

MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金 2023 年中期报告

2023 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：2023 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 2023 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 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

目录

§1 重要提示及目录.....	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介.....	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
§4 管理人报告.....	7
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	11
§5 托管人报告.....	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	11
§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.....	14
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告.....	40
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	56
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.....	58
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.....	62
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	62
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.....	65
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	65
§12 备查文件目录.....	65
12.1 备查文件目录.....	65
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	305,777,775.00 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	010-66596688
	电子邮箱	manager@southernfund.com	fxjd_hq@bank-of-china.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	北京市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	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		518017	100818
法定代表人		周易	葛海蛟

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（如有）

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(2023 年 1 月 1 日 - 2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-12,809,701.50
本期利润	1,614,669.47
加权平均基金份额本期利润	0.0051
本期加权平均净值利润率	0.43%
本期基金份额净值增长率	-1.03%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	37,961,746.34
期末可供分配基金份额利润	0.1241
期末基金资产净值	343,739,521.34
期末基金份额净值	1.1241
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)

基金份额累计净值增长率	39.41%
-------------	--------

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。

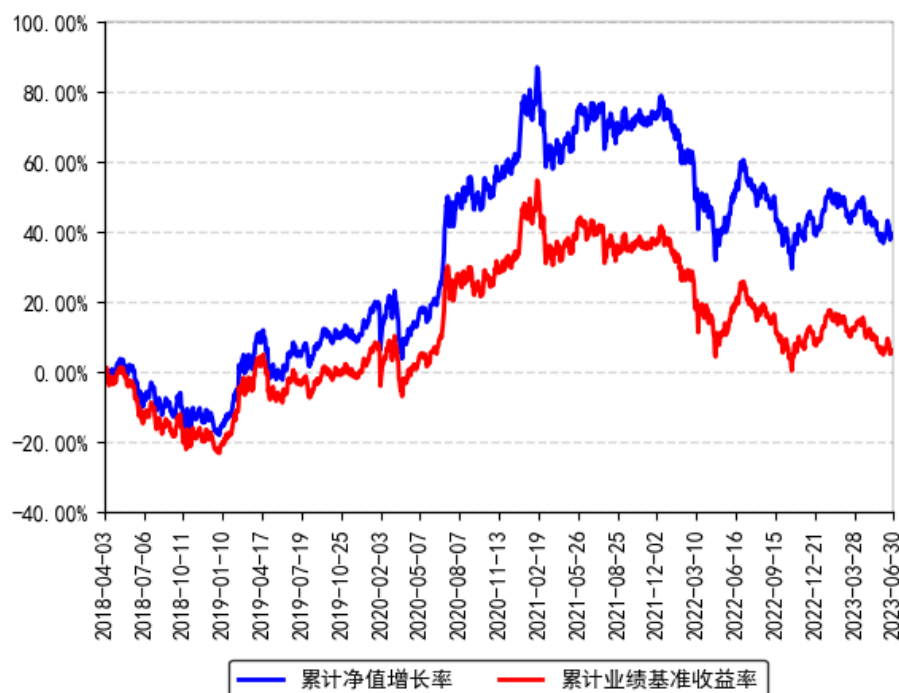
3.2 基金净值表现

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	1.44%	0.86%	0.43%	0.86%	1.01%	0.00%
过去三个月	-4.87%	0.78%	-6.34%	0.79%	1.47%	-0.01%
过去六个月	-1.03%	0.79%	-2.71%	0.79%	1.68%	0.00%
过去一年	-12.80%	0.94%	-15.40%	0.95%	2.60%	-0.01%
过去三年	9.87%	1.18%	-4.83%	1.19%	14.70%	-0.01%
自基金合同生效起至今	39.41%	1.25%	5.96%	1.26%	33.45%	-0.01%

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

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，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。

南方基金管理股份有限公司旗下管理公募基金、全国社保、基本养老保险、企业年金、职业年金和专户组合，已发展成为产品种类丰富、业务领域全面、经营业绩优秀、资产管理规模位居前列的基金管理公司之一。

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	说明

		任职日期	离任日期	年限	
罗文杰	本基金基金经理	2018 年 4 月 3 日	-	18 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；2021 年 3 月 12 日至 2023 年 2 月 24 日，任南方中证创新药产业 ETF 基金经理；2021 年 10 月 22 日至 2023 年 2 月 24 日，任南方中证全指医疗保健 ETF 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 7 月 2 日至今，任南方中证香港科技 ETF（QDII）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；2023 年 5 月 30 日至今，任南方恒生香港上市生物科技 ETF 发起联接（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	14	67,807,323,128.94	2013年04月22日
	私募资产管理计划	8	2,779,034,023.98	2020年08月07日
	其他组合	-	-	-
	合计	22	70,586,357,152.92	-

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13次，是由于指数投资组合的投资策略导致。

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 2.71%。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 1.1241 元，报告期内，份额净值增长率为-1.03%，同期业绩基准增长率为-2.71%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年中国经济增长持续修复，权益市场整体情绪不高，呈现结构性行情。现阶段，大中华权益市场估值继续处于历史底部区域，下行空间收窄，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、现金及债券指数投资部总经理、风险管理部总经理及运作保障部总经理等。本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。基金管理人改变估值技术，导

致基金资产净值的变化在 0.25%以上的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金进行了收益分配，符合法律法规和基金合同约定。具体如下：
权益登记日 2023 年 1 月 16 日，每 10 份基金份额分红数 2.9000。

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：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.3.1	1,670,048.77	1,663,538.70
结算备付金		569,305.85	497,192.02
存出保证金		352,788.83	337,659.35
交易性金融资产	6.4.3.2	341,312,875.55	426,003,343.88
其中：股票投资		341,312,875.55	426,003,343.88
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		193,339.16	212,446.96
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.5	-	-
资产总计		344,098,358.16	428,714,180.91
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.3.3	-	-
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		143,000.07	183,598.16
应付托管费		28,600.00	36,719.65
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	0.07
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.6	187,236.75	593,649.03
负债合计		358,836.82	813,966.91
净资产：			
实收基金	6.4.3.7	305,777,775.00	303,777,775.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.3.8	37,961,746.34	124,122,439.00
净资产合计		343,739,521.34	427,900,214.00
负债和净资产总计		344,098,358.16	428,714,180.91

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.1241 元，基金份额总额 305,777,775.00 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		2,973,162.37	-48,228,922.75
1.利息收入		9,188.85	8,969.14
其中：存款利息收入	6.4.3.9	9,188.85	8,969.14
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-11,542,475.77	-9,956,412.80
其中：股票投资收益	6.4.3.10	-15,721,039.00	-14,590,832.67
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.11	35,135.72	292,837.18

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	85,900.12	-470,338.35
股利收益	6.4.3.13	4,057,527.39	4,811,921.04
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	14,424,370.97	-38,379,916.63
4.汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.3.15	82,078.32	98,437.54
减：二、营业总支出		1,358,492.90	1,756,660.58
1.管理人报酬	6.4.6.2.1	935,943.42	1,283,896.60
2.托管费	6.4.6.2.2	187,188.61	256,779.29
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		723.36	0.36
8.其他费用	6.4.3.16	234,637.51	215,984.33
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		1,614,669.47	-49,985,583.33
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以 “-”号填列）		1,614,669.47	-49,985,583.33
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		1,614,669.47	-49,985,583.33

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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	303,777,775.00	-	124,122,439.00	427,900,214.00

资产(基金净值)				
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)	303,777,775.00	-	124,122,439.00	427,900,214.00
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	2,000,000.00	-	-86,160,692.66	-84,160,692.66
(一)、综合收益总额	-	-	1,614,669.47	1,614,669.47
(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)	2,000,000.00	-	-839,807.38	1,160,192.62
其中: 1.基金申购款	82,000,000.00	-	14,945,390.54	96,945,390.54
2.基金赎回款	-80,000,000.00	-	-15,785,197.92	-95,785,197.92
(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)	-	-	-86,935,554.75	-86,935,554.75
(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)	305,777,775.00	-	37,961,746.34	343,739,521.34
项目	上年度可比期间 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

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

本报告期所采用的会计政策，会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.2 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

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 2023 年 6 月 30 日
活期存款	1,670,048.77
等于：本金	1,669,903.25
加：应计利息	145.52
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	1,670,048.77

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	386,543,873.41	-	341,312,875.55	-45,230,997.86
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	386,543,873.41	-	341,312,875.55	-45,230,997.86

