

招商 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金 2022 年中期报告

2022 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：2022 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 2022 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 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.....	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	10
4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	11
§5 托管人报告.....	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	11
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	11
6.1 资产负债表.....	11
6.2 利润表.....	13
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告.....	37
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	38
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.....	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	53
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	54
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	54
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	54
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	54
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	54

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	54
7.12 投资组合报告附注.....	55
§8 基金份额持有人信息.....	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	56
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	56
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	57
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	57
§9 开放式基金份额变动.....	57
§10 重大事件揭示.....	57
10.1 基金份额持有人大会决议.....	57
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	58
10.4 基金投资策略的改变.....	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	58
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	58
10.8 其他重大事件.....	61
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	62
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.....	62
§12 备查文件目录.....	63
12.1 备查文件目录.....	63
12.2 存放地点.....	63
12.3 查阅方式.....	63

§ 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	519,955,051.00 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	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
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(2022年1月1日 - 2022年6月30日)
本期已实现收益	-5,739,218.47
本期利润	-60,125,442.11
加权平均基金份额本期利润	-0.1160
本期加权平均净值利润率	-8.76%
本期基金份额净值增长率	-7.70%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)

期末可供分配利润	203,154,199.99
期末可供分配基金份额利润	0.3907
期末基金资产净值	723,109,250.99
期末基金份额净值	1.3907
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	39.07%

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

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

3、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。

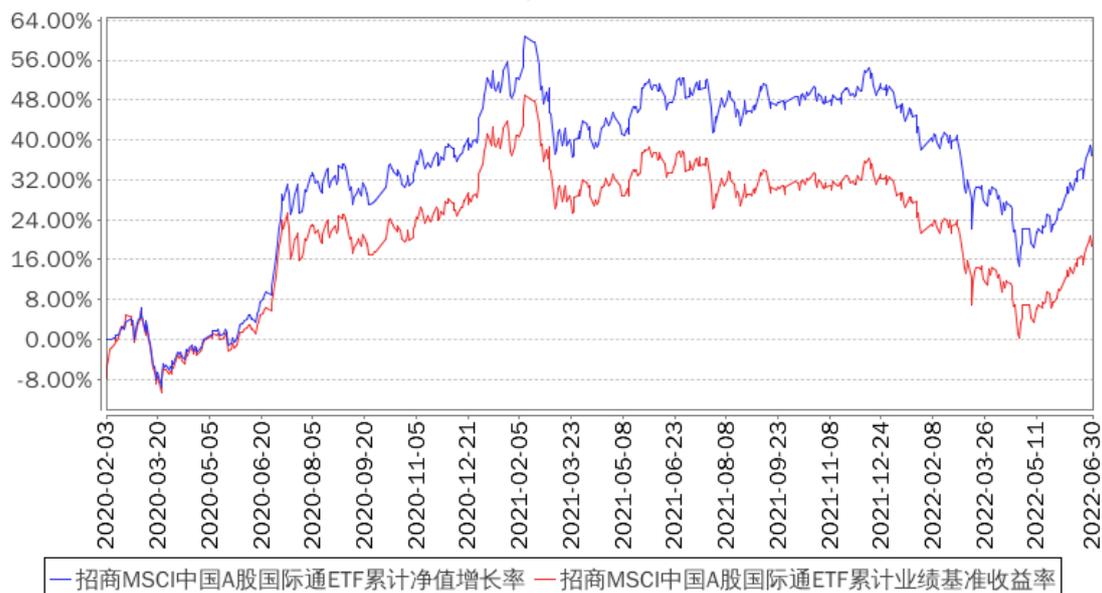
3.2 基金净值表现

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	10.24%	1.06%	9.38%	1.07%	0.86%	-0.01%
过去三个月	7.81%	1.44%	6.60%	1.46%	1.21%	-0.02%
过去六个月	-7.70%	1.44%	-9.07%	1.46%	1.37%	-0.02%
过去一年	-8.72%	1.21%	-12.39%	1.24%	3.67%	-0.03%
自基金合同生效起至今	39.07%	1.24%	20.56%	1.34%	18.51%	-0.10%

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

招商MSCI中国A股国际通ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

招商基金管理有限公司首批获得企业年金基金投资管理人资格、基本养老保险基金投资管理资格；2004 年获得全国社保基金投资管理人资格；同时拥有 QDII (合格境内机构投资者) 资格、专户理财（特定客户资产管理业务）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		
白海峰	本基金基金经理	2020 年 2 月 3 日	-	12	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

					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。
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。

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

2、证券从业年限计算标准遵从中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券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合规守信情况的说明

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% 的情形共发生过五次，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，俄乌冲突的爆发给全球能源供需平衡造成了较大的冲击，能源价格大幅上行，导致欧美等发达国家通胀水平快速攀升。为遏制通胀及通胀预期，美联储大幅收紧货币政策，受此影响海外主要国家权益资产大幅回调。国内方面，年初经济放缓叠加俄乌冲突压制了风险偏好，市场迎来了第一波回调。接着，上海、深圳等地的疫情亦对经济产生了较大的负面冲击，市场在恐慌情绪冲击下继续深度回调。二季度，随着疫情的消退及购车、消费等刺激政策的出台，市场在新能源及汽车的带领下强势反弹。

报告期内，本基金作为 ETF 基金，实现了对业绩比较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-7.70%，同期业绩基准增长率为-9.07%。

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，受通胀及货币紧缩的影响，欧美等国家可能面临一定的下行压力，国内出口大概率难以延续之前强劲态势。消费方面，疫情反复冲击下，消费者收入增长受到一定的影响，消费需求亦可能会受到一定的约束。固定资产投资方面，虽然下半年财政政策会更加积极，但地产市场的低迷及地产公司流动性困境仍然会限制地产投资的增长。总体来说，下半年国内经济仍然会面临一定的增长压力。从流动性环境来说，在国内外均面临经济增长压力的情况下，国内的流动性大概率仍将保持相对较为宽松的环境。从资本市场来说，我们认为虽然国内外经济增长都会面临一定的压力，但两者所处阶段完全不一样，国内经济正处于触底回升阶段，叠加流动性宽松的呵护，资本市场仍有一定的表现机会。

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：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	8,205,755.19	25,451,041.42
结算备付金		219,910.02	353,729.56
存出保证金		17,658.07	22,711.58
交易性金融资产	6.4.7.2	715,885,102.05	770,352,112.68
其中：股票投资		713,004,942.48	766,491,916.48
基金投资		-	-
债券投资		2,880,159.57	3,860,196.20
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		42,721.69	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	14,475.91
资产总计		724,371,147.02	796,194,071.15
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 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		-	-
应付清算款		-	14,698,607.46
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		280,840.05	336,506.09
应付托管费		56,167.99	67,301.23
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.54	-
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	924,887.45	696,443.98
负债合计		1,261,896.03	15,798,858.76
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	519,955,051.00	517,955,051.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	203,154,199.99	262,440,161.39
净资产合计		723,109,250.99	780,395,212.39
负债和净资产总计		724,371,147.02	796,194,071.15

注：1、报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.3907 元，基金份额总额 519,955,051.00 份；

2、以下比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》中的资产负债表格式的要求进行列示：上年度资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目“本期末”余额合并列示在本期资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，上年度资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额中。

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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-57,794,178.98	64,006,695.10
1.利息收入		19,405.50	68,782.94
其中：存款利息收入	6.4.7.9	19,405.50	68,463.40
债券利息收入		-	319.54
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）		-3,360,395.90	58,815,849.50
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-10,085,206.67	52,434,743.96
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	405,808.92	235,088.47
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-

收益			
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	6,319,001.85	6,146,017.07
以摊余成本计量的 金融资产终止确认产生的 收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.16	-54,386,223.64	5,773,086.22
4.汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.17	-66,964.94	-651,023.56
减：二、营业总支出		2,331,263.13	3,644,408.00
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	1,704,348.27	2,362,224.80
2.托管费	6.4.10.2.2	340,869.67	472,444.98
3.销售服务费		-	-
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6.信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7.税金及附加		0.46	0.52
8.其他费用	6.4.7.19	286,044.73	809,737.70
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		-60,125,442.11	60,362,287.10
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		-60,125,442.11	60,362,287.10
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		-60,125,442.11	60,362,287.10

