

招商 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金 2021 年中期报告

2021 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：2021 年 8 月 30 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 2021 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 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介.....	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	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.....	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.....	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.....	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.....	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.....	16
§7 投资组合报告.....	38
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	39
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.....	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	55
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.....	55
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.....	56
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.....	56
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.....	56
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	56

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	56
7.12 投资组合报告附注.....	57
§8 基金份额持有人信息.....	58
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	58
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	58
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	59
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.....	59
§9 开放式基金份额变动.....	59
§10 重大事件揭示.....	59
10.1 基金份额持有人大会决议.....	59
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.....	59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	60
10.4 基金投资策略的改变.....	60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	60
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.....	60
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	60
10.8 其他重大事件.....	63
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	65
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
§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.....	66

§ 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	591,955,051.00 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>本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份券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券及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情形导致基金无法完全投资于标的指数成份券时，基金管理人可采取包括成份券替代策略在内的其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到紧密跟踪标的指数的目的。特殊情形包括但不限于：（1）法律法规的限制；（2）标的指数成份券流动性严重不足；（3）标的指数的成份券票长期停牌；（4）标的指数成份券进行配股或增发；（5）标的指数成份券派发现金股息；（6）标的指数编制方法发生变化；（7）其他可能严重限制本基金跟踪标的指数的合理原因等。</p> <p>本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 以内。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。本基金其他投资策略包括：债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、融资及转融通投资策略和存托凭证投资策略。</p>
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	王小青	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(2021 年 1 月 1 日 - 2021 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	54,589,200.88
本期利润	60,362,287.10
加权平均基金份额本期利润	0.0936
本期加权平均净值利润率	6.36%
本期基金份额净值增长率	5.54%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)

期末可供分配利润	232,604,087.21
期末可供分配基金份额利润	0.3929
期末基金资产净值	901,850,958.55
期末基金份额净值	1.5235
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	52.35%

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。

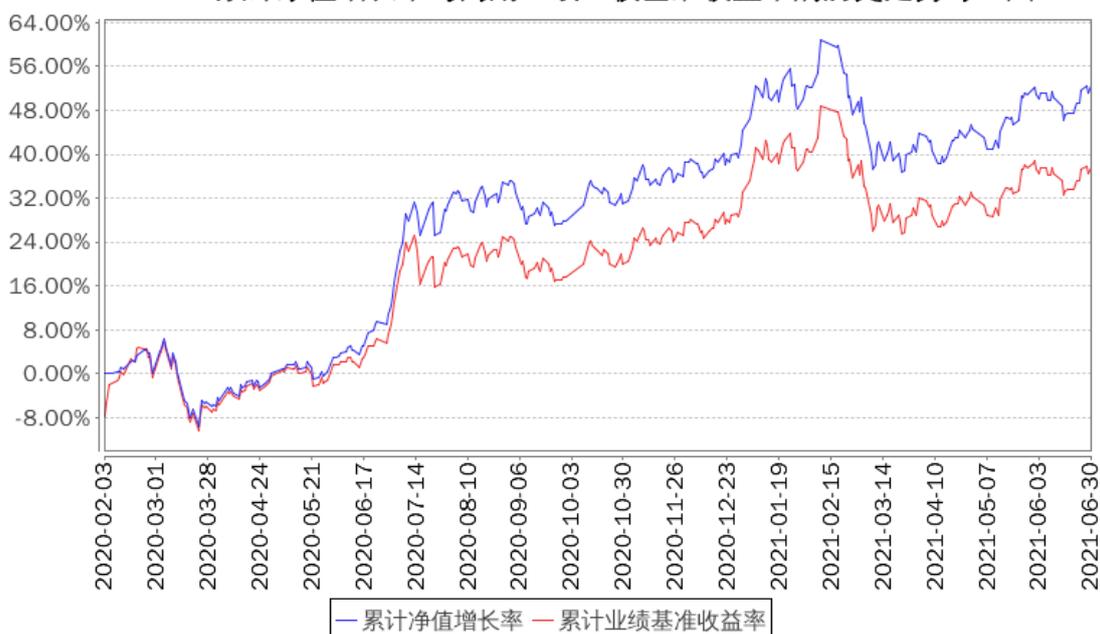
3.2 基金净值表现

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	0.36%	0.83%	-0.55%	0.84%	0.91%	-0.01%
过去三个月	8.54%	0.95%	6.84%	0.98%	1.70%	-0.03%
过去六个月	5.54%	1.28%	3.38%	1.32%	2.16%	-0.04%
过去一年	37.62%	1.27%	28.40%	1.33%	9.22%	-0.06%
自基金合同生效起至今	52.35%	1.27%	37.61%	1.41%	14.74%	-0.14%

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 2021 年中期报告



注：本基金建仓期为 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§ 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，公司注册资本金为人民币 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(特定客户资产管理业务)资格，在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、海外投资、FOF 投资等领域全面布局。

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		
王超	本基金基金经理	2020 年 9 月 23 日	-	13	男，博士。2007 年加入长盛基金管理有限公司先后担任金融工程研究员、基金经理，具有多年量化分析研究，以及基金产品投资管理经验，2019 年加入招商基金管理有限公司国际业务部，现任招

					商 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金、招商 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金、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、招商港股通核心精选股票型证券投资基金基金经理。
白海峰	本基金基金经理	2020 年 2 月 3 日	-	11	男，硕士。曾任职于新东方教育科技集团；2010 年加入国泰基金管理有限公司，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，曾任招商标普金砖四国指数证券投资基金(LOF)、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 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金、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、招商港股通核心精选股票型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。报告期内，公司旗下投资组合同向交易价差分析中未发现异常情形。

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，公司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% 的情形共发生过七次，原因是指数量化投资组合为满足投资策略需要而发生反向交易。报告期内未发现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

上半年，美国等发达国家疫苗接种率快速提高，各主要城市逐步放开线下经济活动，叠加疫情期间居民资产负债表在政府积极财政救济的呵护下仍然维持在良好状态，发达国家市场需求旺盛。但受制于疫苗供给不足，大部分新兴市场国家仍深陷于疫情之中，导致全球产业链供给受限。发达国家及新兴市场国家供需的错配继续支撑着中国出口及中国经济的高位运行。从市场流动性层面看，虽然信用趋紧但市场流动性在财政后置的影响下异常充裕。从资本市场表现上看，春节后受通胀及联储 taper 担忧的影响，A 股及港股大幅回撤后呈箱体震荡态势；从风格上看，价值指数在阶段性领先后重回弱势，成长指数回撤后重回上行通道，整体上看上半年成长表现优于价值。

报告期内，本基金作为 ETF 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 5.54%，同期业绩基准增长率为 3.38%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年，预计美国等发达国家经济在线下消费需求释放的支撑下仍将持续维持较强的增长态势，新兴市场国家有望在疫苗瓶颈缓解的情形下开始迈向经济正常化之路。而中国经济预计随着出口贡献的走弱，经济动能可能会有所回落，市场投资者的关注点可能会从通胀重回盈利增长的持续性。

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”、“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 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：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日

资产：			
银行存款	6.4.7.1	29,436,944.87	62,147,137.61
结算备付金		519,598.75	401,373.38
存出保证金		370,978.79	28,826.44
交易性金融资产	6.4.7.2	872,235,542.26	1,167,898,538.31
其中：股票投资		871,687,650.37	1,166,897,542.73
基金投资		-	-
债券投资		547,891.89	1,000,995.58
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		1,820,885.31	5,391,630.54
应收利息	6.4.7.5	2,819.99	8,799.22
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		904,386,769.97	1,235,876,305.50
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1,667,297.98	5,248,090.07
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		368,319.42	445,150.13
应付托管费		73,663.86	89,030.03
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	25,801.20	157,103.20
应交税费		0.33	2.31

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	400,728.63	100,367.77
负债合计		2,535,811.42	6,039,743.51
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	591,955,051.00	851,955,051.00
未分配利润	6.4.7.10	309,895,907.55	377,881,510.99
所有者权益合计		901,850,958.55	1,229,836,561.99
负债和所有者权益总计		904,386,769.97	1,235,876,305.50

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.5235 元，基金份额总额 591,955,051.00 份。

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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 2 月 3 日(基金合同生效 日)至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		64,006,695.10	24,121,503.07
1. 利息收入		68,782.94	476,915.04
其中：存款利息收入	6.4.7.11	68,463.40	476,911.42
债券利息收入		319.54	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)		58,815,849.50	18,965,186.22