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款估值增值。

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 2023 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	2,369,840.00	-	-	-
一指期货	2,369,840.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	2,369,840.00	-	-	-

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
IC2307	IC2307	1.00	1,198,160.00	-7,200.00
IF2307	IF2307	1.00	1,149,120.00	-15,360.00
合计				-22,560.00
减：可抵销期货暂收款				-22,560.00
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 2023 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	8,545.56
其中：交易所市场	8,545.56
银行间市场	-
应付利息	-
应退退补款	-
预提费用	84,302.56
应付指数使用费	94,388.63
可退替代款	-
其他	-
合计	187,236.75

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	303,777,775.00	303,777,775.00
本期申购	82,000,000.00	82,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-80,000,000.00	-80,000,000.00
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	305,777,775.00	305,777,775.00

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
上年度末	238,439,116.94	-114,316,677.94	124,122,439.00
本期利润	-12,809,701.50	14,424,370.97	1,614,669.47
本期基金份额交易产生的变动数	-43,848.19	-795,959.19	-839,807.38
其中：基金申购款	38,256,402.02	-23,311,011.48	14,945,390.54
基金赎回款	-38,300,250.21	22,515,052.29	-15,785,197.92
本期已分配利润	-86,935,554.75	-	-86,935,554.75
本期末	138,650,012.50	-100,688,266.16	37,961,746.34

6.4.3.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	3,218.66
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	5,443.21
其他	526.98
合计	9,188.85

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-12,073,705.12
股票投资收益——赎回差价收入	-3,647,333.88
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	-15,721,039.00

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	164,427,644.09
减：卖出股票成本总额	176,292,185.39
减：交易费用	209,163.82
买卖股票差价收入	-12,073,705.12

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	95,785,197.92
减：现金支付赎回款总额	37,568,328.92
减：赎回股票成本总额	61,864,202.88
减：交易费用	-
赎回差价收入	-3,647,333.88

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	30.76
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	35,104.96
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	35,135.72

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	194,944.23
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	159,800.00
减：应计利息总额	31.40
减：交易费用	7.87
买卖债券差价收入	35,104.96

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股指期货-投资收益	85,900.12

6.4.3.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	4,057,527.39
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	4,057,527.39

6.4.3.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	14,478,730.97
——股票投资	14,478,730.97
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-54,360.00
——权证投资	-
——期货投资	-54,360.00
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	14,424,370.97

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。

6.4.3.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	80,894.65
其他	1,183.67
合计	82,078.32

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	119,960.55

银行费用	2,374.40
其他	28,000.00
合计	234,637.51

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	6,670,167.91	2.81%	5,613,435.84	3.08%

6.4.6.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
华泰证券	1,472.40	0.76%	744,326.41	36.12%

6.4.6.1.3 债券回购交易

无。

6.4.6.1.4 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。

6.4.6.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	667.02	2.81%	464.71	5.44%
关联方名称	上年度可比期间 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%

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	935,943.42	1,283,896.60
其中：支付销售机构的客户维护费	8,091.04	8,796.47

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的 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	187,188.61	256,779.29

注：支付基金托管人中国银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值的 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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	125,302,600.0	40.98%	104,596,100.0	34.43%

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	310,789.00	0.10%	11,860,689.00	3.90%

注：南方 MSCI 中国 A 股 ETF 联接基金、华泰证券投资本基金适用的认(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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	1,670,048.77	3,218.66	2,554,678.47	3,527.36

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	688472	阿特斯	网下申购	14,468	160,594.80
华泰联合	688478	晶升股份	网下申购	4,013	130,502.76
华泰联合	688512	慧智微	网下申购	6,055	126,670.60
华泰联合	118031	天 23 转债	配债	860	86,000.00
华泰联合	688429	时创能源	网下申购	3,452	66,278.40
华泰联合	113066	平煤转债	配债	290	29,000.00
华泰联合	603291	联合水务	网下申购	536	3,140.96
兴业证券	301322	绿通科技	网下申购	1,167	153,005.37
兴业证券	301315	威士顿	网下申购	2,253	72,749.37
兴业证券,华泰联合	688469	中芯集成	网下申购	43,192	245,762.48
兴业证券,华泰联合	601916	浙商银行	配股	44,070	89,021.40

上年度可比期间 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

6.4.6.8 其他关联交易事项的说明

于本期末，本基金持有关联方兴业证券、华泰证券、中国银行发行的普通股，成本总额为人民币 2,536,016.77 元，估值总额为人民币 2,529,062.12 元，占本基金基金资产净值的比例为 0.74%（上年度末，本基金持有关联方兴业证券、华泰证券、中国银行发行的普通股，成本总额为人民币 3,400,605.37 元，估值总额为人民币 2,879,112.34 元，占本基金基金资产净值的比例为 0.67%）。

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

单位：人民币元

序号	权益登记日	场内除息日	场外除息日	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
1	2023 年 1 月 16 日	2023 年 1 月 17 日	-	2.9000	86,935,554.75	-	86,935,554.75	-
合计	-	-	-	2.9000	86,935,554.75	-	86,935,554.75	-

6.4.8 期末（2023 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
301486	致尚科技	2023 年 6 月 30 日	1 个月内（含）	新股未上市	57.66	57.66	2,191	126,333.06	126,333.06	-
601916	浙商银行	2023 年 6 月 27 日	1 个月内（含）	配股未上市	2.02	2.64	44,070	89,021.40	116,344.80	-
301488	豪恩光电	2023 年 6 月	1 个月内（含）	新股未上市	39.78	39.78	2,356	93,721.68	93,721.68	-

		26 日								
301488	豪恩汽电	2023 年 6 月 26 日	6 个月	新股锁 定期	39.78	39.78	262	10,422.36	10,422.36	-
301202	朗威股份	2023 年 6 月 28 日	1 个月 内(含)	新股未 上市	25.82	25.82	2,754	71,108.28	71,108.28	-
301202	朗威股份	2023 年 6 月 28 日	6 个月	新股锁 定期	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	-
688603	天承科技	2023 年 6 月 30 日	1 个月 内(含)	新股未 上市	55.00	55.00	1,391	76,505.00	76,505.00	-
301261	恒工精密	2023 年 6 月 29 日	1 个月 内(含)	新股未 上市	36.90	36.90	1,973	72,803.70	72,803.70	-
688249	晶合集成	2023 年 4 月 24 日	6 个月	新股锁 定期	19.86	18.06	2,283	45,340.38	41,230.98	-
001286	陕西能源	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁 定期	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
301358	湖南裕能	2023 年 2 月 1 日	6 个月	新股锁 定期	23.77	42.89	580	13,786.60	24,876.20	-
688472	阿特斯	2023 年 6 月 2 日	6 个月	新股锁 定期	11.10	17.04	1,447	16,061.70	24,656.88	-
301293	三博脑科	2023 年 4 月 25 日	6 个月	新股锁 定期	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-
688361	中科飞测	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股锁 定期	23.60	64.67	362	8,543.20	23,410.54	-
688469	中芯集成	2023 年 4 月 28 日	6 个月	新股锁 定期	5.69	5.41	4,320	24,580.80	23,371.20	-
301325	曼恩斯特	2023 年 5 月 4 日	6 个月	新股锁 定期	76.80	107.9 5	200	15,360.00	21,590.00	-
301260	格力博	2023 年 1 月 20 日	6 个月	新股锁 定期	30.85	23.63	897	27,672.45	21,196.11	-
688443	智翔金泰	2023	6 个月	新股锁	37.88	29.49	659	24,962.92	19,433.91	-

