招商央视财经50指数证券投资基金
2021年年度报告

2021年12月31日

基金管理人：招商基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2022年3月30日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

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

本报告期自2021年1月1日起至12月31日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....1
1.1 重要提示.....1
1.2 目录.....2
§2 基金简介.....4
2.1 基金基本情况.....4
2.2 基金产品说明.....4
2.3 基金管理人和基金托管人.....4
2.4 信息披露方式.....5
2.5 其他相关资料.....5
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....5
3.1 主要会计数据和财务指标.....5
3.2 基金净值表现.....6
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....9
§4 管理人报告.....9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....10
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.....11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....14
4.9 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....14
§5 托管人报告.....14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....14
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14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....14
§6 审计报告.....15
6.1 审计报告的基本内容.....15
§7 年度财务报表.....17
7.1 资产负债表.....17
7.2 利润表.....18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....19
7.4 报表附注.....20
§8 投资组合报告.....51
8.1 期末基金资产组合情况.....51
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....51
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....53
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....57
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....59
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....59
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....59

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....59
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....59
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....60
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....60
8.12 投资组合报告附注.....60
§9 基金份额持有人信息.....62
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....62
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....62
9.3 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.....63
§10 开放式基金份额变动.....63
§11 重大事件揭示.....63
11.1 基金份额持有人大会决议.....63
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....63
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....64
11.4 基金投资策略的改变.....64
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....64
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....64
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....64
11.8 其他重大事件.....68
§12 备查文件目录.....70
12.1 备查文件目录.....70
12.2 存放地点.....70
12.3 查阅方式.....70

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	招商央视财经50指数证券投资基金	
基金简称	招商央视财经50指数	
基金主代码	217027	
交易代码	217027	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年2月5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	205,562,735.87份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	招商央视财经50指数A	招商央视财经50指数C
下属分级基金的交易代码	217027	004410
报告期末下属分级基金的份额总额	197,454,918.77份	8,107,817.10份

注：本基金从2017年2月23日起新增C类份额，C类份额自2017年8月18日起存续。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，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。本基金的投资目标是保持基金净值收益率与业绩基准日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%。
投资策略	本基金以央视财经50指数为标的指数，采用完全复制法，按照标的指数成份券组成及其权重构建基金股票投资组合，进行被动式指数化投资。股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份券组成及其权重来拟合复制标的指数，并根据标的指数成份券及其权重的变动而进行相应调整，以复制和跟踪标的指数。本基金的投资目标是保持基金净值收益率与业绩基准日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%。在控制风险的前提下，本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。
业绩比较基准	央视财经50指数收益率*95%+金融机构人民币活期存款基准利率(税后)*5%
风险收益特征	本基金属于股票型指数基金，在证券投资基金中属于较高风险、较高收益的品种，本基金主要采用指数复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

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	许俊
	联系电话	0755－83196666	010-66596688
	电子邮箱	cmf@cmfchina.com	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		王小青	刘连舸

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.cmfchina.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	中国北京市东长安街1号东方广场毕马威大楼8楼
注册登记机构	招商央视财经50指数A：招商基金管理有限公司 招商央视财经50指数C：中国证券登记结算有限责任公司	深圳市福田区深南大道7088号 北京市西城区太平桥大街17号

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

单位：人民币元

1、招商央视财经50指数A

3.1.1 期间数据和指标	2021年	2020年	2019年
本期已实现收益	68,958,522.02	96,845,977.76	24,659,280.30
本期利润	-12,222,971.69	175,052,958.61	163,854,360.51
加权平均基金份额本期利润	-0.0623	0.7709	0.7459
本期加权平均净值利润率	-2.05%	30.36%	36.86%
本期基金份额净值增长率	-2.53%	34.94%	44.47%
3.1.2 期末数据和指标	2021年末	2020年末	2019年末

期末可供分配利润	402,916,023.62	363,376,155.39	323,343,334.86
期末可供分配基金份额利润	2.0405	1.7826	1.3117
期末基金资产净值	600,370,942.39	635,860,490.19	569,852,986.03
期末基金份额净值	3.0405	3.1193	2.3117
3.1.3 累计期末指标	2021年末	2020年末	2019年末
基金份额累计净值增长率	204.05%	211.93%	131.17%

