

# 招商沪深 300ESG 基准交易型开放式指数证券投资基金 2023 年中期报告

2023 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：2023 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 2023 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 2023 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.....	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.....	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	42
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.....	42
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.....	43
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.....	43
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.....	43
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	43

7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	43
7.12	投资组合报告附注.....	43
§8	基金份额持有人信息.....	45
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	45
8.2	期末上市基金前十名持有人.....	45
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	45
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.....	45
§9	开放式基金份额变动.....	45
§10	重大事件揭示.....	46
10.1	基金份额持有人大会决议.....	46
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.....	46
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	46
10.4	基金投资策略的改变.....	46
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	46
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.....	46
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.....	47
§11	备查文件目录.....	48
11.1	备查文件目录.....	48
11.2	存放地点.....	49
11.3	查阅方式.....	49

## § 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（扩位证券简称：沪深 300ESGETF）
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	80,334,374.00 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

### 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	<p>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。</p> <p>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</p>

	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	<a href="http://www.cmfchina.com">http://www.cmfchina.com</a>
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(2023 年 1 月 1 日 - 2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-312,358.23
本期利润	651,017.43
加权平均基金份额本期利润	0.0085
本期加权平均净值利润率	1.05%
本期基金份额净值增长率	0.86%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-17,095,667.16

期末可供分配基金份额利润	-0.2128
期末基金资产净值	63,238,707.11
期末基金份额净值	0.7872
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-21.28%

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。

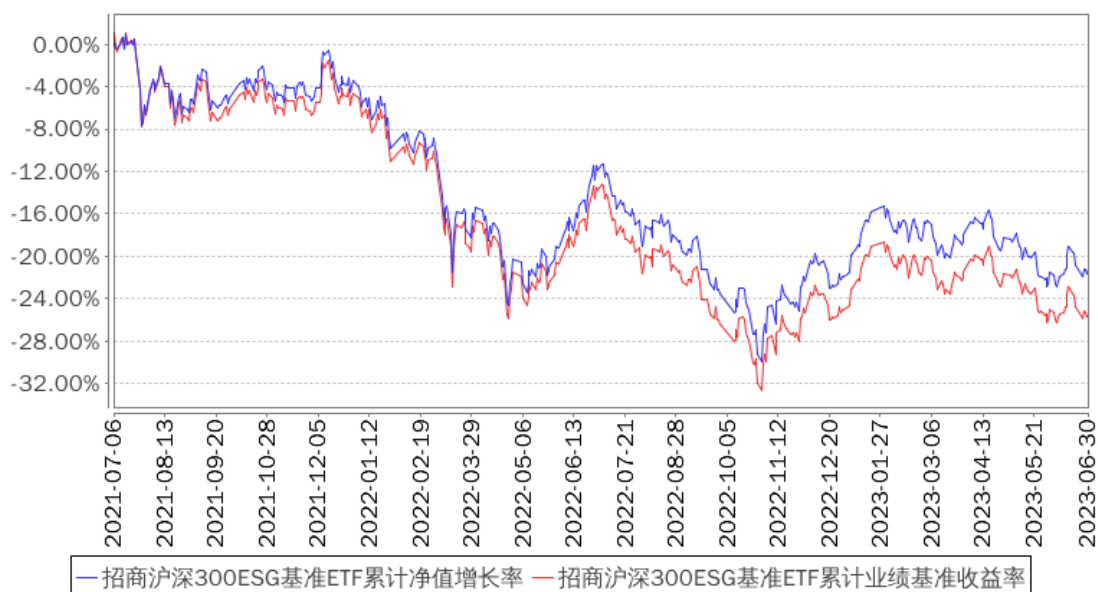
## 3.2 基金净值表现

### 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	2.02%	0.85%	1.10%	0.87%	0.92%	-0.02%
过去三个月	-4.29%	0.80%	-5.33%	0.81%	1.04%	-0.01%
过去六个月	0.86%	0.83%	-0.44%	0.84%	1.30%	-0.01%
过去一年	-11.12%	0.97%	-13.81%	0.99%	2.69%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-21.28%	1.10%	-25.41%	1.12%	4.13%	-0.02%

### 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



## § 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人资格；2004 年获得全国社保基金投资管理人资格；同时拥有合格境内机构投资者（QDII）业务资格、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	-	12	男，学士。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



				<p>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、招商中证生物科技主题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、招商中证香港科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII)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、招商中证 100 交易型开放式指数证券投资基金、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发起式联接基金、招商纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)、招商中证国新央企股东回报交易型开放式指数证券投资基金基金经理。</p>
--	--	--	--	--

