

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 年年度报告

2021 年 12 月 31 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：2022 年 3 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 3 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告财务资料已经审计，德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了 2021 年度无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况.....	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	7
§4 管理人报告.....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	11
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.9 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	12
§5 托管人报告.....	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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.....	13
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	13
§6 审计报告.....	13
6.1 审计报告的基本内容.....	13
§7 年度财务报表.....	15
7.1 资产负债表.....	15
7.2 利润表.....	17
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
7.4 报表附注.....	19
§8 投资组合报告.....	45
8.1 期末基金资产组合情况.....	45
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	46
8.3 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.....	47
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	61
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	62
8.6 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.....	63

8.7	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.....	63
8.8	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.....	63
8.9	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.....	63
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	63
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	64
8.12	投资组合报告附注.....	64
§9	基金份额持有人信息.....	65
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	65
9.2	期末上市基金前十名持有人.....	66
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	66
9.4	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.....	66
§10	开放式基金份额变动.....	66
§11	重大事件揭示.....	66
11.1	基金份额持有人大会决议.....	67
11.2	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.....	67
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	67
11.4	基金投资策略的改变.....	67
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	67
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	67
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	67
11.8	其他重大事件.....	70
§12	影响投资者决策的其他重要信息.....	73
12.1	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.....	73
§13	备查文件目录.....	73
13.1	备查文件目录.....	74
13.2	存放地点.....	74
13.3	查阅方式.....	74

§ 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	517,955,051.00 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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.cmfchina.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）	中国上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2021 年	2020 年 2 月 3 日-2020 年 12 月 31 日
本期已实现收益	74,896,197.69	35,021,575.73
本期利润	49,713,054.89	94,124,013.16

加权平均基金份额本期利润	0.0833	0.4210
本期加权平均净值利润率	5.64%	36.20%
本期基金份额净值增长率	4.38%	44.35%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末	2020 年末
期末可供分配利润	221,956,570.35	266,549,218.12
期末可供分配基金份额利润	0.4285	0.3129
期末基金资产净值	780,395,212.39	1,229,836,561.99
期末基金份额净值	1.5067	1.4435
3.1.3 累计期末指标	2021 年末	2020 年末
基金份额累计净值增长率	50.67%	44.35%

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。

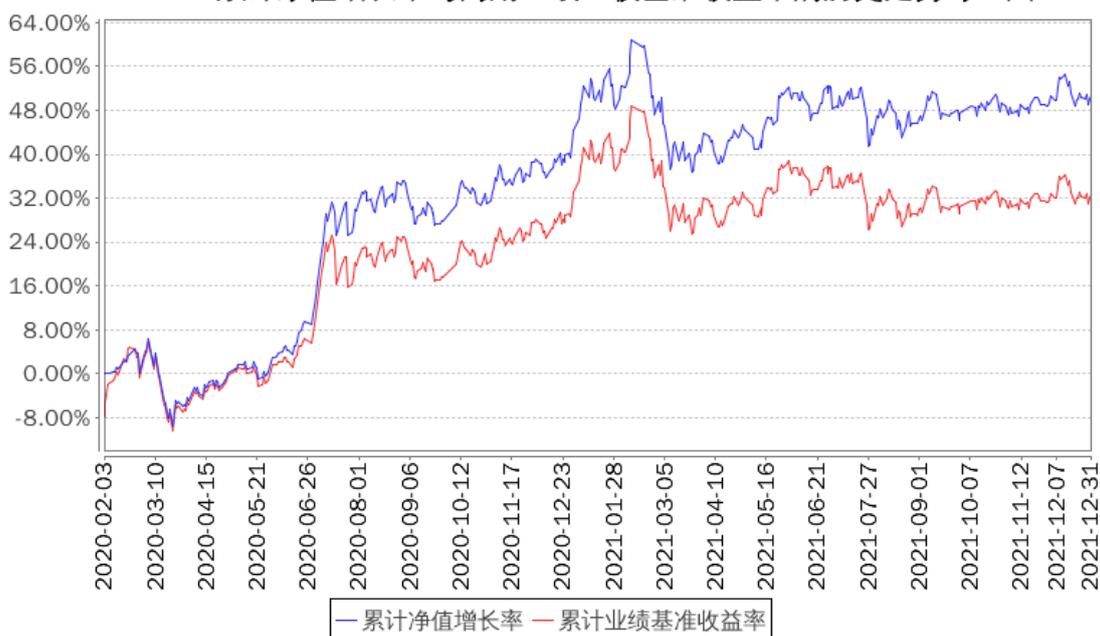
3.2 基金净值表现

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
过去三个月	2.09%	0.72%	1.57%	0.75%	0.52%	-0.03%
过去六个月	-1.10%	0.95%	-3.66%	0.99%	2.56%	-0.04%
过去一年	4.38%	1.12%	-0.40%	1.16%	4.78%	-0.04%
自基金合同生效起至今	50.67%	1.19%	32.58%	1.31%	18.09%	-0.12%

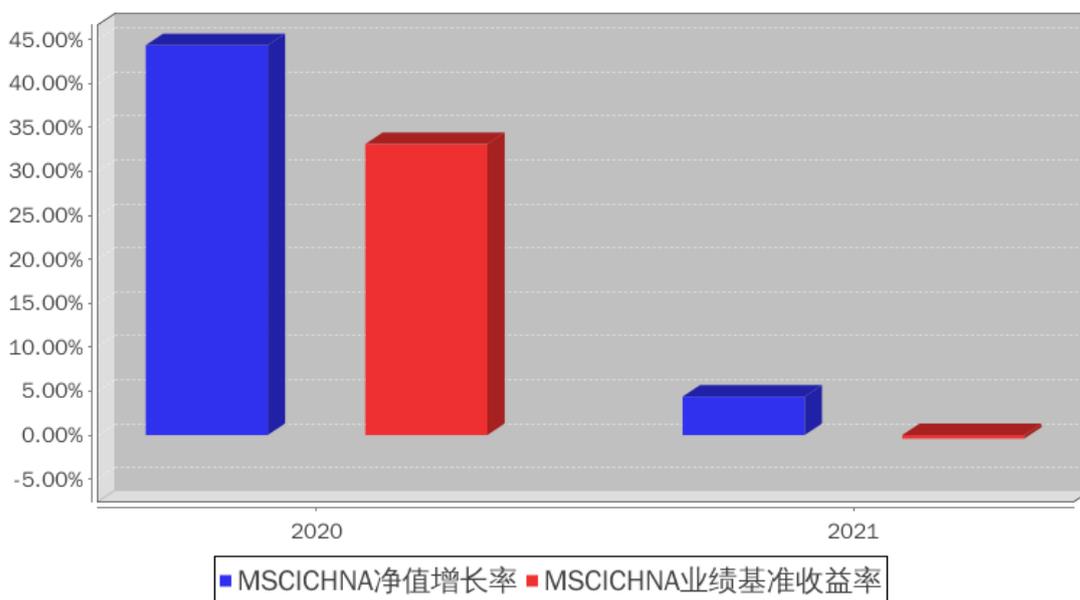
3.2.2 自基金合同生效/自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

MSCICHNA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



3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

MSCICHNA基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金于2020年2月3日成立，截至2020年12月31日基金成立未满1年，故成立当年净值增长率按当年实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金于2020年2月3日成立，自基金合同生效日以来未进行利润分配。

§ 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、公募基金投顾业务资格，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	-	14	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 公平交易制度和控制方法

基金管理人根据《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》和《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》（2011 年修订）的规定，制定了《招商基金管理有限公司公平交易管理办法》，对投资决策的内部控制、交易执行的内部控制、公平交易实施情况的监控与检查稽核、异常交易的监控等进行了规定。为保证各投资组合在投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会，基金管理人合理设置了各类资产管理业务之间以及各类资产管理业务内部的组织结构，建立了科学的投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 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。

4.3.3 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

2021 年，疫苗接种先后在全球铺开，但受制于疫苗产能瓶颈及分配不均的影响，全球各国疫苗接种进度参差不齐，进而导致了全球各国出现“防疫力落差”。发达国家如欧美等国作为疫苗研发及生产国率先普及接种，形成了较强的免疫屏障，在此基础上逐步松懈线下经济活动限制，领先迈入经济正常化进程。而新兴及发展中国家（除中国外）前期受疫苗供应问题影响，疫苗普及进度滞后，经济正常化进程进展缓慢。在全球供应链中，发达国家占据下游消费端而发展中及新兴市场国家则处于全球供应的上中游，上下游经济正常化进程的不同步导致了全球产业链供需的阶段性的错配，叠加全球控碳及地缘政治扰动共同推高了全球的通胀水平，进而导致全球主要国家货币政策开始由松转紧。

国内来看，全球产业链供需的错配继续支撑着中国出口高位运行；但受持续收紧的金融条件的影响，部分杠杆率较高的房企开始“暴雷”，地产投资受到一定的冲击，同时基建投资并未发力，叠加消费疲软的影响，全年经济疲弱不振。从资本市场表现来看，在年初的“春季躁动”后，大盘指数回吐了全部涨幅，全年维持弱势震荡态势。

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 4.38%，同期业绩基准增长率为-0.40%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2022 年，omicron 变异毒株以高逃逸的特性给市场带来了一定的冲击，但新冠口服药的研发及陆续投产给人们带来了真正摆脱新冠病毒阴影的希望，“疫苗+口服药”方案会有助于带领全球各国继续迈向正常化。但需要关注的是，外围各国正常化进程中货币政策收紧可能会对全球资本市场产生一定的冲击。国内方面，随着稳经济政策的实施，市场盈利和风险偏好有望得到一定的修复，但仍需注意外围流动性收紧及地缘政治等潜在风险带来的扰动。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人本着诚实信用、勤勉尽责、合法经营和保障基金持有人利益的原则，经营管理和业务运作稳健、合规，基金的投资、交易、后台等运作规范有序。基金管理人的风险管理及合规控制部门依据独立、客观、公正的原则，主要从以下几个方面进一步加强了公司内部控制和基金投资风险管理工作：

