

招商 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金 2020 年中期报告

2020 年 06 月 30 日

基金管理人：招商基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2020 年 8 月 28 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 2020 年 8 月 27 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 2020 年 2 月 3 日（合同生效日）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.....	5
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.....	6
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.....	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	8
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.....	9
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.....	10
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 半年度财务会计报告（未经审计）.....	11
6.1 资产负债表.....	11
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	15
§7 投资组合报告.....	35
7.1 期末基金资产组合情况.....	35
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	36
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.....	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	53
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	53
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	54
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.....	54
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.....	54
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	54

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54
7.12 投资组合报告附注	55
§8 基金份额持有人信息	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
8.2 期末上市基金前十名持有人	56
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	57
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	57
§9 开放式基金份额变动	57
§10 重大事件揭示	57
10.1 基金份额持有人大会决议	57
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	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
10.4 基金投资策略的改变	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	58
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	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	58
10.8 其他重大事件	61
§11 备查文件目录	62
11.1 备查文件目录	62
11.2 存放地点	62
11.3 查阅方式	62

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	招商 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	招商 MSCI 中国 A 股国际通 ETF
场内简称	MSCICHNA
基金主代码	515160
交易代码	515160
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020 年 2 月 3 日
基金管理人	招商基金管理有限公司
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	77,955,051.00 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	2020 年 3 月 2 日

注：本基金自 2020 年 3 月 16 日起新增扩位证券简称，扩位证券简称为“MSCI 中国招商 ETF”。

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	<p>1、股票投资策略： 本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。</p> <p>2、债券投资策略： 本基金管理人将基于对国内外宏观经济形势的深入分析、国内财政政策与货币市场政策等因素对债券市场的影响，进行合理的利率预期，判断债券市场的基本走势，制定久期控制下的资产类属配置策略。</p> <p>3、资产支持证券投资策略： 本基金将在宏观经济和基本面分析的基础上，对资产支持证券标的资产的质量和构成、利率风险、信用风险、流动性风险和提前偿付风险等进行分析，评估其相对投资价值并作出相应的投资决策。</p> <p>4、股指期货投资策略： 本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，有选择地投资于流动性好、交易活跃的股指期货合约。</p> <p>5、国债期货投资策略： 本基金参与国债期货投资是为了有效控制债券市场的系统性风险，本基金将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，适度运用国债期货提</p>

	高投资组合运作效率。 6、融资及转融通投资策略： 在条件许可的情况下，基金管理人可在不改变本基金既有投资目标、策略和风险收益特征并在控制风险的前提下，根据相关法律法规，参与融资及转融通证券出借业务，以提高投资效率及进行风险管理。届时基金参与融资及转融通证券出借业务的风险控制原则、具体参与比例限制、费用收支、信息披露、估值方法及其他相关事项按照中国证监会的规定及其他相关法律法规的要求执行。
业绩比较基准	MSCI 中国 A 股国际通指数 (MSCI China A Inclusion RMB Index) 收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金、货币市场基金。 本基金为被动式投资的股票型指数基金，主要采用完全复制策略，跟踪 MSCI 中国 A 股国际通指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

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	招商基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	潘西里
	联系电话	0755-83196666
	电子邮箱	cmf@cmfchina.com
客户服务电话	400-887-9555	95566
传真	0755-83196475	010-66594942
注册地址	深圳市福田区深南大道 7088 号	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址	中国深圳深南大道 7088 号招商银行大厦	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	518040	100818
法定代表人	刘辉	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	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.cmfchina.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

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(2020 年 2 月 3 日 - 2020 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	18,603,483.83
本期利润	22,663,202.03
加权平均基金份额本期利润	0.0811
本期加权平均净值利润率	8.09%
本期基金份额净值增长率	10.70%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	5,964,150.54
期末可供分配基金份额利润	0.0765
期末基金资产净值	86,297,067.46
期末基金份额净值	1.1070
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	10.70%

注：1、基金业绩指标不包括持有人认（申）购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

3、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；

4、本基金合同于 2020 年 2 月 3 日生效，截至本报告期末成立未满半年。

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	10.38%	0.84%	8.40%	0.87%	1.98%	-0.03%
过去三个月	17.25%	0.89%	14.49%	0.92%	2.76%	-0.03%
自基金合同生效起至今	10.70%	1.26%	7.17%	1.58%	3.53%	-0.32%

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

MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金 2020 年中期报告



注：本基金合同于 2020 年 2 月 3 日生效，截至本报告期末基金成立未满一年；自基金成立之日起 6 个月内为建仓期，截至报告期末基金尚未完成建仓。

§ 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

招商基金管理有限公司于 2002 年 12 月 27 日经中国证监会【2002】100 号文批准设立。目前，公司注册资本为人民币 13.1 亿元，招商银行股份有限公司持有公司全部股权的 55%，招商证券股份有限公司持有公司全部股权的 45%。

招商基金管理有限公司首批获得企业年金基金投资管理人资格、基本养老保险基金投资管理资格；2004 年获得全国社保基金投资管理人资格；同时拥有 QDII (合格境内机构投资者) 资格、专户理财（特定客户资产管理计划）资格。

2020 年半年度公司获奖情况：

金牛奖·固定收益投资金牛基金公司·《中国证券报》·2020 年 3 月

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		
白海峰	本基金基金经理	2020 年 2 月 3 日	-	10	男，硕士。曾任职于新东方教育科技集团；2010 年 6 月加入国泰基金管理有限

	理			公司，历任管理培训生、宏观经济研究高级经理、首席经济学家助理、国际业务部负责人；2015 年加入招商基金管理有限公司，曾任招商全球资源股票型证券投资基金、招商中国信用机会定期开放债券型证券投资基金(QDII)基金经理，现任招商资产管理（香港）有限公司执行董事兼总经理兼招商标普金砖四国指数证券投资基金(LOF)、招商沪港深科技创新主题精选灵活配置混合型证券投资基金、招商 MSCI 中国 A 股国际通指数型证券投资基金、招商普盛全球配置证券投资基金（QDII）、招商 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金经理。
--	---	--	--	---

注：1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告（生效）日期；

2、证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

基金管理人声明：在本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关法律法规及其各项实施准则的规定以及本基金的基金合同等基金法律文件的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的前提下，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围以及投资运作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

基金管理人已建立较完善的研究方法和投资决策流程，确保各投资组合享有公平的投资决策机会。基金管理人建立了所有组合适用的投资对象备选库，制定明确的备选库建立、维护程序。基金管理人拥有健全的投资授权制度，明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限划分，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。基金管理人的相关研究成果向内部所有投资组合开放，在投资研究层面不存在各投资组合间不公平的问题。

基金管理人按照法规要求，对连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合间的同向交易的交易价差进行分析，相关投资组合经理也对分析中发现的价格差异次数占比超过正常范围的情况进行了合理性解释。根据分析结果，公司旗下组合的同向交易情况基本正常，没有发现有明显异常并且无合理理由的同向交易异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

基金管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。确因投资组合的投资策略或流动性等需要而发生的同日反向交易，基金管理人要求相关投资组合经理提供决策依据，并留存记录备查，完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合等除外。

本报告期内，本基金各项交易均严格按照相关法律法规、基金合同的有关要求执行，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易不存在成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形。报告期内亦未发现其他有可能导致不公平交易和利益输送的重大异常交易行为。

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

回顾 2020 年上半年的基金操作，我们严格遵照基金合同的相关约定，按照既定的投资流程进行规范运作。本基金作为交易型开放式指数基金，实现了对业绩基准指数的良好跟踪。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金份额净值增长率为 10.70%，同期业绩基准增长率为 7.17%。

4. 5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2020 年下半年，新冠疫情和经济恢复两股力量之间的强弱将会对市场产生重要的影响，其中新冠疫苗的研发进展是关键的影响因素。我们对此将予以密切关注。全球各国央行采取的宽松货币政策仍将继续维持，各国政府也会出台史无前例的积极财政政策，“宽货币+宽财政”的组合对投资者保持风险偏好至关重要。另一个重要的关注焦点在于下半年美国的大选以及在竞选过程中中美冲突升级的风险。从 VIX 市场恐慌指数期货的表现来看，目前市场对大选产生的冲击预期偏低，只有 10% 左右的上升。需要警惕超预期事件对市场造成的冲击。

市场大涨之后，成长和价值之间的估值分化达到了历史极值，但我们并不认为必然会出现均值回归，更加关注其中的结构性机会。成长股中的受益于新经济、关键技术国产化

幅度提升等趋势的优质标的有望继续保持业绩高增长和高估值状态。价值股中受益于经济复苏的行业和个股，也将在盈利回升预期和宽松流动性的带动下迎来估值修复。虽然 MSCI 指数纳入 A 股的权重短期内不会进一步提升，但是海外投资者对于 A 股资产的配置趋势已经势不可挡，富时罗素指数也将 A 股纳入其中，顺应全球机构投资者的配置需求。北上资金持续大幅流入，反映不只是被动配置资金在配置 A 股，主动投资资金也在大幅度流入 A 股。后续这一趋势也有望继续维持。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金的估值业务严格按照相关的法律法规、基金合同以及《招商基金管理有限公司基金估值委员会管理制度》进行。基金核算部负责日常的基金资产的估值业务，执行基金估值政策。另外，公司设立由投资和研究部门、风险管理部、基金核算部、法律合规部负责人和基金经理代表组成的估值委员会。公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历。公司估值委员会主要负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，定期评价现有估值政策和程序的适用性及对估值程序执行情况进行监督。