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遵规守信情况的说明

基金管理人声明：在本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关法律法规及其各项实施准则的规定以及本基金的基金合同等基金法律文件的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的前提下，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围以及投资运作符合有关法律法规及基金合同的规定。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

基金管理人已建立较完善的研究方法和投资决策流程，确保各投资组合享有公平的投资决策机会。基金管理人建立了所有组合适用的投资对象备选库，制定明确的备选库建立、维护程序。基金管理人拥有健全的投资授权制度，明确投资决策委员会、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限划分，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。基金管理人的相关研究成果向内部所有投资组合开放，在投资研究层面不存在各投资组合间不公平的问题。

基金管理人按照法规要求，对连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合间的同向交易的交易价差进行分析，相关投资组合经理也对分析中发现的价格差异次数占比超过正常范围的情况进行了合理性解释。报告期内，公司旗下投资组合同向交易价差分析中未发现异常情形。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

基金管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。确因投资组合的投资策略或流动性等需要而发生的同日反向交易，基金管理人要求相关投资组合经理提供决策依据，并留存记录备查，完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合等除外。

本报告期内，本基金各项交易均严格按照相关法律法规、基金合同的有关要求执行，公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 18 次，其中 14 次为旗下指数及量化组合因投资策略需要而发生反向交易，4 次为不同基金经理管理的基金因投资策略不同而发生的反向交易。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，沪深 300 指数下跌 0.75%。A 股各行业中 TMT 板块相对收益明显，通信、传媒、计算机为涨幅前三的行业，分别为 50.66%、42.75%、27.57%。本基金基准指数沪深 300 ESG 基准指数报告期内下跌 0.44%。关于本基金的运作，仓位维持在 98.9%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 0.86%，同期业绩基准增长率为-0.44%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年市场呈现出比较明显的震荡和结构性行情，下半年明显板块间分化的行情可能有所缓解，可适度的增加顺周期板块的配置，同时做好预期管理。300ESG 指数从沪深 300 中，排除 ESG 得分靠后的成分股，在今年上半年，相对于沪深 300 指数，具备一定超额收益；该指数作为头部宽基指数 ESG 指数的基准指数，有望在长期中相对于沪深 300，呈现相对好一些的风险收益特征。

#### 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，咨询会计师事务所的专业意见，并与托管行沟通后由基金核算部具体执行。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。截止报告期末本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供相关债券品种、流通受限股票的估值参考数据。

#### 4.7 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的真实、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：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	862,436.14	827,923.39
结算备付金		10,110.91	11,132.80
存出保证金		8,588.75	14,466.65
交易性金融资产	6.4.7.2	62,499,267.31	59,653,711.22
其中：股票投资		62,499,267.31	59,653,711.22
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		-	28,439.29
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		63,380,403.11	60,535,673.35
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 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		-	2,661.73
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		25,633.43	25,774.64
应付托管费		5,126.69	5,154.93

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	110,935.88	144,259.83
负债合计		141,696.00	177,851.13
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	80,334,374.27	77,334,374.25
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-17,095,667.16	-16,976,552.03
净资产合计		63,238,707.11	60,357,822.22
负债和净资产总计		63,380,403.11	60,535,673.35

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.7872 元，基金份额总额 80,334,374.00 份。

## 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		915,146.82	-7,088,854.68
1.利息收入		3,315.02	5,627.74
其中：存款利息收入	6.4.7.9	3,315.02	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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-63,275.72	-3,878,604.93
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-828,260.00	-4,644,880.86
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	3,706.29	59,646.99
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	761,277.99	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	963,375.66	-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	11,731.86	-12,081.82
减：二、营业总支出		264,129.39	311,121.03
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	153,920.83	184,550.76
2.托管费	6.4.10.2.2	30,784.20	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	79,424.36	89,660.15
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		651,017.43	-7,399,975.71
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		651,017.43	-7,399,975.71
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		651,017.43	-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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 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）	77,334,374.25	-	-16,976,552.03	60,357,822.22
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）	77,334,374.25	-	-16,976,552.03	60,357,822.22
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	3,000,000.02	-	-119,115.13	2,880,884.89
（一）、综合收益总额	-	-	651,017.43	651,017.43
（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）	3,000,000.02	-	-770,132.56	2,229,867.46
其中：1.基金申购款	9,000,000.04	-	-1,856,696.89	7,143,303.15
2.基金赎回款	-6,000,000.02	-	1,086,564.33	-4,913,435.69
（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）	80,334,374.27	-	-17,095,667.16	63,238,707.11
项目	上年度可比期间 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	-	-	-	-



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**

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)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 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