其中：股票投资收益	6.4.7.12	52,434,743.96	17,827,983.52
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	235,088.47	-
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	6,146,017.07	1,137,202.70
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.18	5,773,086.22	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	-651,023.56	619,683.61
减：二、费用		3,644,408.00	1,458,301.04
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,362,224.80	549,397.29
2. 托管费	6.4.10.2.2	472,444.98	109,879.47
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.20	464,549.71	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		0.52	-
7. 其他费用	6.4.7.21	345,187.99	98,647.70
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		60,362,287.10	22,663,202.03
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以 “-”号填列）		60,362,287.10	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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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)	851,955,051.00	377,881,510.99	1,229,836,561.99
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	60,362,287.10	60,362,287.10
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)	-260,000,000.00	-128,347,890.54	-388,347,890.54
其中：1. 基金申购款	8,000,000.00	3,631,030.52	11,631,030.52
2. 基金赎回款	-268,000,000.00	-131,978,921.06	-399,978,921.06
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)	591,955,051.00	309,895,907.55	901,850,958.55
项目	上年度可比期间 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，本基金主要投资于标的指数成份券和备选成份券。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券(包括中小板、创业板及其他中国证监会允许投资的股票和存托凭证)、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。基金的投资组合比例为:本基金投资于标的指数成份券和备选成份券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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金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 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2021 年 1 月 1 日至 2021 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

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。

6.4.5 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 2021 年 6 月 30 日
活期存款	29,436,944.87
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	29,436,944.87

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	806,830,720.98	871,687,650.37	64,856,929.39

贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	529,297.63	547,891.89	18,594.26
	银行间市场	-	-	-
	合计	529,297.63	547,891.89	18,594.26
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		807,360,018.61	872,235,542.26	64,875,523.65

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 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	2,418.79
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	209.34
应收债券利息	41.65
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	150.21
合计	2,819.99

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 2021 年 6 月 30 日
----	---------------------

交易所市场应付交易费用	25,801.20
银行间市场应付交易费用	-
合计	25,801.20

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 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	-
预提费用	149,630.15
应付指数使用费	251,098.48
应退替代款	-
合计	400,728.63

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	851,955,051.00	851,955,051.00
本期申购	8,000,000.00	8,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-268,000,000.00	-268,000,000.00
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	591,955,051.00	591,955,051.00

注：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。

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
上年度末	266,549,218.12	111,332,292.87	377,881,510.99
本期利润	54,589,200.88	5,773,086.22	60,362,287.10
本期基金份额交易产生的变动数	-88,534,331.79	-39,813,558.75	-128,347,890.54
其中：基金申购款	2,985,983.89	645,046.63	3,631,030.52
基金赎回款	-91,520,315.68	-40,458,605.38	-131,978,921.06
本期已分配利润	-	-	-
本期末	232,604,087.21	77,291,820.34	309,895,907.55

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	56,396.25
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	8,985.89
其他	3,081.26
合计	68,463.40

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	37,373,951.59
股票投资收益——赎回差价收入	15,060,792.37
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	52,434,743.96

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	300,156,466.18
减：卖出股票成本总额	262,782,514.59
买卖股票差价收入	37,373,951.59

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	399,978,921.06
减：现金支付赎回款总额	173,442,357.06
减：赎回股票成本总额	211,475,771.63
赎回差价收入	15,060,792.37

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

本基金本报告期内及上年度可比期间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

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	235,088.47

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	235,088.47

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	2,647,543.66
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	2,412,088.18
减：应收利息总额	367.01
买卖债券差价收入	235,088.47

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	6,146,017.07
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	6,146,017.07

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	5,773,086.22
——股票投资	5,754,491.96
——债券投资	18,594.26
——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	5,773,086.22

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	-651,023.56
合计	-651,023.56

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	464,549.71
银行间市场交易费用	-
合计	464,549.71

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
----	------------------------------------

审计费用	19,835.79
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	4,827.13
指数使用费	236,222.51
其他	24,795.19
合计	345,187.99

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

截至财务报告批准报出日，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
招商 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“招商 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 联接”)	本基金的基金管理人管理的其他基金

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 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	成交金额	占当期股票成交总额的比例
招商证券	319,275,735.88	69.92%	693,645,972.51	63.55%

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 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
招商证券	1,946,095.80	73.51%	-	-

6.4.10.1.3 债券回购交易

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债券回购交易。

6.4.10.1.4 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。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
招商证券	73,852.74	80.37%	19,158.77	74.26%
关联方名称	上年度可比期间 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%

注：1、本基金与关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立；

2、基金对该类交易的佣金的计算方式是按合同约定的佣金率计算。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研究成果和市场信息等证券综合服务，并不收取额外对价。

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 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	2,362,224.80	549,397.29
其中：支付销售机构的客户维护费	0.00	0.00

注：支付基金管理人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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 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	472,444.98	109,879.47

注：支付基金托管人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。

6.4.10.4 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。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 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自有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间基金管理人无运用自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

关联方名称	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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
招商 MSCI 中国 A 股国际	566,000,000.	95.62%	820,000,000.	96.25%

通 ETF 联接	00		00	
招商证券股份有限公司	1,820,263.00	0.31%	602,963.00	0.07%

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 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	期末余额	当期利息收入
中国银行	29,436,944.87	56,396.25	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

单位：人民币元

本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
招商证券	001201	东瑞股份	网下申购	477	30,232.26
招商证券	300960	通业科技	网下申购	2,332	28,170.56
招商证券	300968	格林精密	网下申购	11,620	79,829.40
招商证券	300991	创益通	网下申购	2,535	33,107.10
招商证券	688517	金冠电气	网下申购	2,892	22,297.32

上年度可比期间 2020 年 2 月 3 日（基金合同生效日）至 2020 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
-	-	-	-	-	-

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（2021 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	期末成本总额	期末估值总额	备注

							位： 股)			
300614	百川畅银	2021 年 5 月 18 日	2021 年 11 月 25 日	新股锁 定	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300919	中伟股份	2020 年 12 月 15 日	2021 年 7 月 2 日	新股锁 定	24.60	163.00	165	4,059.00	26,895.00	-
300926	博俊科技	2020 年 12 月 29 日	2021 年 7 月 7 日	新股锁 定	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
300927	江天化学	2020 年 12 月 29 日	2021 年 7 月 7 日	新股锁 定	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
300929	华骐环保	2021 年 1 月 12 日	2021 年 7 月 20 日	新股锁 定	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
300932	三友联众	2021 年 1 月 15 日	2021 年 7 月 22 日	新股锁 定	24.69	31.71	453	11,184.57	14,364.63	-
300933	中辰股份	2021 年 1 月 15 日	2021 年 7 月 22 日	新股锁 定	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
300937	药易购	2021 年 1 月 20 日	2021 年 7 月 27 日	新股锁 定	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
300940	南极光	2021 年 1 月 27 日	2021 年 8 月 3 日	新股锁 定	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-
300941	创识科技	2021 年 2 月 2 日	2021 年 8 月 9 日	新股锁 定	21.31	49.94	399	8,502.69	19,926.06	-
300942	易瑞生物	2021 年 2 月 2 日	2021 年 8 月 9 日	新股锁 定	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300943	春晖智控	2021 年 2 月 3 日	2021 年 8 月 10 日	新股锁 定	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300945	曼卡龙	2021 年 2 月 3 日	2021 年 8 月 10 日	新股锁 定	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中生态	2021 年 2 月 18 日	2021 年 8 月 25 日	新股锁 定	13.00	27.42	324	2,808.00	8,884.08	-

300950	德固特	2021年 2月24 日	2021年 9月3 日	新股锁 定	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
300952	恒辉安防	2021年 3月3 日	2021年 9月13 日	新股锁 定	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-
300953	震裕科技	2021年 3月11 日	2021年 9月22 日	新股锁 定	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-
300955	嘉亨家化	2021年 3月16 日	2021年 9月24 日	新股锁 定	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300956	英力股份	2021年 3月16 日	2021年 9月27 日	新股锁 定	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-
300957	贝泰妮	2021年 3月18 日	2021年 9月27 日	新股锁 定	47.33	251.96	694	32,847.02	174,860.24	-
300958	建工修复	2021年 3月18 日	2021年 9月29 日	新股锁 定	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300960	通业科技	2021年 3月22 日	2021年 9月29 日	新股锁 定	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
300961	深水海纳	2021年 3月23 日	2021年 9月30 日	新股锁 定	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300962	中金辐照	2021年 3月29 日	2021年 10月11 日	新股锁 定	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300963	中洲特材	2021年 3月30 日	2021年 10月11 日	新股锁 定	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-
300966	共同药业	2021年 3月31 日	2021年 10月11 日	新股锁 定	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300967	晓鸣股份	2021年 4月2 日	2021年 10月13 日	新股锁 定	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-
300968	格林精密	2021年 4月6 日	2021年 10月15 日	新股锁 定	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-
300971	博亚精工	2021年 4月7 日	2021年 10月15 日	新股锁 定	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-