投资和研究部门以及基金核算部共同负责关注相关投资品种的动态，评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种；投资和研究部门定期审核公允价值的确认和计量；研究部提出合理的数量分析模型对需要进行估值测算或者调整的投资品种进行公允价值定价与计量并定期对估值政策和程序进行评价，以保证其持续适用；基金核算部定期审核估值政策和程序的一致性，并负责与托管行沟通估值调整事项；风险管理部负责估值委员会工作流程中的风险控制；法律合规部负责日常的基金估值调整结果的事后复核监督工作；法律合规部与基金核算部共同负责估值调整事项的信息披露工作。

基金经理代表向估值委员会提供估值参考信息，参与估值政策讨论；对需采用特别估值程序的证券，基金及时启动特别估值程序，由公司估值委员会集体讨论议定特别估值方案，咨询会计事务所的专业意见，并与托管行沟通后由基金核算部具体执行。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。截止报告期末本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供相关债券品种、流通受限股票的估值参考数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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，本基金未发生连续二十个工作日出现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”）在招商 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”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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：招商 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：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日
资产：		

银行存款	6.4.7.1	2,076,360.82
结算备付金		381,347.32
存出保证金		390,330.55
交易性金融资产	6.4.7.2	83,491,704.20
其中：股票投资		83,462,936.07
基金投资		-
债券投资		28,768.13
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
应收证券清算款		3,363,511.80
应收利息	6.4.7.5	963.31
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		89,704,218.00
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		3,221,258.35
应付赎回款		-
应付管理人报酬		51,916.01
应付托管费		10,383.19
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	30,263.87
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-

递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	93,329.12
负债合计		3,407,150.54
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	77,955,051.00
未分配利润	6.4.7.10	8,342,016.46
所有者权益合计		86,297,067.46
负债和所有者权益总计		89,704,218.00

注：1. 报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.1070 元，基金份额总额 77,955,051.00 份；

2. 本财务报表的实际编制期间为 2020 年 2 月 3 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日止期间。

6.2 利润表

会计主体：招商 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：2020 年 2 月 3 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 2 月 3 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		24,121,503.07
1. 利息收入		476,915.04
其中：存款利息收入	6.4.7.11	476,911.42
债券利息收入		3.62
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
证券出借利息收入		-
2. 投资收益(损失以“-”填列)		18,965,186.22
其中：股票投资收益	6.4.7.12	17,827,983.52

基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-
股利收益	6.4.7.17	1,137,202.70
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.18	4,059,718.20
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.19	619,683.61
减: 二、费用		1,458,301.04
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	549,397.29
2. 托管费	6.4.10.2.2	109,879.47
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
4. 交易费用	6.4.7.20	700,376.58
5. 利息支出		-
其中: 卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	6.4.7.21	98,647.70
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		22,663,202.03
减: 所得税费用		-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		22,663,202.03

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 招商 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: 2020 年 2 月 3 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2020 年 2 月 3 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 （基金净值）	507,955,051.00	-	507,955,051.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 （本期利润）	-	22,663,202.03	22,663,202.03
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以 “-”号填列）	-430,000,000.00	-14,321,185.57	-444,321,185.57
其中：1. 基金申购款	24,000,000.00	285,885.76	24,285,885.76
2. 基金赎回款	-454,000,000.00	-14,607,071.33	-468,607,071.33
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益 （基金净值）	77,955,051.00	8,342,016.46	86,297,067.46

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：

____王小青____ ____欧志明____ ____何剑萍____
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

招商 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）系由基金管理人招商基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《招商 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》及其他有关法律法规的规定，经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2019]2081 号文准予公开募集注册。本基金为交易型开放式基金，存续期限为不定期。本基金首次设立募集基金份额为 507,955,051.00 份，经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）验证，并出具了编号为德师报（验）字（20）第 00037 号验资报告。《招商 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》(以下简称“基金合同”)于 2020 年 2 月 3 日正式生效。本基金的基金管理人为招商基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及截至报告期末最新公告的《招商 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围为:本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股。为更好地实现基金的投资目标,本基金可能会少量投资于国内依法发行上市的非成份股(包括中小板、创业板及其他中国证监会允许投资的股票)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、货币市场工具、同业存单、债券回购、资产支持证券、银行存款、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金将根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。本基金的投资组合为:投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%,且不低于非现金基金资产的 80%;股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为 MSCI 中国 A 股国际通指数(MSCI China A Inclusion RMB Index)收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)以及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 2 月 3 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度,即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为自 2020 年 2 月 3 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日止期间。

6.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1) 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和贷款及应收款项，暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表以衍生金融资产列示外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的各类应收款项、买入返售金融资产等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分类为贷款及应收款项。

2) 金融负债的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无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。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价(包括转出的非现金资产或承担的新金融负债)之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层次的输入值确定公允价值计量层次。第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值是

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；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

1) 对于银行间市场交易的固定收益品种，以及交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和私募债券除外），按照第三方估值机构提供的估值确定公允价值。

2) 对存在活跃市场的其他投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值。

3) 对存在活跃市场的其他投资品种，如估值日无市价且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

4) 当投资品种不再存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配（未分配利润）已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配（未分配利润）。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

-利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。

资产支持证券利息收入在持有期内，按资产支持证券的票面价值和预计收益率计算的利息逐日确认资产支持证券利息收入。在收到资产支持证券支付的款项时，其中属于证券投资收益的部分冲减应计利息(若有)后的差额，确认资产支持证券利息收入。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

-投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

债券投资收益为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。

资产支持证券投资收益为卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额确认，由上市公司代扣代缴的个人所得税于卖出交易日按实际代扣代缴金额确认。

-公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产/负债的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产/负债卖出或到期时转出计入投资收益。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬、基金托管费和销售服务费按基金合同及相关公告约定的费率和计算方法逐日计提。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的交易费用发生时按照确定的金额计入交易费用。

卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率逐日计提。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

- 1) 每一基金份额享有同等分配权；
- 2) 本基金场内份额的收益分配方式为现金分红；
- 3) 当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，可进行收益分配；
- 4) 本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值；
- 5) 若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；
- 6) 法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。证券交易所或基金登记机构对场内份额收益分配另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 外币交易

本基金本报告期内无外币交易。

6.4.4.13 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策与计量基础一致。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

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

1) 对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》（中基协发[2017]6 号），在估值日按照该通知规定的流通受限股票公允价值计算模型进行估值。

2) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，根据《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（中国证监会公告[2017]13 号）及《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》（中基协发[2013]13 号）相关规定，本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

3) 根据《关于发布〈中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准〉的通知》（中基协发[2014]24 号），在上海证券交易所、深圳证券

交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税；2018 年 1 月 1 日起，公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。

(2) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。

(3) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在收到相关扣收税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4)对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
活期存款	2,076,360.82
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	2,076,360.82

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	79,406,186.15	83,462,936.07	4,056,749.92
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	28,768.13	2,968.28
	银行间市场	-	-
	合计	28,768.13	2,968.28
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	79,431,986.00	83,491,704.20	4,059,718.20

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	646.97
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	154.44
应收债券利息	3.77
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	158.13
合计	963.31

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	30,263.87
银行间市场应付交易费用	-
合计	30,263.87

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	27,464.64
应付指数使用费	65,864.48
应退替代款	-
应付证券出借违约金	-
合计	93,329.12

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 2 月 3 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	507,955,051.00	507,955,051.00

本期申购	24,000,000.00	24,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-454,000,000.00	-454,000,000.00
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	77,955,051.00	77,955,051.00

1、本期申购含红利再投、转换入份（金）额，本期赎回含转换出份（金）额；

2、本基金自 2019 年 12 月 09 日至 2020 年 1 月 17 日止期间公开发售，有效净认购金额人民币 507,955,051.00 元，折算为 507,955,051.00 份基金份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	18,603,483.83	4,059,718.20	22,663,202.03
本期基金份额交易产生的变动数	-12,639,333.29	-1,681,852.28	-14,321,185.57
其中：基金申购款	660,845.11	-374,959.35	285,885.76
基金赎回款	-13,300,178.40	-1,306,892.93	-14,607,071.33
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,964,150.54	2,377,865.92	8,342,016.46

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 2 月 3 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	315,722.85
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	9,910.94
其他	151,277.63
合计	476,911.42

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 2 月 3 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	15,136,259.16
股票投资收益——赎回差价收入	2,691,724.36
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	17,827,983.52

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 2 月 3 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	381,916,301.61
减：卖出股票成本总额	366,780,042.45
买卖股票差价收入	15,136,259.16

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 2 月 3 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	468,607,071.33
减：现金支付赎回款总额	189,094,434.33
减：赎回股票成本总额	276,820,912.64
赎回差价收入	2,691,724.36

6.4.7.12.4 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。

6.4.7.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内无证券出借差价收入。

6.4.7.13 债券投资收益**6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期内无买卖债券差价收入。

6.4.7.13.3 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。

6.4.7.13.4 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。

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.15 贵金属投资收益**6.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成**