1、公司实施了员工全面培训和形式多样的专题培训，包括不定期推送监管动态和风险案例，持续整理风险点录入系统定期推送，定期或不定期组织法规考试，不定期开展各类合规主题培训等，丰富培训形式，不断提升员工合规与风控意识；

2、公司合规风控部门通过事中合规控制系统、事后投资风险管理系统、风险管理模型等对基金投资合规情况及风险情况进行严格的内部监控和管理；

3、定期稽核方面，除了每季度会对各业务领域进行一次全面的稽核，公司合规审计部门还根据监察稽核计划，对公司的关键业务部门及业务流程进行了专项稽核和检查；

4、根据法律法规的更新及业务的发展变化情况，公司各业务部门对相关内部控制制度提出修改意见和建议，并关注内部控制制度的健全性和有效性，进一步完善了公司内控制度体系，更好的防范法律风险和合规风险。

报告期内，本基金的投资运作符合国家相关法律法规、监管部门的有关规定以及公司相关制度的规定。本基金的投资目标、投资决策依据和投资管理程序均符合相关基金合同和招募说明书的约定，未发现重大异常交易、利益输送、内幕交易及其他有损基金投资者利益的情形。报告期内，本基金若曾因市场波动、申购赎回等原因出现了相关投资比例限制被动突破的情形，均在法规规定的时间内完成了调整，符合法律法规和基金合同的规定和要求。报告期内，本基金未出现因权证未行权、可转债未及时卖出或转股等有损基金份额持有人利益的投资失误行为。本基金管理人承诺将一如既往本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产，在规范经营、控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。

4.7 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，咨询会计师事务所的专业意见，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。

4.8 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。

4.9 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 托管人对本年度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 审计报告

6.1 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	招商 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金全体持有人
审计意见	我们审计了招商 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金的财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了招商 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部

	<p>分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于招商 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>招商基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括招商 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估招商 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算招商 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金、终止经营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督招商 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、</p>

	<p>适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2)了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3)评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和做出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4)对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对招商 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致招商 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5)评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	汪芳 刘典昆
会计师事务所的地址	中国上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼
审计报告日期	2022 年 3 月 29 日

§ 7 年度财务报表

7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	25,451,041.42	62,147,137.61
结算备付金		353,729.56	401,373.38
存出保证金		22,711.58	28,826.44

交易性金融资产	7.4.7.2	770,352,112.68	1,167,898,538.31
其中：股票投资		766,491,916.48	1,166,897,542.73
基金投资		-	-
债券投资		3,860,196.20	1,000,995.58
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	5,391,630.54
应收利息	7.4.7.5	14,475.91	8,799.22
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		796,194,071.15	1,235,876,305.50
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		14,698,607.46	5,248,090.07
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		336,506.09	445,150.13
应付托管费		67,301.23	89,030.03
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	30,618.55	157,103.20
应交税费		-	2.31
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	665,825.43	100,367.77
负债合计		15,798,858.76	6,039,743.51
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	517,955,051.00	851,955,051.00
未分配利润	7.4.7.10	262,440,161.39	377,881,510.99
所有者权益合计		780,395,212.39	1,229,836,561.99
负债和所有者权益总计		796,194,071.15	1,235,876,305.50

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.5067 元，基金份额总额 517,955,051.00 份。

7.2 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12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2021年1月1日至 2021年12月31日	上年度可比期间2020年 2月3日(基金合同生效 日)至2020年12月31 日
一、收入		56,450,711.71	96,857,328.57
1.利息收入		130,689.52	504,648.85
其中：存款利息收入	7.4.7.11	126,993.92	504,565.98
债券利息收入		3,695.60	82.87
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）		82,184,360.96	36,220,028.00
其中：股票投资收益	7.4.7.12	68,724,784.99	34,435,209.57
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	525,888.58	29,174.51
资产支持证券投资 收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	12,933,687.39	1,755,643.92
3.公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	7.4.7.17	-25,183,142.80	59,102,437.43
4.汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-” 号填列）	7.4.7.18	-681,195.97	1,030,214.29
减：二、费用		6,737,656.82	2,733,315.41
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	4,424,840.80	1,143,148.48
2.托管费	7.4.10.2.2	884,968.21	228,629.75
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	7.4.7.19	763,670.79	1,120,814.02
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-

6.税金及附加		0.67	0.24
7.其他费用	7.4.7.20	664,176.35	240,722.92
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		49,713,054.89	94,124,013.16
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		49,713,054.89	94,124,013.16

7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 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）	-	49,713,054.89	49,713,054.89
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）	-334,000,000.00	-165,154,404.49	-499,154,404.49
其中：1.基金申购款	22,000,000.00	10,346,805.58	32,346,805.58
2.基金赎回款	-356,000,000.00	-175,501,210.07	-531,501,210.07
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）	517,955,051.00	262,440,161.39	780,395,212.39
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 12 月 31 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）	-	94,124,013.16	94,124,013.16
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）	344,000,000.00	283,757,497.83	627,757,497.83
其中：1.基金申购款	874,000,000.00	322,880,691.48	1,196,880,691.48

2.基金赎回款	-530,000,000.00	-39,123,193.65	-569,123,193.65
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）	851,955,051.00	377,881,510.99	1,229,836,561.99

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 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。

7.4.2 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。

7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及自 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 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。

7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

7.4.4.3 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中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。

7.4.4.4 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、该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移或虽然既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产的控制，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。

7.4.4.5 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；对于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、首次公开发行时股票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，按照监管机构或行业协会的有关规定确定公允价值。

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。

7.4.4.6 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。

7.4.4.7 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。

7.4.4.8 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)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

1) 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。

2) 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扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后净额确认。

3) 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，并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬和基金托管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。

7.4.4.11 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。

7.4.4.12 外币交易

本基金本报告期内无外币交易。

7.4.4.13 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。

7.4.4.14 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股票投资和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。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

根据财税[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]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、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]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、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，暂不计缴企业所得税。

(3) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司代扣代缴个人所得税；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。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	25,451,041.42	62,147,137.61
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	25,451,041.42	62,147,137.61

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	732,574,421.85	766,491,916.48	33,917,494.63

贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	3,858,396.20	3,860,196.20	1,800.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	3,858,396.20	3,860,196.20	1,800.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		736,432,818.05	770,352,112.68	33,919,294.63
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日			
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		1,107,795,105.30	1,166,897,542.73	59,102,437.43
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	1,000,995.58	1,000,995.58	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	1,000,995.58	1,000,995.58	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,108,796,100.88	1,167,898,538.31	59,102,437.43

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融工具。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末无各项买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	2,426.95	3,530.63
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	157.90	5,180.60
应收债券利息	11,880.86	74.99
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	10.20	13.00
合计	14,475.91	8,799.22

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	30,618.55	157,103.20
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	30,618.55	157,103.20

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 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	255,491.80	85,491.80
应付指数使用费	410,333.63	14,875.97
应退替代款	-	-
合计	665,825.43	100,367.77

7.4.7.9 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 12 月 31 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	22,000,000.00	22,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-356,000,000.00	-356,000,000.00
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	517,955,051.00	517,955,051.00

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。

7.4.7.10 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	74,896,197.69	-25,183,142.80	49,713,054.89

本期基金份额交易产生的变动数	-119,488,845.46	-45,665,559.03	-165,154,404.49
其中：基金申购款	8,935,534.24	1,411,271.34	10,346,805.58
基金赎回款	-128,424,379.70	-47,076,830.37	-175,501,210.07
本期已分配利润	-	-	-
本期末	221,956,570.35	40,483,591.04	262,440,161.39

7.4.7.11 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 2 月 3 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	112,860.58	335,002.75
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	10,598.48	16,700.34
其他	3,534.86	152,862.89
合计	126,993.92	504,565.98

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 2 月 3 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	52,364,644.13	27,351,747.90
股票投资收益——赎回差价收入	16,360,140.86	7,083,461.67
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	68,724,784.99	34,435,209.57

7.4.7.12.2 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 2 月 3 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	462,755,831.08	553,861,637.89
减：卖出股票成本总额	410,391,186.95	526,509,889.99
买卖股票差价收入	52,364,644.13	27,351,747.90

7.4.7.12.3 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 2 月 3 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
赎回基金份额对价总额	531,501,210.07	569,123,193.65
减：现金支付赎回款总额	233,346,921.07	232,959,064.65
减：赎回股票成本总额	281,794,148.14	329,080,667.33
赎回差价收入	16,360,140.86	7,083,461.67

7.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无股票申购差价收入。

7.4.7.12.5 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。

7.4.7.13 债券投资收益**7.4.7.13.1 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 2 月 3 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 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	525,888.58	29,174.51
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	525,888.58	29,174.51

7.4.7.13.2 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 2 月 3 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
卖出债券（、债转股及债券 到期兑付）成交总额	3,832,759.20	154,988.88
减：卖出债券（、债转股及 债券到期兑付）成本总额	3,306,381.80	125,799.40
减：应收利息总额	488.82	14.97
买卖债券差价收入	525,888.58	29,174.51

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无债券赎回差价收入。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无债券申购差价收入。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无买卖贵金属差价收入。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属赎回差价收入。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属申购差价收入。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具买卖权证差价收入。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具其他投资收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 2 月 3 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	12,933,687.39	1,755,643.92
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	12,933,687.39	1,755,643.92

7.4.7.17 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 2 月 3 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	-25,183,142.80	59,102,437.43
——股票投资	-25,184,942.80	59,102,437.43
——债券投资	1,800.00	-
——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	-25,183,142.80	59,102,437.43

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 2 月 3 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	-681,195.97	1,030,214.29
合计	-681,195.97	1,030,214.29

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 2 月 3 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	763,670.79	1,120,814.02
银行间市场交易费用	-	-
合计	763,670.79	1,120,814.02

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 2 月 3 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
审计费用	40,000.00	40,000.00
信息披露费	120,000.00	-
证券出借违约金	-	-
银行费用	8,296.65	8,841.78

指数使用费	445,879.70	145,989.34
其他	50,000.00	45,891.80
合计	664,176.35	240,722.92

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

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
招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)	基金管理人的股东
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
招商财富资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司
招商资产管理(香港)有限公司	基金管理人的全资子公司