#### **6.4.4 重要会计政策和会计估计**

本报告期所采用的会计政策，会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### **6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **6.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金在本报告期间未发生重大会计政策变更。

##### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期间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 2023 年 6 月 30 日
活期存款	862,436.14
等于：本金	862,254.04
加：应计利息	182.10
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	862,436.14

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	72,149,862.20	-	62,499,267.31	-9,650,594.89
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	72,149,862.20	-	62,499,267.31	-9,650,594.89

#### 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 2023 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	2,196.45
其中：交易所市场	2,196.45
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	108,739.43
合计	110,935.88

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	77,334,374.00	77,334,374.25
本期申购	9,000,000.00	9,000,000.04
本期赎回（以“-”号填列）	-6,000,000.00	-6,000,000.02
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	80,334,374.00	80,334,374.27

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
上年度末	-8,883,349.44	-8,093,202.59	-16,976,552.03
本期利润	-312,358.23	963,375.66	651,017.43
本期基金份额交易产生的变动数	-367,479.88	-402,652.68	-770,132.56
其中：基金申购款	-1,072,665.48	-784,031.41	-1,856,696.89
基金赎回款	705,185.60	381,378.73	1,086,564.33
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-9,563,187.55	-7,532,479.61	-17,095,667.16

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	3,073.70
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	144.62
其他	96.70

合计	3,315.02
----	----------

### 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-574,561.81
股票投资收益——赎回差价收入	-253,698.19
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	-828,260.00

#### 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	6,463,692.15
减：卖出股票成本总额	7,027,926.35
减：交易费用	10,327.61
买卖股票差价收入	-574,561.81

#### 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	4,913,435.69
减：现金支付赎回款总额	2,043,561.69
减：赎回股票成本总额	3,123,572.19
减：交易费用	-
赎回差价收入	-253,698.19

#### 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	3.89
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	3,702.40

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	3,706.29

#### 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	23,307.22
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	19,599.88
减：应计利息总额	4.01
减：交易费用	0.93
买卖债券差价收入	3,702.40

#### 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	761,277.99
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	761,277.99

**6.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	963,375.66
——股票投资	963,375.66
——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	963,375.66

**6.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-



替代损益	11,731.86
合计	11,731.86

#### 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	10,000.00
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
IOPV 服务费	9,916.99
合计	79,424.36

#### 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票	成交金额	占当期股票

		成交总额的比例		成交总额的比例
招商证券	9,080,210.08	64.56%	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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 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	成交金额	占当期债券成交总额的比例
招商证券	23,307.22	100.00%	440,150.05	100.00%

#### 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	2,100.24	76.24%	1,945.51	88.58%
关联方名称	上年度可比期间 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 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	153,920.83	184,550.76
其中：支付销售机构的客户维护费	54.34	-

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 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	30,784.20	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固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

##### 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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	5,974,974.00	7.44%	6,543,474.00	8.46%
----------------	--------------	-------	--------------	-------

注：表格中的比例为四舍五入的结果。

#### 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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
银河证券-活期	862,436.14	3,073.70	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 2023 年 1 月 1 日至 2023 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
银河证券	127085	韵达转债	可转债优先配售	46	4,600.00

上年度可比期间 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 2023 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）64,530 股，市值为人民币 2,114,002.80 元，占本基金资产净值的比例为 3.34%（2022 年 6 月 30 日：持有 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 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有招商证券(600999)(2022 年 6 月 30 日：持有 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（2023 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**

本基金为股票型基金，本基金的运作涉及的金融工具主要包括股票投资、债券投资等。与这些金融工具有关的风险，以及本基金的基金管理人管理这些风险所采取的风险管理政策如下所述。

##### **6.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

本基金的基金管理人从事风险管理的目标是提升本基金风险调整后收益水平，保证本基金的基金资产安全，维护基金份额持有人利益。基于该风险管理目标，本基金的基金管理人风险管理的基本策略是识别和分析本基金运作时本基金面临各种类型的风险，确定适当的风险容忍度，并及时可靠地对各种风险进行监督，将风险控制在限定的范围之内。本基金目前面临的主要风险包括：市场风险、信用风险和流动性风险。