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

6.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无贵金属赎回差价收入。

6.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无贵金属申购差价收入。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 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。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具其他投资收益。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 2 月 3 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,137,202.70
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	1,137,202.70

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020 年 2 月 3 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	4,059,718.20
——股票投资	4,056,749.92
——债券投资	2,968.28
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产	-

生的预估增值税	
合计	4,059,718.20

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 2 月 3 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	619,683.61
合计	619,683.61

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 2 月 3 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	700,376.58
银行间市场交易费用	-
合计	700,376.58

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 2 月 3 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
审计费用	17,897.88
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行费用	5,318.58
指数使用费	65,864.48
其他费用	9,566.76
合计	98,647.70

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
招商基金管理有限公司	基金管理人
中国银行股份有限公司	基金托管人
招商证券股份有限公司(以下简称“招商证券”)	基金管理人的股东

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 2 月 3 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
招商证券	693,645,972.51	63.55%

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 2 月 3 日（基金合同生效日）至 2020 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
招商证券	160,447.29	75.44%	26,859.84	88.75%

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 2 月 3 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	549,397.29
其中：支付销售机构的客户维护费	0.00

支付基金管理人招商基金管理有限公司的基金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：

日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×0.50%÷当年天数

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 2 月 3 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	109,879.47

支付基金托管人中国银行的基金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：

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%÷当年天数

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期内无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期内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。

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

本基金本报告期内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。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2020 年 6 月 30 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
招商证券股份有限公司	1,452,873.00	1.86%

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 2 月 3 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入

中国银行	2,076,360.82	315,722.85
------	--------------	------------

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。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2020 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002500	山西证券	2020年6月29日	2020年7月10日	配股未上市	5.00	6.54	3,210	16,050.00	20,993.40	-
300840	酷特智能	2020年6月30日	2020年7月8日	新股锁定	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-
300843	胜蓝股份	2020年6月23日	2020年7月2日	新股锁定	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-
300845	捷安高科	2020年6月24日	2020年7月3日	新股锁定	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-
300846	首都在线	2020年6月22日	2020年7月1日	新股锁定	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-
300847	中船汉光	2020年6月29日	2020年7月9日	新股锁定	6.94	6.94	1,421	9,861.74	9,861.74	-
688027	国盾量子	2020年6月30日	2021年1月9日	新股锁定	36.18	36.18	1,367	49,458.06	49,458.06	-
688277	天智航	2020年6月24日	2021年1月7日	新股锁定	12.04	12.04	5,976	71,951.04	71,951.04	-
688377	迪威尔	2020年6月29日	2021年1月8日	新股锁定	16.42	16.42	3,216	52,806.72	52,806.72	-

688568	中科星图	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 8 日	新股锁 定	16.21	16.21	4,683	75,911.43	75,911.43	-
688599	天合光能	2020 年 6 月 2 日	2020 年 12 月 10 日	新股锁 定	8.16	13.91	20,212	164,929.92	281,148.92	-
688600	皖仪科技	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 3 日	新股锁 定	15.50	15.50	3,372	52,266.00	52,266.00	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认 购日	可流通 日	流通受 限类型	认购 价格	期末 估值 单价	数量（单 位：张）	期末成本 总额	期末估值 总额	备注
128112	歌尔转 2	2020 年 6 月 12 日	2020 年 7 月 13 日	新债未 上市	100.0 0	100.0 0	168	16,799.93	16,799.93	-

6.4.12.1.3 受限证券类别：资产支持证券

证券代码	证券名称	成功认 购日	可流通 日	流通受 限类型	认购 价格	期末 估值 单价	数量（单 位：份）	期末成本 总额	期末估值 总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

以上“可流通日”中，部分证券的日期是根据上市公司公告估算的流通日期。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金为指数型基金，本基金的运作涉及的金融工具主要包括股票投资等。与这些金融工具有关的风险，以及本基金的基金管理人管理这些风险所采取的风险管理政策如下所述。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人从事风险管理的目标是提升本基金风险调整后收益水平，保证本基金的基金资产安全，维护基金份额持有人利益。基于该风险管理目标，本基金的基金管理人风险管理的基本策略是识别和分析本基金运作使本基金面临各种类型的风险，确定适当的风险容忍度，并及时可靠地对各种风险进行监督，将风险控制在限定的范围之内。本基金目前面临的主要风险包括：市场风险、信用风险和流动性风险。与本基金相关的市场风险主要包括利率风险和市场价格风险。

本基金的基金管理人建立了以全面、独立、互相制约以及定性和定量相结合为原则的，监事会、董事会及下设风险控制委员会、督察长、风险管理委员会、法律合规部和风险管理部等多层次的风险管理组织架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指金融工具的一方到期无法履行约定义务致使本基金遭受损失的风险。本基金的信用风险主要存在于银行存款、结算备付金、存出保证金及其他。

本基金的银行存款存放于本基金的基金托管人中国银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在证券交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小。

对于与债券投资、资产支持证券投资相关的信用风险，本基金的基金管理人通过对投资品种的信用等级评估来选择适当的投资对象，并限制单个投资品种的持有比例来管理信用风险。附注 6.4.13.2.1 至 6.4.13.2.6 列示了于本报告期末及上年度末本基金所持有的债券投资的信用评级，该信用评级不包括本基金所持有的国债、央行票据、政策性金融债。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020 年 6 月 30 日
AAA	-
AAA 以下	28,768.13

未评级	-
合计	28,768.13

注：上述评级均由经中国证监会核准从事证券市场资信评级业务的评级机构做出。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

流动性风险是指没有足够资金以满足到期债务支付的风险。本基金流动性风险来源于开放式基金每日兑付赎回资金的流动性风险，因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险以及因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。本基金所持有的交易性金融资产在证券交易所交易，除附注 6.4.12 所披露的流通受限不能自由转让的基金资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种，本基金所持有的金融负债的合约到期日为一年以内且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息。

本基金申购赎回采用一篮子股票的形式，流动性风险相对较低。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的利率敏感性资产主要是银行存款、债券投资。本基金的基金管理人日常通过对利率水平的预测、分析收益率曲线及优化利率重新定价日组合等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 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	2,076,360.82	-	-	-	2,076,360.82
结算备付金	381,347.32	-	-	-	381,347.32

存出保证金	390,330.55	-	-	-	390,330.55
交易性金融资产	-	-	28,768.13	83,462,936.07	83,491,704.20
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	963.31	963.31
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	3,363,511.80	3,363,511.80
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	2,848,038.69	-	28,768.13	86,827,411.18	89,704,218.00
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	51,916.01	51,916.01
应付托管费	-	-	-	10,383.19	10,383.19
应付证券清算款	-	-	-	3,221,258.35	3,221,258.35
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	30,263.87	30,263.87
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	93,329.12	93,329.12
负债总计	-	-	-	3,407,150.54	3,407,150.54
利率敏感度缺口	2,848,038.69	-	28,768.13	83,420,260.64	86,297,067.46

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1.若市场利率平行上升或下降 50 个基点	
	2.其他市场变量保持不变	
	3.仅存在公允价值变动对基金资产净值的影响	
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（2020年6月30日）
	1. 市场利率平行上升 50 个基点	-824.47
2. 市场利率平行下降 50 个基点	853.30	

6.4.13.4.2 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险，该风险可能与特定投资品种相关，也有可能与整体投资品种相关。本基金所持有的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价

值变动均直接反映在当期损益中。本基金在构建资产配置和基金资产投资组合的基础上，通过建立事前和事后跟踪误差的方式，对基金资产的市场价格风险进行管理。

6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	83,462,936.07	96.72
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	83,462,936.07	96.72

6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1.若对市场价格敏感的权益性投资的市场价格上升或下降 5%	
	2.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（2020年6月30日）
	1. 权益性投资的市场价格上升 5%	4,173,146.80
	2. 权益性投资的市场价格下降 5%	-4,173,146.80

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无需要说明有助于理解和分析会计报表的其他事项。

§ 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	83,462,936.07	93.04
	其中：股票	83,462,936.07	93.04
2	固定收益投资	28,768.13	0.03
	其中：债券	28,768.13	0.03
	资产支持证券	-	-

3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	2,457,708.14	2.74
7	其他资产	3,754,805.66	4.19
8	合计	89,704,218.00	100.00

注：此处的股票投资项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

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	1,347,455.00	1.56
B	采矿业	2,039,406.00	2.36
C	制造业	42,596,731.30	49.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,012,659.80	2.33
E	建筑业	1,670,576.00	1.94
F	批发和零售业	1,361,179.00	1.58
G	交通运输、仓储和邮政业	2,205,329.00	2.56
H	住宿和餐饮业	88,076.00	0.10
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,599,269.20	5.33
J	金融业	17,807,419.20	20.64
K	房地产业	2,975,304.00	3.45
L	租赁和商务服务业	1,233,445.00	1.43
M	科学研究和技术服务业	769,504.00	0.89
N	水利、环境和公共设施管理业	66,584.00	0.08
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	119,325.00	0.14
Q	卫生和社会工作	1,051,984.00	1.22
R	文化、体育和娱乐业	729,563.00	0.85
S	综合	53,898.00	0.06
	合计	82,727,707.50	95.86

