

# MSCI 中国 A 股国际通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：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：2022 年 3 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。

本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由总经理（代为履行董事长职务）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 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。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	6
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	8
§4 管理人报告.....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.9 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	13
§5 托管人报告.....	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	14
§6 审计报告.....	14
6.1 审计报告基本信息.....	14
6.2 审计报告的基本内容.....	14
§7 年度财务报表.....	17
7.1 资产负债表.....	17
7.2 利润表.....	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
7.4 报表附注.....	20
§8 投资组合报告.....	50
8.1 期末基金资产组合情况.....	50
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	50
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.....	51
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	64
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	66

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 .....	66
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 .....	66
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 .....	67
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 .....	67
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	67
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	67
8.12	投资组合报告附注 .....	67
§9	基金份额持有人信息 .....	69
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	69
9.2	期末上市基金前十名持有人 .....	69
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	70
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情况 .....	70
9.5	期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况 .....	70
§10	开放式基金份额变动 .....	70
§11	重大事件揭示 .....	70
11.1	基金份额持有人大会决议 .....	70
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 .....	70
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	71
11.4	基金投资策略的改变 .....	71
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	71
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	71
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	71
11.8	其他重大事件 .....	72
§12	影响投资者决策的其他重要信息 .....	75
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 .....	75
12.2	影响投资者决策的其他重要信息 .....	75
§13	备查文件目录 .....	75
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	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	317,777,775.00 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

注：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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.nffund.com">http://www.nffund.com</a>
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
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、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

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	108,141,495.72	229,614,175.73	120,912,489.48
本期利润	24,887,657.32	275,470,879.85	332,740,718.04
加权平均基金份额本期利润	0.0665	0.4903	0.4121
本期加权平均净值利润率	3.88%	35.64%	40.15%
本期基金份额净值增长率	4.41%	43.32%	40.31%
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	236,234,678.73	317,832,619.37	86,673,509.31
期末可供分配基金份额利润	0.7433	0.6234	0.1431
期末基金资产净值	554,012,453.73	851,224,039.70	705,765,960.99
期末基金份额净值	1.7434	1.6698	1.1651
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	74.34%	66.98%	16.51%

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。

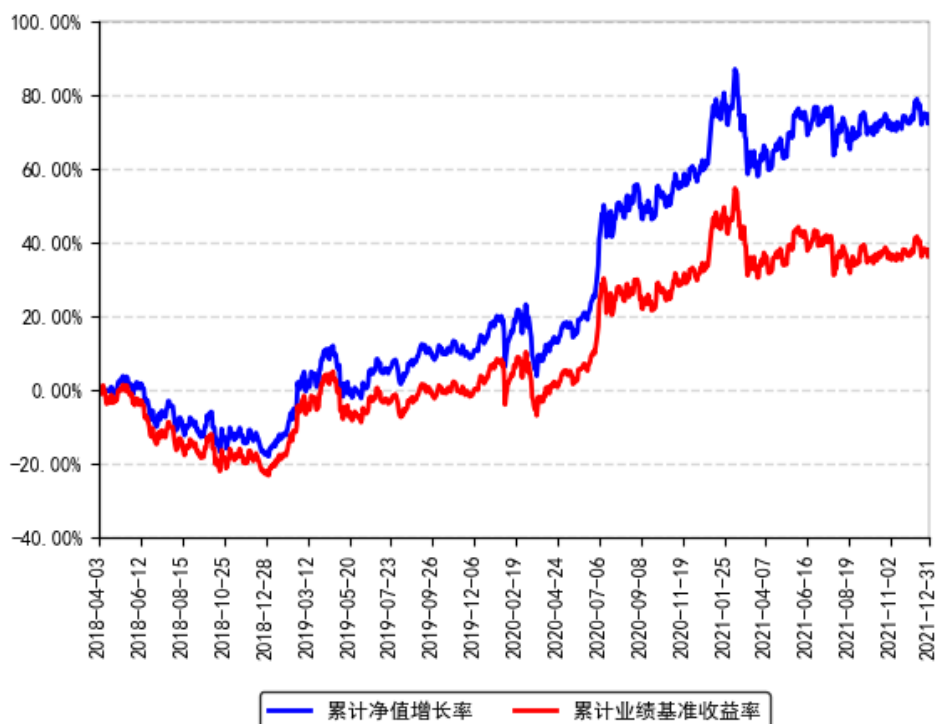
### 3.2 基金净值表现

#### 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
过去三个月	2.05%	0.76%	1.57%	0.75%	0.48%	0.01%
过去六个月	-1.31%	1.00%	-3.66%	0.99%	2.35%	0.01%
过去一年	4.41%	1.17%	-0.40%	1.16%	4.81%	0.01%
过去三年	109.95%	1.28%	77.01%	1.28%	32.94%	0.00%
自基金合同生效起至今	74.34%	1.29%	37.73%	1.30%	36.61%	-0.01%

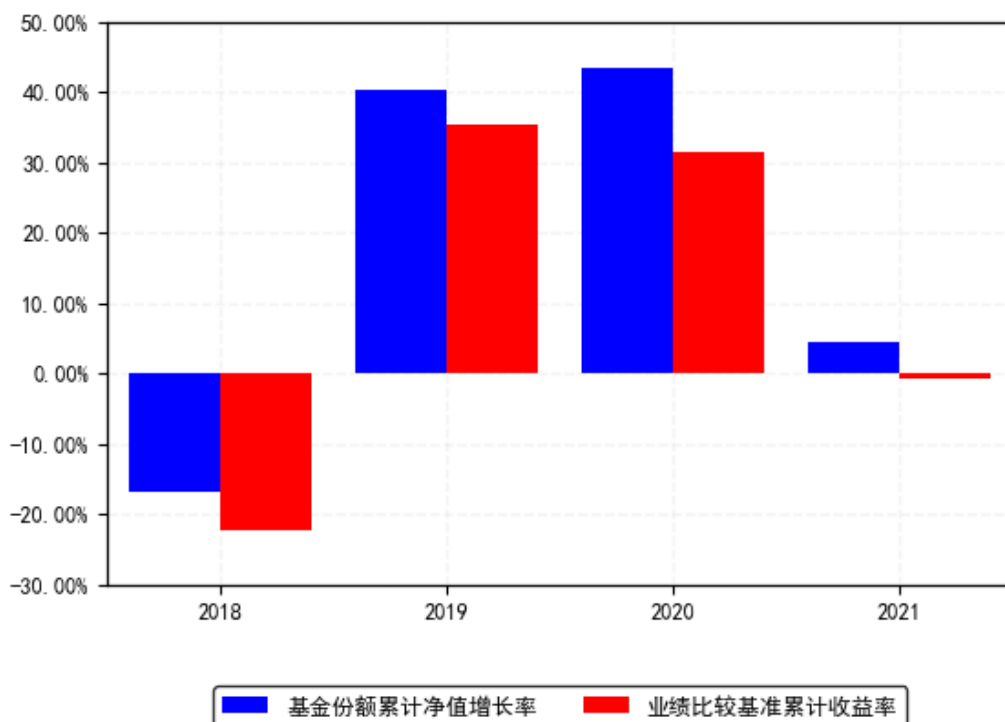
#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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



### 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

MSCI 中国A股国际通ETF每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：基金合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

## § 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

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) 1.72%、厦门合泽祥企业管理合伙企业(有限合伙)2.24%、厦门合泽益企业管理合伙企业(有限合伙) 2.25%、厦门合泽盈企业管理合伙企业(有限合伙) 2.32%。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 1.5 万亿元，旗下管理 274 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；2021 年 7 月 2 日至今，任南方中证香港科技 ETF（QDII）基金经理；2021 年 10 月 22 日至今，任南方中证全指医疗保健 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	14	72,128,116,692.59	2013 年 4 月 22 日
	私募资产管理计划	8	4,068,061,809.18	2020 年 8 月 7 日
	其他组合	-	-	-
	合计	22	76,196,178,501.77	-

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

公司基金经理薪酬由工资、奖金等部分构成。工资由基金经理的 MD 职位职级决定，重点体现员工能力和职位价值导向原则；奖金由员工的绩效贡献决定，重点体现绩效导向与差异化原则。对于兼任私募资产管理计划的基金经理，公司对私募资产管理计划产生的超额业绩报酬实施对应激励，按超出基础创收以上部分的一定比例计提激励奖金，并依据其管理产品的长期业绩与个人综合贡献情况实施分配。

## 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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定，针对股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等投资管理活动，以及授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节，建立了股票、债券、基金等证券池管理制度和细则，投资管理制度和细则，集中交易管理办法，公平交易操作指引，异常交易管理制度等公平交易相关的公司制度或流程指引。通过加强投资决策、交易执行的内部控制，完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估，以及履行相关的报告和信息披露义务，切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为，保护投资者合法权益。

### 4.3.2 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。

#### 4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本基金管理人依据《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》的要求，建立和完善了兼任相关的制度及流程，确保兼任基金经理公平对待其管理的所有投资组合。通过对基金经理的投资交易行为进行监控和分析，本报告期内，两两组合间各项操作、流程及事后分析均正常，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

#### 4.3.3 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 国际通指数微跌。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 1.7434 元，报告期内，份额净值增长率为 4.41%，同期业绩基准增长率为-0.40%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经济复苏高点已过，下行压力开始显现，2022 年上半年经济相对走弱，重要会议召开在即，稳增长政策预期较强。中央经济会议稳字当头，央行降准降息相继落地，进一步增强货币宽松预期。经过市场调整后，当前估值已明显降低，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，本基金管理人根据法律法规、监管要求、自律规则和业务发展情况，严格遵循包括《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》在内的公募基金行业各项法律法规及其他规范要求，有效落实了 2021 年度发布的《关于依法从严打击证券违法活动的意见》《证券期货业网络安全事件报告与调查处理办法》和《个人信息保护法》等公募基金相关新法律法规。