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**

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的债券投资。

#### **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 2023 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	862,436.14	-	-	-	862,436.14
结算备付金	10,110.91	-	-	-	10,110.91
存出保证金	8,588.75	-	-	-	8,588.75
交易性金融资产	-	-	-	62,499,267.31	62,499,267.31
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	881,135.80	-	-	62,499,267.31	63,380,403.11
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	25,633.43	25,633.43
应付托管费	-	-	-	5,126.69	5,126.69
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	-	-	-	110,935.88	110,935.88
负债总计	-	-	-	141,696.00	141,696.00
利率敏感度缺口	881,135.80	-	-	62,357,571.31	63,238,707.11
上年度末 2022 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	827,923.39	-	-	-	827,923.39
结算备付金	11,132.80	-	-	-	11,132.80
存出保证金	14,466.65	-	-	-	14,466.65
交易性金融资产	-	-	-	59,653,711.22	59,653,711.22
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	-	-	-	28,439.29	28,439.29
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	853,522.84	-	-	59,682,150.51	60,535,673.35
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	25,774.64	25,774.64
应付托管费	-	-	-	5,154.93	5,154.93
应付清算款	-	-	-	2,661.73	2,661.73
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	-	-	-	144,259.83	144,259.83
负债总计	-	-	-	177,851.13	177,851.13
利率敏感度缺口	853,522.84	-	-	59,504,299.38	60,357,822.22

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

本基金本报告期末及上年度末无利率风险的敏感性分析。

#### 6.4.13.4.2 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险，该风险可能与特定投资品种相关，也有可能与整体投资品种相关。本基金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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	62,499,267.31	98.83	59,653,711.22	98.83
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	62,499,267.31	98.83	59,653,711.22	98.83

##### 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( 2023 年 6 月 30 日 )	上年度末( 2022 年 12 月 31 日 )
1. 权益性投资的市场价格上升 5%		3,124,963.37	2,982,685.56
2. 权益性投资的市场价格下降 5%		-3,124,963.37	-2,982,685.56

#### 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

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日
第一层次	62,499,267.31
第二层次	-
第三层次	-
合计	62,499,267.31

###### 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工具主要包括应收款项、卖出回购金融资产和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

#### 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	62,499,267.31	98.61
	其中：股票	62,499,267.31	98.61
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	872,547.05	1.38
8	其他资产	8,588.75	0.01
9	合计	63,380,403.11	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	414,756.00	0.66
B	采矿业	2,519,011.00	3.98
C	制造业	36,150,339.14	57.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,027,266.00	3.21
E	建筑业	1,656,498.00	2.62
F	批发和零售业	160,983.00	0.25
G	交通运输、仓储和邮政业	2,044,284.00	3.23
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,602,851.82	5.70
J	金融业	11,096,484.50	17.55

K	房地产业	1,170,579.00	1.85
L	租赁和商务服务业	497,385.00	0.79
M	科学研究和技术服务业	834,130.00	1.32
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	218,648.85	0.35
R	文化、体育和娱乐业	106,051.00	0.17
S	综合	-	-
	合计	62,499,267.31	98.83

### 7.2.2 期末积极投资按行业分类境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

### 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	2,900	4,903,900.00	7.75
2	600036	招商银行	64,530	2,114,002.80	3.34
3	300750	宁德时代	6,960	1,592,378.40	2.52
4	000858	五粮液	7,900	1,292,203.00	2.04
5	000333	美的集团	21,900	1,290,348.00	2.04
6	002594	比亚迪	4,300	1,110,561.00	1.76
7	601166	兴业银行	69,300	1,084,545.00	1.72
8	600900	长江电力	43,800	966,228.00	1.53
9	601318	中国平安	19,600	909,440.00	1.44
10	601398	工商银行	157,300	758,186.00	1.20
11	002415	海康威视	22,100	731,731.00	1.16
12	601012	隆基绿能	25,360	727,071.20	1.15
13	600887	伊利股份	25,300	716,496.00	1.13
14	000725	京东方 A	172,300	704,707.00	1.11
15	300760	迈瑞医疗	2,300	689,540.00	1.09
16	000651	格力电器	18,600	679,086.00	1.07
17	601899	紫金矿业	59,200	673,104.00	1.06
18	000063	中兴通讯	14,200	646,668.00	1.02