		日	日							
300973	立高食品	2021 年 4 月 8 日	2021 年 10 月 15 日	新股锁 定	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	-
300975	商络电子	2021 年 4 月 14 日	2021 年 10 月 21 日	新股锁 定	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300978	东箭科技	2021 年 4 月 15 日	2021 年 10 月 26 日	新股锁 定	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300979	华利集团	2021 年 4 月 15 日	2021 年 10 月 26 日	新股锁 定	33.22	87.50	925	30,728.50	80,937.50	-
300981	中红医疗	2021 年 4 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	新股锁 定	48.59	90.39	601	29,202.59	54,324.39	-
300982	苏文电能	2021 年 4 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	新股锁 定	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300985	致远新能	2021 年 4 月 21 日	2021 年 10 月 29 日	新股锁 定	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	-
300986	志特新材	2021 年 4 月 21 日	2021 年 11 月 1 日	新股锁 定	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300987	川网传媒	2021 年 4 月 28 日	2021 年 11 月 11 日	新股锁 定	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300991	创益通	2021 年 5 月 12 日	2021 年 11 月 22 日	新股锁 定	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300992	泰福泵业	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 25 日	新股锁 定	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
300993	玉马遮阳	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 24 日	新股锁 定	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-
300995	奇德新材	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 26 日	新股锁 定	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
300996	普联软件	2021 年 5 月 26 日	2021 年 12 月 3 日	新股锁 定	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-
300997	欢乐家	2021 年	2021 年	新股锁	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-

		5月26日	12月2日	定						
300998	宁波方正	2021年5月25日	2021年12月2日	新股锁定	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301002	崧盛股份	2021年5月27日	2021年12月7日	新股锁定	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
301004	嘉益股份	2021年6月18日	2021年12月27日	新股锁定	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	-
301007	德迈仕	2021年6月4日	2021年12月16日	新股锁定	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
301009	可靠股份	2021年6月8日	2021年12月17日	新股锁定	12.54	27.89	801	10,044.54	22,339.89	-
301010	晶雪节能	2021年6月9日	2021年12月20日	新股锁定	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
301011	华立科技	2021年6月9日	2021年12月17日	新股锁定	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
301012	扬电科技	2021年6月15日	2021年12月22日	新股锁定	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
301015	百洋医药	2021年6月22日	2021年12月30日	新股锁定	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
301016	雷尔伟	2021年6月23日	2021年12月30日	新股锁定	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
301018	申菱环境	2021年6月28日	2021年7月7日	新股锁定	8.29	8.29	7,029	58,270.41	58,270.41	-
301018	申菱环境	2021年6月28日	2022年1月7日	新股锁定	8.29	8.29	782	6,482.78	6,482.78	-
301020	密封科技	2021年6月28日	2021年7月6日	新股锁定	10.64	10.64	3,789	40,314.96	40,314.96	-
301020	密封科技	2021年6月28日	2022年1月6日	新股锁定	10.64	10.64	421	4,479.44	4,479.44	-

301021	英诺激光	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股锁 定	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	-
301021	英诺激光	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 6 日	新股锁 定	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-
605162	新中港	2021 年 6 月 29 日	2021 年 7 月 7 日	新股锁 定	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
605287	德才股份	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股锁 定	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
688067	爱威科技	2021 年 6 月 7 日	2021 年 12 月 16 日	新股锁 定	14.71	24.83	1,259	18,519.89	31,260.97	-
688083	中望软件	2021 年 3 月 4 日	2021 年 9 月 13 日	新股锁 定	150.50	524.08	1,837	276,468.50	962,734.96	-
688117	圣诺生物	2021 年 5 月 26 日	2021 年 12 月 3 日	新股锁 定	17.90	35.97	1,672	29,928.80	60,141.84	-
688226	威腾电气	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 7 日	新股锁 定	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
688276	百克生物	2021 年 6 月 17 日	2021 年 12 月 27 日	新股锁 定	36.35	79.48	3,486	126,716.10	277,067.28	-
688359	三孚新科	2021 年 5 月 14 日	2021 年 11 月 22 日	新股锁 定	11.03	26.35	2,213	24,409.39	58,312.55	-
688636	智明达	2021 年 3 月 30 日	2021 年 10 月 8 日	新股锁 定	34.50	80.72	918	31,671.00	74,100.96	-
688655	迅捷兴	2021 年 4 月 28 日	2021 年 11 月 11 日	新股锁 定	7.59	15.77	3,083	23,399.97	48,618.91	-
688659	元琛科技	2021 年 3 月 24 日	2021 年 10 月 8 日	新股锁 定	6.50	10.46	3,671	23,861.50	38,398.66	-
688667	菱电电控	2021 年 3 月 3 日	2021 年 9 月 13 日	新股锁 定	75.42	103.88	1,191	89,825.22	123,721.08	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认	可流通	流通受	认购	期末估	数量	期末成本总	期末估值	备注
------	------	-----	-----	-----	----	-----	----	-------	------	----

		购日	日	限类型	价格	值单价	(单 位: 张)	额	总额	
113049	长汽转债	2021 年 6 月 10 日	2021 年 7 月 8 日	新债未 上市	100.00	100.00	240	23,999.89	23,999.89	-
113050	南银转债	2021 年 6 月 15 日	2021 年 7 月 1 日	新债未 上市	100.00	100.00	3,960	395,998.26	395,998.26	-
123117	健帆转债	2021 年 6 月 23 日	2021 年 7 月 12 日	新债未 上市	100.00	100.00	193	19,299.87	19,299.87	-
127038	国微转债	2021 年 6 月 10 日	2021 年 7 月 14 日	新债未 上市	100.00	100.00	300	29,999.87	29,999.87	-

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

金额单位：人民币元

股票代 码	股票 名称	停牌日期	停牌 原因	期末 估值 单价	复牌日期	复牌开 盘单价	数量 (股)	期末成本总 额	期末估值总 额	备注
600460	士兰 微	2021 年 6 月 30 日	重大 事项 停牌	56.35	2021 年 7 月 1 日	59.49	25,800	506,959.01	1,453,830.00	-
002024	苏宁 易购	2021 年 6 月 16 日	重大 事项 停牌	5.59	2021 年 7 月 6 日	6.15	183,900	1,629,074.21	1,028,001.00	-

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时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以全面、独立、互相制约为基本原则，建立了全面的合规及风险管理组织架构，包括：董事会及下设专门委员会、监事会、督察长、法律合规部、监察审计部及风险管理部等。

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，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

本基金本报告期末及上年度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

本基金本报告期末及上年度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

本基金本报告期末及上年度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 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	419,998.15	910,996.01
AAA 以下	127,893.74	89,999.57
未评级	-	-
合计	547,891.89	1,000,995.58

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

本基金本报告期末及上年度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

本基金本报告期末及上年度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 2021 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	29,436,944.87	-	-	-	29,436,944.87
结算备付金	519,598.75	-	-	-	519,598.75
存出保证金	370,978.79	-	-	-	370,978.79
交易性金融资产	-	-	547,891.89	871,687,650.37	872,235,542.26
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	2,819.99	2,819.99
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	1,820,885.31	1,820,885.31
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	30,327,522.41	-	547,891.89	873,511,355.67	904,386,769.97
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	368,319.42	368,319.42
应付托管费	-	-	-	73,663.86	73,663.86
应付证券清算款	-	-	-	1,667,297.98	1,667,297.98
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	25,801.20	25,801.20
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	0.33	0.33
其他负债	-	-	-	400,728.63	400,728.63
负债总计	-	-	-	2,535,811.42	2,535,811.42
利率敏感度缺口	30,327,522.41	-	547,891.89	870,975,544.25	901,850,958.55
上年度末 2020 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	62,147,137.61	-	-	-	62,147,137.61
结算备付金	401,373.38	-	-	-	401,373.38
存出保证金	28,826.44	-	-	-	28,826.44
交易性金融资产	-	-	1,000,995.58	1,166,897,542.73	1,167,898,538.31
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	8,799.22	8,799.22
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	5,391,630.54	5,391,630.54
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	62,577,337.43	-	1,000,995.58	1,172,297,972.49	1,235,876,305.50

