

招商标普金砖四国指数证券投资基金 (LOF) 2020 年中期报告

2020 年 06 月 30 日

基金管理人：招商基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2020 年 8 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 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.....	1
§2 基金简介.....	3
2.1 基金基本情况.....	3
2.2 基金产品说明.....	3
2.3 基金管理人和基金托管人.....	3
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人.....	4
2.5 信息披露方式.....	4
2.6 其他相关资料.....	4
§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.....	5
§4 管理人报告.....	6
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	6
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介.....	7
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	7
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	7
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	8
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	9
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	9
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	10
4.9 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	10
§5 托管人报告.....	10
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	10
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.....	10
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.....	10
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	10
6.1 资产负债表.....	10
6.2 利润表.....	12
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	15
§7 投资组合报告.....	32
7.1 期末基金资产组合情况.....	32
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	33
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	33
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细.....	34
7.5 报告期内股票投资组合的重大变动.....	39
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	42
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	42
7.8 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.....	42

7.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细	42
7.10	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细	42
7.11	投资组合报告附注	42
§8	基金份额持有人信息	43
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	43
8.2	期末上市基金前十名持有人	43
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	44
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	44
§9	开放式基金份额变动	44
§10	重大事件揭示	44
10.1	基金份额持有人大会决议	44
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	45
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	45
10.4	基金投资策略的改变	45
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	45
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	45
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	45
10.8	其他重大事件	46
§11	备查文件目录	47
11.1	备查文件目录	47
11.2	存放地点	48
11.3	查阅方式	48

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	招商标普金砖四国指数证券投资基金(LOF)
基金简称	招商标普金砖四国指数 (QDII-LOF)
场内简称	招商金砖
基金主代码	161714
交易代码	161714
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 2 月 11 日
基金管理人	招商基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	14,796,079.75 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2011 年 5 月 11 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用指数化投资方式，通过投资纪律约束和量化风险管理，力求实现对标的指数的有效跟踪，获得与标的指数收益相似的回报。本基金控制目标为基金净值收益率与标的指数收益率之间的年跟踪误差不超过 6%。
投资策略	本基金至少 80%以上的资产采用完全复制法进行指数化投资，即按照标准普尔金砖四国 40 指数成份股及其权重构建指数投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。在因特殊情况导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将采用优化方法构建最优投资组合的个股权重比例，以求尽可能贴近目标指数的表现。
业绩比较基准	标准普尔金砖四国 40 总收益指数(S&P BRIC 40 Index(Net TR))收益率
风险收益特征	本基金是被动管理的指数型基金，主要投资方向为标普金砖四国 40 指数的成份股及备选成份股，属于具有较高风险和收益预期的证券投资基金品种，其预期风险与收益水平高于债券型基金和混合型基金。并且，本基金主要投资于以金砖四国为代表的新兴市场，其风险收益水平高于投资于海外成熟市场的基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	招商基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	潘西里
	联系电话	0755-83196666
	电子邮箱	cmf@cmfchina.com
		许俊
		010-66594319
		fcid@bankofchina.com

客户服务电话	400-887-9555	95566
传真	0755—83196475	010—66594942
注册地址	深圳市福田区深南大道 7088 号	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址	中国深圳深南大道 7088 号招商银行大厦	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	518040	100818
法定代表人	刘辉	刘连舸

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目	境外投资顾问	境外资产托管人
名称	中文	- 中国银行（香港）有限公司
	英文	- Bank Of China(Hong Kong) Limited
注册地址	-	12/F, BANK OF CHINA TOWER, 1 GARDEN ROAD, HONG KONG
办公地址	-	32/F, BANK OF CHINA TOWER, 1 GARDEN ROAD, HONG KONG
邮政编码	-	-

2.5 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.cmfcchina.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.6 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(2020年1月1日 - 2020年6月30日)
本期已实现收益	207,711.73
本期利润	-1,215,460.66
加权平均基金份额本期利润	-0.0841
本期加权平均净值利润率	-8.34%
本期基金份额净值增长率	-9.33%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)
期末可供分配利润	-3,199,424.85
期末可供分配基金份额利润	-0.2162
期末基金资产净值	15,234,945.31
期末基金份额净值	1.030
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)
基金份额累计净值增长率	3.00%

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

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

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	5.64%	1.33%	6.27%	1.43%	-0.63%	-0.10%
过去三个月	13.44%	1.60%	15.44%	1.75%	-2.00%	-0.15%
过去六个月	-9.33%	2.13%	-6.79%	2.30%	-2.54%	-0.17%
过去一年	-2.37%	1.58%	1.47%	1.70%	-3.84%	-0.12%
过去三年	16.25%	1.24%	29.07%	1.32%	-12.82%	-0.08%
自基金合同生效起至今	3.00%	1.18%	43.22%	1.26%	-40.22%	-0.08%

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

招商标普金砖四国指数(QDII-LOF)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，公司注册资本金为人民币 13.1 亿元，招商银行股份有限公司持有公司全部股权的 55%，招商证券股份有限公司持有公司全部股权的 45%。

