运输、仓储和邮政业	382,793.70	2.91



H	住宿和餐饮业	11,720.00	0.09
I	信息传输、软件和信息技术服务业	454,294.34	3.45
J	金融业	2,186,657.64	16.62
K	房地产业	209,146.20	1.59
L	租赁和商务服务业	155,881.00	1.18
M	科学研究和技术服务业	158,927.60	1.21
N	水利、环境和公共设施管理业	27,398.00	0.21
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	110,863.68	0.84
R	文化、体育和娱乐业	64,035.40	0.49
S	综合	10,101.00	0.08
	合计	12,660,970.56	96.22

### 8.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

### 8.2.3 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。

## 8.3 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

### 8.3.1 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	300	615,000.00	4.67
2	300750	宁德时代	600	352,800.00	2.68
3	600036	招商银行	5,600	272,776.00	2.07
4	000858	五粮液	1,000	222,660.00	1.69
5	601318	中国平安	2,900	146,189.00	1.11
6	600900	长江电力	6,323	143,532.10	1.09
7	002594	比亚迪	500	134,060.00	1.02

8	601012	隆基股份	1,478	127,403.60	0.97
9	300760	迈瑞医疗	300	114,240.00	0.87
10	600809	山西汾酒	360	113,680.80	0.86
11	601888	中国中免	500	109,705.00	0.83
12	601166	兴业银行	5,600	106,624.00	0.81
13	300059	东方财富	2,776	103,017.36	0.78
14	000568	泸州老窖	400	101,548.00	0.77
15	603288	海天味业	940	98,803.40	0.75
16	002475	立讯精密	1,984	97,612.80	0.74
17	002352	顺丰控股	1,300	89,596.00	0.68
18	600276	恒瑞医药	1,727	87,576.17	0.67
19	600436	片仔癀	200	87,430.00	0.66
20	000001	平安银行	5,200	85,696.00	0.65
21	603259	药明康德	720	85,377.60	0.65
22	600309	万华化学	800	80,800.00	0.61
23	601398	工商银行	16,900	78,247.00	0.59
24	002714	牧原股份	1,436	76,624.96	0.58
25	600030	中信证券	2,900	76,589.00	0.58
26	002142	宁波银行	1,820	69,669.60	0.53
27	600000	浦发银行	7,930	67,642.90	0.51
28	600887	伊利股份	1,600	66,336.00	0.50
29	002304	洋河股份	400	65,892.00	0.50
30	300015	爱尔眼科	1,531	64,730.68	0.49
31	601919	中远海控	3,350	62,611.50	0.48
32	603501	韦尔股份	200	62,154.00	0.47
33	600406	国电南瑞	1,539	61,606.17	0.47
34	002812	恩捷股份	240	60,096.00	0.46
35	601288	农业银行	20,000	58,800.00	0.45
36	300274	阳光电源	400	58,320.00	0.44
37	300014	亿纬锂能	492	58,144.56	0.44
38	601668	中国建筑	11,300	56,500.00	0.43
39	600438	通威股份	1,200	53,952.00	0.41
40	601899	紫金矿业	5,500	53,350.00	0.41
41	601816	京沪高铁	11,000	53,130.00	0.40
42	600031	三一重工	2,300	52,440.00	0.40
43	300124	汇川技术	750	51,450.00	0.39
44	000002	万科 A	2,600	51,376.00	0.39
45	000725	京东方 A	10,100	51,005.00	0.39
46	600690	海尔智家	1,700	50,813.00	0.39
47	600048	保利发展	3,200	50,016.00	0.38
48	300122	智飞生物	400	49,840.00	0.38
49	002493	荣盛石化	2,700	49,032.00	0.37
50	601328	交通银行	10,600	48,866.00	0.37
51	601601	中国太保	1,800	48,816.00	0.37

52	002241	歌尔股份	900	48,690.00	0.37
53	600905	三峡能源	6,400	48,064.00	0.37
54	688036	传音控股	300	47,070.00	0.36
55	600111	北方稀土	1,000	45,800.00	0.35
56	600703	三安光电	1,200	45,072.00	0.34
57	002049	紫光国微	200	45,000.00	0.34
58	600893	航发动力	700	44,422.00	0.34
59	600585	海螺水泥	1,100	44,330.00	0.34
60	002466	天齐锂业	410	43,870.00	0.33
61	002821	凯莱英	100	43,500.00	0.33
62	600104	上汽集团	2,100	43,323.00	0.33
63	600019	宝钢股份	6,000	42,960.00	0.33
64	300896	爱美客	80	42,888.80	0.33
65	002460	赣锋锂业	300	42,855.00	0.33
66	603799	华友钴业	368	40,594.08	0.31
67	601088	中国神华	1,800	40,536.00	0.31
68	603986	兆易创新	228	40,093.80	0.30
69	601766	中国中车	6,500	39,585.00	0.30
70	000776	广发证券	1,600	39,344.00	0.30
71	600745	闻泰科技	300	38,790.00	0.29
72	002129	中环股份	900	37,575.00	0.29
73	600346	恒力石化	1,620	37,211.40	0.28
74	002459	晶澳科技	400	37,080.00	0.28
75	600016	民生银行	9,500	37,050.00	0.28
76	601818	光大银行	11,100	36,852.00	0.28
77	601658	邮储银行	7,200	36,720.00	0.28
78	002709	天赐材料	320	36,688.00	0.28
79	600028	中国石化	8,600	36,378.00	0.28
80	601211	国泰君安	2,000	35,780.00	0.27
81	601688	华泰证券	2,000	35,520.00	0.27
82	600999	招商证券	2,000	35,300.00	0.27
83	601066	中信建投	1,200	35,100.00	0.27
84	002371	北方华创	100	34,702.00	0.26
85	600010	包钢股份	12,300	34,317.00	0.26
86	000063	中兴通讯	1,000	33,500.00	0.25
87	601669	中国电建	4,100	33,128.00	0.25
88	300498	温氏股份	1,700	32,742.00	0.25
89	600050	中国联通	8,300	32,619.00	0.25
90	601985	中国核电	3,900	32,370.00	0.25
91	601877	正泰电器	600	32,334.00	0.25
92	000338	潍柴动力	1,800	32,202.00	0.24
93	603659	璞泰来	200	32,122.00	0.24
94	002027	分众传媒	3,900	31,941.00	0.24
95	600837	海通证券	2,600	31,876.00	0.24