注：以下比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》中的利润表格式的要求进行列示：上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

6.3 净资产（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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	517,955,051.00	-	262,440,161.39	780,395,212.39
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	517,955,051.00	-	262,440,161.39	780,395,212.39
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	2,000,000.00	-	-59,285,961.40	-57,285,961.40
（一）、综合收益总额	-	-	-60,125,442.11	-60,125,442.11
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	2,000,000.00	-	839,480.71	2,839,480.71
其中：1.基金申购款	14,000,000.00	-	4,535,433.89	18,535,433.89
2.基金赎回款	-12,000,000.00	-	-3,695,953.18	-15,695,953.18
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	519,955,051.00	-	203,154,199.99	723,109,250.99
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	851,955,051.00	-	377,881,510.99	1,229,836,561.99
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-

正				
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	851,955,051.00	-	377,881,510.99	1,229,836,561.99
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-260,000,000.00	-	-67,985,603.44	-327,985,603.44
（一）、综合收益总额	-	-	60,362,287.10	60,362,287.10
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-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
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	591,955,051.00	-	309,895,907.55	901,850,958.55

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：

_____ 徐勇 _____ 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 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2022 年 1 月 1 日至 2022 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不一致,具体请见 6.4.5.1 会计政策变更的说明。

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

根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》（以下简称“新金融工具准则”）相关规定，以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。本基金在编制本中期财务报表时已采用新金融工具准则，并采用准则允许的实务简便方法，调整期初基金净值，2021 年的比较数据将不作重述。

于首次执行日，本基金因执行新金融工具准则调减期初基金净值人民币 0.00 元，本基金执行新金融工具准则的影响如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融工具包括银行存款、结算备付金、存出保证金和应收利息，金额分别为人民币 25,451,041.42 元、人民币 353,729.56 元、人民币 22,711.58 元和人民币 14,475.91 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融工具包括银行存款、结算备付金、存出保证金和其他资产—应收利息。本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在银行存款、结算备付金和存出保证金等项目中，不单独列示应收利息项目或应付利息项目。新金融工具准则下，银行存款、结算备付金、存出保证金和其他资产—应收利息的金额分别为人民币 25,453,468.37 元、人民币 353,887.46 元、人民币 22,721.78 元和人民币 0.00 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融工具为交易性金融资产，金额为人民币 770,352,112.68 元，归属于交易性金融资产的应收利息金额为人民币 11,880.86 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融工具为交易性金融资产，金额为人民币 770,363,993.54 元。

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 2022 年 6 月 30 日
活期存款	8,205,755.19
等于：本金	8,205,167.19
加：应计利息	588.00
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-

加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	8,205,755.19

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	733,476,461.49	-	713,004,942.48	-20,471,519.01
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	40,410.16	2,880,159.57	4,590.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	40,410.16	2,880,159.57	4,590.00
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	736,311,620.90	40,410.16	715,885,102.05	-20,466,929.01

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

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 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-

应付交易费用	14,571.90
其中：交易所市场	14,571.90
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	329,547.14
应付指数使用费	580,768.41
合计	924,887.45

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	517,955,051.00	517,955,051.00
本期申购	14,000,000.00	14,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-12,000,000.00	-12,000,000.00
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	519,955,051.00	519,955,051.00

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。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	221,956,570.35	40,483,591.04	262,440,161.39
本期利润	-5,739,218.47	-54,386,223.64	-60,125,442.11
本期基金份额交易产生的变动数	824,871.81	14,608.90	839,480.71
其中：基金申购款	5,966,339.66	-1,430,905.77	4,535,433.89
基金赎回款	-5,141,467.85	1,445,514.67	-3,695,953.18
本期已分配利润	-	-	-
本期末	217,042,223.69	-13,888,023.70	203,154,199.99

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	18,062.94
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	1,174.39
其他	168.17
合计	19,405.50

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-9,378,250.89
股票投资收益——赎回差价收入	-706,955.78
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	-10,085,206.67

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	64,592,040.92
减：卖出股票成本总额	73,841,787.33
减：交易费用	128,504.48
买卖股票差价收入	-9,378,250.89

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	15,695,953.18
减：现金支付赎回款总额	6,824,287.18
减：赎回股票成本总额	9,578,621.78
减：交易费用	-
赎回差价收入	-706,955.78

6.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无股票申购差价收入。

6.4.7.10.5 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。

6.4.7.11 债券投资收益**6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	30,407.68
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	375,401.24
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	405,808.92

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	2,891,127.48
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	2,513,831.13
减：应计利息总额	1,887.86
减：交易费用	7.25
买卖债券差价收入	375,401.24

6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券申购差价收入。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益**6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成**

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内无买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.12.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券赎回差价收入。

6.4.7.12.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券申购差价收入。

6.4.7.13 贵金属投资收益**6.4.7.13.1 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。

6.4.7.13.2 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。

6.4.7.13.3 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。

6.4.7.13.4 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。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 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。

6.4.7.14.2 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。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	6,319,001.85
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	6,319,001.85

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-54,386,223.64
——股票投资	-54,389,013.64
——债券投资	2,790.00
——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	-54,386,223.64

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	-66,964.94
合计	-66,964.94

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
IOPV 服务费	24,795.19
银行费用	1,554.61
指数使用费	170,434.78
合计	286,044.73

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

注：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。

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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	80,646,031.89	64.37%	319,275,735.88	69.92%
------	---------------	--------	----------------	--------

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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	2,775,494.70	96.06%	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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
招商证券	18,654.20	76.09%	10,454.02	71.74%
关联方名称	上年度可比期间 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%

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,704,348.27	2,362,224.80
其中：支付销售机构的客户维护费	328.32	-
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：

$$\text{日基金管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	340,869.67	472,444.98

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：

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

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 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	95.39%	496,000,000.00	95.76%
招商证券股份有限公司	6,947,663.00	1.34%	5,084,563.00	0.98%

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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-活期	8,205,755.19	18,062.94	29,436,944.87	56,396.25

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
招商证券	001323	慕思股份	网下申购	573	22,306.89
招商证券	301123	奕东电子	网下申购	6,551	243,893.73
招商证券	700030	中信配股	配股	27,420	395,670.60
中银国际证券	600938	中国海油	网下申购	120,005	1,296,054.00

上年度可比期间 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

注：本表已包含托管人的关联方承销期内承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

于 2022 年 6 月 30 日，本基金因指数成份股原因被动持有招商银行（600036）347,240 股，市值为人民币 14,653,528.00 元，占本基金资产净值的比例为 2.03%（2021 年 6 月 30 日：持有 402,740 股，市值为人民币 21,824,480.60 元，占基金资产净值的比例为 2.42%）。

于 2022 年 6 月 30 日，本基金因指数成份股原因被动持有招商证券（600999）124,880 股，市值为人民币 1,799,520.80 元，占本基金资产净值的比例为 0.25%（2021 年 6 月 30 日：持有 145,080 股，市值为人民币 2,759,421.60 元，占基金资产净值的比例为 0.31%）。