注：1、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。

2、基金的主要关联方包含基金管理人、基金管理人的股东及子公司、基金托管人等。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2020 年 2 月 3 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 12 月 31 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	502,059,330.87	68.40%	1,337,276,661.85	71.25%

7.4.10.1.2 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 2 月 3 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 12 月 31 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	5,892,049.30	86.24%	128,107.20	82.66%

7.4.10.1.3 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。

7.4.10.1.4 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。

7.4.10.1.5 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 12 月 31 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	116,130.36	79.22%	21,978.52	71.78%
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 12 月 31 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	309,322.34	81.36%	139,398.22	88.73%

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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 2 月 3 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	4,424,840.80	1,143,148.48
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-
支付投资顾问的投资顾问费	-	-

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

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 2 月 3 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	884,968.21	228,629.75

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：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

7.4.10.3 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。

7.4.10.4 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**7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本报告期内及上年度可比期间基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

7.4.10.5.2 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 2021 年 12 月 31 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 股国际通 ETF 联接	496,000,000.00	95.76%	820,000,000.00	96.25%
招商证券股份有限公司	5,084,563.00	0.98%	602,963.00	0.07%

司				
---	--	--	--	--

7.4.10.6 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2020 年 2 月 3 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 12 月 31 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-活期	25,451,041.42	112,860.58	62,147,137.61	335,002.75

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。

7.4.10.7 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 12 月 31 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	688206	概伦电子	网下申购	6,000	169,680.00
招商证券	001288	运机集团	网下申购	537	7,813.35
招商证券	688739	成大生物	网下申购	4,014	441,540.00
招商证券	301083	百胜智能	网下申购	4,160	37,772.80
招商证券	688772	珠海冠宇	网下申购	12,960	187,012.80
招商证券	688103	国力股份	网下申购	1,595	19,203.80
招商证券	605069	正和生态	网下申购	608	9,199.04
招商证券	688517	金冠电气	网下申购	2,892	22,297.32
招商证券	300991	创益通	网下申购	2,535	33,107.10
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
中银国际证券	688509	正元地信	网下申购	15,433	30,403.01

上年度可比期间 2020 年 2 月 3 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 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
-	-	-	-	-	-

注：本表已包含托管人的关联方承销期内承销的证券。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2021 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
001234	泰慕士	2021年12月31日	2022年1月11日	新股流通受限	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
300774	倍杰特	2021年7月26日	2022年2月7日	新股流通受限	4.57	21.08	444	2,029.08	9,359.52	-
300814	中富电路	2021年8月4日	2022年2月14日	新股流通受限	8.40	23.88	328	2,755.20	7,832.64	-
300854	中兰环保	2021年9月8日	2022年3月16日	新股流通受限	9.96	27.29	203	2,021.88	5,539.87	-
301018	申菱环境	2021年6月28日	2022年1月7日	新股流通受限	8.29	26.06	782	6,482.78	20,378.92	-
301020	密封科技	2021年6月28日	2022年1月6日	新股流通受限	10.64	30.44	421	4,479.44	12,815.24	-
301021	英诺激光	2021年6月28日	2022年1月6日	新股流通受限	9.46	41.43	290	2,743.40	12,014.70	-
301025	读客文化	2021年7月6日	2022年1月19日	新股流通受限	1.55	20.88	403	624.65	8,414.64	-
301026	浩通科技	2021年7月8日	2022年1月17日	新股流通受限	18.03	62.73	203	3,660.09	12,734.19	-
301027	华蓝集团	2021年7月8日	2022年1月17日	新股流通受限	11.45	16.65	286	3,274.70	4,761.90	-
301028	东亚机械	2021年7月12日	2022年1月20日	新股流通受限	5.31	13.50	733	3,892.23	9,895.50	-
301029	怡合达	2021年7月14日	2022年1月24日	新股流通受限	14.14	89.87	462	6,532.68	41,519.94	-
301030	仕净科技	2021年7月15日	2022年1月24日	新股流通受限	6.10	31.52	242	1,476.20	7,627.84	-
301032	新柴股份	2021年7月15日	2022年1月24日	新股流通受限	4.97	12.51	513	2,549.61	6,417.63	-
301033	迈普医学	2021年7月15日	2022年1月26日	新股流通受限	15.14	59.97	108	1,635.12	6,476.76	-
301035	润丰股份	2021年7月21日	2022年1月28日	新股流通受限	22.04	56.28	644	14,193.76	36,244.32	-
301036	双乐股份	2021年7月21日	2022年2月7日	新股流通受限	23.38	29.93	205	4,792.90	6,135.65	-
301037	保立佳	2021年7月21日	2022年2月7日	新股流通受限	14.82	24.26	193	2,860.26	4,682.18	-
301038	深水	2021年7月	2022年2月	新股流	6.68	20.23	266	1,776.88	5,381.18	-

	规院	月 22 日	月 7 日	通受限						
301040	中环海陆	2021 年 7 月 26 日	2022 年 2 月 7 日	新股流通受限	13.57	38.51	241	3,270.37	9,280.91	-
301041	金百泽	2021 年 8 月 2 日	2022 年 2 月 11 日	新股流通受限	7.31	28.21	215	1,571.65	6,065.15	-
301045	天禄科技	2021 年 8 月 6 日	2022 年 2 月 14 日	新股流通受限	15.81	28.37	335	5,296.35	9,503.95	-
301046	能辉科技	2021 年 8 月 10 日	2022 年 2 月 17 日	新股流通受限	8.34	48.99	290	2,418.60	14,207.10	-
301048	金鹰重工	2021 年 8 月 11 日	2022 年 2 月 18 日	新股流通受限	4.13	12.96	843	3,481.59	10,925.28	-
301049	超越科技	2021 年 8 月 17 日	2022 年 2 月 24 日	新股流通受限	19.34	32.92	196	3,790.64	6,452.32	-
301050	雷电微力	2021 年 8 月 17 日	2022 年 2 月 24 日	新股流通受限	60.64	234.74	233	14,129.12	54,694.42	-
301052	果麦文化	2021 年 8 月 23 日	2022 年 3 月 1 日	新股流通受限	8.11	33.64	252	2,043.72	8,477.28	-
301053	远信工业	2021 年 8 月 25 日	2022 年 3 月 1 日	新股流通受限	11.87	28.78	155	1,839.85	4,460.90	-
301055	张小泉	2021 年 8 月 26 日	2022 年 3 月 7 日	新股流通受限	6.90	21.78	355	2,449.50	7,731.90	-
301056	森赫股份	2021 年 8 月 27 日	2022 年 3 月 7 日	新股流通受限	3.93	11.09	572	2,247.96	6,343.48	-
301057	汇隆新材	2021 年 8 月 31 日	2022 年 3 月 9 日	新股流通受限	8.03	19.02	218	1,750.54	4,146.36	-
301058	中粮工科	2021 年 9 月 1 日	2022 年 3 月 9 日	新股流通受限	3.55	18.24	1,386	4,920.30	25,280.64	-
301059	金三江	2021 年 9 月 3 日	2022 年 3 月 14 日	新股流通受限	8.09	19.30	259	2,095.31	4,998.70	-
301062	上海艾录	2021 年 9 月 7 日	2022 年 3 月 14 日	新股流通受限	3.31	17.01	523	1,731.13	8,896.23	-
301063	海锅股份	2021 年 9 月 9 日	2022 年 3 月 24 日	新股流通受限	17.40	36.11	153	2,662.20	5,524.83	-
301066	万事利	2021 年 9 月 13 日	2022 年 3 月 22 日	新股流通受限	5.24	22.84	344	1,802.56	7,856.96	-
301068	大地海洋	2021 年 9 月 16 日	2022 年 3 月 28 日	新股流通受限	13.98	28.38	144	2,013.12	4,086.72	-
301069	凯盛新材	2021 年 9 月 16 日	2022 年 3 月 28 日	新股流通受限	5.17	44.21	539	2,786.63	23,829.19	-
301072	中捷精工	2021 年 9 月 22 日	2022 年 3 月 29 日	新股流通受限	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	-
301073	君亭酒店	2021 年 9 月 22 日	2022 年 3 月 30 日	新股流通受限	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	-

301079	邵阳 液压	2021年10 月11日	2022年4 月19日	新股流 通受限	11.92	24.82	140	1,668.80	3,474.80	-
301081	严牌 股份	2021年10 月13日	2022年4 月20日	新股流 通受限	12.95	17.44	380	4,921.00	6,627.20	-
301083	百胜 智能	2021年10 月13日	2022年4 月21日	新股流 通受限	9.08	14.21	416	3,777.28	5,911.36	-
301087	可孚 医疗	2021年10 月15日	2022年4 月25日	新股流 通受限	93.09	75.34	489	45,521.01	36,841.26	-
301088	戎美 股份	2021年10 月19日	2022年4 月28日	新股流 通受限	33.16	24.67	704	23,344.64	17,367.68	-
301089	拓新 药业	2021年10 月20日	2022年4 月27日	新股流 通受限	19.11	67.93	220	4,204.20	14,944.60	-
301090	华润 材料	2021年10 月19日	2022年4 月26日	新股流 通受限	10.45	11.22	2,764	28,883.80	31,012.08	-
301092	争光 股份	2021年10 月21日	2022年5 月5日	新股流 通受限	36.31	35.52	323	11,728.13	11,472.96	-
301093	华兰 股份	2021年10 月21日	2022年5 月5日	新股流 通受限	58.08	49.85	409	23,754.72	20,388.65	-
301098	金埔 园林	2021年11 月4日	2022年5 月12日	新股流 通受限	12.36	22.17	307	3,794.52	6,806.19	-
301099	雅创 电子	2021年11 月10日	2022年5 月23日	新股流 通受限	21.99	71.36	310	6,816.90	22,121.60	-
301101	明月 镜片	2021年12 月9日	2022年6 月16日	新股流 通受限	26.91	43.36	371	9,983.61	16,086.56	-
301108	洁雅 股份	2021年11 月25日	2022年6 月6日	新股流 通受限	57.27	53.71	280	16,035.60	15,038.80	-
301111	粤万 年青	2021年11 月30日	2022年6 月7日	新股流 通受限	10.48	36.68	379	3,971.92	13,901.72	-
301118	恒光 股份	2021年11 月9日	2022年5 月18日	新股流 通受限	22.70	49.02	315	7,150.50	15,441.30	-
301126	达嘉 维康	2021年11 月30日	2022年6 月7日	新股流 通受限	12.37	19.23	662	8,188.94	12,730.26	-
301133	金钟 股份	2021年11 月19日	2022年5 月26日	新股流 通受限	14.33	26.95	286	4,098.38	7,707.70	-
301136	招标 股份	2021年12 月31日	2022年1 月11日	新股流 通受限	10.52	10.52	7,172	75,449.44	75,449.44	-
301138	华研 精机	2021年12 月8日	2022年6 月15日	新股流 通受限	26.17	44.86	285	7,458.45	12,785.10	-
301155	海力 风电	2021年11 月17日	2022年5 月24日	新股流 通受限	60.66	96.75	597	36,214.02	57,759.75	-
301166	优宁 维	2021年12 月21日	2022年6 月28日	新股流 通受限	86.06	94.50	253	21,773.18	23,908.50	-
301177	迪阿 股份	2021年12 月8日	2022年6 月15日	新股流 通受限	116.88	116.08	390	45,583.20	45,271.20	-

