

招商沪深 300ESG 基准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：中国银河证券股份有限公司

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。

基金托管人中国银河证券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.....	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.....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	11
§5 托管人报告.....	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	11
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表.....	12
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	34
7.1 期末基金资产组合情况	34
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	34
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.....	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	43
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.....	44
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.....	44
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.....	44
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	44
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	44

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	44
7.12 投资组合报告附注.....	44
§8 基金份额持有人信息.....	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	46
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	46
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	46
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.....	46
§9 开放式基金份额变动.....	46
§10 重大事件揭示.....	47
10.1 基金份额持有人大会决议.....	47
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.....	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	47
10.4 基金投资策略的改变.....	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	47
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.....	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	47
10.8 其他重大事件.....	48
§11 备查文件目录.....	49
11.1 备查文件目录.....	49
11.2 存放地点.....	50
11.3 查阅方式.....	50

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	招商沪深 300ESG 基准交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	招商沪深 300ESG 基准 ETF
场内简称	沪深 ESG
基金主代码	561900
交易代码	561900
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 7 月 6 日
基金管理人	招商基金管理有限公司
基金托管人	中国银河证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	83,334,374.00 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	2021 年 7 月 15 日

注：本基金扩位证券简称为“沪深 300ESGETF”。

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。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。
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。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。</p> <p>本基金其他主要投资策略包括：债券投资策略、可转换债券和可交换债券投资策略、资产支持证券投资策略、衍生品投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略、存托凭证投资策略。</p>
业绩比较基准	沪深 300 ESG 基准指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金。

	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标的指数的表现，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	中国银河证券股份有限公司
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	95551；400-888-8888
传真	0755—83196475	010-80928078
注册地址	深圳市福田区深南大道 7088 号	北京市丰台区西营街 8 号院 1 号楼 7 至 18 层 101
办公地址	深圳市福田区深南大道 7088 号	北京市丰台区西营街 8 号院 1 号楼青海金融大厦
邮政编码	518040	100073
法定代表人	王小青	陈亮

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
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	-4,196,180.04
本期利润	-7,399,975.71
加权平均基金份额本期利润	-0.0853
本期加权平均净值利润率	-9.98%
本期基金份额净值增长率	-8.26%
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	-9,527,120.71
期末可供分配基金份额利润	-0.1143
期末基金资产净值	73,807,253.57
期末基金份额净值	0.8857
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	-11.43%

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。

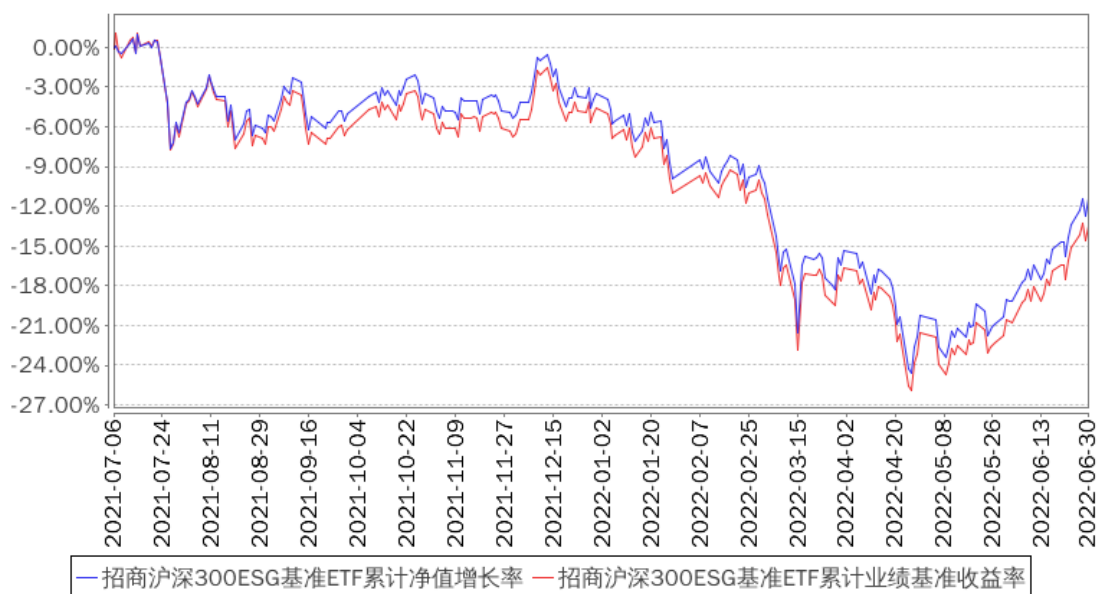
3.2 基金净值表现

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	9.45%	1.04%	8.91%	1.06%	0.54%	-0.02%
过去三个月	5.98%	1.40%	5.15%	1.41%	0.83%	-0.01%
过去六个月	-8.26%	1.43%	-9.30%	1.45%	1.04%	-0.02%
自基金合同 生效起至今	-11.43%	1.22%	-13.46%	1.25%	2.03%	-0.03%