于 2022 年 6 月 30 日，本基金因指数成份股原因被动持有中国银行（601988）589,000 股，市值为人民币 1,920,140.00 元，占本基金资产净值的比例为 0.27%（2021 年 6 月 30 日：持有 688,600 股，市值为人民币 2,120,888.00 元，占基金资产净值的比例为 0.24%）。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2022 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	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
301112	信邦智能	2022 年 6 月 20 日	6 个月	新股流通受限	27.53	45.04	399	10,984.47	17,970.96	-
301116	益客食品	2022 年 1 月 10 日	6 个月	新股流通受限	11.40	20.46	577	6,577.80	11,805.42	-
301117	佳缘科技	2022 年 1 月 7 日	6 个月	新股流通受限	46.80	54.44	262	12,261.60	14,263.28	-
301122	采纳股份	2022 年 1 月 19 日	6 个月	新股流通受限	50.31	70.37	301	15,143.31	21,181.37	-
301123	奕东电子	2022 年 1 月 14 日	6 个月	新股流通受限	37.23	25.39	656	24,422.88	16,655.84	-
301125	腾亚精工	2022 年 5 月 27 日	6 个月	新股流通受限	22.49	27.42	327	7,354.23	8,966.34	-
301130	西点药业	2022 年 2 月 16 日	6 个月	新股流通受限	22.55	37.70	237	5,344.35	8,934.90	-
301148	嘉戎技术	2022 年 4 月 14 日	6 个月	新股流通受限	38.39	23.90	516	19,809.24	12,332.40	-
301153	中科江南	2022 年 5 月 10 日	6 个月	新股流通受限	33.68	43.98	398	13,404.64	17,504.04	-
301158	德石股份	2022 年 1 月 7 日	6 个月	新股流通受限	15.64	20.38	379	5,927.56	7,724.02	-
301160	翔楼新材	2022 年 5 月 25 日	6 个月	新股流通受限	31.56	37.66	392	12,371.52	14,762.72	-
301163	宏德	2022 年 4 月	6 个月	新股流	26.27	32.33	277	7,276.79	8,955.41	-

	股份	月 11 日		通受限						
301175	中科环保	2022 年 6 月 30 日	1 个月内(含)	新股流通受限	3.82	3.82	57,324	218,977.68	218,977.68	-
301175	中科环保	2022 年 6 月 30 日	6 个月	新股流通受限	3.82	3.82	6,370	24,333.40	24,333.40	-
301196	唯科科技	2022 年 1 月 4 日	6 个月	新股流通受限	64.08	37.52	271	17,365.68	10,167.92	-
301200	大族数控	2022 年 2 月 18 日	6 个月	新股流通受限	76.56	51.92	509	38,969.04	26,427.28	-
301215	中汽股份	2022 年 2 月 28 日	6 个月	新股流通受限	3.80	6.39	4,743	18,023.40	30,307.77	-
301216	万凯新材	2022 年 3 月 21 日	6 个月	新股流通受限	35.68	29.84	789	28,151.52	23,543.76	-
301217	铜冠铜箔	2022 年 1 月 20 日	6 个月	新股流通受限	17.27	14.83	2,273	39,254.71	33,708.59	-
301219	腾远钴业	2022 年 3 月 10 日	6 个月	新股流通受限	173.98	87.82	230	22,269.44	20,198.60	-
301220	亚香股份	2022 年 6 月 15 日	6 个月	新股流通受限	35.98	39.15	285	10,254.30	11,157.75	-
301238	瑞泰新材	2022 年 6 月 10 日	6 个月	新股流通受限	19.18	32.07	1,903	36,499.54	61,029.21	-
301239	普瑞眼科	2022 年 6 月 22 日	1 个月内(含)	新股流通受限	33.65	33.65	5,172	174,037.80	174,037.80	-
301239	普瑞眼科	2022 年 6 月 22 日	6 个月	新股流通受限	33.65	33.65	575	19,348.75	19,348.75	-
301258	富士莱	2022 年 3 月 21 日	6 个月	新股流通受限	48.30	41.68	295	14,248.50	12,295.60	-
301263	泰恩康	2022 年 3 月 22 日	6 个月	新股流通受限	19.93	31.38	682	13,592.26	21,401.16	-
301266	宇邦新材	2022 年 5 月 30 日	6 个月	新股流通受限	26.86	47.07	517	13,886.62	24,335.19	-
301268	铭利达	2022 年 3 月 29 日	6 个月	新股流通受限	28.50	34.87	641	18,268.50	22,351.67	-
301279	金道科技	2022 年 4 月 6 日	6 个月	新股流通受限	31.20	22.81	296	9,235.20	6,751.76	-
301298	东利机械	2022 年 5 月 27 日	6 个月	新股流通受限	12.68	20.83	634	8,039.12	13,206.22	-
301302	华如科技	2022 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通受限	52.03	56.42	466	24,245.98	26,291.72	-
600938	中国海油	2022 年 4 月 14 日	6 个月	新股流通受限	10.80	15.86	84,004	907,243.20	1,332,303.44	-
688120	华海清科	2022 年 5 月 30 日	6 个月	新股流通受限	136.66	217.12	2,471	337,686.86	536,503.52	-

688237	超卓航科	2022 年 6 月 24 日	1 个月内(含)	新股流通受限	41.27	41.27	2,891	119,311.57	119,311.57	-
688267	中触媒	2022 年 2 月 9 日	6 个月	新股流通受限	41.90	31.90	3,390	142,041.00	108,141.00	-
688283	坤恒顺维	2022 年 2 月 8 日	6 个月	新股流通受限	33.80	45.41	1,595	53,911.00	72,428.95	-
688322	奥比中光	2022 年 6 月 30 日	1 个月内(含)	新股流通受限	30.99	30.99	8,529	264,313.71	264,313.71	-
688400	凌云光	2022 年 6 月 27 日	1 个月内(含)	新股流通受限	21.93	21.93	11,664	255,791.52	255,791.52	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113060	浙 22 转债	2022 年 6 月 14 日	1 个月内(含)	新债未上市	100.00	100.01	1,170	116,999.49	117,008.21	-
127064	杭氧转债	2022 年 5 月 19 日	1-6 个月(含)	新债未上市	100.00	100.02	187	18,699.92	18,703.44	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金是指数型基金，本基金的运作涉及的金融工具主要包括股票投资(主要是指数成份股、备选成份股)。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建立了以全面、独立、互相制约以及定性和定量相结合为原则的，监事会、董事会及下设风险控制委员会、督察长、风险管理委员会、法律合规部和风险管理部等多层次的风险管理组织架构体系。

6.4.13.2 信用风险

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

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；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并采用券款对付交割方式，以控制相应的信用风险。

对于与债券投资、资产支持证券投资等投资品种相关的信用风险，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 列示了本基金所持有的债券投资及资产支持证券投资的信用评级，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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
AAA	117,008.21	845,996.29
AAA 以下	18,703.44	12,999.91
未评级	-	-
合计	135,711.65	858,996.20

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 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。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。

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，并按照合同约定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 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	8,205,755.19	-	-	-	8,205,755.19
结算备付金	219,910.02	-	-	-	219,910.02
存出保证金	17,658.07	-	-	-	17,658.07
交易性金融资产	2,744,447.92	-	135,711.65	713,004,942.48	715,885,102.05
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	42,721.69	42,721.69
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	11,187,771.20	-	135,711.65	713,047,664.17	724,371,147.02
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	280,840.05	280,840.05
应付托管费	-	-	-	56,167.99	56,167.99
应付清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	0.54	0.54
其他负债	-	-	-	924,887.45	924,887.45
负债总计	-	-	-	1,261,896.03	1,261,896.03
利率敏感度缺口	11,187,771.20	-	135,711.65	711,785,768.14	723,109,250.99
上年度末 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

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

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（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
		1. 市场利率平行上升 50 个基点	-8,282.96
	2. 市场利率平行下降 50 个基点	8,430.76	37,281.65

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，也有可能与其他投资品种相关。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 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 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	713,004,942.48	98.60	766,491,916.48	98.22
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	713,004,942.48	98.60	766,491,916.48	98.22

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（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
	1. 权益性投资的市场价格上升 5%	35,650,247.12	38,324,595.82
	2. 权益性投资的市场价格下降 5%	-35,650,247.12	-38,324,595.82

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日
第一层次	709,375,220.24
第二层次	3,956,274.00
第三层次	2,553,607.81
合计	715,885,102.05

6.4.14.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其公允价值和账面价值相若。

6.4.15 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	713,004,942.48	98.43
	其中：股票	713,004,942.48	98.43
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,880,159.57	0.40
	其中：债券	2,880,159.57	0.40
	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	8,425,665.21	1.16
8	其他资产	60,379.76	0.01
9	合计	724,371,147.02	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	8,705,252.74	1.20
B	采矿业	27,681,430.88	3.83
C	制造业	422,080,134.78	58.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	21,439,907.50	2.96
E	建筑业	12,516,926.00	1.73
F	批发和零售业	5,761,102.48	0.80
G	交通运输、仓储和邮政业	21,855,482.58	3.02
H	住宿和餐饮业	1,437,380.00	0.20
I	信息传输、软件和信息技术服务业	21,639,780.70	2.99
J	金融业	124,676,375.67	17.24
K	房地产业	12,678,966.24	1.75
L	租赁和商务服务业	10,124,496.00	1.40
M	科学研究和技术服务业	8,436,654.03	1.17
N	水利、环境和公共设施管理业	1,482,108.00	0.20
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	6,029,257.26	0.83
R	文化、体育和娱乐业	2,194,979.00	0.30
S	综合	586,815.00	0.08
	合计	709,327,048.86	98.09