301179	泽宇智能	2021年12月1日	2022年6月8日	新股流通受限	43.99	50.77	295	12,977.05	14,977.15	-
301182	凯旺科技	2021年12月16日	2022年6月23日	新股流通受限	27.12	30.58	294	7,973.28	8,990.52	-
301185	鸥玛软件	2021年11月11日	2022年5月19日	新股流通受限	11.88	21.16	578	6,866.64	12,230.48	-
301188	力诺特玻	2021年11月4日	2022年5月11日	新股流通受限	13.00	20.48	647	8,411.00	13,250.56	-
301189	奥尼电子	2021年12月21日	2022年6月28日	新股流通受限	66.18	56.62	435	28,788.30	24,629.70	-
301190	善水科技	2021年12月17日	2022年6月24日	新股流通受限	27.85	27.46	575	16,013.75	15,789.50	-
301198	喜悦智行	2021年11月25日	2022年6月2日	新股流通受限	21.76	29.20	262	5,701.12	7,650.40	-
301199	迈赫股份	2021年11月30日	2022年6月7日	新股流通受限	29.28	32.00	402	11,770.56	12,864.00	-
301211	亨迪药业	2021年12月14日	2022年6月22日	新股流通受限	25.80	33.65	967	24,948.60	32,539.55	-
688262	国芯科技	2021年12月28日	2022年1月6日	新股流通受限	41.98	41.98	7,009	294,237.82	294,237.82	-
688511	天微电子	2021年7月22日	2022年2月7日	新股流通受限	28.09	54.52	1,490	41,854.10	81,234.80	-
688718	唯赛勃	2021年7月20日	2022年1月28日	新股流通受限	5.85	27.71	3,145	18,398.25	87,147.95	-

7.4.12.1.2 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
113052	兴业转债	2021年12月27日	2022年1月14日	新债未上市	100.00	100.00	8,460	845,996.29	845,996.29	-
113634	珀莱转债	2021年12月8日	2022年1月4日	新债未上市	100.00	100.00	130	12,999.91	12,999.91	-

注：以上“可流通日”中，部分证券的日期是根据公告的限售期限估算的流通日期，最终日期以上市公司公告为准。

7.4.12.2 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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 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。

7.4.12.3.2 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。

7.4.12.4 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。

7.4.13 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。

7.4.13.1 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。

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。

7.4.13.2 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 7.4.13.2.1 至 7.4.13.2.6 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。

7.4.13.2.1 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。

7.4.13.2.2 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。

7.4.13.2.3 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。

7.4.13.2.4 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 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	845,996.29	910,996.01
AAA 以下	12,999.91	89,999.57
未评级	-	-
合计	858,996.20	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。

7.4.13.2.5 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。

7.4.13.2.6 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。

7.4.13.3 流动性风险

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金流动性风险来源于基金约定开放日兑付赎回资金的流动性风险，以及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。本基金所持有的金融资产主要在证券交易所和银行间同业市场交易。除附注 7.4.12 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。除卖出回购金融资产外，本基金所持有的金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人在基金合同约定巨额赎回条款，设计了非常情况下赎回资金的处理模式，控制因开放模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

日常流动性风险管理中，本基金的基金管理人每日监控和预测本基金的流动性指标，通过对投资品种的流动性指标来持续地评估、选择、跟踪和控制基金投资的流动性风险。同时，本基金通过预留一定的现金头寸，并且在需要时可通过卖出回购金融资产方式融入短期资金，以缓解流动性风险。

本基金按合同约定申购赎回可采用一篮子股票的形式或现金替代方式，流动性风险相对较低。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 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	25,451,041.42	-	-	-	25,451,041.42
结算备付金	353,729.56	-	-	-	353,729.56
存出保证金	22,711.58	-	-	-	22,711.58
交易性金融资产	3,001,200.00	-	858,996.20	766,491,916.48	770,352,112.68
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	14,475.91	14,475.91
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	28,828,682.56	-	858,996.20	766,506,392.39	796,194,071.15
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	336,506.09	336,506.09
应付托管费	-	-	-	67,301.23	67,301.23
应付证券清算款	-	-	-	14,698,607.46	14,698,607.46
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	30,618.55	30,618.55
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-

其他负债	-	-	-	665,825.43	665,825.43
负债总计	-	-	-	15,798,858.76	15,798,858.76
利率敏感度缺口	28,828,682.56	-	858,996.20	750,707,533.63	780,395,212.39
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

7.4.13.4.1.2 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 12 月 31 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	1. 市场利率平行上升 50 个基点	-36,389.87	-28,132.17

2. 市场利率平行下降 50 个基点	37,281.65	29,096.78
--------------------	-----------	-----------

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 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	766,491,916.48	98.22	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	766,491,916.48	98.22	1,166,897,542.73	94.88

7.4.13.4.2.2 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 12 月 31 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%	38,324,595.82	58,344,877.14
2. 权益性投资的市场价格下降 5%	-38,324,595.82	-58,344,877.14	

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收账款和其他金融负债等,其账面价值与公允价值相差很小。

(b)以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

下表按公允价值三个层次列示了以公允价值计量的金融资产工具于本报告期末的账面价值。

单位:人民币元

资产	本期末(2021年12月31日)			
	第一层次	第二层次	第三层次	合计
交易性金融资产				
股票投资	764,956,170.70	1,535,745.78	-	766,491,916.48
债券投资	-	3,860,196.20	-	3,860,196.20
基金投资	-	-	-	-
合计	764,956,170.70	5,395,941.98	-	770,352,112.68
资产	上年度末(2020年12月31日)			
	第一层次	第二层次	第三层次	合计
交易性金融资产				
股票投资	1,165,745,276.07	1,152,266.66	-	1,166,897,542.73
债券投资	-	1,000,995.58	-	1,000,995.58
基金投资	-	-	-	-
合计	1,165,745,276.07	2,153,262.24	-	1,167,898,538.31

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层次或第三层次。

本基金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(可转换债券和可交换债券除外)按照第三方估值机构提供的估值确定公允价值,相关固定收益品种的公允价值层次归入第二层次。

(2)除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	766,491,916.48	96.27
	其中：股票	766,491,916.48	96.27
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,860,196.20	0.48
	其中：债券	3,860,196.20	0.48
	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	25,804,770.98	3.24
8	其他资产	37,187.49	0.00
9	合计	796,194,071.15	100.00

注：此处的股票投资项含可退替代款估值增值。

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	8,937,394.32	1.15
B	采矿业	20,807,122.52	2.67
C	制造业	463,089,013.85	59.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	19,022,574.47	2.44
E	建筑业	12,354,301.30	1.58
F	批发和零售业	7,181,013.76	0.92
G	交通运输、仓储和邮政业	21,236,808.34	2.72
H	住宿和餐饮业	920,020.00	0.12
I	信息传输、软件和信息技术服务业	28,690,351.80	3.68
J	金融业	137,877,873.00	17.67
K	房地产业	12,995,598.24	1.67
L	租赁和商务服务业	10,329,960.00	1.32
M	科学研究和技术服务业	9,423,955.26	1.21
N	水利、环境和公共设施管理业	1,894,887.00	0.24
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	6,427,818.64	0.82
R	文化、体育和娱乐业	3,128,229.20	0.40
S	综合	639,249.00	0.08
	合计	764,956,170.70	98.02

8.2.2 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	918,163.01	0.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	6,806.19	0.00
F	批发和零售业	121,399.24	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	4,608.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	321,445.45	0.04
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	125,080.26	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	21,351.71	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	16,891.92	0.00
S	综合	-	-
	合计	1,535,745.78	0.20

8.2.3 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。

8.3 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

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	21,567	44,212,350.00	5.67
2	300750	宁德时代	40,000	23,520,000.00	3.01
3	600036	招商银行	354,240	17,255,030.40	2.21
4	000858	五粮液	66,700	14,851,422.00	1.90
5	601318	中国平安	186,000	9,376,260.00	1.20
6	600900	长江电力	390,500	8,864,350.00	1.14