本基金管理人坚持从保护基金份额持有人利益出发，树立并坚守“全员合规、合规从高层做起、合规创造价值、合规是公司生存基础、合规为先、行稳致远”的合规理念，继续致力于合规与内控机制的完善，通过有效过程管控，将合规管理全面深度嵌入流程与业务，积极推动主动合规风控管理，持续加强业务风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，有效保障了旗下基金及公司各项业务合法合规、稳健有序运作开展。

本报告期内，本基金管理人结合新法规的实施、新的监管要求和公司业务发展实际情况，积极推动监管新规落实，持续完善内部控制体系和内部控制制度、业务流程，制订和修订了包括《合规手册》《制度管理办法》《廉洁从业内部控制制度》《内控稽核工作操作指引》《“洗钱和恐怖融资风险”自评估制度》和《反洗钱内部控制制度》等一系列与监察稽核和合规内控相关的管理制度。

在进一步优化制度体系的基础上，本基金管理人积极开展形式丰富的合规培训与考试，加强员工行为规范检查、严格进行合规问责，强化全员合规、主动合规理念；对投研交易、市场销售、后台运营及人员管理等业务和相关部门开展了定期稽核、专项稽核及多项自查，检查业务开展的合规性和制度执行的有效性，排查业务中的风险点并完善内控措施，促进公司业务合规运作、稳健经营；采取事前防范、事中控制和事后监督等三阶段工作，持续完善投资合规风控制度流程和系统，加强流动性指标等重要指标的监控和内幕交易防控，有效确保投研交易业务合规运作；全面履行新产品、新业务合规评估程序，保障新产品、新业务合规开展；严格审查基金宣传推介材料以及包括网络直播脚本在内的其他宣传材料合规性，及时检查基金销售业务的合法合规情况，督促落实投资者适当性管理制度；完成各项信息披露工作，保障所披露信息的真实性、准确性和完整性；监督和落实客户投诉处理，重视媒体监督和投资者关系管理。

本基金管理人高度重视反洗钱相关工作，通过研究监管形势，开展洗钱风险自评估工作，参考同业先进经验，按照风险为本的工作思路，积极主动的采取有效措施防控洗钱风

险。从制度建设、系统功能建设、业务流程规范、宣传培训、监督检查等方面入手，将反洗钱工作贯穿于公司各项业务流程，有效提升了公司反洗钱工作的合规水平。

本基金管理人承诺将坚持诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，积极健全内部管理制度，不断提高监察稽核及合规管理工作的科学性和有效性，持续全面推进合规数字化工作在更广范围应用并与合规管理工作深度融合，努力防范和管理各类风险，切实维护基金资产的安全与利益。

#### 4.7 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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规的规定和基金合同的约定，以及本基金的实际运作情况，本基金报告期末未进行利润分配。在符合分红条件的前提下，本基金已实现尚未分配的可供分配收益部分，将严格按照基金合同的约定适时向投资者予以分配。

#### 4.9 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合规守信、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 审计报告

## 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2022)第 22032 号

## 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“南方 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 基金”)的财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p>

	<p>(二)我们的意见</p> <p>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”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了南方 MSCI 中国 A 股国际通 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。</p>
形成审计意见的基础	<p>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。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。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于南方 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 基金，并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>南方 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司(以下简称“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及允许的基金行业实务操作编制财务报表，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。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估南方 MSCI 中国 A 股国际通 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南方 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督南方 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>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</p>



	<p>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。</p> <p>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：</p> <p>(一) 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。(二) 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。(三) 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。</p> <p>(四) 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，根据获取的审计证据，就可能导致对南方 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 基金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南方 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、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。</p> <p>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。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	张振波；曹阳

会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2022 年 3 月 28 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 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 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	2,512,242.66	12,955,501.89
结算备付金		1,038,445.33	2,168,562.02
存出保证金		825,068.46	1,425,371.15
交易性金融资产	7.4.7.2	550,384,990.46	846,653,210.11
其中：股票投资		549,764,990.46	844,745,210.11
基金投资		-	-
债券投资		620,000.00	1,908,000.00
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		72,088.99	13,415,836.64
应收利息	7.4.7.5	702.49	1,388.70
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		554,833,538.39	876,619,870.51
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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	3,118,855.29
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		230,057.83	556,202.25

应付托管费		46,011.56	111,240.47
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	16,283.68	58,758.66
应交税费		-	4,081.35
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	528,731.59	21,546,692.79
负债合计		821,084.66	25,395,830.81
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	317,777,775.00	509,777,775.00
未分配利润	7.4.7.10	236,234,678.73	341,446,264.70
所有者权益合计		554,012,453.73	851,224,039.70
负债和所有者权益总计		554,833,538.39	876,619,870.51

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.7434 元，基金份额总额 317,777,775.00 份。

## 7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	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
一、收入		30,102,748.49	282,243,216.46
1.利息收入		35,074.41	64,922.11
其中：存款利息收入	7.4.7.11	34,583.07	64,590.42
债券利息收入		491.34	331.69
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）		110,576,305.98	236,587,482.70
其中：股票投资收益	7.4.7.12	99,889,296.34	224,167,193.27
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	498,789.41	410,336.02
资产支持证券投资 收益	7.4.7.13.5	-	-

贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	823,294.76	3,788,260.20
股利收益	7.4.7.16	9,364,925.47	8,221,693.21
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-83,253,838.40	45,856,704.12
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	2,745,206.50	-265,892.47
减：二、费用		5,215,091.17	6,772,336.61
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	3,221,489.29	3,878,022.32
2.托管费	7.4.10.2.2	644,297.83	775,604.51
3.销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4.交易费用	7.4.7.19	834,498.45	1,494,574.10
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		3,336.52	13,638.83
7.其他费用	7.4.7.20	511,469.08	610,496.85
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		24,887,657.32	275,470,879.85
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		24,887,657.32	275,470,879.85

### 7.3 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 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）	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）	-	24,887,657.32	24,887,657.32
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）	-192,000,000.00	-130,099,243.29	-322,099,243.29
其中：1.基金申购款	330,000,000.00	242,154,337.13	572,154,337.13
2.基金赎回款	-522,000,000.00	-372,253,580.42	-894,253,580.42
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）	317,777,775.00	236,234,678.73	554,012,453.73
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）	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）	-	275,470,879.85	275,470,879.85
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）	-96,000,000.00	-34,012,801.14	-130,012,801.14
其中：1.基金申购款	1,156,000,000.00	461,855,601.28	1,617,855,601.28
2.基金赎回款	-1,252,000,000.00	-495,868,402.42	-1,747,868,402.42
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）	509,777,775.00	341,446,264.70	851,224,039.70

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)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]408 号《关于准予 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》注册，由南方基金管理股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《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》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,309,777,775.00 元(含募集股票市值)，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2018)第 0216 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《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》于 2018 年 4 月 3 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为

1,309,777,775.00 份基金份额，无认购资金利息折合基金份额。本基金的基金管理人为南方基金管理股份有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2018]45 号审核同意，本基金 1,309,777,775.00 份基金份额于 2018 年 4 月 27 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《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》的有关规定，本基金的投资目标是紧密跟踪 MSCI 中国 A 股国际通指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化；主要投资于 MSCI 中国 A 股国际通指数成份股和备选成份股。此外，本基金可少量投资于非成份股(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票以及存托凭证)、衍生工具(权证、股指期货等)、债券资产(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、现金资产、货币市场工具以及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的相关规定)。本基金投资于 MSCI 中国 A 股国际通指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。在正常市场情况下，本基金力争控制本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.1%，年跟踪误差不超过 2%。本基金的业绩比较基准为：MSCI 中国 A 股国际通指数收益率。

本基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司以本基金为目标 ETF，募集成立了 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(以下简称“MSCI 中国 A 股国际通 ETF 联接基金”)。MSCI 中国 A 股国际通 ETF 联接基金为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

本财务报表由本基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司于 2022 年 3 月 28 日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“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》、《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》和在财务报表附注 7.4.4 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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年度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 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、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。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。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债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，以公允价值计量且其变动计入当期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及其他金融负债。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。

### 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，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；对于支付的价款中包含的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。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。

对于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；对于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

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

#### 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/(累计亏损)。

#### 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。

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。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。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。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。

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）》（以下简称“指引”），按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(2) 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

财政部于2017年颁布了修订后的《企业会计准则第14号—收入》，本基金于2021年1月1日起执行。本基金在编制2021年度财务报表时已采用该准则，该准则的采用未对本基金财务报表产生重大影响。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 7.4.5.3 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。

#### 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，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	2,512,242.66	12,955,501.89
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	2,512,242.66	12,955,501.89

### 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		523,531,945.25	549,764,990.46	26,233,045.21
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	620,000.00	620,000.00	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	620,000.00	620,000.00	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		524,151,945.25	550,384,990.46	26,233,045.21
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		735,455,658.50	844,745,210.11	109,289,551.61
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	1,908,000.00	1,908,000.00	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	1,908,000.00	1,908,000.00	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		737,363,658.50	846,653,210.11	109,289,551.61

注：于 2021 年 12 月 31 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-6.00 元(2020 年 12 月 31 日：0.00 元)。

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目		本期末 2021 年 12 月 31 日			备注
		合同/名义金额	公允价值		
	资产		负债		
利率衍生工具		-	-	-	-
货币衍生工具		-	-	-	-
权益衍生工具		5,842,000.00	-	-	-
一股指期货		5,842,000.00	-	-	-
其他衍生工具		-	-	-	-
合计		5,842,000.00	-	-	-
项目		上年度末 2020 年 12 月 31 日			备注
		合同/名义金额	公允价值		
	资产		负债		

利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	8,818,168.00	-	-	-
—股指期货	8,818,168.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	8,818,168.00	-	-	-

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 12 月 31 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
IC2201	IC2201	2.00	2,951,120.00	85,120.00
IF2201	IF2201	2.00	2,968,440.00	-7,560.00
总额合计	-	4.00	5,919,560.00	77,560.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	77,560.00
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。

#### 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

本基金本报告期末及上年度末无各项买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无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	257.75	309.96
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	404.93	793.64
应收债券利息	14.81	146.20
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	25.00	138.90