招商基金管理有限公司首批获得企业年金基金投资管理人资格、基本养老保险基金投资管理资格；2004 年获得全国社保基金投资管理人资格；同时拥有 QDII(合格境内机构投资者)资格、专户理财（特定客户资产管理计划）资格。

2020 年半年度公司获奖情况：

金牛奖·固定收益投资金牛基金公司·《中国证券报》·2020 年 3 月

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
白海峰	本基金基金经理	2016 年 11 月 8 日	-	10	男，硕士。曾任职于新东方教育科技集团；2010 年 6 月加入国泰基金管理有限

	理			公司，历任管理培训生、宏观经济研究高级经理、首席经济学家助理、国际业务部负责人；2015 年加入招商基金管理有限公司，曾任招商全球资源股票型证券投资基金、招商中国信用机会定期开放债券型证券投资基金(QDII)基金经理，现任招商资产管理（香港）有限公司执行董事兼总经理兼招商标普金砖四国指数证券投资基金(LOF)、招商沪港深科技创新主题精选灵活配置混合型证券投资基金、招商 MSCI 中国 A 股国际通指数型证券投资基金、招商普盛全球配置证券投资基金（QDII）、招商 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金经理。
--	---	--	--	---

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

2、证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金无境外投资顾问。

4.3 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。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 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、投资总监、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。根据分析结果，公司旗下组合的同向交易情况基本正常，没有发现有明显异常并且无合理理由的同向交易异常情况。

4.4.2 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，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易不存在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。报告期内亦未发现其他有可能导致不公平交易和利益输送的重大异常交易行为。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年，新冠疫情席卷全球大多数国家，为抗击疫情各国先后封锁城市，在疫情的冲击下全球风险资产大幅下跌，随后各国央行向市场注入了大量的流动性，且各国政府也采取了积极的财政政策对受冲击的行业和居民进行了救助，叠加各主要国家经济重启后，经济数据也触底回升，全球风险资产触底后快速大幅反弹。

报告期内，欧美国家先后遭受新冠疫情的正面冲击，并采取封城策略，失业率数据屡破新高，投资者极度恐慌，市场遭遇无差别抛售，一致性的抛售行为快速抽干了市场的流动性，进一步加剧了投资者的恐慌情绪及市场的跌幅。随后各主要国家央行纷纷快速行动，向市场注入充裕的流动性，在一定程度上缓解了恐慌情绪的蔓延。之后各国政府纷纷推出积极的财政政策，救助受冲击的企业和居民，同时叠加各国抗疫取得一定成效及经济的重启，市场风险偏好有所修复，风险资产价格大部分修复，上半年 MSCI 发达市场指数下跌 6.64%，其中标普 500 下跌 4.84%。

报告期内，新兴市场在疫情和大宗商品价格的双重冲击下也经历了大幅的回撤，但随着大宗商品价格的修复和全球主要国家经济的触底反弹，叠加全球流动性充裕下市场风险偏好的上升，新兴市场亦迎来 V 型反弹，上半年 MSCI 发达市场指数累计下跌 10.73%，其

中恒生指数下跌 13.35%、俄罗斯 MOEX 指数下跌 9.94%、印度 SENSEX30 下跌 16.12%、巴西 IBOVESPA 指数下跌 19.83%。

本基金在报告期内继续维持了严格复制跟踪指数策略。

4.5.2 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-9.33%，同期业绩基准增长率为-6.79%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年，预计复工仍将持续，全球经济大概率仍会继续复苏，市场流动性仍将保持充裕状态，但新冠疫情存在二次爆发的可能性，且美国大选亦可能会对市场形成一定的扰动。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金的估值业务严格按照相关的法律法规、基金合同以及《招商基金管理有限公司基金估值委员会管理制度》进行。基金核算部负责日常的基金资产的估值业务，执行基金估值政策。另外，公司设立由投资和研究部门、风险管理部、基金核算部、法律合规部负责人和基金经理代表组成的估值委员会。公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历。公司估值委员会主要负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，定期评价现有估值政策和程序的适用性及对估值程序执行情况进行监督。

投资和研究部门以及基金核算部共同负责关注相关投资品种的动态，评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种；投资和研究部门定期审核公允价值的确认和计量；研究部提出合理的数量分析模型对需要进行估值测算或者调整的投资品种进行公允价值定价与计量并定期对估值政策和程序进行评价，以保证其持续适用；基金核算部定期审核估值政策和程序的一致性，并负责与托管行沟通估值调整事项；风险管理部负责估值委员会工作流程中的风险控制；法律合规部负责日常的基金估值调整结果的事后复核监督工作；法律合规部与基金核算部共同负责估值调整事项的信息披露工作。

基金经理代表向估值委员会提供估值参考信息，参与估值政策讨论；对需采用特别估值程序的证券，基金及时启动特别估值程序，由公司估值委员会集体讨论议定特别估值方案，咨询会计事务所的专业意见，并与托管行沟通后由基金核算部具体执行。

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规的规定和基金合同的约定，以及本基金的实际运作情况，本基金报告期末未进行利润分配。在符合分红条件的前提下，本基金已实现尚未分配的可供分配收益部分，将严格按照基金合同的约定适时向投资者予以分配。