		年 6 月 13 日		定期						
301317	鑫磊股份	2023 年 1 月 12 日	6 个月	新股锁 定期	20.67	26.17	694	14,344.98	18,161.98	-
688478	晶升股份	2023 年 4 月 13 日	6 个月	新股锁 定期	32.52	42.37	402	13,073.04	17,032.74	-
688562	航天软件	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁 定期	12.68	22.31	723	9,167.64	16,130.13	-
688576	西山科技	2023 年 5 月 30 日	6 个月	新股锁 定期	135.8 0	120.4 1	132	17,925.60	15,894.12	-
688531	日联科技	2023 年 3 月 24 日	6 个月	新股锁 定期	152.3 8	135.9 7	116	17,676.08	15,772.52	-
688582	芯动联科	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新股锁 定期	26.74	40.68	365	9,760.10	14,848.20	-
688146	中船特气	2023 年 4 月 13 日	6 个月	新股锁 定期	36.15	38.13	366	13,230.90	13,955.58	-
688352	颀中科技	2023 年 4 月 11 日	6 个月	新股锁 定期	12.10	12.07	1,122	13,576.20	13,542.54	-
301382	蜂助手	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新股锁 定期	23.80	32.84	408	9,710.40	13,398.72	-
688458	美芯晟	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁 定期	75.00	90.76	147	11,025.00	13,341.72	-
301320	豪江智能	2023 年 6 月 1 日	6 个月	新股锁 定期	13.06	20.62	642	8,384.52	13,238.04	-
688629	华丰科技	2023 年 6 月 16 日	6 个月	新股锁 定期	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	-
688620	安凯微	2023 年 6 月 15 日	6 个月	新股锁 定期	10.68	12.34	1,016	10,850.88	12,537.44	-
688334	西高院	2023 年 6 月 9 日	6 个月	新股锁 定期	14.16	16.21	720	10,195.20	11,671.20	-

688543	国科军工	2023年6月14日	6个月	新股锁定期	43.67	53.05	219	9,563.73	11,617.95	-
688512	慧智微	2023年5月8日	6个月	新股锁定期	20.92	19.16	606	12,677.52	11,610.96	-
301315	威士顿	2023年6月13日	6个月	新股锁定期	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-
688507	索辰科技	2023年4月10日	6个月	新股锁定期	245.56	122.11	63	15,470.28	7,692.93	-
688507	索辰科技	2023年6月20日	1-6个月(含)	锁定期转增	-	122.11	30	-	3,663.30	-
688570	天玛智控	2023年5月29日	6个月	新股锁定期	30.26	25.33	442	13,374.92	11,195.86	-
688433	华曙高科	2023年4月7日	6个月	新股锁定期	26.66	31.50	352	9,384.32	11,088.00	-
001287	中电港	2023年3月30日	6个月	新股锁定期	11.88	21.02	499	5,928.12	10,488.98	-
301232	飞沃科技	2023年6月8日	6个月	新股锁定期	72.50	58.42	165	11,962.50	9,639.30	-
301355	南王科技	2023年6月2日	6个月	新股锁定期	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	-
301322	绿通科技	2023年2月27日	6个月	新股锁定期	131.11	53.24	117	15,339.87	6,229.08	-
301322	绿通科技	2023年5月25日	1-6个月(含)	锁定期转增	-	53.24	59	-	3,141.16	-
301439	泓淋电力	2023年3月10日	6个月	新股锁定期	19.99	16.90	551	11,014.49	9,311.90	-
301376	致欧科技	2023年6月14日	6个月	新股锁定期	24.66	22.51	413	10,184.58	9,296.63	-
301357	北方长龙	2023年4月	6个月	新股锁定期	50.00	48.39	190	9,500.00	9,194.10	-

		11 日								
601061	中信金属	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股锁 定期	6.58	7.58	1,180	7,764.40	8,944.40	-
688429	时创能源	2023 年 6 月 20 日	6 个月	新股锁 定期	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-
301373	凌玮科技	2023 年 1 月 20 日	6 个月	新股锁 定期	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45	-
301323	新莱福	2023 年 5 月 29 日	6 个月	新股锁 定期	39.06	39.36	220	8,593.20	8,659.20	-
688631	莱斯信息	2023 年 6 月 19 日	6 个月	新股锁 定期	25.28	29.87	285	7,204.80	8,512.95	-
688535	华海诚科	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股锁 定期	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-
688623	双元科技	2023 年 5 月 31 日	6 个月	新股锁 定期	125.8 8	86.79	95	11,958.60	8,245.05	-
301157	华塑科技	2023 年 3 月 1 日	6 个月	新股锁 定期	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-
301295	美硕科技	2023 年 6 月 19 日	6 个月	新股锁 定期	37.40	36.07	215	8,041.00	7,755.05	-
301203	国泰环保	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股锁 定期	46.13	34.40	225	10,379.25	7,740.00	-
688479	友车科技	2023 年 5 月 4 日	6 个月	新股锁 定期	33.99	29.49	260	8,837.40	7,667.40	-
301345	涛涛车业	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新股锁 定期	73.45	46.64	153	11,237.85	7,135.92	-
301337	亚华电子	2023 年 5 月 16 日	6 个月	新股锁 定期	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-
301428	世纪恒通	2023 年 5 月 10 日	6 个月	新股锁 定期	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-
601133	柏诚股份	2023	6 个月	新股锁	11.66	12.26	391	4,559.06	4,793.66	-

		年 3 月 31 日		定期						
601065	江盐集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定期	10.36	11.84	403	4,175.08	4,771.52	-
001328	登康口腔	2023 年 3 月 29 日	6 个月	新股锁定期	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-
603125	常青科技	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股锁定期	25.98	24.53	128	3,325.44	3,139.84	-
001360	南矿集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定期	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	-
001324	长青科技	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股锁定期	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-
001367	海森药业	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股锁定期	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
603172	万丰股份	2023 年 4 月 28 日	6 个月	新股锁定期	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-

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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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同责任，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。本基金的流动性风险来自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，从而造成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、流通受限限制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。

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,670,048.77	-	-	-	1,670,048.77
结算备付金	569,305.85	-	-	-	569,305.85
存出保证金	71,115.23	-	-	281,673.60	352,788.83
交易性金融资产	-	-	-	341,312,875.55	341,312,875.55
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	-	-	-	193,339.16	193,339.16
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	2,310,469.85	-	-	341,787,888.31	344,098,358.16
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	-	-	-	143,000.07	143,000.07
应付托管费	-	-	-	28,600.00	28,600.00
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	-	-	-	187,236.75	187,236.75
负债总计	-	-	-	358,836.82	358,836.82
利率敏感度缺口	2,310,469.85	-	-	341,429,051.49	343,739,521.34
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,663,538.70	-	-	-	1,663,538.70
结算备付金	497,192.02	-	-	-	497,192.02
存出保证金	33,280.15	-	-	304,379.20	337,659.35
交易性金融资产	-	-	-	426,003,343.88	426,003,343.88
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	-	-	-	212,446.96	212,446.96
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-

资产总计	2,194,010.87	-	-	426,520,170.04	428,714,180.91
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	-	-	-	183,598.16	183,598.16
应付托管费	-	-	-	36,719.65	36,719.65
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	0.07	0.07
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	593,649.03	593,649.03
负债总计	-	-	-	813,966.91	813,966.91
利率敏感度缺口	2,194,010.87	-	-	425,706,203.13	427,900,214.00

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（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
	1. 市场利率平行上升 25 个基点	0.00	0.00
2. 市场利率平行下降 25 个基点	0.00	0.00	

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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	341,312,875.55	99.29	426,003,343.88	99.56
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	341,312,875.55	99.29	426,003,343.88	99.56

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(2023 年 6 月 30 日)	上年度末(2022 年 12 月 31 日)
	1.组合自身基准上升 5%	17,071,842.34	21,339,765.92
	2.组合自身基准下降 5%	-17,071,842.34	-21,339,765.92

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

单位:人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日
第一层次	340,002,936.14
第二层次	575,139.80
第三层次	734,799.61
合计	341,312,875.55

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的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 2023 年 06 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。

6.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	341,312,875.55	99.19
	其中：股票	341,312,875.55	99.19
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,239,354.62	0.65
8	其他资产	546,127.99	0.16
9	合计	344,098,358.16	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	3,627,425.10	1.06
B	采矿业	15,001,016.85	4.36
C	制造业	192,215,606.63	55.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,099,507.26	3.81
E	建筑业	7,675,425.76	2.23
F	批发和零售业	3,701,009.36	1.08
G	交通运输、仓储和邮政业	11,422,825.60	3.32
H	住宿和餐饮业	518,301.00	0.15
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,773,245.21	4.88
J	金融业	60,709,838.21	17.66
K	房地产业	5,176,706.35	1.51
L	租赁和商务服务业	3,126,342.42	0.91
M	科学研究和技术服务业	2,307,998.11	0.67
N	水利、环境和公共设施管理业	449,855.00	0.13
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	251,450.00	0.07
Q	卫生和社会工作	2,323,237.58	0.68

R	文化、体育和娱乐业	1,280,941.50	0.37
S	综合	458,549.00	0.13
	合计	340,119,280.94	98.95

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	998,757.62	0.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.01
E	建筑业	4,793.66	0.00
F	批发和零售业	28,730.01	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	82,671.79	0.02
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	11,671.20	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	7,740.00	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	23,782.86	0.01
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,193,594.61	0.35

