

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 06 月 30 日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 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 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介.....	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
§4 管理人报告.....	7
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	11
§5 托管人报告.....	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	12
§6 中期财务会计报告（未经审计）.....	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	17
§7 投资组合报告.....	41
7.1 期末基金资产组合情况.....	41
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	42
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.....	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	57
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.....	57
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.....	57
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	57
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	58
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	58
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	58

7.12 投资组合报告附注.....	58
§8 基金份额持有人信息.....	59
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	59
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	60
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	60
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	60
§9 开放式基金份额变动.....	60
§10 重大事件揭示.....	61
10.1 基金份额持有人大会决议.....	61
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.....	61
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	61
10.4 基金投资策略的改变.....	61
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	61
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	61
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	61
10.8 其他重大事件.....	63
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	64
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	64
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	64
§12 备查文件目录.....	64
12.1 备查文件目录.....	64
12.2 存放地点.....	65
12.3 查阅方式.....	65

§ 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	南方 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	355,777,775.00 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

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	<p>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。</p> <p>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。</p>
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
		许俊

	联系电话	0755-82763888	95566
	电子邮箱	manager@southernfund.com	fcid@bankofchina.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		周易	刘连舸

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022 年 1 月 1 日 - 2022 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-11,605,666.70
本期利润	-49,985,583.33
加权平均基金份额本期利润	-0.1473
本期加权平均净值利润率	-9.66%
本期基金份额净值增长率	-8.30%
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	213,016,920.71
期末可供分配基金份额利润	0.5987
期末基金资产净值	568,794,695.71
期末基金份额净值	1.5987
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	59.87%
-------------	--------

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；

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

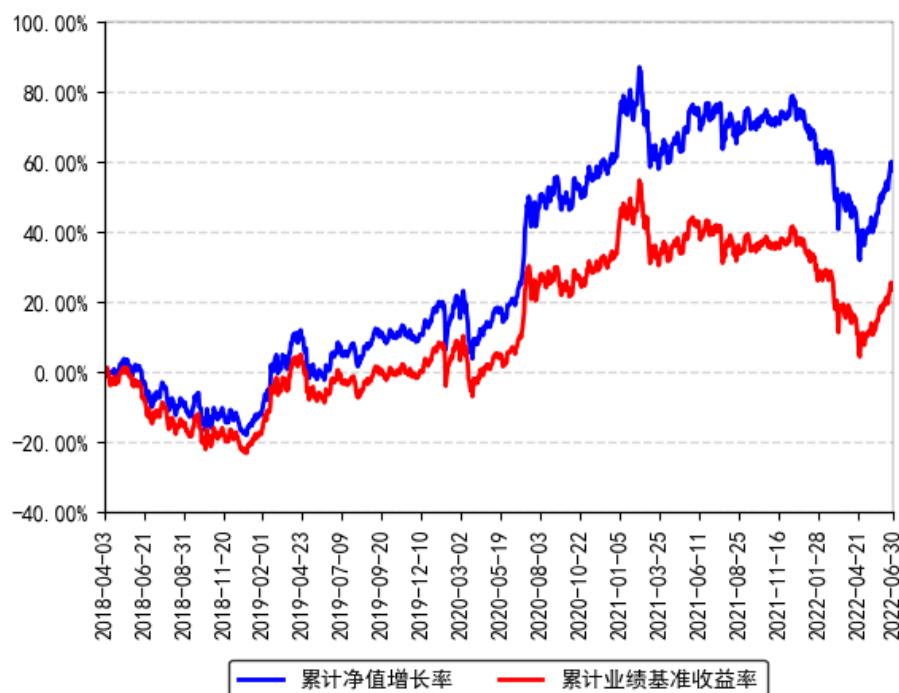
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	10.18%	1.07%	9.38%	1.07%	0.80%	0.00%
过去三个月	7.53%	1.46%	6.60%	1.46%	0.93%	0.00%
过去六个月	-8.30%	1.47%	-9.07%	1.46%	0.77%	0.01%
过去一年	-9.50%	1.24%	-12.39%	1.24%	2.89%	0.00%
过去三年	51.84%	1.27%	28.25%	1.27%	23.59%	0.00%
自基金合同生效起至今	59.87%	1.32%	25.24%	1.32%	34.63%	0.00%

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

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



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

2018年1月，公司整体变更设立为南方基金管理股份有限公司。2019年7月，根据南方基金管理股份有限公司股东大会决议，并经中国证监会核准，本公司原股东及新增股东共同认购了本公司新增的注册资本，认购完成后注册资本为36172万元人民币。目前股权结构为：华泰证券股份有限公司41.16%、深圳市投资控股有限公司27.44%、厦门国际信托有限公司13.72%、兴业证券股份有限公司9.15%、厦门合泽吉企业管理合伙企业(有限合伙)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 1.69 万亿元，旗下管理 296 只公募基金，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	-	17 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; 2022 年 6 月 17 日至今, 任南方恒生香港上市生物科技 ETF (QDII) 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中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券投资基金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	15	67,195,576,481.91	2013 年 4 月 22 日
	私募资产管理计划	8	3,690,743,708.86	2020 年 8 月 7 日
	其他组合	-	-	-
	合计	23	70,886,320,190.77	-

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价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% 的交易次数为 2 次,是由于投资组合的投资策略需要以及接受投资者申赎后被动增减仓位所致。

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 国际通指数下跌 9.07%。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 1.5987 元,报告期内,份额净值增长率为-8.30%,同期业绩基准增长率为-9.07%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年海内外宏观环境较为复杂,俄乌冲突、美元紧缩等,也带来 A 股市场调整。调整后,估值下行空间收窄,大中华地区权益市场仍具长期配置价值。

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定,本基金管理人应严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定,对基金所持有的投资品种进行估值。本基金

管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术，建立了估值委员会，组成人员包括副总经理、督察长、权益研究部总经理、固定收益研究部总经理、指数投资部总经理、现金投资部总经理、风险管理部总经理及运作保障部总经理等。本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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。

4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 中期财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：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	6.4.3.1	2,554,678.47	2,512,242.66
结算备付金		1,097,634.47	1,038,445.33
存出保证金		546,312.74	825,068.46
交易性金融资产	6.4.3.2	565,401,449.03	550,384,990.46
其中：股票投资		565,301,939.97	549,764,990.46
基金投资		-	-
债券投资		99,509.06	620,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-	-
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		-	72,088.99
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.5	-	702.49
资产总计		569,600,074.71	554,833,538.39
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

		日	31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		159,345.06	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		207,848.65	230,057.83
应付托管费		41,569.73	46,011.56
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.43	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.6	396,615.13	545,015.27
负债合计		805,379.00	821,084.66
净资产：			
实收基金	6.4.3.7	355,777,775.00	317,777,775.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.3.8	213,016,920.71	236,234,678.73
净资产合计		568,794,695.71	554,012,453.73
负债和净资产总计		569,600,074.71	554,833,538.39

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.5987 元，基金份额总额 355,777,775.00 份。

6.2 利润表

会计主体：MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：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 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
一、营业总收入		-48,228,922.75	37,670,707.79
1.利息收入		8,969.14	23,731.29
其中：存款利息收入	6.4.3.9	8,969.14	23,309.58
债券利息收入		-	421.71
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）		-9,956,412.80	86,906,983.01
其中：股票投资收益	6.4.3.10	-14,590,832.67	81,375,224.68
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.11	292,837.18	280,586.75
资产支持证券投资 收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.3.12	-470,338.35	751,354.76
股利收益	6.4.3.13	4,811,921.04	4,499,816.82
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）	6.4.3.14	-38,379,916.63	-50,799,888.41
4.汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.3.15	98,437.54	1,539,881.90
减：二、营业总支出		1,756,660.58	2,992,458.51
1.管理人报酬	6.4.6.2.1	1,283,896.60	1,791,497.21
2.托管费	6.4.6.2.2	256,779.29	358,299.46
3.销售服务费	6.4.6.2.3	-	-
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		0.36	3,336.32
8.其他费用	6.4.3.16	215,984.33	839,325.52
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		-49,985,583.33	34,678,249.28
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以 “-”号填列）		-49,985,583.33	34,678,249.28
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		-49,985,583.33	34,678,249.28