96	601390	中国中铁	5,500	31,845.00	0.24
97	600588	用友网络	887	31,825.56	0.24
98	601225	陕西煤业	2,600	31,720.00	0.24
99	688599	天合光能	400	31,560.00	0.24
100	002230	科大讯飞	600	31,506.00	0.24
101	000538	云南白药	300	31,395.00	0.24
102	603806	福斯特	240	31,332.00	0.24
103	000166	申万宏源	6,100	31,232.00	0.24
104	300661	圣邦股份	100	30,900.00	0.23
105	601100	恒立液压	372	30,429.60	0.23
106	300433	蓝思科技	1,300	29,874.00	0.23
107	600150	中国船舶	1,200	29,748.00	0.23
108	002311	海大集团	400	29,320.00	0.22
109	601633	长城汽车	600	29,124.00	0.22
110	601988	中国银行	9,500	28,975.00	0.22
111	300782	卓胜微	88	28,758.40	0.22
112	601857	中国石油	5,800	28,478.00	0.22
113	300759	康龙化成	200	28,254.00	0.21
114	001979	招商蛇口	2,100	28,014.00	0.21
115	600989	宝丰能源	1,600	27,776.00	0.21
116	300413	芒果超媒	480	27,465.60	0.21
117	601229	上海银行	3,810	27,165.30	0.21
118	000661	长春高新	100	27,140.00	0.21
119	603993	洛阳钼业	4,800	26,784.00	0.20
120	688111	金山办公	100	26,500.00	0.20
121	000625	长安汽车	1,700	25,823.00	0.20
122	601006	大秦铁路	4,000	25,600.00	0.19
123	688012	中微公司	200	25,320.00	0.19
124	601169	北京银行	5,700	25,308.00	0.19
125	000895	双汇发展	800	25,240.00	0.19
126	300999	金龙鱼	400	25,172.00	0.19
127	002050	三花智控	976	24,692.80	0.19
128	600196	复星医药	500	24,470.00	0.19
129	000596	古井贡酒	100	24,400.00	0.19
130	601009	南京银行	2,700	24,192.00	0.18
131	601360	三六零	1,900	24,168.00	0.18
132	601138	工业富联	2,000	23,840.00	0.18
133	601127	小康股份	400	23,820.00	0.18
134	601868	中国能建	8,700	23,751.00	0.18
135	603833	欧派家居	160	23,600.00	0.18
136	600958	东方证券	1,600	23,584.00	0.18
137	600660	福耀玻璃	500	23,570.00	0.18
138	000100	TCL 科技	3,800	23,446.00	0.18
139	600919	江苏银行	4,010	23,378.30	0.18

140	601336	新华保险	600	23,328.00	0.18
141	600563	法拉电子	100	23,240.00	0.18
142	601865	福莱特	400	23,176.00	0.18
143	300763	锦浪科技	100	23,155.00	0.18
144	688005	容百科技	200	23,116.00	0.18
145	002001	新 和 成	740	23,028.80	0.18
146	600570	恒生电子	370	22,995.50	0.17
147	600702	舍得酒业	100	22,730.00	0.17
148	600741	华域汽车	800	22,640.00	0.17
149	300142	沃森生物	400	22,480.00	0.17
150	300408	三环集团	500	22,300.00	0.17
151	603392	万泰生物	100	22,150.00	0.17
152	600886	国投电力	1,900	21,793.00	0.17
153	600460	士兰微	400	21,680.00	0.16
154	688006	杭可科技	200	21,516.00	0.16
155	002916	深南电路	176	21,440.32	0.16
156	601600	中国铝业	3,500	21,315.00	0.16
157	000799	酒鬼酒	100	21,250.00	0.16
158	600089	特变电工	1,000	21,170.00	0.16
159	300207	欣旺达	500	21,080.00	0.16
160	601628	中国人寿	700	21,063.00	0.16
161	300316	晶盛机电	300	20,850.00	0.16
162	603605	珀莱雅	100	20,831.00	0.16
163	600926	杭州银行	1,600	20,512.00	0.16
164	601799	星宇股份	100	20,425.00	0.16
165	300628	亿联网络	250	20,362.50	0.15
166	600763	通策医疗	100	19,900.00	0.15
167	600600	青岛啤酒	200	19,800.00	0.15
168	603026	石大胜华	100	19,799.00	0.15
169	600176	中国巨石	1,086	19,765.20	0.15
170	300601	康泰生物	200	19,708.00	0.15
171	600015	华夏银行	3,500	19,600.00	0.15
172	002736	国信证券	1,700	19,516.00	0.15
173	000963	华东医药	480	19,296.00	0.15
174	000938	紫光股份	842	19,239.70	0.15
175	002648	卫星化学	480	19,214.40	0.15
176	601117	中国化学	1,600	19,200.00	0.15
177	300347	泰格医药	150	19,170.00	0.15
178	300454	深信服	100	19,100.00	0.15
179	600426	华鲁恒升	610	19,093.00	0.15
180	600029	南方航空	2,800	19,068.00	0.14
181	002236	大华股份	811	19,042.28	0.14
182	600011	华能国际	1,961	19,002.09	0.14
183	600547	山东黄金	985	18,537.70	0.14