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	10,842	18,333,822.00	5.33
2	300750	宁德时代	38,183	8,735,888.57	2.54
3	600036	招商银行	179,743	5,888,380.68	1.71
4	000858	五粮液	33,944	5,552,220.08	1.62
5	600900	长江电力	205,254	4,527,903.24	1.32

6	601318	中国平安	94,408	4,380,531.20	1.27
7	002594	比亚迪	15,800	4,080,666.00	1.19
8	300760	迈瑞医疗	10,500	3,147,900.00	0.92
9	601166	兴业银行	180,200	2,820,130.00	0.82
10	000568	泸州老窖	12,800	2,682,496.00	0.78
11	600276	恒瑞医药	55,433	2,655,240.70	0.77
12	601398	工商银行	545,800	2,630,756.00	0.77
13	601288	农业银行	738,500	2,606,905.00	0.76
14	600309	万华化学	27,180	2,387,491.20	0.69
15	601138	工业富联	86,100	2,169,720.00	0.63
16	600030	中信证券	106,195	2,100,537.10	0.61
17	601668	中国建筑	363,760	2,087,982.40	0.61
18	601899	紫金矿业	178,600	2,030,682.00	0.59
19	002475	立讯精密	61,773	2,004,533.85	0.58
20	002714	牧原股份	47,414	1,998,500.10	0.58
21	601328	交通银行	340,500	1,974,900.00	0.57
22	300059	东方财富	137,546	1,953,153.20	0.57
23	600809	山西汾酒	10,544	1,951,378.08	0.57
24	002352	顺丰控股	42,400	1,911,816.00	0.56
25	000001	平安银行	168,400	1,891,132.00	0.55
26	688111	金山办公	4,004	1,890,768.88	0.55
27	601012	隆基绿能	65,773	1,885,711.91	0.55
28	603288	海天味业	40,131	1,880,137.35	0.55
29	601888	中国中免	16,894	1,867,293.82	0.54
30	600000	浦发银行	254,678	1,843,868.72	0.54
31	601088	中国神华	57,178	1,758,223.50	0.51
32	600028	中国石化	275,014	1,749,089.04	0.51
33	002304	洋河股份	13,099	1,720,553.65	0.50
34	600406	国电南瑞	69,629	1,608,429.90	0.47
35	600887	伊利股份	55,488	1,571,420.16	0.46
36	000063	中兴通讯	34,500	1,571,130.00	0.46
37	601601	中国太保	59,358	1,542,120.84	0.45
38	601225	陕西煤业	84,030	1,528,505.70	0.44
39	600436	片仔癀	5,319	1,523,148.84	0.44
40	300274	阳光电源	12,900	1,504,527.00	0.44
41	300015	爱尔眼科	80,930	1,501,251.50	0.44
42	601816	京沪高铁	284,000	1,493,840.00	0.43
43	002371	北方华创	4,700	1,492,955.00	0.43
44	002142	宁波银行	57,310	1,449,943.00	0.42
45	601857	中国石油	187,342	1,399,444.74	0.41
46	603259	药明康德	22,201	1,383,344.31	0.40
47	601766	中国中车	211,100	1,372,150.00	0.40
48	002230	科大讯飞	20,150	1,369,394.00	0.40

49	600048	保利发展	103,800	1,352,514.00	0.39
50	601390	中国中铁	178,200	1,350,756.00	0.39
51	600438	通威股份	39,000	1,338,090.00	0.39
52	600905	三峡能源	248,300	1,333,371.00	0.39
53	000725	京东方 A	325,400	1,330,886.00	0.39
54	600050	中国联通	275,900	1,324,320.00	0.39
55	600690	海尔智家	54,681	1,283,909.88	0.37
56	600150	中国船舶	38,800	1,276,908.00	0.37
57	601818	光大银行	402,600	1,235,982.00	0.36
58	601658	邮储银行	252,300	1,233,747.00	0.36
59	600031	三一重工	73,663	1,225,015.69	0.36
60	002459	晶澳科技	28,628	1,193,787.60	0.35
61	601988	中国银行	304,700	1,191,377.00	0.35
62	000002	万科 A	84,300	1,181,886.00	0.34
63	002129	TCL 中环	35,025	1,162,830.00	0.34
64	601985	中国核电	163,700	1,154,085.00	0.34
65	600016	民生银行	307,600	1,153,500.00	0.34
66	600019	宝钢股份	193,119	1,085,328.78	0.32
67	300014	亿纬锂能	17,724	1,072,302.00	0.31
68	688036	传音控股	7,179	1,055,313.00	0.31
69	300498	温氏股份	56,880	1,043,748.00	0.30
70	601919	中远海控	110,560	1,039,264.00	0.30
71	002493	荣盛石化	87,804	1,022,038.56	0.30
72	300308	中际旭创	6,920	1,020,354.00	0.30
73	603501	韦尔股份	10,238	1,003,733.52	0.29
74	600893	航发动力	23,126	977,304.76	0.28
75	601006	大秦铁路	129,000	958,470.00	0.28
76	600104	上汽集团	67,512	956,645.04	0.28
77	600919	江苏银行	128,124	941,711.40	0.27
78	000625	长安汽车	71,873	929,317.89	0.27
79	300122	智飞生物	20,850	921,570.00	0.27
80	601211	国泰君安	65,169	911,714.31	0.27
81	601066	中信建投	37,500	907,500.00	0.26
82	000166	申万宏源	195,482	903,126.84	0.26
83	000792	盐湖股份	47,100	902,907.00	0.26
84	002466	天齐锂业	12,800	894,848.00	0.26
85	000651	格力电器	24,400	890,844.00	0.26
86	000596	古井贡酒	3,600	890,568.00	0.26
87	601688	华泰证券	63,828	878,911.56	0.26
88	600346	恒力石化	61,065	875,061.45	0.25
89	001979	招商蛇口	67,132	874,729.96	0.25
90	600999	招商证券	64,341	873,107.37	0.25
91	688012	中微公司	5,557	869,392.65	0.25

92	601669	中国电建	149,400	857,556.00	0.25
93	002027	分众传媒	125,260	853,020.60	0.25
94	002460	赣锋锂业	13,960	851,001.60	0.25
95	601169	北京银行	183,460	849,419.80	0.25
96	300896	爱美客	1,908	848,964.60	0.25
97	601628	中国人寿	24,100	842,536.00	0.25
98	300033	同花顺	4,700	823,816.00	0.24
99	600585	海螺水泥	34,700	823,778.00	0.24
100	000538	云南白药	15,620	819,737.60	0.24
101	002812	恩捷股份	8,500	818,975.00	0.24
102	600886	国投电力	64,700	818,455.00	0.24
103	603993	洛阳钼业	153,300	817,089.00	0.24
104	688223	晶科能源	57,836	813,174.16	0.24
105	688599	天合光能	18,831	802,388.91	0.23
106	600989	宝丰能源	63,600	801,996.00	0.23
107	300316	晶盛机电	11,300	801,170.00	0.23
108	000938	紫光股份	24,802	789,943.70	0.23
109	601360	三六零	62,000	777,480.00	0.23
110	600845	宝信软件	15,286	776,681.66	0.23
111	601689	拓普集团	9,600	774,720.00	0.23
112	600837	海通证券	83,800	772,636.00	0.22
113	002920	德赛西威	4,900	763,469.00	0.22
114	000776	广发证券	51,341	755,226.11	0.22
115	600111	北方稀土	31,350	751,773.00	0.22
116	600089	特变电工	33,700	751,173.00	0.22
117	601100	恒立液压	11,632	748,286.56	0.22
118	600703	三安光电	43,300	746,492.00	0.22
119	300124	汇川技术	11,500	738,415.00	0.21
120	600011	华能国际	79,500	736,170.00	0.21
121	600547	山东黄金	31,352	736,144.96	0.21
122	000895	双汇发展	30,010	734,944.90	0.21
123	000338	潍柴动力	58,800	732,648.00	0.21
124	600570	恒生电子	16,502	730,873.58	0.21
125	601009	南京银行	89,700	717,600.00	0.21
126	601229	上海银行	123,212	708,469.00	0.21
127	600010	宝钢股份	395,500	707,945.00	0.21
128	000425	徐工机械	102,500	693,925.00	0.20
129	002049	紫光国微	7,380	688,185.00	0.20
130	002709	天赐材料	16,700	687,873.00	0.20
131	600085	同仁堂	11,900	684,964.00	0.20
132	688256	寒武纪	3,593	675,484.00	0.20
133	002311	海大集团	14,400	674,496.00	0.20
134	002555	三七互娱	19,300	673,184.00	0.20