6.3 净资产（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：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)	317,777,775.00	-	236,234,678.73	554,012,453.73
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)	317,777,775.00	-	236,234,678.73	554,012,453.73
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	38,000,000.00	-	-23,217,758.02	14,782,241.98
(一)、综合收益总额	-	-	-49,985,583.33	-49,985,583.33
(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)	38,000,000.00	-	26,767,825.31	64,767,825.31
其中：1.基金申购款	98,000,000.00	-	57,051,080.93	155,051,080.93
2.基金赎回款	-60,000,000.00	-	-30,283,255.62	-90,283,255.62
(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)	355,777,775.00	-	213,016,920.71	568,794,695.71
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)	509,777,775.00	-	341,446,264.70	851,224,039.70

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)	509,777,775.00	-	341,446,264.70	851,224,039.70
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-142,000,000.00	-	-59,493,929.85	-201,493,929.85
(一)、综合收益总额	-	-	34,678,249.28	34,678,249.28
(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)	-142,000,000.00	-	-94,172,179.13	-236,172,179.13
其中：1.基金申购款	224,000,000.00	-	165,660,396.37	389,660,396.37
2.基金赎回款	-366,000,000.00	-	-259,832,575.50	-625,832,575.50
(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)	367,777,775.00	-	281,952,334.85	649,730,109.85

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

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

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。除下述会计政策外，本基金本报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.1.1 金融资产和金融负债的分类

新金融工具准则

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、买入返售金融资产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和资产支持证券投资，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卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以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衍生金融资产/负债。

原金融工具准则（截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则）

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

(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、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，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。

6.4.1.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

新金融工具准则

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或资产支持证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。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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或资产支持证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。

6.4.1.3 收入/（损失）的确认和计量

新金融工具准则

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。债券投资和资产支持证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和资产支持证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扣除按票面利率（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后的净额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及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。

原金融工具准则（截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则）

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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。债券投资和资产支持证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和资产支持证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。

6.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.2.1 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 2,512,242.66 元、1,038,445.33 元、825,068.46 元、702.49 元和 72,088.99 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 2,512,500.41 元、1,038,850.26 元、825,093.46 元、0.00 元和 72,088.99 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 550,384,990.46 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 550,385,005.27 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 230,057.83 元、46,011.56 元、16,283.68 元和 353,731.59 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 230,057.83 元、46,011.56 元、16,283.68 元和 353,731.59 元。

i) 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。

6.4.2.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.2.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.3 重要财务报表项目的说明

6.4.3.1 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	2,554,678.47
等于：本金	2,554,424.99
加：应计利息	253.48
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 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	2,554,678.47

6.4.3.2 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	577,544,941.39	-	565,301,939.97	-12,243,001.42
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	99,500.00	9.06	99,509.06
	银行间市场	-	-	-

	合计	99,500.00	9.06	99,509.06	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		577,644,441.39	9.06	565,401,449.03	-12,243,001.42

注：于 2022 年 06 月 30 日，股票投资的公允价值和公允价值变动包含的可退替代款的估值增值为 0.00 元(2021 年 12 月 31 日：-6.00 元)。

6.4.3.3 衍生金融资产/负债

6.4.3.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	3,797,150.00	-	-	-
一指期货	3,797,150.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	3,797,150.00	-	-	-

6.4.3.3.2 期末基金持有的期货合约情况

代码	名称	持仓量 (买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2207	IC2207	1.00	1,286,920.00	46,520.00
IF2207	IF2207	2.00	2,683,920.00	127,170.00
合计				173,690.00
减：可抵销期货暂收款				173,690.00
净额				-

注：1、买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

2、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。

6.4.3.4 买入返售金融资产

6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产。

6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.3.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.3.6 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	10,180.21
其中：交易所市场	10,180.21
银行间市场	-
应付利息	-
应退退补款	103,834.98
预提费用	84,302.56
应付指数使用费	198,297.38
可退替代款	-
其他	-
合计	396,615.13

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。

6.4.3.7 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	317,777,775.00	317,777,775.00
本期申购	98,000,000.00	98,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-60,000,000.00	-60,000,000.00
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	355,777,775.00	355,777,775.00

6.4.3.8 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	279,019,890.26	-42,785,211.53	236,234,678.73

本期利润	-11,605,666.70	-38,379,916.63	-49,985,583.33
本期基金份额交易产生的变动数	32,892,648.32	-6,124,823.01	26,767,825.31
其中：基金申购款	84,477,707.87	-27,426,626.94	57,051,080.93
基金赎回款	-51,585,059.55	21,301,803.93	-30,283,255.62
本期已分配利润	-	-	-
本期末	300,306,871.88	-87,289,951.17	213,016,920.71

6.4.3.9 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	3,527.36
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	5,076.61
其他	365.17
合计	8,969.14

6.4.3.10 股票投资收益

6.4.3.10.1 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	-10,363,983.36
股票投资收益——赎回差价收入	-4,226,849.31
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	-14,590,832.67

6.4.3.10.2 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	78,509,869.57
减：卖出股票成本总额	88,745,187.63
减：交易费用	128,665.30
买卖股票差价收入	-10,363,983.36

注：上述交易费用（如有）包含股票买卖产生的交易费用。

6.4.3.10.3 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	90,283,255.62
减：现金支付赎回款总额	35,316,674.62

减：赎回股票成本总额	59,193,430.31
减：交易费用	-
赎回差价收入	-4,226,849.31

6.4.3.10.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无股票申购差价收入。

6.4.3.10.5 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无证券出借差价收入。

6.4.3.11 债券投资收益

6.4.3.11.1 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	167.66
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	292,669.52
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	292,837.18

6.4.3.11.2 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	2,060,552.93
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,767,700.00
减：应计利息总额	176.26
减：交易费用	7.15
买卖债券差价收入	292,669.52

注：上述交易费用（如有）包含债券买卖产生的交易费用。

6.4.3.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

6.4.3.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券申购差价收入。

6.4.3.12 衍生工具收益

6.4.3.12.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具买卖权证差价收入。

6.4.3.12.2 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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股指期货-投资收益	-470,338.35
合计	-470,338.35

6.4.3.13 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	4,811,921.04
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	4,811,921.04

6.4.3.14 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	-38,476,046.63
——股票投资	-38,476,046.63
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	96,130.00
——权证投资	-
——期货投资	96,130.00
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	-38,379,916.63

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(2021 上半年度：0.00 元)。

6.4.3.15 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	98,437.54
合计	98,437.54

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。

6.4.3.16 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	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
指数使用费	129,483.78
银行费用	2,197.99
合计	215,984.33

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.0125% 的季度费率计提，逐日累计，按季支付。标的指数许可使用费的收取下限为每季度美元 5,000 元。计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。

6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.4.1 或有事项

无。

6.4.4.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.5 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.5.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.6.1.1 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
华泰证券	5,613,435.84	3.08%	29,214,314.58	4.15%

6.4.6.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.6.1.3 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
华泰证券	561.30	3.08%	291.13	2.86%
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
华泰证券	2,921.61	4.15%	1,881.10	10.47%

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算。

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

6.4.6.2 关联方报酬

6.4.6.2.1 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	1,283,896.60	1,791,497.21
其中：支付销售机构的客户维护费	8,796.47	14,880.04

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

6.4.6.2.2 基金托管费

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托管费	256,779.29	358,299.46

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。

6.4.6.2.3 销售服务费

无。

6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

6.4.6.4 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

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

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

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

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

6.4.6.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.6.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.6.5.2 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
MSCI 中国 A 股国际通交	112,980,000.0	31.76%	112,723,100.0	35.47%