7	002594	比亚迪	31,100	8,338,532.00	1.07
8	601012	隆基股份	92,925	8,010,135.00	1.03
9	300760	迈瑞医疗	20,880	7,951,104.00	1.02
10	601888	中国中免	33,500	7,350,235.00	0.94
11	601166	兴业银行	356,700	6,791,568.00	0.87
12	600809	山西汾酒	20,995	6,629,801.10	0.85
13	300059	东方财富	177,476	6,586,134.36	0.84
14	000568	泸州老窖	25,200	6,397,524.00	0.82
15	603288	海天味业	60,230	6,330,775.30	0.81
16	002475	立讯精密	120,769	5,941,834.80	0.76
17	002352	顺丰控股	84,200	5,803,064.00	0.74
18	600276	恒瑞医药	109,832	5,569,580.72	0.71
19	000001	平安银行	333,200	5,491,136.00	0.70
20	600309	万华化学	53,896	5,443,496.00	0.70
21	603259	药明康德	44,037	5,221,907.46	0.67
22	601398	工商银行	1,080,200	5,001,326.00	0.64
23	600030	中信证券	182,800	4,827,748.00	0.62
24	002714	牧原股份	90,362	4,821,716.32	0.62
25	603501	韦尔股份	14,900	4,630,473.00	0.59
26	600887	伊利股份	109,900	4,556,454.00	0.58
27	600436	片仔癀	10,400	4,546,360.00	0.58
28	002142	宁波银行	113,430	4,342,100.40	0.56
29	600000	浦发银行	504,100	4,299,973.00	0.55
30	002304	洋河股份	25,900	4,266,507.00	0.55
31	601919	中远海控	217,320	4,061,710.80	0.52
32	300015	爱尔眼科	92,838	3,925,190.64	0.50
33	300014	亿纬锂能	32,513	3,842,386.34	0.49
34	002812	恩捷股份	15,300	3,831,120.00	0.49
35	600406	国电南瑞	95,240	3,812,457.20	0.49
36	601288	农业银行	1,279,200	3,760,848.00	0.48
37	300274	阳光电源	25,050	3,652,290.00	0.47
38	601668	中国建筑	720,400	3,602,000.00	0.46
39	600438	通威股份	77,300	3,475,408.00	0.45
40	601899	紫金矿业	353,600	3,429,920.00	0.44
41	300122	智飞生物	27,500	3,426,500.00	0.44
42	601816	京沪高铁	702,700	3,394,041.00	0.43
43	600031	三一重工	145,800	3,324,240.00	0.43
44	000002	万科 A	167,000	3,299,920.00	0.42
45	000725	京东方 A	644,100	3,252,705.00	0.42
46	600690	海尔智家	108,300	3,237,087.00	0.41
47	600048	保利发展	205,500	3,211,965.00	0.41
48	601601	中国太保	117,600	3,189,312.00	0.41
49	002241	歌尔股份	58,700	3,175,670.00	0.41

50	002493	荣盛石化	173,874	3,157,551.84	0.40
51	002371	北方华创	9,000	3,123,180.00	0.40
52	601328	交通银行	673,900	3,106,679.00	0.40
53	300124	汇川技术	45,000	3,087,000.00	0.40
54	600893	航发动力	45,800	2,906,468.00	0.37
55	600111	北方稀土	62,400	2,857,920.00	0.37
56	002460	赣锋锂业	19,700	2,814,145.00	0.36
57	600585	海螺水泥	68,700	2,768,610.00	0.35
58	600745	闻泰科技	21,400	2,767,020.00	0.35
59	600104	上汽集团	133,768	2,759,633.84	0.35
60	600019	宝钢股份	382,300	2,737,268.00	0.35
61	601088	中国神华	113,208	2,549,444.16	0.33
62	002459	晶澳科技	27,500	2,549,250.00	0.33
63	601766	中国中车	417,800	2,544,402.00	0.33
64	000776	广发证券	101,600	2,498,344.00	0.32
65	600016	民生银行	608,800	2,374,320.00	0.30
66	601818	光大银行	710,100	2,357,532.00	0.30
67	002049	紫光国微	10,400	2,340,000.00	0.30
68	601658	邮储银行	456,600	2,328,660.00	0.30
69	002129	中环股份	55,500	2,317,125.00	0.30
70	600028	中国石化	547,000	2,313,810.00	0.30
71	600346	恒力石化	100,700	2,313,079.00	0.30
72	601211	国泰君安	129,100	2,309,599.00	0.30
73	603799	华友钴业	20,926	2,308,347.06	0.30
74	000538	云南白药	22,000	2,302,300.00	0.30
75	600999	招商证券	127,380	2,248,257.00	0.29
76	601688	华泰证券	126,300	2,243,088.00	0.29
77	000063	中兴通讯	66,700	2,234,450.00	0.29
78	600010	包钢股份	782,800	2,184,012.00	0.28
79	601066	中信建投	74,409	2,176,463.25	0.28
80	603806	福斯特	16,360	2,135,798.00	0.27
81	601669	中国电建	262,700	2,122,616.00	0.27
82	300498	温氏股份	109,400	2,107,044.00	0.27
83	600050	中国联通	532,500	2,092,725.00	0.27
84	002311	海大集团	28,500	2,089,050.00	0.27
85	000338	潍柴动力	116,500	2,084,185.00	0.27
86	002230	科大讯飞	39,500	2,074,145.00	0.27
87	601985	中国核电	249,800	2,073,340.00	0.27
88	002027	分众传媒	252,000	2,063,880.00	0.26
89	600837	海通证券	165,800	2,032,708.00	0.26
90	601225	陕西煤业	166,500	2,031,300.00	0.26
91	601390	中国中铁	349,600	2,024,184.00	0.26
92	600588	用友网络	56,160	2,015,020.80	0.26

93	603986	兆易创新	11,408	2,006,096.80	0.26
94	601877	正泰电器	36,900	1,988,541.00	0.25
95	300896	爱美客	3,700	1,983,607.00	0.25
96	000166	申万宏源	387,000	1,981,440.00	0.25
97	300433	蓝思科技	85,400	1,962,492.00	0.25
98	603659	璞泰来	11,900	1,911,259.00	0.24
99	600150	中国船舶	76,800	1,903,872.00	0.24
100	000661	长春高新	6,976	1,893,286.40	0.24
101	300782	卓胜微	5,760	1,882,368.00	0.24
102	002709	天赐材料	16,360	1,875,674.00	0.24
103	601633	长城汽车	38,400	1,863,936.00	0.24
104	601988	中国银行	603,300	1,840,065.00	0.24
105	300413	芒果超媒	32,100	1,836,762.00	0.24
106	601100	恒立液压	22,382	1,830,847.60	0.23
107	002821	凯莱英	4,200	1,827,000.00	0.23
108	600989	宝丰能源	104,900	1,821,064.00	0.23
109	601857	中国石油	370,800	1,820,628.00	0.23
110	001979	招商蛇口	136,000	1,814,240.00	0.23
111	688036	传音控股	11,400	1,788,660.00	0.23
112	688111	金山办公	6,600	1,749,000.00	0.22
113	601229	上海银行	243,894	1,738,964.22	0.22
114	000596	古井贡酒	7,000	1,708,000.00	0.22
115	603993	洛阳钼业	303,400	1,692,972.00	0.22
116	600196	复星医药	34,500	1,688,430.00	0.22
117	000625	长安汽车	109,060	1,656,621.40	0.21
118	600660	福耀玻璃	34,400	1,621,616.00	0.21
119	601169	北京银行	363,100	1,612,164.00	0.21
120	300759	康龙化成	11,300	1,596,351.00	0.20
121	000895	双汇发展	49,600	1,564,880.00	0.20
122	601360	三六零	122,700	1,560,744.00	0.20
123	300999	金龙鱼	24,800	1,560,664.00	0.20
124	600570	恒生电子	25,108	1,560,462.20	0.20
125	002050	三花智控	61,640	1,559,492.00	0.20
126	601009	南京银行	171,800	1,539,328.00	0.20
127	300316	晶盛机电	22,100	1,535,950.00	0.20
128	600741	华域汽车	54,100	1,531,030.00	0.20
129	603392	万泰生物	6,900	1,528,350.00	0.20
130	300142	沃森生物	26,900	1,511,780.00	0.19
131	600958	东方证券	102,400	1,509,376.00	0.19
132	601138	工业富联	125,100	1,491,192.00	0.19
133	000100	TCL 科技	241,000	1,486,970.00	0.19
134	600919	江苏银行	253,540	1,478,138.20	0.19
135	600886	国投电力	128,001	1,468,171.47	0.19

136	300408	三环集团	32,900	1,467,340.00	0.19
137	002074	国轩高科	28,600	1,465,750.00	0.19
138	601628	中国人寿	47,715	1,435,744.35	0.18
139	601865	福莱特	24,300	1,407,942.00	0.18
140	601336	新华保险	35,800	1,391,904.00	0.18
141	002001	新和成	44,240	1,376,748.80	0.18
142	601600	中国铝业	224,500	1,367,205.00	0.18
143	300454	深信服	7,100	1,356,100.00	0.17
144	600089	特变电工	63,800	1,350,646.00	0.17
145	688012	中微公司	10,600	1,341,960.00	0.17
146	300033	同花顺	9,200	1,330,136.00	0.17
147	600926	杭州银行	101,800	1,305,076.00	0.17
148	603833	欧派家居	8,720	1,286,200.00	0.16
149	002736	国信证券	110,100	1,263,948.00	0.16
150	300628	亿联网络	15,500	1,262,475.00	0.16
151	601117	中国化学	104,900	1,258,800.00	0.16
152	600132	重庆啤酒	8,300	1,255,956.00	0.16
153	600176	中国巨石	68,725	1,250,795.00	0.16
154	300207	欣旺达	29,500	1,243,720.00	0.16
155	603486	科沃斯	8,200	1,237,790.00	0.16
156	300661	圣邦股份	4,000	1,236,000.00	0.16
157	600029	南方航空	181,400	1,235,334.00	0.16
158	600015	华夏银行	220,300	1,233,680.00	0.16
159	600011	华能国际	125,900	1,219,971.00	0.16
160	600460	士兰微	22,500	1,219,500.00	0.16
161	002013	中航机电	66,700	1,212,606.00	0.16
162	600600	青岛啤酒	12,200	1,207,800.00	0.15
163	002236	大华股份	51,400	1,206,872.00	0.15
164	000963	华东医药	30,000	1,206,000.00	0.15
165	000799	酒鬼酒	5,600	1,190,000.00	0.15
166	000723	美锦能源	73,300	1,189,659.00	0.15
167	002648	卫星化学	29,560	1,183,286.80	0.15
168	000876	新希望	77,300	1,175,733.00	0.15
169	601618	中国中冶	306,600	1,174,278.00	0.15
170	603369	今世缘	21,500	1,169,600.00	0.15
171	600547	山东黄金	62,108	1,168,872.56	0.15
172	002601	龙佰集团	40,800	1,166,472.00	0.15
173	600845	宝信软件	19,170	1,166,111.10	0.15
174	300601	康泰生物	11,800	1,162,772.00	0.15
175	300751	迈为股份	1,800	1,156,140.00	0.15
176	002180	纳思达	24,200	1,155,792.00	0.15
177	600426	华鲁恒升	36,350	1,137,755.00	0.15
178	601377	兴业证券	115,000	1,136,200.00	0.15