负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	445,150.13	445,150.13
应付托管费	-	-	-	89,030.03	89,030.03
应付证券清算款	-	-	-	5,248,090.07	5,248,090.07
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	157,103.20	157,103.20
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	2.31	2.31
其他负债	-	-	-	100,367.77	100,367.77
负债总计	-	-	-	6,039,743.51	6,039,743.51
利率敏感度缺口	62,577,337.43	-	1,000,995.58	1,166,258,228.98	1,229,836,561.99

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（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	1. 市场利率平行上升 50 个基点	-15,617.99	-28,132.17
2. 市场利率平行下降 50 个基点	16,160.29	29,096.78	

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 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	871,687,650.37	96.66	1,166,897,542.73	94.88

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	871,687,650.37	96.66	1,166,897,542.73	94.88

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（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
	1. 权益性投资的市场价格上升 5%	43,584,382.52	58,344,877.14
	2. 权益性投资的市场价格下降 5%	-43,584,382.52	-58,344,877.14

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	871,687,650.37	96.38
	其中：股票	871,687,650.37	96.38
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	547,891.89	0.06
	其中：债券	547,891.89	0.06
	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	29,956,543.62	3.31
8	其他资产	2,194,684.09	0.24
9	合计	904,386,769.97	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	9,553,360.84	1.06
B	采矿业	21,860,166.92	2.42
C	制造业	514,261,480.43	57.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	15,807,925.61	1.75
E	建筑业	10,446,896.00	1.16
F	批发和零售业	11,426,028.04	1.27
G	交通运输、仓储和邮政业	25,181,240.90	2.79
H	住宿和餐饮业	1,002,320.00	0.11
I	信息传输、软件和信息技术服务业	25,699,112.75	2.85
J	金融业	166,977,106.14	18.51
K	房地产业	18,431,491.20	2.04
L	租赁和商务服务业	15,787,042.00	1.75
M	科学研究和技术服务业	12,591,827.83	1.40
N	水利、环境和公共设施管理业	977,634.00	0.11
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	912,893.00	0.10
Q	卫生和社会工作	13,748,739.24	1.52
R	文化、体育和娱乐业	4,199,471.00	0.47
S	综合	-	-
	合计	868,864,735.90	96.34

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	5,850.78	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,639,969.26	0.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00
E	建筑业	25,371.37	0.00
F	批发和零售业	46,404.58	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	1,013,138.66	0.11
J	金融业	34,721.10	0.00
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	44,438.33	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,822,914.47	0.31

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	24,467	50,321,278.90	5.58
2	300750	宁德时代	45,400	24,279,920.00	2.69
3	000858	五粮液	75,800	22,580,062.00	2.50
4	600036	招商银行	402,740	21,824,480.60	2.42
5	601318	中国平安	212,700	13,672,356.00	1.52
6	601888	中国中免	38,500	11,553,850.00	1.28
7	300760	迈瑞医疗	23,680	11,367,584.00	1.26
8	600900	长江电力	446,000	9,205,440.00	1.02
9	601012	隆基股份	103,125	9,161,625.00	1.02
10	002594	比亚迪	35,700	8,960,700.00	0.99
11	603288	海天味业	69,130	8,914,313.50	0.99
12	000001	平安银行	380,300	8,602,386.00	0.95
13	600276	恒瑞医药	125,332	8,518,816.04	0.94
14	601166	兴业银行	407,100	8,365,905.00	0.93
15	603259	药明康德	50,437	7,897,929.83	0.88
16	600809	山西汾酒	16,739	7,499,072.00	0.83

17	300015	爱尔眼科	104,638	7,427,205.24	0.82
18	000568	泸州老窖	28,700	6,771,478.00	0.75
19	600309	万华化学	61,596	6,702,876.72	0.74
20	300059	东方财富	203,776	6,681,815.04	0.74
21	601398	工商银行	1,233,100	6,375,127.00	0.71
22	002475	立讯精密	137,069	6,305,174.00	0.70
23	002714	牧原股份	102,762	6,249,984.84	0.69
24	002304	洋河股份	29,600	6,133,120.00	0.68
25	002352	顺丰控股	89,400	6,052,380.00	0.67
26	300122	智飞生物	31,500	5,881,995.00	0.65
27	601919	中远海控	189,600	5,790,384.00	0.64
28	600000	浦发银行	575,300	5,753,000.00	0.64
29	600436	片仔癀	12,200	5,469,260.00	0.61
30	603501	韦尔股份	16,700	5,377,400.00	0.60
31	600030	中信证券	209,100	5,214,954.00	0.58
32	000333	美的集团	69,300	4,945,941.00	0.55
33	600031	三一重工	166,000	4,825,620.00	0.54
34	002142	宁波银行	117,900	4,594,563.00	0.51
35	000002	万科 A	190,200	4,528,662.00	0.50
36	601288	农业银行	1,460,500	4,425,315.00	0.49
37	600887	伊利股份	119,300	4,393,819.00	0.49
38	601816	京沪高铁	803,100	4,248,399.00	0.47
39	000725	京东方 A	664,100	4,143,984.00	0.46
40	002812	恩捷股份	17,100	4,003,110.00	0.44
41	601601	中国太保	133,900	3,879,083.00	0.43
42	300014	亿纬锂能	37,313	3,877,940.09	0.43
43	601668	中国建筑	822,700	3,825,555.00	0.42
44	600438	通威股份	88,300	3,820,741.00	0.42
45	601328	交通银行	769,100	3,768,590.00	0.42
46	300124	汇川技术	50,500	3,750,130.00	0.42
47	601899	紫金矿业	386,800	3,748,092.00	0.42
48	300782	卓胜微	6,760	3,633,500.00	0.40
49	002493	荣盛石化	197,974	3,419,010.98	0.38
50	600104	上汽集团	152,868	3,358,509.96	0.37
51	600019	宝钢股份	436,700	3,336,388.00	0.37
52	300274	阳光电源	28,600	3,290,716.00	0.36
53	600585	海螺水泥	78,200	3,210,110.00	0.36
54	600690	海尔智家	123,700	3,205,067.00	0.36
55	000661	长春高新	8,176	3,164,112.00	0.35
56	600016	民生银行	695,400	3,066,714.00	0.34
57	601818	光大银行	810,700	3,064,446.00	0.34
58	600346	恒力石化	114,900	3,014,976.00	0.33
59	002230	科大讯飞	43,200	2,919,456.00	0.32

60	000538	云南白药	24,900	2,881,428.00	0.32
61	300433	蓝思科技	97,900	2,879,239.00	0.32
62	002241	歌尔股份	67,200	2,872,128.00	0.32
63	300759	康龙化成	13,200	2,864,268.00	0.32
64	600196	复星医药	39,600	2,856,348.00	0.32
65	600048	保利地产	234,600	2,824,584.00	0.31
66	600703	三安光电	87,900	2,817,195.00	0.31
67	002371	北方华创	10,000	2,773,800.00	0.31
68	600893	航发动力	52,000	2,765,880.00	0.31
69	600999	招商证券	145,080	2,759,421.60	0.31
70	600028	中国石化	625,100	2,725,436.00	0.30
71	002027	分众传媒	288,300	2,712,903.00	0.30
72	603799	华友钴业	23,626	2,698,089.20	0.30
73	601066	中信建投	85,309	2,681,261.87	0.30
74	600763	通策医疗	6,500	2,671,500.00	0.30
75	002311	海大集团	32,700	2,668,320.00	0.30
76	002460	赣锋锂业	21,700	2,627,653.00	0.29
77	601658	邮储银行	520,500	2,612,910.00	0.29
78	601211	国泰君安	147,500	2,528,150.00	0.28
79	601088	中国神华	129,508	2,527,996.16	0.28
80	600406	国电南瑞	108,640	2,524,793.60	0.28
81	603986	兆易创新	13,408	2,519,363.20	0.28
82	000063	中兴通讯	75,300	2,502,219.00	0.28
83	300413	芒果超媒	35,100	2,407,860.00	0.27
84	600745	闻泰科技	24,300	2,354,670.00	0.26
85	601225	陕西煤业	195,300	2,314,305.00	0.26
86	000625	长安汽车	87,400	2,296,872.00	0.25
87	002129	中环股份	59,500	2,296,700.00	0.25
88	601229	上海银行	278,194	2,281,190.80	0.25
89	601688	华泰证券	144,200	2,278,360.00	0.25
90	601857	中国石油	423,100	2,238,199.00	0.25
91	600660	福耀玻璃	39,600	2,211,660.00	0.25
92	601100	恒立液压	25,482	2,189,413.44	0.24
93	300454	深信服	8,400	2,179,632.00	0.24
94	600837	海通证券	188,900	2,172,350.00	0.24
95	603486	科沃斯	9,500	2,166,760.00	0.24
96	600588	用友网络	64,360	2,140,613.60	0.24
97	601988	中国银行	688,600	2,120,888.00	0.24
98	000100	TCL 科技	275,200	2,105,280.00	0.23
99	300999	金龙鱼	24,700	2,098,512.00	0.23
100	000338	潍柴动力	117,000	2,090,790.00	0.23
101	601390	中国中铁	397,800	2,084,472.00	0.23
102	000166	申万宏源	442,100	2,069,028.00	0.23