4.9 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，相关解决方案已经上报证监会。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在招商标普金砖四国指数证券投资基金(LOF)（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：招商标普金砖四国指数证券投资基金 (LOF)

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	1,331,868.00	615,928.46
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	14,165,188.21	15,762,528.63
其中：股票投资		14,165,188.21	15,762,528.63
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	342,584.36
应收利息	6.4.7.5	56.80	143.58
应收股利		82,943.12	64,178.39
应收申购款		111,424.69	153,585.78
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	212,385.00	209,286.00
资产总计		15,903,865.82	17,148,235.20
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		496,956.61	390,835.91

应付管理人报酬		10,193.04	11,400.17
应付托管费		3,185.33	3,562.53
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	-	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	158,585.53	90,539.12
负债合计		668,920.51	496,337.73
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	14,796,079.75	14,657,741.22
未分配利润	6.4.7.10	438,865.56	1,994,156.25
所有者权益合计		15,234,945.31	16,651,897.47
负债和所有者权益总计		15,903,865.82	17,148,235.20

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.030 元，基金份额总额 14,796,079.75 份。

6.2 利润表

会计主体：招商标普金砖四国指数证券投资基金(LOF)

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		-820,481.54	2,661,059.86
1. 利息收入		2,420.06	1,479.34
其中：存款利息收入	6.4.7.11	2,420.06	1,479.34
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）		607,069.65	684,161.92
其中：股票投资收益	6.4.7.12	501,928.36	456,944.11
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资 收益	6.4.7.15	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.16	-	-
衍生工具收益	6.4.7.17	-	-
股利收益	6.4.7.18	105,141.29	227,217.81
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	-1,423,172.39	1,975,627.55
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-13,592.67	-4,308.69
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	6,793.81	4,099.74
减：二、费用		394,979.12	285,656.50
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	58,106.21	77,776.00
2. 托管费	6.4.10.2.2	18,158.11	24,304.98
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.21	5,434.20	6,406.44
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.22	313,280.60	177,169.08
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,215,460.66	2,375,403.36
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,215,460.66	2,375,403.36

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：招商标普金砖四国指数证券投资基金(LOF)

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	14,657,741.22	1,994,156.25	16,651,897.47
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,215,460.66	-1,215,460.66
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	138,338.53	-339,830.03	-201,491.50
其中：1. 基金申购款	6,583,891.25	-138,054.87	6,445,836.38
2. 基金赎回款	-6,445,552.72	-201,775.16	-6,647,327.88
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	14,796,079.75	438,865.56	15,234,945.31
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	21,387,497.43	-1,370,094.77	20,017,402.66
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,375,403.36	2,375,403.36
三、本期基金份额交易产生的基金净值变	-3,415,800.21	-14,742.71	-3,430,542.92

动数（净值减少以“—”号填列）			
其中：1. 基金申购款	1,303,553.20	24,248.30	1,327,801.50
2. 基金赎回款	-4,719,353.41	-38,991.01	-4,758,344.42
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“—”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	17,971,697.22	990,565.88	18,962,263.10

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

_____王小青_____欧志明_____何剑萍_____

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

招商标普金砖四国指数证券投资基金(LOF) (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》、《招商标普金砖四国指数证券投资基金(LOF)基金合同》(以下简称“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[2010]1244号文批准公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限为不定期,首次设立募集基金份额为436,572,159.14份,经德勤华永会计师事务所有限公司验证,并出具了编号为德师报(验)字(11)第0004号验资报告。基金合同于2011年2月11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,基金境内托管人为中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”),境外托管人为中国银行(香港)有限公司(以下简称“中国银行(香港)”)。

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《招商标普金砖四国指数证券投资基金更新的招募说明书》的有关规定,本基金主要投资于全球证券市场中具有良好流动性的金融工具,包括普通股、优先股、存托凭证等权益类证券;银行存款、可转让存单、回购协议、短期政府债券等货币市场工具;政府债券、公司债券、可转换债券等固定收益类证券;以及基金、ETFs、金融衍生品和中国证监会许可的其他金融工具。投资于股票等权益类证券的比例不低于基金资产的90%,其中投资于标的指数成份股、备选成份股的资产占基金资产的比例不低于80%。现金及到期日在一年以内的

政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%，其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为标准普尔金砖四国 40 总收益指数 (S&PBRIC40Index (NetTR)) 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关于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。

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 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策, 会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问

题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税；2018年1月1日起，公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

(2) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。

(3) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在收到相关扣收税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 对于基金从事A股买卖，出让方按0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税。

(5) 基金在境外证券交易所进行交易或取得的源自境外证券市场的收益，其涉及的税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行。

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 2020 年 6 月 30 日
活期存款	1,331,868.00
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	1,331,868.00

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	11,310,498.95	14,165,188.21	2,854,689.26
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	11,310,498.95	14,165,188.21	2,854,689.26

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	56.80
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	-
合计	56.80

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
其他应收款	212,385.00
待摊费用	-
合计	212,385.00

6.4.7.7 应付交易费用

本基金本报告期末无应付交易费用。

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	878.31
预提费用	154,426.14
应付指数使用费	3,281.08
应付证券出借违约金	-
合计	158,585.53