184	601618	中国中冶	4,800	18,384.00	0.14
185	000876	新希望	1,200	18,252.00	0.14
186	002013	中航机电	1,000	18,180.00	0.14
187	002791	坚朗五金	100	18,159.00	0.14
188	688396	华润微	280	18,088.00	0.14
189	600085	同仁堂	400	17,992.00	0.14
190	603267	鸿远电子	100	17,944.00	0.14
191	000786	北新建材	500	17,915.00	0.14
192	000723	美锦能源	1,100	17,853.00	0.14
193	601377	兴业证券	1,800	17,784.00	0.14
194	601155	新城控股	600	17,478.00	0.13
195	000301	东方盛虹	900	17,406.00	0.13
196	601901	方正证券	2,200	17,248.00	0.13
197	002601	龙佰集团	600	17,154.00	0.13
198	603345	安井食品	100	17,078.00	0.13
199	002555	三七互娱	630	17,022.60	0.13
200	002080	中材科技	500	17,010.00	0.13
201	002938	鹏鼎控股	400	16,972.00	0.13
202	002602	世纪华通	2,020	16,947.80	0.13
203	688008	澜起科技	200	16,774.00	0.13
204	603737	三棵树	120	16,698.00	0.13
205	603185	上机数控	100	16,698.00	0.13
206	601727	上海电气	3,400	16,524.00	0.13
207	600188	兖矿能源	700	16,471.00	0.13
208	601111	中国国航	1,800	16,434.00	0.12
209	601788	光大证券	1,100	16,423.00	0.12
210	000408	藏格矿业	400	16,400.00	0.12
211	603369	今世缘	300	16,320.00	0.12
212	002841	视源股份	200	16,280.00	0.12
213	300390	天华超净	200	16,200.00	0.12
214	600845	宝信软件	266	16,180.78	0.12
215	600038	中直股份	200	16,060.00	0.12
216	002850	科达利	100	16,034.00	0.12
217	600918	中泰证券	1,600	15,952.00	0.12
218	601689	拓普集团	300	15,900.00	0.12
219	002202	金风科技	961	15,827.67	0.12
220	002120	韵达股份	770	15,754.20	0.12
221	601916	浙商银行	4,500	15,750.00	0.12
222	600039	四川路桥	1,300	15,652.00	0.12
223	600383	金地集团	1,200	15,564.00	0.12
224	600584	长电科技	500	15,510.00	0.12
225	000069	华侨城 A	2,200	15,488.00	0.12
226	002414	高德红外	638	15,445.98	0.12
227	603816	顾家家居	200	15,432.00	0.12

228	002074	国轩高科	300	15,375.00	0.12
229	601939	建设银行	2,600	15,236.00	0.12
230	600795	国电电力	4,800	15,216.00	0.12
231	600132	重庆啤酒	100	15,132.00	0.12
232	603486	科沃斯	100	15,095.00	0.11
233	600219	南山铝业	3,200	15,072.00	0.11
234	600233	圆通速递	900	15,012.00	0.11
235	600875	东方电气	700	14,994.00	0.11
236	600885	宏发股份	200	14,928.00	0.11
237	300450	先导智能	200	14,874.00	0.11
238	688126	沪硅产业	576	14,872.32	0.11
239	002756	永兴材料	100	14,802.00	0.11
240	603707	健友股份	351	14,742.00	0.11
241	601995	中金公司	300	14,709.00	0.11
242	601966	玲珑轮胎	400	14,620.00	0.11
243	300033	同花顺	100	14,458.00	0.11
244	002625	光启技术	600	14,406.00	0.11
245	002180	纳思达	300	14,328.00	0.11
246	002007	华兰生物	490	14,278.60	0.11
247	300725	药石科技	100	14,217.00	0.11
248	603589	口子窖	200	14,174.00	0.11
249	002920	德赛西威	100	14,151.00	0.11
250	600183	生益科技	600	14,130.00	0.11
251	600009	上海机场	300	14,007.00	0.11
252	603939	益丰药房	254	13,997.94	0.11
253	002600	领益智造	1,900	13,984.00	0.11
254	603198	迎驾贡酒	200	13,890.00	0.11
255	600061	国投资本	1,684	13,842.48	0.11
256	300496	中科创达	100	13,842.00	0.11
257	300595	欧普康视	240	13,768.80	0.10
258	600018	上港集团	2,500	13,700.00	0.10
259	600332	白云山	400	13,680.00	0.10
260	603517	绝味食品	200	13,666.00	0.10
261	000157	中联重科	1,900	13,623.00	0.10
262	600522	中天科技	800	13,568.00	0.10
263	002384	东山精密	500	13,550.00	0.10
264	300146	汤臣倍健	500	13,480.00	0.10
265	002340	格林美	1,300	13,455.00	0.10
266	601881	中国银河	1,200	13,428.00	0.10
267	300223	北京君正	100	13,400.00	0.10
268	600362	江西铜业	600	13,398.00	0.10
269	688180	君实生物	200	13,396.00	0.10
270	000977	浪潮信息	372	13,328.76	0.10
271	603260	合盛硅业	100	13,197.00	0.10