7.2.2 期末积极投资按行业分类境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,332,320.89	0.18
C	制造业	1,786,774.73	0.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	21,401.16	0.00
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	58,059.04	0.01

	务业		
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	30,307.77	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	255,643.48	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	193,386.55	0.03
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,677,893.62	0.51

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	21,167	43,286,515.00	5.99
2	300750	宁德时代	39,300	20,986,200.00	2.90
3	600036	招商银行	347,240	14,653,528.00	2.03
4	000858	五粮液	65,400	13,206,222.00	1.83
5	002594	比亚迪	30,500	10,171,445.00	1.41
6	600900	长江电力	382,800	8,850,336.00	1.22
7	601318	中国平安	182,300	8,511,587.00	1.18
8	601012	隆基绿能	127,535	8,497,657.05	1.18
9	601888	中国中免	32,800	7,640,104.00	1.06
10	601166	兴业银行	349,700	6,959,030.00	0.96
11	600809	山西汾酒	20,595	6,689,256.00	0.93
12	300760	迈瑞医疗	20,480	6,414,336.00	0.89
13	000568	泸州老窖	24,800	6,114,192.00	0.85
14	603288	海天味业	65,053	5,878,189.08	0.81
15	300059	东方财富	222,411	5,649,239.40	0.78
16	600309	万华化学	52,796	5,120,684.04	0.71
17	601398	工商银行	1,058,800	5,050,476.00	0.70
18	002714	牧原股份	88,562	4,894,821.74	0.68
19	000001	平安银行	326,600	4,892,468.00	0.68

20	002304	洋河股份	25,400	4,652,010.00	0.64
21	002352	顺丰控股	82,400	4,598,744.00	0.64
22	600438	通威股份	75,800	4,537,388.00	0.63
23	603259	药明康德	43,137	4,485,816.63	0.62
24	600030	中信证券	205,420	4,449,397.20	0.62
25	601288	农业银行	1,432,900	4,327,358.00	0.60
26	600887	伊利股份	107,700	4,194,915.00	0.58
27	300015	爱尔眼科	91,038	4,075,771.26	0.56
28	002475	立讯精密	119,069	4,023,341.51	0.56
29	002142	宁波银行	111,230	3,983,146.30	0.55
30	600276	恒瑞医药	107,332	3,980,943.88	0.55
31	600000	浦发银行	494,000	3,956,940.00	0.55
32	002812	恩捷股份	15,100	3,781,795.00	0.52
33	601668	中国建筑	706,100	3,756,452.00	0.52
34	601088	中国神华	111,008	3,696,566.40	0.51
35	600436	片仔癀	10,200	3,638,646.00	0.50
36	600048	保利发展	201,500	3,518,190.00	0.49
37	601816	京沪高铁	688,800	3,457,776.00	0.48
38	601225	陕西煤业	163,200	3,456,576.00	0.48
39	000002	万科 A	163,700	3,355,850.00	0.46
40	601328	交通银行	660,600	3,289,788.00	0.45
41	601899	紫金矿业	347,000	3,237,510.00	0.45
42	002129	TCL 中环	54,400	3,203,616.00	0.44
43	300014	亿纬锂能	31,913	3,111,517.50	0.43
44	600406	国电南瑞	112,728	3,043,656.00	0.42
45	600905	三峡能源	480,900	3,024,861.00	0.42
46	300122	智飞生物	26,900	2,986,169.00	0.41
47	002459	晶澳科技	37,620	2,968,218.00	0.41
48	601919	中远海控	213,020	2,960,978.00	0.41
49	300124	汇川技术	44,400	2,924,628.00	0.40
50	600690	海尔智家	106,200	2,916,252.00	0.40
51	002460	赣锋锂业	19,400	2,884,780.00	0.40
52	600031	三一重工	143,100	2,727,486.00	0.38
53	601601	中国太保	115,300	2,713,009.00	0.38
54	002493	荣盛石化	170,474	2,623,594.86	0.36
55	603501	韦尔股份	14,800	2,560,844.00	0.35
56	603799	华友钴业	26,694	2,552,480.28	0.35
57	000725	京东方 A	631,300	2,487,322.00	0.34
58	002371	北方华创	8,800	2,438,656.00	0.34
59	000625	长安汽车	139,308	2,412,814.56	0.33
60	601658	邮储银行	447,600	2,412,564.00	0.33
61	300274	阳光电源	24,550	2,412,037.50	0.33
62	600585	海螺水泥	67,400	2,377,872.00	0.33

63	688599	天合光能	36,300	2,368,575.00	0.33
64	600104	上汽集团	131,068	2,334,321.08	0.32
65	300498	温氏股份	106,900	2,275,901.00	0.31
66	600019	宝钢股份	374,900	2,256,898.00	0.31
67	600016	民生银行	596,900	2,220,468.00	0.31
68	600346	恒力石化	98,800	2,197,312.00	0.30
69	600028	中国石化	536,800	2,190,144.00	0.30
70	600111	北方稀土	61,100	2,148,276.00	0.30
71	601766	中国中车	409,500	2,129,400.00	0.29
72	601390	中国中铁	345,700	2,122,598.00	0.29
73	601066	中信建投	72,909	2,107,799.19	0.29
74	601818	光大银行	696,000	2,094,960.00	0.29
75	601985	中国核电	302,600	2,075,836.00	0.29
76	600893	航发动力	44,900	2,043,399.00	0.28
77	601669	中国电建	257,500	2,026,525.00	0.28
78	002709	天赐材料	32,420	2,011,985.20	0.28
79	603659	璞泰来	23,400	1,974,960.00	0.27
80	002049	紫光国微	10,300	1,954,116.00	0.27
81	002241	歌尔股份	57,500	1,932,000.00	0.27
82	601857	中国石油	363,300	1,925,490.00	0.27
83	601211	国泰君安	126,500	1,922,800.00	0.27
84	601988	中国银行	589,000	1,920,140.00	0.27
85	000776	广发证券	99,700	1,864,390.00	0.26
86	000538	云南白药	30,140	1,820,154.60	0.25
87	600050	中国联通	521,500	1,804,390.00	0.25
88	600010	包钢股份	767,300	1,803,155.00	0.25
89	300896	爱美客	3,000	1,800,030.00	0.25
90	600999	招商证券	124,880	1,799,520.80	0.25
91	001979	招商蛇口	133,300	1,790,219.00	0.25
92	600745	闻泰科技	21,000	1,787,310.00	0.25
93	600919	江苏银行	248,640	1,770,316.80	0.24
94	601688	华泰证券	123,900	1,759,380.00	0.24
95	601009	南京银行	168,500	1,755,770.00	0.24
96	600089	特变电工	63,700	1,744,743.00	0.24
97	000596	古井贡酒	6,900	1,722,654.00	0.24
98	000063	中兴通讯	67,000	1,710,510.00	0.24
99	000895	双汇发展	58,300	1,708,190.00	0.24
100	603993	洛阳钼业	297,400	1,704,102.00	0.24
101	600188	兖矿能源	42,700	1,685,796.00	0.23
102	000651	格力电器	49,800	1,679,256.00	0.23
103	002311	海大集团	27,900	1,674,279.00	0.23
104	601006	大秦铁路	250,300	1,649,477.00	0.23
105	601138	工业富联	167,200	1,645,248.00	0.23