合计	702.49	1,388.70
----	--------	----------

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

#### 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	16,283.68	58,758.66
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	16,283.68	58,758.66

#### 7.4.7.8 其他负债

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	-	-
应退退补款	284,363.89	21,107,960.46
预提费用	175,000.00	190,000.00
应付指数使用费	68,813.60	245,329.73
可退替代款	554.10	3,402.60
其他	-	-
合计	528,731.59	21,546,692.79

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

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

#### 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	509,777,775.00	509,777,775.00
本期申购	330,000,000.00	330,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-522,000,000.00	-522,000,000.00
基金拆分/份额折算前	-	-
基金份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	317,777,775.00	317,777,775.00

**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	317,832,619.37	23,613,645.33	341,446,264.70
本期利润	108,141,495.72	-83,253,838.40	24,887,657.32
本期基金份额交易产生的变动数	-146,954,224.83	16,854,981.54	-130,099,243.29
其中：基金申购款	250,300,421.23	-8,146,084.10	242,154,337.13
基金赎回款	-397,254,646.06	25,001,065.64	-372,253,580.42
本期已分配利润	-	-	-
本期末	279,019,890.26	-42,785,211.53	236,234,678.73

**7.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	8,689.36	20,165.15
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	22,901.64	42,301.67
其他	2,992.07	2,123.60
合计	34,583.07	64,590.42

**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 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
股票投资收益——买卖股票差价收入	63,412,089.27	151,304,652.96
股票投资收益——赎回差价收入	36,477,207.07	72,862,540.31
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	99,889,296.34	224,167,193.27

**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 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
卖出股票成交总额	583,271,424.58	994,253,549.89
减：卖出股票成本总额	519,859,335.31	842,948,896.93

买卖股票差价收入	63,412,089.27	151,304,652.96
----------	---------------	----------------

#### 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 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
赎回基金份额对价总额	894,253,580.42	1,747,868,402.42
减：现金支付赎回款总额	372,073,016.42	697,882,640.42
减：赎回股票成本总额	485,703,356.93	977,123,221.69
赎回差价收入	36,477,207.07	72,862,540.31

#### 7.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无股票申购差价收入。

#### 7.4.7.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无证券出借差价收入。

### 7.4.7.13 债券投资收益

#### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 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	498,789.41	410,336.02
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	498,789.41	410,336.02

#### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
卖出债券（、债转股及债券 到期兑付）成交总额	5,689,519.11	1,891,540.75
减：卖出债券（、债转股及 债券到期兑付）成本总额	5,190,100.00	1,481,000.00
减：应收利息总额	629.70	204.73
买卖债券差价收入	498,789.41	410,336.02

#### 7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入



本基金本报告期内及上年度可比期间无债券赎回差价收入。

#### 7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无债券申购差价收入。

#### 7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

##### 7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

##### 7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无买卖贵金属差价收入。

##### 7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属赎回差价收入。

##### 7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属申购差价收入。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

##### 7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具买卖权证差价收入。

##### 7.4.7.15.2 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 12 月 31 日	上年度可比期间收益金额 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
股指期货-投资收益	823,294.76	3,788,260.20

#### 7.4.7.16 股利收益

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
股票投资产生的股利收益	9,364,925.47	8,221,693.21
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	9,364,925.47	8,221,693.21

**7.4.7.17 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	-83,056,506.40	45,780,912.12
——股票投资	-83,056,506.40	45,780,912.12
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-197,332.00	75,792.00
——权证投资	-	-
——期货投资	-197,332.00	75,792.00
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	-83,253,838.40	45,856,704.12

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-6.00 元(2020 年度：-591.00 元)。

**7.4.7.18 其他收入**

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
基金赎回费收入	-	-
替代损益	1,780,245.43	-265,892.47
其他	964,961.07	-
合计	2,745,206.50	-265,892.47

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。

**7.4.7.19 交易费用**

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
交易所市场交易费用	834,498.45	1,494,574.10
银行间市场交易费用	-	-
合计	834,498.45	1,494,574.10

**7.4.7.20 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	55,000.00	70,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
指数使用费	325,604.77	406,209.89
银行费用	10,864.31	14,286.96
合计	511,469.08	610,496.85

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。

#### 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

无。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 7.4.9 关联方关系

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
厦门国际信托有限公司("厦门国际信托")	基金管理人的股东
深圳市投资控股有限公司("深圳投资控股")	基金管理人的股东
厦门合泽吉企业管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
厦门合泽祥企业管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
厦门合泽益企业管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
厦门合泽盈企业管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
华泰联合证券有限责任公司("华泰联合")	基金管理人的股东华泰证券控制的公司
南方资本管理有限公司("南方资本")	基金管理人的子公司
南方东英资产管理有限公司("南方东英")	基金管理人的子公司
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。

#### 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

#### 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
华泰证券	45,901,074.27	4.36%	147,536,129.61	7.38%

#### 7.4.10.1.2 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。

#### 7.4.10.1.3 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 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
华泰证券	4,590.34	4.36%	594.23	3.65%
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
华泰证券	14,754.69	7.38%	1,720.32	2.93%

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。

### 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	3,221,489.29	3,878,022.32
其中：支付销售机构的客户维护费	27,541.51	6,096.26

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。

#### 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	644,297.83	775,604.51

注：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。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

无。

#### 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。

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

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

本基金本报告期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。

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

本基金本报告期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。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

无。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2021 年 12 月 31 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	112,723,100.00	35.47%	273,193,100.00	53.59%

华泰证券股份有限公司	8,485,389.00	2.67%	3,944,089.00	0.77%
------------	--------------	-------	--------------	-------

注：南方 MSCI 中国 A 股 ETF 联接基金和华泰证券投资本基金适用的认(申)购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 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
中国银行	2,512,242.66	8,689.36	12,955,501.89	20,165.15

注：本基金由基金托管人中国银行保管的银行存款，按银行约定利率计息。

#### 7.4.10.7 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 12 月 31 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	688246	嘉和美康	网下申购	7,515	296,842.50
华泰联合	113050	南银转债	配债	2,920	292,000.00
华泰联合	688192	迪哲医药	网下申购	5,299	278,621.42
华泰联合	688083	中望软件	网下申购	1,837	276,468.50
华泰联合	688105	诺唯赞	网下申购	3,726	204,930.00
华泰联合	002142	宁波银行	配股	7,410	147,977.70
华泰联合	110081	闻泰转债	配债	1,250	125,000.00
华泰联合	688161	威高骨科	网下申购	3,069	111,159.18
华泰联合	600909	华安证券	配股	16,260	59,836.80
华泰联合	688633	星球石墨	网下申购	1,558	52,379.96
华泰联合	688097	博众精工	网下申购	3,983	44,888.41
华泰联合	301078	孩子王	网下申购	7,551	43,569.27
华泰联合	688613	奥精医疗	网下申购	2,617	42,997.31
华泰联合	688350	富淼科技	网下申购	2,552	34,656.16
华泰联合	605499	东鹏饮料	网下申购	632	29,242.64
华泰联合	688260	昀冢科技	网下申购	2,990	28,793.70
华泰联合	300975	商络电子	网下申购	4,917	26,945.16
华泰联合	688314	康拓医疗	网下申购	1,085	18,813.90
华泰联合	301033	迈普医学	网下申购	1,076	16,290.64
华泰联合	605389	长龄液压	网下申购	356	14,026.40
华泰联合	605208	永茂泰	网下申购	801	10,733.40
华泰联合	001234	泰慕士	网下申购	333	5,504.49
兴业证券	300979	华利集团	网下申购	8,136	270,277.92
兴业证券	300941	创识科技	网下申购	3,989	85,005.59

兴业证券	688639	华恒生物	网下申购	2,302	53,314.32
兴业证券	688195	腾景科技	网下申购	2,693	36,624.80
兴业证券	688597	煜邦电力	网下申购	3,907	22,973.16
兴业证券	605298	必得科技	网下申购	391	6,252.09
兴业证券	605086	龙高股份	网下申购	443	5,696.98
兴业证券, 华泰联合	113052	兴业转债	配债	6,110	611,000.00

上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 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	688510	航亚科技	网下申购	5,991	48,946.47
华泰联合	300919	中伟股份	网下申购	6,093	149,887.80

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

于 2021 年 12 月 31 日, 本基金持有关联方中国银行、华泰证券、兴业证券发行的普通股, 成本总额为人民币 3,768,079.63 元, 估值总额为人民币 3,742,816.08 元, 占本基金基金资产净值的比例为 0.68% (2020 年 12 月 31 日: 成本总额为人民币 6,493,119.96 元, 估值总额为人民币 6,149,053.08 元, 占本基金基金资产净值的比例为 0.72%)。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 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

金额单位: 人民币元

7.4.12.1.1 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
001234	泰慕士	2021 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 11 日	新股未上市	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
300814	中富电路	2021 年 8 月 4 日	2022 年 2 月 14 日	新股锁定期	8.40	23.88	328	2,755.20	7,832.64	-
300854	中兰环保	2021 年 9 月 8 日	2022 年 3 月 16 日	新股锁定期	9.96	27.29	203	2,021.88	5,539.87	-
300994	久祺股份	2021 年 8 月 2 日	2022 年 2 月 14 日	新股锁定期	11.90	45.45	420	4,998.00	19,089.00	-