272	601878	浙商证券	1,000	13,180.00	0.10
273	600486	扬农化工	100	13,120.00	0.10
274	600884	杉杉股份	400	13,108.00	0.10
275	601615	明阳智能	500	13,050.00	0.10
276	688099	晶晨股份	100	13,020.00	0.10
277	002192	融捷股份	100	13,015.00	0.10
278	603899	晨光文具	200	12,902.00	0.10
279	600115	中国东航	2,500	12,900.00	0.10
280	601233	桐昆股份	600	12,708.00	0.10
281	000425	徐工机械	2,100	12,579.00	0.10
282	002064	华峰化学	1,200	12,528.00	0.10
283	600674	川投能源	1,000	12,500.00	0.09
284	000733	振华科技	100	12,428.00	0.09
285	600499	科达制造	500	12,410.00	0.09
286	600399	抚顺特钢	500	12,385.00	0.09
287	002252	上海莱士	1,800	12,276.00	0.09
288	600161	天坛生物	420	12,163.20	0.09
289	000738	航发控制	400	12,112.00	0.09
290	600298	安琪酵母	200	12,072.00	0.09
291	601216	君正集团	2,300	12,029.00	0.09
292	600733	北汽蓝谷	1,200	12,024.00	0.09
293	605358	立昂微	100	12,001.00	0.09
294	601838	成都银行	1,000	12,000.00	0.09
295	002353	杰瑞股份	300	12,000.00	0.09
296	600779	水井坊	100	11,999.00	0.09
297	601636	旗滨集团	700	11,970.00	0.09
298	002568	百润股份	200	11,966.00	0.09
299	601058	赛轮轮胎	800	11,832.00	0.09
300	600256	广汇能源	1,800	11,772.00	0.09
301	300529	健帆生物	220	11,726.00	0.09
302	600754	锦江酒店	200	11,720.00	0.09
303	000831	五矿稀土	300	11,706.00	0.09
304	600732	爱旭股份	500	11,680.00	0.09
305	000513	丽珠集团	290	11,660.90	0.09
306	002240	盛新锂能	200	11,590.00	0.09
307	603127	昭衍新药	100	11,543.00	0.09
308	002385	大北农	1,100	11,539.00	0.09
309	002185	华天科技	900	11,439.00	0.09
310	300724	捷佳伟创	100	11,430.00	0.09
311	601555	东吴证券	1,287	11,402.82	0.09
312	600352	浙江龙盛	900	11,367.00	0.09
313	600141	兴发集团	300	11,364.00	0.09
314	601021	春秋航空	200	11,360.00	0.09
315	002223	鱼跃医疗	300	11,340.00	0.09



316	000066	中国长城	800	11,328.00	0.09
317	300003	乐普医疗	500	11,315.00	0.09
318	000783	长江证券	1,500	11,310.00	0.09
319	300037	新宙邦	100	11,300.00	0.09
320	603456	九洲药业	200	11,252.00	0.09
321	002268	卫士通	200	11,188.00	0.09
322	002372	伟星新材	460	11,187.20	0.09
323	002624	完美世界	550	11,170.50	0.08
324	603882	金域医学	100	11,137.00	0.08
325	601108	财通证券	1,000	11,120.00	0.08
326	603019	中科曙光	400	11,028.00	0.08
327	600803	新奥股份	600	11,016.00	0.08
328	603568	伟明环保	300	10,959.00	0.08
329	600157	永泰能源	6,000	10,920.00	0.08
330	000703	恒逸石化	1,020	10,832.40	0.08
331	002508	老板电器	300	10,806.00	0.08
332	603160	汇顶科技	100	10,777.00	0.08
333	600489	中金黄金	1,300	10,699.00	0.08
334	000519	中兵红箭	400	10,668.00	0.08
335	300144	宋城演艺	740	10,596.80	0.08
336	002532	天山铝业	1,300	10,595.00	0.08
337	000825	太钢不锈	1,500	10,560.00	0.08
338	600516	方大炭素	975	10,549.50	0.08
339	000739	普洛药业	300	10,527.00	0.08
340	601198	东兴证券	900	10,467.00	0.08
341	002176	江特电机	500	10,380.00	0.08
342	002024	苏宁易购	2,500	10,300.00	0.08
343	300251	光线传媒	800	10,280.00	0.08
344	002326	永太科技	200	10,242.00	0.08
345	600606	绿地控股	2,345	10,177.30	0.08
346	603233	大参林	240	10,106.40	0.08
347	000009	中国宝安	700	10,101.00	0.08
348	688567	孚能科技	300	10,095.00	0.08
349	300253	卫宁健康	600	10,056.00	0.08
350	300726	宏达电子	100	10,006.00	0.08
351	002266	浙富控股	1,400	9,968.00	0.08
352	688009	中国通号	2,000	9,960.00	0.08
353	601607	上海医药	500	9,935.00	0.08
354	601990	南京证券	1,000	9,910.00	0.08
355	603218	日月股份	300	9,885.00	0.08
356	002028	思源电气	200	9,842.00	0.07
357	000932	华菱钢铁	1,920	9,811.20	0.07
358	600096	云天化	500	9,810.00	0.07
359	600392	盛和资源	500	9,810.00	0.07

