

景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金 2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 31 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经全部独立董事签字同意，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 08 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 2022 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	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	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	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	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内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	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产（基金净值）变动表	14
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	53
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	53
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	53
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	53
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
7.12 投资组合报告附注	53
§ 8 基金份额持有人信息	55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
8.2 期末上市基金前十名持有人	55
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	55
§ 9 开放式基金份额变动	55
§ 10 重大事件揭示	56
10.1 基金份额持有人大会决议	56
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
10.4 基金投资策略的改变	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	56
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	56
10.8 其他重大事件	59
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	60
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	61
§ 12 备查文件目录	61
12.1 备查文件目录	61
12.2 存放地点	62
12.3 查阅方式	62

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城 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	景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通 ETF
场内简称	景顺 MSCI (扩位证券简称: 景顺 MSCIA 股 ETF)
基金主代码	512280
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2018 年 4 月 27 日
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
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	62,005,740.00 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 5 月 25 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，以期获得与标的指数收益相似的回报。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。
投资策略	本基金以 MSCI 中国 A 股国际通指数为标的指数，采用完全复制法，即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。在因特殊情况（包括但不限于成份股停牌、流动性不足、法律法规限制、其它合理原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等）导致无法获得足够数量的股票时，本基金可以根据市场情况，结合经验判断，综合考虑相关性、估值、流动性等因素挑选标的指数中其他成份股或备选成份股进行替代或者采用其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。
业绩比较基准	MSCI 中国 A 股国际通指数(MSCIChina A Inclusion RMB Index (CNY))。
风险收益特征	本基金为股票型指数基金，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预期风险较高、预期收益较高的品种。

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	景顺长城基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	杨皞阳	秦一楠
	联系电话	0755-82370388	010-66060069
	电子邮箱	investor@igwfm.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4008888606	95599
传真		0755-22381339	010-68121816
注册地址		深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 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		518048	100031
法定代表人		李进	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.igwfm.com
基金中期报告备置地点	基金管理人的办公场所

2.5 其他相关资料

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022年1月1日-2022年6月30日)
本期已实现收益	-10,914,539.33
本期利润	-20,613,019.08
加权平均基金份额本期利润	-0.2456
本期加权平均净值利润率	-15.61%
本期基金份额净值增长率	-7.48%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)
期末可供分配利润	39,645,782.87
期末可供分配基金份额利润	0.6394
期末基金资产净值	101,651,522.87
期末基金份额净值	1.6394
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)
基金份额累计净值增长率	63.94%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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、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、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

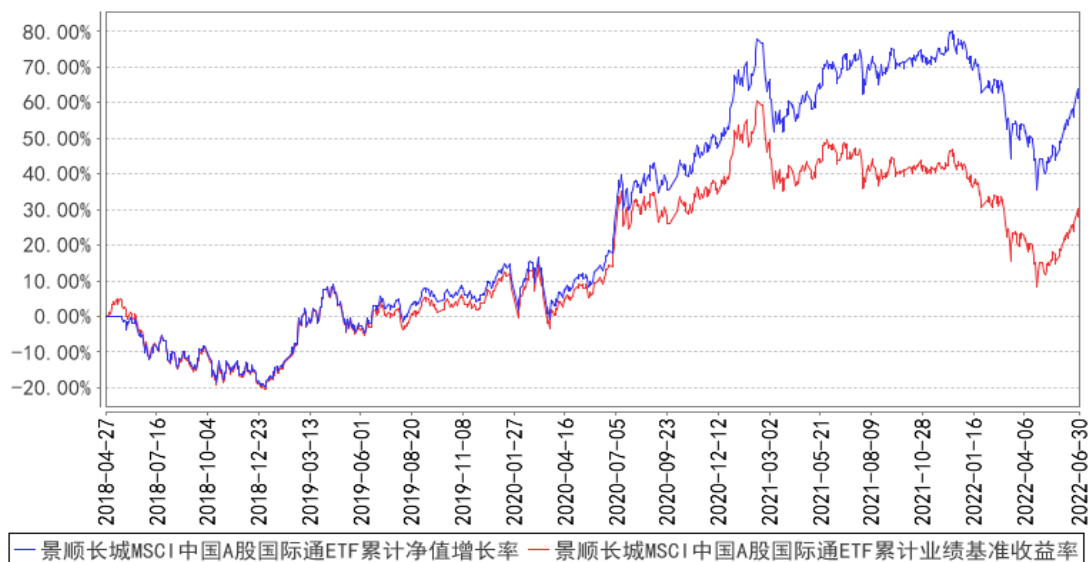
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	10.02%	1.05%	9.38%	1.07%	0.64%	-0.02%
过去三个月	7.57%	1.44%	6.60%	1.46%	0.97%	-0.02%
过去六个月	-7.48%	1.43%	-9.07%	1.46%	1.59%	-0.03%
过去一年	-5.59%	1.22%	-12.39%	1.24%	6.80%	-0.02%
过去三年	59.34%	1.24%	28.25%	1.27%	31.09%	-0.03%
自基金合同生效起至今	63.94%	1.29%	29.92%	1.32%	34.02%	-0.03%

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

景顺长城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



注：基金的投资组合比例为：基金投资于标的指数成份股及备选成份股的资产不低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%。本基金的建仓期为自2018年4月27日基金合同生效日起6个月。建仓期结束时，本基金投资组合达到上述投资组合比例的要求。

3.3 其他指标

无。

§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

本基金管理人景顺长城基金管理有限公司（以下简称“本公司”）是经中国证监会证监基金字[2003]76号文批准设立的证券投资基金管理公司，由长城证券股份有限公司、景顺资产管理有限公司、开滦（集团）有限责任公司、大连实德集团有限公司共同发起设立，并于2003年6月9日获得开业批文，注册资本1.3亿元人民币，目前，各家出资比例分别为49%、49%、1%、1%。总部设在深圳，在北京、上海、广州设有分公司，并设立全资子公司——景顺长城资产管理（深圳）有限公司。

本公司拥有公募、特定客户资产管理、QDII等业务资格，截至2022年6月30日，本公司旗下共管理150只开放式基金，在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、海外投资、资产配置等多个领域布局。

本公司采用团队投资方式，即通过整个投资部门全体人员的共同努力，争取良好投资业绩。

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		
张 晓 南	本基金的基金经理	2020年7月3日	-	12年	经济学硕士，CFA，FRM。曾任鹏华基金管理有限公司产品规划部高级产品设计师，兴银基金管理有限公司研究发展部研究员、权益投资部基金经理。2020年2月加入本公司，自2020年4月起担任ETF与创新投资部基金经理。具有12年证券、基金行业从业经验。

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”按基金合同生效日填写，“离任日期”为根据公司决定的解聘日期（公告前一日）；对此后的非首任基金经理，“任职日期”指根据公司决定聘任后的公告日期，“离任日期”指根据公司决定的解聘日期（公告前一日）；

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业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

无。

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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》和《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《景顺长城 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》和其他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，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011 年修订）》，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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 27 次，为投资组合的投资策略需要而发生的同日反向交易，按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

2022 年 6 月工业增加值当月同比增长 3.90%，前值 0.70%，上海疫情对二季度经济造成的影响已经基本恢复；当月环比增长 0.84%，在 4 月和 5 月大幅波动后仍然平稳增长。6 月 PMI 指数为 50.20，从 4 月的 47.40 向上恢复，预计后续将延续 50 以上景气度。6 月 PPI 同比增长 6.10%，前值 6.40%，环比增长 0.00%；CPI 同比增长 2.50%，前值 2.10%，环比增长 0.00%，全球滞胀风险有所回落。6 月 M2 同比增长 11.40%，M1 同比增长 5.80%，社会融资规模存量同比增长 10.80%，基本可控且处于良性增长态势。5 月末外汇储备 3.07 万亿美元。今年上半年经济整体呈现 V 型态势，一季度全球经济在原本疫情冲击外受到俄乌冲突这一突发事件的影响，双方的相互制裁令全球风险偏好快速下降，对大宗商品及全球商贸活动的影响令滞胀风险再次出现；同时国内受到境外输入疫情的影响加大，深圳、上海等地经济活动受到了极大影响，国内市场对疫情的担忧再次出现。本次上海疫情自 3 月底开始发酵，后续对周边及相关产业链形成了较大范围的冲击，此次疫情对

经济的影响超出了此前的市场预期，相当多重要产品供应链出现问题。随着国内疫情的好转，国内经济生产走势再次验证了市场韧性，可以看到后续多个经济指标出现明显好转，预计国内经济后续将再次回到之前的稳健增长曲线。由于一季度整体市场较差，即使二季度市场略有回暖，上半年主流市场指数仍然呈现跌势，上证综指、深证成指、沪深 300、中证 500、创业板指和科创 50 的收益率分别为-6.63%、-13.20%、-9.22%、-12.30%、-15.41%和-20.92%。

上半年海外最重要的事件是俄乌冲突的爆发，在这种灰犀牛事件的影响下，全球投资者风险厌恶程度快速上升，由于对能源、粮食等大宗商品的供给担忧，全球大宗商品价格出现了比较大的波动，同时叠加美国中期选举的临近，当前全球主要经济体未来的政策不确定性进一步增加。虽然 5 月份美联储议息会议之后，市场对于美联储可以实现“软着陆”的信心有所增强，但 6 月中旬以来，随着通胀数据的超预期走高、经济数据的全面走弱，市场对于美联储牺牲需求被动加快收紧以及经济“硬着陆”担忧加剧，各市场波动明显加大。