		日	日							
301020	密封科技	2021年 6月28 日	2022年 1月6 日	新股锁 定期	10.64	30.44	421	4,479.44	12,815.24	-
301021	英诺激光	2021年 6月28 日	2022年 1月6 日	新股锁 定期	9.46	41.43	290	2,743.40	12,014.70	-
301025	读客文化	2021年 7月6 日	2022年 1月24 日	新股锁 定期	1.55	20.88	403	624.65	8,414.64	-
301026	浩通科技	2021年 7月8 日	2022年 1月17 日	新股锁 定期	18.03	62.73	203	3,660.09	12,734.19	-
301027	华蓝集团	2021年 7月8 日	2022年 1月19 日	新股锁 定期	11.45	16.65	286	3,274.70	4,761.90	-
301028	东亚机械	2021年 7月12 日	2022年 1月20 日	新股锁 定期	5.31	13.50	733	3,892.23	9,895.50	-
301030	仕净科技	2021年 7月15 日	2022年 1月24 日	新股锁 定期	6.10	31.52	242	1,476.20	7,627.84	-
301032	新柴股份	2021年 7月15 日	2022年 1月24 日	新股锁 定期	4.97	12.51	513	2,549.61	6,417.63	-
301033	迈普医学	2021年 7月15 日	2022年 1月26 日	新股锁 定期	15.14	59.97	108	1,635.12	6,476.76	-
301035	润丰股份	2021年 7月21 日	2022年 1月28 日	新股锁 定期	22.04	56.28	644	14,193.76	36,244.32	-
301037	保立佳	2021年 7月21 日	2022年 2月7 日	新股锁 定期	14.82	24.26	193	2,860.26	4,682.18	-
301039	中集车辆	2021年 7月1 日	2022年 1月10 日	新股锁 定期	6.96	12.51	2,064	14,365.44	25,820.64	-
301041	金百泽	2021年 8月2 日	2022年 2月11 日	新股锁 定期	7.31	28.21	215	1,571.65	6,065.15	-
301045	天禄科技	2021年 8月6 日	2022年 2月17 日	新股锁 定期	15.81	28.37	335	5,296.35	9,503.95	-
301046	能辉科技	2021年	2022年	新股锁	8.34	48.99	290	2,418.60	14,207.10	-



		8月10日	2月17日	定期						
301050	雷电微力	2021年8月17日	2022年2月24日	新股锁定期	60.64	234.74	233	14,129.12	54,694.42	-
301053	远信工业	2021年8月25日	2022年3月1日	新股锁定期	11.87	28.78	155	1,839.85	4,460.90	-
301056	森赫股份	2021年8月27日	2022年3月7日	新股锁定期	3.93	11.09	572	2,247.96	6,343.48	-
301057	汇隆新材	2021年8月31日	2022年3月9日	新股锁定期	8.03	19.02	218	1,750.54	4,146.36	-
301059	金三江	2021年9月3日	2022年3月14日	新股锁定期	8.09	19.30	259	2,095.31	4,998.70	-
301060	兰卫医学	2021年9月6日	2022年3月14日	新股锁定期	4.17	30.94	587	2,447.79	18,161.78	-
301062	上海艾录	2021年9月7日	2022年3月14日	新股锁定期	3.31	17.01	523	1,731.13	8,896.23	-
301063	海锅股份	2021年9月9日	2022年3月24日	新股锁定期	17.40	36.11	153	2,662.20	5,524.83	-
301069	凯盛新材	2021年9月16日	2022年3月28日	新股锁定期	5.17	44.21	539	2,786.63	23,829.19	-
301072	中捷精工	2021年9月22日	2022年3月29日	新股锁定期	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	-
301073	君亭酒店	2021年9月22日	2022年3月30日	新股锁定期	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	-
301078	孩子王	2021年9月30日	2022年4月14日	新股锁定期	5.77	12.14	756	4,362.12	9,177.84	-
301079	邵阳液压	2021年10月11日	2022年4月19日	新股锁定期	11.92	24.82	140	1,668.80	3,474.80	-
301083	百胜智能	2021年10月13日	2022年4月21日	新股锁定期	9.08	14.21	416	3,777.28	5,911.36	-

301089	拓新药业	2021年 10月20 日	2022年 4月27 日	新股锁 定期	19.11	67.93	220	4,204.20	14,944.60	-
301127	天源环保	2021年 12月23 日	2022年 6月30 日	新股锁 定期	12.03	17.12	1,685	20,270.55	28,847.20	-
301138	华研精机	2021年 12月8 日	2022年 6月15 日	新股锁 定期	26.17	44.86	285	7,458.45	12,785.10	-
301168	通灵股份	2021年 12月2 日	2022年 6月10 日	新股锁 定期	39.08	52.13	329	12,857.32	17,150.77	-
301177	迪阿股份	2021年 12月8 日	2022年 6月15 日	新股锁 定期	116.8 8	116.0 8	238	27,817.44	27,627.04	-
301180	万祥科技	2021年 11月9 日	2022年 5月16 日	新股锁 定期	12.20	22.72	654	7,978.80	14,858.88	-
301193	家联科技	2021年 12月2 日	2022年 6月9 日	新股锁 定期	30.73	29.14	297	9,126.81	8,654.58	-
688103	国力股份	2021年 9月2 日	2022年 3月10 日	新股锁 定期	12.04	66.10	1,595	19,203.80	105,429.50	-
688772	珠海冠宇	2021年 9月30 日	2022年 4月15 日	新股锁 定期	14.43	39.09	10,598	152,929.14	414,275.82	-
688779	长远锂科	2021年 8月3 日	2022年 2月11 日	新股锁 定期	5.65	22.86	31,822	179,794.30	727,450.92	-

## 7.4.12.1.2 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
113634	珀莱转债	2021年 12月9 日	2022年 1月4 日	配债未 上市	100.0 0	100.0 0	90	9,000.00	9,000.00	-
113052	兴业转债	2021年 12月28 日	2022年 1月14 日	配债未 上市	100.0 0	100.0 0	6,110	611,000.00	611,000.00	-

注：1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，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

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。

2、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。

3、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。

#### **7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本基金本报告期末未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因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

##### **7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

无。

#### **7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券**

本基金本报告期末无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之内。

#### 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 12 月 31 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 0.11% (2020 年 12 月 31 日：0.22%)。

#### 7.4.13.3 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 12 月 31 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。

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注“期末本基金持有的流通受限证券”。此外，如根据基金合同的规定，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 0.43%。

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。

#### 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。

#### 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	2,512,242.66	-	-	-	2,512,242.66
结算备付金	1,038,445.33	-	-	-	1,038,445.33
存出保证金	55,698.86	-	-	769,369.60	825,068.46
交易性金融资产	-	-	620,000.00	549,764,990.46	550,384,990.46
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	702.49	702.49
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	72,088.99	72,088.99
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	3,606,386.85	-	620,000.00	550,607,151.54	554,833,538.39
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	230,057.83	230,057.83
应付托管费	-	-	-	46,011.56	46,011.56
应付证券清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	16,283.68	16,283.68
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-

其他负债	-	-	-	528,731.59	528,731.59
负债总计	-	-	-	821,084.66	821,084.66
利率敏感度缺口	3,606,386.85	-	620,000.00	549,786,066.88	554,012,453.73
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	-	-	-	25,395,830.8	25,395,830.8

				1	1
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。

#### 7.4.13.4.1.2 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12月31日）	上年度末（2020年12月31日）
	1.市场利率平行上升25个基点	-8,846.89	-27,034.03
2.市场利率平行下降25个基点	8,998.05	27,493.45	

#### 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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

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	549,764,990.46	99.23	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	549,764,990.46	99.23	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。

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021 年 12 月 31 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	1.组合自身基准上升 5%	27,667,684.44	42,323,512.23
	2.组合自身基准下降 5%	-27,667,684.44	-42,323,512.23

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 基金申购款

于 2021 年度，本基金申购基金份额的对价总额为 572,154,337.13 元（2020 年度：1,617,855,601.28 元），其中包括以股票支付的申购款 309,078,104.30 元和以现金支付的申购款 263,076,232.83 元（2020 年度：其中包括以股票支付的申购款 882,088,574.15 元和以现金支付的申购款 735,767,027.13 元）。

##### (2) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 548,017,043.21 元，属于第二层次的余额为 625,504.49 元，属

于第三层次的余额为 1,742,442.76 元(2020 年 12 月 31 日: 第一层次 841,623,362.54 元, 第二层次 5,029,847.57 元, 无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

于 2021 年 12 月 31 日,本基金持有公允价值归属于第三层次的金融工具 1,742,442.76 元(2020 年 12 月 31 日: 未持有公允价值归属于第三层次的金融工具)。其中,于本会计期间购买第三层次金融工具的金额为 561,068.94 元,计入损益的利得或损失金额为 1,181,373.82 元,均为 2021 年 12 月 31 日仍持有的资产计入未实现利得或损失的变动(公允价值变动损益)(2020 年度: 无)。

于 2021 年 12 月 31 日,本基金持有的第三层次交易性金融资产均为股票投资,采用平均价格亚式期权模型进行估值,不可观察输入值为预期波动率,与公允价值之间为负相关关系。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 12 月 31 日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2020 年 12 月 31 日: 同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(3) 根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关衔接规定,以及财政部、银保监会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》,公募证券投资基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。截至 2021 年 12 月 31 日,本基金已完成了执行新金融工具准则对财务报表潜在影响的评估。鉴于本基金业务的性质,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。

本基金将自 2022 年 1 月 1 日起追溯执行相关新规定,并采用准则允许的实务简便方法,调整期初所有者权益,2021 年的比较数据将不作重述。

(4) 除基金申购款、公允价值和执行新金融工具准则外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 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（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	549,764,990.46	99.09
	其中：股票	549,764,990.46	99.09
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	620,000.00	0.11
	其中：债券	620,000.00	0.11
	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	3,550,687.99	0.64
8	其他资产	897,859.94	0.16
9	合计	554,833,538.39	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。

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 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	6,405,424.84	1.16
B	采矿业	14,898,909.69	2.69
C	制造业	331,617,793.31	59.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,633,529.30	2.46
E	建筑业	8,860,037.80	1.60
F	批发和零售业	5,160,640.20	0.93
G	交通运输、仓储和邮政业	15,235,588.66	2.75
H	住宿和餐饮业	662,180.00	0.12
I	信息传输、软件和信息技术服	20,576,626.38	3.71