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	14,657,741.22	14,657,741.22
本期申购	6,583,891.25	6,583,891.25
本期赎回（以“-”号填列）	-6,445,552.72	-6,445,552.72
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	14,796,079.75	14,796,079.75

注：本期申购含红利再投、转换入份（金）额，本期赎回含转换出份（金）额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-3,386,387.13	5,380,543.38	1,994,156.25
本期利润	207,711.73	-1,423,172.39	-1,215,460.66
本期基金份额交易产生的变动数	-20,749.45	-319,080.58	-339,830.03
其中：基金申购款	-1,484,068.55	1,346,013.68	-138,054.87
基金赎回款	1,463,319.10	-1,665,094.26	-201,775.16
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-3,199,424.85	3,638,290.41	438,865.56

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	2,420.06
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	-

其他	-
合计	2,420.06

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	501,928.36
股票投资收益——赎回差价收入	-
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	501,928.36

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	2,015,022.76
减：卖出股票成本总额	1,513,094.40
买卖股票差价收入	501,928.36

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无股票赎回差价收入。

6.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无股票申购差价收入。

6.4.7.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无证券出借差价收入。

6.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期内无基金投资收益。

6.4.7.14 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期内无买卖债券差价收入。

6.4.7.15 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16 贵金属投资收益

6.4.7.16.1 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。

6.4.7.16.2 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。

6.4.7.16.3 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。

6.4.7.16.4 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。

6.4.7.17 衍生工具收益**6.4.7.17.1 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。

6.4.7.17.2 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。

6.4.7.18 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	105,141.29
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	105,141.29

6.4.7.19 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-1,423,172.39
——股票投资	-1,423,172.39
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——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	-1,423,172.39

6.4.7.20 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	6,793.81
利息	-
合计	6,793.81

6.4.7.21 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	5,434.20
银行间市场交易费用	-
合计	5,434.20

6.4.7.22 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
审计费用	14,918.54
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行费用	3,382.75
指数使用费	203,128.38
上市费	29,835.26
其他	2,343.33
合计	313,280.60

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，本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系**6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
招商基金管理有限公司	基金管理人
中国银行股份有限公司	基金托管人
中国银行(香港)	基金境外托管人

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

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股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

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交易。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	58,106.21	77,776.00
其中：支付销售机构的客户 维护费	23,192.75	-

注：支付基金管理人招商基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值×0.80%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×0.80%÷当年天数

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托 管费	18,158.11	24,304.98

注：支付基金托管人中国银行的基金托管费按前一日基金资产净值×0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明**6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况**

本报告期内及上年度可比期间基金管理人无运用自有资金投资本基金的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行（香港）	763,019.26	-	566,901.30	-
中国银行股份有限公司	568,848.74	2,420.06	490,769.83	1,479.34

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行股份有限公司和中国银行（香港）保管，按适用利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2020 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其他价格风险。

本基金的基金管理人建立了以全面、独立、相互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、存出保证金及其他。

本基金的银行存款存放于本基金的基金托管人中国银行和境外托管人中国银行(香港)，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在境外交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，在境内交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手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。

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

流动性风险是指没有足够资金以满足到期债务支付的风险。本基金流动风险来源于开放式基金每日兑付赎回资金的流动性风险，因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险以及因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。本基金所持有的大部分交易性金融资产在证券交易所上市，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。本基金所持有的金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息。

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的评估、选择、跟踪和控制基金投资的流动性风险。同时，本基金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。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的利率敏感性资产主要是银行存款。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定价日组合等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 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	1,331,868.00	-	-	-	1,331,868.00
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	14,165,188.21	14,165,188.21
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	56.80	56.80
应收股利	-	-	-	82,943.12	82,943.12
应收申购款	-	-	-	111,424.69	111,424.69
应收证券清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	212,385.00	212,385.00
资产总计	1,331,868.00	-	-	14,571,997.82	15,903,865.82
负债					
应付赎回款	-	-	-	496,956.61	496,956.61
应付管理人报酬	-	-	-	10,193.04	10,193.04
应付托管费	-	-	-	3,185.33	3,185.33
应付证券清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	158,585.53	158,585.53
负债总计	-	-	-	668,920.51	668,920.51

利率敏感度缺口	1,331,868.00	-	-	13,903,077.31	15,234,945.31
上年度末 2019 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	615,928.46	-	-	-	615,928.46
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	15,762,528.63	15,762,528.63
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	143.58	143.58
应收股利	-	-	-	64,178.39	64,178.39
应收申购款	-	-	-	153,585.78	153,585.78
应收证券清算款	-	-	-	342,584.36	342,584.36
其他资产	-	-	-	209,286.00	209,286.00
资产总计	615,928.46	-	-	16,532,306.74	17,148,235.20
负债					
应付赎回款	-	-	-	390,835.91	390,835.91
应付管理人报酬	-	-	-	11,400.17	11,400.17
应付托管费	-	-	-	3,562.53	3,562.53
应付证券清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	90,539.12	90,539.12
负债总计	-	-	-	496,337.73	496,337.73
利率敏感度缺口	615,928.46	-	-	16,035,969.01	16,651,897.47