而在国内方面，3 月底开始发酵的上海疫情对周边以及产业链相关地区、企业的冲击和对国内经济的影响超出了此前市场预期。在上海逐步复商复市，相关产业链及工商企业逐步恢复正常后，政策方面对于稳定经济大盘诉求更是明显提升，近期疫情的影响大概率也可以告一段落。虽然当前国内还有部分地区存在零星疫情，但是当前最新版防疫政策已经根据新的病毒流行株特征进行了修订，预计后续将更好的兼顾疫情防护与经济增长的关系，国内经济走势将持续稳中向好。

本基金采用完全复制 MSCI 中国 A 股国际通指数的方法进行组合管理，通过控制跟踪误差和跟踪偏离度，力争基金收益和指数收益基本一致。在报告期内，本基金结合申购赎回情况，根据指数成份股及其权重变化定期或不定期调整投资组合，保持对标的指数的紧密跟踪。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2022 年上半年，本基金份额净值增长率为-7.48%，业绩比较基准收益率为-9.07%。报告期内，本基金相对于业绩比较基准的日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2%以内，跟踪误差（年化）控制在 2%以内。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2022 年下半年，疫情仍将是影响全球经济活动的最大变量，在 Omicron 不同变异株的影响下，大部分经济体短时间内无法做到对病毒感染的有效控制，全球产能恢复的速度在当前时点仍然无法明确预见，且 COVID-19 的长期影响也开始显现。在这种情况下，更加凸显了国内疫情防控的前瞻性和先进性，今年上半年上海疫情的快速控制和疫情后恢复也凸显了“中国制造”的韧性，预计后续国内企业仍将为全球工业品和消费品的生产做出卓越的贡献，全球市场地位有望后续持续提升。在整体经济复苏的基础上，资本市场仍有强大的吸引力，我们对市场保持乐观。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人成立基金估值委员会对基金财产的估值方法及程序作决策，基金估值委员会在遵守法律法规的前提下，通过参考行业协会的估值指引及独立第三方估值服务机构的估值数据等方式，谨慎合理地制定高效可行的估值方法，及时准确地进行份额净值的计量，保护基金份额持有人的合法权益。

基金日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行。基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以双方认可的方式报送给基金托管人，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，无误后返回给基金管理人，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

当发生了影响估值方法和程序的有效性及适用性的情况时，通过会议方式启动估值委员会的运作。研究人员凭借其丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究，综合宏观经济、行业发展及个券状况等各方面因素，从价值投资的角度进行理论分析，并根据分析的结果向基金估值委员会提出有关估值方法或估值模型的建议。风险管理人员根据研究人员提出的估值方法或估值模型进行计算及验证，并根据计算和验证的结果与投资人员共同确定估值方法并提交估值委员会。基金事务部基金会计负责与基金托管人沟通，必要时应就所采用的估值技术、假设及输入值得适当性等咨询会计师事务所的专业意见。法律、监察稽核部相关人员负责监察执行估值政策及程序的合规性，控制执行中可能发生的风险。估值委员会共同讨论通过后，基金事务部基金会计根据估值委员会确认的估值方法对各基金进行估值核算并与基金托管行核对，法律、监察稽核部负责对外进行信息披露。

截止本报告期末，本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司合作，由其提供相关债券品种、流通受限股票的估值参考数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§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—景顺长城基金管理有限公司 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、

独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：景顺长城 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：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	1,796,022.05	3,999,846.12
结算备付金		31,885.82	158,463.18
存出保证金		20,048.37	31,134.97
交易性金融资产	6.4.7.2	99,989,439.12	169,756,197.23
其中：股票投资		99,970,637.40	169,564,197.23
基金投资		-	-
债券投资		18,801.72	192,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-

其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		42,455.52	99,802.94
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	866.29
资产总计		101,879,850.88	174,046,310.73
负债和净资产	附注号	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		39,907.74	72,191.88
应付托管费		7,981.54	14,438.34
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	180,438.73	301,638.26
负债合计		228,328.01	388,268.48
净资产:			
实收基金	6.4.7.7	62,005,740.00	98,005,740.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	39,645,782.87	75,652,302.25
净资产合计		101,651,522.87	173,658,042.25
负债和净资产总计		101,879,850.88	174,046,310.73

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.6394 元，基金份额总额 62,005,740.00 份。

6.2 利润表

会计主体：景顺长城 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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2022 年 1 月 1 日至 2022 年	2021 年 1 月 1 日至 2021 年

		6 月 30 日	6 月 30 日
一、营业总收入		-20,063,462.74	17,102,772.78
1. 利息收入		11,561.58	14,191.83
其中：存款利息收入	6.4.7.9	11,561.58	14,158.69
债券利息收入		-	33.14
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-10,128,610.03	27,688,752.05
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-11,062,294.76	26,615,442.51
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	71,691.04	38,604.96
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	-	-
股利收益	6.4.7.13	861,993.69	1,034,704.58
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	-9,698,479.75	-10,812,652.63
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	-247,934.54	212,481.53
减：二、营业总支出		549,556.34	892,742.32
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	330,029.19	390,421.98
2. 托管费	6.4.10.2.2	66,005.86	78,084.34
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		0.02	0.02
8. 其他费用	6.4.7.16	153,521.27	424,235.98
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-20,613,019.08	16,210,030.46
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-20,613,019.08	16,210,030.46
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-20,613,019.08	16,210,030.46

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城 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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	98,005,740.00	-	75,652,302.25	173,658,042.25
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	98,005,740.00	-	75,652,302.25	173,658,042.25
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-36,000,000.00	-	-36,006,519.38	-72,006,519.38
（一）、综合收益总额	-	-	-20,613,019.08	-20,613,019.08
（二）、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）	-36,000,000.00	-	-15,393,500.30	-51,393,500.30
其中：1. 基金申购款	12,000,000.00	-	8,021,298.47	20,021,298.47
2. 基金赎回款	-48,000,000.00	-	-23,414,798.77	-71,414,798.77
（三）、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）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	62,005,740.00	-	39,645,782.87	101,651,522.87
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	122,005,740.00	-	70,947,428.69	192,953,168.69
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	122,005,740.00	-	70,947,428.69	192,953,168.69
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-28,000,000.00	-	-1,709,763.66	-29,709,763.66
（一）、综合收益总额	-	-	16,210,030.46	16,210,030.46
（二）、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	-	-17,919,794.12	-45,919,794.12
其中：1. 基金申购款	38,000,000.00	-	24,573,524.87	62,573,524.87

2. 基金赎回款	-66,000,000.00	-	-42,493,318.99	-108,493,318.99
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	94,005,740.00	-	69,237,665.03	163,243,405.03

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

康乐

吴建军

邵媛媛

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

景顺长城 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]548 号《关于准予景顺长城 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》核准,由景顺长城基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城 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指数基金,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 1,533,998,240.00 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 0283 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《景顺长城 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 27 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,534,005,740.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 7,500.00 份基金份额。本基金的基金管理人为景顺长城基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)上证函[2018]67 号文审核同意,本基金 1,534,005,740.00 份基金份额于 2018 年 5 月 25 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《景顺长城 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标的指数 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。投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股,投资于标的指数成份股及备选成份股的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%。此外,为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于部分非成份股(包含中小板、创业

板及其他经中国证监会核准上市的股票及存托凭证)、股指期货、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)。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。本基金的业绩比较基准为 MSCI 中国 A 股国际通指数(MSCI China A Inclusion RMB Index (CNY))。

本基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司以本基金为目标 ETF，募集成立了景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 联接基金”)。景顺长城 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景顺长城基金管理有限公司于 2022 年 8 月 29 日批准报出。

6.4.2 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》、本基金基金合同和在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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2022 年半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 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

除下述变更后的会计政策外，本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入

其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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主要为债券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和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。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括其他各类应付款项等。

6.4.4.2 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在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，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，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，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。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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。

6.4.4.3 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(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率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投资收益。

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相关交易费用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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《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》及《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”），财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《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〉》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

(a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度可比期间的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息和应收证券清算款，金额分别为 3,999,846.12 元、158,463.18 元、31,134.97 元、866.29 元和 99,802.94 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息和应收清算款，金额分别为 4,000,622.40 元、158,534.48 元、31,149.07 元、0.00 元和 99,802.94 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 169,756,197.23 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 169,756,201.84 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付管理人报酬、应付托管费、应付交易费

用和其他负债-其他应付款，金额分别为 72,191.88 元、14,438.34 元、61,757.29 元和 64,880.97 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付管理人报酬、应付托管费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 72,191.88 元、14,438.34 元、61,757.29 元和 64,880.97 元。

于 2021 年 12 月 31 日，“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，本基金无期初留存收益影响。

(b) 修订后的《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>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《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>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[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[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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。

对基金通过沪港通或深港通(如有)投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通或深港通(如有)投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过沪港通或深港通(如有)买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	1,796,022.05
等于：本金	1,795,682.94
加：应计利息	339.11

减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1 个月（含）-3 个月	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	1,796,022.05

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	101,649,461.30	-	99,970,637.40	-1,678,823.90	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	18,800.00	1.72	18,801.72	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	18,800.00	1.72	18,801.72	-
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	101,668,261.30	1.72	99,989,439.12	-1,678,823.90	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末的衍生金融资产/负债余额为零。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末的买入返售金融资产余额为零。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末买断式逆回购交易中取得的债券余额为零。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末的其他资产余额为零。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	29,517.97
其中：交易所市场	29,517.97
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	86,780.45
应付指数使用费	64,140.31
合计	180,438.73