103	601009	南京银行	195,900	2,060,868.00	0.23
104	300601	康泰生物	13,800	2,056,200.00	0.23
105	600919	江苏银行	289,040	2,052,184.00	0.23
106	601169	北京银行	414,600	2,019,102.00	0.22
107	600132	重庆啤酒	9,800	1,939,910.00	0.22
108	600760	中航沈飞	31,860	1,921,158.00	0.21
109	002709	天赐材料	17,960	1,914,176.80	0.21
110	603659	璞泰来	14,000	1,912,400.00	0.21
111	601336	新华保险	41,200	1,891,492.00	0.21
112	600570	恒生电子	20,277	1,890,830.25	0.21
113	601633	长城汽车	43,200	1,883,088.00	0.21
114	002049	紫光国微	12,200	1,881,118.00	0.21
115	300142	沃森生物	30,300	1,869,510.00	0.21
116	603806	福斯特	17,760	1,867,108.80	0.21
117	000596	古井贡酒	7,700	1,844,150.00	0.20
118	601989	中国重工	447,200	1,842,464.00	0.20
119	601628	中国人寿	54,315	1,840,735.35	0.20
120	601155	新城控股	43,888	1,825,740.80	0.20
121	002821	凯莱英	4,900	1,825,740.00	0.20
122	000895	双汇发展	56,600	1,799,880.00	0.20
123	300498	温氏股份	125,200	1,799,124.00	0.20
124	603993	洛阳钼业	346,400	1,787,424.00	0.20
125	601138	工业富联	142,800	1,772,148.00	0.20
126	000776	广发证券	116,000	1,756,240.00	0.19
127	600926	杭州银行	116,300	1,715,425.00	0.19
128	001979	招商蛇口	156,000	1,708,200.00	0.19
129	002050	三花智控	70,740	1,696,345.20	0.19
130	300595	欧普康视	16,340	1,692,007.00	0.19
131	002179	中航光电	21,400	1,691,028.00	0.19
132	000799	酒鬼酒	6,600	1,686,960.00	0.19
133	600989	宝丰能源	121,800	1,666,224.00	0.18
134	002841	视源股份	13,400	1,665,486.00	0.18
135	600600	青岛啤酒	14,300	1,653,795.00	0.18
136	600741	华域汽车	62,000	1,628,740.00	0.18
137	000963	华东医药	34,500	1,587,345.00	0.18
138	600015	华夏银行	251,100	1,554,309.00	0.17
139	300408	三环集团	35,800	1,518,636.00	0.17
140	603899	晨光文具	17,900	1,513,624.00	0.17
141	002601	龙佰集团	43,500	1,504,230.00	0.17
142	601901	方正证券	160,300	1,500,408.00	0.17
143	603882	金域医学	9,300	1,485,861.00	0.16
144	600111	北方稀土	71,500	1,480,050.00	0.16
145	688185	康希诺	1,900	1,477,763.00	0.16

146	300347	泰格医药	7,600	1,469,080.00	0.16
147	600460	士兰微	25,800	1,453,830.00	0.16
148	300628	亿联网络	17,300	1,449,740.00	0.16
149	002001	新和成	50,340	1,443,751.20	0.16
150	601985	中国核电	285,200	1,443,112.00	0.16
151	600150	中国船舶	86,700	1,431,417.00	0.16
152	000768	中航西飞	54,200	1,424,376.00	0.16
153	603833	欧派家居	10,020	1,422,439.20	0.16
154	601877	正泰电器	42,500	1,418,650.00	0.16
155	002568	百润股份	14,820	1,404,787.80	0.16
156	600010	宝钢股份	893,200	1,384,460.00	0.15
157	600547	山东黄金	71,108	1,366,695.76	0.15
158	601788	光大证券	76,100	1,361,429.00	0.15
159	601600	中国铝业	256,500	1,359,450.00	0.15
160	002064	华峰化学	95,300	1,353,260.00	0.15
161	002736	国信证券	125,600	1,350,200.00	0.15
162	000301	东方盛虹	64,300	1,343,870.00	0.15
163	300496	中科创达	8,500	1,335,010.00	0.15
164	603737	三棵树	7,560	1,330,560.00	0.15
165	603369	今世缘	24,500	1,326,920.00	0.15
166	300529	健帆生物	15,330	1,323,898.80	0.15
167	002007	华兰生物	35,990	1,320,113.20	0.15
168	002648	卫星石化	33,660	1,319,135.40	0.15
169	600584	长电科技	35,000	1,318,800.00	0.15
170	600886	国投电力	136,401	1,310,813.61	0.15
171	000786	北新建材	33,200	1,303,100.00	0.14
172	601916	浙商银行	328,000	1,302,160.00	0.14
173	000876	新希望	88,400	1,296,828.00	0.14
174	600426	华鲁恒升	41,750	1,292,162.50	0.14
175	000157	中联重科	138,300	1,277,892.00	0.14
176	002600	领益智造	138,200	1,270,058.00	0.14
177	300316	晶盛机电	25,100	1,267,550.00	0.14
178	002414	高德红外	45,872	1,265,149.76	0.14
179	601799	星宇股份	5,600	1,264,032.00	0.14
180	002791	坚朗五金	6,500	1,261,325.00	0.14
181	601377	兴业证券	130,400	1,259,664.00	0.14
182	601939	建设银行	188,200	1,251,530.00	0.14
183	002236	大华股份	58,700	1,238,570.00	0.14
184	600779	水井坊	9,800	1,238,230.00	0.14
185	000938	紫光股份	56,000	1,225,280.00	0.14
186	603345	安井食品	4,800	1,219,296.00	0.14
187	300033	同花顺	10,800	1,218,024.00	0.14
188	600176	中国巨石	78,225	1,213,269.75	0.13

189	300661	圣邦股份	4,800	1,213,104.00	0.13
190	600029	南方航空	200,400	1,206,408.00	0.13
191	000069	华侨城A	160,400	1,193,376.00	0.13
192	603160	汇顶科技	9,186	1,190,781.18	0.13
193	601966	玲珑轮胎	26,869	1,175,250.06	0.13
194	600958	东方证券	116,900	1,167,831.00	0.13
195	601669	中国电建	300,000	1,161,000.00	0.13
196	601360	三六零	93,600	1,142,856.00	0.13
197	300003	乐普医疗	35,100	1,127,412.00	0.13
198	600115	中国东航	219,342	1,114,257.36	0.12
199	300146	汤臣倍健	33,400	1,098,860.00	0.12
200	600845	宝信软件	21,570	1,097,913.00	0.12
201	002916	深南电路	9,840	1,093,519.20	0.12
202	002074	国轩高科	25,000	1,089,000.00	0.12
203	601233	桐昆股份	44,500	1,072,005.00	0.12
204	600061	国投资本	125,512	1,065,596.88	0.12
205	002938	鹏鼎控股	29,400	1,054,872.00	0.12
206	600143	金发科技	50,100	1,045,086.00	0.12
207	600183	生益科技	44,600	1,044,086.00	0.12
208	601618	中国中冶	350,000	1,043,000.00	0.12
209	601995	中金公司	16,900	1,039,350.00	0.12
210	603517	绝味食品	12,300	1,036,767.00	0.11
211	002024	苏宁易购	183,900	1,028,001.00	0.11
212	601111	中国国航	130,200	1,012,956.00	0.11
213	002459	晶澳科技	20,600	1,009,400.00	0.11
214	300207	欣旺达	30,900	1,006,104.00	0.11
215	002555	三七互娱	41,800	1,004,036.00	0.11
216	600754	锦江酒店	17,600	1,002,320.00	0.11
217	601021	春秋航空	17,600	1,001,440.00	0.11
218	601878	浙商证券	75,700	990,156.00	0.11
219	603816	顾家家居	12,800	989,184.00	0.11
220	002252	上海莱士	131,700	986,433.00	0.11
221	300676	华大基因	8,300	984,380.00	0.11
222	603185	上机数控	5,500	984,225.00	0.11
223	002920	德赛西威	8,900	979,712.00	0.11
224	000425	徐工机械	153,800	979,706.00	0.11
225	601636	旗滨集团	52,000	965,120.00	0.11
226	300751	迈为股份	2,100	954,870.00	0.11
227	300285	国瓷材料	19,400	945,750.00	0.10
228	002602	世纪华通	146,220	938,732.40	0.10
229	600089	特变电工	72,500	931,625.00	0.10
230	600332	白云山	27,500	930,875.00	0.10
231	600161	天坛生物	26,843	919,372.75	0.10