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价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 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。外汇风险对本基金资产净值的影响来自于外币货币性资产与负债净头寸，以公允价值计量的外币非货币性金融资产和负债的净头寸及涉及外币货币衍生工具的公允价值受汇率波动的影响。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

下表统计了本基金于2020年6月30日资产负债表项目面临的外汇风险敞口，各原币资产和负债的账面价值已折合为人民币金额。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末2020年6月30日					合计
	美元折合人民币	港币折合人民币	欧元折合人民币	日元折合人民币	其他币种折合人民币	
以外币计价的资产						
银行存款	523,934.69	239,270.27	-	-	-	763,204.96
结算备付金	-	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	7,724,859.80	6,440,328.41	-	-	-	14,165,188.21
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-
应收股利	36,845.69	46,097.43	-	-	-	82,943.12
应收利息	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-
其它资产	212,385.00	-	-	-	-	212,385.00
资产合计	8,498,025.18	6,725,696.11	-	-	-	15,223,721.29
以外币计价的负债						
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-
应付交易	-	-	-	-	-	-

费用						
其他负债	-	-	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-	-	-
资产负债表外 外汇风险敞口 净额	8,498,025.1 8	6,725,696.1 1	-	-	-	15,223,721. 29

项目	上年度末 2019 年 12 月 31 日					
	美元折合 人民币	港币折合 人民币	欧元折合 人民币	日元折合 人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产						
银行存款	158,037.23	1,048.56	-	-	-	159,085.79
结算备付金	-	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	9,025,574.6 2	6,736,954.0 1	-	-	-	15,762,528. 63
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-
应收股利	64,178.39	-	-	-	-	64,178.39
应收利息	1.67	-	-	-	-	1.67
应收申购款	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	342,584.36	-	-	-	342,584.36
其它资产	209,286.00	-	-	-	-	209,286.00
资产合计	9,457,077.9 1	7,080,586.9 3	-	-	-	16,537,664. 84
以外币计价的负债						
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-	-	-
应付销售	-	-	-	-	-	-

服务费						
应付交易费用	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-	-	-
资产负债 表外汇风 险敞口净 额	9,457,077.9 1	7,080,586.9 3	-	-	-	16,537,664. 84

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的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（2020年6月30日）	上年度末（2019年12月31日）
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	761,186.06	826,883.24
2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-761,186.06	-826,883.24	

6.4.13.4.3 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。

本基金主要投资于以公允价值计量的股票、债券和基金，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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 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	14,165,188.21	92.98	15,762,528.63	94.66
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	14,165,188.21	92.98	15,762,528.63	94.66

注：合计比例为年末交易性金融资产的公允价值除以基金资产净值计算得出。

6.4.13.4.3.2 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（2020年6月30日）	上年度末（2019年12月31日）
	1. 权益性投资的市场价格上升 5%	708,259.41	788,126.43
	2. 权益性投资的市场价格下降 5%	-708,259.41	-788,126.43

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无需要说明有助于理解和分析会计报表的其他事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（人民币元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	14,165,188.21	89.07
	其中：普通股	7,371,280.89	46.35
	存托凭证	6,793,907.32	42.72
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的 买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-

7	银行存款和结算备付金合计	1,331,868.00	8.37
8	其他资产	406,809.61	2.56
9	合计	15,903,865.82	100.00

注：由于四舍五入的原因公允价值占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

国家（地区）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
中国香港	6,440,328.41	42.27
美国	6,126,528.09	40.21
英国	1,598,331.71	10.49
合计	14,165,188.21	92.98

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

7.3.1 期末指数投资按行业分类的权益投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
通信服务	3,293,192.54	21.62
消费者非必需品	3,211,364.63	21.08
消费者常用品	125,857.65	0.83
能源	1,537,334.18	10.09
金融	4,480,889.12	29.41
医疗保健	128,378.51	0.84
工业	-	-
信息技术	629,894.90	4.13
基础材料	524,359.95	3.44
地产业	233,916.73	1.54
公用事业	-	-
合计	14,165,188.21	92.98

注：本基金对以上行业分类采用全球行业分类标准（GICS）。

7.3.2 期末积极投资按行业分类的权益投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的权益投资。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

7.4.1 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权益投资明细

序号	公司名称（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
----	----------	----------	------	--------	----------	-------	------------	--------------

1	TENCENT HOLDINGS LTD	腾讯控股有限公司	700 HK	香港联合交易所	中国香港	4,843	2,205,701.65	14.48
2	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	阿里巴巴	BABA US	美国纽约证券交易所	美国	1,011	1,543,845.68	10.13
3	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	中国建设银行股份有限公司	939 HK	香港联合交易所	中国香港	151,125	865,533.50	5.68
4	HDFC BANK LTD-ADR	-	HDB US	美国纽约证券交易所	美国	2,049	659,438.01	4.33
5	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	中国平安保险(集团)股份有限公司	2318 HK	香港联合交易所	中国香港	8,348	590,968.28	3.88
6	JD.COM INC-ADR	京东	JD US	纳斯达克证券交易所	美国	1,335	568,769.15	3.73
7	INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA-H	中国工商银行股份有限公司	1398 HK	香港联合交易所	中国香港	120,073	515,493.56	3.38
8	CHINA MOBILE LTD	中国移动有限公司	941 HK	香港联合交易所	中国香港	8,557	408,792.81	2.68
9	INFOSYS TECHN	-	INFY US	美国纽约证券交易所	美国	5,712	390,632.08	2.56