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	98,005,740.00	98,005,740.00
本期申购	12,000,000.00	12,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-48,000,000.00	-48,000,000.00
本期末	62,005,740.00	62,005,740.00

6.4.7.8 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
本期期初	93,240,510.60	-17,588,208.35	75,652,302.25
本期利润	-10,914,539.33	-9,698,479.75	-20,613,019.08
本期基金份额交易产生的变动数	-32,272,909.22	16,879,408.92	-15,393,500.30
其中：基金申购款	11,437,181.84	-3,415,883.37	8,021,298.47
基金赎回款	-43,710,091.06	20,295,292.29	-23,414,798.77
本期已分配利润	-	-	-
本期末	50,053,062.05	-10,407,279.18	39,645,782.87

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	10,634.27
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	717.63
其他	209.68
合计	11,561.58

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-6,744,122.32
股票投资收益——赎回差价收入	-4,318,172.44
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	-11,062,294.76

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	47,931,299.34
减：卖出股票成本总额	54,545,524.72
减：交易费用	129,896.94
买卖股票差价收入	-6,744,122.32

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
赎回基金份额对价总额	71,414,798.77
减：现金支付赎回款总额	28,601,375.77
减：赎回股票成本总额	47,131,595.44
减：交易费用	-
赎回差价收入	-4,318,172.44

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	65.38
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	71,625.66
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	71,691.04

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	461,596.04
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	389,900.00
减：应计利息总额	68.55
减：交易费用	1.83
买卖债券差价收入	71,625.66

6.4.7.12 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	861,993.69
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	861,993.69

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
1. 交易性金融资产	-9,698,479.75
股票投资	-9,698,479.75
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	-9,698,479.75

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	-247,934.54
合计	-247,934.54

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

6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
审计费用	27,273.08
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	2,600.51
指数使用费	64,140.31
合计	153,521.27

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，按季支付，标的指数许可使用费的收取下限为每季度（自然季度）美元 5,000 元。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
景顺长城基金管理有限公司	基金管理人
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人
长城证券股份有限公司（“长城证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 联接基金”）	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例(%)
长城证券	302,479.40	0.40	-	-

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例(%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例(%)
长城证券	281.67	0.40	281.67	0.95
关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例(%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例(%)
长城证券	-	-	-	-

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6 月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	330,029.19	390,421.98
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：支付基金管理人景顺长城基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50% 的费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.50% / 当年天数。

6.4.10.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	66,005.86	78,084.34

注：支付基金托管人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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金于本报告期及上年度可比期间均未发生转融通证券出借业务交易。

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

本基金于本报告期及上年度可比期间均未发生转融通证券出借业务交易。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人本报告期和上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 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（%）
景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金	-	-	22,352,800.00	22.8100

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行-活期	1,796,022.05	10,634.27	3,628,658.52	12,379.60

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

于 2022 年 6 月 30 日，本基金持有 6,100 股长城证券的 A 股普通股，成本总额为人民币 68,800.19 元，估值总额为人民币 61,976.00 元，占基金资产净值的比例为 0.06%；本基金持有 201,000 股中国农业银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 623,930.06 元，估值总额为人民币 607,020.00 元，占基金资产净值的比例为 0.60%(2021 年 12 月 31 日，本基金持有 9,700 股长城证券的 A 股普通股，成本总额为人民币 110,364.48 元，估值总额为人民币 125,615.00 元，占基金资产净值的比例为 0.07%；本基金持有 281,700 股中国农业银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 883,962.73 元，估值总额为人民币 828,198.00 元，占基金资产净值的比例为 0.48%)。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

6.4.12 期末(2022年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	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
301110	青木股份	2022年3月4日	6个月	新股流通受限	63.10	39.85	85	5,363.50	3,387.25	-
301116	益客食品	2022年1月10日	6个月	新股流通受限	11.40	20.46	505	5,757.00	10,332.30	-
301117	佳缘科技	2022年1月7日	6个月	新股流通受限	46.80	54.44	135	6,318.00	7,349.40	-
301123	奕东电子	2022年1月14日	6个月	新股流通受限	37.23	25.39	161	5,994.03	4,087.79	-
301130	西点药业	2022年2月16日	6个月	新股流通受限	22.55	37.70	221	4,983.55	8,331.70	-
301137	哈焊华通	2022年3月14日	6个月	新股流通受限	15.37	15.99	403	6,194.11	6,443.97	-
301158	德石股份	2022年1月7日	6个月	新股流通受限	15.64	20.38	316	4,942.24	6,440.08	-
301196	唯科科技	2022年1月4日	6个月	新股流通受限	64.08	37.52	60	3,844.80	2,251.20	-
301200	大族数控	2022年2月18日	6个月	新股流通受限	76.56	51.92	109	8,345.04	5,659.28	-
301207	华兰疫苗	2022年2月10日	6个月	新股流通受限	56.88	56.42	113	6,427.44	6,375.46	-
301215	中汽股份	2022年2月28日	6个月	新股流通受限	3.80	6.39	2,008	7,630.40	12,831.12	-
301216	万凯新材	2022年3月21日	6个月	新股流通受限	35.68	29.84	168	5,994.24	5,013.12	-

301219	腾远钴业	2022 年 3 月 10 日	6 个月	新股流通受限	173.98	87.82	28	4,871.44	2,458.96	-
301219	腾远钴业	2022 年 5 月 24 日	4 个月	新股流通受限—转增	-	87.82	22	-	1,932.04	-
301222	浙江恒威	2022 年 3 月 2 日	6 个月	新股流通受限	33.98	28.96	160	5,436.80	4,633.60	-
301228	实朴检测	2022 年 1 月 21 日	6 个月	新股流通受限	20.08	20.34	344	6,907.52	6,996.96	-
301235	华康医疗	2022 年 1 月 21 日	6 个月	新股流通受限	39.30	37.93	220	8,646.00	8,344.60	-
301256	华融化学	2022 年 3 月 14 日	6 个月	新股流通受限	8.05	10.08	757	6,093.85	7,630.56	-
301258	富士莱	2022 年 3 月 21 日	6 个月	新股流通受限	48.30	41.68	100	4,830.00	4,168.00	-
301263	泰恩康	2022 年 3 月 22 日	6 个月	新股流通受限	19.93	31.38	269	5,361.17	8,441.22	-
688163	赛伦生物	2022 年 3 月 2 日	6 个月	新股流通受限	33.03	23.56	1,683	55,589.49	39,651.48	-
688223	晶科能源	2022 年 1 月 19 日	6 个月	新股流通受限	5.00	14.47	18,247	91,235.00	264,034.09	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	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
113060	浙 22 转债	2022 年 6 月 15 日	1 个月内（含）	新债流通受限	100.00	100.01	160	16,000.00	16,001.19	-
127064	杭氧转债	2022 年 5 月 19 日	1-6 个月（含）	新债流通受限	100.00	100.02	28	2,800.00	2,800.53	-

注：受限期内，本基金因上市公司发生股票红利、送股、资本公积转增股本、配股等权益行为获取的衍生股份，亦应遵守相关股份的受限安排。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截止本报告期末，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截止本报告期末，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中由金融工具产生的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。

本基金管理人秉承全面风险管理的理念，将风险管理融入业务中，建立了以风险管理委员会为核心，由风险管理委员会、督察长、法律监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。各业务部门负责人为其所在部门的风险管理第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控和

及时报告的义务。员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。本基金管理人配备的风险管理人员对投资风险进行独立的监控并及时向管理层汇报。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的投资范围及投资比例符合相关法律法规的要求、相关监管机构的相关规定及本基金的合同要求。本基金管理人通过建立和完善内部信用评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。本基金的活期银行存款存放在具有托管资格的银行；本基金存放定期存款前，均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险，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；本基金在银行间同业市场仅与达到本基金管理人既定信用政策标准的交易对手进行交易，以控制相应的信用风险。

本基金管理人还通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券余额的 10%。

于本报告期末，本基金持有除国债、央行票据、政策性金融债及地方政府债券之外的债券和资产支持证券的账面价值占基金净资产的比例为 0.02%（上年度末：0.11%）。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险，是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险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，另一方面来自于基金份额持有人可依据基金合同约定要求赎回其持有的基金份额。

本基金的基金管理人专业审慎、勤勉尽责地管控本基金的流动性风险，全覆盖、多维度的建立以压力测试为核心的流动性风险监测与预警制度，确保本基金组合的资产变现能力与投资者赎回需求匹配与平衡。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《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》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）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、流通受限制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。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。由本基金的基金管理人管理的所有开放式基金于开放期内共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制）。

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 6.4.12。此外，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%。

本基金的基金管理人对其管理的所有开放式基金于开放期内，对基金组合资产中 7 个工作日内可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日内可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的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本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场价格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。本基金管理人通过对不同类型的风险分别设定风险限制，并由独立于投资部门的风险管理人员监控、报告以及定期风险回顾的方法管理投资组合的市场风险。