易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	0		0	
华泰证券股份有限公司	2,759,989.00	0.78%	8,485,389.00	2.67%

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。

6.4.6.6 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
中国银行	2,554,678.47	3,527.36	1,668,584.06	5,482.43

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

6.4.6.7 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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
华泰联合	688048	长光华芯	网下申购	3,542	286,193.60
华泰联合	688046	药康生物	网下申购	12,070	271,937.10
华泰联合	301207	华兰疫苗	网下申购	3,679	209,261.52
华泰联合	110085	通 22 转债	配债	1,580	158,000.00
华泰联合	301153	中科江南	网下申购	3,973	133,810.64
华泰联合	113055	成银转债	配债	1,050	105,000.00
华泰联合	601108	财通证券	配股	14,430	98,124.00
华泰联合	123145	药石转债	配债	138	13,800.00
兴业证券	600030	中信证券	配股	19,995	288,527.85

上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
华泰联合	113050	南银转债	优先配售	2,920	292,000.00
华泰联合	605208	永茂泰	网下申购	801	10,733.40
华泰联合	605389	长龄液压	网下申购	356	14,026.40
华泰联合	605499	东鹏饮料	网下申购	632	29,242.64
华泰联合	688083	中望软件	网下申购	1,837	276,468.50
华泰联合	688097	博众精工	网下申购	3,983	44,888.41
华泰联合	688161	威高骨科	网下申购	3,069	111,159.18
华泰联合	688260	昀冢科技	网下申购	2,990	28,793.70

华泰联合	688314	康拓医疗	网下申购	1,085	18,813.90
华泰联合	688350	富淼科技	网下申购	2,552	34,656.16
华泰联合	688613	奥精医疗	网下申购	2,617	42,997.31
华泰联合	688633	星球石墨	网下申购	1,558	52,379.96
华泰联合	300975	商络电子	网下申购	4,917	26,945.16
兴业证券	605086	龙高股份	网下申购	443	5,696.98
兴业证券	605298	必得科技	网下申购	391	6,252.09
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	688639	华恒生物	网下申购	2,302	53,314.32
兴业证券	300941	创识科技	网下申购	3,989	85,005.59
兴业证券	300979	华利集团	网下申购	8,136	270,277.92

6.4.6.8 其他关联交易事项的说明

于 2022 年 06 月 30 日，本基金持有关联方兴业证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司发行的普通股，成本总额为人民币 2,482,357.16 元，估值总额为人民币 2,024,513.10 元，占本基金基金资产净值的比例为 0.36%（于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有关联方兴业证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司发行的普通股，成本总额为人民币 2,379,917.31 元，估值总额为人民币 2,422,776.08 元，占本基金基金资产净值的比例为 0.44%）。

6.4.7 利润分配情况

6.4.7.1 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.8 期末（2022 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 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

6.4.8.1.1 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
301109	军信股份	2022 年 4 月 6 日	6 个月	新股锁定期	34.81	16.14	827	28,787.87	13,347.78	-
301109	军信股份	2022 年 6 月 17 日	1-6 个月（含）	锁定期转增	-	16.14	414	-	6,681.96	-
301150	中一科技	2022 年 4 月	6 个月	新股锁定期	163.56	82.76	166	27,150.96	13,738.16	-

		14 日								
301150	中一科技	2022 年 6 月 10 日	1-6 个月(含)	锁定期转增	-	82.76	83	-	6,869.08	-
301153	中科江南	2022 年 5 月 10 日	6 个月	新股锁定期	33.68	43.98	398	13,404.64	17,504.04	-
301181	标榜股份	2022 年 2 月 11 日	6 个月	新股锁定期	40.25	30.59	257	10,344.25	7,861.63	-
301196	唯科科技	2022 年 1 月 4 日	6 个月	新股锁定期	64.08	37.52	195	12,495.60	7,316.40	-
301207	华兰疫苗	2022 年 2 月 10 日	6 个月	新股锁定期	56.88	56.42	368	20,931.84	20,762.56	-
301219	腾远钴业	2022 年 3 月 10 日	6 个月	新股锁定期	173.98	87.82	112	19,485.76	9,835.84	-
301219	腾远钴业	2022 年 5 月 24 日	1-6 个月(含)	锁定期转增	-	87.82	90	-	7,903.80	-
301238	瑞泰新材	2022 年 6 月 10 日	6 个月	新股锁定期	19.18	32.07	1,634	31,340.12	52,402.38	-
301248	杰创智能	2022 年 4 月 13 日	6 个月	新股锁定期	39.07	29.87	472	18,441.04	14,098.64	-
688175	高凌信息	2022 年 3 月 8 日	6 个月	新股锁定期	51.68	32.23	2,851	147,339.68	91,887.73	-
688259	创耀科技	2022 年 1 月 5 日	6 个月	新股锁定期	66.60	79.22	1,595	106,227.00	126,355.90	-
688283	坤恒顺维	2022 年 2 月 8 日	6 个月	新股锁定期	33.80	45.41	1,595	53,911.00	72,428.95	-

6.4.8.1.2 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
127064	杭氧转债	2022 年 5 月 19 日	1-6 个月(含)	配债未上市	100.00	100.02	145	14,502.73	14,502.73	-

113060	浙 22 转债	2022 年 6 月 15 日	1 个月 内 (含)	配债未 上市	100.0 0	100.0 1	850	85,006.33	85,006.33	-
--------	---------	-----------------------	---------------	-----------	------------	------------	-----	-----------	-----------	---

6.4.8.2 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。

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.8.4 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。

6.4.9 金融工具风险及管理

6.4.9.1 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，将风险控制可在可承受的范围内。

6.4.9.2 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。

6.4.9.3 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。

6.4.9.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

6.4.9.4 市场风险

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

6.4.9.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,554,678.47	-	-	-	2,554,678.47
结算备付金	1,097,634.47	-	-	-	1,097,634.47
存出保证金	546,312.74	-	-	-	546,312.74
交易性金融资产	-	-	99,509.06	565,301,939.97	565,401,449.03

衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
其他债权投资	-	-	-	-	-
其他权益工具投资	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	4,198,625.68	-	99,509.06	565,301,939.97	569,600,074.71
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	159,345.06	159,345.06
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	207,848.65	207,848.65
应付托管费	-	-	-	41,569.73	41,569.73
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	0.43	0.43
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	396,615.13	396,615.13
负债总计	-	-	-	805,379.00	805,379.00
利率敏感度缺口	4,198,625.68	-	99,509.06	564,496,560.97	568,794,695.71
上年度末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

2021 年 12 月 31 日					
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
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
其他债权投资	-	-	-	-	-
其他权益工具投资	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	72,088.99	72,088.99
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	702.49	702.49
资产总计	3,606,386.85	-	620,000.00	550,607,151.54	554,833,538.39
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
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	-	-	-	545,015.27	545,015.27
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

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

6.4.9.4.1.2 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（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）
	1.市场利率平行上升25个基点	-1,425.39	-8,846.89
2.市场利率平行下降25个基点	1,449.83	8,998.05	

6.4.9.4.2 外汇风险

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

6.4.9.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

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	公允价值	占基金资产

		净值比例(%)		净值比例(%)
交易性金融资产-股票投资	565,301,939.97	99.39	549,764,990.46	99.23
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	565,301,939.97	99.39	549,764,990.46	99.23

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

6.4.9.4.3.2 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（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
	1.组合自身基准上升 5%	28,425,923.15	27,667,684.44
	2.组合自身基准下降 5%	-28,425,923.15	-27,667,684.44

6.4.10 公允价值

6.4.10.1 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。

6.4.10.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.10.2.1 各层次金融工具的公允价值

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日
第一层次	564,832,945.12
第二层次	99,509.06
第三层次	468,994.85
合计	565,401,449.03