19	002230	科大讯飞	8,500	577,660.00	0.91
20	603259	药明康德	9,200	573,252.00	0.91
21	300274	阳光电源	4,900	571,487.00	0.90
22	002475	立讯精密	17,400	564,630.00	0.89
23	600276	恒瑞医药	11,500	550,850.00	0.87
24	600028	中国石化	85,600	544,416.00	0.86
25	601668	中国建筑	94,400	541,856.00	0.86
26	601816	京沪高铁	99,500	523,370.00	0.83
27	300124	汇川技术	7,900	507,259.00	0.80
28	600030	中信证券	25,505	504,488.90	0.80
29	002352	顺丰控股	11,100	500,499.00	0.79
30	601888	中国中免	4,500	497,385.00	0.79
31	000568	泸州老窖	2,300	482,011.00	0.76
32	601328	交通银行	82,600	479,080.00	0.76
33	000001	平安银行	42,400	476,152.00	0.75
34	600406	国电南瑞	18,820	434,742.00	0.69
35	600048	保利发展	32,000	416,960.00	0.66
36	002714	牧原股份	9,840	414,756.00	0.66
37	600837	海通证券	44,800	413,056.00	0.65
38	600050	中国联通	85,900	412,320.00	0.65
39	002129	TCL 中环	12,350	410,020.00	0.65
40	601857	中国石油	53,200	397,404.00	0.63
41	601088	中国神华	12,800	393,600.00	0.62
42	000002	万 科 A	27,800	389,756.00	0.62
43	688111	金山办公	824	389,109.28	0.62
44	002371	北方华创	1,200	381,180.00	0.60
45	600690	海尔智家	16,100	378,028.00	0.60
46	600436	片仔癀	1,300	372,268.00	0.59
47	002304	洋河股份	2,797	367,385.95	0.58
48	688981	中芯国际	7,253	366,421.56	0.58
49	603501	韦尔股份	3,735	366,179.40	0.58
50	603288	海天味业	7,784	364,680.40	0.58
51	600031	三一重工	21,800	362,534.00	0.57
52	601390	中国中铁	47,600	360,808.00	0.57
53	600438	通威股份	10,400	356,824.00	0.56
54	600809	山西汾酒	1,880	347,931.60	0.55
55	601988	中国银行	88,900	347,599.00	0.55
56	601728	中国电信	58,800	331,044.00	0.52
57	603986	兆易创新	3,100	329,375.00	0.52
58	600941	中国移动	3,500	326,550.00	0.52
59	600905	三峡能源	60,600	325,422.00	0.51
60	600309	万华化学	3,700	325,008.00	0.51
61	300014	亿纬锂能	5,300	320,650.00	0.51

62	600089	特变电工	14,200	316,518.00	0.50
63	601985	中国核电	44,300	312,315.00	0.49
64	600570	恒生电子	6,650	294,528.50	0.47
65	000938	紫光股份	9,100	289,835.00	0.46
66	601138	工业富联	11,500	289,800.00	0.46
67	601766	中国中车	44,000	286,000.00	0.45
68	688012	中微公司	1,817	284,269.65	0.45
69	600104	上汽集团	19,900	281,983.00	0.45
70	601658	邮储银行	57,300	280,197.00	0.44
71	000625	长安汽车	21,480	277,736.40	0.44
72	603019	中科曙光	5,200	264,680.00	0.42
73	601919	中远海控	27,940	262,636.00	0.42
74	000100	TCL 科技	66,520	262,088.80	0.41
75	600660	福耀玻璃	7,300	261,705.00	0.41
76	002049	紫光国微	2,800	261,100.00	0.41
77	300059	东方财富	18,008	255,713.60	0.40
78	601688	华泰证券	18,300	251,991.00	0.40
79	601288	农业银行	71,000	250,630.00	0.40
80	000338	潍柴动力	20,100	250,446.00	0.40
81	002050	三花智控	7,900	239,054.00	0.38
82	600019	宝钢股份	41,400	232,668.00	0.37
83	600000	浦发银行	32,100	232,404.00	0.37
84	601628	中国人寿	6,600	230,736.00	0.36
85	601377	兴业证券	36,630	224,175.60	0.35
86	002555	三七互娱	6,400	223,232.00	0.35
87	000977	浪潮信息	4,600	223,100.00	0.35
88	300015	爱尔眼科	11,787	218,648.85	0.35
89	002142	宁波银行	8,480	214,544.00	0.34
90	300316	晶盛机电	3,000	212,700.00	0.34
91	601186	中国铁建	21,200	208,820.00	0.33
92	601939	建设银行	32,800	205,328.00	0.32
93	002812	恩捷股份	2,100	202,335.00	0.32
94	002410	广联达	6,180	200,788.20	0.32
95	300122	智飞生物	4,450	196,690.00	0.31
96	688036	传音控股	1,333	195,951.00	0.31
97	601600	中国铝业	35,000	192,150.00	0.30
98	001979	招商蛇口	14,600	190,238.00	0.30
99	002920	德赛西威	1,200	186,972.00	0.30
100	603799	华友钴业	3,960	181,803.60	0.29
101	600588	用友网络	8,700	178,350.00	0.28
102	300896	爱美客	400	177,980.00	0.28
103	601800	中国交建	16,200	176,742.00	0.28
104	300033	同花顺	1,000	175,280.00	0.28