	OLOGI ES-SP ADR							
10	BAIDU INC - SPON ADR	-	BIDU US	纳斯达 克证券 交易所	美国	420	356,479 .73	2.34
11	VALE SA-SP ADR	-	VALE US	美国纽 约证券 交易所	美国	4,847	353,780 .81	2.32
12	GAZPR OM OAO- SPON ADR	俄罗斯 天然气 工业公 司	OGZD LI	英国伦 敦证券 交易所	英国	9,228	352,518 .68	2.31
13	LUKOI L OAO- SPON ADR	卢克石 油	LKOD LI	英国伦 敦证券 交易所	英国	645	339,091 .77	2.23
14	PINDU ODUO INC- ADR	-	PDD US	纳斯达 克证券 交易所	美国	552	335,452 .76	2.20
15	SBERB ANK OF RUSSI A PAO- ADR	-	SBER LI	英国伦 敦证券 交易所	英国	4,125	332,329 .43	2.18
16	NETEA SE INC- ADR	-	NTES US	纳斯达 克证券 交易所	美国	106	322,218 .35	2.11
17	BANK OF CHINA LTD-H	-	3988 HK	香港联 合交易 所	中国香 港	118,000	309,345 .59	2.03
18	TAL EDUCA TION GROUP - ADR	-	TAL US	美国纽 约证券 交易所	美国	589	285,132 .67	1.87
19	ITAU UNIBA NCO	-	ITUB US	美国纽 约证券 交易所	美国	7,407	245,933 .55	1.61

	HLDN G-PREF ADR							
20	XIAOMI CORP- CLASS B	-	1810 HK	香港联合交易所	中国香港	20,400	239,262 .82	1.57
21	CNOOC LTD	中海油	883 HK	香港联合交易所	中国香港	25,504	200,814 .74	1.32
22	YUM CHINA HOLDINGS INC	-	YUMC US	美国纽约证券交易所	美国	575	195,679 .15	1.28
23	CHINA MERCHANTS BANK	-	3968 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	195,384 .82	1.28
24	BANCO BRADESCO- ADR	-	BBD US	美国纽约证券交易所	美国	6,780	182,876 .23	1.20
25	MMC NORILSK NICKEL JSC- ADR	-	MNOD LI	英国伦敦证券交易所	英国	920	170,579 .14	1.12
26	NEW ORIENTAL EDUCATION- SP ADR	-	EDU US	美国纽约证券交易所	美国	182	167,797 .32	1.10
27	ICICI BANK LTD- SPON ADR	-	IBN US	美国纽约证券交易所	美国	2,403	158,041 .84	1.04
28	CHINA LIFE	-	2628 HK	香港联合交易所	中国香港	11,037	157,273 .54	1.03

	INSURANCE CO-H			所				
29	NOVATEK OAO-SPONS GDR REG S	-	NVTK LI	英国伦敦证券交易所	英国	154	155,032.55	1.02
30	BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	-	3328 HK	香港联合交易所	中国香港	33,035	144,238.84	0.95
31	TATNEFT-SPONSORED GDR	-	ATAD LI	英国伦敦证券交易所	英国	411	135,939.99	0.89
32	CSPC PHARMACEUTICAL	-	1093 HK	香港联合交易所	中国香港	9,600	128,378.51	0.84
33	CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	-	688 HK	香港联合交易所	中国香港	5,914	126,678.87	0.83
34	AMBEV SA-ADR	-	ABEV US	美国纽约证券交易所	美国	6,734	125,857.65	0.83
35	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	-	1288 HK	香港联合交易所	中国香港	43,521	124,031.93	0.81
36	CHINA PETROLEUM	中国石油化工股份	386 HK	香港联合交易所	中国香港	41,076	121,191.09	0.80

	&CHE MICAL -H							
37	PETRO LEO BRASI LEIRO S.A.- ADR	-	PBR US	美国纽 约证券 交易所	美国	2,048	119,905 .21	0.79
38	TRIP.C OM GROUP LTD	-	TCOM US	纳斯达 克证券 交易所	美国	625	114,687 .90	0.75
39	RELIA NCE INDS- SPONS GDR 144A	-	RIGD LI	英国伦 敦证券 交易所	英国	345	112,840 .15	0.74
40	CHINA RESOU RCES LAND LTD	-	1109 HK	香港联 合交易 所	中国香 港	4,000	107,237 .86	0.70

注：以上证券代码采用当地市场代码。

7.4.2 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前五名权益投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资的权益投资。

7.5 报告期内股票投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	TENCENT HOLDINGS LTD	700 HK	179,393.66	1.08
2	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	BABA US	170,458.97	1.02
3	CHINA	939 HK	102,084.53	0.61