7.2.2 期末积极投资按行业分类境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	634,453.25	0.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,766.32	0.01
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	88,009.00	0.10
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	-	-
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	735,228.57	0.85

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	3,103	4,539,316.64	5.26
2	601318	中国平安	28,000	1,999,200.00	2.32
3	600036	招商银行	52,900	1,783,788.00	2.07
4	000858	五粮液	9,700	1,659,864.00	1.92
5	600276	恒瑞医药	13,380	1,234,974.00	1.43
6	600900	长江电力	56,400	1,068,216.00	1.24
7	300750	宁德时代	5,400	941,544.00	1.09
8	002475	立讯精密	17,669	907,303.15	1.05
9	603288	海天味业	6,840	850,896.00	0.99
10	601166	兴业银行	53,400	842,652.00	0.98
11	601888	中国中免	5,200	800,956.00	0.93

12	600000	浦发银行	75,300	796,674.00	0.92
13	002714	牧原股份	9,330	765,060.00	0.89
14	002415	海康威视	24,200	734,470.00	0.85
15	300760	迈瑞医疗	2,400	733,680.00	0.85
16	601398	工商银行	138,100	687,738.00	0.80
17	000002	万科 A	24,700	645,658.00	0.75
18	601288	农业银行	190,900	645,242.00	0.75
19	000001	平安银行	49,900	638,720.00	0.74
20	600030	中信证券	25,100	605,161.00	0.70
21	603259	药明康德	5,620	542,892.00	0.63
22	600585	海螺水泥	10,100	534,391.00	0.62
23	000661	长春高新	1,200	522,360.00	0.61
24	600016	民生银行	91,000	515,970.00	0.60
25	601328	交通银行	100,500	515,565.00	0.60
26	601668	中国建筑	107,400	512,298.00	0.59
27	600887	伊利股份	15,700	488,741.00	0.57
28	600048	保利地产	30,700	453,746.00	0.53
29	601601	中国太保	16,300	444,175.00	0.51
30	300015	爱尔眼科	10,220	444,059.00	0.51
31	000651	格力电器	7,700	435,589.00	0.50
32	300122	智飞生物	4,200	420,630.00	0.49
33	002352	顺丰控股	7,600	415,720.00	0.48
34	300059	东方财富	20,380	411,676.00	0.48
35	002304	洋河股份	3,900	410,046.00	0.48
36	002142	宁波银行	15,500	407,185.00	0.47
37	000725	京东方 A	86,900	405,823.00	0.47
38	600309	万华化学	8,100	404,919.00	0.47
39	600031	三一重工	21,500	403,340.00	0.47
40	000063	中兴通讯	9,700	389,261.00	0.45
41	601012	隆基股份	9,400	382,862.00	0.44
42	600588	用友网络	8,460	373,086.00	0.43
43	601818	光大银行	102,200	365,876.00	0.42
44	300498	温氏股份	16,600	361,880.00	0.42
45	601688	华泰证券	18,900	355,320.00	0.41
46	000568	泸州老窖	3,800	346,256.00	0.40
47	601766	中国中车	62,100	345,897.00	0.40
48	002594	比亚迪	4,800	344,640.00	0.40
49	603501	韦尔股份	1,700	343,315.00	0.40
50	600104	上汽集团	20,200	343,198.00	0.40
51	601211	国泰君安	19,300	333,118.00	0.39
52	000895	双汇发展	7,000	322,630.00	0.37
53	600999	招商证券	14,600	320,470.00	0.37
54	600050	中国联通	66,100	319,924.00	0.37

55	000876	新希望	10,700	318,860.00	0.37
56	601988	中国银行	90,000	313,200.00	0.36
57	603160	汇顶科技	1,400	312,060.00	0.36
58	603986	兆易创新	1,320	311,401.20	0.36
59	300601	康泰生物	1,900	308,104.00	0.36
60	600436	片仔癀	1,800	306,450.00	0.36
61	300413	芒果超媒	4,700	306,440.00	0.36
62	600809	山西汾酒	2,100	304,500.00	0.35
63	601229	上海银行	36,194	300,410.20	0.35
64	000538	云南白药	3,200	300,192.00	0.35
65	600690	海尔智家	16,400	290,280.00	0.34
66	000166	申万宏源	57,400	289,870.00	0.34
67	600745	闻泰科技	2,200	277,090.00	0.32
68	600570	恒生电子	2,570	276,789.00	0.32
69	601066	中信建投	7,000	275,660.00	0.32
70	001979	招商蛇口	16,600	272,904.00	0.32
71	601006	大秦铁路	38,200	268,928.00	0.31
72	002555	三七互娱	5,700	266,760.00	0.31
73	601169	北京银行	53,900	264,110.00	0.31
74	601390	中国中铁	52,100	261,542.00	0.30
75	600837	海通证券	20,500	257,890.00	0.30
76	600703	三安光电	10,300	257,500.00	0.30
77	002371	北方华创	1,500	256,365.00	0.30
78	600028	中国石化	65,000	254,150.00	0.29
79	601336	新华保险	5,600	247,968.00	0.29
80	002241	歌尔股份	8,400	246,624.00	0.29
81	601186	中国铁建	29,400	246,372.00	0.29
82	600406	国电南瑞	11,900	240,975.00	0.28
83	002007	华兰生物	4,790	240,026.90	0.28
84	600547	山东黄金	6,500	238,030.00	0.28
85	000938	紫光股份	5,500	236,390.00	0.27
86	300014	亿纬锂能	4,913	235,087.05	0.27
87	002916	深南电路	1,400	234,528.00	0.27
88	601989	中国重工	58,200	232,800.00	0.27
89	601138	工业富联	15,300	231,795.00	0.27
90	601857	中国石油	55,200	231,288.00	0.27
91	601933	永辉超市	24,300	227,934.00	0.26
92	601899	紫金矿业	50,000	220,000.00	0.25
93	600019	宝钢股份	47,400	216,144.00	0.25
94	000100	TCL 科技	34,800	215,760.00	0.25
95	000776	广发证券	15,200	214,624.00	0.25
96	300033	同花顺	1,600	212,928.00	0.25
97	002024	苏宁易购	24,100	211,357.00	0.24

98	000338	潍柴动力	15,400	211,288.00	0.24
99	600346	恒力石化	15,000	210,000.00	0.24
100	300142	沃森生物	4,000	209,440.00	0.24
101	002027	分众传媒	37,600	209,432.00	0.24
102	002050	三花智控	9,540	208,926.00	0.24
103	300433	蓝思科技	7,200	201,888.00	0.23
104	600015	华夏银行	32,700	200,124.00	0.23
105	601088	中国神华	13,900	199,604.00	0.23
106	002230	科大讯飞	5,300	198,379.00	0.23
107	002410	广联达	2,800	195,160.00	0.23
108	002311	海大集团	4,100	195,119.00	0.23
109	601628	中国人寿	7,100	193,191.00	0.22
110	002841	视源股份	1,900	189,088.00	0.22
111	601009	南京银行	25,600	187,648.00	0.22
112	300676	华大基因	1,200	187,092.00	0.22
113	002624	完美世界	3,200	184,448.00	0.21
114	600196	复星医药	5,400	182,790.00	0.21
115	600340	华夏幸福	7,800	178,308.00	0.21
116	300347	泰格医药	1,700	173,196.00	0.20
117	601155	新城控股	5,500	171,820.00	0.20
118	300003	乐普医疗	4,700	171,644.00	0.20
119	300124	汇川技术	4,500	170,955.00	0.20
120	600741	华域汽车	8,200	170,478.00	0.20
121	002821	凯莱英	700	170,100.00	0.20
122	002001	新 和 成	5,800	168,780.00	0.20
123	600438	通威股份	9,700	168,586.00	0.20
124	601100	恒立液压	2,100	168,420.00	0.20
125	300558	贝达药业	1,200	167,976.00	0.19
126	600919	江苏银行	29,500	167,265.00	0.19
127	600763	通策医疗	1,000	166,770.00	0.19
128	002271	东方雨虹	4,100	166,583.00	0.19
129	603993	洛阳钼业	45,300	166,251.00	0.19
130	600009	上海机场	2,300	165,761.00	0.19
131	000596	古井贡酒	1,100	165,264.00	0.19
132	300454	深信服	800	164,768.00	0.19
133	600183	生益科技	5,600	163,912.00	0.19
134	002493	荣盛石化	13,200	162,360.00	0.19
135	002602	世纪华通	10,500	160,755.00	0.19
136	600600	青岛啤酒	2,100	160,650.00	0.19
137	002129	中环股份	7,100	159,466.00	0.18
138	600383	金地集团	11,600	158,920.00	0.18
139	601788	光大证券	9,800	157,388.00	0.18
140	002600	领益智造	14,500	154,135.00	0.18