232	600362	江西铜业	41,000	917,580.00	0.10
233	002624	完美世界	38,350	916,948.50	0.10
234	002607	中公教育	43,700	912,893.00	0.10
235	600009	上海机场	18,918	910,523.34	0.10
236	601881	中国银河	84,300	908,754.00	0.10
237	600079	人福医药	32,100	907,467.00	0.10
238	600383	金地集团	88,500	906,240.00	0.10
239	601838	成都银行	71,100	898,704.00	0.10
240	300558	贝达药业	8,300	898,392.00	0.10
241	600885	宏发股份	14,200	890,340.00	0.10
242	600674	川投能源	72,000	887,760.00	0.10
243	601727	上海电气	209,101	886,588.24	0.10
244	002625	光启技术	42,600	886,506.00	0.10
245	300677	英科医疗	7,100	886,080.00	0.10
246	601933	永辉超市	186,500	882,145.00	0.10
247	600352	浙江龙盛	64,000	879,360.00	0.10
248	002340	格林美	93,800	877,030.00	0.10
249	600018	上港集团	182,100	868,617.00	0.10
250	600606	绿地控股	159,100	867,095.00	0.10
251	300450	先导智能	14,400	866,016.00	0.10
252	002080	中材科技	33,000	863,610.00	0.10
253	000703	恒逸石化	72,170	862,431.50	0.10
254	601865	福莱特	21,800	861,754.00	0.10
255	600298	安琪酵母	15,800	859,204.00	0.10
256	688002	睿创微纳	8,600	858,538.00	0.10
257	300144	宋城演艺	51,060	857,808.00	0.10
258	688008	澜起科技	13,700	854,606.00	0.09
259	002508	老板电器	18,300	850,950.00	0.09
260	601117	中国化学	97,000	849,720.00	0.09
261	300223	北京君正	8,400	847,728.00	0.09
262	600219	南山铝业	234,800	845,280.00	0.09
263	603127	昭衍新药	4,600	845,250.00	0.09
264	000066	中国长城	57,600	840,960.00	0.09
265	601216	君正集团	165,100	840,359.00	0.09
266	600862	中航高科	27,300	840,294.00	0.09
267	000825	太钢不锈	111,600	835,884.00	0.09
268	601162	天风证券	171,600	833,976.00	0.09
269	300037	新宙邦	8,300	830,830.00	0.09
270	603658	安图生物	10,950	829,681.50	0.09
271	002353	杰瑞股份	18,500	826,950.00	0.09
272	002202	金风科技	68,000	826,880.00	0.09
273	002185	华天科技	53,600	824,904.00	0.09
274	603589	口子窖	12,100	819,049.00	0.09

275	600315	上海家化	13,600	817,904.00	0.09
276	600489	中金黄金	94,800	817,176.00	0.09
277	300724	捷佳伟创	7,000	812,070.00	0.09
278	603605	珀莱雅	4,100	806,511.00	0.09
279	000977	浪潮信息	28,532	802,605.16	0.09
280	601689	拓普集团	21,400	801,002.00	0.09
281	601607	上海医药	37,900	800,827.00	0.09
282	688009	中国通号	140,700	800,583.00	0.09
283	603233	大参林	15,560	795,271.60	0.09
284	000932	华菱钢铁	120,300	793,980.00	0.09
285	000783	长江证券	108,200	792,024.00	0.09
286	300699	光威复材	10,400	789,880.00	0.09
287	600704	物产中大	99,400	782,278.00	0.09
288	603939	益丰药房	13,936	781,670.24	0.09
289	603456	九洲药业	15,900	772,422.00	0.09
290	002120	韵达股份	56,840	769,045.20	0.09
291	002013	中航机电	75,800	763,306.00	0.08
292	601990	南京证券	72,400	761,648.00	0.08
293	002690	美亚光电	13,600	758,336.00	0.08
294	601696	中银证券	36,700	755,653.00	0.08
295	600109	国金证券	59,300	752,517.00	0.08
296	603444	吉比特	1,400	742,000.00	0.08
297	600188	兖州煤业	48,300	741,888.00	0.08
298	601108	财通证券	70,700	741,643.00	0.08
299	002223	鱼跃医疗	19,400	739,722.00	0.08
300	600655	豫园股份	63,600	737,124.00	0.08
301	002409	雅克科技	9,100	737,100.00	0.08
302	002444	巨星科技	21,600	736,128.00	0.08
303	601872	招商轮船	158,400	731,808.00	0.08
304	002157	正邦科技	60,900	727,755.00	0.08
305	000807	云铝股份	60,900	724,710.00	0.08
306	002673	西部证券	87,700	723,525.00	0.08
307	603638	艾迪精密	16,640	713,356.80	0.08
308	000027	深圳能源	77,300	708,841.00	0.08
309	000830	鲁西化工	37,800	707,994.00	0.08
310	002511	中顺洁柔	25,600	705,280.00	0.08
311	600486	扬农化工	6,300	704,151.00	0.08
312	002032	苏泊尔	11,000	701,690.00	0.08
313	002384	东山精密	33,600	700,224.00	0.08
314	002044	美年健康	76,300	695,093.00	0.08
315	601699	潞安环能	58,700	693,247.00	0.08
316	601077	渝农商行	173,300	691,467.00	0.08
317	603613	国联股份	6,900	689,793.00	0.08

318	688006	杭可科技	8,100	688,500.00	0.08
319	601319	中国人保	115,900	687,287.00	0.08
320	300253	卫宁健康	42,180	686,268.60	0.08
321	002078	太阳纸业	51,200	683,520.00	0.08
322	600699	均胜电子	26,760	682,915.20	0.08
323	002603	以岭药业	23,400	682,344.00	0.08
324	000728	国元证券	85,540	681,753.80	0.08
325	300357	我武生物	10,600	679,672.00	0.08
326	000050	深天马 A	47,900	679,222.00	0.08
327	600705	中航产融	174,900	676,863.00	0.08
328	000739	普洛药业	23,000	676,200.00	0.07
329	002430	杭氧股份	19,500	674,505.00	0.07
330	002180	纳思达	20,800	669,760.00	0.07
331	002294	信立泰	20,300	667,870.00	0.07
332	000983	山西焦煤	80,220	666,628.20	0.07
333	000800	一汽解放	60,900	658,938.00	0.07
334	600392	盛和资源	37,800	656,208.00	0.07
335	002405	四维图新	44,400	652,680.00	0.07
336	002372	伟星新材	31,300	646,971.00	0.07
337	600827	百联股份	32,000	644,800.00	0.07
338	002507	涪陵榨菜	17,100	643,986.00	0.07
339	600872	中炬高新	15,200	638,704.00	0.07
340	600369	西南证券	130,300	634,561.00	0.07
341	000723	美锦能源	83,700	632,772.00	0.07
342	601555	东吴证券	75,810	632,255.40	0.07
343	600372	中航电子	38,000	628,900.00	0.07
344	600038	中直股份	11,900	627,606.00	0.07
345	000513	丽珠集团	12,500	625,250.00	0.07
346	002156	通富微电	26,000	625,040.00	0.07
347	002541	鸿路钢构	10,700	624,345.00	0.07
348	600739	辽宁成大	30,000	624,300.00	0.07
349	600233	圆通速递	62,100	621,621.00	0.07
350	300251	光线传媒	57,500	621,575.00	0.07
351	603707	健友股份	14,870	620,822.50	0.07
352	601615	明阳智能	37,900	613,601.00	0.07
353	002152	广电运通	46,900	611,107.00	0.07
354	601058	赛轮轮胎	61,100	610,389.00	0.07
355	600011	华能国际	143,600	605,992.00	0.07
356	000656	金科股份	104,400	604,476.00	0.07
357	600522	中天科技	60,200	602,000.00	0.07
358	600177	雅戈尔	90,900	599,031.00	0.07
359	600875	东方电气	54,400	596,768.00	0.07
360	600803	新奥股份	36,100	596,011.00	0.07