360	000423	东阿阿胶	200	9,750.00	0.07
361	000630	铜陵有色	2,800	9,744.00	0.07
362	601933	永辉超市	2,400	9,720.00	0.07
363	600023	浙能电力	2,400	9,696.00	0.07
364	002531	天顺风能	500	9,695.00	0.07
365	002673	西部证券	1,200	9,684.00	0.07
366	603613	国联股份	90	9,675.00	0.07
367	603338	浙江鼎力	120	9,631.20	0.07
368	600027	华电国际	1,800	9,630.00	0.07
369	000728	国元证券	1,250	9,625.00	0.07
370	600642	申能股份	1,300	9,581.00	0.07
371	002405	四维图新	600	9,552.00	0.07
372	600705	中航产融	2,400	9,528.00	0.07
373	600369	西南证券	1,800	9,522.00	0.07
374	000983	山西焦煤	1,140	9,427.80	0.07
375	002603	以岭药业	480	9,408.00	0.07
376	601162	天风证券	2,300	9,315.00	0.07
377	000998	隆平高科	400	9,304.00	0.07
378	300088	长信科技	700	9,296.00	0.07
379	002739	万达电影	600	9,288.00	0.07
380	002463	沪电股份	560	9,284.80	0.07
381	600655	豫园股份	900	9,270.00	0.07
382	601077	渝农商行	2,400	9,240.00	0.07
383	002444	巨星科技	300	9,153.00	0.07
384	000050	深天马 A	700	9,114.00	0.07
385	600487	亨通光电	600	9,072.00	0.07
386	002939	长城证券	700	9,065.00	0.07
387	600109	国金证券	800	9,064.00	0.07
388	600549	厦门钨业	400	9,052.00	0.07
389	600160	巨化股份	700	9,037.00	0.07
390	600079	人福医药	400	9,008.00	0.07
391	002430	杭氧股份	300	9,003.00	0.07
392	002407	多氟多	200	8,998.00	0.07
393	000591	太阳能	800	8,960.00	0.07
394	000629	攀钢钒钛	2,300	8,947.00	0.07
395	300363	博腾股份	100	8,945.00	0.07
396	000807	云铝股份	800	8,936.00	0.07
397	601319	中国人保	1,900	8,930.00	0.07
398	601872	招商轮船	2,160	8,856.00	0.07
399	300832	新产业	200	8,810.00	0.07
400	600143	金发科技	700	8,806.00	0.07
401	600699	均胜电子	400	8,788.00	0.07
402	300676	华大基因	100	8,780.00	0.07
403	002456	欧菲光	900	8,730.00	0.07

404	600418	江淮汽车	500	8,700.00	0.07
405	300073	当升科技	100	8,687.00	0.07
406	603712	七一二	200	8,660.00	0.07
407	600170	上海建工	2,400	8,640.00	0.07
408	002497	雅化集团	300	8,598.00	0.07
409	601577	长沙银行	1,100	8,591.00	0.07
410	000027	深圳能源	1,060	8,586.00	0.07
411	601699	潞安环能	755	8,539.05	0.06
412	002925	盈趣科技	250	8,507.50	0.06
413	600637	东方明珠	900	8,505.00	0.06
414	300308	中际旭创	200	8,500.00	0.06
415	600801	华新水泥	440	8,492.00	0.06
416	002044	美年健康	1,080	8,478.00	0.06
417	601016	节能风电	1,300	8,463.00	0.06
418	000999	华润三九	247	8,457.28	0.06
419	300699	光威复材	100	8,448.00	0.06
420	600521	华海药业	390	8,447.40	0.06
421	002030	达安基因	420	8,425.20	0.06
422	002408	齐翔腾达	800	8,400.00	0.06
423	000860	顺鑫农业	220	8,399.60	0.06
424	000988	华工科技	300	8,358.00	0.06
425	002152	广电运通	700	8,330.00	0.06
426	600704	物产中大	1,400	8,288.00	0.06
427	603658	安图生物	150	8,259.00	0.06
428	000800	一汽解放	800	8,232.00	0.06
429	002294	信立泰	300	8,196.00	0.06
430	603077	和邦生物	2,400	8,184.00	0.06
431	601168	西部矿业	600	8,166.00	0.06
432	600177	雅戈尔	1,180	8,130.20	0.06
433	002409	雅克科技	100	8,117.00	0.06
434	600859	王府井	300	8,100.00	0.06
435	600315	上海家化	200	8,082.00	0.06
436	002797	第一创业	1,100	8,052.00	0.06
437	002153	石基信息	280	8,047.20	0.06
438	002078	太阳纸业	700	8,043.00	0.06
439	300558	贝达药业	100	7,983.00	0.06
440	000155	川能动力	300	7,959.00	0.06
441	603156	养元饮品	280	7,954.80	0.06
442	688002	睿创微纳	100	7,857.00	0.06
443	000960	锡业股份	400	7,812.00	0.06
444	600739	辽宁成大	400	7,808.00	0.06
445	002156	通富微电	400	7,772.00	0.06
446	601179	中国西电	1,400	7,770.00	0.06
447	002157	正邦科技	800	7,728.00	0.06