135	603659	璞泰来	17,514	669,385.08	0.19
136	601336	新华保险	18,129	666,603.33	0.19
137	601868	中国能建	281,300	658,242.00	0.19
138	600188	兖矿能源	22,000	658,240.00	0.19
139	000963	华东医药	15,160	657,489.20	0.19
140	000100	TCL 科技	162,890	641,786.60	0.19
141	000301	东方盛虹	53,900	637,098.00	0.19
142	603799	华友钴业	13,864	636,496.24	0.19
143	600600	青岛啤酒	6,110	633,179.30	0.18
144	601600	中国铝业	114,700	629,703.00	0.18
145	600958	东方证券	64,752	628,094.40	0.18
146	603986	兆易创新	5,888	625,600.00	0.18
147	688303	大全能源	15,434	624,305.30	0.18
148	600660	福耀玻璃	17,400	623,790.00	0.18
149	600015	华夏银行	115,052	622,431.32	0.18
150	600039	四川路桥	63,040	618,422.40	0.18
151	601618	中国中冶	154,900	614,953.00	0.18
152	000977	浪潮信息	12,660	614,010.00	0.18
153	600588	用友网络	29,776	610,408.00	0.18
154	688396	华润微	11,638	609,947.58	0.18
155	600926	杭州银行	51,420	604,185.00	0.18
156	603806	福斯特	16,146	600,469.74	0.17
157	601995	中金公司	16,900	600,288.00	0.17
158	600795	国电电力	154,700	592,501.00	0.17
159	600029	南方航空	97,400	587,322.00	0.17
160	600221	海航控股	371,700	587,286.00	0.17
161	600674	川投能源	38,700	582,435.00	0.17
162	688008	澜起科技	10,063	577,817.46	0.17
163	603369	今世缘	10,900	575,520.00	0.17
164	002236	大华股份	28,800	568,800.00	0.17
165	600196	复星医药	18,400	568,560.00	0.17
166	601865	福莱特	14,700	566,097.00	0.16
167	605117	德业股份	3,784	565,897.20	0.16
168	600426	华鲁恒升	18,440	564,817.20	0.16
169	300413	芒果超媒	16,250	555,912.50	0.16
170	601111	中国国航	67,300	554,552.00	0.16
171	601633	长城汽车	21,500	541,155.00	0.16
172	601607	上海医药	24,126	540,663.66	0.16
173	601788	光大证券	33,853	537,924.17	0.16
174	600745	闻泰科技	10,800	528,120.00	0.15
175	002241	歌尔股份	29,608	525,542.00	0.15
176	000999	华润三九	8,610	522,282.60	0.15
177	601939	建设银行	83,200	520,832.00	0.15

178	601877	正泰电器	18,648	515,617.20	0.15
179	300433	蓝思科技	43,172	507,702.72	0.15
180	600741	华域汽车	27,333	504,567.18	0.15
181	601916	浙商银行	190,970	504,160.80	0.15
182	601727	上海电气	109,818	501,868.26	0.15
183	300999	金龙鱼	12,502	499,954.98	0.15
184	688126	沪硅产业	23,683	494,974.70	0.14
185	600023	浙能电力	96,900	491,283.00	0.14
186	000661	长春高新	3,600	490,680.00	0.14
187	600176	中国巨石	34,651	490,658.16	0.14
188	002602	世纪华通	64,640	490,617.60	0.14
189	600009	上海机场	10,800	490,536.00	0.14
190	603392	万泰生物	7,336	489,824.72	0.14
191	601021	春秋航空	8,500	488,495.00	0.14
192	300408	三环集团	16,600	487,210.00	0.14
193	600732	爱旭股份	15,800	485,850.00	0.14
194	002736	国信证券	55,600	485,388.00	0.14
195	600584	长电科技	15,400	480,018.00	0.14
196	601319	中国人保	82,100	479,464.00	0.14
197	601127	赛力斯	13,000	478,010.00	0.14
198	603260	合盛硅业	6,800	476,136.00	0.14
199	600027	华电国际	70,918	474,441.42	0.14
200	600115	中国东航	99,000	471,240.00	0.14
201	600522	中天科技	29,600	470,936.00	0.14
202	002050	三花智控	15,500	469,030.00	0.14
203	601901	方正证券	71,400	466,956.00	0.14
204	000876	新希望	39,400	460,192.00	0.13
205	601377	兴业证券	74,963	458,773.56	0.13
206	601825	沪农商行	83,700	456,165.00	0.13
207	300782	卓胜微	4,704	454,547.52	0.13
208	600875	东方电气	24,100	449,465.00	0.13
209	000983	山西焦煤	49,240	448,084.00	0.13
210	601238	广汽集团	42,700	444,934.00	0.13
211	000733	振华科技	4,600	440,910.00	0.13
212	002252	上海莱士	58,500	439,335.00	0.13
213	601117	中国化学	52,982	438,690.96	0.13
214	002648	卫星化学	29,194	436,742.24	0.13
215	600489	中金黄金	42,100	434,893.00	0.13
216	600233	圆通速递	29,800	433,888.00	0.13
217	601881	中国银河	37,300	433,053.00	0.13
218	603833	欧派家居	4,440	425,352.00	0.12
219	002074	国轩高科	15,400	425,348.00	0.12
220	600803	新奥股份	22,400	425,152.00	0.12

221	601699	潞安环能	25,978	423,960.96	0.12
222	002600	领益智造	61,100	422,201.00	0.12
223	300454	深信服	3,700	419,025.00	0.12
224	300418	昆仑万维	10,400	418,912.00	0.12
225	002180	纳思达	12,200	417,850.00	0.12
226	600918	中泰证券	60,400	417,364.00	0.12
227	000157	中联重科	61,600	415,800.00	0.12
228	002001	新和成	26,824	413,089.60	0.12
229	300751	迈为股份	2,424	410,577.12	0.12
230	002841	视源股份	6,139	410,330.76	0.12
231	601872	招商轮船	70,500	408,195.00	0.12
232	002938	鹏鼎控股	16,800	408,072.00	0.12
233	600415	小商品城	47,600	406,028.00	0.12
234	600515	海南机场	99,100	402,346.00	0.12
235	300832	新产业	6,800	401,200.00	0.12
236	600061	国投资本	55,700	396,584.00	0.12
237	600132	重庆啤酒	4,302	396,472.32	0.12
238	601838	成都银行	32,400	395,604.00	0.12
239	688777	中控技术	6,277	394,070.06	0.11
240	600256	广汇能源	57,000	391,020.00	0.11
241	603486	科沃斯	5,000	388,850.00	0.11
242	600161	天坛生物	14,300	388,245.00	0.11
243	600332	白云山	12,168	387,915.84	0.11
244	000066	中国长城	27,973	386,866.59	0.11
245	300496	中科创达	4,000	385,400.00	0.11
246	002384	东山精密	14,800	383,320.00	0.11
247	000807	云铝股份	30,100	383,173.00	0.11
248	300628	亿联网络	10,920	382,964.40	0.11
249	603345	安井食品	2,600	381,680.00	0.11
250	600026	中远海能	30,100	380,464.00	0.11
251	600079	人福医药	14,100	379,854.00	0.11
252	002422	科伦药业	12,700	376,936.00	0.11
253	603198	迎驾贡酒	5,900	376,420.00	0.11
254	688363	华熙生物	4,169	371,708.04	0.11
255	300223	北京君正	4,200	370,902.00	0.11
256	002603	以岭药业	14,420	370,449.80	0.11
257	600460	士兰微	12,200	369,294.00	0.11
258	300003	乐普医疗	16,300	368,543.00	0.11
259	300142	沃森生物	13,874	366,967.30	0.11
260	300763	锦浪科技	3,500	364,350.00	0.11
261	603688	石英股份	3,200	364,288.00	0.11
262	688009	中国通号	62,350	361,630.00	0.11
263	600702	舍得酒业	2,900	359,455.00	0.10