141	601939	建设银行	24,300	153,333.00	0.18
142	601225	陕西煤业	21,200	152,852.00	0.18
143	601877	正泰电器	5,800	152,830.00	0.18
144	300661	圣邦股份	500	152,525.00	0.18
145	601901	方正证券	20,900	147,972.00	0.17
146	002236	大华股份	7,700	147,917.00	0.17
147	002120	韵达股份	6,040	147,678.00	0.17
148	603939	益丰药房	1,620	147,420.00	0.17
149	000977	浪潮信息	3,732	146,219.76	0.17
150	603658	安图生物	900	146,196.00	0.17
151	600958	东方证券	15,300	145,197.00	0.17
152	002044	美年健康	9,900	142,659.00	0.17
153	002460	赣锋锂业	2,600	139,282.00	0.16
154	601985	中国核电	33,200	135,788.00	0.16
155	600926	杭州银行	15,200	135,584.00	0.16
156	600886	国投电力	17,200	135,192.00	0.16
157	601669	中国电建	38,900	134,594.00	0.16
158	300529	健帆生物	1,930	134,135.00	0.16
159	603659	璞泰来	1,300	133,926.00	0.16
160	300308	中际旭创	2,100	132,300.00	0.15
161	002049	紫光国微	1,800	130,950.00	0.15
162	300253	卫宁健康	5,680	130,299.20	0.15
163	600893	航发动力	5,500	129,140.00	0.15
164	002127	南极电商	6,100	129,137.00	0.15
165	300408	三环集团	4,600	127,420.00	0.15
166	603517	绝味食品	1,800	127,332.00	0.15
167	002456	欧菲光	6,900	126,891.00	0.15
168	600606	绿地控股	20,500	126,690.00	0.15
169	600010	宝钢股份	116,900	126,252.00	0.15
170	601881	中国银河	11,000	126,170.00	0.15
171	000069	华侨城 A	20,800	126,048.00	0.15
172	002384	东山精密	4,200	125,790.00	0.15
173	603882	金域医学	1,400	125,300.00	0.15
174	600521	华海药业	3,690	125,201.70	0.15
175	002812	恩捷股份	1,900	125,020.00	0.14
176	000768	中航飞机	7,000	124,180.00	0.14
177	603369	今世缘	3,100	123,349.00	0.14
178	600029	南方航空	23,800	123,046.00	0.14
179	601990	南京证券	8,600	122,722.00	0.14
180	300136	信维通信	2,300	121,946.00	0.14
181	300595	欧普康视	1,750	121,345.00	0.14
182	603899	晨光文具	2,200	120,120.00	0.14
183	000425	徐工机械	20,300	119,973.00	0.14

184	603019	中科曙光	3,120	119,808.00	0.14
185	002414	高德红外	4,080	119,462.40	0.14
186	002607	中公教育	4,300	119,325.00	0.14
187	600536	中国软件	1,500	118,800.00	0.14
188	600061	国投资本	9,300	118,389.00	0.14
189	600845	宝信软件	2,000	118,160.00	0.14
190	002736	国信证券	10,400	117,520.00	0.14
191	600332	白云山	3,600	116,388.00	0.13
192	000963	华东医药	4,600	116,380.00	0.13
193	603707	健友股份	1,800	116,226.00	0.13
194	300628	亿联网络	1,700	116,042.00	0.13
195	601377	兴业证券	16,900	115,765.00	0.13
196	601618	中国中冶	45,900	115,209.00	0.13
197	002032	苏泊尔	1,600	113,600.00	0.13
198	300144	宋城演艺	6,560	113,488.00	0.13
199	600161	天坛生物	2,500	113,325.00	0.13
200	600660	福耀玻璃	5,400	112,698.00	0.13
201	002463	沪电股份	4,500	112,410.00	0.13
202	600872	中炬高新	1,900	111,207.00	0.13
203	002179	中航光电	2,700	110,727.00	0.13
204	601111	中国国航	16,700	110,387.00	0.13
205	000656	金科股份	13,500	110,160.00	0.13
206	002157	正邦科技	6,300	110,124.00	0.13
207	002252	上海莱士	13,000	109,980.00	0.13
208	603444	吉比特	200	109,802.00	0.13
209	603338	浙江鼎力	1,440	109,108.80	0.13
210	600352	浙江龙盛	8,500	108,715.00	0.13
211	000157	中联重科	16,900	108,667.00	0.13
212	603605	珀莱雅	600	108,012.00	0.13
213	000625	长安汽车	9,800	107,800.00	0.12
214	002690	美亚光电	2,000	105,200.00	0.12
215	603799	华友钴业	2,700	104,922.00	0.12
216	600674	川投能源	11,300	104,751.00	0.12
217	300383	光环新网	4,000	104,280.00	0.12
218	300482	万孚生物	1,000	104,000.00	0.12
219	601727	上海电气	20,500	103,320.00	0.12
220	600132	重庆啤酒	1,400	102,200.00	0.12
221	600115	东方航空	24,200	102,124.00	0.12
222	601162	天风证券	16,800	101,808.00	0.12
223	601799	星宇股份	800	101,600.00	0.12
224	002065	东华软件	8,100	101,412.00	0.12
225	600018	上港集团	24,000	100,800.00	0.12
226	601360	三六零	5,500	100,705.00	0.12

227	300357	我武生物	1,600	99,600.00	0.12
228	601872	招商轮船	17,000	99,110.00	0.11
229	000066	中国长城	7,500	99,000.00	0.11
230	600298	安琪酵母	2,000	98,960.00	0.11
231	601319	中国人保	15,200	97,888.00	0.11
232	002385	大北农	10,700	97,477.00	0.11
233	601108	财通证券	9,500	97,375.00	0.11
234	300450	先导智能	2,100	97,041.00	0.11
235	000860	顺鑫农业	1,700	96,866.00	0.11
236	600315	上海家化	2,000	95,800.00	0.11
237	600760	中航沈飞	2,900	95,178.00	0.11
238	600085	同仁堂	3,500	94,920.00	0.11
239	000783	长江证券	14,000	94,360.00	0.11
240	600867	通化东宝	5,400	94,122.00	0.11
241	300699	光威复材	1,500	94,095.00	0.11
242	000786	北新建材	4,400	93,852.00	0.11
243	601607	上海医药	5,100	93,738.00	0.11
244	600779	水井坊	1,500	93,630.00	0.11
245	002603	以岭药业	3,000	93,570.00	0.11
246	002185	华天科技	6,900	93,357.00	0.11
247	300496	中科创达	1,200	93,240.00	0.11
248	600998	九州通	5,000	93,100.00	0.11
249	603833	欧派家居	800	92,720.00	0.11
250	002439	启明星辰	2,200	92,554.00	0.11
251	600795	国电电力	50,000	92,500.00	0.11
252	601600	中国铝业	33,500	92,460.00	0.11
253	603589	口子窖	1,800	91,620.00	0.11
254	600705	中航资本	23,100	91,476.00	0.11
255	002373	千方科技	3,800	91,162.00	0.11
256	002202	金风科技	9,100	90,727.00	0.11
257	600522	中天科技	7,900	90,455.00	0.10
258	603883	老百姓	900	90,036.00	0.10
259	002146	荣盛发展	11,100	89,910.00	0.10
260	002299	圣农发展	3,100	89,900.00	0.10
261	300212	易华录	1,600	89,600.00	0.10
262	601800	中国交建	12,200	89,548.00	0.10
263	600118	中国卫星	2,900	89,407.00	0.10
264	600109	国金证券	7,800	88,998.00	0.10
265	002223	鱼跃医疗	2,400	87,360.00	0.10
266	002466	天齐锂业	3,800	87,210.00	0.10
267	600637	东方明珠	9,000	86,850.00	0.10
268	000513	丽珠集团	1,800	86,418.00	0.10
269	002405	四维图新	5,200	85,748.00	0.10

270	600111	北方稀土	9,200	85,744.00	0.10
271	002180	纳思达	2,600	85,566.00	0.10
272	002739	万达电影	5,600	85,512.00	0.10
273	601919	中远海控	24,600	85,362.00	0.10
274	600004	白云机场	5,600	85,344.00	0.10
275	000050	深天马 A	5,500	84,480.00	0.10
276	600380	健康元	5,200	84,448.00	0.10
277	600176	中国巨石	9,200	84,180.00	0.10
278	600498	烽火通信	2,900	83,839.00	0.10
279	000703	恒逸石化	9,170	83,722.10	0.10
280	600487	亨通光电	5,100	83,691.00	0.10
281	600489	中金黄金	9,100	83,174.00	0.10
282	000975	银泰黄金	5,300	83,104.00	0.10
283	000021	深科技	3,800	82,954.00	0.10
284	002153	石基信息	2,100	81,963.00	0.09
285	000961	中南建设	9,200	81,880.00	0.09
286	300251	光线传媒	7,500	81,825.00	0.09
287	600895	张江高科	4,000	81,480.00	0.09
288	603866	桃李面包	1,600	81,424.00	0.09
289	002601	龙麟佰利	4,400	81,400.00	0.09
290	002557	洽洽食品	1,500	81,285.00	0.09
291	002925	盈趣科技	1,400	81,116.00	0.09
292	601231	环旭电子	3,700	80,808.00	0.09
293	603858	步长制药	2,800	80,780.00	0.09
294	300146	汤臣倍健	4,100	80,729.00	0.09
295	600801	华新水泥	3,400	80,614.00	0.09
296	601018	宁波港	22,500	80,325.00	0.09
297	601555	东吴证券	9,810	80,049.60	0.09
298	001914	招商积余	2,600	79,898.00	0.09
299	600271	航天信息	4,900	79,576.00	0.09
300	002773	康弘药业	1,600	79,360.00	0.09
301	600011	华能国际	18,800	79,336.00	0.09
302	300316	晶盛机电	3,200	79,168.00	0.09
303	600177	雅戈尔	13,100	78,076.00	0.09
304	002422	科伦药业	3,700	77,700.00	0.09
305	002152	广电运通	6,000	77,640.00	0.09
306	601021	春秋航空	2,200	77,528.00	0.09
307	300207	欣旺达	4,100	77,490.00	0.09
308	300285	国瓷材料	2,300	77,073.00	0.09
309	002558	巨人网络	4,400	76,560.00	0.09
310	601198	东兴证券	7,000	76,300.00	0.09
311	600598	北大荒	4,700	75,670.00	0.09
312	600642	申能股份	12,800	75,648.00	0.09