106	002027	分众传媒	243,200	1,636,736.00	0.23
107	000166	申万宏源	379,400	1,627,626.00	0.23
108	002230	科大讯飞	39,200	1,615,824.00	0.22
109	601169	北京银行	355,900	1,615,786.00	0.22
110	603986	兆易创新	11,308	1,608,110.68	0.22
111	300759	康龙化成	16,750	1,594,935.00	0.22
112	600837	海通证券	162,500	1,594,125.00	0.22
113	000661	长春高新	6,776	1,581,653.92	0.22
114	601229	上海银行	239,094	1,566,065.70	0.22
115	603392	万泰生物	9,960	1,546,788.00	0.21
116	688111	金山办公	7,800	1,537,536.00	0.21
117	600989	宝丰能源	102,900	1,507,485.00	0.21
118	600926	杭州银行	99,800	1,495,004.00	0.21
119	600196	复星医药	33,800	1,490,242.00	0.21
120	603806	福斯特	22,444	1,470,530.88	0.20
121	300316	晶盛机电	21,700	1,466,703.00	0.20
122	601628	中国人寿	46,715	1,451,902.20	0.20
123	600150	中国船舶	75,300	1,429,194.00	0.20
124	000338	潍柴动力	114,200	1,424,074.00	0.20
125	300751	迈为股份	2,880	1,413,792.00	0.20
126	600660	福耀玻璃	33,700	1,408,997.00	0.19
127	601633	长城汽车	37,800	1,400,112.00	0.19
128	002920	德赛西威	9,400	1,391,200.00	0.19
129	600029	南方航空	186,300	1,361,853.00	0.19
130	601100	恒立液压	21,982	1,356,729.04	0.19
131	000963	华东医药	29,400	1,327,704.00	0.18
132	600522	中天科技	57,400	1,325,940.00	0.18
133	300763	锦浪科技	6,200	1,320,600.00	0.18
134	600886	国投电力	125,501	1,317,760.50	0.18
135	300999	金龙鱼	24,300	1,312,686.00	0.18
136	600958	东方证券	128,524	1,312,230.04	0.18
137	601111	中国国航	111,800	1,297,998.00	0.18
138	601868	中国能建	545,700	1,293,309.00	0.18
139	601877	正泰电器	36,100	1,291,658.00	0.18
140	300142	沃森生物	26,600	1,287,174.00	0.18
141	603833	欧派家居	8,520	1,283,793.60	0.18
142	002074	国轩高科	28,000	1,276,800.00	0.18
143	601689	拓普集团	18,600	1,272,798.00	0.18
144	601238	广汽集团	82,600	1,258,824.00	0.17
145	600588	用友网络	57,860	1,256,140.60	0.17
146	600600	青岛啤酒	12,000	1,247,040.00	0.17
147	600460	士兰微	23,800	1,237,600.00	0.17
148	300782	卓胜微	9,056	1,222,560.00	0.17

149	600741	华域汽车	53,100	1,221,300.00	0.17
150	688012	中微公司	10,400	1,214,200.00	0.17
151	002180	纳思达	23,800	1,204,756.00	0.17
152	002001	新 和 成	52,108	1,188,583.48	0.16
153	600132	重庆啤酒	8,100	1,187,460.00	0.16
154	601615	明阳智能	35,100	1,186,380.00	0.16
155	002821	凯莱英	4,100	1,184,900.00	0.16
156	000733	振华科技	8,700	1,182,939.00	0.16
157	600233	圆通速递	57,800	1,178,542.00	0.16
158	600176	中国巨石	67,425	1,173,869.25	0.16
159	600795	国电电力	300,200	1,173,782.00	0.16
160	600256	广汇能源	110,500	1,164,670.00	0.16
161	000876	新 希 望	75,800	1,159,740.00	0.16
162	300628	亿联网络	15,200	1,157,480.00	0.16
163	688008	澜起科技	19,000	1,151,020.00	0.16
164	000100	TCL 科技	238,800	1,143,852.00	0.16
165	601336	新华保险	35,100	1,129,869.00	0.16
166	000301	东方盛虹	66,800	1,129,588.00	0.16
167	600547	山东黄金	60,808	1,128,596.48	0.16
168	600015	华夏银行	215,800	1,124,318.00	0.16
169	603290	斯达半导	2,900	1,119,110.00	0.15
170	300769	德方纳米	2,700	1,103,436.00	0.15
171	300661	圣邦股份	6,000	1,092,120.00	0.15
172	601865	福莱特	28,600	1,089,660.00	0.15
173	688396	华润微	18,400	1,086,888.00	0.15
174	600011	华能国际	154,300	1,086,272.00	0.15
175	603369	今世缘	21,100	1,076,100.00	0.15
176	600570	恒生电子	24,608	1,071,432.32	0.15
177	600884	杉杉股份	36,000	1,069,920.00	0.15
178	601618	中国中冶	300,400	1,051,400.00	0.15
179	300413	芒果超媒	31,500	1,050,840.00	0.15
180	002648	卫星化学	40,562	1,048,527.70	0.15
181	601600	中国铝业	220,200	1,045,950.00	0.14
182	300957	贝泰妮	4,800	1,044,144.00	0.14
183	600845	宝信软件	19,070	1,041,222.00	0.14
184	600426	华鲁恒升	35,550	1,038,060.00	0.14
185	601788	光大证券	65,800	1,037,008.00	0.14
186	002756	永兴材料	6,800	1,035,028.00	0.14
187	002736	国信证券	107,900	1,032,603.00	0.14
188	601360	三六零	120,300	1,024,956.00	0.14
189	000799	酒鬼酒	5,500	1,021,955.00	0.14
190	600383	金地集团	76,000	1,021,440.00	0.14
191	603185	上机数控	6,500	1,013,935.00	0.14

192	601838	成都银行	60,800	1,008,064.00	0.14
193	688036	传音控股	11,200	999,376.00	0.14
194	603260	合盛硅业	8,400	990,864.00	0.14
195	000786	北新建材	28,400	983,208.00	0.14
196	002938	鹏鼎控股	32,500	981,825.00	0.14
197	601939	建设银行	161,400	978,084.00	0.14
198	603486	科沃斯	8,000	975,120.00	0.13
199	300408	三环集团	32,300	972,230.00	0.13
200	688005	容百科技	7,500	970,800.00	0.13
201	600754	锦江酒店	15,400	968,660.00	0.13
202	601155	新城控股	38,088	968,577.84	0.13
203	601117	中国化学	102,800	967,348.00	0.13
204	605117	德业股份	3,400	951,626.00	0.13
205	600763	通策医疗	5,400	941,976.00	0.13
206	601916	浙商银行	281,400	934,248.00	0.13
207	000938	紫光股份	48,100	933,140.00	0.13
208	300433	蓝思科技	83,700	926,559.00	0.13
209	300496	中科创达	7,100	926,408.00	0.13
210	601901	方正证券	138,000	925,980.00	0.13
211	000983	山西焦煤	69,020	924,177.80	0.13
212	600009	上海机场	16,218	919,560.60	0.13
213	600018	上港集团	156,800	914,144.00	0.13
214	300207	欣旺达	28,900	913,240.00	0.13
215	000069	华侨城 A	138,000	895,620.00	0.12
216	603606	东方电缆	11,600	888,560.00	0.12
217	601727	上海电气	215,001	883,654.11	0.12
218	002240	盛新锂能	14,600	881,256.00	0.12
219	603899	晨光股份	15,700	880,456.00	0.12
220	000723	美锦能源	71,900	877,180.00	0.12
221	601995	中金公司	19,700	876,453.00	0.12
222	300033	同花顺	9,100	874,965.00	0.12
223	300390	天华超净	10,000	874,000.00	0.12
224	688180	君实生物	11,600	873,944.00	0.12
225	688126	沪硅产业	38,000	873,240.00	0.12
226	300223	北京君正	8,100	860,625.00	0.12
227	002202	金风科技	58,000	858,400.00	0.12
228	002841	视源股份	11,300	851,116.00	0.12
229	600039	四川路桥	80,400	846,612.00	0.12
230	601607	上海医药	46,700	844,336.00	0.12
231	600115	中国东航	153,742	844,043.58	0.12
232	300919	中伟股份	6,800	842,520.00	0.12
233	300601	康泰生物	18,480	834,926.40	0.12
234	300450	先导智能	13,200	833,976.00	0.12