264	000786	北新建材	14,638	358,777.38	0.10
265	603899	晨光股份	8,000	357,120.00	0.10
266	002821	凯莱英	3,020	355,937.20	0.10
267	002007	华兰生物	15,800	354,078.00	0.10
268	300146	汤臣倍健	14,700	352,506.00	0.10
269	300724	捷佳伟创	3,100	348,285.00	0.10
270	600536	中国软件	7,410	347,380.80	0.10
271	002463	沪电股份	16,470	344,881.80	0.10
272	002601	龙佰集团	20,815	343,447.50	0.10
273	002916	深南电路	4,540	342,179.80	0.10
274	600362	江西铜业	18,000	341,640.00	0.10
275	300037	新宙邦	6,460	335,209.40	0.10
276	600754	锦江酒店	7,900	334,486.00	0.10
277	300661	圣邦股份	4,062	333,612.06	0.10
278	601615	明阳智能	19,700	332,536.00	0.10
279	601878	浙商证券	33,600	331,968.00	0.10
280	000988	华工科技	8,700	330,687.00	0.10
281	300759	康龙化成	8,600	329,208.00	0.10
282	300957	贝泰妮	3,700	328,856.00	0.10
283	002568	百润股份	9,040	328,604.00	0.10
284	603290	斯达半导	1,500	322,800.00	0.09
285	603939	益丰药房	8,722	322,714.00	0.09
286	600160	巨化股份	23,400	322,452.00	0.09
287	600018	上港集团	60,592	318,108.00	0.09
288	002202	金风科技	29,886	317,389.32	0.09
289	600487	亨通光电	21,500	315,190.00	0.09
290	688122	西部超导	5,629	313,704.17	0.09
291	000069	华侨城 A	71,200	313,280.00	0.09
292	002223	鱼跃医疗	8,700	313,113.00	0.09
293	688063	派能科技	1,579	313,036.75	0.09
294	002028	思源电气	6,700	313,024.00	0.09
295	002738	中矿资源	6,136	312,567.84	0.09
296	601958	金铂股份	28,000	312,200.00	0.09
297	002558	巨人网络	17,400	311,982.00	0.09
298	688521	芯原股份	4,328	311,269.76	0.09
299	000423	东阿阿胶	5,800	310,010.00	0.09
300	603882	金域医学	4,100	309,550.00	0.09
301	000408	藏格矿业	13,700	309,209.00	0.09
302	601799	星宇股份	2,500	309,000.00	0.09
303	002340	格林美	44,600	308,186.00	0.09
304	688561	奇安信	5,948	308,165.88	0.09
305	603737	三棵树	4,698	307,343.16	0.09
306	600219	南山铝业	101,600	306,832.00	0.09

307	002409	雅克科技	4,200	306,096.00	0.09
308	000729	燕京啤酒	24,500	305,515.00	0.09
309	601058	赛轮轮胎	26,600	302,974.00	0.09
310	688099	晶晨股份	3,592	302,877.44	0.09
311	601555	东吴证券	43,420	301,334.80	0.09
312	601216	君正集团	73,200	300,120.00	0.09
313	002294	信立泰	9,600	299,424.00	0.09
314	603606	东方电缆	6,100	299,083.00	0.09
315	002756	永兴材料	4,770	298,649.70	0.09
316	600884	杉杉股份	19,700	298,258.00	0.09
317	600642	申能股份	42,600	297,774.00	0.09
318	002080	中材科技	14,500	297,540.00	0.09
319	603885	吉祥航空	19,200	296,256.00	0.09
320	002156	通富微电	13,100	296,060.00	0.09
321	002064	华峰化学	43,100	295,666.00	0.09
322	600004	白云机场	20,600	295,404.00	0.09
323	300919	中伟股份	4,900	295,225.00	0.09
324	603444	吉比特	600	294,666.00	0.09
325	600705	中航产融	76,600	293,378.00	0.09
326	002430	杭氧股份	8,500	292,060.00	0.08
327	601108	财通证券	40,330	291,989.20	0.08
328	600970	中材国际	22,900	291,975.00	0.08
329	000629	钒钛股份	74,600	291,686.00	0.08
330	600183	生益科技	20,300	288,260.00	0.08
331	002414	高德红外	37,070	288,033.90	0.08
332	000932	华菱钢铁	59,900	285,723.00	0.08
333	002625	光启技术	18,700	285,362.00	0.08
334	603596	伯特利	3,600	285,336.00	0.08
335	601966	玲珑轮胎	12,811	284,660.42	0.08
336	002624	完美世界	16,850	284,596.50	0.08
337	002939	长城证券	35,000	284,550.00	0.08
338	600153	建发股份	26,048	284,183.68	0.08
339	002372	伟星新材	13,800	283,452.00	0.08
340	000723	美锦能源	37,500	282,750.00	0.08
341	601155	新城控股	19,600	282,436.00	0.08
342	600383	金地集团	39,159	282,336.39	0.08
343	000975	银泰黄金	24,080	281,736.00	0.08
344	300144	宋城演艺	22,720	281,728.00	0.08
345	300487	蓝晓科技	4,500	280,890.00	0.08
346	600109	国金证券	32,300	280,041.00	0.08
347	600606	绿地控股	101,600	279,400.00	0.08
348	601233	桐昆股份	21,000	278,250.00	0.08
349	000738	航发控制	11,400	278,160.00	0.08

350	000783	长江证券	47,900	277,820.00	0.08
351	002850	科达利	2,100	277,725.00	0.08
352	688301	奕瑞科技	980	276,781.40	0.08
353	002153	石基信息	19,711	275,954.00	0.08
354	603233	大参林	9,838	275,562.38	0.08
355	601077	渝农商行	76,700	275,353.00	0.08
356	688516	奥特维	1,459	274,875.60	0.08
357	600563	法拉电子	2,000	274,600.00	0.08
358	688220	翱捷科技	3,631	273,741.09	0.08
359	600157	永泰能源	192,700	273,634.00	0.08
360	600298	安琪酵母	7,536	272,878.56	0.08
361	000027	深圳能源	41,240	271,771.60	0.08
362	600096	云天化	15,900	271,413.00	0.08
363	600763	通策医疗	2,800	271,208.00	0.08
364	688187	时代电气	6,474	271,001.64	0.08
365	601577	长沙银行	34,900	270,824.00	0.08
366	603816	顾家家居	7,090	270,483.50	0.08
367	000009	中国宝安	22,400	270,368.00	0.08
368	000021	深科技	13,500	269,865.00	0.08
369	000032	深桑达 A	8,200	269,780.00	0.08
370	688536	思瑞浦	1,236	269,448.00	0.08
371	603156	养元饮品	10,900	269,230.00	0.08
372	603658	安图生物	5,200	268,996.00	0.08
373	603185	弘元绿能	3,600	268,380.00	0.08
374	300769	德方纳米	2,420	266,756.60	0.08
375	000630	铜陵有色	91,300	263,857.00	0.08
376	600352	浙江龙盛	28,200	263,670.00	0.08
377	688180	君实生物	6,841	263,652.14	0.08
378	600021	上海电力	24,400	262,788.00	0.08
379	300207	欣旺达	16,100	262,752.00	0.08
380	601990	南京证券	32,000	261,760.00	0.08
381	603589	口子窖	5,300	261,555.00	0.08
382	000799	酒鬼酒	2,900	261,435.00	0.08
383	688169	石头科技	813	260,712.84	0.08
384	002078	太阳纸业	24,200	258,698.00	0.08
385	300390	天华新能	7,210	258,118.00	0.08
386	002128	电投能源	19,500	257,790.00	0.07
387	603568	伟明环保	14,700	257,397.00	0.07
388	688032	禾迈股份	724	257,128.60	0.07
389	601696	中银证券	24,100	256,906.00	0.07
390	002056	横店东磁	14,100	256,761.00	0.07
391	300604	长川科技	5,400	256,446.00	0.07
392	002185	华天科技	27,800	255,760.00	0.07