179	601155	新城控股	38,788	1,129,894.44	0.14
180	002938	鹏鼎控股	26,600	1,128,638.00	0.14
181	000938	紫光股份	49,100	1,121,935.00	0.14
182	002920	德赛西威	7,900	1,117,929.00	0.14
183	601901	方正证券	141,300	1,107,792.00	0.14
184	603290	斯达半导	2,900	1,104,900.00	0.14
185	600763	通策医疗	5,500	1,094,500.00	0.14
186	000733	振华科技	8,800	1,093,664.00	0.14
187	300223	北京君正	8,100	1,085,400.00	0.14
188	688008	澜起科技	12,900	1,081,923.00	0.14
189	002602	世纪华通	128,020	1,074,087.80	0.14
190	000301	东方盛虹	55,400	1,071,436.00	0.14
191	601727	上海电气	219,401	1,066,288.86	0.14
192	601111	中国国航	114,000	1,040,820.00	0.13
193	000786	北新建材	29,000	1,039,070.00	0.13
194	002756	永兴材料	7,000	1,036,140.00	0.13
195	002555	三七互娱	38,100	1,029,462.00	0.13
196	002916	深南电路	8,440	1,028,160.80	0.13
197	603899	晨光文具	15,900	1,025,709.00	0.13
198	600875	东方电气	47,700	1,021,734.00	0.13
199	002120	韵达股份	49,840	1,019,726.40	0.13
200	300496	中科创达	7,300	1,010,466.00	0.13
201	600779	水井坊	8,400	1,007,916.00	0.13
202	600383	金地集团	77,500	1,005,175.00	0.13
203	601916	浙商银行	287,100	1,004,850.00	0.13
204	600188	兖矿能源	42,600	1,002,378.00	0.13
205	601788	光大证券	67,100	1,001,803.00	0.13
206	601689	拓普集团	18,900	1,001,700.00	0.13
207	601799	星宇股份	4,900	1,000,825.00	0.13
208	002791	坚朗五金	5,500	998,745.00	0.13
209	300450	先导智能	13,400	996,558.00	0.13
210	300763	锦浪科技	4,300	995,665.00	0.13
211	600918	中泰证券	99,700	994,009.00	0.13
212	000069	华侨城 A	140,900	991,936.00	0.13
213	600039	四川路桥	82,000	987,280.00	0.13
214	600233	圆通速递	58,900	982,452.00	0.13
215	002080	中材科技	28,800	979,776.00	0.13
216	002202	金风科技	59,300	976,671.00	0.13
217	603260	合盛硅业	7,400	976,578.00	0.13
218	688169	石头科技	1,200	975,600.00	0.13
219	002414	高德红外	40,272	974,985.12	0.12
220	600795	国电电力	306,300	970,971.00	0.12
221	600219	南山铝业	205,300	966,963.00	0.12

222	601939	建设银行	164,700	965,142.00	0.12
223	600885	宏发股份	12,800	955,392.00	0.12
224	600584	长电科技	30,600	949,212.00	0.12
225	002841	视源股份	11,500	936,100.00	0.12
226	600183	生益科技	39,500	930,225.00	0.12
227	600754	锦江酒店	15,700	920,020.00	0.12
228	688126	沪硅产业	35,500	916,610.00	0.12
229	002007	华兰生物	31,290	911,790.60	0.12
230	600061	国投资本	110,312	906,764.64	0.12
231	600563	法拉电子	3,900	906,360.00	0.12
232	601995	中金公司	18,400	902,152.00	0.12
233	603737	三棵树	6,460	898,909.00	0.12
234	600522	中天科技	52,700	893,792.00	0.11
235	000977	浪潮信息	24,932	893,313.56	0.11
236	002600	领益智造	121,300	892,768.00	0.11
237	002625	光启技术	37,000	888,370.00	0.11
238	603882	金域医学	7,900	879,823.00	0.11
239	603707	健友股份	20,921	878,682.00	0.11
240	601878	浙商证券	66,600	877,788.00	0.11
241	601233	桐昆股份	41,400	876,852.00	0.11
242	600018	上港集团	159,900	876,252.00	0.11
243	601615	明阳智能	33,500	874,350.00	0.11
244	000157	中联重科	121,800	873,306.00	0.11
245	002240	盛新锂能	14,900	863,455.00	0.11
246	600298	安琪酵母	14,300	863,148.00	0.11
247	601966	玲珑轮胎	23,569	861,446.95	0.11
248	603160	汇顶科技	7,886	849,874.22	0.11
249	002340	格林美	82,100	849,735.00	0.11
250	603816	顾家家居	10,900	841,044.00	0.11
251	300595	欧普康视	14,640	839,896.80	0.11
252	002064	华峰化学	79,600	831,024.00	0.11
253	601881	中国银河	73,800	825,822.00	0.11
254	600332	白云山	24,100	824,220.00	0.11
255	300347	泰格医药	6,400	817,920.00	0.10
256	002268	卫士通	14,500	811,130.00	0.10
257	600038	中直股份	10,100	811,030.00	0.10
258	300390	天华超净	10,000	810,000.00	0.10
259	600115	中国东航	156,842	809,304.72	0.10
260	000425	徐工机械	134,500	805,655.00	0.10
261	603456	九洲药业	14,300	804,518.00	0.10
262	300037	新宙邦	7,100	802,300.00	0.10
263	603198	迎驾贡酒	11,500	798,675.00	0.10
264	002384	东山精密	29,400	796,740.00	0.10

265	600362	江西铜业	35,600	794,948.00	0.10
266	688180	君实生物	11,800	790,364.00	0.10
267	002252	上海莱士	115,700	789,074.00	0.10
268	603568	伟明环保	21,600	789,048.00	0.10
269	601636	旗滨集团	46,100	788,310.00	0.10
270	600674	川投能源	63,000	787,500.00	0.10
271	300146	汤臣倍健	29,200	787,232.00	0.10
272	603185	上机数控	4,700	784,806.00	0.10
273	601058	赛轮轮胎	52,600	777,954.00	0.10
274	002326	永太科技	15,100	773,271.00	0.10
275	002568	百润股份	12,920	773,003.60	0.10
276	600009	上海机场	16,518	771,225.42	0.10
277	601555	东吴证券	85,643	758,796.98	0.10
278	600256	广汇能源	115,900	757,986.00	0.10
279	601216	君正集团	144,900	757,827.00	0.10
280	300073	当升科技	8,700	755,769.00	0.10
281	300699	光威复材	8,900	751,872.00	0.10
282	600803	新奥股份	40,700	747,252.00	0.10
283	002385	大北农	71,100	745,839.00	0.10
284	601838	成都银行	62,000	744,000.00	0.10
285	688006	杭可科技	6,900	742,302.00	0.10
286	300529	健帆生物	13,830	737,139.00	0.09
287	688122	西部超导	7,600	736,744.00	0.09
288	603589	口子窖	10,300	729,961.00	0.09
289	603605	珀莱雅	3,500	729,085.00	0.09
290	600141	兴发集团	19,200	727,296.00	0.09
291	603267	鸿远电子	4,000	717,760.00	0.09
292	603517	绝味食品	10,500	717,465.00	0.09
293	603345	安井食品	4,200	717,276.00	0.09
294	000783	长江证券	94,900	715,546.00	0.09
295	000066	中国长城	50,400	713,664.00	0.09
296	000739	普洛药业	20,200	708,818.00	0.09
297	600516	方大炭素	65,427	707,920.14	0.09
298	600352	浙江龙盛	55,900	706,017.00	0.09
299	300003	乐普医疗	31,000	701,530.00	0.09
300	002185	华天科技	55,000	699,050.00	0.09
301	600486	扬农化工	5,300	695,360.00	0.09
302	603019	中科曙光	25,100	692,007.00	0.09
303	300726	宏达电子	6,900	690,414.00	0.09
304	000825	太钢不锈	97,900	689,216.00	0.09
305	300724	捷佳伟创	6,000	685,800.00	0.09
306	601108	财通证券	61,600	684,992.00	0.09
307	000738	航发控制	22,600	684,328.00	0.09

308	600161	天坛生物	23,543	681,805.28	0.09
309	603939	益丰药房	12,336	679,836.96	0.09
310	002624	完美世界	33,250	675,307.50	0.09
311	603338	浙江鼎力	8,348	670,010.48	0.09
312	000703	恒逸石化	62,970	668,741.40	0.09
313	000807	云铝股份	59,600	665,732.00	0.09
314	002372	伟星新材	27,300	663,936.00	0.09
315	002353	杰瑞股份	16,500	660,000.00	0.08
316	002024	苏宁易购	159,800	658,376.00	0.08
317	002266	浙富控股	92,200	656,464.00	0.08
318	601607	上海医药	33,000	655,710.00	0.08
319	000831	五矿稀土	16,800	655,536.00	0.08
320	002532	天山铝业	79,900	651,185.00	0.08
321	002223	鱼跃医疗	17,200	650,160.00	0.08
322	300251	光线传媒	50,400	647,640.00	0.08
323	601198	东兴证券	55,490	645,348.70	0.08
324	002028	思源电气	13,100	644,651.00	0.08
325	300144	宋城演艺	44,960	643,827.20	0.08
326	002850	科达利	4,000	641,360.00	0.08
327	002409	雅克科技	7,900	641,243.00	0.08
328	000009	中国宝安	44,300	639,249.00	0.08
329	000519	中兵红箭	23,900	637,413.00	0.08
330	600606	绿地控股	146,245	634,703.30	0.08
331	603613	国联股份	5,900	634,250.00	0.08
332	601933	永辉超市	155,800	630,990.00	0.08
333	600079	人福医药	28,000	630,560.00	0.08
334	603127	昭衍新药	5,460	630,247.80	0.08
335	000630	铜陵有色	180,700	628,836.00	0.08
336	601990	南京证券	63,300	627,303.00	0.08
337	300676	华大基因	7,100	623,380.00	0.08
338	600027	华电国际	116,500	623,275.00	0.08
339	002405	四维图新	39,000	620,880.00	0.08
340	002673	西部证券	76,700	618,969.00	0.08
341	300253	卫宁健康	36,780	616,432.80	0.08
342	688009	中国通号	123,300	614,034.00	0.08
343	600487	亨通光电	40,600	613,872.00	0.08
344	688208	道通科技	7,700	611,380.00	0.08
345	600705	中航产融	153,200	608,204.00	0.08
346	000932	华菱钢铁	118,700	606,557.00	0.08
347	600369	西南证券	114,100	603,589.00	0.08
348	601162	天风证券	148,700	602,235.00	0.08
349	002531	天顺风能	30,900	599,151.00	0.08
350	688185	康希诺	2,000	599,100.00	0.08