361	600521	华海药业	28,490	594,871.20	0.07
362	000860	顺鑫农业	14,100	594,738.00	0.07
363	000547	航天发展	31,500	594,405.00	0.07
364	600642	申能股份	96,600	593,124.00	0.07
365	601198	东兴证券	53,990	590,110.70	0.07
366	002138	顺络电子	15,200	589,304.00	0.07
367	603267	鸿远电子	4,600	588,432.00	0.07
368	002797	第一创业	82,300	587,622.00	0.07
369	600039	四川路桥	93,500	586,245.00	0.07
370	000021	深科技	30,600	585,684.00	0.06
371	300482	万孚生物	9,020	583,503.80	0.06
372	002030	达安基因	27,424	582,485.76	0.06
373	002299	圣农发展	24,300	580,284.00	0.06
374	300136	信维通信	18,700	577,456.00	0.06
375	600549	厦门钨业	27,700	576,991.00	0.06
376	603866	桃李面包	18,380	573,456.00	0.06
377	603338	浙江鼎力	9,748	572,110.12	0.06
378	600536	中国软件	10,000	569,300.00	0.06
379	600998	九州通	36,900	567,153.00	0.06
380	002422	科伦药业	28,200	562,590.00	0.06
381	002939	长城证券	50,500	562,065.00	0.06
382	000630	铜陵有色	206,300	561,136.00	0.06
383	600848	上海临港	31,240	559,196.00	0.06
384	002385	大北农	82,100	558,280.00	0.06
385	600895	张江高科	30,400	555,408.00	0.06
386	300308	中际旭创	14,400	554,688.00	0.06
387	600415	小商品城	107,400	553,110.00	0.06
388	600516	方大炭素	74,227	552,248.88	0.06
389	600066	宇通客车	43,530	543,689.70	0.06
390	002429	兆驰股份	88,800	539,016.00	0.06
391	603712	七一二	14,800	534,280.00	0.06
392	600380	健康元	38,600	529,978.00	0.06
393	002463	沪电股份	33,900	524,433.00	0.06
394	002266	浙富控股	104,800	522,952.00	0.06
395	002563	森马服饰	43,700	522,215.00	0.06
396	600909	华安证券	93,700	521,909.00	0.06
397	002373	千方科技	31,100	519,370.00	0.06
398	000975	银泰黄金	54,280	516,202.80	0.06
399	000709	河钢股份	208,400	512,664.00	0.06
400	002925	盈趣科技	13,140	511,277.40	0.06
401	600598	北大荒	34,100	510,136.00	0.06
402	000999	华润三九	18,900	505,575.00	0.06
403	002010	传化智联	65,000	501,150.00	0.06

404	603858	步长制药	22,146	498,063.54	0.06
405	002926	华西证券	51,300	494,019.00	0.05
406	603218	日月股份	18,200	492,856.00	0.05
407	600988	赤峰黄金	32,700	490,173.00	0.05
408	601456	国联证券	31,700	488,180.00	0.05
409	601231	环旭电子	28,900	485,809.00	0.05
410	002065	东华软件	61,100	484,523.00	0.05
411	600170	上海建工	174,600	481,896.00	0.05
412	002146	荣盛发展	85,200	480,528.00	0.05
413	600867	通化东宝	40,100	478,794.00	0.05
414	002242	九阳股份	14,700	477,603.00	0.05
415	600511	国药股份	14,400	476,064.00	0.05
416	300463	迈克生物	11,300	475,617.00	0.05
417	000423	东阿阿胶	13,220	474,730.20	0.05
418	002500	山西证券	70,710	474,464.10	0.05
419	002075	沙钢股份	43,300	472,403.00	0.05
420	002153	石基信息	19,960	469,259.60	0.05
421	002456	欧菲光	52,700	467,976.00	0.05
422	600801	华新水泥	26,600	467,362.00	0.05
423	002127	南极电商	47,700	466,029.00	0.05
424	600160	巨化股份	52,700	465,868.00	0.05
425	002958	青农商行	108,800	465,664.00	0.05
426	000738	航发控制	22,300	464,509.00	0.05
427	000987	越秀金控	36,200	458,292.00	0.05
428	600027	华电国际	132,800	456,832.00	0.05
429	000988	华工科技	19,400	456,288.00	0.05
430	300070	碧水源	62,200	454,682.00	0.05
431	600153	建发股份	56,000	453,600.00	0.05
432	002212	天融信	22,900	452,733.00	0.05
433	000750	国海证券	106,600	451,984.00	0.05
434	601099	太平洋	133,300	451,887.00	0.05
435	600688	上海石化	119,800	450,448.00	0.05
436	002557	洽洽食品	10,231	440,956.10	0.05
437	002558	巨人网络	33,100	440,230.00	0.05
438	600256	广汇能源	132,100	439,893.00	0.05
439	601992	金隅集团	163,400	439,546.00	0.05
440	002151	北斗星通	10,200	439,314.00	0.05
441	000961	中南建设	73,700	436,304.00	0.05
442	300383	光环新网	30,200	434,578.00	0.05
443	603883	老百姓	8,240	434,083.20	0.05
444	601598	中国外运	85,800	433,290.00	0.05
445	300773	拉卡拉	15,300	431,919.00	0.05
446	600859	王府井	14,800	427,424.00	0.05

447	002465	海格通信	44,800	423,808.00	0.05
448	600026	中远海能	68,200	420,112.00	0.05
449	000671	阳光城	80,500	418,600.00	0.05
450	603027	千禾味业	15,880	417,485.20	0.05
451	002081	金螳螂	52,400	415,008.00	0.05
452	002705	新宝股份	15,800	414,750.00	0.05
453	002019	亿帆医药	24,000	414,000.00	0.05
454	000998	隆平高科	25,800	413,832.00	0.05
455	600498	烽火通信	22,000	409,860.00	0.05
456	600529	山东药玻	12,000	407,400.00	0.05
457	002727	一心堂	12,200	403,942.00	0.04
458	600879	航天电子	53,200	400,064.00	0.04
459	000729	燕京啤酒	55,200	399,648.00	0.04
460	600340	华夏幸福	76,210	399,340.40	0.04
461	002506	协鑫集成	114,700	399,156.00	0.04
462	002683	宏大爆破	14,300	397,111.00	0.04
463	300088	长信科技	47,900	395,654.00	0.04
464	000402	金融街	58,600	395,550.00	0.04
465	600583	海油工程	86,600	389,700.00	0.04
466	300296	利亚德	49,500	387,090.00	0.04
467	000629	攀钢钒钛	168,300	385,407.00	0.04
468	000686	东北证券	45,500	384,475.00	0.04
469	000540	中天金融	137,100	374,283.00	0.04
470	300418	昆仑万维	22,800	373,464.00	0.04
471	001914	招商积余	20,600	353,908.00	0.04
472	300212	易华录	13,120	353,059.20	0.04
473	000627	天茂集团	97,200	351,864.00	0.04
474	000623	吉林敖东	22,600	350,074.00	0.04
475	000581	威孚高科	16,100	335,363.00	0.04
476	601128	常熟银行	53,700	332,940.00	0.04
477	000401	冀东水泥	26,300	324,805.00	0.04
478	002399	海普瑞	20,200	321,786.00	0.04
479	601098	中南传媒	35,400	312,228.00	0.03
480	002131	利欧股份	132,100	309,114.00	0.03
481	002572	索菲亚	9,200	222,640.00	0.02

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	688083	中望软件	1,837	962,734.96	0.11

2	688276	百克生物	3,486	277,067.28	0.03
3	300957	贝泰妮	694	174,860.24	0.02
4	688667	菱电电控	1,191	123,721.08	0.01
5	300979	华利集团	925	80,937.50	0.01
6	688636	智明达	918	74,100.96	0.01
7	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.01
8	688117	圣诺生物	1,672	60,141.84	0.01
9	688359	三孚新科	2,213	58,312.55	0.01
10	300981	中红医疗	601	54,324.39	0.01
11	688655	迅捷兴	3,083	48,618.91	0.01
12	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.00
13	300894	火星人	628	42,704.00	0.00
14	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
15	688659	元琛科技	3,671	38,398.66	0.00
16	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
17	688067	爱威科技	1,259	31,260.97	0.00
18	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
19	300919	中伟股份	165	26,895.00	0.00
20	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
21	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
22	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00
23	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00
24	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
25	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
26	300932	三友联众	453	14,364.63	0.00
27	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
28	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
29	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
30	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
31	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
32	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
33	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
34	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
35	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
36	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
37	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
38	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
39	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
40	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
41	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
42	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
43	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
44	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00