235	002120	韵达股份	48,840	833,210.40	0.12
236	002236	大华股份	50,400	827,568.00	0.11
237	603737	三棵树	6,360	823,174.80	0.11
238	600141	兴发集团	18,700	822,613.00	0.11
239	603345	安井食品	4,900	822,563.00	0.11
240	601799	星宇股份	4,800	820,800.00	0.11
241	300595	欧普康视	14,340	820,104.60	0.11
242	002013	中航机电	65,700	811,395.00	0.11
243	002916	深南电路	8,640	809,654.40	0.11
244	600584	长电科技	29,900	807,300.00	0.11
245	002601	龙佰集团	40,100	804,005.00	0.11
246	601377	兴业证券	112,700	794,535.00	0.11
247	002555	三七互娱	37,300	791,879.00	0.11
248	603816	顾家家居	13,910	787,723.30	0.11
249	600563	法拉电子	3,800	779,608.00	0.11
250	002080	中材科技	28,200	775,500.00	0.11
251	600875	东方电气	46,800	769,860.00	0.11
252	605358	立昂微	11,400	768,132.00	0.11
253	300073	当升科技	8,500	767,890.00	0.11
254	688363	华熙生物	5,400	767,772.00	0.11
255	600779	水井坊	8,200	758,828.00	0.10
256	600332	白云山	23,700	748,683.00	0.10
257	600918	中泰证券	97,800	748,170.00	0.10
258	603613	国联股份	8,410	745,126.00	0.10
259	600803	新奥股份	40,000	743,600.00	0.10
260	601878	浙商证券	65,300	743,114.00	0.10
261	000999	华润三九	16,500	742,500.00	0.10
262	600219	南山铝业	201,200	742,428.00	0.10
263	688169	石头科技	1,200	740,040.00	0.10
264	600885	宏发股份	17,640	738,234.00	0.10
265	000157	中联重科	119,500	736,120.00	0.10
266	603198	迎驾贡酒	11,300	736,082.00	0.10
267	600674	川投能源	61,700	735,464.00	0.10
268	601699	潞安环能	50,300	735,386.00	0.10
269	002340	格林美	80,500	732,550.00	0.10
270	603568	伟明环保	21,900	730,803.00	0.10
271	603456	九洲药业	14,100	728,970.00	0.10
272	300454	深信服	7,000	726,460.00	0.10
273	300347	泰格医药	6,300	721,035.00	0.10
274	688122	西部超导	7,800	719,160.00	0.10
275	002176	江特电机	28,700	718,648.00	0.10
276	002414	高德红外	55,261	711,209.07	0.10
277	000425	徐工机械	131,800	710,402.00	0.10

278	688099	晶晨股份	7,000	707,000.00	0.10
279	002738	中矿资源	7,620	705,688.20	0.10
280	002064	华峰化学	83,500	704,740.00	0.10
281	002791	坚朗五金	5,400	700,488.00	0.10
282	601881	中国银河	72,400	700,108.00	0.10
283	002007	华兰生物	30,690	699,732.00	0.10
284	601216	君正集团	142,100	693,448.00	0.10
285	600486	扬农化工	5,200	693,056.00	0.10
286	300529	健帆生物	13,530	688,541.70	0.10
287	600298	安琪酵母	14,100	687,375.00	0.10
288	000519	中兵红箭	23,500	685,025.00	0.09
289	002603	以岭药业	28,140	683,802.00	0.09
290	300144	宋城演艺	44,060	676,321.00	0.09
291	002192	融捷股份	4,400	676,280.00	0.09
292	002252	上海莱士	113,400	672,462.00	0.09
293	600392	盛和资源	29,500	666,700.00	0.09
294	600183	生益科技	39,000	662,610.00	0.09
295	002384	东山精密	28,800	660,384.00	0.09
296	300037	新宙邦	12,520	658,051.20	0.09
297	600499	科达制造	31,700	654,288.00	0.09
298	002353	杰瑞股份	16,200	652,860.00	0.09
299	000683	远兴能源	61,800	649,518.00	0.09
300	000703	恒逸石化	61,670	648,151.70	0.09
301	000977	浪潮信息	24,432	646,959.36	0.09
302	601233	桐昆股份	40,600	644,728.00	0.09
303	002372	伟星新材	26,800	644,272.00	0.09
304	603882	金域医学	7,800	643,890.00	0.09
305	603939	益丰药房	12,136	641,144.88	0.09
306	603077	和邦生物	148,700	633,462.00	0.09
307	002497	雅化集团	19,400	633,410.00	0.09
308	002407	多氟多	12,900	630,939.00	0.09
309	688187	时代电气	9,700	630,403.00	0.09
310	600153	建发股份	48,200	629,974.00	0.09
311	601966	玲珑轮胎	24,769	628,389.53	0.09
312	600348	华阳股份	40,500	626,130.00	0.09
313	002625	光启技术	36,200	625,174.00	0.09
314	601696	中银证券	46,800	622,440.00	0.09
315	600362	江西铜业	34,900	622,267.00	0.09
316	000738	航发控制	22,100	621,010.00	0.09
317	002850	科达利	3,900	620,100.00	0.09
318	600655	豫园股份	65,600	619,264.00	0.09
319	300146	汤臣倍健	28,600	619,190.00	0.09
320	601108	财通证券	78,520	617,952.40	0.09

321	002268	卫 士 通	14,300	613,613.00	0.08
322	300373	扬杰科技	8,600	612,750.00	0.08
323	603127	昭衍新药	5,360	609,968.00	0.08
324	600985	淮北矿业	41,800	608,608.00	0.08
325	601319	中国人保	119,600	605,176.00	0.08
326	002602	世纪华通	125,420	604,524.40	0.08
327	600026	中远海能	58,400	603,272.00	0.08
328	002405	四维图新	40,000	602,800.00	0.08
329	603517	绝味食品	10,400	601,328.00	0.08
330	600160	巨化股份	45,500	598,325.00	0.08
331	603589	口子窖	10,200	597,822.00	0.08
332	002600	领益智造	118,900	596,878.00	0.08
333	000932	华菱钢铁	116,300	591,967.00	0.08
334	603707	健友股份	20,921	589,972.20	0.08
335	000066	中国长城	54,300	587,526.00	0.08
336	000009	中国宝安	43,500	586,815.00	0.08
337	601555	东吴证券	84,243	583,803.99	0.08
338	601058	赛轮轮胎	51,600	581,532.00	0.08
339	600487	亨通光电	39,800	578,692.00	0.08
340	000630	铜陵有色	177,100	577,346.00	0.08
341	000807	云铝股份	58,400	576,992.00	0.08
342	002508	老板电器	16,000	576,480.00	0.08
343	601636	旗滨集团	45,200	576,300.00	0.08
344	600521	华海药业	25,090	569,543.00	0.08
345	300003	乐普医疗	30,400	564,528.00	0.08
346	600109	国金证券	62,600	563,400.00	0.08
347	300568	星源材质	19,379	562,766.16	0.08
348	600161	天坛生物	23,143	561,912.04	0.08
349	002078	太阳纸业	45,200	556,412.00	0.08
350	000830	鲁西化工	32,000	553,280.00	0.08
351	000783	长江证券	93,100	552,083.00	0.08
352	000155	川能动力	24,900	551,535.00	0.08
353	000629	攀钢钒钛	144,900	550,620.00	0.08
354	601077	渝农商行	148,800	550,560.00	0.08
355	688009	中国通号	120,900	547,677.00	0.08
356	600848	上海临港	40,340	547,010.40	0.08
357	002385	大北农	69,700	544,357.00	0.08
358	600027	华电国际	137,200	539,196.00	0.07
359	601577	长沙银行	67,800	537,654.00	0.07
360	002568	百润股份	17,768	533,750.72	0.07
361	601666	平煤股份	39,000	530,010.00	0.07
362	002294	信立泰	18,800	528,280.00	0.07
363	300724	捷佳伟创	5,900	527,165.00	0.07