105	600585	海螺水泥	7,100	168,554.00	0.27
106	002179	中航光电	3,690	167,341.50	0.26
107	600958	东方证券	17,128	166,141.60	0.26
108	600600	青岛啤酒	1,600	165,808.00	0.26
109	600150	中国船舶	5,000	164,550.00	0.26
110	601006	大秦铁路	22,000	163,460.00	0.26
111	300450	先导智能	4,500	162,765.00	0.26
112	300347	泰格医药	2,500	161,350.00	0.26
113	002709	天赐材料	3,900	160,641.00	0.25
114	000776	广发证券	10,900	160,339.00	0.25
115	002271	东方雨虹	5,800	158,108.00	0.25
116	601601	中国太保	6,000	155,880.00	0.25
117	688599	天合光能	3,623	154,376.03	0.24
118	002236	大华股份	7,800	154,050.00	0.24
119	603993	洛阳钼业	28,500	151,905.00	0.24
120	000661	长春高新	1,100	149,930.00	0.24
121	002311	海大集团	3,200	149,888.00	0.24
122	600547	山东黄金	6,300	147,924.00	0.23
123	002241	歌尔股份	8,200	145,550.00	0.23
124	600196	复星医药	4,700	145,230.00	0.23
125	600760	中航沈飞	3,220	144,900.00	0.23
126	601633	长城汽车	5,700	143,469.00	0.23
127	600016	民生银行	37,900	142,125.00	0.22
128	002821	凯莱英	1,200	141,432.00	0.22
129	002460	赣锋锂业	2,320	141,427.20	0.22
130	600176	中国巨石	9,800	138,768.00	0.22
131	300408	三环集团	4,700	137,945.00	0.22
132	688008	澜起科技	2,399	137,750.58	0.22
133	000538	云南白药	2,620	137,497.60	0.22
134	600919	江苏银行	18,600	136,710.00	0.22
135	600886	国投电力	10,200	129,030.00	0.20
136	600795	国电电力	33,600	128,688.00	0.20
137	600115	中国东航	26,900	128,044.00	0.20
138	002841	视源股份	1,900	126,996.00	0.20
139	601615	明阳智能	7,400	124,912.00	0.20
140	300454	深信服	1,100	124,575.00	0.20
141	002202	金风科技	11,700	124,254.00	0.20
142	600989	宝丰能源	9,800	123,578.00	0.20
143	601669	中国电建	21,000	120,540.00	0.19
144	000792	盐湖股份	6,200	118,854.00	0.19
145	601169	北京银行	25,300	117,139.00	0.19
146	002493	荣盛石化	10,000	116,400.00	0.18
147	300782	卓胜微	1,200	115,956.00	0.18

148	300207	欣旺达	7,100	115,872.00	0.18
149	000157	中联重科	17,100	115,425.00	0.18
150	600741	华域汽车	6,100	112,606.00	0.18
151	000895	双汇发展	4,500	110,205.00	0.17
152	600845	宝信软件	2,164	109,952.84	0.17
153	601238	广汽集团	10,400	108,368.00	0.17
154	003816	中国广核	34,300	106,673.00	0.17
155	601868	中国能建	45,500	106,470.00	0.17
156	300413	芒果超媒	3,100	106,051.00	0.17
157	002601	龙佰集团	6,400	105,600.00	0.17
158	002074	国轩高科	3,800	104,956.00	0.17
159	600383	金地集团	14,500	104,545.00	0.17
160	600426	华鲁恒升	3,400	104,142.00	0.16
161	600111	北方稀土	4,300	103,114.00	0.16
162	600233	圆通速递	6,900	100,464.00	0.16
163	600926	杭州银行	8,500	99,875.00	0.16
164	300759	康龙化成	2,600	99,528.00	0.16
165	601066	中信建投	4,100	99,220.00	0.16
166	601111	中国国航	11,800	97,232.00	0.15
167	688396	华润微	1,844	96,644.04	0.15
168	002007	华兰生物	4,300	96,363.00	0.15
169	000876	新希望	8,200	95,776.00	0.15
170	601229	上海银行	16,500	94,875.00	0.15
171	601877	正泰电器	3,400	94,010.00	0.15
172	300999	金龙鱼	2,300	91,977.00	0.15
173	600219	南山铝业	30,300	91,506.00	0.14
174	600362	江西铜业	4,800	91,104.00	0.14
175	000786	北新建材	3,700	90,687.00	0.14
176	601100	恒立液压	1,400	90,062.00	0.14
177	688303	大全能源	2,223	89,920.35	0.14
178	600029	南方航空	14,600	88,038.00	0.14
179	600875	东方电气	4,600	85,790.00	0.14
180	002180	纳思达	2,500	85,625.00	0.14
181	300661	圣邦股份	1,040	85,415.20	0.14
182	601618	中国中冶	21,400	84,958.00	0.13
183	300142	沃森生物	3,200	84,640.00	0.13
184	601872	招商轮船	14,500	83,955.00	0.13
185	600188	兖矿能源	2,800	83,776.00	0.13
186	000166	申万宏源	18,000	83,160.00	0.13
187	601607	上海医药	3,700	82,917.00	0.13
188	600460	士兰微	2,700	81,729.00	0.13
189	603659	璞泰来	2,085	79,688.70	0.13
190	000963	华东医药	1,800	78,066.00	0.12