	务业		
J	金融业	98,861,485.84	17.84
K	房地产业	9,326,956.91	1.68
L	租赁和商务服务业	7,446,859.54	1.34
M	科学研究和技术服务业	6,694,955.98	1.21
N	水利、环境和公共设施管理业	1,314,330.00	0.24
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	4,555,918.96	0.82
R	文化、体育和娱乐业	2,254,355.40	0.41
S	综合	458,874.00	0.08
	合计	547,964,466.81	98.91

### 8.2.2 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	1,644,978.68	0.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	4,713.80	0.00
F	批发和零售业	36,804.88	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	4,608.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	18,969.00	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	34,387.07	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	18,161.78	0.00
R	文化、体育和娱乐业	37,906.44	0.01
S	综合	-	-
	合计	1,800,529.65	0.32

### 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 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

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	15,442	31,656,100.00	5.71
2	300750	宁德时代	28,746	16,902,648.00	3.05
3	600036	招商银行	253,743	12,359,821.53	2.23
4	000858	五粮液	47,644	10,608,413.04	1.91
5	601318	中国平安	133,508	6,730,138.28	1.21
6	600900	长江电力	279,854	6,352,685.80	1.15
7	002594	比亚迪	22,600	6,059,512.00	1.09
8	601012	隆基股份	66,552	5,736,782.40	1.04
9	300760	迈瑞医疗	14,900	5,673,920.00	1.02
10	601888	中国中免	24,194	5,308,405.54	0.96
11	601166	兴业银行	255,600	4,866,624.00	0.88
12	600809	山西汾酒	14,944	4,719,016.32	0.85
13	300059	东方财富	127,068	4,715,493.48	0.85
14	603288	海天味业	43,278	4,548,950.58	0.82
15	000568	泸州老窖	17,900	4,544,273.00	0.82
16	002475	立讯精密	86,673	4,264,311.60	0.77
17	002352	顺丰控股	60,500	4,169,660.00	0.75
18	600276	恒瑞医药	78,733	3,992,550.43	0.72
19	000001	平安银行	238,700	3,933,776.00	0.71
20	600309	万华化学	38,880	3,926,880.00	0.71
21	603259	药明康德	31,601	3,747,246.58	0.68
22	601398	工商银行	774,300	3,585,009.00	0.65
23	600030	中信证券	130,900	3,457,069.00	0.62
24	002714	牧原股份	64,714	3,453,139.04	0.62
25	603501	韦尔股份	10,832	3,366,260.64	0.61
26	600436	片仔癀	7,619	3,330,645.85	0.60
27	600887	伊利股份	78,688	3,262,404.48	0.59
28	002142	宁波银行	81,210	3,108,718.80	0.56
29	600000	浦发银行	361,078	3,079,995.34	0.56
30	002304	洋河股份	18,499	3,047,340.27	0.55
31	601919	中远海控	155,860	2,913,023.40	0.53
32	300015	爱尔眼科	66,447	2,809,379.16	0.51
33	300014	亿纬锂能	23,524	2,780,066.32	0.50

34	002812	恩捷股份	11,100	2,779,440.00	0.50
35	600406	国电南瑞	68,120	2,726,843.60	0.49
36	601288	农业银行	916,900	2,695,686.00	0.49
37	300274	阳光电源	17,800	2,595,240.00	0.47
38	601668	中国建筑	516,460	2,582,300.00	0.47
39	600438	通威股份	55,600	2,499,776.00	0.45
40	601899	紫金矿业	253,400	2,457,980.00	0.44
41	300122	智飞生物	19,600	2,442,160.00	0.44
42	601816	京沪高铁	503,800	2,433,354.00	0.44
43	600031	三一重工	104,663	2,386,316.40	0.43
44	000002	万 科 A	119,800	2,367,248.00	0.43
45	000725	京东方 A	461,700	2,331,585.00	0.42
46	600690	海尔智家	77,581	2,318,896.09	0.42
47	600048	保利发展	147,200	2,300,736.00	0.42
48	601601	中国太保	84,058	2,279,652.96	0.41
49	002241	歌尔股份	42,108	2,278,042.80	0.41
50	002493	荣盛石化	124,604	2,262,808.64	0.41
51	601328	交通银行	483,400	2,228,474.00	0.40
52	002371	北方华创	6,400	2,220,928.00	0.40
53	300124	汇川技术	32,200	2,208,920.00	0.40
54	600893	航发动力	32,726	2,076,791.96	0.37
55	600111	北方稀土	44,750	2,049,550.00	0.37
56	002460	赣锋锂业	14,100	2,014,185.00	0.36
57	600585	海螺水泥	49,100	1,978,730.00	0.36
58	600104	上汽集团	95,912	1,978,664.56	0.36
59	600745	闻泰科技	15,300	1,978,290.00	0.36
60	600019	宝钢股份	274,119	1,962,692.04	0.35
61	601088	中国神华	81,078	1,825,876.56	0.33
62	601766	中国中车	299,500	1,823,955.00	0.33
63	002459	晶澳科技	19,600	1,816,920.00	0.33
64	000776	广发证券	72,941	1,793,619.19	0.32
65	002049	紫光国微	7,700	1,732,500.00	0.31
66	600016	民生银行	436,800	1,703,520.00	0.31
67	601818	光大银行	508,900	1,689,548.00	0.30
68	601658	邮储银行	327,500	1,670,250.00	0.30
69	002129	中环股份	39,900	1,665,825.00	0.30
70	600346	恒力石化	72,365	1,662,224.05	0.30
71	600028	中国石化	392,214	1,659,065.22	0.30
72	601211	国泰君安	92,669	1,657,848.41	0.30
73	603799	华友钴业	15,026	1,657,518.06	0.30
74	000538	云南白药	15,700	1,643,005.00	0.30
75	600999	招商证券	91,441	1,613,933.65	0.29
76	601688	华泰证券	90,628	1,609,553.28	0.29

77	000063	中兴通讯	47,700	1,597,950.00	0.29
78	600010	包钢股份	561,400	1,566,306.00	0.28
79	601066	中信建投	53,100	1,553,175.00	0.28
80	603806	福 斯 特	11,740	1,532,657.00	0.28
81	601669	中国电建	188,300	1,521,464.00	0.27
82	300498	温氏股份	78,480	1,511,524.80	0.27
83	600050	中国联通	381,600	1,499,688.00	0.27
84	002311	海大集团	20,400	1,495,320.00	0.27
85	002230	科大讯飞	28,450	1,493,909.50	0.27
86	000338	潍柴动力	83,400	1,492,026.00	0.27
87	601985	中国核电	178,900	1,484,870.00	0.27
88	002027	分众传媒	180,960	1,482,062.40	0.27
89	603986	兆易创新	8,388	1,475,029.80	0.27
90	600837	海通证券	119,000	1,458,940.00	0.26
91	601225	陕西煤业	119,530	1,458,266.00	0.26
92	601390	中国中铁	250,700	1,451,553.00	0.26
93	600588	用友网络	40,376	1,448,690.88	0.26
94	601877	正泰电器	26,648	1,436,060.72	0.26
95	000166	申万宏源	277,582	1,421,219.84	0.26
96	300433	蓝思科技	61,272	1,408,030.56	0.25
97	300896	爱 美 客	2,600	1,393,886.00	0.25
98	603659	璞 泰 来	8,660	1,390,882.60	0.25
99	600150	中国船舶	55,200	1,368,408.00	0.25
100	000661	长春高新	5,000	1,357,000.00	0.24
101	002709	天赐材料	11,750	1,347,137.50	0.24
102	601633	长城汽车	27,700	1,344,558.00	0.24
103	300413	芒果超媒	23,250	1,330,365.00	0.24
104	300782	卓 胜 微	4,040	1,320,272.00	0.24
105	601988	中国银行	432,800	1,320,040.00	0.24
106	601100	恒立液压	16,032	1,311,417.60	0.24
107	600989	宝丰能源	75,300	1,307,208.00	0.24
108	601857	中国石油	265,842	1,305,284.22	0.24
109	002821	凯 莱 英	3,000	1,305,000.00	0.24
110	001979	招商蛇口	97,532	1,301,076.88	0.23
111	688036	传音控股	8,174	1,282,500.60	0.23
112	601229	上海银行	174,912	1,247,122.56	0.23
113	688111	金山办公	4,700	1,245,500.00	0.22
114	000596	古井贡酒	5,000	1,220,000.00	0.22
115	600196	复星医药	24,900	1,218,606.00	0.22
116	603993	洛阳钼业	217,500	1,213,650.00	0.22
117	000625	长安汽车	78,195	1,187,782.05	0.21
118	300759	康龙化成	8,300	1,172,541.00	0.21
119	600660	福耀玻璃	24,800	1,169,072.00	0.21

120	601169	北京银行	260,560	1,156,886.40	0.21
121	002050	三花智控	44,300	1,120,790.00	0.20
122	601360	三 六 零	88,100	1,120,632.00	0.20
123	000895	双汇发展	35,410	1,117,185.50	0.20
124	300999	金 龙 鱼	17,702	1,113,986.86	0.20
125	600570	恒生电子	17,894	1,112,112.10	0.20
126	603392	万泰生物	5,000	1,107,500.00	0.20
127	600741	华域汽车	39,033	1,104,633.90	0.20
128	601009	南京银行	123,200	1,103,872.00	0.20
129	300316	晶盛机电	15,800	1,098,100.00	0.20
130	600958	东方证券	73,556	1,084,215.44	0.20
131	300142	沃森生物	19,274	1,083,198.80	0.20
132	601138	工业富联	89,800	1,070,416.00	0.19
133	000100	TCL 科技	172,800	1,066,176.00	0.19
134	300408	三环集团	23,800	1,061,480.00	0.19
135	600919	江苏银行	182,024	1,061,199.92	0.19
136	600886	国投电力	91,660	1,051,340.20	0.19
137	002074	国轩高科	20,300	1,040,375.00	0.19
138	601628	中国人寿	34,100	1,026,069.00	0.19
139	601336	新华保险	25,829	1,004,231.52	0.18
140	601865	福 莱 特	17,300	1,002,362.00	0.18
141	002001	新 和 成	31,720	987,126.40	0.18
142	300033	同 花 顺	6,800	983,144.00	0.18
143	601600	中国铝业	160,900	979,881.00	0.18
144	300454	深 信 服	5,100	974,100.00	0.18
145	600089	特变电工	45,700	967,469.00	0.17
146	688012	中微公司	7,540	954,564.00	0.17
147	600926	杭州银行	73,120	937,398.40	0.17
148	603833	欧派家居	6,340	935,150.00	0.17
149	300628	亿联网络	11,200	912,240.00	0.16
150	002736	国信证券	78,900	905,772.00	0.16
151	601117	中国化学	75,282	903,384.00	0.16
152	600176	中国巨石	49,151	894,548.20	0.16
153	300207	欣 旺 达	21,100	889,576.00	0.16
154	600029	南方航空	129,900	884,619.00	0.16
155	600015	华夏银行	157,852	883,971.20	0.16
156	600600	青岛啤酒	8,910	882,090.00	0.16
157	600132	重庆啤酒	5,802	877,958.64	0.16
158	600011	华能国际	90,300	875,007.00	0.16
159	600460	士 兰 微	16,100	872,620.00	0.16
160	002013	中航机电	47,800	869,004.00	0.16
161	000963	华东医药	21,460	862,692.00	0.16
162	002236	大华股份	36,700	861,716.00	0.16