	CONSTRUCTIO N BANK-H			
4	HDFC BANK LTD-ADR	HDB US	69,046.24	0.41
5	INDUSTRIAL& COMMERCIAL BK OF CHINA- H	1398 HK	61,096.66	0.37
6	JD.COM INC- ADR	JD US	52,367.66	0.31
7	INFOSYS TECHNOLOGIE S-SP ADR	INFY US	42,660.23	0.26
8	GAZPROM OAO-SPON ADR	OGZD LI	39,144.68	0.24
9	BANK OF CHINA LTD-H	3988 HK	37,520.93	0.23
10	BAIDU INC - SPON ADR	BIDU US	36,571.07	0.22
11	LUKOIL OAO- SPON ADR	LKOD LI	36,060.14	0.22
12	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	2318 HK	35,891.90	0.22
13	VALE SA-SP ADR	VALE US	35,851.96	0.22
14	SBERBANK OF RUSSIA PAO- ADR	SBER LI	35,431.88	0.21
15	NETEASE INC- ADR	NTES US	29,636.59	0.18
16	TAL EDUCATION GROUP- ADR	TAL US	27,330.11	0.16
17	CHINA MOBILE LTD	941 HK	27,147.25	0.16
18	ITAU UNIBANCO HLDNG-PREF ADR	ITUB US	26,565.39	0.16
19	PINDUODUO INC-ADR	PDD US	22,434.07	0.13
20	YUM CHINA	YUMC US	22,093.39	0.13

	HOLDINGS INC			
--	--------------	--	--	--

注：1、“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

2、本基金对以上证券代码采用当地市场代码。

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	BABA US	239,410.47	1.44
2	TENCENT HOLDINGS LTD	700 HK	217,804.02	1.31
3	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	939 HK	131,911.76	0.79
4	HDFC BANK LTD-ADR	HDB US	118,907.31	0.71
5	INDUSTRIAL&COMMERCIAL BK OF CHINA-H	1398 HK	78,510.98	0.47
6	JD.COM INC-ADR	JD US	68,023.74	0.41
7	GAZPROM OAO-SPON ADR	OGZD LI	67,985.41	0.41
8	SBERBANK OF RUSSIA PAO-ADR	SBER LI	64,363.48	0.39
9	LUKOIL OAO-SPON ADR	LKOD LI	64,013.15	0.38
10	INFOSYS TECHNOLOGIES-SP ADR	INFY US	63,094.42	0.38
11	VALE SA-SP ADR	VALE US	61,087.04	0.37
12	CHINA MOBILE LTD	941 HK	58,424.60	0.35
13	BAIDU INC - SPON ADR	BIDU US	58,004.65	0.35

14	ITAU UNIBANCO HLDNG-PREF ADR	ITUB US	56,010.85	0.34
15	BANK OF CHINA LTD-H	3988 HK	50,152.81	0.30
16	BANCO BRADESCO- ADR	BBD US	44,799.21	0.27
17	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	2318 HK	40,888.14	0.25
18	NETEASE INC- ADR	NTES US	38,270.88	0.23
19	TAL EDUCATION GROUP- ADR	TAL US	37,059.89	0.22
20	ICICI BANK LTD-SPON ADR	IBN US	33,235.92	0.20

注：1、“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

2、本基金对以上证券代码采用当地市场代码。

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

买入成本（成交）总额	1,338,926.37
卖出收入（成交）总额	2,015,022.76

注：“买入成本”、“卖出收入”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。

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.8 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。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1

报告期内基金投资的前十名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。

7.11.2

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。

7.11.3 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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	82,943.12
4	应收利息	56.80
5	应收申购款	111,424.69
6	其他应收款	212,385.00
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	406,809.61

7.11.4 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。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

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。

7.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资的股票投资。

§ 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
2,847	5,197.08	3,200.00	0.02%	14,792,879.75	99.98%

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	陈建霞	200,942.00	10.31%
2	冯金涛	107,200.00	5.50%
3	马迪	80,900.00	4.15%
4	姚晓琴	66,000.00	3.39%
5	陈致同	63,928.00	3.28%
6	陈海峰	61,500.00	3.16%
7	张启凡	46,159.00	2.37%
8	吴可春	40,400.00	2.07%
9	江天法	40,000.00	2.05%
10	邵常红	31,701.00	1.63%

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	397.73	0.0027%

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(2011年2月11日)基金份额总额	436,572,159.14
本报告期期初基金份额总额	14,657,741.22
本报告期基金总申购份额	6,583,891.25
减：报告期基金总赎回份额	6,445,552.72
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	14,796,079.75

§ 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 2020 年 5 月 7 日的公告，因本公司第五届董事会任期届满，经公司股东会审议通过，选举刘辉女士、金旭女士、杜凯先生、王小青先生、何玉慧女士、张思宁女士、邹胜先生担任公司第六届董事会董事，其中何玉慧女士、张思宁女士、邹胜先生为独立董事。第五届董事会董事邓晓力女士及独立董事吴冠雄先生、王莉女士、孙谦先生不再继续担任本公司董事职务。