191	601336	新华保险	2,100	77,217.00	0.12
192	601818	光大银行	25,100	77,057.00	0.12
193	603833	欧派家居	800	76,640.00	0.12
194	603899	晨光股份	1,700	75,888.00	0.12
195	601865	福莱特	1,900	73,169.00	0.12
196	000708	中信特钢	4,600	72,864.00	0.12
197	300628	亿联网络	2,060	72,244.20	0.11
198	601998	中信银行	11,700	69,966.00	0.11
199	000069	华侨城 A	15,700	69,080.00	0.11
200	000983	山西焦煤	7,500	68,250.00	0.11
201	603195	公牛集团	644	61,862.64	0.10
202	300601	康泰生物	2,400	60,936.00	0.10
203	300433	蓝思科技	4,900	57,624.00	0.09
204	002001	新和成	3,740	57,596.00	0.09
205	000723	美锦能源	7,500	56,550.00	0.09
206	601117	中国化学	6,800	56,304.00	0.09
207	300751	迈为股份	320	54,201.60	0.09
208	002120	韵达股份	5,600	53,536.00	0.08
209	002916	深南电路	700	52,759.00	0.08
210	600183	生益科技	3,700	52,540.00	0.08
211	600025	华能水电	7,000	49,910.00	0.08
212	688363	华熙生物	524	46,719.84	0.07
213	688065	凯赛生物	729	45,387.54	0.07
214	300957	贝泰妮	500	44,440.00	0.07
215	600015	华夏银行	8,100	43,821.00	0.07
216	002938	鹏鼎控股	1,800	43,722.00	0.07
217	600018	上港集团	8,200	43,050.00	0.07
218	000877	天山股份	5,200	42,328.00	0.07
219	300763	锦浪科技	400	41,640.00	0.07
220	000301	东方盛虹	3,500	41,370.00	0.07
221	601319	中国人保	6,700	39,128.00	0.06
222	601995	中金公司	1,100	39,072.00	0.06
223	002064	华峰化学	5,600	38,416.00	0.06
224	002736	国信证券	4,300	37,539.00	0.06
225	002648	卫星化学	2,500	37,400.00	0.06
226	605499	东鹏饮料	200	34,580.00	0.05
227	688187	时代电气	819	34,283.34	0.05
228	300979	华利集团	700	34,118.00	0.05
229	601808	中海油服	2,400	33,312.00	0.05
230	688005	容百科技	591	31,925.82	0.05
231	600918	中泰证券	4,500	31,095.00	0.05
232	601898	中煤能源	3,000	25,320.00	0.04
233	601881	中国银河	1,600	18,576.00	0.03

234	001289	龙源电力	400	9,000.00	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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

## 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	338,682.00	0.56
2	600941	中国移动	333,794.00	0.55
3	000333	美的集团	238,469.00	0.40
4	300750	宁德时代	209,587.00	0.35
5	600436	片仔癀	172,519.00	0.29
6	600031	三一重工	158,270.00	0.26
7	000858	五粮液	157,853.00	0.26
8	601318	中国平安	152,478.00	0.25
9	600905	三峡能源	152,144.00	0.25
10	002594	比亚迪	151,064.00	0.25
11	601899	紫金矿业	148,079.00	0.25
12	600028	中国石化	145,430.00	0.24
13	000792	盐湖股份	119,774.00	0.20
14	601857	中国石油	119,211.00	0.20
15	600036	招商银行	118,961.00	0.20
16	603501	韦尔股份	116,274.00	0.19
17	002415	海康威视	102,564.00	0.17
18	688303	大全能源	97,179.18	0.16
19	300760	迈瑞医疗	90,226.00	0.15
20	002371	北方华创	88,951.00	0.15

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票；

2、基金持有的股票分类为交易性金融资产的，本项的“累计买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 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	223,889.00	0.37