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

招商沪深300ESG基准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



注：本基金合同于 2021 年 7 月 6 日生效，截至本报告期末基金成立未满一年；自基金成立日起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

招商基金管理有限公司于 2002 年 12 月 27 日经中国证监会【2002】100 号文批准设立。目前，公司注册资本为人民币 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		
刘重杰	本基金基金经理	2021 年 7 月 6 日	-	11	男，本科。曾任职于成都商报社、西南财经大学金融数据中心、南京大学金陵学院；2010 年 7 月加入华西期货有限责

					任公司，历任金融工程部高级研究员、部门负责人；2014 年 3 月加入西南证券股份有限公司，历任衍生品业务岗、平仓处置岗、策略研究岗、投资者教育及培训岗；2017 年 9 月加入招商基金管理有限公司，曾任深证电子信息传媒产业(TMT)50 交易型开放式指数证券投资基金、招商深证电子信息传媒产业(TMT)50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、招商中证生物科技主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，现任招商深证 100 交易型开放式指数证券投资基金、招商中证红利交易型开放式指数证券投资基金、招商深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、招商中证浙江 100 交易型开放式指数证券投资基金、招商国证食品饮料行业交易型开放式指数证券投资基金、招商中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金、招商中证云计算与大数据主题交易型开放式指数证券投资基金、招商沪深 300ESG 基准交易型开放式指数证券投资基金、招商中证新能源汽车指数型证券投资基金、招商中证物联网主题交易型开放式指数证券投资基金、招商中证香港科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII)、招商中证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金、招商中证银行 AH 价格优选交易型开放式指数证券投资基金、招商中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

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

2、证券从业年限计算标准遵从中国证监会《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

报告期内 A 股波动较大，从行业来看业绩表现分化相对较大，煤炭涨幅 31.38%，电子、计算机、传媒、国防军工等行业板块跌幅较大，跌幅超过 20%。本基金的基准指数沪深 300 ESG 基准指数报告期内下跌 9.30%。关于本基金的运作，仓位维持在 98.8% 左右的水平，基本完成了对基准的跟踪。

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-8.26%，同期业绩基准增长率为-9.30%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

整体来看，上半年国内经济先抑后扬。5 月份以前主要受疫情影响，经济数据明显走弱。随着疫情影响消除，经济持续恢复中。流动性在上半年有所波动，但整体维持在合理充裕的区间内。上半年 A 股从恐慌避险到逐级反弹。2022 年 1 到 4 月，实物资产（上游）通胀与经济需求的通缩，在股票定价上则体现为投资者盈利预期的下降与贴现率预期的抬升，既拉低盈利又拉低估值。4 月底以来，“稳增长”政策落地叠加疫情影响逐步消退，基本面预期最悲观时刻或已然过去，A 股市场拾级修复。下半年 A 股市场运行区间有望上移，回调或是配置良机。“稳增长”政策落地叠加疫情影响逐步消退，基本面预期最悲观时刻或已然过去。展望下半年，经济预期上修，风险偏好与风险评价积极变化，对 A 股判断转向乐观，上修上证指数运行区间，回调或是配置良机。下半年 A 股盈利环比逐步改善，盈利预期的上修将是市场的积极支撑；“稳增长”政策持续加码与疫情防控发生积极变化，风险偏好与风险评价可能也有驱动；无风险利率有一定下行空间，但幅度相对有限，非市场下阶段的核心驱动。

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，中国银河证券股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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，本托管人按照《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关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真实、准确和完整发表意见

本托管人依法复核招商基金管理有限公司编制和披露的本基金本期报告中财务指标、净值表现、利润分配、财务会计报告、投资组合报告等内容，以上内容真实、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：招商沪深 300ESG 基准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	1,084,906.29	991,697.74
结算备付金		29,245.82	14,141.21
存出保证金		28,367.11	278,738.60
交易性金融资产	6.4.7.2	72,805,451.51	82,290,880.44
其中：股票投资		72,805,451.51	82,064,881.43
基金投资		-	-
债券投资		-	225,999.01
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		-	71,245.20
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	287.84
资产总计		73,947,970.73	83,646,991.03
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		-	190,568.44
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		28,935.87	38,439.39
应付托管费		5,787.18	7,687.86
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	105,994.11	60,007.19
负债合计		140,717.16	296,702.88
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	83,334,374.28	86,334,374.29
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-9,527,120.71	-2,984,086.14
净资产合计		73,807,253.57	83,350,288.15
负债和净资产总计		73,947,970.73	83,646,991.03