6.4.10.2.2 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。

6.4.10.3 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资产。

6.4.10.4 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。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	565,301,939.97	99.25
	其中：股票	565,301,939.97	99.25
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	99,509.06	0.02
	其中：债券	99,509.06	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	3,652,312.94	0.64
8	其他资产	546,312.74	0.10
9	合计	569,600,074.71	100.00

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

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	6,911,780.98	1.22
B	采矿业	21,912,937.85	3.85
C	制造业	336,701,498.41	59.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,993,898.62	2.99
E	建筑业	9,948,542.82	1.75
F	批发和零售业	4,578,427.96	0.80
G	交通运输、仓储和邮政业	17,351,017.46	3.05
H	住宿和餐饮业	1,160,730.00	0.20
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,222,407.46	3.03
J	金融业	99,046,009.06	17.41
K	房地产业	10,060,668.12	1.77
L	租赁和商务服务业	8,038,389.96	1.41
M	科学研究和技术服务业	6,677,809.29	1.17
N	水利、环境和公共设施管理业	1,167,992.00	0.21
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	4,784,383.15	0.84
R	文化、体育和娱乐业	1,767,343.00	0.31
S	综合	460,009.00	0.08
	合计	564,783,845.14	99.29

7.2.2 期末积极投资按行业分类境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	339,160.46	0.06
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	-	-
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	157,958.58	0.03
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	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	20,975.79	0.00
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	518,094.83	0.09

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	16,842	34,441,890.00	6.06
2	300750	宁德时代	31,246	16,685,364.00	2.93
3	600036	招商银行	276,343	11,661,674.60	2.05
4	000858	五粮液	52,044	10,509,244.92	1.85
5	002594	比亚迪	24,300	8,103,807.00	1.42
6	600900	长江电力	303,654	7,020,480.48	1.23
7	601012	隆基绿能	101,773	6,781,134.99	1.19
8	601318	中国平安	144,808	6,761,085.52	1.19
9	601888	中国中免	26,094	6,078,075.42	1.07
10	601166	兴业银行	278,000	5,532,200.00	0.97
11	600809	山西汾酒	16,444	5,341,011.20	0.94
12	300760	迈瑞医疗	16,400	5,136,480.00	0.90
13	000568	泸州老窖	19,700	4,856,838.00	0.85
14	603288	海天味业	51,626	4,664,925.36	0.82
15	300059	东方财富	176,722	4,488,738.80	0.79
16	600309	万华化学	42,080	4,081,339.20	0.72
17	601398	工商银行	841,600	4,014,432.00	0.71
18	000001	平安银行	260,100	3,896,298.00	0.69
19	002714	牧原股份	70,414	3,891,781.78	0.68
20	002304	洋河股份	20,199	3,699,446.85	0.65
21	002352	顺丰控股	65,800	3,672,298.00	0.65
22	600438	通威股份	60,900	3,645,474.00	0.64
23	603259	药明康德	34,301	3,566,960.99	0.63
24	600030	中信证券	162,495	3,519,641.70	0.62
25	601288	农业银行	1,136,300	3,431,626.00	0.60
26	600887	伊利股份	85,788	3,341,442.60	0.59
27	300015	爱尔眼科	72,047	3,225,544.19	0.57
28	600276	恒瑞医药	85,633	3,176,127.97	0.56

29	002475	立讯精密	93,873	3,171,968.67	0.56
30	002142	宁波银行	88,110	3,155,219.10	0.55
31	600000	浦发银行	391,178	3,133,335.78	0.55
32	002812	恩捷股份	11,900	2,980,355.00	0.52
33	601668	中国建筑	559,760	2,977,923.20	0.52
34	601088	中国神华	87,978	2,929,667.40	0.52
35	600436	片仔癀	8,119	2,896,290.87	0.51
36	600048	保利发展	159,600	2,786,616.00	0.49
37	601816	京沪高铁	545,800	2,739,916.00	0.48
38	601225	陕西煤业	128,930	2,730,737.40	0.48
39	000002	万科 A	129,300	2,650,650.00	0.47
40	601328	交通银行	523,800	2,608,524.00	0.46
41	002129	TCL 中环	44,000	2,591,160.00	0.46
42	601899	紫金矿业	275,100	2,566,683.00	0.45
43	300014	亿纬锂能	26,124	2,547,090.00	0.45
44	600406	国电南瑞	89,224	2,409,048.00	0.42
45	600905	三峡能源	381,500	2,399,635.00	0.42
46	002459	晶澳科技	30,320	2,392,248.00	0.42
47	300122	智飞生物	21,500	2,386,715.00	0.42
48	601919	中远海控	169,260	2,352,714.00	0.41
49	002460	赣锋锂业	15,600	2,319,720.00	0.41
50	300124	汇川技术	35,200	2,318,624.00	0.41
51	600690	海尔智家	84,381	2,317,102.26	0.41
52	600031	三一重工	113,863	2,170,228.78	0.38
53	601601	中国太保	91,058	2,142,594.74	0.38
54	603501	韦尔股份	12,232	2,116,502.96	0.37
55	002493	荣盛石化	135,404	2,083,867.56	0.37
56	603799	华友钴业	20,964	2,004,577.68	0.35
57	000725	京东方 A	501,200	1,974,728.00	0.35
58	002371	北方华创	7,000	1,939,840.00	0.34
59	688599	天合光能	29,723	1,939,425.75	0.34
60	601658	邮储银行	354,500	1,910,755.00	0.34
61	000625	长安汽车	109,873	1,903,000.36	0.33
62	300274	阳光电源	19,200	1,886,400.00	0.33
63	600585	海螺水泥	53,300	1,880,424.00	0.33
64	600104	上汽集团	104,012	1,852,453.72	0.33
65	300498	温氏股份	84,880	1,807,095.20	0.32
66	600019	宝钢股份	297,119	1,788,656.38	0.31
67	600016	民生银行	473,100	1,759,932.00	0.31
68	600346	恒力石化	78,865	1,753,957.60	0.31
69	600028	中国石化	424,714	1,732,833.12	0.30
70	600111	北方稀土	48,750	1,714,050.00	0.30
71	601766	中国中车	325,400	1,692,080.00	0.30

72	601390	中国中铁	274,400	1,684,816.00	0.30
73	601066	中信建投	57,900	1,673,889.00	0.29
74	601818	光大银行	551,200	1,659,112.00	0.29
75	002709	天赐材料	26,600	1,650,796.00	0.29
76	601985	中国核电	240,200	1,647,772.00	0.29
77	600893	航发动力	35,526	1,616,788.26	0.28
78	601669	中国电建	204,500	1,609,415.00	0.28
79	002241	歌尔股份	46,508	1,562,668.80	0.27
80	603659	璞泰来	18,420	1,554,648.00	0.27
81	002049	紫光国微	8,100	1,536,732.00	0.27
82	601211	国泰君安	100,569	1,528,648.80	0.27
83	601988	中国银行	468,900	1,528,614.00	0.27
84	601857	中国石油	287,542	1,523,972.60	0.27
85	000776	广发证券	79,541	1,487,416.70	0.26
86	000538	云南白药	24,020	1,450,567.80	0.26
87	300896	爱美客	2,408	1,444,824.08	0.25
88	600050	中国联通	414,200	1,433,132.00	0.25
89	600999	招商证券	99,441	1,432,944.81	0.25
90	600010	包钢股份	608,500	1,429,975.00	0.25
91	600745	闻泰科技	16,700	1,421,337.00	0.25
92	001979	招商蛇口	105,632	1,418,637.76	0.25
93	600919	江苏银行	196,824	1,401,386.88	0.25
94	601688	华泰证券	98,628	1,400,517.60	0.25
95	601009	南京银行	133,900	1,395,238.00	0.25
96	600089	特变电工	50,700	1,388,673.00	0.24
97	000895	双汇发展	47,110	1,380,323.00	0.24
98	000596	古井贡酒	5,500	1,373,130.00	0.24
99	000063	中兴通讯	53,000	1,353,090.00	0.24
100	603993	洛阳钼业	235,200	1,347,696.00	0.24
101	600188	兖矿能源	33,900	1,338,372.00	0.24
102	000651	格力电器	38,900	1,311,708.00	0.23
103	601138	工业富联	133,000	1,308,720.00	0.23
104	002311	海大集团	21,800	1,308,218.00	0.23
105	601006	大秦铁路	198,000	1,304,820.00	0.23
106	002027	分众传媒	192,660	1,296,601.80	0.23
107	300759	康龙化成	13,600	1,294,992.00	0.23
108	000166	申万宏源	300,482	1,289,067.78	0.23
109	002230	科大讯飞	31,250	1,288,125.00	0.23
110	000661	长春高新	5,500	1,283,810.00	0.23
111	601169	北京银行	281,960	1,280,098.40	0.23
112	603986	兆易创新	8,888	1,263,962.48	0.22
113	600837	海通证券	128,700	1,262,547.00	0.22
114	601229	上海银行	189,712	1,242,613.60	0.22