364	603267	鸿远电子	3,900	523,887.00	0.07
365	688202	美迪西	1,540	522,999.40	0.07
366	000825	太钢不锈	95,900	522,655.00	0.07
367	600705	中航产融	150,200	519,692.00	0.07
368	688188	柏楚电子	2,360	519,294.40	0.07
369	002430	杭氧股份	16,600	518,916.00	0.07
370	000831	五矿稀土	16,600	518,750.00	0.07
371	002507	涪陵榨菜	15,000	517,800.00	0.07
372	601990	南京证券	62,000	517,080.00	0.07
373	600549	厦门钨业	23,900	516,718.00	0.07
374	600177	雅戈尔	77,900	516,477.00	0.07
375	600415	小商品城	92,500	515,225.00	0.07
376	000027	深圳能源	80,000	512,800.00	0.07
377	002032	苏泊尔	9,100	512,694.00	0.07
378	300699	光威复材	8,700	512,169.00	0.07
379	002185	华天科技	53,900	505,582.00	0.07
380	300676	华大基因	7,000	501,900.00	0.07
381	603233	大参林	16,012	501,175.60	0.07
382	300832	新产业	11,100	500,721.00	0.07
383	601866	中远海发	166,800	500,400.00	0.07
384	002531	天顺风能	30,300	499,647.00	0.07
385	300850	新强联	5,590	497,677.70	0.07
386	601456	国联证券	40,300	494,481.00	0.07
387	000933	神火股份	37,800	494,424.00	0.07
388	000987	越秀金控	70,315	494,314.45	0.07
389	002673	西部证券	75,200	491,808.00	0.07
390	000800	一汽解放	52,200	487,548.00	0.07
391	600516	方大炭素	64,127	487,365.20	0.07
392	002326	永太科技	14,800	487,364.00	0.07
393	002557	洽洽食品	8,531	485,669.83	0.07
394	601198	东兴证券	54,390	484,071.00	0.07
395	601168	西部矿业	40,100	474,383.00	0.07
396	000401	冀东水泥	44,800	471,296.00	0.07
397	000960	锡业股份	28,100	471,237.00	0.07
398	002463	沪电股份	31,920	471,139.20	0.07
399	688006	杭可科技	6,700	469,402.00	0.06
400	002624	完美世界	32,650	469,180.50	0.06
401	600258	首旅酒店	18,900	468,720.00	0.06
402	300251	光线传媒	49,400	467,818.00	0.06
403	600872	中炬高新	13,500	467,235.00	0.06
404	002153	石基信息	29,384	466,324.08	0.06
405	603444	吉比特	1,200	465,600.00	0.06
406	002128	电投能源	32,300	462,536.00	0.06

407	002028	思源电气	12,900	460,014.00	0.06
408	300357	我武生物	8,800	457,864.00	0.06
409	000728	国元证券	73,440	456,796.80	0.06
410	000975	银泰黄金	46,680	454,663.20	0.06
411	002797	第一创业	70,700	453,187.00	0.06
412	600170	上海建工	149,400	452,682.00	0.06
413	600038	中直股份	10,000	452,000.00	0.06
414	601880	辽港股份	264,200	449,140.00	0.06
415	600704	物产中大	87,500	448,875.00	0.06
416	002422	科伦药业	24,000	448,800.00	0.06
417	600801	华新水泥	22,900	446,779.00	0.06
418	600988	赤峰黄金	28,000	446,600.00	0.06
419	002409	雅克科技	8,000	444,080.00	0.06
420	600369	西南证券	111,800	443,846.00	0.06
421	000937	冀中能源	59,400	443,124.00	0.06
422	600338	西藏珠峰	15,400	441,980.00	0.06
423	002939	长城证券	43,500	441,960.00	0.06
424	600598	北大荒	29,900	441,324.00	0.06
425	000893	亚钾国际	12,800	440,448.00	0.06
426	600079	人福医药	27,500	440,000.00	0.06
427	002223	鱼跃医疗	16,900	433,654.00	0.06
428	002266	浙富控股	90,500	433,495.00	0.06
429	603338	浙江鼎力	8,548	433,383.60	0.06
430	002532	天山铝业	65,300	426,409.00	0.06
431	300558	贝达药业	7,000	425,600.00	0.06
432	000591	太阳能	50,700	423,345.00	0.06
433	300726	宏达电子	6,900	422,073.00	0.06
434	300308	中际旭创	13,500	419,175.00	0.06
435	603218	日月股份	16,300	414,020.00	0.06
436	600143	金发科技	43,400	413,168.00	0.06
437	000050	深天马 A	41,400	412,758.00	0.06
438	603712	七一二	13,000	409,500.00	0.06
439	000739	普洛药业	19,800	408,672.00	0.06
440	000423	东阿阿胶	11,020	407,189.00	0.06
441	002030	达安基因	23,624	406,096.56	0.06
442	601016	节能风电	84,400	405,120.00	0.06
443	000709	河钢股份	178,900	404,314.00	0.06
444	002299	圣农发展	21,000	402,780.00	0.06
445	600380	健康元	32,100	396,435.00	0.05
446	603605	珀莱雅	2,380	393,128.40	0.05
447	600688	上海石化	123,300	392,094.00	0.05
448	000988	华工科技	16,900	391,573.00	0.05
449	002541	鸿路钢构	11,670	389,778.00	0.05

450	601992	金隅集团	140,300	388,631.00	0.05
451	002408	齐翔腾达	47,900	388,469.00	0.05
452	002152	广电运通	41,800	387,486.00	0.05
453	000513	丽珠集团	10,600	383,826.00	0.05
454	600808	马钢股份	100,500	380,895.00	0.05
455	603858	步长制药	19,246	379,338.66	0.05
456	600998	九州通	31,500	375,165.00	0.05
457	600056	中国医药	25,200	373,464.00	0.05
458	603866	桃李面包	22,452	371,580.60	0.05
459	002138	顺络电子	13,600	370,600.00	0.05
460	000998	隆平高科	22,200	369,852.00	0.05
461	002456	欧菲光	54,900	368,379.00	0.05
462	002044	美年健康	66,000	367,620.00	0.05
463	002506	协鑫集成	98,600	366,792.00	0.05
464	600699	均胜电子	23,060	362,272.60	0.05
465	600711	盛屯矿业	46,200	358,512.00	0.05
466	688185	康希诺	1,800	358,344.00	0.05
467	600295	鄂尔多斯	19,840	358,112.00	0.05
468	002145	中核钛白	50,125	357,391.25	0.05
469	002465	海格通信	38,900	353,601.00	0.05
470	002926	华西证券	44,200	346,528.00	0.05
471	002500	山西证券	60,310	346,179.40	0.05
472	002156	通富微电	22,400	344,960.00	0.05
473	002065	东华软件	53,900	340,648.00	0.05
474	002092	中泰化学	43,400	336,784.00	0.05
475	688298	东方生物	2,940	335,601.00	0.05
476	000860	顺鑫农业	12,500	335,250.00	0.05
477	000750	国海证券	91,700	332,871.00	0.05
478	002010	传化智联	51,700	332,431.00	0.05
479	600895	张江高科	26,100	324,945.00	0.04
480	300418	昆仑万维	20,200	323,200.00	0.04
481	002157	正邦科技	52,900	320,574.00	0.04
482	300070	碧水源	61,000	317,810.00	0.04
483	300253	卫宁健康	36,080	316,782.40	0.04
484	300383	光环新网	30,200	314,684.00	0.04
485	002558	巨人网络	34,000	311,100.00	0.04
486	002958	青农商行	93,600	310,752.00	0.04
487	600583	海油工程	74,600	309,590.00	0.04
488	688002	睿创微纳	7,400	293,928.00	0.04
489	600498	烽火通信	20,000	289,600.00	0.04
490	601598	中国外运	73,800	286,344.00	0.04
491	002925	盈趣科技	13,250	285,140.00	0.04
492	300677	英科医疗	11,200	284,032.00	0.04

493	000686	东北证券	39,400	275,406.00	0.04
494	002563	森马服饰	45,300	268,176.00	0.04
495	000656	金科股份	89,900	257,114.00	0.04