163	603486	科沃斯	5,700	860,415.00	0.16
164	000723	美锦能源	52,400	850,452.00	0.15
165	000799	酒鬼酒	4,000	850,000.00	0.15
166	300661	圣邦股份	2,750	849,750.00	0.15
167	300601	康泰生物	8,600	847,444.00	0.15
168	000876	新希望	55,700	847,197.00	0.15
169	002648	卫星化学	21,040	842,231.20	0.15
170	601618	中国中冶	219,800	841,834.00	0.15
171	600547	山东黄金	44,552	838,468.64	0.15
172	002601	龙佰集团	29,315	838,115.85	0.15
173	603369	今世缘	15,400	837,760.00	0.15
174	600845	宝信软件	13,760	837,020.80	0.15
175	300751	迈为股份	1,300	834,990.00	0.15
176	002180	纳思达	17,300	826,248.00	0.15
177	600426	华鲁恒升	26,140	818,182.00	0.15
178	601377	兴业证券	82,310	813,222.80	0.15
179	601155	新城控股	27,900	812,727.00	0.15
180	002938	鹏鼎控股	19,000	806,170.00	0.15
181	000938	紫光股份	35,102	802,080.70	0.14
182	601901	方正证券	101,000	791,840.00	0.14
183	002920	德赛西威	5,500	778,305.00	0.14
184	000301	东方盛虹	39,900	771,666.00	0.14
185	000733	振华科技	6,200	770,536.00	0.14
186	002602	世纪华通	91,740	769,698.60	0.14
187	601727	上海电气	157,318	764,565.48	0.14
188	603290	斯达半导	2,000	762,000.00	0.14
189	688008	澜起科技	9,021	756,591.27	0.14
190	600763	通策医疗	3,800	756,200.00	0.14
191	300223	北京君正	5,600	750,400.00	0.14
192	601111	中国国航	81,700	745,921.00	0.13
193	000786	北新建材	20,738	743,042.54	0.13
194	603899	晨光文具	11,500	741,865.00	0.13
195	002555	三七互娱	27,400	740,348.00	0.13
196	600875	东方电气	34,100	730,422.00	0.13
197	002120	韵达股份	35,585	728,069.10	0.13
198	300450	先导智能	9,780	727,338.60	0.13
199	002756	永兴材料	4,900	725,298.00	0.13
200	600383	金地集团	55,859	724,491.23	0.13
201	601689	拓普集团	13,600	720,800.00	0.13
202	601916	浙商银行	205,800	720,300.00	0.13
203	600188	兖矿能源	30,600	720,018.00	0.13
204	601788	光大证券	48,053	717,431.29	0.13
205	600918	中泰证券	71,700	714,849.00	0.13

206	000069	华侨城 A	101,500	714,560.00	0.13
207	002916	深南电路	5,840	711,428.80	0.13
208	600039	四川路桥	58,900	709,156.00	0.13
209	300496	中科创达	5,100	705,942.00	0.13
210	600233	圆通速递	42,300	705,564.00	0.13
211	002414	高德红外	29,000	702,090.00	0.13
212	002202	金风科技	42,586	701,391.42	0.13
213	002080	中材科技	20,600	700,812.00	0.13
214	600795	国电电力	219,600	696,132.00	0.13
215	600885	宏发股份	9,316	695,346.24	0.13
216	600779	水井坊	5,793	695,102.07	0.13
217	601799	星宇股份	3,400	694,450.00	0.13
218	601939	建设银行	118,300	693,238.00	0.13
219	600219	南山铝业	147,000	692,370.00	0.12
220	002791	坚朗五金	3,800	690,042.00	0.12
221	002841	视源股份	8,339	678,794.60	0.12
222	600584	长电科技	21,800	676,236.00	0.12
223	603260	合盛硅业	5,100	673,047.00	0.12
224	300763	锦浪科技	2,900	671,495.00	0.12
225	600183	生益科技	28,400	668,820.00	0.12
226	600754	锦江酒店	11,300	662,180.00	0.12
227	002007	华兰生物	22,700	661,478.00	0.12
228	688126	沪硅产业	25,571	660,243.22	0.12
229	688169	石头科技	800	650,400.00	0.12
230	600061	国投资本	79,032	649,643.04	0.12
231	601995	中金公司	13,200	647,196.00	0.12
232	600522	中天科技	37,900	642,784.00	0.12
233	002625	光启技术	26,700	641,067.00	0.12
234	002600	领益智造	87,100	641,056.00	0.12
235	000977	浪潮信息	17,760	636,340.80	0.11
236	601615	明阳智能	24,200	631,620.00	0.11
237	601233	桐昆股份	29,700	629,046.00	0.11
238	601878	浙商证券	47,700	628,686.00	0.11
239	600563	法拉电子	2,700	627,480.00	0.11
240	600018	上港集团	114,492	627,416.16	0.11
241	000157	中联重科	87,500	627,375.00	0.11
242	603707	健友股份	14,899	625,758.00	0.11
243	600298	安琪酵母	10,336	623,880.96	0.11
244	002240	盛新锂能	10,700	620,065.00	0.11
245	603737	三棵树	4,456	620,052.40	0.11
246	603816	顾家家居	8,000	617,280.00	0.11
247	601966	玲珑轮胎	16,811	614,442.05	0.11
248	603882	金域医学	5,500	612,535.00	0.11

249	002340	格林美	59,000	610,650.00	0.11
250	300595	欧普康视	10,570	606,400.90	0.11
251	300390	天华超净	7,400	599,400.00	0.11
252	002064	华峰化学	57,200	597,168.00	0.11
253	600038	中直股份	7,400	594,220.00	0.11
254	603160	汇顶科技	5,500	592,735.00	0.11
255	601881	中国银河	52,700	589,713.00	0.11
256	002268	卫士通	10,500	587,370.00	0.11
257	600332	白云山	17,168	587,145.60	0.11
258	603456	九洲药业	10,400	585,104.00	0.11
259	603198	迎驾贡酒	8,400	583,380.00	0.11
260	600115	中国东航	112,400	579,984.00	0.10
261	000425	徐工机械	96,400	577,436.00	0.10
262	600362	江西铜业	25,700	573,881.00	0.10
263	300347	泰格医药	4,450	568,710.00	0.10
264	002384	东山精密	20,900	566,390.00	0.10
265	600674	川投能源	45,200	565,000.00	0.10
266	002252	上海莱士	82,800	564,696.00	0.10
267	601636	旗滨集团	33,000	564,300.00	0.10
268	603568	伟明环保	15,400	562,562.00	0.10
269	002568	百润股份	9,400	562,402.00	0.10
270	300146	汤臣倍健	20,800	560,768.00	0.10
271	002326	永太科技	10,900	558,189.00	0.10
272	601058	赛轮轮胎	37,700	557,583.00	0.10
273	600009	上海机场	11,900	555,611.00	0.10
274	688180	君实生物	8,272	554,058.56	0.10
275	300037	新宙邦	4,900	553,700.00	0.10
276	601216	君正集团	104,100	544,443.00	0.10
277	600256	广汇能源	83,000	542,820.00	0.10
278	603589	口子窖	7,600	538,612.00	0.10
279	601555	东吴证券	60,720	537,979.20	0.10
280	600803	新奥股份	29,300	537,948.00	0.10
281	603185	上机数控	3,200	534,336.00	0.10
282	601838	成都银行	44,500	534,000.00	0.10
283	300529	健帆生物	10,000	533,000.00	0.10
284	002385	大北农	50,800	532,892.00	0.10
285	300699	光威复材	6,300	532,224.00	0.10
286	300073	当升科技	6,100	529,907.00	0.10
287	603517	绝味食品	7,748	529,420.84	0.10
288	600141	兴发集团	13,700	518,956.00	0.09
289	688006	杭可科技	4,800	516,384.00	0.09
290	000783	长江证券	68,000	512,720.00	0.09
291	000066	中国长城	36,073	510,793.68	0.09