115	688111	金山办公	6,278	1,237,519.36	0.22
116	603392	万泰生物	7,840	1,217,552.00	0.21
117	600196	复星医药	27,400	1,208,066.00	0.21
118	600989	宝丰能源	81,900	1,199,835.00	0.21
119	600926	杭州银行	79,620	1,192,707.60	0.21
120	603806	福斯特	17,776	1,164,683.52	0.20
121	300316	晶盛机电	17,200	1,162,548.00	0.20
122	601628	中国人寿	37,000	1,149,960.00	0.20
123	600660	福耀玻璃	27,500	1,149,775.00	0.20
124	300751	迈为股份	2,340	1,148,706.00	0.20
125	000338	潍柴动力	90,500	1,128,535.00	0.20
126	600150	中国船舶	59,300	1,125,514.00	0.20
127	601633	长城汽车	30,300	1,122,312.00	0.20
128	002920	德赛西威	7,400	1,095,200.00	0.19
129	600029	南方航空	147,500	1,078,225.00	0.19
130	601100	恒立液压	17,432	1,075,903.04	0.19
131	600522	中天科技	46,200	1,067,220.00	0.19
132	300763	锦浪科技	5,000	1,065,000.00	0.19
133	600600	青岛啤酒	10,210	1,061,023.20	0.19
134	600886	国投电力	99,860	1,048,530.00	0.18
135	600958	东方证券	102,152	1,042,971.92	0.18
136	601877	正泰电器	29,048	1,039,337.44	0.18
137	601868	中国能建	438,200	1,038,534.00	0.18
138	000963	华东医药	22,960	1,036,873.60	0.18
139	300999	金龙鱼	19,102	1,031,890.04	0.18
140	601111	中国国航	88,800	1,030,968.00	0.18
141	603833	欧派家居	6,840	1,030,651.20	0.18
142	601689	拓普集团	14,900	1,019,607.00	0.18
143	300142	沃森生物	20,774	1,005,253.86	0.18
144	600588	用友网络	46,276	1,004,651.96	0.18
145	601238	广汽集团	65,900	1,004,316.00	0.18
146	002074	国轩高科	21,800	994,080.00	0.17
147	600460	士兰微	18,900	982,800.00	0.17
148	688012	中微公司	8,300	969,025.00	0.17
149	601615	明阳智能	28,500	963,300.00	0.17
150	300782	卓胜微	7,104	959,040.00	0.17
151	002821	凯莱英	3,300	953,700.00	0.17
152	600132	重庆啤酒	6,502	953,193.20	0.17
153	600741	华域汽车	41,433	952,959.00	0.17
154	000733	振华科技	7,000	951,790.00	0.17
155	300628	亿联网络	12,400	944,260.00	0.17
156	600233	圆通速递	46,300	944,057.00	0.17
157	000876	新希望	61,600	942,480.00	0.17

158	002180	纳思达	18,600	941,532.00	0.17
159	300769	德方纳米	2,300	939,964.00	0.17
160	600795	国电电力	239,100	934,881.00	0.16
161	002001	新和成	40,724	928,914.44	0.16
162	688008	澜起科技	15,302	926,995.16	0.16
163	600176	中国巨石	52,951	921,876.91	0.16
164	600256	广汇能源	86,900	915,926.00	0.16
165	000100	TCL 科技	189,900	909,621.00	0.16
166	601336	新华保险	28,229	908,691.51	0.16
167	600547	山东黄金	48,652	902,981.12	0.16
168	000301	东方盛虹	53,000	896,230.00	0.16
169	600015	华夏银行	171,852	895,348.92	0.16
170	603290	斯达半导	2,300	887,570.00	0.16
171	600884	杉杉股份	29,100	864,852.00	0.15
172	688396	华润微	14,616	863,367.12	0.15
173	603369	今世缘	16,900	861,900.00	0.15
174	300661	圣邦股份	4,725	860,044.50	0.15
175	300413	芒果超媒	25,750	859,020.00	0.15
176	600011	华能国际	121,400	854,656.00	0.15
177	601865	福莱特	22,200	845,820.00	0.15
178	600570	恒生电子	19,294	840,060.76	0.15
179	600426	华鲁恒升	28,640	836,288.00	0.15
180	600845	宝信软件	15,260	833,196.00	0.15
181	601788	光大证券	52,853	832,963.28	0.15
182	002648	卫星化学	32,139	830,793.15	0.15
183	601618	中国中冶	236,600	828,100.00	0.15
184	300957	贝泰妮	3,800	826,614.00	0.15
185	600383	金地集团	61,159	821,976.96	0.14
186	002756	永兴材料	5,400	821,934.00	0.14
187	601600	中国铝业	173,000	821,750.00	0.14
188	000799	酒鬼酒	4,400	817,564.00	0.14
189	002938	鹏鼎控股	26,900	812,649.00	0.14
190	002736	国信证券	84,900	812,493.00	0.14
191	603185	上机数控	5,200	811,148.00	0.14
192	601838	成都银行	48,700	807,446.00	0.14
193	688036	传音控股	8,998	802,891.54	0.14
194	603260	合盛硅业	6,800	802,128.00	0.14
195	601360	三六零	93,800	799,176.00	0.14
196	300408	三环集团	26,200	788,620.00	0.14
197	600754	锦江酒店	12,500	786,250.00	0.14
198	601155	新城控股	30,500	775,615.00	0.14
199	601117	中国化学	82,182	773,332.62	0.14
200	300033	同花顺	8,000	769,200.00	0.14

201	601939	建设银行	126,700	767,802.00	0.13
202	000786	北新建材	22,138	766,417.56	0.13
203	300390	天华超净	8,700	760,380.00	0.13
204	603606	东方电缆	9,900	758,340.00	0.13
205	603486	科沃斯	6,200	755,718.00	0.13
206	605117	德业股份	2,680	750,105.20	0.13
207	600763	通策医疗	4,300	750,092.00	0.13
208	601901	方正证券	111,700	749,507.00	0.13
209	688005	容百科技	5,780	748,163.20	0.13
210	300496	中科创达	5,700	743,736.00	0.13
211	600009	上海机场	13,100	742,770.00	0.13
212	601916	浙商银行	221,300	734,716.00	0.13
213	000938	紫光股份	37,702	731,418.80	0.13
214	002240	盛新锂能	12,100	730,356.00	0.13
215	300433	蓝思科技	65,972	730,310.04	0.13
216	002841	视源股份	9,639	726,009.48	0.13
217	000983	山西焦煤	54,140	724,934.60	0.13
218	600018	上港集团	123,092	717,626.36	0.13
219	688126	沪硅产业	31,106	714,815.88	0.13
220	603899	晨光股份	12,700	712,216.00	0.13
221	300207	欣旺达	22,500	711,000.00	0.13
222	601995	中金公司	15,800	702,942.00	0.12
223	000069	华侨城 A	108,300	702,867.00	0.12
224	688180	君实生物	9,305	701,038.70	0.12
225	300450	先导智能	11,080	700,034.40	0.12
226	601727	上海电气	169,218	695,485.98	0.12
227	002202	金风科技	46,686	690,952.80	0.12
228	300223	北京君正	6,500	690,625.00	0.12
229	000723	美锦能源	56,300	686,860.00	0.12
230	600039	四川路桥	64,500	679,185.00	0.12
231	603816	顾家家居	11,990	678,993.70	0.12
232	300601	康泰生物	14,900	673,182.00	0.12
233	300595	欧普康视	11,770	673,126.30	0.12
234	603345	安井食品	4,000	671,480.00	0.12
235	300919	中伟股份	5,400	669,060.00	0.12
236	600141	兴发集团	15,100	664,249.00	0.12
237	600115	中国东航	120,800	663,192.00	0.12
238	601607	上海医药	36,626	662,198.08	0.12
239	603737	三棵树	5,056	654,398.08	0.12
240	605358	立昂微	9,700	653,586.00	0.11
241	002120	韵达股份	38,285	653,142.10	0.11
242	002916	深南电路	6,940	650,347.40	0.11
243	601799	星宇股份	3,800	649,800.00	0.11

