

# 招商创业板大盘交易型开放式指数证 券投资基金 2021 年第 3 季度报告

2021 年 09 月 30 日

基金管理人：招商基金管理有限公司

基金托管人：中信建投证券股份有限公司

送出日期：2021 年 10 月 26 日

## § 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。

基金托管人中信建投证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 10 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	招商创业板大盘 ETF
场内简称	创大盘 ETF
基金主代码	159991
交易代码	159991
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020 年 3 月 20 日
报告期末基金份额总额	147,463,172.00 份
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。在正常情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。
投资策略	<p>1、股票投资策略</p> <p>本基金主要采用完全复制法，即按照标的指数的成份券的构成及其权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份券及其权重的变化进行相应调整。当预期成份券发生调整和成份券发生配股、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，从而使投资组合紧密地跟踪标的指数。</p> <p>2、债券投资策略</p> <p>本基金管理人将基于对国内外宏观经济形势的深入分</p>

	<p>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。在债券投资组合构建和管理过程中,本基金管理人将具体采用期限结构配置、市场转换、信用利差和相对价值判断、信用风险评估、现金管理等管理手段进行个券选择。本基金债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上,降低跟踪误差。</p> <p><b>3、资产支持证券投资策略</b></p> <p>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><b>4、股指期货投资策略</b></p> <p>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。</p> <p><b>5、国债期货投资策略</b></p> <p>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。</p> <p><b>6、融资及转融通证券出借业务投资策略</b></p> <p>为更好地实现投资目标,在加强风险防范并遵守审慎原则的前提下,本基金可根据投资管理的需要参与融资、转融通证券出借业务。参与融资业务时,本基金将力争利用融资的杠杆作用,降低因申购造成基金仓位较低带来的跟踪误差,达到有效跟踪标的指数的目的。参与转融通证券出借业务时,本基金将在分析市场情况、投资者类型与结构、基金历史申赎情况、出借证券流动性情况等因素的基础上,合理确定出借证券的范围、期限和比例。</p> <p><b>7、存托凭证投资策略</b></p> <p>在控制风险的前提下,本基金将根据本基金的投资目标</p>
--	--

	和股票投资策略,基于对基础证券投资价值的深入研究判断,进行存托凭证的投资。
业绩比较基准	创业板大盘指数收益率
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货币市场基金、债券型基金。 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,跟踪创业板大盘指数,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。
基金管理人	招商基金管理有限公司
基金托管人	中信建投证券股份有限公司

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2021年7月1日—2021年9月30日)
1.本期已实现收益	12,670,994.82
2.本期利润	-4,763,975.76
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0307
4.期末基金资产净值	100,983,147.23
5.期末基金份额净值	0.6848

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

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。

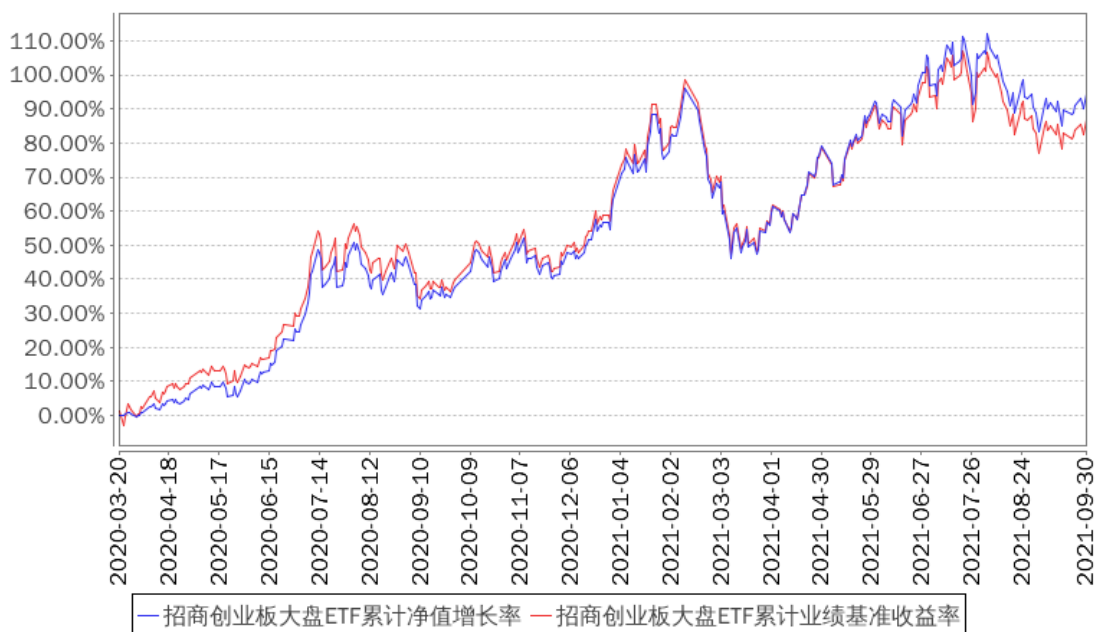
#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-5.47%	2.03%	-7.59%	2.06%	2.12%	-0.03%
过去六个月	24.80%	1.90%	19.59%	1.93%	5.21%	-0.03%
过去一年	41.36%	1.99%	33.75%	2.02%	7.61%	-0.03%
自基金合同生效起至今	94.48%	1.88%	86.94%	1.95%	7.54%	-0.07%

##### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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