注：1、报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.8857 元，基金份额总额 83,334,374.00 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：招商沪深 300ESG 基准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
一、营业总收入		-7,088,854.68
1.利息收入		5,627.74
其中：存款利息收入	6.4.7.9	5,627.74
债券利息收入		-
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）		-3,878,604.93
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-4,644,880.86
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	59,646.99
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-
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	706,628.94
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	-3,203,795.67
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	-12,081.82
减：二、营业总支出		311,121.03
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	184,550.76
2.托管费	6.4.10.2.2	36,910.12
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		-
8.其他费用	6.4.7.19	89,660.15
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-7,399,975.71
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-7,399,975.71
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-7,399,975.71

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：招商沪深 300ESG 基准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）	86,334,374.29	-	-2,984,086.14	83,350,288.15
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）	86,334,374.29	-	-2,984,086.14	83,350,288.15
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-3,000,000.01	-	-6,543,034.57	-9,543,034.58
（一）、综合收益总额	-	-	-7,399,975.71	-7,399,975.71
（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）	-3,000,000.01	-	856,941.14	-2,143,058.87
其中：1.基金申购款	9,000,000.03	-	-1,456,200.61	7,543,799.42
2.基金赎回款	-12,000,000.04	-	2,313,141.75	-9,686,858.29
（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）	83,334,374.28	-	-9,527,120.71	73,807,253.57

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

招商沪深 300ESG 基准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》、《招商沪深 300ESG 基准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[2021]1481 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。本基金根据认购方式的不同,将基金份额分为网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购。本基金首次设立募集基金份额为 242,334,374.00 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(21)第 00321 号验资报告。《招商沪深 300ESG 基准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 2021 年 7 月 6 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河证券股份有限公司(以下简称“银河证券”)。

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《招商沪深 300ESG 基准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(含存托凭证,下同)和备选成份券(含存托凭证,下同)。

为更好地实现基金的投资目标,本基金可少量投资于非成份券(包括主板、中小板、创业板及其他中国证监会允许基金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、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、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(含可分离交易可转债)、可交换债券)、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、股票期权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)。

本基金可根据相关法律法规和基金合同的约定,参与融资业务和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%。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。股指期货、国债期货、股票期权的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

如法律法规或中国证监会以后允许基金投资其他品种或变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围或调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为:沪深 300ESG 基准指数收益率。

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 991,697.74 元、人民币 14,141.21 元、人民币 278,738.60 元和人民币 287.84 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 991,835.65 元、人民币 14,148.25 元、人民币 278,876.54 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 82,290,880.44 元，属于交易性金融资产的应收利息金额为人民币 4.95 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 82,290,885.39 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

本基金本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 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。

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	1,084,906.29
等于：本金	1,084,731.28
加：应计利息	175.01
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	1,084,906.29

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	78,467,633.63	-	72,805,451.51	-5,662,182.12
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-

基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	78,467,633.63	-	72,805,451.51	-5,662,182.12

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	7,418.89
其中：交易所市场	7,418.89
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	98,575.22
合计	105,994.11

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	86,334,374.00	86,334,374.29
本期申购	9,000,000.00	9,000,000.03
本期赎回（以“-”号填列）	-12,000,000.00	-12,000,000.04
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	83,334,374.00	83,334,374.28

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	-1,630,532.08	-1,353,554.06	-2,984,086.14
本期利润	-4,196,180.04	-3,203,795.67	-7,399,975.71
本期基金份额交易产生的变动数	118,829.40	738,111.74	856,941.14
其中：基金申购款	-261,162.42	-1,195,038.19	-1,456,200.61
基金赎回款	379,991.82	1,933,149.93	2,313,141.75
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-5,707,882.72	-3,819,237.99	-9,527,120.71

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	4,522.67
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	414.40
其他	690.67
合计	5,627.74

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	-3,710,518.90
股票投资收益——赎回差价收入	-934,361.96
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	-4,644,880.86

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	19,028,192.06
减：卖出股票成本总额	22,708,695.29
减：交易费用	30,015.67
买卖股票差价收入	-3,710,518.90

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	9,686,858.29
减：现金支付赎回款总额	3,682,756.29
减：赎回股票成本总额	6,938,463.96
减：交易费用	-
赎回差价收入	-934,361.96

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	28.61
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	59,618.38
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	59,646.99

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	440,151.50
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	380,498.46
减：应计利息总额	34.11
减：交易费用	0.55
买卖债券差价收入	59,618.38

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	706,628.94
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	706,628.94

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	-3,203,795.67
——股票投资	-3,203,795.67
——债券投资	-
——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	-3,203,795.67

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	-12,081.82
合计	-12,081.82

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	19,835.79
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
IOPV 服务费	9,916.99
其他	400.00
合计	89,660.15

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
中国银河证券股份有限公司	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

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	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
招商证券	30,379,271.71	80.77%

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	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
招商证券	440,150.05	100.00%

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	7,027.25	88.10%	6,771.17	91.27%

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
当期发生的基金应支付的管理费	184,550.76
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：