244	002013	中航机电	52,500	648,375.00	0.11
245	002236	大华股份	39,400	646,948.00	0.11
246	002601	龙佰集团	32,115	643,905.75	0.11
247	002555	三七互娱	30,100	639,023.00	0.11
248	600584	长电科技	23,300	629,100.00	0.11
249	603198	迎驾贡酒	9,600	625,344.00	0.11
250	601377	兴业证券	88,510	623,995.50	0.11
251	600885	宏发股份	14,863	622,016.55	0.11
252	300073	当升科技	6,800	614,312.00	0.11
253	688363	华熙生物	4,316	613,648.88	0.11
254	600779	水井坊	6,593	610,116.22	0.11
255	002080	中材科技	22,000	605,000.00	0.11
256	600875	东方电气	36,700	603,715.00	0.11
257	000999	华润三九	13,410	603,450.00	0.11
258	603613	国联股份	6,735	596,721.00	0.10
259	600563	法拉电子	2,900	594,964.00	0.10
260	603456	九洲药业	11,500	594,550.00	0.10
261	600332	白云山	18,568	586,563.12	0.10
262	600803	新奥股份	31,500	585,585.00	0.10
263	601878	浙商证券	51,300	583,794.00	0.10
264	600918	中泰证券	76,300	583,695.00	0.10
265	600219	南山铝业	158,000	583,020.00	0.10
266	600674	川投能源	48,700	580,504.00	0.10
267	300347	泰格医药	5,050	577,972.50	0.10
268	002340	格林美	63,500	577,850.00	0.10
269	603568	伟明环保	17,300	577,301.00	0.10
270	688122	西部超导	6,251	576,342.20	0.10
271	601699	潞安环能	39,378	575,706.36	0.10
272	000157	中联重科	93,300	574,728.00	0.10
273	300529	健帆生物	11,200	569,968.00	0.10
274	002738	中矿资源	6,140	568,625.40	0.10
275	002176	江特电机	22,600	565,904.00	0.10
276	002414	高德红外	43,800	563,706.00	0.10
277	600298	安琪酵母	11,536	562,380.00	0.10
278	300454	深信服	5,400	560,412.00	0.10
279	600486	扬农化工	4,200	559,776.00	0.10
280	000425	徐工机械	103,600	558,404.00	0.10
281	002064	华峰化学	65,800	555,352.00	0.10
282	002007	华兰生物	24,300	554,040.00	0.10
283	601216	君正集团	112,500	549,000.00	0.10
284	601881	中国银河	56,700	548,289.00	0.10
285	002791	坚朗五金	4,200	544,824.00	0.10
286	300037	新宙邦	10,360	544,521.60	0.10

287	603939	益丰药房	10,244	541,190.52	0.10
288	000519	中兵红箭	18,400	536,360.00	0.09
289	002603	以岭药业	21,920	532,656.00	0.09
290	600499	科达制造	25,800	532,512.00	0.09
291	002353	杰瑞股份	13,200	531,960.00	0.09
292	300144	宋城演艺	34,620	531,417.00	0.09
293	600392	盛和资源	23,400	528,840.00	0.09
294	002252	上海莱士	89,100	528,363.00	0.09
295	688099	晶晨股份	5,200	525,200.00	0.09
296	002407	多氟多	10,700	523,337.00	0.09
297	002384	东山精密	22,800	522,804.00	0.09
298	600183	生益科技	30,700	521,593.00	0.09
299	603882	金域医学	6,300	520,065.00	0.09
300	603517	绝味食品	8,948	517,373.36	0.09
301	600362	江西铜业	28,900	515,287.00	0.09
302	002372	伟星新材	21,400	514,456.00	0.09
303	000683	远兴能源	48,700	511,837.00	0.09
304	000703	恒逸石化	48,680	511,626.80	0.09
305	601233	桐昆股份	32,000	508,160.00	0.09
306	002625	光启技术	29,400	507,738.00	0.09
307	000977	浪潮信息	19,160	507,356.80	0.09
308	002192	融捷股份	3,300	507,210.00	0.09
309	603589	口子窖	8,600	504,046.00	0.09
310	002268	卫士通	11,700	502,047.00	0.09
311	002497	雅化集团	15,300	499,545.00	0.09
312	600348	华阳股份	32,300	499,358.00	0.09
313	603077	和邦生物	117,000	498,420.00	0.09
314	601966	玲珑轮胎	19,511	494,994.07	0.09
315	600153	建发股份	37,748	493,366.36	0.09
316	688169	石头科技	800	493,360.00	0.09
317	300146	汤臣倍健	22,700	491,455.00	0.09
318	000738	航发控制	17,400	488,940.00	0.09
319	601108	财通证券	62,030	488,176.10	0.09
320	601696	中银证券	36,700	488,110.00	0.09
321	600655	豫园股份	51,500	486,160.00	0.09
322	600985	淮北矿业	33,300	484,848.00	0.09
323	601319	中国人保	95,100	481,206.00	0.08
324	002405	四维图新	31,800	479,226.00	0.08
325	002850	科达利	3,000	477,000.00	0.08
326	002600	领益智造	95,000	476,900.00	0.08
327	002602	世纪华通	98,840	476,408.80	0.08
328	600026	中远海能	46,100	476,213.00	0.08
329	000066	中国长城	43,973	475,787.86	0.08