招商创业板大盘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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
苏燕青	本基金基金经理	2020年3月20日	-	9	女，硕士。2012年1月加入招商基金管理有限公司量化投资部，曾任ETF专员，协助指数类基金产品的投资管理工作，上证消费80交易型开放式指数证券投资基金、招商上证消费80交易型开放式指数证券投资基金联接基金、招商沪深300地产等权重指数证券投资基金、招商沪深300高贝塔指数证券投资基金、招商中证全指证券公司指数证券投资基金、招商富时中国A-H50指数型证券投资基金（LOF）基金经理，现任深证电子信息传媒产业(TMT)50交易型开放式指数证券投资基金、招商深证电子信息传媒产业(TMT)50交易型开放式指数证券投资基金联接基金、招商创业板大盘交易型开放式指数证券投资基金、招商上证港股通交易型开放式指数证券投资基金、招商中证全指医疗器械交易型开放

					式指数证券投资基金、招商中证全指软件交易型开放式指数证券投资基金、招商中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金、招商中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

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 公平交易专项说明

### 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。

### 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 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，三季度经济数据较二季度见顶后持续回落，货币整体维持相对宽松。报告期内 A 股表现分化相对较大，从行业来看，采掘、公用事业、有色金属、钢铁等行业板块涨幅相对较高，医药生物、休闲服务、食品饮料、传媒等行业板块跌幅较大。本基金的基准指数创业板大盘指数报告期内下跌 7.59%。

关于本基金的运作，股票仓位维持在 98.5% 左右的水平，基本完成了对基准的跟踪。

#### 4.5 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-5.47%，同期业绩基准增长率为-7.59%。

#### 4.6 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 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	99,555,003.25	97.91
	其中：股票	99,555,003.25	97.91
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	15,406.60	0.02
	其中：债券	15,406.60	0.02
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,944,368.45	1.91
8	其他资产	160,606.85	0.16
9	合计	101,675,385.15	100.00

注：此处的股票投资项含可退替代款估值增值。

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	72,986,952.30	72.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,599,145.29	3.56
J	金融业	10,185,389.23	10.09
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	6,724,278.80	6.66
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	4,132,839.60	4.09
R	文化、体育和娱乐业	1,374,564.20	1.36
S	综合	-	-
	合计	99,003,169.42	98.04

### 5.2.2 报告期末积极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	12,350.52	0.01
B	采矿业	-	-
C	制造业	429,346.54	0.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	17,274.18	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	3,345.12	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,551.33	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	25,454.76	0.03
N	水利、环境和公共设施管理业	36,558.76	0.04
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	8,952.62	0.01
S	综合	-	-
	合计	551,833.83	0.55

### 5.2.3 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。

## 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

### 5.3.1 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前十名股票投资明细

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	300750	宁德时代	35,500	18,663,415.00	18.48
2	300059	东方财富	271,579	9,334,170.23	9.24
3	300760	迈瑞医疗	14,400	5,550,048.00	5.50
4	300274	阳光电源	34,200	5,074,596.00	5.03
5	300015	爱尔眼科	77,394	4,132,839.60	4.09
6	300014	亿纬锂能	39,792	3,940,601.76	3.90
7	300122	智飞生物	23,998	3,815,442.02	3.78
8	300124	汇川技术	55,650	3,505,950.00	3.47
9	300142	沃森生物	52,500	3,316,950.00	3.28
10	300347	泰格医药	18,420	3,205,080.00	3.17

### 5.3.2 报告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前五名股票投资明细

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	301006	迈拓股份	3,821	98,963.90	0.10
2	001218	丽臣实业	350	15,928.50	0.02
3	301029	怡合达	274	15,856.38	0.02
4	300614	百川畅银	329	15,624.21	0.02
5	300979	华利集团	176	15,107.84	0.01

#### 5.4 报告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）	15,406.60	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	15,406.60	0.02

#### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	118002	天合转债	110	15,406.60	0.02

#### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名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。

#### 5.7 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。

#### 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 5.9.1 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。

##### 5.9.2 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。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 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。

### 5.10.2 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。

### 5.10.3 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。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1

报告期内基金投资的前十名证券除爱尔眼科（证券代码 300015）、东方财富（证券代码 300059）、汇川技术（证券代码 300124）、沃森生物（证券代码 300142）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、爱尔眼科（证券代码 300015）

根据 2021 年 4 月 21 日发布的相关公告，该证券发行人因违反税收管理规定被国家税务总局长沙市天心区税务局责令改正。

#### 2、东方财富（证券代码 300059）

根据 2021 年 7 月 19 日发布的相关公告，该证券发行人因未依法履行职责被工信部通报批评，并责令改正。

#### 3、汇川技术（证券代码 300124）

根据 2021 年 5 月 18 日发布的相关公告，该证券发行人因未依法履行职责被广东省通信管理局责令改正。

#### 4、沃森生物（证券代码 300142）

根据 2021 年 7 月 1 日发布的相关公告，该证券发行人因内部制度不完善被云南证监局责令改正。

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。

### 5.11.2

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。

### 5.11.3 其他资产构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	160,219.79
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	387.06
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	160,606.85

### 5.11.4 报告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。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 5.11.5.2 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	301006	迈拓股份	98,963.90	0.10	新股锁定
2	001218	丽臣实业	15,928.50	0.02	新股锁定
3	301029	怡合达	15,856.38	0.02	新股锁定
4	300614	百川畅银	15,624.21	0.02	新股锁定

5	300979	华利集团	15,107.84	0.01	新股锁定
---	--------	------	-----------	------	------

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	155,863,172.00
报告期期间基金总申购份额	106,400,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	114,800,000.00
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	147,463,172.00

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

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。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的交易明细。

## § 8 备查文件目录

### 8.1 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创业板大盘交易型开放式指数证券投资基金设立的文件；
- 3、《招商创业板大盘交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 4、《招商创业板大盘交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 5、《招商创业板大盘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。

### 8.2 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

### 8.3 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.cmfcchina.com>

招商基金管理有限公司

2021 年 10 月 26 日