292	300003	乐普医疗	22,500	509,175.00	0.09
293	000739	普洛药业	14,500	508,805.00	0.09
294	600352	浙江龙盛	40,172	507,372.36	0.09
295	600516	方大炭素	46,787	506,235.34	0.09
296	688122	西部超导	5,200	504,088.00	0.09
297	002185	华天科技	39,600	503,316.00	0.09
298	603605	珀莱雅	2,400	499,944.00	0.09
299	000825	太钢不锈	70,400	495,616.00	0.09
300	603345	安井食品	2,900	495,262.00	0.09
301	603019	中科曙光	17,900	493,503.00	0.09
302	603939	益丰药房	8,944	492,903.84	0.09
303	601108	财通证券	44,200	491,504.00	0.09
304	002624	完美世界	24,150	490,486.50	0.09
305	600161	天坛生物	16,854	488,091.84	0.09
306	000738	航发控制	16,100	487,508.00	0.09
307	600486	扬农化工	3,700	485,440.00	0.09
308	603267	鸿远电子	2,700	484,488.00	0.09
309	300726	宏达电子	4,800	480,288.00	0.09
310	300724	捷佳伟创	4,200	480,060.00	0.09
311	000703	恒逸石化	45,180	479,811.60	0.09
312	002353	杰瑞股份	11,900	476,000.00	0.09
313	601607	上海医药	23,926	475,409.62	0.09
314	002372	伟星新材	19,500	474,240.00	0.09
315	000831	五矿稀土	12,100	472,142.00	0.09
316	002024	苏宁易购	114,500	471,740.00	0.09
317	002266	浙富控股	66,000	469,920.00	0.08
318	002223	鱼跃医疗	12,400	468,720.00	0.08
319	002532	天山铝业	57,500	468,625.00	0.08
320	002028	思源电气	9,500	467,495.00	0.08
321	601198	东兴证券	40,000	465,200.00	0.08
322	603338	浙江鼎力	5,780	463,902.80	0.08
323	300251	光线传媒	36,000	462,600.00	0.08
324	300144	宋城演艺	32,220	461,390.40	0.08
325	000009	中国宝安	31,800	458,874.00	0.08
326	600606	绿地控股	105,020	455,786.80	0.08
327	000519	中兵红箭	17,000	453,390.00	0.08
328	601933	永辉超市	111,639	452,137.95	0.08
329	000630	铜陵有色	129,500	450,660.00	0.08
330	600079	人福医药	20,000	450,400.00	0.08
331	601990	南京证券	45,400	449,914.00	0.08
332	002850	科达利	2,800	448,952.00	0.08
333	002409	雅克科技	5,500	446,435.00	0.08
334	600027	华电国际	83,418	446,286.30	0.08

335	002405	四维图新	28,000	445,760.00	0.08
336	002673	西部证券	55,216	445,593.12	0.08
337	300253	卫宁健康	26,530	444,642.80	0.08
338	600487	亨通光电	29,200	441,504.00	0.08
339	603613	国联股份	4,100	440,750.00	0.08
340	688009	中国通号	88,491	440,685.18	0.08
341	000932	华菱钢铁	85,400	436,394.00	0.08
342	603127	昭衍新药	3,780	436,325.40	0.08
343	600705	中航产融	109,800	435,906.00	0.08
344	002531	天顺风能	22,400	434,336.00	0.08
345	601162	天风证券	106,800	432,540.00	0.08
346	000807	云铝股份	38,700	432,279.00	0.08
347	600369	西南证券	81,700	432,193.00	0.08
348	002407	多氟多	9,600	431,904.00	0.08
349	300676	华大基因	4,900	430,220.00	0.08
350	002444	巨星科技	14,100	430,191.00	0.08
351	002032	苏泊尔	6,900	429,456.00	0.08
352	600160	巨化股份	33,200	428,612.00	0.08
353	600338	西藏珠峰	11,300	425,558.00	0.08
354	688188	柏楚电子	1,100	424,006.00	0.08
355	688002	睿创微纳	5,375	422,313.75	0.08
356	600392	盛和资源	21,500	421,830.00	0.08
357	300308	中际旭创	9,920	421,600.00	0.08
358	002508	老板电器	11,700	421,434.00	0.08
359	688208	道通科技	5,300	420,820.00	0.08
360	600109	国金证券	37,083	420,150.39	0.08
361	688185	康希诺	1,400	419,370.00	0.08
362	601077	渝农商行	108,900	419,265.00	0.08
363	000983	山西焦煤	50,340	416,311.80	0.08
364	002507	涪陵榨菜	11,000	415,800.00	0.08
365	603233	大参林	9,873	415,752.03	0.08
366	603712	七一二	9,600	415,680.00	0.08
367	601699	潞安环能	36,678	414,828.18	0.07
368	000999	华润三九	12,110	414,646.40	0.07
369	000155	川能动力	15,600	413,868.00	0.07
370	000591	太阳能	36,900	413,280.00	0.07
371	000728	国元证券	53,610	412,797.00	0.07
372	600655	豫园股份	40,000	412,000.00	0.07
373	000629	攀钢钒钛	105,900	411,951.00	0.07
374	002939	长城证券	31,800	411,810.00	0.07
375	601319	中国人保	87,500	411,250.00	0.07
376	002497	雅化集团	14,200	406,972.00	0.07
377	603658	安图生物	7,380	406,342.80	0.07

378	300677	英科医疗	7,000	404,880.00	0.07
379	002192	融捷股份	3,100	403,465.00	0.07
380	300088	长信科技	30,300	402,384.00	0.07
381	601016	节能风电	61,800	402,318.00	0.07
382	002603	以岭药业	20,520	402,192.00	0.07
383	000960	锡业股份	20,500	400,365.00	0.07
384	000423	东阿阿胶	8,200	399,750.00	0.07
385	300558	贝达药业	5,000	399,150.00	0.07
386	600143	金发科技	31,700	398,786.00	0.07
387	600521	华海药业	18,310	396,594.60	0.07
388	601866	中远海发	121,900	396,175.00	0.07
389	000800	一汽解放	38,500	396,165.00	0.07
390	603218	日月股份	12,000	395,400.00	0.07
391	000027	深圳能源	48,740	394,794.00	0.07
392	600170	上海建工	109,600	394,560.00	0.07
393	000050	深天马 A	30,300	394,506.00	0.07
394	600177	雅戈尔	57,220	394,245.80	0.07
395	600549	厦门钨业	17,400	393,762.00	0.07
396	002456	欧菲光	40,300	390,910.00	0.07
397	002463	沪电股份	23,570	390,790.60	0.07
398	601577	长沙银行	49,400	385,814.00	0.07
399	300357	我武生物	6,700	383,910.00	0.07
400	002138	顺络电子	10,000	381,800.00	0.07
401	002078	太阳纸业	33,000	379,170.00	0.07
402	600704	物产中大	64,000	378,880.00	0.07
403	002044	美年健康	48,128	377,804.80	0.07
404	002797	第一创业	51,600	377,712.00	0.07
405	000998	隆平高科	16,200	376,812.00	0.07
406	002157	正邦科技	39,000	376,740.00	0.07
407	600872	中炬高新	9,883	375,257.51	0.07
408	002557	洽洽食品	6,100	374,296.00	0.07
409	002294	信立泰	13,700	374,284.00	0.07
410	603077	和邦生物	108,800	371,008.00	0.07
411	002299	圣农发展	15,300	369,801.00	0.07
412	600699	均胜电子	16,800	369,096.00	0.07
413	002152	广电运通	30,600	364,140.00	0.07
414	600711	盛屯矿业	33,800	362,674.00	0.07
415	002408	齐翔腾达	34,500	362,250.00	0.07
416	000830	鲁西化工	23,700	361,662.00	0.07
417	300832	新产业	8,200	361,210.00	0.07
418	002430	杭氧股份	11,900	357,119.00	0.06
419	000860	顺鑫农业	9,300	355,074.00	0.06
420	002153	石基信息	12,340	354,651.60	0.06

421	002541	鸿路钢构	6,600	353,364.00	0.06
422	300568	星源材质	9,600	352,608.00	0.06
423	002030	达安基因	17,228	345,593.68	0.06
424	000988	华工科技	12,400	345,464.00	0.06
425	601456	国联证券	24,700	345,059.00	0.06
426	600315	上海家化	8,500	343,485.00	0.06
427	600998	九州通	23,300	342,976.00	0.06
428	300725	药石科技	2,400	341,208.00	0.06
429	688202	美迪西	700	339,913.00	0.06
430	300850	新强联	1,900	339,169.00	0.06
431	603444	吉比特	800	337,480.00	0.06
432	603866	桃李面包	11,820	335,688.00	0.06
433	300418	昆仑万维	14,500	335,675.00	0.06
434	000987	越秀金控	38,460	334,602.00	0.06
435	603638	艾迪精密	10,420	332,606.40	0.06
436	002925	盈趣科技	9,760	332,132.80	0.06
437	002422	科伦药业	17,500	331,275.00	0.06
438	000683	远兴能源	45,200	329,960.00	0.06
439	002010	传化智联	37,818	329,016.60	0.06
440	000547	航天发展	19,700	328,990.00	0.06
441	600415	小商品城	67,500	327,375.00	0.06
442	600801	华新水泥	16,700	322,310.00	0.06
443	000709	河钢股份	130,600	321,276.00	0.06
444	002145	中核钛白	25,500	321,045.00	0.06
445	300296	利亚德	31,300	320,825.00	0.06
446	600153	建发股份	35,148	318,792.36	0.06
447	002690	美亚光电	8,507	318,672.22	0.06
448	002926	华西证券	32,300	318,155.00	0.06
449	600598	北大荒	21,800	317,408.00	0.06
450	002156	通富微电	16,300	316,709.00	0.06
451	600688	上海石化	75,247	313,779.99	0.06
452	000513	丽珠集团	7,800	313,638.00	0.06
453	600380	健康元	24,300	312,012.00	0.06
454	002465	海格通信	28,500	311,220.00	0.06
455	601696	中银证券	23,100	310,695.00	0.06
456	000021	深科技	19,200	304,128.00	0.05
457	600988	赤峰黄金	20,400	303,960.00	0.05
458	300136	信维通信	12,000	303,840.00	0.05
459	002092	中泰化学	31,700	302,418.00	0.05
460	002065	东华软件	38,700	301,860.00	0.05
461	002558	巨人网络	25,100	300,447.00	0.05
462	000975	银泰黄金	34,080	299,222.40	0.05
463	300212	易华录	8,400	296,940.00	0.05