6.4.13.4.1 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因市场利率变动而发生波动的风险。

本基金管理人通过风险管理人员定期监控组合中债券投资部分的利率风险，及时调整投资组合久期等方法管理利率风险。

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的重新定价日或到期日进行了分类。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	1,796,022.05	-	-	-	-	-	1,796,022.05
结算备付金	31,885.82	-	-	-	-	-	31,885.82
存出保证金	20,048.37	-	-	-	-	-	20,048.37
交易性金融资产	-	-	-	-	18,801.72	99,970,637.40	99,989,439.12
应收证券清算款	-	-	-	-	-	42,455.52	42,455.52
资产总计	1,847,956.24	-	-	-	18,801.72	100,013,092.92	101,879,850.88
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	39,907.74	39,907.74
应付托管费	-	-	-	-	-	7,981.54	7,981.54
其他负债	-	-	-	-	-	180,438.73	180,438.73
负债总计	-	-	-	-	-	228,328.01	228,328.01
利率敏感度缺口	1,847,956.24	-	-	-	18,801.72	-	-
上年度末 2021 年 12 月 31 日							
资产							
银行存款	3,999,846.12	-	-	-	-	-	3,999,846.12
结算备付金	158,463.18	-	-	-	-	-	158,463.18
存出保证金	31,134.97	-	-	-	-	-	31,134.97
交易性金融资产	-	-	-	-	192,000.00	169,564,197.23	169,756,197.23
应收利息	-	-	-	-	-	866.29	866.29
应收证券清算款	-	-	-	-	-	99,802.94	99,802.94
资产总计	4,189,444.27	-	-	-	192,000.00	169,664,866.46	174,046,310.73
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	72,191.88	72,191.88
应付托管费	-	-	-	-	-	14,438.34	14,438.34
应付交易费用	-	-	-	-	-	61,757.29	61,757.29
其他负债	-	-	-	-	-	239,880.97	239,880.97
负债总计	-	-	-	-	-	388,268.48	388,268.48
利率敏感度缺口	4,189,444.27	-	-	-	192,000.00	-	-

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期末，本基金持有的债券资产的账面价值占资产净值比例为 0.02%（上年度末：0.11%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年度末：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因除外汇风险和利率风险以外的市场价格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证券，所面临的重大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其它价格风险，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。

经测算本基金面临的其他价格风险列示如下：

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日		上年度末 2021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	99,970,637.40	98.35	169,564,197.23	97.64
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	99,970,637.40	98.35	169,564,197.23	97.64

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
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（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）	
分析	沪深 300 指数上升 5%	4,990,956.27	8,143,452.23
	沪深 300 指数下降 5%	-4,990,956.27	-8,143,452.23

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	99,543,843.22	168,477,302.91
第二层次	18,801.72	1,278,894.32
第三层次	426,794.18	-
合计	99,989,439.12	169,756,197.23

6.4.14.2.2 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。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具（2021 年 12 月 31 日：同）。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于 2022 年上半年度，本基金申购基金份额的对价总额为 20,021,298.47 元（2021 年上半年度：62,573,524.87 元），其中包括以股票支付的申购款 11,485,449.00 元和以现金支付的申购款 8,535,849.47 元（2021 年上半年度：其中包括以股票支付的申购款 35,887,421.66 元和以现金支付的申购款 26,686,103.21 元）。

除基金申购款外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	99,970,637.40	98.13
	其中：股票	99,970,637.40	98.13
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	18,801.72	0.02
	其中：债券	18,801.72	0.02
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,827,907.87	1.79
8	其他各项资产	62,503.89	0.06
9	合计	101,879,850.88	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告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	1,217,264.54	1.20
B	采矿业	3,863,737.44	3.80
C	制造业	59,262,423.93	58.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,003,242.12	2.95
E	建筑业	1,754,007.20	1.73
F	批发和零售业	798,149.57	0.79
G	交通运输、仓储和邮政业	3,056,097.80	3.01
H	住宿和餐饮业	196,570.00	0.19
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,038,663.34	2.99
J	金融业	17,475,962.76	17.19
K	房地产业	1,771,436.78	1.74
L	租赁和商务服务业	1,442,143.80	1.42
M	科学研究和技术服务业	1,180,222.40	1.16
N	水利、环境和公共设施管理业	204,749.00	0.20
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	844,343.21	0.83
R	文化、体育和娱乐业	305,735.40	0.30
S	综合	80,940.00	0.08

合计	99,495,689.29	97.88
----	---------------	-------

7.2.2 报告期末积极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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	427,597.56	0.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	8,441.22	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,736.65	0.01
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	28,172.68	0.03
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
合计		474,948.11	0.47

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	2,987	6,108,415.00	6.01
2	300750	宁德时代	5,515	2,945,010.00	2.90
3	600036	招商银行	48,778	2,058,431.60	2.02
4	000858	五粮液	9,172	1,852,101.96	1.82
5	002594	比亚迪	4,320	1,440,676.80	1.42
6	600900	长江电力	53,712	1,241,821.44	1.22
7	601318	中国平安	25,637	1,196,991.53	1.18
8	601012	隆基绿能	17,939	1,195,275.57	1.18
9	601888	中国中免	4,700	1,094,771.00	1.08

10	601166	兴业银行	49,100	977,090.00	0.96
11	600809	山西汾酒	2,941	955,236.80	0.94
12	300760	迈瑞医疗	2,900	908,280.00	0.89
13	000568	泸州老窖	3,535	871,518.90	0.86
14	603288	海天味业	9,203	831,583.08	0.82
15	300059	东方财富	31,261	794,029.40	0.78
16	600309	万华化学	7,465	724,030.35	0.71
17	601398	工商银行	148,500	708,345.00	0.70
18	002714	牧原股份	12,422	686,563.94	0.68
19	000001	平安银行	45,800	686,084.00	0.67
20	002304	洋河股份	3,613	661,720.95	0.65
21	002352	顺丰控股	11,550	644,605.50	0.63
22	600438	通威股份	10,668	638,586.48	0.63
23	603259	药明康德	6,040	628,099.60	0.62
24	600030	中信证券	28,850	624,891.00	0.61
25	601288	农业银行	201,000	607,020.00	0.60
26	600887	伊利股份	15,100	588,145.00	0.58
27	300015	爱尔眼科	12,757	571,130.89	0.56
28	002475	立讯精密	16,680	563,617.20	0.55
29	600276	恒瑞医药	15,034	557,611.06	0.55
30	002142	宁波银行	15,566	557,418.46	0.55
31	600000	浦发银行	69,300	555,093.00	0.55
32	002812	恩捷股份	2,200	550,990.00	0.54
33	600436	片仔癀	1,504	536,521.92	0.53
34	601668	中国建筑	99,060	526,999.20	0.52
35	601088	中国神华	15,530	517,149.00	0.51
36	600048	保利发展	28,200	492,372.00	0.48
37	601225	陕西煤业	22,900	485,022.00	0.48
38	601816	京沪高铁	96,600	484,932.00	0.48
39	000002	万科 A	22,885	469,142.50	0.46
40	601328	交通银行	92,600	461,148.00	0.45
41	601899	紫金矿业	48,600	453,438.00	0.45
42	002129	TCL 中环	7,600	447,564.00	0.44
43	300014	亿纬锂能	4,485	437,287.50	0.43
44	600406	国电南瑞	15,764	425,628.00	0.42
45	600905	三峡能源	67,400	423,946.00	0.42
46	300122	智飞生物	3,800	421,838.00	0.41
47	002459	晶澳科技	5,320	419,748.00	0.41
48	601919	中远海控	29,843	414,817.70	0.41
49	300124	汇川技术	6,237	410,831.19	0.40
50	002460	赣锋锂业	2,750	408,925.00	0.40
51	600690	海尔智家	14,834	407,341.64	0.40

52	600031	三一重工	20,000	381,200.00	0.38
53	601601	中国太保	16,100	378,833.00	0.37
54	002493	荣盛石化	23,850	367,051.50	0.36
55	603501	韦尔股份	2,100	363,363.00	0.36
56	002371	北方华创	1,300	360,256.00	0.35
57	603799	华友钴业	3,753	358,861.86	0.35
58	000725	京东方 A	88,600	349,084.00	0.34
59	300274	阳光电源	3,500	343,875.00	0.34
60	688599	天合光能	5,196	339,039.00	0.33
61	000625	长安汽车	19,545	338,519.40	0.33
62	601658	邮储银行	62,800	338,492.00	0.33
63	600585	海螺水泥	9,449	333,360.72	0.33
64	600104	上汽集团	18,295	325,833.95	0.32
65	300498	温氏股份	14,940	318,072.60	0.31
66	600019	宝钢股份	52,556	316,387.12	0.31
67	600016	民生银行	83,660	311,215.20	0.31
68	600346	恒力石化	13,840	307,801.60	0.30
69	600028	中国石化	75,200	306,816.00	0.30
70	300896	爱美客	500	300,005.00	0.30
71	600111	北方稀土	8,503	298,965.48	0.29
72	601766	中国中车	57,400	298,480.00	0.29
73	601390	中国中铁	48,400	297,176.00	0.29
74	601066	中信建投	10,200	294,882.00	0.29
75	601818	光大银行	97,600	293,776.00	0.29
76	601985	中国核电	42,400	290,864.00	0.29
77	600893	航发动力	6,282	285,893.82	0.28
78	002049	紫光国微	1,500	284,580.00	0.28
79	601669	中国电建	36,100	284,107.00	0.28
80	002709	天赐材料	4,520	280,511.20	0.28
81	603659	璞泰来	3,280	276,832.00	0.27
82	601988	中国银行	82,900	270,254.00	0.27
83	601857	中国石油	50,949	270,029.70	0.27
84	601211	国泰君安	17,728	269,465.60	0.27
85	002241	歌尔股份	8,000	268,800.00	0.26
86	000776	广发证券	13,900	259,930.00	0.26
87	000538	云南白药	4,220	254,845.80	0.25
88	600050	中国联通	73,100	252,926.00	0.25
89	600010	包钢股份	107,600	252,860.00	0.25
90	600999	招商证券	17,520	252,463.20	0.25
91	001979	招商蛇口	18,700	251,141.00	0.25
92	000596	古井贡酒	1,000	249,660.00	0.25
93	600919	江苏银行	34,780	247,633.60	0.24