351	600160	巨化股份	46,400	599,024.00	0.08
352	002444	巨星科技	19,600	597,996.00	0.08
353	688002	睿创微纳	7,600	597,132.00	0.08
354	600392	盛和资源	30,200	592,524.00	0.08
355	600338	西藏珠峰	15,700	591,262.00	0.08
356	002407	多氟多	13,100	589,369.00	0.08
357	600109	国金证券	51,900	588,027.00	0.08
358	002508	老板电器	16,300	587,126.00	0.08
359	002192	融捷股份	4,500	585,675.00	0.08
360	601077	渝农商行	151,900	584,815.00	0.07
361	300308	中际旭创	13,700	582,250.00	0.07
362	000983	山西焦煤	70,320	581,546.40	0.07
363	601699	潞安环能	51,300	580,203.00	0.07
364	002032	苏泊尔	9,300	578,832.00	0.07
365	000155	川能动力	21,800	578,354.00	0.07
366	000591	太阳能	51,600	577,920.00	0.07
367	000728	国元证券	74,840	576,268.00	0.07
368	603712	七一二	13,300	575,890.00	0.07
369	002939	长城证券	44,400	574,980.00	0.07
370	002507	涪陵榨菜	15,200	574,560.00	0.07
371	601319	中国人保	121,900	572,930.00	0.07
372	600655	豫园股份	55,600	572,680.00	0.07
373	603233	大参林	13,560	571,011.60	0.07
374	002497	雅化集团	19,800	567,468.00	0.07
375	300558	贝达药业	7,100	566,793.00	0.07
376	002603	以岭药业	28,740	563,304.00	0.07
377	000629	攀钢钒钛	144,700	562,883.00	0.07
378	000999	华润三九	16,400	561,536.00	0.07
379	000960	锡业股份	28,700	560,511.00	0.07
380	601016	节能风电	86,000	559,860.00	0.07
381	300088	长信科技	42,100	559,088.00	0.07
382	600143	金发科技	44,200	556,036.00	0.07
383	600521	华海药业	25,590	554,279.40	0.07
384	603658	安图生物	10,050	553,353.00	0.07
385	601866	中远海发	170,200	553,150.00	0.07
386	600549	厦门钨业	24,400	552,172.00	0.07
387	000027	深圳能源	68,100	551,610.00	0.07
388	600170	上海建工	152,900	550,440.00	0.07
389	000050	深天马 A	42,200	549,444.00	0.07
390	600177	雅戈尔	79,500	547,755.00	0.07
391	000800	一汽解放	53,200	547,428.00	0.07
392	000423	东阿阿胶	11,220	546,975.00	0.07
393	603218	日月股份	16,600	546,970.00	0.07

394	300677	英科医疗	9,450	546,588.00	0.07
395	002456	欧菲光	56,000	543,200.00	0.07
396	601577	长沙银行	69,100	539,671.00	0.07
397	688188	柏楚电子	1,400	539,644.00	0.07
398	002463	沪电股份	32,520	539,181.60	0.07
399	002557	洽洽食品	8,731	535,734.16	0.07
400	688202	美迪西	1,100	534,149.00	0.07
401	002078	太阳纸业	46,200	530,838.00	0.07
402	600704	物产中大	89,300	528,656.00	0.07
403	002797	第一创业	72,200	528,504.00	0.07
404	002044	美年健康	67,300	528,305.00	0.07
405	002138	顺络电子	13,800	526,884.00	0.07
406	000998	隆平高科	22,600	525,676.00	0.07
407	002294	信立泰	19,100	521,812.00	0.07
408	002157	正邦科技	54,000	521,640.00	0.07
409	600872	中炬高新	13,700	520,189.00	0.07
410	603077	和邦生物	151,700	517,297.00	0.07
411	002299	圣农发展	21,400	517,238.00	0.07
412	300357	我武生物	9,000	515,700.00	0.07
413	600699	均胜电子	23,460	515,416.20	0.07
414	002152	广电运通	42,600	506,940.00	0.06
415	600711	盛屯矿业	47,200	506,456.00	0.06
416	603444	吉比特	1,200	506,220.00	0.06
417	002408	齐翔腾达	48,200	506,100.00	0.06
418	300850	新强联	2,800	499,828.00	0.06
419	000830	鲁西化工	32,700	499,002.00	0.06
420	002430	杭氧股份	16,600	498,166.00	0.06
421	300832	新产业	11,300	497,765.00	0.06
422	002153	石基信息	17,160	493,178.40	0.06
423	000860	顺鑫农业	12,700	484,886.00	0.06
424	300568	星源材质	13,200	484,836.00	0.06
425	002030	达安基因	24,124	483,927.44	0.06
426	300725	药石科技	3,400	483,378.00	0.06
427	000988	华工科技	17,300	481,978.00	0.06
428	002541	鸿路钢构	9,000	481,860.00	0.06
429	601456	国联证券	34,200	477,774.00	0.06
430	600998	九州通	32,200	473,984.00	0.06
431	600315	上海家化	11,700	472,797.00	0.06
432	300418	昆仑万维	20,200	467,630.00	0.06
433	603866	桃李面包	16,380	465,192.00	0.06
434	002422	科伦药业	24,500	463,785.00	0.06
435	000987	越秀金控	53,185	462,709.50	0.06
436	603638	艾迪精密	14,440	460,924.80	0.06

437	000683	远兴能源	63,100	460,630.00	0.06
438	000547	航天发展	27,500	459,250.00	0.06
439	002010	传化智联	52,700	458,490.00	0.06
440	002925	盈趣科技	13,450	457,703.50	0.06
441	600415	小商品城	94,300	457,355.00	0.06
442	600801	华新水泥	23,400	451,620.00	0.06
443	300070	碧水源	62,500	449,375.00	0.06
444	000709	河钢股份	182,300	448,458.00	0.06
445	300296	利亚德	43,700	447,925.00	0.06
446	600153	建发股份	49,200	446,244.00	0.06
447	002145	中核钛白	35,300	444,427.00	0.06
448	002926	华西证券	45,100	444,235.00	0.06
449	600598	北大荒	30,500	444,080.00	0.06
450	002156	通富微电	22,800	443,004.00	0.06
451	600688	上海石化	104,800	437,016.00	0.06
452	002690	美亚光电	11,600	434,536.00	0.06
453	600380	健康元	33,700	432,708.00	0.06
454	002465	海格通信	39,500	431,340.00	0.06
455	000513	丽珠集团	10,700	430,247.00	0.06
456	601696	中银证券	31,800	427,710.00	0.05
457	600988	赤峰黄金	28,600	426,140.00	0.05
458	000021	深科技	26,800	424,512.00	0.05
459	002092	中泰化学	44,300	422,622.00	0.05
460	300136	信维通信	16,600	420,312.00	0.05
461	000975	银泰黄金	47,680	418,630.40	0.05
462	002065	东华软件	53,500	417,300.00	0.05
463	002558	巨人网络	34,700	415,359.00	0.05
464	603858	步长制药	19,646	414,334.14	0.05
465	000656	金科股份	91,700	410,816.00	0.05
466	600511	国药股份	13,000	409,890.00	0.05
467	002500	山西证券	61,710	407,286.00	0.05
468	002373	千方科技	27,200	406,640.00	0.05
469	600848	上海临港	27,340	406,545.80	0.05
470	601992	金隅集团	143,100	406,404.00	0.05
471	601231	环旭电子	25,300	406,318.00	0.05
472	300212	易华录	11,420	403,697.00	0.05
473	600895	张江高科	26,600	400,596.00	0.05
474	300773	拉卡拉	13,700	397,574.00	0.05
475	300383	光环新网	26,500	393,260.00	0.05
476	002212	天融信	20,400	391,068.00	0.05
477	000750	国海证券	93,500	384,285.00	0.05
478	002506	协鑫集成	100,600	382,280.00	0.05
479	002429	兆驰股份	77,700	377,622.00	0.05

480	300432	富临精工	12,800	376,320.00	0.05
481	002511	中顺洁柔	22,500	375,975.00	0.05
482	002958	青农商行	95,400	368,244.00	0.05
483	002563	森马服饰	46,200	357,126.00	0.05
484	600026	中远海能	59,600	352,832.00	0.05
485	000686	东北证券	40,100	352,078.00	0.05
486	600583	海油工程	75,900	349,899.00	0.04
487	600498	烽火通信	19,400	348,812.00	0.04
488	603883	老百姓	7,040	347,635.20	0.04
489	002151	北斗星通	8,700	341,475.00	0.04
490	601598	中国外运	75,200	336,896.00	0.04
491	002146	荣盛发展	74,600	324,510.00	0.04