464	600511	国药股份	9,400	296,382.00	0.05
465	603858	步长制药	14,040	296,103.60	0.05
466	000656	金科股份	65,700	294,336.00	0.05
467	601992	金隅集团	102,900	292,236.00	0.05
468	600848	上海临港	19,640	292,046.80	0.05
469	002500	山西证券	44,220	291,852.00	0.05
470	300773	拉卡拉	10,000	290,200.00	0.05
471	002373	千方科技	19,400	290,030.00	0.05
472	601231	环旭电子	18,000	289,080.00	0.05
473	600895	张江高科	19,000	286,140.00	0.05
474	300383	光环新网	19,000	281,960.00	0.05
475	300070	碧水源	39,200	281,848.00	0.05
476	002212	天融信	14,600	279,882.00	0.05
477	000750	国海证券	66,980	275,287.80	0.05
478	002506	协鑫集成	72,200	274,360.00	0.05
479	300432	富临精工	9,300	273,420.00	0.05
480	002429	兆驰股份	56,000	272,160.00	0.05
481	002511	中顺洁柔	16,100	269,031.00	0.05
482	002958	青农商行	68,300	263,638.00	0.05
483	002563	森马服饰	33,100	255,863.00	0.05
484	000686	东北证券	28,900	253,742.00	0.05
485	600026	中远海能	42,800	253,376.00	0.05
486	600583	海油工程	54,547	251,461.67	0.05
487	600498	烽火通信	13,900	249,922.00	0.05
488	601598	中国外运	54,200	242,816.00	0.04
489	603883	老百姓	4,880	240,974.40	0.04
490	002151	北斗星通	6,100	239,425.00	0.04
491	002146	荣盛发展	53,700	233,595.00	0.04

### 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

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	688779	长远锂科	31,822	727,450.92	0.13
2	688772	珠海冠宇	10,598	414,275.82	0.07
3	688103	国力股份	1,595	105,429.50	0.02
4	301050	雷电微力	233	54,694.42	0.01
5	301035	润丰股份	644	36,244.32	0.01
6	603230	内蒙新华	1,140	29,491.80	0.01
7	301127	天源环保	1,685	28,847.20	0.01
8	301177	迪阿股份	238	27,627.04	0.00
9	301039	中集车辆	2,064	25,820.64	0.00



10	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.00
11	300994	久祺股份	420	19,089.00	0.00
12	001296	长江材料	310	18,376.80	0.00
13	301060	兰卫医学	587	18,161.78	0.00
14	301168	通灵股份	329	17,150.77	0.00
15	301089	拓新药业	220	14,944.60	0.00
16	301180	万祥科技	654	14,858.88	0.00
17	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.00
18	301020	密封科技	421	12,815.24	0.00
19	301138	华研精机	285	12,785.10	0.00
20	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.00
21	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.00
22	301028	东亚机械	733	9,895.50	0.00
23	301045	天禄科技	335	9,503.95	0.00
24	301078	孩子王	756	9,177.84	0.00
25	301062	上海艾录	523	8,896.23	0.00
26	301193	家联科技	297	8,654.58	0.00
27	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
28	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
29	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.00
30	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
31	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.00
32	301056	森赫股份	572	6,343.48	0.00
33	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
34	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
35	301083	百胜智能	416	5,911.36	0.00
36	300854	中兰环保	203	5,539.87	0.00
37	301063	海锅股份	153	5,524.83	0.00
38	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
39	301059	金三江	259	4,998.70	0.00
40	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
41	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
42	301037	保立佳	193	4,682.18	0.00
43	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
44	301053	远信工业	155	4,460.90	0.00
45	301057	汇隆新材	218	4,146.36	0.00
46	301079	邵阳液压	140	3,474.80	0.00

#### 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	300750	宁德时代	16,981,676.50	1.99
2	000858	五粮液	15,387,076.98	1.81
3	002594	比亚迪	10,427,327.74	1.22
4	300760	迈瑞医疗	9,873,553.97	1.16
5	000333	美的集团	8,303,923.00	0.98
6	002352	顺丰控股	7,081,410.82	0.83
7	000001	平安银行	6,257,737.74	0.74
8	002475	立讯精密	5,352,192.50	0.63
9	002714	牧原股份	4,826,458.43	0.57
10	300059	东方财富	4,668,140.00	0.55
11	300015	爱尔眼科	4,554,082.98	0.54
12	300014	亿纬锂能	4,487,723.30	0.53
13	000568	泸州老窖	4,478,527.13	0.53
14	600519	贵州茅台	4,294,889.00	0.50
15	601888	中国中免	4,025,884.00	0.47
16	002812	恩捷股份	3,997,281.00	0.47
17	000002	万科A	3,947,162.00	0.46
18	002142	宁波银行	3,941,322.23	0.46
19	002049	紫光国微	3,880,400.00	0.46
20	300601	康泰生物	3,780,968.00	0.44

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。

#### 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	24,480,102.68	2.88
2	000858	五粮液	23,784,067.58	2.79
3	002594	比亚迪	12,761,848.67	1.50
4	300760	迈瑞医疗	11,354,494.08	1.33
5	002415	海康威视	10,745,638.06	1.26
6	000001	平安银行	9,493,920.32	1.12
7	002352	顺丰控股	8,344,552.22	0.98
8	002714	牧原股份	7,574,801.60	0.89
9	002475	立讯精密	7,539,479.97	0.89
10	000568	泸州老窖	7,319,430.48	0.86
11	300059	东方财富	6,976,824.44	0.82
12	300015	爱尔眼科	6,887,759.91	0.81
13	000333	美的集团	6,841,627.00	0.80
14	000002	万科A	6,183,552.99	0.73

15	002304	洋河股份	6,162,333.88	0.72
16	002142	宁波银行	5,651,974.00	0.66
17	300014	亿纬锂能	5,584,856.00	0.66
18	600519	贵州茅台	5,470,183.00	0.64
19	300122	智飞生物	5,467,061.00	0.64
20	000725	京东方 A	4,820,953.00	0.57

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。

#### 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

买入股票成本（成交）总额	484,188,073.91
卖出股票收入（成交）总额	583,271,424.58

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。

#### 8.5 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）	620,000.00	0.11
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	620,000.00	0.11

#### 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

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	113052	兴业转债	6,110	611,000.00	0.11
2	113634	珀莱转债	90	9,000.00	0.00

#### 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。

## 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。

## 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。

## 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

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
IC2201	IC2201	2	2,951,120.00	85,120.00	-
IF2201	IF2201	2	2,968,440.00	-7,560.00	-
公允价值变动总额合计（元）					77,560.00
股指期货投资本期收益（元）					823,294.76
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-197,332.00

### 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

无。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

### 8.11.3 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。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 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，因向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。

### 8.12.2 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。

### 8.12.3 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	825,068.46
2	应收证券清算款	72,088.99
3	应收股利	-
4	应收利息	702.49
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	897,859.94

### 8.12.4 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。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 8.12.5.1 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。

#### 8.12.5.2 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	688779	长远锂科	727,450.92	0.13	新股锁定期
2	688772	珠海冠宇	414,275.82	0.07	新股锁定期
3	688103	国力股份	105,429.50	0.02	新股锁定期
4	301050	雷电微力	54,694.42	0.01	新股锁定期
5	301035	润丰股份	36,244.32	0.01	新股锁定期

## § 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		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
3,962	80,206.40	90,079,571.00	28.35%	114,975,104.00	36.18%	112,723,100.00	35.47%

### 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	上海浦东发展银行股份有限公司-兴证全球积极配置三年封闭运作混合型基金中基金	36,645,300.00	11.53%
2	伦敦市投资管理有限公司	8,974,200.00	2.82%
3	华泰证券股份有限公司	8,485,389.00	2.67%
4	招商证券股份有限公司	6,609,089.00	2.08%
5	方正证券股份有限公司	6,337,100.00	1.99%
6	申万宏源证券有限公司	4,618,500.00	1.45%
7	中航安盟财产保险有限公司-自有资金	3,368,300.00	1.06%
8	中信证券股份有限公司	3,184,765.00	1.00%
9	吴美兰	3,000,000.00	0.94%
10	中国民生银行股份有限公司-兴证全球优选平衡三个月持有期混合型基金中基金(FOF)	2,739,400.00	0.86%
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	112,723,100.00	35.47%

注：持有人名称与注册登记机构持有人名册保持一致。

### 9.3 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。

### 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。

### 9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产情况

基金经理姓名	产品类型	持有本人管理的产份额总量的数量区间(万份)
罗文杰	公募基金	50~100
	私募资产管理计划	0
	合计	50~100

## § 10 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	330,000,000.00
减：报告期基金总赎回份额	522,000,000.00
本报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
本报告期期末基金份额总额	317,777,775.00

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末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

因南方基金管理股份有限公司（以下简称“公司”）董事长张海波先生病逝缺位，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先生兼任首席信息官。

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。

### 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。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金的审计事务所无变化，目前普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）已为本基金提供审计服务 4 年，本报告期应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为人民币 55,000.00 元。

### 11.6 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。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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	623,483,304.77	59.21%	62,354.66	59.21%	-
中泰证券	2	383,604,866.21	36.43%	38,362.80	36.43%	-
华泰证券	2	45,901,074.27	4.36%	4,590.34	4.36%	-
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。

C：报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

新增交易单元：

华泰证券

退租交易单元：

无

### 11.7.2 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	435,683.06	7.66%	-	-	-	-
中泰证券	2,664,748.95	46.84%	-	-	-	-
华泰证券	2,589,087.10	45.51%	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-

### 11.8 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
13	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
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、中国证监会基金电子披露网站	2021-06-25
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
23	南方基金关于旗下部分基金增加东方证券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	2021-07-12
24	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	2021-07-17
25	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	2021-07-31
26	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	2021-10-01
27	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	2021-11-06
28	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金参与宁波银行股份有限公司配股的关联交易公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-12-04
29	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	2021-12-04

		基金电子披露网站	
30	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	2021-12-09
31	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	2021-12-29

## § 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
联接基金	1	20210101-20211231	273,193,100.00	55,530,000.00	216,000,000.00	112,723,100.00	35.47%
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。							

注：申购份额包含红利再投资和份额折算。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 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 年年度报告》原文。

## 13.2 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。

## 13.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>