2	600900	长江电力	217,197.00	0.36
3	600919	江苏银行	210,043.00	0.35
4	600276	恒瑞医药	201,772.00	0.33
5	002460	赣锋锂业	180,122.00	0.30
6	000858	五粮液	153,540.00	0.25
7	002594	比亚迪	127,111.00	0.21
8	601288	农业银行	124,315.00	0.21
9	601059	信达证券	114,529.80	0.19
10	002415	海康威视	114,104.00	0.19
11	600011	华能国际	105,504.00	0.17
12	000651	格力电器	100,878.00	0.17
13	603882	金域医学	95,830.00	0.16
14	000725	京东方 A	95,815.00	0.16
15	601818	光大银行	95,552.00	0.16
16	600085	同仁堂	95,117.00	0.16
17	300760	迈瑞医疗	92,743.00	0.15
18	601009	南京银行	89,395.00	0.15
19	001301	尚太科技	87,774.20	0.15
20	002459	晶澳科技	86,532.16	0.14

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	7,890,843.97
卖出股票收入（成交）总额	6,463,692.15

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，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工商银行（证券代码 601398）、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、工商银行（证券代码 601398）

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、内部制度不完善、违反反洗钱法、未依法履行职责等原因，多次受到监管机构的处罚。

#### 2、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。

#### 3、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、未依法履行职责、违反反洗钱法等原因，多次受到监管机构的处罚。

#### 4、中国平安（证券代码 601318）

根据 2022 年 8 月 22 日发布的相关公告，该证券发行人因未依法履行职责被国家外汇管理局深圳市分局处以罚款，警告，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	8,588.75
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	8,588.75

### 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
1,111	72,308.17	24,766,874.00	30.83%	55,567,500.00	69.17%

### 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	广发证券股份有限公司	6,572,800.00	8.18%
2	苗金红	6,000,000.00	7.47%
3	招商证券股份有限公司	5,974,974.00	7.44%
4	叶岸	5,000,000.00	6.22%
5	方正证券股份有限公司	3,495,400.00	4.35%
6	郑州尚之居物业服务有限公司	3,448,400.00	4.29%
7	中信证券股份有限公司	2,144,700.00	2.67%
8	上海汇利资产管理有限公司-汇利玖 奕 6 号私募证券投资基金	1,831,600.00	2.28%
9	范秋萍	1,760,000.00	2.19%
10	王德娥	1,304,800.00	1.62%

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	77,334,374.00
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	6,000,000.00
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	80,334,374.00

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

根据本基金管理人 2023 年 6 月 22 日的公告，经招商基金管理有限公司第六届董事会 2023 年第四次会议审议通过，钟文岳先生离任公司常务副总经理、财务负责人职务。

本报告期内，基金托管人于 2023 年 5 月 18 日发布《关于中国银河证券股份有限公司托管总部总经理变更的公告》，中国银河证券股份有限公司托管总部总经理自 2023 年 5 月 17 日起变更为鹿宁，罗黎明不再担任托管总部总经理。

### 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

#### 10.6.1 管理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受到监管部门的稽查或处罚的书面通知或文件。

### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 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	3	9,080,210.08	64.56%	2,100.24	76.24%	-
方正证券	2	4,985,513.20	35.44%	654.52	23.76%	-
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	23,307.22	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旗下基金 2022 年第 4 季度报告提示性公告	证券时报及基金管理人网站	2023-01-18
2	招商沪深 300ESG 基准交易型开放式指数证券投资基金 2022 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	2023-01-18
3	招商基金管理有限公司旗下部分基金增加国金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	2023-03-14



4	招商基金管理有限公司旗下部分基金增加东海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	2023-03-14
5	招商基金管理有限公司旗下部分基金增加中国中金财富证券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	2023-03-23
6	招商沪深 300ESG 基准交易型开放式指数证券投资基金 2022 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	2023-03-30
7	招商基金管理有限公司旗下基金 2022 年年度报告提示性公告	证券时报及基金管理人网站	2023-03-30
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	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	2023-04-19
9	招商基金管理有限公司旗下部分基金增加长城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	2023-04-20
10	招商基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 1 季度报告提示性公告	证券时报及基金管理人网站	2023-04-21
11	招商沪深 300ESG 基准交易型开放式指数证券投资基金 2023 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	2023-04-21
12	招商基金管理有限公司旗下部分基金增加国泰君安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	2023-04-26
13	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	2023-05-12
14	招商基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	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	2023-06-22
15	招商基金管理有限公司旗下部分基金增加华福证券有限责任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	2023-06-27

## § 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.cmfchina.com>

招商基金管理有限公司

2023 年 8 月 30 日