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600938	中国海油	84,005	1,332,320.89	0.18
2	688120	华海清科	2,471	536,503.52	0.07
3	688322	奥比中光	8,529	264,313.71	0.04
4	688400	凌云光	11,664	255,791.52	0.04
5	301175	中科环保	63,694	243,311.08	0.03
6	301239	普瑞眼科	5,747	193,386.55	0.03
7	688237	超卓航科	2,891	119,311.57	0.02
8	688267	中触媒	3,390	108,141.00	0.01
9	688283	坤恒顺维	1,595	72,428.95	0.01
10	301238	瑞泰新材	1,903	61,029.21	0.01
11	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.01
12	301217	铜冠铜箔	2,273	33,708.59	0.00
13	301215	中汽股份	4,743	30,307.77	0.00
14	301200	大族数控	509	26,427.28	0.00
15	301302	华如科技	466	26,291.72	0.00
16	301266	宇邦新材	517	24,335.19	0.00
17	301216	万凯新材	789	23,543.76	0.00
18	301268	铭利达	641	22,351.67	0.00
19	301263	泰恩康	682	21,401.16	0.00
20	301122	采纳股份	301	21,181.37	0.00
21	301219	腾远钴业	230	20,198.60	0.00
22	301112	信邦智能	399	17,970.96	0.00
23	301153	中科江南	398	17,504.04	0.00
24	301123	奕东电子	656	16,655.84	0.00
25	301160	翔楼新材	392	14,762.72	0.00
26	301117	佳缘科技	262	14,263.28	0.00
27	301298	东利机械	634	13,206.22	0.00
28	301148	嘉戎技术	516	12,332.40	0.00
29	301258	富士莱	295	12,295.60	0.00
30	301116	益客食品	577	11,805.42	0.00
31	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
32	301220	亚香股份	285	11,157.75	0.00
33	301196	唯科科技	271	10,167.92	0.00

34	301125	腾亚精工	327	8,966.34	0.00
35	301163	宏德股份	277	8,955.41	0.00
36	301130	西点药业	237	8,934.90	0.00
37	301158	德石股份	379	7,724.02	0.00
38	301279	金道科技	296	6,751.76	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	600905	三峡能源	3,496,660.00	0.45
2	688599	天合光能	2,694,075.80	0.35
3	000651	格力电器	1,851,494.64	0.24
4	601006	大秦铁路	1,721,114.00	0.22
5	601868	中国能建	1,474,476.00	0.19
6	600938	中国海油	1,296,054.00	0.17
7	601238	广汽集团	1,195,155.00	0.15
8	688396	华润微	1,099,395.71	0.14
9	688005	容百科技	1,094,939.87	0.14
10	600884	杉杉股份	1,078,798.00	0.14
11	300919	中伟股份	945,652.00	0.12
12	000858	五粮液	944,120.00	0.12
13	300957	贝泰妮	906,197.00	0.12
14	605117	德业股份	890,272.80	0.11
15	300769	德方纳米	794,536.60	0.10
16	688363	华熙生物	772,943.22	0.10
17	300750	宁德时代	772,394.27	0.10
18	688099	晶晨股份	715,643.56	0.09
19	605358	立昂微	679,837.00	0.09
20	002594	比亚迪	664,210.00	0.09

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	000858	五粮液	1,170,154.00	0.15

2	002050	三花智控	1,166,384.90	0.15
3	300750	宁德时代	1,142,647.00	0.15
4	600519	贵州茅台	1,068,285.00	0.14
5	688348	昱能科技	1,031,420.79	0.13
6	688223	晶科能源	790,792.80	0.10
7	603019	中科曙光	773,975.00	0.10
8	002594	比亚迪	761,666.00	0.10
9	600061	国投资本	697,975.72	0.09
10	601933	永辉超市	686,891.00	0.09
11	301238	瑞泰新材	601,346.60	0.08
12	600352	浙江龙盛	583,204.00	0.07
13	600606	绿地控股	567,146.55	0.07
14	600938	中国海油	529,200.00	0.07
15	688349	三一重能	527,600.00	0.07
16	300763	锦浪科技	517,814.50	0.07
17	688052	纳芯微	515,950.95	0.07
18	688047	龙芯中科	514,661.77	0.07
19	601162	天风证券	472,088.00	0.06
20	600900	长江电力	469,394.00	0.06

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	73,798,082.75
卖出股票收入（成交）总额	64,592,040.92

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	2,744,447.92	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）	135,711.65	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,880,159.57	0.40

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	019664	21 国债 16	27,000	2,744,447.92	0.38
2	113060	浙 22 转债	1,170	117,008.21	0.02
3	127064	杭氧转债	187	18,703.44	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 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 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

报告期内基金投资的前十名证券除兴业银行（证券代码 601166）、招商银行（证券代码 600036）、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、兴业银行（证券代码 601166）

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

2、招商银行（证券代码 600036）

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

3、中国平安（证券代码 601318）

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。

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	17,658.07
2	应收清算款	42,721.69

3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	60,379.76

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	600938	中国海油	1,332,303.44	0.18	新股流通受限
2	688120	华海清科	536,503.52	0.07	新股流通受限
3	688322	奥比中光	264,313.71	0.04	新股流通受限
4	688400	凌云光	255,791.52	0.04	新股流通受限
5	301175	中科环保	243,311.08	0.03	新股流通受限

§ 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
528	984,763.35	506,941,763.00	97.50%	13,013,288.00	2.50%	496,000,000.00	95.39%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	招商证券股份有限公司	6,947,663.00	1.34%
2	方正证券股份有限公司	2,422,700.00	0.47%

3	张永峰	1,000,000.00	0.19%
4	广发证券股份有限公司	954,300.00	0.18%
5	梁维灿	600,000.00	0.12%
6	洪培新	500,000.00	0.10%
7	海通证券股份有限公司	474,000.00	0.09%
8	王喆	350,100.00	0.07%
9	李和明	300,000.00	0.06%
10	王勇	220,000.00	0.04%
-	招商 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 联接	496,000,000.00	95.39%

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	517,955,051.00
本报告期基金总申购份额	14,000,000.00
减：报告期基金总赎回份额	12,000,000.00
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	519,955,051.00

§ 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

本基金本报告期内基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期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。

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	80,646,031.89	64.37%	18,654.20	76.09%	-
方正证券	7	44,647,370.29	35.63%	5,862.49	23.91%	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	3	-	-	-	-	-
长江证券	4	-	-	-	-	-
诚通证券	1	-	-	-	-	-
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	4	-	-	-	-	-
宏信证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	3	-	-	-	-	-
华创证券	4	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	5	-	-	-	-	-
华西证券	3	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	3	-	-	-	-	-
瑞信方正	2	-	-	-	-	-
山西证券	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	-	-	-	-	-
万和证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	5	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
英大证券	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	3	-	-	-	-	-
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	2,775,494.70	96.06%	-	-	-	-
方正证券	113,977.26	3.94%	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
诚通证券	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-

华金证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
瑞信方正	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证 券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
万和证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-

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旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	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	2022-01-01
2	招商基金管理有限公司关于旗下基金投资关联	上海证券报、基金管理人网站及	2022-01-15

	方承销证券的公告	中国证监会基金电子披露网站	
3	招商基金管理有限公司旗下基金 2021 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	2022-01-21
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 2021 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	2022-01-21
5	招商基金管理有限公司关于公司自有资金投资旗下公募基金的公告	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	2022-01-27
6	招商 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金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	2022-01-28
7	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（二零二二年第一号）	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	2022-01-28
8	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	2022-01-28
9	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	2022-03-22
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 2021 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	2022-03-30
11	招商基金管理有限公司旗下基金 2021 年年度报告提示性公告	上海证券报及基金管理人网站	2022-03-30
12	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	2022-04-15
13	招商基金管理有限公司旗下基金 2022 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	2022-04-21
14	招商 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金 2022 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	2022-04-21
15	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	2022-05-13
16	招商基金管理有限公司关于养老金客户通过直销柜台申购旗下基金开展费率优惠活动的公告	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	2022-06-09
17	招商基金管理有限公司关于旗下管理的上海证券交易所上市 ETF 实施申赎业务多码合一的公告	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	2022-06-17
18	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	2022-06-17

§ 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	20220101-20220630	496,000,000.00	-	-	496,000,000.00	95.39%
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: 深圳市福田区深南大道 7088 号

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

2022 年 8 月 30 日