94	600745	闻泰科技	2,900	246,819.00	0.24
95	601688	华泰证券	17,309	245,787.80	0.24
96	601009	南京银行	23,566	245,557.72	0.24
97	600089	特变电工	8,944	244,976.16	0.24
98	603993	洛阳钼业	41,700	238,941.00	0.24
99	000063	中兴通讯	9,300	237,429.00	0.23
100	000895	双汇发展	8,100	237,330.00	0.23
101	688111	金山办公	1,200	236,544.00	0.23
102	002311	海大集团	3,900	234,039.00	0.23
103	000661	长春高新	1,000	233,420.00	0.23
104	600188	兖矿能源	5,900	232,932.00	0.23
105	000651	格力电器	6,900	232,668.00	0.23
106	601006	大秦铁路	35,100	231,309.00	0.23
107	601138	工业富联	23,357	229,832.88	0.23
108	002027	分众传媒	34,060	229,223.80	0.23
109	000166	申万宏源	53,200	228,228.00	0.22
110	002230	科大讯飞	5,500	226,710.00	0.22
111	601169	北京银行	49,900	226,546.00	0.22
112	603986	兆易创新	1,580	224,691.80	0.22
113	600837	海通证券	22,724	222,922.44	0.22
114	603392	万泰生物	1,430	222,079.00	0.22
115	601229	上海银行	33,504	219,451.20	0.22
116	300759	康龙化成	2,300	219,006.00	0.22
117	300751	迈为股份	440	215,996.00	0.21
118	600989	宝丰能源	14,400	210,960.00	0.21
119	600926	杭州银行	14,000	209,720.00	0.21
120	600196	复星医药	4,708	207,575.72	0.20
121	603806	福斯特	3,148	206,256.96	0.20
122	601628	中国人寿	6,550	203,574.00	0.20
123	300316	晶盛机电	3,000	202,770.00	0.20
124	300763	锦浪科技	950	202,350.00	0.20
125	000338	潍柴动力	16,000	199,520.00	0.20
126	600150	中国船舶	10,500	199,290.00	0.20
127	600660	福耀玻璃	4,700	196,507.00	0.19
128	601633	长城汽车	5,300	196,312.00	0.19
129	002920	德赛西威	1,300	192,400.00	0.19
130	600029	南方航空	26,100	190,791.00	0.19
131	601100	恒立液压	3,064	189,110.08	0.19
132	688012	中微公司	1,604	187,267.00	0.18
133	000963	华东医药	4,117	185,923.72	0.18
134	600522	中天科技	8,000	184,800.00	0.18
134	600886	国投电力	17,600	184,800.00	0.18

135	600958	东方证券	18,012	183,902.52	0.18
136	300999	金龙鱼	3,400	183,668.00	0.18
137	601868	中国能建	76,500	181,305.00	0.18
138	601111	中国国航	15,600	181,116.00	0.18
139	300142	沃森生物	3,703	179,188.17	0.18
140	601877	正泰电器	5,000	178,900.00	0.18
141	603833	欧派家居	1,187	178,857.16	0.18
142	601689	拓普集团	2,600	177,918.00	0.18
143	002074	国轩高科	3,900	177,840.00	0.17
144	600132	重庆啤酒	1,200	175,920.00	0.17
145	601238	广汽集团	11,500	175,260.00	0.17
146	600600	青岛啤酒	1,682	174,793.44	0.17
147	600588	用友网络	8,022	174,157.62	0.17
148	002821	凯莱英	600	173,400.00	0.17
149	300782	卓胜微	1,280	172,800.00	0.17
150	600460	士兰微	3,300	171,600.00	0.17
151	600741	华域汽车	7,400	170,200.00	0.17
152	002180	纳思达	3,300	167,046.00	0.16
153	002001	新和成	7,288	166,239.28	0.16
154	688008	澜起科技	2,740	165,989.20	0.16
155	601615	明阳智能	4,900	165,620.00	0.16
156	600233	圆通速递	8,100	165,159.00	0.16
157	600795	国电电力	42,100	164,611.00	0.16
158	300661	圣邦股份	900	163,818.00	0.16
159	300769	德方纳米	400	163,472.00	0.16
160	600256	广汇能源	15,500	163,370.00	0.16
161	600176	中国巨石	9,373	163,183.93	0.16
162	000733	振华科技	1,200	163,164.00	0.16
163	000876	新希望	10,601	162,195.30	0.16
164	000100	TCL 科技	33,500	160,465.00	0.16
165	300628	亿联网络	2,103	160,143.45	0.16
166	601336	新华保险	4,919	158,342.61	0.16
167	600547	山东黄金	8,504	157,834.24	0.16
168	600015	华夏银行	30,218	157,435.78	0.15
169	688396	华润微	2,663	157,303.41	0.15
170	000301	东方盛虹	9,300	157,263.00	0.15
171	603290	斯达半导	400	154,360.00	0.15
172	601865	福莱特	4,000	152,400.00	0.15
173	300957	贝泰妮	700	152,271.00	0.15
174	002756	永兴材料	1,000	152,210.00	0.15
175	600011	华能国际	21,587	151,972.48	0.15
176	688005	容百科技	1,166	150,927.04	0.15

177	600570	恒生电子	3,441	149,821.14	0.15
178	000799	酒鬼酒	800	148,648.00	0.15
179	600884	杉杉股份	5,000	148,600.00	0.15
180	603369	今世缘	2,900	147,900.00	0.15
181	601618	中国中冶	42,100	147,350.00	0.14
182	002648	卫星化学	5,681	146,853.85	0.14
183	300413	芒果超媒	4,390	146,450.40	0.14
184	601600	中国铝业	30,800	146,300.00	0.14
185	002736	国信证券	15,100	144,507.00	0.14
186	600426	华鲁恒升	4,940	144,248.00	0.14
187	600845	宝信软件	2,640	144,144.00	0.14
188	601788	光大证券	9,127	143,841.52	0.14
189	601360	三六零	16,811	143,229.72	0.14
190	600383	金地集团	10,562	141,953.28	0.14
191	603260	合盛硅业	1,200	141,552.00	0.14
192	601838	成都银行	8,500	140,930.00	0.14
193	605117	德业股份	500	139,945.00	0.14
194	600763	通策医疗	800	139,552.00	0.14
195	688036	传音控股	1,539	137,324.97	0.14
196	603185	上机数控	880	137,271.20	0.14
197	601939	建设银行	22,600	136,956.00	0.13
198	002938	鹏鼎控股	4,500	135,945.00	0.13
199	601117	中国化学	14,400	135,504.00	0.13
200	300408	三环集团	4,500	135,450.00	0.13
201	000786	北新建材	3,900	135,018.00	0.13
202	601155	新城控股	5,300	134,779.00	0.13
203	603486	科沃斯	1,100	134,079.00	0.13
204	600754	锦江酒店	2,100	132,090.00	0.13
205	601916	浙商银行	39,376	130,728.32	0.13
206	300496	中科创达	1,000	130,480.00	0.13
207	601901	方正证券	19,428	130,361.88	0.13
208	000938	紫光股份	6,679	129,572.60	0.13
209	300433	蓝思科技	11,700	129,519.00	0.13
210	000983	山西焦煤	9,590	128,410.10	0.13
211	600018	上港集团	21,900	127,677.00	0.13
212	300207	欣旺达	4,000	126,400.00	0.12
213	000069	华侨城 A	19,300	125,257.00	0.12
214	300033	同花顺	1,300	124,995.00	0.12
215	600009	上海机场	2,200	124,740.00	0.12
216	601727	上海电气	30,100	123,711.00	0.12
217	603606	东方电缆	1,600	122,560.00	0.12
218	000723	美锦能源	10,000	122,000.00	0.12