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

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
当期发生的基金应支付的托管费	36,910.12

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

本基金本报告期内无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期内无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

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

本基金本报告期内无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 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
招商证券股份有限公司	7,229,487.00	8.68%	8,070,587.00	9.35%

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	
	期末余额	当期利息收入
银河证券-活期	1,084,906.29	4,522.67

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银河证券股份有限公司保管，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、银河证券	700030	中信配股	配股	4,905	70,779.15

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）67,430 股，市值为人民币 2,845,546.00 元，占本基金资产净值的比例为 3.86%。

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）8,300 股，市值为人民币 119,603.00 元，占本基金资产净值的比例为 0.16%。

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

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

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

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
AAA	-	225,999.01
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	225,999.01

注：上述评级均由经中国证监会核准从事证券市场资信评级业务的评级机构做出。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

流动性风险是指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，并按照合约规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	1,084,906.29	-	-	-	1,084,906.29
结算备付金	29,245.82	-	-	-	29,245.82
存出保证金	28,367.11	-	-	-	28,367.11
交易性金融资产	-	-	-	72,805,451.51	72,805,451.51
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	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,142,519.22	-	-	72,805,451.51	73,947,970.73
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	28,935.87	28,935.87
应付托管费	-	-	-	5,787.18	5,787.18
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	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	105,994.11	105,994.11
负债总计	-	-	-	140,717.16	140,717.16
利率敏感度缺口	1,142,519.22	-	-	72,664,734.35	73,807,253.57
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	991,697.74	-	-	-	991,697.74
结算备付金	14,141.21	-	-	-	14,141.21
存出保证金	278,738.60	-	-	-	278,738.60
交易性金融资产	-	-	225,999.01	82,064,881.43	82,290,880.44
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	287.84	287.84
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	71,245.20	71,245.20
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,284,577.55	-	225,999.01	82,136,414.47	83,646,991.03
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	38,439.39	38,439.39
应付托管费	-	-	-	7,687.86	7,687.86
应付证券清算款	-	-	-	190,568.44	190,568.44

卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	10,692.12	10,692.12
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	49,315.07	49,315.07
负债总计	-	-	-	296,702.88	296,702.88
利率敏感度缺口	1,284,577.55	-	225,999.01	81,839,711.59	83,350,288.15

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	-	-6,395.99
	2. 市场利率平行下降 50 个基点	-	6,616.50

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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的债券和股票，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	72,805,451.51	98.64	82,064,881.43	98.46
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	72,805,451.51	98.64	82,064,881.43	98.46

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%	3,640,272.58	4,103,244.07
	2. 权益性投资的市场价格下降 5%	-3,640,272.58	-4,103,244.07

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	72,805,451.51
第二层次	-
第三层次	-
合计	72,805,451.51

6.4.14.2.2 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	72,805,451.51	98.45
	其中：股票	72,805,451.51	98.45
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,114,152.11	1.51
8	其他资产	28,367.11	0.04
9	合计	73,947,970.73	100.00

注：此处的股票投资项含可退替代款估值增值。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
----	------	---------	--------------

A	农、林、牧、渔业	1,178,088.80	1.60
B	采矿业	2,252,670.00	3.05
C	制造业	44,553,286.92	60.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,828,363.00	2.48
E	建筑业	1,498,874.00	2.03
F	批发和零售业	73,632.00	0.10
G	交通运输、仓储和邮政业	1,961,183.00	2.66
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,597,263.88	3.52
J	金融业	12,636,003.98	17.12
K	房地产业	1,713,203.00	2.32
L	租赁和商务服务业	242,280.00	0.33
M	科学研究和技术服务业	1,496,882.00	2.03
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	41,688.00	0.06
Q	卫生和社会工作	572,224.00	0.78
R	文化、体育和娱乐业	106,752.00	0.14
S	综合	-	-
	合计	72,752,394.58	98.57

7.2.2 期末积极投资按行业分类境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	49,690.73	0.07
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	1,878.00	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、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	1,488.20	0.00
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	53,056.93	0.07