393	000933	神火股份	19,600	254,800.00	0.07
394	601880	辽港股份	163,300	254,748.00	0.07
395	600779	水井坊	4,293	253,244.07	0.07
396	600177	雅戈尔	40,120	253,157.20	0.07
397	600511	国药股份	6,500	252,525.00	0.07
398	002152	广电运通	21,500	251,980.00	0.07
399	002240	盛新锂能	7,900	251,773.00	0.07
400	000831	中国稀土	8,500	251,600.00	0.07
401	002607	中公教育	53,500	251,450.00	0.07
402	300118	东方日升	9,800	251,174.00	0.07
403	603338	浙江鼎力	4,480	250,924.80	0.07
404	600998	九州通	24,138	250,552.44	0.07
405	600872	中炬高新	6,783	249,546.57	0.07
406	600848	上海临港	20,840	249,038.00	0.07
407	600546	山煤国际	17,200	248,884.00	0.07
408	600985	淮北矿业	21,500	247,680.00	0.07
409	600348	华阳股份	31,300	247,583.00	0.07
410	000728	国元证券	37,810	246,521.20	0.07
411	002673	西部证券	38,816	246,481.60	0.07
412	601933	永辉超市	78,700	246,331.00	0.07
413	600378	昊华科技	6,500	244,660.00	0.07
414	300601	康泰生物	9,600	243,744.00	0.07
415	002532	天山铝业	40,400	241,996.00	0.07
416	002044	美年健康	33,928	241,228.08	0.07
417	002120	韵达股份	25,185	240,768.60	0.07
418	688390	固德威	1,439	240,111.54	0.07
419	002405	四维图新	20,700	239,706.00	0.07
420	002244	滨江集团	27,000	238,140.00	0.07
421	601231	环旭电子	15,900	237,864.00	0.07
422	002531	天顺风能	15,600	237,588.00	0.07
423	601991	大唐发电	71,700	237,327.00	0.07
424	002739	万达电影	18,900	237,006.00	0.07
425	002385	大北农	35,900	236,940.00	0.07
426	600486	扬农化工	2,700	236,034.00	0.07
427	600521	华海药业	12,810	235,832.10	0.07
428	002032	苏泊尔	4,700	235,000.00	0.07
429	600549	厦门钨业	12,300	234,069.00	0.07
430	600566	济川药业	8,000	232,320.00	0.07
431	600655	豫园股份	33,800	231,868.00	0.07
432	300595	欧普康视	7,670	231,557.30	0.07
433	688385	复旦微电	4,604	230,660.40	0.07
434	688188	柏楚电子	1,222	230,420.32	0.07
435	603613	国联股份	6,231	230,110.83	0.07

436	000987	越秀资本	36,226	230,035.10	0.07
437	000591	太阳能	33,900	229,842.00	0.07
438	688728	格科微	14,463	228,804.66	0.07
439	600873	梅花生物	25,500	227,715.00	0.07
440	300073	当升科技	4,500	226,485.00	0.07
441	600481	双良节能	16,200	226,476.00	0.07
442	300395	菲利华	4,600	226,320.00	0.07
443	301236	软通动力	8,300	225,843.00	0.07
444	603893	瑞芯微	3,100	225,835.00	0.07
445	000683	远兴能源	31,400	225,766.00	0.07
446	000800	一汽解放	26,900	225,153.00	0.07
447	601198	东兴证券	28,000	224,560.00	0.07
448	600583	海油工程	38,347	224,329.95	0.07
449	002353	杰瑞股份	8,900	223,657.00	0.07
450	600704	物产中大	45,100	222,794.00	0.06
451	000960	锡业股份	14,200	220,810.00	0.06
452	605358	立昂微	6,000	220,380.00	0.06
453	300699	光威复材	7,120	219,652.00	0.06
454	000519	中兵红箭	12,000	217,080.00	0.06
455	601168	西部矿业	20,600	216,506.00	0.06
456	300347	泰格医药	3,350	216,209.00	0.06
457	300676	华大基因	3,600	215,964.00	0.06
458	000703	恒逸石化	31,780	215,468.40	0.06
459	000513	丽珠集团	5,500	214,005.00	0.06
460	603456	九洲药业	7,800	213,564.00	0.06
461	600141	兴发集团	9,600	213,312.00	0.06
462	600380	健康元	16,700	212,257.00	0.06
463	601866	中远海发	85,900	212,173.00	0.06
464	688005	容百科技	3,907	211,056.14	0.06
465	600369	西南证券	57,600	210,240.00	0.06
466	002797	第一创业	36,500	208,780.00	0.06
467	002966	苏州银行	31,800	208,290.00	0.06
468	600699	均胜电子	11,800	208,152.00	0.06
469	600170	上海建工	77,200	207,668.00	0.06
470	002508	老板电器	8,200	207,378.00	0.06
471	600038	中直股份	5,200	207,064.00	0.06
472	300251	光线传媒	25,500	206,295.00	0.06
473	601016	节能风电	56,200	206,254.00	0.06
474	603529	爱玛科技	6,400	206,208.00	0.06
475	603517	绝味食品	5,548	206,108.20	0.06
476	002465	海格通信	19,900	205,766.00	0.06
477	600598	北大荒	15,400	205,282.00	0.06
478	002299	圣农发展	10,700	204,905.00	0.06

479	600516	方大炭素	32,987	204,519.40	0.06
480	002518	科士达	5,100	204,051.00	0.06
481	002268	电科网安	7,300	203,451.00	0.06
482	000709	河钢股份	89,700	202,722.00	0.06
483	603712	七一二	6,700	202,407.00	0.06
484	601636	旗滨集团	23,300	200,846.00	0.06
485	002145	中核钛白	33,615	197,992.35	0.06
486	600688	上海石化	63,547	197,631.17	0.06
487	300438	鹏辉能源	4,100	196,964.00	0.06
488	000050	深天马 A	21,400	196,452.00	0.06
489	603858	步长制药	9,540	196,428.60	0.06
490	002065	东华软件	27,800	196,268.00	0.06
491	300212	易华录	5,900	196,057.00	0.06
492	600392	盛和资源	15,200	195,624.00	0.06
493	000937	冀中能源	30,600	195,228.00	0.06
494	002831	裕同科技	8,000	195,120.00	0.06
495	600988	赤峰黄金	14,400	193,824.00	0.06
496	600559	老白干酒	7,900	193,629.00	0.06
497	002266	浙富控股	46,600	192,458.00	0.06
498	000825	太钢不锈	49,700	192,339.00	0.06
499	600499	科达制造	16,900	191,984.00	0.06
500	300568	星源材质	11,083	190,516.77	0.06
501	002926	华西证券	22,800	189,468.00	0.06
502	601456	国联证券	20,800	189,280.00	0.06
503	688779	长远锂科	16,737	188,625.99	0.05
504	603707	健友股份	13,949	188,311.50	0.05
505	600673	东阳光	26,100	188,181.00	0.05
506	603077	和邦生物	76,600	186,138.00	0.05
507	000155	川能动力	12,800	184,320.00	0.05
508	002407	多氟多	9,260	183,903.60	0.05
509	600258	首旅酒店	9,700	183,815.00	0.05
510	000893	亚钾国际	8,000	183,520.00	0.05
511	300373	扬杰科技	4,500	182,565.00	0.05
512	002507	涪陵榨菜	9,970	182,550.70	0.05
513	002791	坚朗五金	2,800	181,188.00	0.05
514	000739	普洛药业	10,200	180,948.00	0.05
515	002497	雅化集团	10,000	177,800.00	0.05
516	300558	贝达药业	3,700	177,711.00	0.05
517	002176	江特电机	14,800	176,416.00	0.05
518	000830	鲁西化工	16,600	175,296.00	0.05
519	000998	隆平高科	11,400	174,990.00	0.05
520	002541	鸿路钢构	6,070	174,876.70	0.05
521	002500	山西证券	31,120	173,649.60	0.05

522	688002	睿创微纳	3,876	173,644.80	0.05
523	002487	大金重工	5,600	172,704.00	0.05
524	000401	冀东水泥	23,100	170,247.00	0.05
525	603218	日月股份	8,900	169,011.00	0.05
526	600056	中国医药	12,900	167,442.00	0.05
527	002138	顺络电子	7,000	167,370.00	0.05
528	603127	昭衍新药	3,992	163,272.80	0.05
529	300529	健帆生物	7,000	162,260.00	0.05
530	601992	金隅集团	72,300	157,614.00	0.05
531	002408	齐翔腾达	24,700	157,339.00	0.05
532	300357	我武生物	4,600	154,698.00	0.05
533	002192	融捷股份	2,300	153,709.00	0.04
534	601666	平煤股份	20,000	150,800.00	0.04
535	002092	中泰化学	22,600	145,770.00	0.04
536	600801	华新水泥	11,800	145,730.00	0.04
537	600885	宏发股份	4,563	145,331.55	0.04
538	600338	西藏珠峰	7,900	144,254.00	0.04
539	300363	博腾股份	4,800	142,032.00	0.04
540	603866	桃李面包	13,830	139,959.60	0.04
541	002030	达安基因	12,128	120,916.16	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	301486	致尚科技	2,191	126,333.06	0.04
2	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.03
3	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.02
4	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.02
5	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.02
6	688249	晶合集成	2,283	41,230.98	0.01
7	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.01
8	301358	湖南裕能	580	24,876.20	0.01
9	688472	阿特斯	1,447	24,656.88	0.01
10	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.01
11	688361	中科飞测	362	23,410.54	0.01
12	688469	中芯集成	4,320	23,371.20	0.01
13	301325	曼恩斯特	200	21,590.00	0.01
14	301260	格力博	897	21,196.11	0.01
15	688443	智翔金泰	659	19,433.91	0.01
16	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.01
17	688478	晶升股份	402	17,032.74	0.00
18	688562	航天软件	723	16,130.13	0.00