219	688126	沪硅产业	5,302	121,839.96	0.12
220	002240	盛新锂能	2,000	120,720.00	0.12
221	688180	君实生物	1,600	120,544.00	0.12
222	601995	中金公司	2,700	120,123.00	0.12
223	601799	星宇股份	700	119,700.00	0.12
224	002202	金风科技	8,084	119,643.20	0.12
225	600115	中国东航	21,500	118,035.00	0.12
226	600039	四川路桥	11,200	117,936.00	0.12
227	603899	晨光股份	2,100	117,768.00	0.12
228	601607	上海医药	6,500	117,520.00	0.12
229	603345	安井食品	700	117,509.00	0.12
230	300223	北京君正	1,100	116,875.00	0.11
231	300450	先导智能	1,840	116,251.20	0.11
232	002120	韵达股份	6,810	116,178.60	0.11
233	300601	康泰生物	2,560	115,660.80	0.11
234	002841	视源股份	1,534	115,540.88	0.11
235	002236	大华股份	7,000	114,940.00	0.11
236	600141	兴发集团	2,600	114,374.00	0.11
237	300390	天华超净	1,300	113,620.00	0.11
238	600584	长电科技	4,200	113,400.00	0.11
239	300595	欧普康视	1,980	113,236.20	0.11
240	002013	中航机电	9,100	112,385.00	0.11
241	002601	龙佰集团	5,600	112,280.00	0.11
242	300919	中伟股份	900	111,510.00	0.11
243	601377	兴业证券	15,800	111,390.00	0.11
244	688122	西部超导	1,208	111,377.60	0.11
245	603737	三棵树	860	111,309.80	0.11
246	002916	深南电路	1,180	110,577.80	0.11
247	002555	三七互娱	5,200	110,396.00	0.11
248	688363	华熙生物	768	109,194.24	0.11
249	300073	当升科技	1,200	108,408.00	0.11
250	002080	中材科技	3,900	107,250.00	0.11
251	600875	东方电气	6,500	106,925.00	0.11
252	688169	石头科技	173	106,689.10	0.10
253	600918	中泰证券	13,700	104,805.00	0.10
254	600803	新奥股份	5,600	104,104.00	0.10
255	600219	南山铝业	28,200	104,058.00	0.10
256	300454	深信服	1,000	103,780.00	0.10
257	601878	浙商证券	9,100	103,558.00	0.10
258	000999	华润三九	2,300	103,500.00	0.10
259	603816	顾家家居	1,820	103,066.60	0.10
260	000157	中联重科	16,700	102,872.00	0.10

261	600563	法拉电子	500	102,580.00	0.10
262	600674	川投能源	8,600	102,512.00	0.10
263	601699	潞安环能	7,000	102,340.00	0.10
264	002340	格林美	11,200	101,920.00	0.10
265	600332	白云山	3,226	101,909.34	0.10
266	600779	水井坊	1,100	101,794.00	0.10
267	605358	立昂微	1,500	101,070.00	0.10
268	002176	江特电机	4,000	100,160.00	0.10
269	603568	伟明环保	3,000	100,110.00	0.10
270	600885	宏发股份	2,380	99,603.00	0.10
271	688099	晶晨股份	986	99,586.00	0.10
272	002414	高德红外	7,724	99,407.88	0.10
273	000425	徐工机械	18,400	99,176.00	0.10
274	002064	华峰化学	11,700	98,748.00	0.10
275	603456	九洲药业	1,900	98,230.00	0.10
276	603613	国联股份	1,105	97,903.00	0.10
277	002007	华兰生物	4,290	97,812.00	0.10
278	603198	迎驾贡酒	1,500	97,710.00	0.10
279	601881	中国银河	10,100	97,667.00	0.10
280	601216	君正集团	19,900	97,112.00	0.10
281	688202	美迪西	280	95,090.80	0.09
282	002252	上海莱士	15,900	94,287.00	0.09
283	002603	以岭药业	3,880	94,284.00	0.09
284	300144	宋城演艺	6,120	93,942.00	0.09
285	600486	扬农化工	700	93,296.00	0.09
286	000519	中兵红箭	3,200	93,280.00	0.09
287	300529	健帆生物	1,830	93,128.70	0.09
288	600392	盛和资源	4,100	92,660.00	0.09
289	600298	安琪酵母	1,900	92,625.00	0.09
290	002738	中矿资源	1,000	92,610.00	0.09
291	002192	融捷股份	600	92,220.00	0.09
292	600183	生益科技	5,400	91,746.00	0.09
293	002384	东山精密	4,000	91,720.00	0.09
294	300347	泰格医药	800	91,560.00	0.09
295	600499	科达制造	4,400	90,816.00	0.09
296	002791	坚朗五金	700	90,804.00	0.09
297	000703	恒逸石化	8,610	90,491.10	0.09
298	000683	远兴能源	8,600	90,386.00	0.09
299	688187	时代电气	1,388	90,206.12	0.09
300	300037	新宙邦	1,700	89,352.00	0.09
301	002372	伟星新材	3,700	88,948.00	0.09
302	601233	桐昆股份	5,600	88,928.00	0.09

303	000977	浪潮信息	3,356	88,866.88	0.09
304	002353	杰瑞股份	2,200	88,660.00	0.09
305	603077	和邦生物	20,800	88,608.00	0.09
306	002497	雅化集团	2,700	88,155.00	0.09
307	002407	多氟多	1,800	88,038.00	0.09
308	601966	玲珑轮胎	3,460	87,780.20	0.09
309	603939	益丰药房	1,658	87,592.14	0.09
310	600153	建发股份	6,690	87,438.30	0.09
311	600362	江西铜业	4,900	87,367.00	0.09
312	000738	航发控制	3,100	87,110.00	0.09
313	300146	汤臣倍健	4,000	86,600.00	0.09
314	600348	华阳股份	5,600	86,576.00	0.09
315	601696	中银证券	6,500	86,450.00	0.09
316	002625	光启技术	5,000	86,350.00	0.08
317	601108	财通证券	10,960	86,255.20	0.08
318	600655	豫园股份	9,100	85,904.00	0.08
319	300373	扬杰科技	1,200	85,500.00	0.08
320	601319	中国人保	16,700	84,502.00	0.08
321	600985	淮北矿业	5,800	84,448.00	0.08
322	002602	世纪华通	17,520	84,446.40	0.08
323	002405	四维图新	5,600	84,392.00	0.08
324	600026	中远海能	8,100	83,673.00	0.08
325	002600	领益智造	16,600	83,332.00	0.08
326	000932	华菱钢铁	16,300	82,967.00	0.08
327	600160	巨化股份	6,300	82,845.00	0.08
328	603882	金域医学	1,000	82,550.00	0.08
329	000066	中国长城	7,600	82,232.00	0.08
330	603589	口子窖	1,400	82,054.00	0.08
331	603127	昭衍新药	720	81,936.00	0.08
332	002268	卫士通	1,900	81,529.00	0.08
333	601555	东吴证券	11,759	81,489.87	0.08
334	603707	健友股份	2,884	81,328.80	0.08
335	601058	赛轮轮胎	7,200	81,144.00	0.08
336	603517	绝味食品	1,400	80,948.00	0.08
337	000009	中国宝安	6,000	80,940.00	0.08
338	000630	铜陵有色	24,800	80,848.00	0.08
339	601636	旗滨集团	6,300	80,325.00	0.08
340	000807	云铝股份	8,100	80,028.00	0.08
341	600487	亨通光电	5,500	79,970.00	0.08
342	600521	华海药业	3,510	79,677.00	0.08
343	002850	科达利	500	79,500.00	0.08
344	002508	老板电器	2,200	79,266.00	0.08

345	600109	国金证券	8,700	78,300.00	0.08
346	300568	星源材质	2,696	78,291.84	0.08
347	600161	天坛生物	3,220	78,181.60	0.08
348	300003	乐普医疗	4,200	77,994.00	0.08
349	603444	吉比特	200	77,600.00	0.08
350	002078	太阳纸业	6,300	77,553.00	0.08
351	000629	攀钢钒钛	20,300	77,140.00	0.08
352	000783	长江证券	13,000	77,090.00	0.08
353	601077	渝农商行	20,800	76,960.00	0.08
354	000830	鲁西化工	4,400	76,076.00	0.07
355	688009	中国通号	16,789	76,054.17	0.07
356	600848	上海临港	5,600	75,936.00	0.07
357	002385	大北农	9,700	75,757.00	0.07
358	600027	华电国际	19,200	75,456.00	0.07
359	000155	川能动力	3,400	75,310.00	0.07
360	601577	长沙银行	9,400	74,542.00	0.07
361	002568	百润股份	2,452	73,658.08	0.07
362	601666	平煤股份	5,400	73,386.00	0.07
363	000825	太钢不锈	13,400	73,030.00	0.07
364	600705	中航产融	21,000	72,660.00	0.07
365	601990	南京证券	8,700	72,558.00	0.07
366	002294	信立泰	2,580	72,498.00	0.07
367	600177	雅戈尔	10,900	72,267.00	0.07
368	000027	深圳能源	11,220	71,920.20	0.07
369	002430	杭氧股份	2,300	71,898.00	0.07
370	000831	五矿稀土	2,300	71,875.00	0.07
371	600415	小商品城	12,900	71,853.00	0.07
372	300724	捷佳伟创	800	71,480.00	0.07
373	600549	厦门钨业	3,300	71,346.00	0.07
374	300699	光威复材	1,200	70,644.00	0.07
375	002185	华天科技	7,500	70,350.00	0.07
376	601866	中远海发	23,400	70,200.00	0.07
377	300850	新强联	780	69,443.40	0.07
378	000933	神火股份	5,300	69,324.00	0.07
379	002531	天顺风能	4,200	69,258.00	0.07
380	000987	越秀金控	9,821	69,041.63	0.07
381	002507	涪陵榨菜	2,000	69,040.00	0.07
382	002673	西部证券	10,542	68,944.68	0.07
383	601456	国联证券	5,600	68,712.00	0.07
384	000800	一汽解放	7,300	68,182.00	0.07
385	600516	方大炭素	8,914	67,746.40	0.07
386	603233	大参林	2,164	67,733.20	0.07