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	2,800	5,726,000.00	7.76
2	600036	招商银行	67,430	2,845,546.00	3.86
3	300750	宁德时代	4,000	2,136,000.00	2.89
4	000858	五粮液	9,700	1,958,721.00	2.65
5	601012	隆基绿能	27,960	1,862,974.80	2.52
6	002594	比亚迪	4,400	1,467,356.00	1.99
7	000333	美的集团	22,600	1,364,814.00	1.85
8	601166	兴业银行	57,400	1,142,260.00	1.55
9	600900	长江电力	44,900	1,038,088.00	1.41
10	603259	药明康德	9,500	987,905.00	1.34
11	601318	中国平安	20,800	971,152.00	1.32
12	600887	伊利股份	22,200	864,690.00	1.17
13	002415	海康威视	23,400	847,080.00	1.15
14	002475	立讯精密	24,000	810,960.00	1.10
15	601398	工商银行	166,100	792,297.00	1.07
16	300760	迈瑞医疗	2,400	751,680.00	1.02
17	601328	交通银行	143,300	713,634.00	0.97
18	600438	通威股份	11,500	688,390.00	0.93
19	002714	牧原股份	12,340	682,031.80	0.92
20	000725	京东方 A	170,300	670,982.00	0.91
21	000001	平安银行	43,800	656,124.00	0.89
22	000002	万科 A	32,000	656,000.00	0.89
23	601899	紫金矿业	67,200	626,976.00	0.85
24	603288	海天味业	6,770	611,737.20	0.83
25	600809	山西汾酒	1,880	610,624.00	0.83
26	002142	宁波银行	16,680	597,310.80	0.81

27	000651	格力电器	17,300	583,356.00	0.79
28	002129	TCL 中环	9,800	577,122.00	0.78
29	600030	中信证券	26,605	576,264.30	0.78
30	600048	保利发展	33,000	576,180.00	0.78
31	300124	汇川技术	8,600	566,482.00	0.77
32	002460	赣锋锂业	3,800	565,060.00	0.77
33	601668	中国建筑	102,100	543,172.00	0.74
34	000568	泸州老窖	2,200	542,388.00	0.73
35	601088	中国神华	16,100	536,130.00	0.73
36	600309	万华化学	5,500	533,445.00	0.72
37	603799	华友钴业	5,460	522,085.20	0.71
38	002352	顺丰控股	9,300	519,033.00	0.70
39	002304	洋河股份	2,797	512,270.55	0.69
40	300498	温氏股份	23,300	496,057.00	0.67
41	600690	海尔智家	17,800	488,788.00	0.66
42	300014	亿纬锂能	5,000	487,500.00	0.66
43	000792	盐湖股份	16,000	479,360.00	0.65
44	600436	片仔癀	1,300	463,749.00	0.63
45	300015	爱尔眼科	10,200	456,654.00	0.62
46	600406	国电南瑞	16,800	453,600.00	0.61
47	601919	中远海控	32,240	448,136.00	0.61
48	002812	恩捷股份	1,700	425,765.00	0.58
49	000063	中兴通讯	16,100	411,033.00	0.56
50	300122	智飞生物	3,700	410,737.00	0.56
51	600837	海通证券	41,500	407,115.00	0.55
52	603501	韦尔股份	2,200	380,666.00	0.52
53	688981	中芯国际	8,424	380,512.08	0.52
54	000625	长安汽车	21,580	373,765.60	0.51
55	300274	阳光电源	3,800	373,350.00	0.51
56	002230	科大讯飞	9,000	370,980.00	0.50
57	002371	北方华创	1,300	360,256.00	0.49
58	002241	歌尔股份	10,700	359,520.00	0.49
59	002271	东方雨虹	6,900	355,143.00	0.48
60	600104	上汽集团	19,600	349,076.00	0.47
61	300142	沃森生物	7,100	343,569.00	0.47
62	601988	中国银行	105,300	343,278.00	0.47
63	000100	TCL 科技	69,400	332,426.00	0.45
64	601288	农业银行	109,600	330,992.00	0.45
65	600585	海螺水泥	9,300	328,104.00	0.44
66	600276	恒瑞医药	8,700	322,683.00	0.44
67	601390	中国中铁	52,100	319,894.00	0.43
68	600050	中国联通	90,300	312,438.00	0.42
69	300347	泰格医药	2,700	309,015.00	0.42