330	688187	时代电气	7,300	474,427.00	0.08
331	603707	健友股份	16,799	473,731.80	0.08
332	600160	巨化股份	35,700	469,455.00	0.08
333	002508	老板电器	13,000	468,390.00	0.08
334	600487	亨通光电	32,100	466,734.00	0.08
335	603127	昭衍新药	4,080	464,304.00	0.08
336	000932	华菱钢铁	91,200	464,208.00	0.08
337	000830	鲁西化工	26,800	463,372.00	0.08
338	601058	赛轮轮胎	41,100	463,197.00	0.08
339	300373	扬杰科技	6,500	463,125.00	0.08
340	601555	东吴证券	66,420	460,290.60	0.08
341	000009	中国宝安	34,100	460,009.00	0.08
342	000807	云铝股份	46,100	455,468.00	0.08
343	000630	铜陵有色	139,200	453,792.00	0.08
344	600109	国金证券	50,383	453,447.00	0.08
345	601636	旗滨集团	35,500	452,625.00	0.08
346	002032	苏泊尔	8,000	450,720.00	0.08
347	300003	乐普医疗	24,100	447,537.00	0.08
348	600521	华海药业	19,610	445,147.00	0.08
349	300568	星源材质	15,283	443,818.32	0.08
350	000629	攀钢钒钛	116,200	441,560.00	0.08
351	600161	天坛生物	18,154	440,779.12	0.08
352	002078	太阳纸业	35,500	437,005.00	0.08
353	600848	上海临港	32,040	434,462.40	0.08
354	688009	中国通号	95,824	434,082.72	0.08
355	601077	渝农商行	117,200	433,640.00	0.08
356	000783	长江证券	73,000	432,890.00	0.08
357	000155	川能动力	19,400	429,710.00	0.08
358	002507	涪陵榨菜	12,400	428,048.00	0.08
359	688188	柏楚电子	1,944	427,757.76	0.08
360	002385	大北农	54,700	427,207.00	0.08
361	002568	百润股份	14,140	424,765.60	0.07
362	601666	平煤股份	31,200	424,008.00	0.07
363	600027	华电国际	107,818	423,724.74	0.07
364	601577	长沙银行	53,200	421,876.00	0.07
365	000831	五矿稀土	13,500	421,875.00	0.07
366	300832	新产业	9,300	419,523.00	0.07
367	002294	信立泰	14,900	418,690.00	0.07
368	000825	太钢不锈	76,700	418,015.00	0.07
369	002185	华天科技	44,000	412,720.00	0.07
370	002430	杭氧股份	13,200	412,632.00	0.07
371	000027	深圳能源	63,940	409,855.40	0.07
372	600705	中航产融	118,100	408,626.00	0.07

373	600177	雅戈尔	61,520	407,877.60	0.07
374	601990	南京证券	48,900	407,826.00	0.07
375	603233	大参林	12,948	405,272.40	0.07
376	600549	厦门钨业	18,700	404,294.00	0.07
377	600415	小商品城	72,500	403,825.00	0.07
378	300724	捷佳伟创	4,500	402,075.00	0.07
379	688202	美迪西	1,180	400,739.80	0.07
380	002326	永太科技	12,100	398,453.00	0.07
381	000933	神火股份	30,400	397,632.00	0.07
382	002531	天顺风能	24,100	397,409.00	0.07
383	000987	越秀金控	56,526	397,377.78	0.07
384	300699	光威复材	6,700	394,429.00	0.07
385	601866	中远海发	131,400	394,200.00	0.07
386	601456	国联证券	32,100	393,867.00	0.07
387	601198	东兴证券	44,200	393,380.00	0.07
388	600038	中直股份	8,700	393,240.00	0.07
389	002028	思源电气	11,000	392,260.00	0.07
390	603267	鸿远电子	2,900	389,557.00	0.07
391	000800	一汽解放	41,600	388,544.00	0.07
392	603444	吉比特	1,000	388,000.00	0.07
393	002673	西部证券	58,816	384,656.64	0.07
394	600872	中炬高新	11,083	383,582.63	0.07
395	002624	完美世界	26,650	382,960.50	0.07
396	600516	方大炭素	50,387	382,941.20	0.07
397	601168	西部矿业	32,100	379,743.00	0.07
398	300251	光线传媒	39,800	376,906.00	0.07
399	002463	沪电股份	25,470	375,937.20	0.07
400	000960	锡业股份	22,400	375,648.00	0.07
401	002128	电投能源	26,200	375,184.00	0.07
402	600258	首旅酒店	15,100	374,480.00	0.07
403	000401	冀东水泥	35,500	373,460.00	0.07
404	300676	华大基因	5,200	372,840.00	0.07
405	300850	新强联	4,170	371,255.10	0.07
406	002557	洽洽食品	6,400	364,352.00	0.06
407	600338	西藏珠峰	12,600	361,620.00	0.06
408	000893	亚钾国际	10,500	361,305.00	0.06
409	002153	石基信息	22,716	360,502.92	0.06
410	000728	国元证券	57,510	357,712.20	0.06
411	000975	银泰黄金	36,680	357,263.20	0.06
412	600170	上海建工	117,900	357,237.00	0.06
413	601880	辽港股份	210,000	357,000.00	0.06
414	688006	杭可科技	5,094	356,885.64	0.06
415	002797	第一创业	55,500	355,755.00	0.06

416	600988	赤峰黄金	22,300	355,685.00	0.06
417	000937	冀中能源	47,600	355,096.00	0.06
418	300357	我武生物	6,800	353,804.00	0.06
419	600704	物产中大	68,800	352,944.00	0.06
420	002422	科伦药业	18,800	351,560.00	0.06
421	002223	鱼跃医疗	13,700	351,542.00	0.06
422	600801	华新水泥	18,000	351,180.00	0.06
423	600079	人福医药	21,900	350,400.00	0.06
424	600598	北大荒	23,700	349,812.00	0.06
425	600369	西南证券	87,900	348,963.00	0.06
426	002939	长城证券	34,200	347,472.00	0.06
427	002541	鸿路钢构	10,370	346,358.00	0.06
428	300308	中际旭创	11,120	345,276.00	0.06
429	603712	七一二	10,800	340,200.00	0.06
430	002266	浙富控股	71,000	340,090.00	0.06
431	000423	东阿阿胶	9,200	339,940.00	0.06
432	000591	太阳能	40,700	339,845.00	0.06
433	603218	日月股份	13,300	337,820.00	0.06
434	002532	天山铝业	51,100	333,683.00	0.06
435	002409	雅克科技	6,000	333,060.00	0.06
436	300558	贝达药业	5,400	328,320.00	0.06
437	000050	深天马 A	32,600	325,022.00	0.06
438	600143	金发科技	34,100	324,632.00	0.06
439	002299	圣农发展	16,900	324,142.00	0.06
440	000739	普洛药业	15,700	324,048.00	0.06
441	600380	健康元	26,200	323,570.00	0.06
442	603338	浙江鼎力	6,380	323,466.00	0.06
443	000513	丽珠集团	8,900	322,269.00	0.06
444	000988	华工科技	13,800	319,746.00	0.06
445	601016	节能风电	66,400	318,720.00	0.06
446	688185	康希诺	1,600	318,528.00	0.06
447	002030	达安基因	18,528	318,496.32	0.06
448	300726	宏达电子	5,200	318,084.00	0.06
449	000709	河钢股份	140,400	317,304.00	0.06
450	002408	齐翔腾达	38,300	310,613.00	0.05
451	600688	上海石化	97,547	310,199.46	0.05
452	600998	九州通	25,900	308,469.00	0.05
453	002138	顺络电子	11,200	305,200.00	0.05
454	002152	广电运通	32,900	304,983.00	0.05
455	601992	金隅集团	110,100	304,977.00	0.05
456	600808	马钢股份	80,300	304,337.00	0.05
457	603866	桃李面包	18,208	301,342.40	0.05
458	603605	珀莱雅	1,820	300,627.60	0.05

459	603858	步长制药	15,240	300,380.40	0.05
460	600699	均胜电子	18,700	293,777.00	0.05
461	600056	中国医药	19,700	291,954.00	0.05
462	002456	欧菲光	43,500	291,885.00	0.05
463	000998	隆平高科	17,400	289,884.00	0.05
464	002506	协鑫集成	77,900	289,788.00	0.05
465	002044	美年健康	51,828	288,681.96	0.05
466	002145	中核钛白	40,115	286,019.95	0.05
467	600295	鄂尔多斯	15,800	285,190.00	0.05
468	600711	盛屯矿业	36,300	281,688.00	0.05
469	002156	通富微电	18,200	280,280.00	0.05
470	002465	海格通信	30,700	279,063.00	0.05
471	000860	顺鑫农业	10,400	278,928.00	0.05
472	002500	山西证券	47,720	273,912.80	0.05
473	002926	华西证券	34,700	272,048.00	0.05
474	002065	东华软件	43,000	271,760.00	0.05
475	000750	国海证券	74,580	270,725.40	0.05
476	002092	中泰化学	34,100	264,616.00	0.05
477	300418	昆仑万维	16,400	262,400.00	0.05
478	600895	张江高科	20,900	260,205.00	0.05
479	002010	传化智联	40,418	259,887.74	0.05
480	300253	卫宁健康	29,230	256,639.40	0.05
481	002558	巨人网络	27,600	252,540.00	0.04
482	300383	光环新网	24,200	252,164.00	0.04
483	002958	青农商行	75,900	251,988.00	0.04
484	300070	碧水源	48,100	250,601.00	0.04
485	002157	正邦科技	41,100	249,066.00	0.04
486	600583	海油工程	58,247	241,725.05	0.04
487	688298	东方生物	2,100	239,715.00	0.04
488	300677	英科医疗	9,260	234,833.60	0.04
489	002925	盈趣科技	10,860	233,707.20	0.04
490	600498	烽火通信	15,800	228,784.00	0.04
491	601598	中国外运	57,700	223,876.00	0.04
492	002563	森马服饰	36,900	218,448.00	0.04
493	000686	东北证券	31,100	217,389.00	0.04
494	688002	睿创微纳	5,375	213,495.00	0.04
495	000656	金科股份	73,300	209,638.00	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