313	601838	成都银行	9,500	75,620.00	0.09
314	600362	江西铜业	5,600	75,376.00	0.09
315	600201	生物股份	2,700	75,168.00	0.09
316	002074	国轩高科	2,800	75,152.00	0.09
317	002673	西部证券	9,200	75,072.00	0.09
318	002013	中航机电	9,500	75,050.00	0.09
319	601998	中信银行	14,500	74,675.00	0.09
320	002212	南洋股份	2,800	74,424.00	0.09
321	600655	豫园股份	8,400	74,424.00	0.09
322	600426	华鲁恒升	4,200	74,256.00	0.09
323	600486	扬农化工	900	74,250.00	0.09
324	002294	信立泰	2,500	74,150.00	0.09
325	600038	中直股份	1,800	73,926.00	0.09
326	000728	国元证券	8,800	73,920.00	0.09
327	600739	辽宁成大	3,900	73,827.00	0.09
328	002465	海格通信	5,700	73,758.00	0.09
329	002511	中顺洁柔	3,300	73,590.00	0.09
330	002683	宏大爆破	2,100	73,290.00	0.08
331	600699	均胜电子	3,060	72,858.60	0.08
332	002353	杰瑞股份	2,300	71,300.00	0.08
333	002019	亿帆医药	3,100	71,207.00	0.08
334	600068	葛洲坝	11,900	70,805.00	0.08
335	601117	中国化学	12,900	70,692.00	0.08
336	601878	浙商证券	7,100	70,361.00	0.08
337	600170	上海建工	22,900	70,303.00	0.08
338	002926	华西证券	6,600	70,158.00	0.08
339	002156	通富微电	2,800	70,140.00	0.08
340	300418	昆仑万维	2,800	69,888.00	0.08
341	601689	拓普集团	2,500	69,750.00	0.08
342	600511	国药股份	1,700	69,139.00	0.08
343	603712	七一二	1,800	69,084.00	0.08
344	002939	长城证券	5,600	68,992.00	0.08
345	002508	老板电器	2,200	68,442.00	0.08
346	300088	长信科技	6,100	68,320.00	0.08
347	600885	宏发股份	1,700	68,204.00	0.08
348	000423	东阿阿胶	1,900	68,039.00	0.08
349	000739	普洛药业	2,900	67,541.00	0.08
350	002075	沙钢股份	5,400	67,500.00	0.08
351	002500	山西证券	10,310	67,427.40	0.08
352	600667	太极实业	5,700	67,374.00	0.08
353	000627	天茂集团	12,900	67,209.00	0.08
354	000999	华润三九	2,300	67,137.00	0.08
355	002242	九阳股份	1,800	67,086.00	0.08

356	300070	碧水源	8,200	66,584.00	0.08
357	600369	西南证券	14,400	66,096.00	0.08
358	002131	利欧股份	17,100	66,006.00	0.08
359	600066	宇通客车	5,400	65,880.00	0.08
360	002281	光迅科技	2,000	65,720.00	0.08
361	002468	申通快递	4,000	65,640.00	0.08
362	600909	华安证券	9,600	65,568.00	0.08
363	600208	新湖中宝	22,000	65,560.00	0.08
364	000723	美锦能源	10,400	65,104.00	0.08
365	601992	金隅集团	21,200	64,872.00	0.08
366	002507	涪陵榨菜	1,800	64,818.00	0.08
367	000671	阳光城	10,200	64,668.00	0.07
368	300168	万达信息	2,900	64,003.00	0.07
369	002797	第一创业	9,200	63,664.00	0.07
370	600221	海航控股	42,300	63,450.00	0.07
371	600875	东方电气	7,100	62,835.00	0.07
372	002399	海普瑞	2,500	62,600.00	0.07
373	601233	桐昆股份	4,900	62,524.00	0.07
374	002958	青农商行	14,100	62,463.00	0.07
375	600219	南山铝业	30,700	62,321.00	0.07
376	600089	特变电工	9,200	62,284.00	0.07
377	002078	太阳纸业	6,500	61,880.00	0.07
378	002340	格林美	12,400	61,628.00	0.07
379	601966	玲珑轮胎	3,000	60,600.00	0.07
380	002396	星网锐捷	1,700	60,061.00	0.07
381	000750	国海证券	13,800	59,892.00	0.07
382	000932	华菱钢铁	15,800	59,566.00	0.07
383	600516	方大炭素	9,460	59,408.80	0.07
384	600027	华电国际	17,200	58,824.00	0.07
385	600026	中远海能	9,100	58,786.00	0.07
386	000988	华工科技	2,400	58,632.00	0.07
387	600153	建发股份	7,200	58,320.00	0.07
388	000547	航天发展	4,200	57,414.00	0.07
389	000540	中天金融	17,800	57,316.00	0.07
390	002030	达安基因	2,090	57,015.20	0.07
391	600704	物产中大	13,300	55,993.00	0.06
392	600167	联美控股	3,900	55,926.00	0.06
393	000709	河钢股份	27,400	55,896.00	0.06
394	600688	上海石化	15,800	54,984.00	0.06
395	000998	隆平高科	3,300	54,945.00	0.06
396	601099	太平洋	17,300	54,841.00	0.06
397	002174	游族网络	2,100	54,768.00	0.06
398	300024	机器人	4,000	54,680.00	0.06

399	601216	君正集团	21,500	54,610.00	0.06
400	000401	冀东水泥	3,400	54,536.00	0.06
401	600673	东阳光	7,800	53,898.00	0.06
402	300271	华宇软件	1,900	53,599.00	0.06
403	002081	金螳螂	6,800	53,448.00	0.06
404	600188	兖州煤业	6,100	53,436.00	0.06
405	002572	索菲亚	2,200	53,174.00	0.06
406	600754	锦江酒店	1,900	52,725.00	0.06
407	600977	中国电影	4,000	52,520.00	0.06
408	000630	铜陵有色	27,100	52,303.00	0.06
409	000688	国城矿业	2,800	51,884.00	0.06
410	601128	常熟银行	6,900	51,819.00	0.06
411	600583	海油工程	11,300	51,415.00	0.06
412	000402	金融街	7,700	51,128.00	0.06
413	300017	网宿科技	6,000	50,940.00	0.06
414	600372	中航电子	3,800	50,616.00	0.06
415	002387	维信诺	3,500	49,980.00	0.06
416	601098	中南传媒	4,700	49,726.00	0.06
417	000983	西山煤电	13,220	49,575.00	0.06
418	000028	国药一致	1,100	49,511.00	0.06
419	000729	燕京啤酒	7,200	49,320.00	0.06
420	000686	东北证券	5,800	49,010.00	0.06
421	600021	上海电力	6,600	48,840.00	0.06
422	600460	士兰微	3,300	48,444.00	0.06
423	600566	济川药业	1,900	48,374.00	0.06
424	600160	巨化股份	7,000	48,230.00	0.06
425	600733	北汽蓝谷	7,500	48,225.00	0.06
426	000825	太钢不锈	14,500	48,140.00	0.06
427	002372	伟星新材	4,100	47,683.00	0.06
428	000415	渤海租赁	16,000	47,680.00	0.06
429	000027	深圳能源	10,020	46,492.80	0.05
430	600256	广汇能源	17,200	46,440.00	0.05
431	002010	传化智联	8,500	46,240.00	0.05
432	600820	隧道股份	8,100	45,765.00	0.05
433	600967	内蒙一机	4,400	45,716.00	0.05
434	000623	吉林敖东	2,900	45,617.00	0.05
435	600879	航天电子	6,900	44,436.00	0.05
436	000629	攀钢钒钛	21,900	44,019.00	0.05
437	601699	潞安环能	7,700	42,889.00	0.05
438	002268	卫士通	2,000	42,680.00	0.05
439	600549	厦门钨业	3,600	42,624.00	0.05
440	002217	合力泰	8,100	42,525.00	0.05
441	300026	红日药业	7,700	42,504.00	0.05