387	300832	新产业	1,500	67,665.00	0.07
388	601198	东兴证券	7,600	67,640.00	0.07
389	002032	苏泊尔	1,200	67,608.00	0.07
390	603267	鸿远电子	500	67,165.00	0.07
391	601168	西部矿业	5,600	66,248.00	0.07
392	002326	永太科技	2,000	65,860.00	0.06
393	000960	锡业股份	3,900	65,403.00	0.06
394	002624	完美世界	4,551	65,397.87	0.06
395	300251	光线传媒	6,900	65,343.00	0.06
396	002153	石基信息	4,117	65,336.79	0.06
397	000401	冀东水泥	6,200	65,224.00	0.06
398	002463	沪电股份	4,400	64,944.00	0.06
399	300676	华大基因	900	64,530.00	0.06
400	600258	首旅酒店	2,600	64,480.00	0.06
401	002128	电投能源	4,500	64,440.00	0.06
402	002028	思源电气	1,800	64,188.00	0.06
403	600872	中炬高新	1,849	63,993.89	0.06
404	000728	国元证券	10,260	63,817.20	0.06
405	600170	上海建工	21,000	63,630.00	0.06
406	002797	第一创业	9,900	63,459.00	0.06
407	000975	银泰黄金	6,460	62,920.40	0.06
408	601880	辽港股份	37,000	62,900.00	0.06
409	002557	洽洽食品	1,100	62,623.00	0.06
410	600704	物产中大	12,200	62,586.00	0.06
411	300357	我武生物	1,200	62,436.00	0.06
412	600801	华新水泥	3,200	62,432.00	0.06
413	600988	赤峰黄金	3,900	62,205.00	0.06
414	002939	长城证券	6,100	61,976.00	0.06
415	600369	西南证券	15,600	61,932.00	0.06
416	000937	冀中能源	8,300	61,918.00	0.06
417	002422	科伦药业	3,300	61,710.00	0.06
418	688188	柏楚电子	280	61,611.20	0.06
419	002409	雅克科技	1,100	61,061.00	0.06
420	600079	人福医药	3,800	60,800.00	0.06
421	600598	北大荒	4,100	60,516.00	0.06
422	002266	浙富控股	12,600	60,354.00	0.06
423	600338	西藏珠峰	2,100	60,270.00	0.06
424	688006	杭可科技	849	59,480.94	0.06
425	002532	天山铝业	9,100	59,423.00	0.06
426	000591	太阳能	7,100	59,285.00	0.06
427	002223	鱼跃医疗	2,300	59,018.00	0.06
428	603338	浙江鼎力	1,160	58,812.00	0.06

429	600038	中直股份	1,300	58,760.00	0.06
430	000893	亚钾国际	1,700	58,497.00	0.06
431	000050	深天马 A	5,800	57,826.00	0.06
432	600143	金发科技	6,000	57,120.00	0.06
433	603712	七一二	1,800	56,700.00	0.06
434	601016	节能风电	11,800	56,640.00	0.06
435	000709	河钢股份	25,000	56,500.00	0.06
436	002030	达安基因	3,276	56,314.44	0.06
437	300308	中际旭创	1,800	55,890.00	0.05
438	603218	日月股份	2,200	55,880.00	0.05
439	000739	普洛药业	2,700	55,728.00	0.05
440	002299	圣农发展	2,900	55,622.00	0.05
441	600380	健康元	4,500	55,575.00	0.05
442	000423	东阿阿胶	1,500	55,425.00	0.05
443	300726	宏达电子	900	55,053.00	0.05
444	600688	上海石化	17,230	54,791.40	0.05
445	300558	贝达药业	900	54,720.00	0.05
446	002408	齐翔腾达	6,700	54,337.00	0.05
447	601992	金隅集团	19,600	54,292.00	0.05
448	002152	广电运通	5,800	53,766.00	0.05
449	000988	华工科技	2,300	53,291.00	0.05
450	600808	马钢股份	14,000	53,060.00	0.05
451	002541	鸿路钢构	1,560	52,104.00	0.05
452	600056	中国医药	3,500	51,870.00	0.05
453	603858	步长制药	2,631	51,857.01	0.05
454	002138	顺络电子	1,900	51,775.00	0.05
455	603866	桃李面包	3,124	51,702.20	0.05
456	002456	欧菲光	7,700	51,667.00	0.05
457	000998	隆平高科	3,100	51,646.00	0.05
458	600998	九州通	4,331	51,582.21	0.05
459	002506	协鑫集成	13,800	51,336.00	0.05
460	002044	美年健康	9,176	51,110.32	0.05
461	000513	丽珠集团	1,400	50,694.00	0.05
462	600699	均胜电子	3,200	50,272.00	0.05
463	002145	中核钛白	7,005	49,945.65	0.05
464	600295	鄂尔多斯	2,760	49,818.00	0.05
465	600711	盛屯矿业	6,400	49,664.00	0.05
466	002465	海格通信	5,400	49,086.00	0.05
467	002500	山西证券	8,440	48,445.60	0.05
468	002926	华西证券	6,100	47,824.00	0.05
469	002156	通富微电	3,100	47,740.00	0.05
470	002065	东华软件	7,500	47,400.00	0.05

471	000750	国海证券	12,840	46,609.20	0.05
472	002092	中泰化学	6,000	46,560.00	0.05
473	002010	传化智联	7,200	46,296.00	0.05
474	603605	珀莱雅	280	46,250.40	0.05
475	688298	东方生物	402	45,888.30	0.05
476	000860	顺鑫农业	1,700	45,594.00	0.04
477	002157	正邦科技	7,400	44,844.00	0.04
478	600895	张江高科	3,600	44,820.00	0.04
479	300418	昆仑万维	2,800	44,800.00	0.04
480	300070	碧水源	8,500	44,285.00	0.04
481	300253	卫宁健康	5,020	44,075.60	0.04
482	300383	光环新网	4,200	43,764.00	0.04
483	002958	青农商行	13,100	43,492.00	0.04
484	600583	海油工程	10,400	43,160.00	0.04
485	002558	巨人网络	4,700	43,005.00	0.04
486	600498	烽火通信	2,800	40,544.00	0.04
487	601598	中国外运	10,300	39,964.00	0.04
488	688185	康希诺	200	39,816.00	0.04
489	300677	英科医疗	1,540	39,054.40	0.04
490	002925	盈趣科技	1,810	38,951.20	0.04
491	000686	东北证券	5,500	38,445.00	0.04
492	688002	睿创微纳	958	38,051.76	0.04
493	002563	森马服饰	6,300	37,296.00	0.04
494	000656	金科股份	12,600	36,036.00	0.04

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688223	晶科能源	18,247	264,034.09	0.26
2	688163	赛伦生物	1,683	39,651.48	0.04
3	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.04
4	301215	中汽股份	2,008	12,831.12	0.01
5	001268	联合精密	409	11,337.48	0.01
6	301116	益客食品	505	10,332.30	0.01
7	301263	泰恩康	269	8,441.22	0.01
8	301235	华康医疗	220	8,344.60	0.01
9	301130	西点药业	221	8,331.70	0.01
10	301256	华融化学	757	7,630.56	0.01
11	301117	佳缘科技	135	7,349.40	0.01
12	301228	实朴检测	344	6,996.96	0.01
13	301137	哈焊华通	403	6,443.97	0.01

14	301158	德石股份	316	6,440.08	0.01
15	301207	华兰疫苗	113	6,375.46	0.01
16	301200	大族数控	109	5,659.28	0.01
17	301216	万凯新材	168	5,013.12	0.00
18	301222	浙江恒威	160	4,633.60	0.00
19	301219	腾远钴业	50	4,391.00	0.00
20	301258	富士莱	100	4,168.00	0.00
21	301123	奕东电子	161	4,087.79	0.00
22	301110	青木股份	85	3,387.25	0.00
23	301196	唯科科技	60	2,251.20	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	964,445.00	0.56
2	600905	三峡能源	753,832.00	0.43
3	002594	比亚迪	621,389.00	0.36
4	688599	天合光能	538,216.32	0.31
5	000858	五粮液	429,673.00	0.25
6	000651	格力电器	404,308.00	0.23
7	601006	大秦铁路	384,150.00	0.22
8	600436	片仔癀	374,335.00	0.22
9	002049	紫光国微	349,462.00	0.20
10	601868	中国能建	326,972.00	0.19
11	002812	恩捷股份	316,515.00	0.18
12	601888	中国中免	262,762.00	0.15
13	688005	容百科技	260,892.32	0.15
14	300760	迈瑞医疗	260,776.00	0.15
15	600884	杉杉股份	248,436.00	0.14
16	300059	东方财富	236,264.00	0.14
17	002475	立讯精密	233,926.00	0.13
18	688396	华润微	232,100.99	0.13
19	603659	璞泰来	228,384.00	0.13
20	300014	亿纬锂能	213,123.00	0.12

注：买入金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
----	------	------	----------	-----------------

1	300750	宁德时代	2,386,661.00	1.37
2	000858	五粮液	1,356,358.00	0.78
3	002594	比亚迪	1,257,224.00	0.72
4	300760	迈瑞医疗	778,388.84	0.45
5	000001	平安银行	613,267.25	0.35
6	000568	泸州老窖	581,897.00	0.34
7	002714	牧原股份	575,229.37	0.33
8	002812	恩捷股份	558,155.00	0.32
9	300059	东方财富	556,489.00	0.32
10	002475	立讯精密	546,482.00	0.31
11	002352	顺丰控股	544,850.00	0.31
12	002049	紫光国微	494,044.00	0.28
13	002142	宁波银行	478,354.00	0.28
14	002304	洋河股份	454,316.61	0.26
15	000002	万科 A	398,343.00	0.23
16	300014	亿纬锂能	392,061.73	0.23
17	300015	爱尔眼科	356,797.00	0.21
18	300122	智飞生物	336,581.00	0.19
19	002460	赣锋锂业	328,701.00	0.19
20	002129	TCL 中环	328,263.00	0.19