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	688259	创耀科技	1,595	126,355.90	0.02

2	688175	高凌信息	2,851	91,887.73	0.02
3	688283	坤恒顺维	1,595	72,428.95	0.01
4	301238	瑞泰新材	1,634	52,402.38	0.01
5	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.01
6	301207	华兰疫苗	368	20,762.56	0.00
7	301150	中一科技	249	20,607.24	0.00
8	301109	军信股份	1,241	20,029.74	0.00
9	301219	腾远钴业	202	17,739.64	0.00
10	301153	中科江南	398	17,504.04	0.00
11	301248	杰创智能	472	14,098.64	0.00
12	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
13	301181	标榜股份	257	7,861.63	0.00
14	301196	唯科科技	195	7,316.40	0.00
15	301127	天源环保	85	946.05	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	5,549,558.70	1.00
2	000858	五粮液	2,965,063.00	0.54
3	600905	三峡能源	2,636,643.00	0.48
4	688599	天合光能	2,203,131.56	0.40
5	002594	比亚迪	2,050,566.00	0.37
6	300760	迈瑞医疗	1,727,737.00	0.31
7	000651	格力电器	1,613,691.00	0.29
8	300059	东方财富	1,384,068.00	0.25
9	601006	大秦铁路	1,321,203.00	0.24
10	002812	恩捷股份	1,312,447.00	0.24
11	000568	泸州老窖	1,211,612.00	0.22
12	000001	平安银行	1,181,111.00	0.21
13	002352	顺丰控股	1,169,880.00	0.21
14	002714	牧原股份	1,156,900.00	0.21
15	601868	中国能建	1,153,021.00	0.21
16	002049	紫光国微	1,131,232.00	0.20
17	002475	立讯精密	1,027,535.80	0.19
18	300014	亿纬锂能	976,379.00	0.18
19	002142	宁波银行	928,046.38	0.17
20	601238	广汽集团	914,651.00	0.17

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	3,929,335.00	0.71
2	000858	五粮液	1,981,507.00	0.36
3	002594	比亚迪	1,499,258.00	0.27
4	600519	贵州茅台	1,429,914.00	0.26
5	300760	迈瑞医疗	1,218,290.00	0.22
6	002812	恩捷股份	1,089,926.00	0.20
7	002049	紫光国微	1,037,904.00	0.19
8	002050	三花智控	944,643.00	0.17
9	600436	片仔癀	844,044.00	0.15
10	000001	平安银行	825,544.00	0.15
11	002352	顺丰控股	820,683.00	0.15
12	002714	牧原股份	795,047.00	0.14
13	000568	泸州老窖	768,528.00	0.14
14	300059	东方财富	750,686.00	0.14
15	002475	立讯精密	709,136.00	0.13
16	300014	亿纬锂能	670,886.00	0.12
17	002142	宁波银行	648,480.00	0.12
18	688779	长远锂科	648,173.36	0.12
19	002304	洋河股份	609,768.00	0.11
20	603019	中科曙光	607,634.00	0.11

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	109,876,175.08
卖出股票收入（成交）总额	78,509,869.57

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-

4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	99,509.06	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	99,509.06	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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	113060	浙 22 转债	850	85,006.33	0.01
2	127064	杭氧转债	145	14,502.73	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，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等，主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会、中国人民银行的处罚；招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。除上述证券的发行主体外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期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。

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

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

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	546,312.74
2	应收清算款	-
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	546,312.74

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688259	创耀科技	126,355.90	0.02	新股锁定期
2	688175	高凌信息	91,887.73	0.02	新股锁定期
3	688283	坤恒顺维	72,428.95	0.01	新股锁定期
4	301238	瑞泰新材	52,402.38	0.01	新股锁定期

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
3,631	97,983.41	131,363,072.00	36.92%	111,434,703.00	31.32%	112,980,000.00	31.76%

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	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(FOF)	52,924,100.00	14.88%
2	上海东证期货-工商银行-东证期货工银慧享二号集合资产管理计划	31,580,600.00	8.88%
3	伦敦市投资管理有限公司	12,324,200.00	3.46%
4	方正证券股份有限公司	7,611,601.00	2.14%
5	中国人寿保险股份有限公司万能账户(国寿资产受托)	4,124,600.00	1.16%
6	中信证券股份有限公司	3,983,482.00	1.12%
7	广发证券股份有限公司	3,592,300.00	1.01%
8	吴美兰	3,000,000.00	0.84%
9	华泰证券股份有限公司	2,759,989.00	0.78%
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	0.77%

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	112,980,000.00	31.76%
----	--	----------------	--------

注：持有人名称与注册登记机构持有人名册保持一致。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2018年4月3日)基金份额总额	1,309,777,775.00
本报告期期初基金份额总额	317,777,775.00
本报告期基金总申购份额	98,000,000.00
减：报告期基金总赎回份额	60,000,000.00
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	355,777,775.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末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

2022年5月27日，周易先生任南方基金管理股份有限公司董事长（法定代表人）。

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人主营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

本报告期内，基金管理人收到中国证券监督管理委员会深圳监管局对公司的监管措施。基金管理人已及时按要求改正并报告。

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
安信证券	1	99,584,681.03	54.59%	9,960.38	54.59%	-
中泰证券	2	77,228,393.59	42.33%	7,723.31	42.33%	-
华泰证券	2	5,613,435.84	3.08%	561.30	3.08%	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-

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

A：选择标准

1、公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；

2、公司具有较强的研究能力，能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告；

- 3、公司内部管理规范，能满足基金操作的保密要求；
- 4、建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯服务。

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

- 1、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座；
- 2、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实，投资建议是否准确
- 3、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

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：

招商证券

退租交易单元：

申万宏源

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
安信证券	9,370.15	0.45%	-	-	-	-
中泰证券	1,306,846.71	63.42%	-	-	-	-
华泰证券	744,326.41	36.12%	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-01-01
2	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金参与中信证券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	2022-01-28
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关联交易公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会	2022-02-12

		基金电子披露网站	
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	2022-02-27
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可转换公司债券的关联交易公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-03-05
6	南方基金关于 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金增加长城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	2022-03-18
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	2022-03-26
8	南方基金关于旗下部分基金增加华安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	2022-03-30
9	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金参与财通证券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	2022-04-14
10	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	2022-04-16
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可转换公司债券的关联交易公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-04-22
12	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	2022-05-12
13	南方基金管理股份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	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-06-18

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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

联接基金	1	20220101- 20220630	112,723,100.00	10,256,900.00	10,000,000.00	112,980,000.00	31.76%
------	---	-----------------------	----------------	---------------	---------------	----------------	--------

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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录**12.1 备查文件目录**

- 1、中国证监会批准设立 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金的文件；
- 2、《MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告；
- 6、《MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金 2022 年中期报告》原文。

12.2 存放地点

深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼。

12.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>