70	600660	福耀玻璃	7,300	305,213.00	0.41
71	601688	华泰证券	21,400	303,880.00	0.41
72	300896	爱美客	500	300,005.00	0.41
73	601985	中国核电	43,500	298,410.00	0.40
74	300450	先导智能	4,700	296,946.00	0.40
75	002466	天齐锂业	2,300	287,040.00	0.39
76	600000	浦发银行	34,500	276,345.00	0.37
77	002179	中航光电	4,200	265,944.00	0.36
78	002410	广联达	4,800	261,312.00	0.35
79	601816	京沪高铁	51,100	256,522.00	0.35
80	600028	中国石化	62,500	255,000.00	0.35
81	601766	中国中车	48,900	254,280.00	0.34
82	600019	宝钢股份	41,300	248,626.00	0.34
83	002027	分众传媒	36,000	242,280.00	0.33
84	600196	复星医药	5,400	238,086.00	0.32
85	603659	璞泰来	2,800	236,320.00	0.32
86	000338	潍柴动力	18,800	234,436.00	0.32
87	002459	晶澳科技	2,940	231,966.00	0.31
88	600570	恒生电子	5,200	226,408.00	0.31
89	001979	招商蛇口	16,400	220,252.00	0.30
90	300782	卓胜微	1,600	216,000.00	0.29
91	600893	航发动力	4,700	213,897.00	0.29
92	000895	双汇发展	7,300	213,890.00	0.29
93	601939	建设银行	34,400	208,464.00	0.28
94	601857	中国石油	39,000	206,700.00	0.28
95	002311	海大集团	3,400	204,034.00	0.28
96	000538	云南白药	3,320	200,494.80	0.27
97	300759	康龙化成	2,100	199,962.00	0.27
98	601229	上海银行	30,100	197,155.00	0.27
99	600176	中国巨石	11,100	193,251.00	0.26
100	601818	光大银行	63,400	190,834.00	0.26
101	603993	洛阳钼业	33,300	190,809.00	0.26
102	000661	长春高新	800	186,736.00	0.25
103	601658	邮储银行	34,600	186,494.00	0.25
104	601633	长城汽车	5,000	185,200.00	0.25
105	300207	欣旺达	5,800	183,280.00	0.25
106	601877	正泰电器	5,100	182,478.00	0.25
107	601186	中国铁建	22,900	180,910.00	0.25
108	601377	兴业证券	25,500	179,775.00	0.24
109	002920	德赛西威	1,200	177,600.00	0.24
110	600760	中航沈飞	2,900	175,305.00	0.24
111	600029	南方航空	23,900	174,709.00	0.24
112	002202	金风科技	11,700	173,160.00	0.23

113	601600	中国铝业	35,400	168,150.00	0.23
114	003816	中国广核	60,000	168,000.00	0.23
115	600600	青岛啤酒	1,600	166,272.00	0.23
116	300661	圣邦股份	900	163,818.00	0.22
117	300408	三环集团	5,400	162,540.00	0.22
118	688111	金山办公	824	162,426.88	0.22
119	688012	中微公司	1,391	162,399.25	0.22
120	601111	中国国航	13,600	157,896.00	0.21
121	601601	中国太保	6,700	157,651.00	0.21
122	600588	用友网络	7,200	156,312.00	0.21
123	600989	宝丰能源	10,600	155,290.00	0.21
124	601100	恒立液压	2,500	154,300.00	0.21
125	600188	兖矿能源	3,900	153,972.00	0.21
126	600547	山东黄金	8,100	150,336.00	0.20
127	601066	中信建投	5,200	150,332.00	0.20
128	000596	古井贡酒	600	149,796.00	0.20
129	600741	华域汽车	6,500	149,500.00	0.20
130	002236	大华股份	9,000	147,780.00	0.20
131	300751	迈为股份	300	147,270.00	0.20
132	002050	三花智控	5,300	145,644.00	0.20
133	601868	中国能建	61,400	145,518.00	0.20
134	601238	广汽集团	9,500	144,780.00	0.20
135	601006	大秦铁路	21,800	143,662.00	0.19
136	300496	中科创达	1,100	143,528.00	0.19
137	603019	中科曙光	4,900	142,198.00	0.19
138	600460	士兰微	2,700	140,400.00	0.19
139	600011	华能国际	19,800	139,392.00	0.19
140	601989	中国重工	37,400	138,754.00	0.19
141	600115	中国东航	24,800	136,152.00	0.18
142	601138	工业富联	13,800	135,792.00	0.18
143	002601	龙佰集团	6,700	134,335.00	0.18
144	688396	华润微	2,268	133,970.76	0.18
145	000876	新 希 望	8,700	133,110.00	0.18
146	600085	同仁堂	2,500	132,200.00	0.18
147	000157	中联重科	21,400	131,824.00	0.18
148	000069	华侨城 A	20,300	131,747.00	0.18
149	688599	天合光能	1,990	129,847.50	0.18
150	300999	金龙鱼	2,400	129,648.00	0.18
151	002493	荣盛石化	8,400	129,276.00	0.18
152	600383	金地集团	9,600	129,024.00	0.17
153	000977	浪潮信息	4,800	127,104.00	0.17
154	600919	江苏银行	17,800	126,736.00	0.17
155	601800	中国交建	13,600	126,208.00	0.17