8.3.2 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	688262	国芯科技	7,009	294,237.82	0.04
2	688718	唯赛勃	3,145	87,147.95	0.01
3	688511	天微电子	1,490	81,234.80	0.01
4	301136	招标股份	7,172	75,449.44	0.01
5	301155	海力风电	597	57,759.75	0.01
6	301050	雷电微力	233	54,694.42	0.01
7	301177	迪阿股份	390	45,271.20	0.01
8	301029	怡合达	462	41,519.94	0.01
9	301087	可孚医疗	489	36,841.26	0.00
10	301035	润丰股份	644	36,244.32	0.00
11	301211	亨迪药业	967	32,539.55	0.00
12	301090	华润材料	2,764	31,012.08	0.00
13	301058	中粮工科	1,386	25,280.64	0.00
14	301189	奥尼电子	435	24,629.70	0.00
15	301166	优宁维	253	23,908.50	0.00
16	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.00
17	301099	雅创电子	310	22,121.60	0.00
18	301093	华兰股份	409	20,388.65	0.00
19	301018	申菱环境	782	20,378.92	0.00
20	301088	戎美股份	704	17,367.68	0.00
21	301101	明月镜片	371	16,086.56	0.00
22	301190	善水科技	575	15,789.50	0.00
23	301118	恒光股份	315	15,441.30	0.00
24	301108	洁雅股份	280	15,038.80	0.00
25	301179	泽宇智能	295	14,977.15	0.00

26	301089	拓新药业	220	14,944.60	0.00
27	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.00
28	301111	粤万年青	379	13,901.72	0.00
29	301188	力诺特玻	647	13,250.56	0.00
30	301199	迈赫股份	402	12,864.00	0.00
31	301020	密封科技	421	12,815.24	0.00
32	301138	华研精机	285	12,785.10	0.00
33	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.00
34	301126	达嘉维康	662	12,730.26	0.00
35	301185	鸥玛软件	578	12,230.48	0.00
36	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.00
37	301092	争光股份	323	11,472.96	0.00
38	301048	金鹰重工	843	10,925.28	0.00
39	301028	东亚机械	733	9,895.50	0.00
40	301045	天禄科技	335	9,503.95	0.00
41	300774	倍杰特	444	9,359.52	0.00
42	301040	中环海陆	241	9,280.91	0.00
43	301182	凯旺科技	294	8,990.52	0.00
44	301062	上海艾录	523	8,896.23	0.00
45	301052	果麦文化	252	8,477.28	0.00
46	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
47	301066	万事利	344	7,856.96	0.00
48	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
49	301055	张小泉	355	7,731.90	0.00
50	301133	金钟股份	286	7,707.70	0.00
51	301198	喜悦智行	262	7,650.40	0.00
52	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.00
53	301098	金埔园林	307	6,806.19	0.00
54	301081	严牌股份	380	6,627.20	0.00
55	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
56	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
57	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.00
58	301056	森赫股份	572	6,343.48	0.00
59	301036	双乐股份	205	6,135.65	0.00
60	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
61	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
62	301083	百胜智能	416	5,911.36	0.00
63	300854	中兰环保	203	5,539.87	0.00
64	301063	海锅股份	153	5,524.83	0.00
65	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
66	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
67	301059	金三江	259	4,998.70	0.00
68	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00

69	301037	保立佳	193	4,682.18	0.00
70	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
71	301053	远信工业	155	4,460.90	0.00
72	301057	汇隆新材	218	4,146.36	0.00
73	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
74	301079	邵阳液压	140	3,474.80	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	600519	贵州茅台	9,362,107.00	0.76
2	000333	美的集团	7,346,496.00	0.60
3	300750	宁德时代	5,829,344.04	0.47
4	300760	迈瑞医疗	4,805,626.00	0.39
5	300999	金龙鱼	4,734,732.46	0.38
6	000858	五粮液	4,419,698.00	0.36
7	601816	京沪高铁	3,671,489.15	0.30
8	002352	顺丰控股	3,124,668.00	0.25
9	601766	中国中车	3,066,138.00	0.25
10	600036	招商银行	2,979,584.00	0.24
11	600809	山西汾酒	2,605,534.00	0.21
12	600050	中国联通	2,461,876.00	0.20
13	300759	康龙化成	2,458,743.65	0.20
14	601658	邮储银行	2,317,432.00	0.19
15	601318	中国平安	2,200,058.00	0.18
16	603501	韦尔股份	2,162,994.00	0.18
17	300896	爱美客	2,146,660.00	0.17
18	600989	宝丰能源	1,928,002.00	0.16
19	688235	百济神州	1,850,500.80	0.15
20	688036	传音控股	1,811,395.21	0.15

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。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
----	------	------	----------	-----------------

1	300750	宁德时代	16,864,196.47	1.37
2	000858	五粮液	16,851,770.58	1.37
3	002415	海康威视	14,415,000.78	1.17
4	300760	迈瑞医疗	8,043,566.00	0.65
5	000001	平安银行	5,995,298.23	0.49
6	002594	比亚迪	5,581,076.46	0.45
7	000333	美的集团	5,502,033.37	0.45
8	002714	牧原股份	5,159,713.20	0.42
9	000568	泸州老窖	5,129,259.00	0.42
10	002475	立讯精密	4,943,612.93	0.40
11	002352	顺丰控股	4,893,965.83	0.40
12	300059	东方财富	4,490,449.31	0.37
13	300015	爱尔眼科	4,449,490.00	0.36
14	002304	洋河股份	4,373,846.98	0.36
15	600519	贵州茅台	4,092,444.00	0.33
16	002271	东方雨虹	4,029,271.89	0.33
17	000002	万科A	3,835,661.90	0.31
18	601766	中国中车	3,799,270.92	0.31
19	300122	智飞生物	3,560,336.00	0.29
20	002142	宁波银行	3,285,378.28	0.27

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。

8.4.3 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	299,722,953.64
卖出股票收入（成交）总额	462,755,831.08

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。

8.5 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	3,001,200.00	0.38
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）	858,996.20	0.11
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,860,196.20	0.49

8.6 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	019664	21 国债 16	30,000	3,001,200.00	0.38
2	113052	兴业转债	8,460	845,996.29	0.11
3	113634	珀莱转债	130	12,999.91	0.00

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.11.3 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。

8.12 投资组合报告附注

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。

根据 2021 年 7 月 5 日发布的相关公告，该证券发行人因违规经营被银保监会人身保险监管部通报批评，并责令改正。

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。

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。

8.12.1 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	22,711.58
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	14,475.91
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	37,187.49

8.12.2 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。

8.12.3 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.3.1 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。

8.12.3.2 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	688262	国芯科技	294,237.82	0.04	新股锁定
2	688718	唯赛勃	87,147.95	0.01	新股锁定
3	688511	天微电子	81,234.80	0.01	新股锁定
4	301136	招标股份	75,449.44	0.01	新股锁定
5	301155	海力风电	57,759.75	0.01	新股锁定

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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
576	899,227.52	502,342,263.00	96.99%	15,612,788.00	3.01%	496,000,000.00	95.76%

9.2 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	5,084,563.00	0.98%
2	方正证券股份有限公司	1,157,700.00	0.22%
3	张永峰	1,000,000.00	0.19%
4	陈桂琴	1,000,000.00	0.19%
5	梁维灿	600,000.00	0.12%
6	洪培新	500,000.00	0.10%
7	王喆	350,100.00	0.07%
8	李和明	300,000.00	0.06%
9	陈长安	202,000.00	0.04%
10	韩雅茹	200,000.00	0.04%
-	招商 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 联接	496,000,000.00	95.76%

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。

9.3 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	-	-

9.4 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

§ 10 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	22,000,000.00
减：报告期基金总赎回份额	356,000,000.00
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	517,955,051.00

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期未召开基金份额持有人大会。

11.2 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。

根据本基金管理人 2021 年 9 月 25 日的公告，经招商基金管理有限公司第六届董事会 2021 年第七次会议审议通过，王小青先生离任公司总经理职务、代为履行公司总经理职务。

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金的审计事务所无变化，目前德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）已为本基金提供审计服务 2 年，本报告期应支付给德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为人民币 40,000.00 元。

11.6 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、托管人的托管业务部门及其相关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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	502,059,330.87	68.40%	116,130.36	79.22%	-
方正证券	5	231,950,721.93	31.60%	30,455.95	20.78%	-
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	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
粤开证券	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。

11.7.2 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	5,892,049.30	86.24%	-	-	-	-
方正证券	940,109.90	13.76%	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-

11.8 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	上海证券报、基金管	2021-02-02

	证券投资基金更新的招募说明书（二零二一年第一号）	理人网站及中国证监会基金电子披露网站	
6	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基金电子披露网站	2021-03-06
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	2021-05-13

		会基金电子披露网站	
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基金电子披露网站	2021-06-05
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
23	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 2 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	2021-07-20
24	招商基金管理有限公司旗下基金 2021 年第 2 季度报告提示性公告	上海证券报及基金管理人网站	2021-07-20
25	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	2021-07-23
26	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	2021-08-10
27	关于警惕冒用招商基金管理有限公司名义进行诈骗活动的特别提示公告	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	2021-08-12
28	招商基金管理有限公司旗下部分基金增加国信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	2021-08-16
29	招商基金管理有限公司旗下基金 2021 年中期报告提示性公告	上海证券报及基金管理人网站	2021-08-30
30	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	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	2021-08-30
31	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	2021-09-03
32	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基金电子披露网站	2021-09-25
33	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	2021-10-08
34	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	2021-10-14
35	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	2021-10-22

36	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	2021-10-23
37	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 3 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	2021-10-26
38	招商基金管理有限公司旗下基金 2021 年第 3 季度报告提示性公告	上海证券报及基金管理人网站	2021-10-26
39	招商基金管理有限公司关于旗下部分公开募集证券投资基金可投资于北京证券交易所股票的公告	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	2021-11-16
40	关于警惕冒用招商基金管理有限公司名义进行诈骗活动的特别提示公告	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	2021-12-07
41	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	2021-12-21
42	招商基金管理有限公司关于基金美元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	2021-12-31

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	20210101-20211231	820,000,000.00	2,000,000.00	326,000,000.00	496,000,000.00	95.76%
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。

§ 13 备查文件目录

13.1 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。

13.2 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

13.3 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

2022 年 3 月 30 日