根据本基金管理人 2020 年 5 月 12 日的公告，经招商基金管理有限公司第六届董事会 2020 年第一次会议审议通过，同意聘任王小青先生为公司总经理，金旭女士不再担任公司总经理职务，担任公司副董事长。

本基金本报告期内基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的重大诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
Scotia	1	1,603,603.57	47.81%	1,603.84	40.15%	-
BOCI SECURIT EIS LTD	1	1,280,613.38	38.18%	1,921.03	48.09%	-
Daiwa	1	469,732.19	14.01%	470.05	11.77%	-

注：1、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、联合调研质量以及销售服务质量打分，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。

2、此处股票交易包括股票、存托凭证交易；佣金指本基金通过单一券商进行股票、基金等交易而合计支付该券商的佣金合计。

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

本基金本报告期无租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况。

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	关于招商标普金砖四国指数证券投资基金(LOF)2020年境外主要市场节假日暂停申购(含定期定额投资)和赎回业务的公告	证券时报及基金管理人网站	2020-01-15
2	招商基金管理有限公司旗下基金2019年第4季度报告提示性公告	证券时报及基金管理人网站	2020-01-18
3	招商标普金砖四国指数证券投资基金(LOF)2019年第4季度报告	证券时报及基金管理人网站	2020-01-18

4	招商基金管理有限公司关于调整旗下基金2020年春节假期申购赎回等交易业务及清算交收安排的提示性公告	证券时报及基金管理人网站	2020-01-29
5	招商基金管理有限公司关于公司自有资金投资旗下偏股型公募基金的公告	证券时报及基金管理人网站	2020-02-05
6	关于暂停招商标普金砖四国指数证券投资基金(LOF)申购(含定期定额投资)和赎回业务的公告	证券时报及基金管理人网站	2020-02-12
7	招商标普金砖四国指数证券投资基金(LOF)托管协议(2020年2月25日修订)	证券时报及基金管理人网站	2020-02-25
8	招商标普金砖四国指数证券投资基金(LOF)基金合同(2020年2月25日修订)	证券时报及基金管理人网站	2020-02-25
9	招商基金管理有限公司关于修订旗下部分公募基金基金合同信息披露有关条款的公告	证券时报及基金管理人网站	2020-02-25
10	招商标普金砖四国指数证券投资基金(LOF)更新的招募说明书(二零二零年第一号)	证券时报及基金管理人网站	2020-02-28
11	招商标普金砖四国指数证券投资基金(LOF)更新的招募说明书摘要(二零二零年第一号)	证券时报及基金管理人网站	2020-02-28
12	招商标普金砖四国指数证券投资基金(LOF)更新的招募说明书摘要(二零二零年第二号)	证券时报及基金管理人网站	2020-03-25
13	招商标普金砖四国指数证券投资基金(LOF)更新的招募说明书(二零二零年第二号)	证券时报及基金管理人网站	2020-03-25
14	招商基金管理有限公司旗下基金2019年年度报告提示性公告	证券时报及基金管理人网站	2020-03-31
15	关于招商标普金砖四国指数证券投资基金(LOF)2020年境外主要市场节假日暂停申购(含定期定额投资)和赎回业务的公告	证券时报及基金管理人网站	2020-03-31
16	招商标普金砖四国指数证券投资基金(LOF)2019年年度报告	证券时报及基金管理人网站	2020-03-31
17	招商标普金砖四国指数证券投资基金(LOF)2020年第1季度报告	证券时报及基金管理人网站	2020-04-21
18	招商基金管理有限公司旗下基金2020年第1季度报告提示性公告	证券时报及基金管理人网站	2020-04-21
19	关于招商标普金砖四国指数证券投资基金(LOF)2020年境外主要市场节假日暂停申购(含定期定额投资)和赎回业务的公告	证券时报及基金管理人网站	2020-04-28
20	关于招商标普金砖四国指数证券投资基金(LOF)2020年境外主要市场节假日暂停申购(含定期定额投资)和赎回业务的公告	证券时报及基金管理人网站	2020-05-06
21	招商基金管理有限公司关于公司董事变更的公告	证券时报及基金管理人网站	2020-05-07
22	招商基金管理有限公司关于提醒网上直销个人投资者及时上传身份证件影印件并完善、更新身份信息以免影响日常交易的公告	证券时报及基金管理人网站	2020-05-09

23	招商基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证券时报及基金管理人网站	2020-05-12
24	关于招商标普金砖四国指数证券投资基金(LOF) 2020 年境外主要市场节假日暂停申购(含定期定额投资)和赎回业务的公告	证券时报及基金管理人网站	2020-05-21
25	关于招商标普金砖四国指数证券投资基金(LOF) 2020 年境外主要市场节假日暂停申购(含定期定额投资)和赎回业务的公告	证券时报及基金管理人网站	2020-06-19

§ 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标普金砖四国指数证券投资基金(LOF)设立的文件；
- 3、《招商标普金砖四国指数证券投资基金(LOF)基金合同》；
- 4、《招商标普金砖四国指数证券投资基金(LOF)托管协议》；
- 5、《招商标普金砖四国指数证券投资基金(LOF)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：中国深圳深南大道 7088 号招商银行大厦

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

2020 年 8 月 28 日