156	601628	中国人寿	4,000	124,320.00	0.17
157	688169	石头科技	200	123,340.00	0.17
158	002555	三七互娱	5,700	121,011.00	0.16
159	600941	中国移动	2,000	121,000.00	0.16
160	600999	招商证券	8,300	119,603.00	0.16
161	002007	华兰生物	5,200	118,560.00	0.16
162	000938	紫光股份	6,100	118,340.00	0.16
163	600016	民生银行	31,400	116,808.00	0.16
164	603882	金域医学	1,400	115,570.00	0.16
165	600886	国投电力	10,800	113,400.00	0.15
166	002841	视源股份	1,500	112,980.00	0.15
167	000776	广发证券	6,000	112,200.00	0.15
168	002001	新 和 成	4,840	110,400.40	0.15
169	600219	南山铝业	29,900	110,331.00	0.15
170	300601	康泰生物	2,400	108,432.00	0.15
171	300413	芒果超媒	3,200	106,752.00	0.14
172	300763	锦浪科技	500	106,500.00	0.14
173	300454	深信服	1,000	103,780.00	0.14
174	300529	健帆生物	2,000	101,780.00	0.14
175	000066	中国长城	9,300	100,626.00	0.14
176	601916	浙商银行	29,600	98,272.00	0.13
177	601618	中国中冶	27,600	96,600.00	0.13
178	300433	蓝思科技	8,700	96,309.00	0.13
179	600958	东方证券	9,428	96,259.88	0.13
180	300033	同花顺	1,000	96,150.00	0.13
181	603899	晨光股份	1,700	95,336.00	0.13
182	600489	中金黄金	12,300	90,897.00	0.12
183	002648	卫星化学	3,500	90,475.00	0.12
184	603833	欧派家居	600	90,408.00	0.12
185	601009	南京银行	8,600	89,612.00	0.12
186	601728	中国电信	23,600	88,028.00	0.12
187	600362	江西铜业	4,900	87,367.00	0.12
188	000708	中信特钢	4,300	86,645.00	0.12
189	601117	中国化学	9,200	86,572.00	0.12
190	300316	晶盛机电	1,200	81,108.00	0.11
191	002120	韵达股份	4,700	80,182.00	0.11
192	601865	福莱特	2,100	80,010.00	0.11
193	688008	澜起科技	1,316	79,723.28	0.11
194	000786	北新建材	2,300	79,626.00	0.11
195	002074	国轩高科	1,700	77,520.00	0.11
196	600845	宝信软件	1,400	76,440.00	0.10
197	002916	深南电路	800	74,968.00	0.10
198	600655	豫园股份	7,800	73,632.00	0.10

199	002736	国信证券	7,200	68,904.00	0.09
200	601799	星宇股份	400	68,400.00	0.09
201	600010	包钢股份	28,800	67,680.00	0.09
202	601998	中信银行	14,100	66,975.00	0.09
203	300003	乐普医疗	3,600	66,852.00	0.09
204	002938	鹏鼎控股	2,200	66,462.00	0.09
205	002008	大族激光	2,000	66,260.00	0.09
206	600161	天坛生物	2,700	65,556.00	0.09
207	601966	玲珑轮胎	2,400	60,888.00	0.08
208	600025	华能水电	8,300	58,017.00	0.08
209	000166	申万宏源	13,100	56,199.00	0.08
210	603392	万泰生物	335	52,025.50	0.07
211	600352	浙江龙盛	5,100	51,918.00	0.07
212	002791	坚朗五金	400	51,888.00	0.07
213	600183	生益科技	2,900	49,271.00	0.07
214	601838	成都银行	2,800	46,424.00	0.06
215	002064	华峰化学	5,500	46,420.00	0.06
216	300595	欧普康视	800	45,752.00	0.06
217	600018	上港集团	7,700	44,891.00	0.06
218	000301	东方盛虹	2,600	43,966.00	0.06
219	002568	百润股份	1,400	42,056.00	0.06
220	601808	中海油服	3,000	41,850.00	0.06
221	601336	新华保险	1,300	41,847.00	0.06
222	002607	中公教育	7,200	41,688.00	0.06
223	600332	白云山	1,300	41,067.00	0.06
224	601788	光大证券	2,600	40,976.00	0.06
225	002600	领益智造	8,100	40,662.00	0.06
226	601881	中国银河	4,200	40,614.00	0.06
227	603160	汇顶科技	600	37,158.00	0.05
228	300866	安克创新	500	33,160.00	0.04
229	000800	一汽解放	3,400	31,756.00	0.04
230	601995	中金公司	700	31,143.00	0.04
231	000408	藏格矿业	700	23,058.00	0.03
232	601319	中国人保	4,400	22,264.00	0.03
233	601825	沪农商行	2,200	13,794.00	0.02
234	001289	龙源电力	600	13,056.00	0.02
235	000877	天山股份	800	9,840.00	0.01

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	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.05
2	001268	联合精密	409	11,337.48	0.02
3	603233	大参林	60	1,878.00	0.00
4	002414	高德红外	80	1,029.60	0.00
5	300059	东方财富	40	1,016.00	0.00
6	300677	英科医疗	20	507.20	0.00
7	601108	财通证券	60	472.20	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	600519	贵州茅台	3,352,563.00	4.02
2	000792	盐湖股份	562,712.00	0.68
3	300124	汇川技术	310,622.00	0.37
4	000858	五粮液	293,549.00	0.35
5	601398	工商银行	278,801.00	0.33
6	300750	宁德时代	278,418.00	0.33
7	300014	亿纬锂能	272,963.00	0.33
8	601816	京沪高铁	272,701.00	0.33
9	002142	宁波银行	259,489.00	0.31
10	688981	中芯国际	252,833.90	0.30
11	300498	温氏股份	212,385.00	0.25
12	002230	科大讯飞	198,151.00	0.24
13	002594	比亚迪	182,997.00	0.22
14	300207	欣旺达	175,392.00	0.21
15	002311	海大集团	175,285.00	0.21
16	300142	沃森生物	173,350.00	0.21
17	688012	中微公司	172,205.18	0.21
18	002920	德赛西威	172,116.00	0.21
19	002179	中航光电	171,874.60	0.21
20	000333	美的集团	170,091.00	0.20