448	603638	艾迪精密	240	7,660.80	0.06
449	002138	顺络电子	200	7,636.00	0.06
450	000830	鲁西化工	500	7,630.00	0.06
451	300136	信维通信	300	7,596.00	0.06
452	600872	中炬高新	200	7,594.00	0.06
453	002422	科伦药业	400	7,572.00	0.06
454	002507	涪陵榨菜	200	7,560.00	0.06
455	002145	中核钛白	600	7,554.00	0.06
456	600338	西藏珠峰	200	7,532.00	0.06
457	600711	盛屯矿业	700	7,511.00	0.06
458	002690	美亚光电	200	7,492.00	0.06
459	600998	九州通	500	7,360.00	0.06
460	000987	越秀金控	845	7,351.50	0.06
461	300568	星源材质	200	7,346.00	0.06
462	000683	远兴能源	1,000	7,300.00	0.06
463	600598	北大荒	500	7,280.00	0.06
464	600415	小商品城	1,500	7,275.00	0.06
465	600153	建发股份	800	7,256.00	0.06
466	002299	圣农发展	300	7,251.00	0.06
467	600004	白云机场	600	7,236.00	0.05
468	300677	英科医疗	125	7,230.00	0.05
469	300296	利亚德	700	7,175.00	0.05
470	000709	河钢股份	2,900	7,134.00	0.05
471	300212	易华录	200	7,070.00	0.05
472	688779	长远锂科	300	7,032.00	0.05
473	600497	驰宏锌锗	1,400	6,986.00	0.05
474	601456	国联证券	500	6,985.00	0.05
475	002010	传化智联	800	6,960.00	0.05
476	300418	昆仑万维	300	6,945.00	0.05
477	002500	山西证券	1,050	6,930.00	0.05
478	600909	华安证券	1,280	6,924.80	0.05
479	002926	华西证券	700	6,895.00	0.05
480	600208	新潮中宝	2,300	6,854.00	0.05
481	600848	上海临港	460	6,840.20	0.05
482	601866	中远海发	2,100	6,825.00	0.05
483	603866	桃李面包	240	6,816.00	0.05
484	600008	首创环保	1,980	6,751.80	0.05
485	603858	步长制药	320	6,748.80	0.05
486	601696	中银证券	500	6,725.00	0.05
487	600271	航天信息	500	6,695.00	0.05
488	002511	中顺洁柔	400	6,684.00	0.05
489	000547	航天发展	400	6,680.00	0.05
490	002092	中泰化学	700	6,678.00	0.05
491	000516	国际医学	600	6,618.00	0.05

492	600066	宇通客车	600	6,612.00	0.05
493	002465	海格通信	600	6,552.00	0.05
494	600688	上海石化	1,562	6,513.54	0.05
495	300070	碧水源	900	6,471.00	0.05
496	601231	环旭电子	400	6,424.00	0.05
497	600977	中国电影	500	6,405.00	0.05
498	600390	五矿资本	1,200	6,384.00	0.05
499	600110	诺德股份	400	6,380.00	0.05
500	600535	天士力	400	6,340.00	0.05
501	601118	海南橡胶	1,200	6,336.00	0.05
502	000021	深科技	400	6,336.00	0.05
503	000975	银泰黄金	720	6,321.60	0.05
504	600511	国药股份	200	6,306.00	0.05
505	000656	金科股份	1,400	6,272.00	0.05
506	002626	金达威	200	6,266.00	0.05
507	601106	中国一重	1,800	6,264.00	0.05
508	601997	贵阳银行	960	6,249.60	0.05
509	601992	金隅集团	2,200	6,248.00	0.05
510	002065	东华软件	800	6,240.00	0.05
511	002032	苏泊尔	100	6,224.00	0.05
512	600166	福田汽车	1,800	6,192.00	0.05
513	000750	国海证券	1,500	6,165.00	0.05
514	600380	健康元	480	6,163.20	0.05
515	002557	洽洽食品	100	6,136.00	0.05
516	002506	协鑫集成	1,600	6,080.00	0.05
517	600895	张江高科	400	6,024.00	0.05
518	002373	千方科技	400	5,980.00	0.05
519	600988	赤峰黄金	400	5,960.00	0.05
520	300383	光环新网	400	5,936.00	0.05
521	601099	太平洋	1,800	5,904.00	0.04
522	300432	富临精工	200	5,880.00	0.04
523	600297	广汇汽车	2,200	5,874.00	0.04
524	002429	兆驰股份	1,200	5,832.00	0.04
525	300773	拉卡拉	200	5,804.00	0.04
526	003035	南网能源	700	5,803.00	0.04
527	002958	青农商行	1,500	5,790.00	0.04
528	002212	天融信	300	5,751.00	0.04
529	300357	我武生物	100	5,730.00	0.04
530	600737	中粮糖业	600	5,640.00	0.04
531	600583	海油工程	1,200	5,532.00	0.04
532	002558	巨人网络	459	5,494.23	0.04
533	600867	通化东宝	500	5,480.00	0.04
534	002563	森马服饰	700	5,411.00	0.04
535	600498	烽火通信	300	5,394.00	0.04