442	000089	深圳机场	5,500	42,130.00	0.05
443	600466	蓝光发展	7,800	42,042.00	0.05
444	601958	金钼股份	6,800	42,024.00	0.05
445	600675	中华企业	10,300	41,921.00	0.05
446	000046	泛海控股	11,100	41,847.00	0.05
447	002195	二三四五	14,800	41,588.00	0.05
448	000581	威孚高科	2,000	41,360.00	0.05
449	600446	金证股份	2,100	40,740.00	0.05
450	002110	三钢闽光	6,100	40,626.00	0.05
451	600373	中文传媒	3,400	40,052.00	0.05
452	000997	新大陆	2,500	39,950.00	0.05
453	300012	华测检测	2,000	39,520.00	0.05
454	600808	马钢股份	15,300	39,474.00	0.05
455	603885	吉祥航空	4,300	39,130.00	0.05
456	000883	湖北能源	11,100	39,072.00	0.05
457	300296	利亚德	6,400	38,848.00	0.05
458	002563	森马服饰	5,500	38,775.00	0.04
459	000738	航发控制	2,800	38,220.00	0.04
460	600376	首开股份	6,500	38,090.00	0.04
461	601866	中远海发	20,600	37,904.00	0.04
462	000031	大悦城	7,300	37,157.00	0.04
463	000413	东旭光电	13,900	37,113.00	0.04
464	600572	康恩贝	6,700	36,850.00	0.04
465	600056	中国医药	2,600	36,790.00	0.04
466	600863	内蒙华电	14,900	36,654.00	0.04
467	601598	中国外运	11,200	36,176.00	0.04
468	000598	兴蓉环境	7,700	35,420.00	0.04
469	600258	首旅酒店	2,300	35,351.00	0.04
470	002085	万丰奥威	5,300	34,344.00	0.04
471	002506	协鑫集成	13,000	33,930.00	0.04
472	000898	鞍钢股份	13,400	32,830.00	0.04
473	600260	凯乐科技	2,400	32,448.00	0.04

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688599	天合光能	20,212	281,148.92	0.33
2	688568	中科星图	4,683	75,911.43	0.09
3	688277	天智航	5,976	71,951.04	0.08
4	688377	迪威尔	3,216	52,806.72	0.06

5	688600	皖仪科技	3,372	52,266.00	0.06
6	688027	国盾量子	1,367	49,458.06	0.06
7	603087	甘李药业	452	45,335.60	0.05
8	300824	北鼎股份	1,954	26,789.34	0.03
9	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.02
10	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.01
11	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.01
12	300847	中船汉光	1,421	9,861.74	0.01
13	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.01
14	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.01
15	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.01
16	300846	首都在线	1,131	3,811.47	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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	27,054,641.75	31.35
2	601318	中国平安	15,980,782.00	18.52
3	600036	招商银行	12,930,056.73	14.98
4	603288	海天味业	12,642,149.01	14.65
5	000651	格力电器	10,229,324.76	11.85
6	600690	海尔智家	10,163,550.69	11.78
7	000858	五粮液	9,986,614.00	11.57
8	600276	恒瑞医药	7,327,083.80	8.49
9	300750	宁德时代	7,073,823.03	8.20
10	300498	温氏股份	7,069,369.00	8.19
11	600438	通威股份	6,958,854.71	8.06
12	600900	长江电力	6,867,086.00	7.96
13	002415	海康威视	6,616,986.00	7.67
14	300760	迈瑞医疗	6,551,266.00	7.59
15	601166	兴业银行	6,530,464.00	7.57
16	600000	浦发银行	5,831,233.57	6.76
17	002602	世纪华通	5,574,698.20	6.46
18	000063	中兴通讯	5,449,897.82	6.32
19	600183	生益科技	5,437,821.90	6.30
20	000001	平安银行	5,430,607.00	6.29
21	000002	万科 A	5,407,342.00	6.27
22	002841	视源股份	5,400,546.73	6.26
23	601398	工商银行	5,304,066.00	6.15
24	600030	中信证券	5,293,868.00	6.13

25	300059	东方财富	5,293,803.67	6.13
26	300308	中际旭创	5,286,422.00	6.13
27	002714	牧原股份	5,249,151.00	6.08
28	601108	财通证券	5,248,645.00	6.08
29	002508	老板电器	5,231,084.53	6.06
30	000725	京东方 A	5,219,330.00	6.05
31	601990	南京证券	5,216,490.00	6.04
32	601901	方正证券	5,207,867.00	6.03
33	002044	美年健康	5,187,046.00	6.01
34	600498	烽火通信	5,181,458.26	6.00
35	601066	中信建投	5,175,407.00	6.00
36	002706	良信电器	5,169,459.50	5.99
37	603228	景旺电子	5,134,479.45	5.95
38	600999	招商证券	5,131,586.00	5.95
39	002475	立讯精密	5,081,693.00	5.89
40	601288	农业银行	4,637,458.00	5.37
41	601668	中国建筑	4,063,587.00	4.71
42	600585	海螺水泥	4,019,503.00	4.66
43	601328	交通银行	3,788,216.00	4.39
44	600016	民生银行	3,733,360.60	4.33
45	601601	中国太保	3,728,024.00	4.32
46	600048	保利地产	3,296,894.00	3.82
47	600050	中国联通	3,236,102.00	3.75
48	600104	上汽集团	3,232,349.00	3.75
49	600887	伊利股份	3,227,163.79	3.74
50	600745	闻泰科技	3,217,395.00	3.73
51	603259	药明康德	2,875,462.14	3.33
52	601888	中国中免	2,824,618.00	3.27
53	002304	洋河股份	2,820,553.00	3.27
54	002142	宁波银行	2,799,888.00	3.24
55	601766	中国中车	2,781,116.80	3.22
56	601818	光大银行	2,778,737.00	3.22
57	002212	南洋股份	2,766,015.90	3.21
58	300168	万达信息	2,763,789.00	3.20
59	600309	万华化学	2,742,847.22	3.18
60	601688	华泰证券	2,621,428.00	3.04
61	001979	招商蛇口	2,618,956.00	3.03
62	600031	三一重工	2,581,961.07	2.99
63	601200	上海环境	2,577,265.70	2.99
64	300253	卫宁健康	2,576,629.70	2.99
65	000967	盈峰环境	2,571,936.73	2.98
66	300451	创业慧康	2,556,731.10	2.96
67	300682	朗新科技	2,536,617.00	2.94

68	600323	瀚蓝环境	2,531,026.70	2.93
69	300015	爱尔眼科	2,525,345.00	2.93
70	300078	思创医惠	2,520,583.00	2.92
71	601012	隆基股份	2,494,509.02	2.89
72	601211	国泰君安	2,429,047.00	2.81
73	600588	用友网络	2,341,715.00	2.71
74	002594	比亚迪	2,330,084.00	2.70
75	603160	汇顶科技	2,307,833.00	2.67
76	600809	山西汾酒	2,305,920.00	2.67
77	600837	海通证券	2,301,331.00	2.67
78	601988	中国银行	2,278,542.00	2.64
79	601229	上海银行	2,259,379.04	2.62
80	000568	泸州老窖	2,202,408.00	2.55
81	603986	兆易创新	2,187,186.00	2.53
82	000538	云南白药	2,176,967.00	2.52
83	600703	三安光电	2,154,694.32	2.50
84	600028	中国石化	2,125,444.00	2.46
85	000876	新希望	2,082,659.00	2.41
86	600570	恒生电子	2,079,311.00	2.41
87	000166	申万宏源	2,067,921.15	2.40
88	601169	北京银行	1,996,061.00	2.31
89	603501	韦尔股份	1,972,750.00	2.29
90	601006	大秦铁路	1,946,231.00	2.26
91	601989	中国重工	1,896,647.00	2.20
92	002230	科大讯飞	1,893,504.00	2.19
93	601390	中国中铁	1,880,964.00	2.18
94	000895	双汇发展	1,878,679.30	2.18
95	601186	中国铁建	1,844,277.00	2.14
96	600547	山东黄金	1,834,942.00	2.13
97	002352	顺丰控股	1,815,344.00	2.10
98	002179	中航光电	1,793,224.00	2.08
99	600019	宝钢股份	1,787,599.00	2.07

注：1、买入包括基金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；

2、基金持有的股票分类为交易性金融资产的，本项的“累计买入金额”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。

7.4.2 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	000858	五粮液	9,507,917.76	11.02

2	000651	格力电器	9,445,555.00	10.95
3	600690	海尔智家	8,364,108.00	9.69
4	600438	通威股份	7,860,687.61	9.11
5	603288	海天味业	7,253,093.25	8.40
6	300498	温氏股份	7,097,437.42	8.22
7	300059	东方财富	6,517,208.80	7.55
8	000063	中兴通讯	6,190,744.40	7.17
9	300750	宁德时代	6,122,071.95	7.09
10	300760	迈瑞医疗	6,053,958.40	7.02
11	603228	景旺电子	5,939,575.91	6.88
12	002841	视源股份	5,911,933.20	6.85
13	002706	良信电器	5,865,803.00	6.80
14	002602	世纪华通	5,716,177.43	6.62
15	601108	财通证券	5,491,799.00	6.36
16	002508	老板电器	5,335,300.71	6.18
17	002714	牧原股份	5,310,413.07	6.15
18	300308	中际旭创	5,282,213.40	6.12
19	600498	烽火通信	5,276,622.00	6.11
20	600183	生益科技	5,205,860.00	6.03
21	002415	海康威视	5,158,644.68	5.98
22	000725	京东方 A	5,149,675.00	5.97
23	601990	南京证券	4,991,232.00	5.78
24	000002	万科 A	4,715,295.56	5.46
25	002044	美年健康	4,596,409.68	5.33
26	000001	平安银行	4,521,660.20	5.24
27	002475	立讯精密	4,442,253.47	5.15
28	601901	方正证券	4,125,703.00	4.78
29	601066	中信建投	3,768,219.00	4.37
30	600999	招商证券	3,629,507.00	4.21
31	300253	卫宁健康	3,194,556.40	3.70
32	300168	万达信息	3,023,488.24	3.50
33	002212	南洋股份	2,996,819.00	3.47
34	300078	思创医惠	2,933,801.44	3.40
35	300451	创业慧康	2,696,833.00	3.13
36	300682	朗新科技	2,688,216.00	3.12
37	000967	盈峰环境	2,523,145.91	2.92
38	002142	宁波银行	2,474,842.28	2.87
39	601200	上海环境	2,462,160.00	2.85
40	002304	洋河股份	2,418,853.93	2.80
41	600323	瀚蓝环境	2,402,273.00	2.78
42	300015	爱尔眼科	2,376,243.16	2.75
43	001979	招商蛇口	2,361,227.78	2.74
44	000568	泸州老窖	1,985,888.00	2.30