19	688576	西山科技	132	15,894.12	0.00
20	688531	日联科技	116	15,772.52	0.00
21	688582	芯动联科	365	14,848.20	0.00
22	688146	中船特气	366	13,955.58	0.00
23	688352	硕中科技	1,122	13,542.54	0.00
24	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
25	688458	美芯晟	147	13,341.72	0.00
26	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
27	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
28	688620	安凯微	1,016	12,537.44	0.00
29	688334	西高院	720	11,671.20	0.00
30	688543	国科军工	219	11,617.95	0.00
31	688512	慧智微	606	11,610.96	0.00
32	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
33	688507	索辰科技	93	11,356.23	0.00
34	688570	天玛智控	442	11,195.86	0.00
35	688433	华曙高科	352	11,088.00	0.00
36	001287	中电港	499	10,488.98	0.00
37	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
38	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
39	301322	绿通科技	176	9,370.24	0.00
40	301439	泓淋电力	551	9,311.90	0.00
41	301376	致欧科技	413	9,296.63	0.00
42	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00
43	601061	中信金属	1,180	8,944.40	0.00
44	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
45	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
46	301323	新莱福	220	8,659.20	0.00
47	688631	莱斯信息	285	8,512.95	0.00
48	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
49	688623	双元科技	95	8,245.05	0.00
50	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
51	301295	美硕科技	215	7,755.05	0.00
52	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
53	688479	友车科技	260	7,667.40	0.00
54	301345	涛涛车业	153	7,135.92	0.00
55	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
56	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
57	601133	柏诚股份	391	4,793.66	0.00
58	601065	江盐集团	403	4,771.52	0.00
59	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
60	603125	常青科技	128	3,139.84	0.00
61	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00

62	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
63	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
64	603172	万丰股份	122	1,967.86	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	3,597,933.92	0.84
2	000858	五粮液	1,808,203.00	0.42
3	601816	京沪高铁	1,624,049.00	0.38
4	300760	迈瑞医疗	1,441,429.00	0.34
5	002594	比亚迪	1,139,180.00	0.27
6	000568	泸州老窖	1,059,917.00	0.25
7	600519	贵州茅台	889,188.00	0.21
8	688256	寒武纪	879,280.59	0.21
9	600886	国投电力	845,670.00	0.20
10	600703	三安光电	843,132.00	0.20
11	688223	晶科能源	728,964.11	0.17
12	002304	洋河股份	722,155.00	0.17
13	002352	顺丰控股	710,107.00	0.17
14	300059	东方财富	703,266.02	0.16
15	000001	平安银行	680,567.09	0.16
16	688303	大全能源	664,958.06	0.16
17	600221	海航控股	628,654.00	0.15
18	002812	恩捷股份	625,539.00	0.15
19	002714	牧原股份	602,872.01	0.14
20	300418	昆仑万维	592,575.00	0.14

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	600519	贵州茅台	7,392,467.96	1.73
2	300750	宁德时代	6,467,750.00	1.51
3	000858	五粮液	3,766,447.62	0.88
4	300760	迈瑞医疗	2,511,960.58	0.59
5	002594	比亚迪	2,457,971.00	0.57
6	600036	招商银行	2,276,218.00	0.53

7	000568	泸州老窖	1,988,157.00	0.46
8	300124	汇川技术	1,710,676.58	0.40
9	601318	中国平安	1,566,966.00	0.37
10	300059	东方财富	1,481,050.00	0.35
11	002352	顺丰控股	1,457,521.00	0.34
12	000001	平安银行	1,409,346.00	0.33
13	002304	洋河股份	1,397,250.36	0.33
14	002714	牧原股份	1,243,740.00	0.29
15	600900	长江电力	1,185,511.00	0.28
16	601888	中国中免	1,131,427.00	0.26
17	300015	爱尔眼科	1,106,414.73	0.26
18	600809	山西汾酒	1,103,677.00	0.26
19	002142	宁波银行	1,052,182.10	0.25
20	002475	立讯精密	1,049,910.00	0.25

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	80,804,820.97
卖出股票收入（成交）总额	164,427,644.09

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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，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、中国人民银行的处罚；中国平安保险(集团)股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局的处罚；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。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	352,788.83
2	应收清算款	193,339.16
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	546,127.99

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	301486	致尚科技	126,333.06	0.04	新股未上市
2	301488	豪恩汽电	93,721.68	0.03	新股未上市
3	301488	豪恩汽电	10,422.36	0.00	新股锁定期
4	301202	朗威股份	71,108.28	0.02	新股未上市
5	301202	朗威股份	7,900.92	0.00	新股锁定期
6	688603	天承科技	76,505.00	0.02	新股未上市
7	301261	恒工精密	72,803.70	0.02	新股未上市

§ 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

3,251	94,056.53	73,200,97 1.00	23.94%	107,274,2 04.00	35.08%	125,302,6 00.00	40.98%
-------	-----------	-------------------	--------	--------------------	--------	--------------------	--------

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(FO	50,277,900.00	16.44%
2	招商证券股份有限公司	5,408,089.00	1.77%
3	中信证券股份有限公司	3,477,881.00	1.14%
4	方正证券股份有限公司	3,161,401.00	1.03%
5	吴美兰	3,000,000.00	0.98%
6	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	2,602,400.00	0.85%
7	广发证券股份有限公司	2,361,500.00	0.77%
8	刘曙峰	2,258,800.00	0.74%
9	余开胜	2,000,000.00	0.65%
10	周诣鑫	1,922,600.00	0.63%
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	125,302,600.00	40.98%

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	303,777,775.00
本报告期基金总申购份额	82,000,000.00

减：报告期基金总赎回份额	80,000,000.00
本报告期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	305,777,775.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，权益登记日为 2023 年 3 月 31 日。2023 年 5 月 5 日，在本基金的基金托管人中国银行股份有限公司授权代表的监督下，基金管理人对本次大会表决进行了计票，北京金诚同达（深圳）律师事务所对计票过程进行了见证，深圳市深圳公证处对计票过程及结果进行了公证。

根据计票结果，本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一），因此未达到《中华人民共和国证券投资基金法》和《MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》规定的关于以通讯方式召开基金份额持有人大会的有效开会条件。

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

本报告期内，本基金的基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人主营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中泰证券	2	150,732,151.86	63.53%	15,073.65	63.52%	-
安信证券	1	79,867,497.22	33.66%	7,988.14	33.66%	-
华泰证券	2	6,670,167.91	2.81%	667.02	2.81%	-
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：

无

退租交易单元：

无

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
中泰证券	192,251.59	98.62%	-	-	-	-
安信证券	1,220.24	0.63%	-	-	-	-
华泰证券	1,472.40	0.76%	-	-	-	-
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	MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金分红公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-01-12
2	关于南方基金管理股份有限公司旗下上交所 ETF 申购赎回清单版本更新的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-02-08
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	2023-02-16
4	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-01
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	2023-03-18
6	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-22
7	南方基金管理股份有限公司关于以通讯方式召开 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-31
8	南方基金管理股份有限公司关于以通讯方式召开 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-04-01

	性公告		
9	南方基金管理股份有限公司关于以通讯方式召开 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-04-03
10	南方基金关于旗下部分基金增加华宝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	2023-04-07
11	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-04-15
12	南方基金关于旗下部分基金增加东海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	2023-04-26
13	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	2023-04-29
14	关于 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会会议情况的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-05-06
15	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-05-10
16	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-06-03
17	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-06-15
18	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-06-21
19	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金参与浙商银行股份有限公司配股的关联交易公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-06-28

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

		达到或者超过 20% 的时间区间					
联接基金	1	20230101-20230630	104,596,100.00	59,596,200.00	38,889,700.00	125,302,600.00	40.98%

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 2023 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>