536	601598	中国外运	1,200	5,376.00	0.04
537	002541	鸿路钢构	100	5,354.00	0.04
538	600827	百联股份	400	5,332.00	0.04
539	600026	中远海能	900	5,328.00	0.04
540	002146	荣盛发展	1,200	5,220.00	0.04
541	000686	东北证券	591	5,188.98	0.04
542	600536	中国软件	100	4,993.00	0.04
543	603883	老百姓	100	4,938.00	0.04
544	300339	润和软件	200	4,554.00	0.03
545	002151	北斗星通	100	3,925.00	0.03

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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 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	464,824.00	0.73
2	600519	贵州茅台	401,273.00	0.63
3	300750	宁德时代	276,038.00	0.43
4	300759	康龙化成	210,917.00	0.33
5	601888	中国中免	202,181.00	0.32
6	600905	三峡能源	186,818.00	0.29
7	600809	山西汾酒	179,690.00	0.28
8	601816	京沪高铁	178,227.00	0.28
9	002352	顺丰控股	176,284.00	0.28
10	000858	五粮液	162,431.00	0.25
11	002594	比亚迪	141,596.00	0.22
12	600309	万华化学	136,435.00	0.21
13	601658	邮储银行	127,850.00	0.20
14	300760	迈瑞医疗	127,596.00	0.20
15	603501	韦尔股份	123,252.00	0.19
16	300015	爱尔眼科	121,444.00	0.19
17	002812	恩捷股份	117,263.00	0.18
18	300601	康泰生物	110,980.00	0.17
19	601825	沪农商行	100,383.10	0.16
20	300059	东方财富	95,744.00	0.15

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。

## 8.4.2 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	300750	宁德时代	1,646,530.00	2.58
2	000858	五粮液	1,451,448.00	2.27
3	002415	海康威视	746,353.01	1.17
4	300760	迈瑞医疗	643,818.72	1.01
5	002594	比亚迪	634,355.00	0.99
6	600519	贵州茅台	604,968.00	0.95
7	000001	平安银行	567,332.00	0.89
8	300015	爱尔眼科	496,301.00	0.78
9	300059	东方财富	467,760.00	0.73
10	002714	牧原股份	447,127.00	0.70
11	002352	顺丰控股	440,834.00	0.69
12	002475	立讯精密	438,289.40	0.69
13	000568	泸州老窖	434,648.00	0.68
14	002304	洋河股份	398,470.00	0.62
15	300122	智飞生物	378,590.00	0.59
16	000333	美的集团	369,906.00	0.58
17	000002	万科 A	342,429.00	0.54
18	300014	亿纬锂能	334,335.00	0.52
19	002812	恩捷股份	321,710.00	0.50
20	002142	宁波银行	304,351.00	0.48

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。

## 8.4.3 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

买入股票的成本（成交）总额	14,451,622.03
卖出股票的收入（成交）总额	36,582,142.31

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。

## 8.5 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。

#### **8.6 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。

#### **8.7 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。

#### **8.8 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投资。

#### **8.9 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。

#### **8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

##### **8.10.1 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。

##### **8.10.2 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。

#### **8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

##### **8.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金合同无国债期货投资政策。

##### **8.11.2 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。

#### **8.12 本报告期投资基金情况**

##### **8.12.1 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。



### 8.13 投资组合报告附注

8.13.1“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。

8.13.2 本报告期末，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之外的股票。

#### 8.13.3 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	3,405.92
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	139.24
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,545.16

#### 8.13.4 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。

#### 8.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 8.13.5.1 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。

##### 8.13.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

### 8.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 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
79	89,780.25	5,944,640.00	83.81%	1,148,000.00	16.19%

### 9.2 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	3,653,100.00	51.51%
2	华泰证券股份有限公司	1,669,200.00	23.53%
3	中信证券股份有限公司	609,340.00	8.59%
4	孙楠	189,400.00	2.67%
5	孙曦	100,000.00	1.41%
6	颜琼端	100,000.00	1.41%
7	段增恩	90,000.00	1.27%
8	李亦蒙	50,000.00	0.70%
9	门春艳	50,000.00	0.70%
10	温梦飞	50,000.00	0.70%

### 9.3 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%

**9.4 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

**§10 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	30,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	7,092,640.00