45	000876	新希望	1,971,323.49	2.28
46	000538	云南白药	1,945,582.09	2.25
47	002271	东方雨虹	1,906,275.75	2.21
48	002179	中航光电	1,830,419.50	2.12
49	000625	长安汽车	1,829,397.00	2.12
50	002594	比亚迪	1,785,702.43	2.07
51	000895	双汇发展	1,758,535.36	2.04
52	000671	阳光城	1,737,836.00	2.01

注：1、卖出主要指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；

2、基金持有的股票分类为交易性金融资产的，本项“累计卖出金额”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。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	711,958,608.24
卖出股票收入（成交）总额	381,916,301.61

注：1、买入包括基金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，卖出主要指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；

2、“买入股票成本（成交）总额”、“卖出股票收入（成交）总额”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）	28,768.13	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	28,768.13	0.03

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	128112	歌尔转 2	168	16,799.93	0.02
2	113583	益丰转债	90	11,968.20	0.01

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，有选择地投资于流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金在进行股指期货投资时，首先将基于对证券市场总体行情的判断和组合风险收益的分析确定投资时机，并根据风险资产投资（或拟投资）的总体规模和风险系数决定股指期货的投资比例；其次，本基金将在综合考虑证券市场和期货市场运行趋势以及股指期货流动性、收益性、风险特征和估值水平的基础上进行投资品种选择，以对冲风险资产组合的系统性风险和流动性风险。

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

本基金参与国债期货投资是为了有效控制债券市场的系统性风险，本基金将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，适度运用国债期货提高投资组合运作效率。在国债期货投资过程中，基金管理人通过对宏观经济和利率市场走势的分析与判断，并充分考虑国

债期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置，谨慎进行投资，以调整债券组合的久期，降低投资组合的整体风险。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

报告期内基金投资的前十名证券除兴业银行（证券代码 601166）、招商银行（证券代码 600036）外其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

1、兴业银行（证券代码 601166）

根据发布的相关公告，该证券发行人在报告期内因违规经营、未依法履行职责、涉嫌违反法律法规等原因，多次受到监管机构的处罚。

2、招商银行（证券代码 600036）

根据发布的相关公告，该证券发行人在报告期内因违规经营、违反反洗钱法、未依法履行职责、财务会计报告违规等原因，多次受到监管机构的处罚。

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

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

金额单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	390,330.55
2	应收证券清算款	3,363,511.80
3	应收股利	-
4	应收利息	963.31
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	3,754,805.66
---	----	--------------

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688599	天合光能	281,148.92	0.33	新股锁定
2	688568	中科星图	75,911.43	0.09	新股锁定
3	688277	天智航	71,951.04	0.08	新股锁定
4	688377	迪威尔	52,806.72	0.06	新股锁定
5	688600	皖仪科技	52,266.00	0.06	新股锁定

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
2,014	38,706.58	3,554,359.00	4.56%	74,400,692.00	95.44%

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	招商证券股份有限公司	1,452,873.00	1.86%
2	牟少玲	1,000,000.00	1.28%
3	陈桂琴	1,000,000.00	1.28%
4	张永峰	1,000,000.00	1.28%
5	方正证券股份有限公司	958,986.00	1.23%
6	林永根	928,000.00	1.19%
7	盈丹(深圳)资产管理有限公司-盈丹汇萃三期私募证券投资基金	770,800.00	0.99%

8	刘钺	700,000.00	0.90%
9	王喆	700,000.00	0.90%
10	蔡泳彦	600,000.00	0.77%
11	韦玉萍	600,000.00	0.77%

注：以上数据由中国证券登记结算公司提供，持有人为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	-	-

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

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2020年2月3日)基金份额总额	507,955,051.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	24,000,000.00
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	454,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	77,955,051.00

§ 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

根据本基金管理人 2020 年 5 月 7 日的公告，因本公司第五届董事会任期届满，经公司股东会审议通过，选举刘辉女士、金旭女士、杜凯先生、王小青先生、何玉慧女士、张思

宁女士、邹胜先生担任公司第六届董事会董事，其中何玉慧女士、张思宁女士、邹胜先生为独立董事。第五届董事会董事邓晓力女士及独立董事吴冠雄先生、王莉女士、孙谦先生不再继续担任本公司董事职务。

根据本基金管理人 2020 年 5 月 12 日的公告，经招商基金管理有限公司第六届董事会 2020 年第一次会议审议通过，同意聘任王小青先生为公司总经理，金旭女士不再担任公司总经理职务，担任公司副董事长。

本基金本报告期内基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的重大诉讼事项。

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，基金管理人没有受到监管部门的稽查或处罚，亦未收到关于基金管理人的高级管理人员、托管人及其高级管理人员受到监管部门的稽查或处罚的书面通知或文件。

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	
招商证券	2	693,645,972.51	63.55%	160,447.29	75.44%	-
方正证券	5	397,922,146.51	36.45%	52,247.54	24.56%	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	3	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
大通证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	3	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-

东方证券	3	-	-	-	-	-
东兴证券	3	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安 证券	3	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	3	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	4	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	3	-	-	-	-	-
瑞信方正	2	-	-	-	-	-
申万宏源	4	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证 券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
东方财富	3	-	-	-	-	-
新时代证 券	1	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中金财富 证券	2	-	-	-	-	-
中信建投 证券	6	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
中银国际 证券	4	-	-	-	-	-

注：基金交易佣金根据券商季度综合评分结果给与分配，券商综合评分根据研究报告质量、路演质量、联合调研质量等维度进行打分，从多家服务券商中选取符合法律规范经营的综合能力靠前的券商给与佣金分配，季度评分和佣金分配分别由专人负责。

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
招商证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
瑞信方正	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-

银河证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中金财富 证券	-	-	-	-	-	-
中信建投 证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际 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	关于招商 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金增加东方证券股份有限公司为销售机构的公告	上海证券报及基金管理人网站	2020-01-03
2	招商 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金上网发售提示性公告	上海证券报及基金管理人网站	2020-01-15
3	招商基金管理有限公司关于调整旗下基金 2020 年春节假期申购赎回等交易业务及清算交收安排的提示性公告	上海证券报及基金管理人网站	2020-01-29
4	招商 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生效公告	上海证券报及基金管理人网站	2020-02-04
5	招商基金管理有限公司关于公司自有资金投资旗下偏股型公募基金的公告	上海证券报及基金管理人网站	2020-02-05
6	招商 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书	上海证券报及基金管理人网站	2020-02-26
7	关于招商 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金修改招募说明书的公告	上海证券报及基金管理人网站	2020-02-26
8	招商 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金更新的招募说明书（二零二零年第一号）	上海证券报及基金管理人网站	2020-02-26
9	招商 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金更新的招募说明书摘要（二零二零年第一号）	上海证券报及基金管理人网站	2020-02-26
10	关于开放招商 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金日常申购赎回业务的公告	上海证券报及基金管理人网站	2020-02-26
11	招商基金管理有限公司关于调整招商 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金最小申购、赎回单位的公告	上海证券报及基金管理人网站	2020-02-26

12	招商 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书提示性公告	上海证券报及基金管理人网站	2020-02-26
13	招商 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金上市交易提示性公告	上海证券报及基金管理人网站	2020-03-02
14	招商基金管理有限公司关于旗下上海证券交易所上市的基金增加扩位证券简称的公告	上海证券报及基金管理人网站	2020-03-13
15	招商基金管理有限公司关于公司董事变更的公告	上海证券报及基金管理人网站	2020-05-07
16	招商基金管理有限公司关于提醒网上直销个人投资者及时上传身份证件影印件并完善、更新身份信息以免影响日常交易的公告	上海证券报及基金管理人网站	2020-05-09
17	招商基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报及基金管理人网站	2020-05-12

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准设立招商基金管理有限公司的文件；
- 2、中国证券监督管理委员会批准招商 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金设立的文件；
- 3、《招商 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》；
- 4、《招商 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 5、《招商 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照。

11.2 存放地点

招商基金管理有限公司

地址：中国深圳深南大道 7088 号招商银行大厦

11.3 查阅方式

上述文件可在招商基金管理有限公司互联网站上查阅，或者在营业时间内到招商基金管理有限公司查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人招商基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-887-9555

网址：<http://www.cmfchina.com>

招商基金管理有限公司

2020 年 8 月 28 日