注：卖出金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	30,296,591.08
卖出股票收入（成交）总额	47,931,299.34

注：买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额均为买卖股票成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
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）	18,801.72	0.02
8	同业存单	-	-

9	其他	-	-
10	合计	18,801.72	0.02

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113060	浙 22 转债	160	16,001.19	0.02
2	127064	杭氧转债	28	2,800.53	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 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，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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

2022 年 3 月 21 日，招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”，股票代码：600036）收到中国银行保险监督管理委员会出具的行政处罚决定书（银保监罚决字〔2022〕21 号），其因不良贷款余额 EAST 数据存在偏差、漏报贷款核销业务 EAST 数据等违法违规行为，被处以罚款人民币 300 万元。

本基金基金经理依据基金合同及公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对招商银行进行了投资。

兴业银行股份有限公司（以下简称“兴业银行”，股票代码：601166）于 2021 年 8 月 13 日收

到中国人民银行出具的行政处罚决定书(银罚字〔2021〕26号), 其因违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定, 被处以罚款人民币5万元。

兴业银行于2022年3月21日收到中国银行保险监督管理委员会出具的行政处罚决定书(银保监罚决字〔2022〕22号), 其因漏报贸易融资业务 EAST 数据、漏报贷款核销业务 EAST 数据等违法违规行为, 被处以罚款人民币350万元。

本基金基金经理依据基金合同及公司投资管理制度, 在投资授权范围内, 经正常投资决策程序对兴业银行进行了投资。

本基金投资前十名证券的其余发行主体本报告期内没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 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

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位: 人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	20,048.37
2	应收清算款	42,455.52
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	62,503.89

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位: 人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	688223	晶科能源	264,034.09	0.26	新股流通受限
2	688163	赛伦生物	39,651.48	0.04	新股流通受限

3	301215	中汽股份	12,831.12	0.01	新股流通受限
---	--------	------	-----------	------	--------

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人 户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
1,283	48,328.71	19,686,802	31.75	42,318,938	68.25

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	中国平安财产保险股份有限公司—传统—普通保险产品	11,890,600.00	19.18
2	方正证券股份有限公司	2,624,200.00	4.23
3	唐崇霖	2,568,000.00	4.14
4	广发证券股份有限公司	1,816,125.00	2.93
5	张红	1,790,400.00	2.89
6	中信建投证券股份有限公司	1,717,811.00	2.77
7	郭莉芬	1,613,800.00	2.60
8	林李丽琴	1,600,000.00	2.58
9	中信证券股份有限公司	1,551,505.00	2.50
10	郑时昭	650,000.00	1.05

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本期末基金管理人的所有从业人员未持有本基金。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

- 1、本期末基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。
- 2、本期末本基金的基金经理未持有本基金。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2018年4月27日） 基金份额总额	1,534,005,740.00
本报告期期初基金份额总额	98,005,740.00

本报告期基金总申购份额	12,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	48,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	62,005,740.00

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

在本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人重大人事变动：

本报告期内本基金管理人未发生重大人事变动。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

- 1、2022年3月，中国农业银行总行决定王霄勇任托管业务部总裁。
- 2、2022年3月，中国农业银行总行决定王洪滨任托管业务部高级专家。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

在本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期末更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员、托管人托管业务部门及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	
中国国际金融股份有限公司	2	38,412,220.54	50.76	35,773.88	50.80	-
华福证券有限责任公司	1	9,399,367.57	12.42	8,754.08	12.43	-

东兴证券股份有限公司	1	5,339,051.50	7.06	4,972.35	7.06	-
中信建投证券股份有限公司	1	3,839,128.08	5.07	3,575.65	5.08	-
国泰君安证券股份有限公司	1	2,213,447.18	2.93	2,061.36	2.93	-
川财证券有限责任公司	1	2,212,411.72	2.92	2,060.51	2.93	-
瑞银证券有限责任公司	1	1,910,030.26	2.52	1,779.04	2.53	-
中信证券股份有限公司	5	1,758,678.71	2.32	1,590.09	2.26	-
兴业证券股份有限公司	1	1,429,086.50	1.89	1,330.93	1.89	-
光大证券股份有限公司	2	1,401,512.36	1.85	1,305.18	1.85	-
申港证券股份有限公司	1	1,326,283.06	1.75	1,235.24	1.75	-
东北证券股份有限公司	2	1,281,065.50	1.69	1,193.15	1.69	-
国金证券股份有限公司	1	1,215,439.23	1.61	1,131.96	1.61	-
国盛证券有限责任公司	1	763,330.50	1.01	710.93	1.01	-
华创证券有限责任公司	1	753,595.58	1.00	701.94	1.00	-
天风证券股份有限公司	1	752,640.26	0.99	701.00	1.00	-
广发证券股份有限公司	1	358,767.23	0.47	334.12	0.47	-
长城证券股份有限公司	1	302,479.40	0.40	281.67	0.40	-
中泰证券股份有限公司	2	294,683.74	0.39	274.44	0.39	-
民生证券股份有限公司	1	273,847.20	0.36	255.04	0.36	-
平安证券股份有限公司	2	187,031.54	0.25	174.15	0.25	-
东方证券股份有限公司	2	124,861.31	0.17	116.31	0.17	-
长江证券股份有限公司	2	121,949.31	0.16	113.58	0.16	-
安信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
大同证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
恒泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	1	-	-	-	-	-
西南证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
诚通证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-

注：1. 基金专用交易单元的选择标准和程序如下：

1) 选择标准

- a、资金实力雄厚，信誉良好；
- b、财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- c、经营行为规范，最近三年未因重大违规行为受到监管机关的处罚；
- d、内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求；
- e、该证券经营机构具有较强的研究能力，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时、全

面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析报告、个股分析报告及其他专门报告以及全面的信息服务。并能根据基金管理人的特定要求，提供专门研究报告。

2) 选择程序

基金管理人根据以上标准进行考察后，确定证券经营机构的选择。基金管理人与被选择的证券经营机构签订协议。

2. 本基金本报告期交易单元未发生变更。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华福证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	36,012.64	7.80	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	72,761.80	15.76	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
川财证券有限责任公司	96,019.90	20.80	-	-	-	-
瑞银证券有限责任公司	37,701.60	8.17	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	219,100.10	47.47	-	-	-	-
申港证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
天风证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
民生证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
大同证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
恒泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	-	-	-	-	-	-
西南证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
诚通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	景顺长城基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-01
2	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-07
3	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-20
4	景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-24
5	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2021 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-24
6	景顺长城基金管理有限公司关于投资旗下偏股型公募基金的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-27
7	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-02-18
8	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-02-25
9	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-03-04
10	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2021 年年度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-03-28
11	景顺长城 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	中国证监会指定报刊及网站	2022-03-28
12	景顺长城基金管理有限公司关于系统	中国证监会指定报刊及	2022-04-08

	停机升级的公告	网站	
13	景顺长城基金管理有限公司关于持续完善客户身份信息的提示	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-12
14	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-16
15	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2022 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-22
16	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-22
17	景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-22
18	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-29
19	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-05-06
20	关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金调整持有停牌股票估值价格的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-05-12
21	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-06-10
22	景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2022-06-16
23	景顺长城基金管理有限公司关于旗下管理的上海证券交易所上市 ETF 实施申赎业务多码合一的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-06-20
24	景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2022-06-22
25	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-06-24

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)

本基金的联接基金	1	20220101-20220424	22,352,800.00	6,795,000.00	29,147,800.00	0.00	0.00
产品特有风险							
<p>本基金由于存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20% 的情况，可能会出现如下风险：</p> <p>1、大额申购风险</p> <p>在出现投资者大额申购时，如本基金所投资的标的资产未及时准备，则可能降低基金净值涨幅。</p> <p>2、如面临大额赎回的情况，可能导致以下风险：</p> <p>(1) 基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；</p> <p>(2) 如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20% 的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回，如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；</p> <p>(3) 基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；</p> <p>(4) 因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，导致基金净值出现较大波动；</p> <p>(5) 基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略；</p> <p>(6) 大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。</p> <p>本基金管理人将建立完善的风险管理机制，以有效防止和化解上述风险，最大限度地保护基金份额持有人的合法权益。投资者在投资本基金前，请认真阅读本风险提示及基金合同等信息披露文件，全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，获得基金投资收益，亦自行承担基金投资中出现的各类风险。</p>							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据上海证券交易所（以下简称“上交所”）《关于上海证券交易所 ETF 申赎业务多码合一及平台迁移切换上线有关事项的通知》，自 2022 年 6 月 20 日起，景顺长城基金管理有限公司旗下管理的上交所上市 ETF 取消申赎业务相关代码，投资者可通过 ETF 基金的证券代码（与交易使用的证券代码相同），选择申赎相关业务类型，参与 ETF 申赎业务。本基金原申赎代码 512281 取消，多码合一上线后参与申赎业务的证券代码为 512280。详情请参阅本基金管理人于 2022 年 6 月 20 日发布的《景顺长城基金管理有限公司关于旗下管理的上海证券交易所上市 ETF 实施申赎业务多码合一的公告》。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城 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、《景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城 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》；

5、景顺长城基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程；

6、其他在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、定期报告及临时公告。

12.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅。

景顺长城基金管理有限公司

2022 年 8 月 31 日