**§11 重大事件揭示****11.1 基金份额持有人大会决议**

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

**11.2 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，翟晨曦女士担任公司董事长，张宗友先生担任公司联席董事长。2021年5月26日，于春玲女士担任公司总经理，翟晨曦女士不再代任总经理职务。2021年9月22日，申峰旗先生不再担任副总经理。

本报告期，公司董事刘全胜先生离任，增补于春玲女士为董事。本年度，公司监事赵志刚先生离职，增补王建岭先生为职工监事。

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。

2021年8月，中国农业银行总行决定王霄勇任托管业务部副总裁。

**11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼**

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

**11.4 基金投资策略的改变**

2021年1月8日，本基金投资策略增加存托凭证的投资策略。

### 11.5 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。

### 11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

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），报告年度应支付给其报酬 80000 元人民币。审计年限为 1 年。自 2020 年，致同会计师事务所为本基金连续提供 2 年审计服务。

### 11.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人报告期收到重庆证监局对公司和相关人员的行政监管措施，公司已按要求改正并报告。

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。

### 11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.8.1 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	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	3	22,368,522.67	44.53%	4,123.79	15.64%	-
东方财富证券	2	4,655,504.90	9.27%	3,404.80	12.91%	-
天风证券	1	4,510,584.77	8.98%	3,298.54	12.51%	-
国盛证券	2	4,322,439.32	8.60%	3,160.77	11.99%	-
华西证券	1	3,416,349.91	6.80%	3,181.76	12.07%	-
中信证券	2	3,337,185.00	6.64%	3,108.08	11.79%	-
浙商证券	1	2,121,826.00	4.22%	1,551.75	5.89%	-
中泰证券	2	1,541,208.85	3.07%	1,160.63	4.40%	-
东兴证券	2	753,197.30	1.50%	550.93	2.09%	-

恒泰证券	2	696,388.06	1.39%	648.51	2.46%	-
中金公司	1	629,475.12	1.25%	586.25	2.22%	-
光大证券	1	415,180.00	0.83%	386.62	1.47%	-
国泰君安	1	315,272.20	0.63%	293.53	1.11%	-
中银国际证券	2	314,726.87	0.63%	230.13	0.87%	-
银河证券	1	197,220.35	0.39%	144.22	0.55%	-
申万宏源	1	182,027.70	0.36%	169.55	0.64%	-
华创证券	2	159,387.22	0.32%	116.56	0.44%	-
国金证券	1	108,119.84	0.22%	100.70	0.38%	-
渤海证券	1	73,678.66	0.15%	53.89	0.20%	-
兴业证券	1	66,928.64	0.13%	62.34	0.24%	-
信达证券	1	31,682.00	0.06%	23.16	0.09%	-
安信证券	1	14,956.93	0.03%	10.95	0.04%	-

注：本基金根据中国证券监督管理委员会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》（证监基金字[1998]29号）以及《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，本基金共租用44个交易席位，其中报告期内新增0个交易席位，退租1个交易席位。其中退租席位为：1个渤海证券深圳席位。

#### 一、交易席位的分配依据

交易席位的分配以券商实力及其所提供的研究支持为基础，主要考察点包括：

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

#### 二、交易席位的选择流程

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

#### 三、交易量的分配

交易量的分配以券商所提供的服务及研究支持为基础，主要考察点包括：

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

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

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

和评分高低成正比。

3、交易部负责落实交易量的实际分配工作。

### 11.8.2 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	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-

安信证券	-	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---	---

### 11.9 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	中国证券报、上海证券报	2021-03-30

	2020 年年度报告提示性公告	报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	
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
21	新华基金管理股份有限公司旗下全部基金 2021 年第 2 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	2021-07-20
22	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 2 季度报告	公司网站、电子信披网站	2021-07-20
23	新华基金管理股份有限公司关于新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金增加中信华南证券股份有限公司为销售机构的公告	证券时报、公司网站、电子信披网站	2021-08-21
24	新华基金管理股份有限公司旗下全部基金 2021 年中期报告提示性公告	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	2021-08-27
25	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	公司网站、电子信披网站	2021-08-27
26	新华基金管理股份有限公司基金行业高级管	中国证券报、公司网站、	2021-09-24



	理人员变更公告	电子信披网站	
27	新华基金管理股份有限公司关于办公地址及直销表单变更的公告	中国证券报、公司网站、电子信披网站	2021-10-08
28	新华基金管理股份有限公司旗下全部基金第 3 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	2021-10-26
29	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 3 季度报告	公司网站、电子信披网站	2021-10-26
30	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	2021-12-24
31	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（更新）	公司网站、电子信披网站	2021-12-24
32	新华基金管理股份有限公司关于调整直销柜台及网上直销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	2021-12-28

## 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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	20210101-202112 31	30,638,700.00	934,300.00	27,919,900.00	3,653,100.00	51.51%
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> <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；</p> <p>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</p>							

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的第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  $\beta$  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。

## 12.2 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。

## §13 备查文件目录

### 13.1 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基金合同》
- (四)《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》
- (五)《新华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》
- (六)更新的《新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》
- (七)《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》(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)重庆市工商行政管理局关于核准新华基金管理有限公司变更公司名称、变更住所的批复
- (十一)中国证监会要求的其他文件

### 13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

### 13.3 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

二〇二二年三月三十日