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	300750	宁德时代	1,644,546.00	1.97
2	000858	五粮液	831,998.00	1.00
3	601728	中国电信	681,101.74	0.82
4	601166	兴业银行	607,478.00	0.73
5	300760	迈瑞医疗	547,744.00	0.66
6	600036	招商银行	526,354.00	0.63
7	600887	伊利股份	464,169.00	0.56
8	600900	长江电力	405,530.00	0.49
9	000568	泸州老窖	384,914.00	0.46
10	002475	立讯精密	374,599.00	0.45
11	300059	东方财富	340,204.00	0.41
12	000333	美的集团	338,247.00	0.41
13	000002	万科 A	330,631.00	0.40
14	002415	海康威视	325,897.00	0.39
15	601318	中国平安	284,855.00	0.34
16	002714	牧原股份	254,905.00	0.31
17	601899	紫金矿业	227,940.00	0.27
18	002460	赣锋锂业	211,046.00	0.25
19	002241	歌尔股份	210,075.00	0.25
20	601288	农业银行	206,693.00	0.25

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	18,954,038.00
卖出股票收入（成交）总额	19,028,192.06

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。通过对股指期货的投资，实现管理市场风险和改善投资组合风险收益特性的目的。

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）外其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

1、兴业银行（证券代码 601166）

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

2、招商银行（证券代码 600036）

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

对上述证券的投资决策程序的说明：本基金为指数型基金，因复制指数被动持有，上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

7.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

7.12.3 期末其他各项资产构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	28,367.11
2	应收清算款	-
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	28,367.11

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

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
1,238	67,313.71	24,028,374.00	28.83%	59,306,000.00	71.17%

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	7,229,487.00	8.68%
2	广发证券股份有限公司	6,881,300.00	8.26%
3	苗金红	6,000,000.00	7.20%
4	叶岸	5,000,000.00	6.00%
5	方正证券股份有限公司	2,886,800.00	3.46%
6	郑州尚之居物业服务有限公司	2,500,000.00	3.00%
7	范秋萍	1,760,000.00	2.11%
8	财信证券股份有限公司	1,759,687.00	2.11%
9	中信证券股份有限公司	1,735,100.00	2.08%
10	刘广梅	1,000,000.00	1.20%
11	陈琪	1,000,000.00	1.20%

注：以上数据由中国证券登记结算公司提供，持有人为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2021 年 7 月 6 日)基金份额总额	242,334,374.00
本报告期期初基金份额总额	86,334,374.00
本报告期基金总申购份额	9,000,000.00
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	83,334,374.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期未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。

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的重大诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券	2	30,379,271.71	80.77%	7,027.25	88.10%	-
方正证券	2	7,232,069.00	19.23%	949.51	11.90%	-
银河证券	2	-	-	-	-	-

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	440,150.05	100.00%	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

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	证券时报、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	招商沪深 300ESG 基准交易型开放式指数证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-01-21
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	证券时报及基金管理人网站	2022-01-21
4	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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-01-27
5	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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-01-28
6	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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会	2022-03-22

		基金电子披露网站	
7	招商沪深 300ESG 基准交易型开放式指数证券投资基金 2021 年年度报告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-03-30
8	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	证券时报及基金管理人网站	2022-03-30
9	招商基金管理有限公司旗下部分基金增加财达证券股份有限公司为场内申购赎回代办券商的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-04-20
10	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	证券时报及基金管理人网站	2022-04-21
11	招商沪深 300ESG 基准交易型开放式指数证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-04-21
12	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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-05-13
13	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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-06-09
14	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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-06-17
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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-06-17
16	招商沪深 300ESG 基准交易型开放式指数证券投资基金产品资料概要更新	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-06-23

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准设立招商基金管理有限公司的文件；
- 2、中国证券监督管理委员会批准招商沪深 300ESG 基准交易型开放式指数证券投资基金设立的文件；
- 3、《招商沪深 300ESG 基准交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 4、《招商沪深 300ESG 基准交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 5、《招商沪深 300ESG 基准交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照。

11.2 存放地点

招商基金管理有限公司

地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

11.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人招商基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-887-9555

网址：<http://www.cmfcchina.com>

招商基金管理有限公司

2022 年 8 月 30 日