45	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
46	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
47	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
48	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
49	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
50	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
51	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
52	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
53	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
54	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
55	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
56	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
57	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
58	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
59	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
60	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
61	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
62	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
63	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
64	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
65	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
66	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
67	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
68	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
69	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
70	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
71	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
72	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
73	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
74	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
75	301010	晶雪节能	218	3,838.98	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	000333	美的集团	7,251,130.00	0.59
2	600519	贵州茅台	5,905,282.00	0.48
3	300999	金龙鱼	4,421,838.46	0.36
4	300760	迈瑞医疗	3,839,095.00	0.31
5	601816	京沪高铁	3,470,832.00	0.28

6	300750	宁德时代	2,917,328.04	0.24
7	000858	五粮液	2,730,388.00	0.22
8	002352	顺丰控股	2,522,415.00	0.21
9	300759	康龙化成	2,444,679.65	0.20
10	601658	邮储银行	2,174,493.00	0.18
11	600809	山西汾酒	1,880,111.00	0.15
12	600989	宝丰能源	1,861,038.00	0.15
13	600036	招商银行	1,770,360.00	0.14
14	601318	中国平安	1,680,456.00	0.14
15	600150	中国船舶	1,577,994.00	0.13
16	603501	韦尔股份	1,533,020.00	0.12
17	600584	长电科技	1,442,823.00	0.12
18	002064	华峰化学	1,248,092.00	0.10
19	601398	工商银行	1,195,438.00	0.10
20	601066	中信建投	1,189,756.00	0.10

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	占期初基金资产净值比例（%）
1	002415	海康威视	14,415,000.78	1.17
2	000858	五粮液	13,040,273.58	1.06
3	300750	宁德时代	10,865,549.69	0.88
4	300760	迈瑞医疗	6,032,679.00	0.49
5	000001	平安银行	4,564,093.23	0.37
6	002714	牧原股份	4,037,116.20	0.33
7	002271	东方雨虹	4,029,271.89	0.33
8	002352	顺丰控股	3,973,788.83	0.32
9	000568	泸州老窖	3,894,448.00	0.32
10	002475	立讯精密	3,832,114.93	0.31
11	002594	比亚迪	3,765,342.46	0.31
12	601766	中国中车	3,712,415.92	0.30
13	300015	爱尔眼科	3,390,853.00	0.28
14	002304	洋河股份	3,341,445.98	0.27
15	600050	中国联通	3,158,707.00	0.26
16	300059	东方财富	3,119,131.00	0.25
17	000002	万科 A	3,023,864.90	0.25
18	300122	智飞生物	2,642,910.00	0.21

19	601186	中国铁建	2,541,391.00	0.21
20	002142	宁波银行	2,454,624.28	0.20

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	166,910,154.90
卖出股票收入（成交）总额	300,156,466.18

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）	547,891.89	0.06
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	547,891.89	0.06

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	113050	南银转债	3,960	395,998.26	0.04
2	127036	三花转债	600	78,594.00	0.01
3	127038	国微转债	300	29,999.87	0.00

4	113049	长汽转债	240	23,999.89	0.00
5	123117	健帆转债	193	19,299.87	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 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招商银行（证券代码 600036）、中国平安（证券代码 601318）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、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。

2、中国平安（证券代码 601318）

根据 2021 年 2 月 23 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。

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	370,978.79
2	应收证券清算款	1,820,885.31
3	应收股利	-
4	应收利息	2,819.99
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,194,684.09

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	688083	中望软件	962,734.96	0.11	新股锁定
2	688276	百克生物	277,067.28	0.03	新股锁定
3	300957	贝泰妮	174,860.24	0.02	新股锁定
4	688667	菱电电控	123,721.08	0.01	新股锁定
5	300979	华利集团	80,937.50	0.01	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		招商 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 联接	
		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
762	776,843.90	570,543,063.00	96.38%	21,411,988.00	3.62%	566,000,000.00	95.62%

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	方正证券股份有限公司	2,334,500.00	0.39%
2	招商证券股份有限公司	1,820,263.00	0.31%
3	张永峰	1,000,000.00	0.17%
4	陈桂琴	1,000,000.00	0.17%
5	梁维灿	600,000.00	0.10%
6	洪培新	500,000.00	0.08%
7	孙奇峰	465,000.00	0.08%
8	陶沙	453,900.00	0.08%
9	王喆	350,100.00	0.06%
10	李和明	300,000.00	0.05%
11	毛曼莉	300,000.00	0.05%

12	林永根	300,000.00	0.05%
-	招商 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 联接	566,000,000.00	95.62%

注：前十名持有人为除招商 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 联接基金以外的前十名持有人。

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
本报告期期初基金份额总额	851,955,051.00
本报告期基金总申购份额	8,000,000.00
减：报告期基金总赎回份额	268,000,000.00
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	591,955,051.00

§ 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 2021 年 3 月 6 日的公告，经招商基金管理有限公司第六届董事会 2021 年第二次会议审议通过，同意沙骏先生离任副总经理。

根据本基金管理人 2021 年 6 月 5 日的公告，经招商基金管理有限公司第六届董事会 2021 年第六次会议审议通过，同意选举王小青先生担任公司董事长，刘辉女士不再担任公司董事长。

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	319,275,735.88	69.92%	73,852.74	80.37%	-
方正证券	5	137,359,745.32	30.08%	18,036.14	19.63%	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	3	-	-	-	-	-
长江证券	4	-	-	-	-	-
大通证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	3	-	-	-	-	-
东北证券	3	-	-	-	-	-
东方财富	3	-	-	-	-	-
东方证券	3	-	-	-	-	-
东兴证券	3	-	-	-	-	-

光大证券	3	-	-	-	-	-
广发证券	3	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安 证券	3	-	-	-	-	-
国信证券	3	-	-	-	-	-
海通证券	3	-	-	-	-	-
华安证券	3	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	4	-	-	-	-	-
华西证券	3	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	3	-	-	-	-	-
瑞信方正	2	-	-	-	-	-
上海证券	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	-	-	-	-	-
湘财证券	2	-	-	-	-	-
新时代证 券	1	-	-	-	-	-
信达证券	5	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
中航证券	2	-	-	-	-	-
中金财富 证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	3	-	-	-	-	-
中泰证券	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	1,946,095.80	73.51%	-	-	-	-
方正证券	701,447.86	26.49%	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
瑞信方正	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-

申万宏源	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证 券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
新时代证 券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
中金财富 证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
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	招商基金管理有限公司关于基金直销账户信息变更的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-13
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 2020 年第 4 季度报告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-21
3	招商基金管理有限公司旗下基金 2020 年第 4 季度报告提示性公告	上海证券报及基金管理人网站	2021-01-21
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产品资料概要更新	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-02-02
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更新的招募说明书（二零二一年第一号）	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-02-02
6	招商基金管理有限公司关于高级管理人员变更	上海证券报、基金管	2021-03-06

	的公告	理人网站及中国证监会基金电子披露网站	
7	招商基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-24
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 2020 年年度报告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-30
9	招商基金管理有限公司旗下基金 2020 年年度报告提示性公告	上海证券报及基金管理人网站	2021-03-30
10	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（2021 年 3 月 31 日修订）	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-31
11	招商基金管理有限公司关于修订旗下部分公募基金基金合同的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-31
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更新的招募说明书（二零二一年第二号）	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-04-06
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基金产品资料概要更新	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-04-06
14	招商基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-04-08
15	招商基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-04-17
16	招商 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-04-21
17	招商基金管理有限公司旗下基金 2021 年第 1 季度报告提示性公告	上海证券报及基金管理人网站	2021-04-21
18	招商基金管理有限公司关于提醒投资者持续完善身份信息资料的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-05-07
19	关于招商基金管理有限公司旗下部分基金增加第一创业证券股份有限公司为场内申购赎回代办券商的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-05-10
20	招商基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-05-13
21	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、基金管理人网站及中国证监会	2021-06-05

		会基金电子披露网站	
22	招商基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-06-11

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
招商 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 联接	1	20210101-20210630	820,000,000.00	2,000,000.00	256,000,000.00	566,000,000.00	95.62%
产品特有风险							
本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况，可能会出现集中赎回甚至巨额赎回从而引发基金净值剧烈波动，甚至引发基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。							

注：1、报告期末持有份额占比按照四舍五入方法保留至小数点后第 2 位；

2、申购份额包含申购、定期定额投资、转换转入、红利再投资、买入等业务增加的份额，赎回份额包含赎回、转换转出、卖出等业务减少的份额。

§ 12 备查文件目录

12.1 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。

12.2 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

12.3 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 8 月 30 日