2、招商央视财经50指数C

3.1.1 期间数据和指标	2021年	2020年	2019年
本期已实现收益	3,761,784.76	2,495,970.35	411,707.74
本期利润	-18,991.52	6,742,922.35	4,889,774.47
加权平均基金份额本期利润	-0.0019	0.9072	1.0502
本期加权平均净值利润率	-0.06%	34.56%	52.53%
本期基金份额净值增长率	-2.92%	34.38%	43.89%
3.1.2 期末数据和指标	2021年末	2020年末	2019年末
期末可供分配利润	14,087,373.25	24,262,269.84	5,492,256.44
期末可供分配基金份额利润	1.7375	1.4026	0.9790
期末基金资产净值	24,209,853.77	53,206,226.83	12,840,622.05
期末基金份额净值	2.9860	3.0759	2.2889
3.1.3 累计期末指标	2021年末	2020年末	2019年末
基金份额累计净值增长率	65.52%	70.50%	26.88%

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；

4、本基金从2017年2月23日起新增C类份额，C类份额自2017年8月18日起存续。

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

招商央视财经50指数A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	5.72%	0.81%	5.43%	0.80%	0.29%	0.01%
过去六个月	-3.30%	1.04%	-5.44%	1.02%	2.14%	0.02%
过去一年	-2.53%	1.08%	-8.12%	1.07%	5.59%	0.01%
过去三年	90.02%	1.19%	51.76%	1.19%	38.26%	0.00%
过去五年	108.97%	1.18%	63.27%	1.17%	45.70%	0.01%

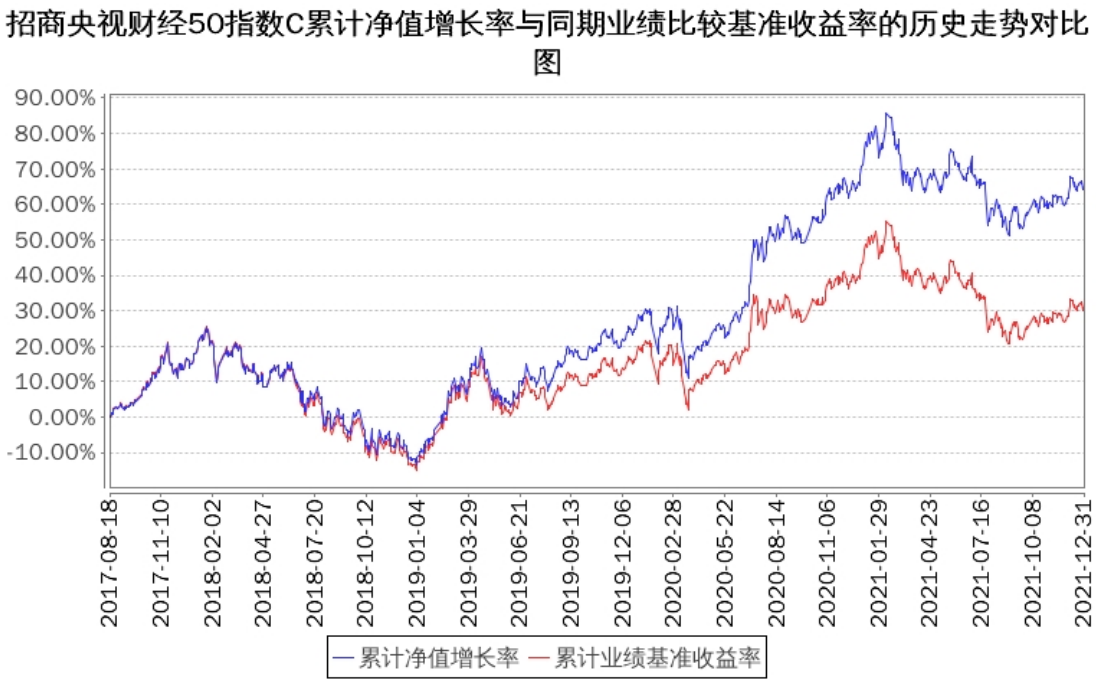
自基金合同生效起至今	204.05%	1.38%	122.15%	1.35%	81.90%	0.03%

招商央视财经 50 指数 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	5.61%	0.81%	5.43%	0.80%	0.18%	0.01%
过去六个月	-3.50%	1.04%	-5.44%	1.02%	1.94%	0.02%
过去一年	-2.92%	1.08%	-8.12%	1.07%	5.20%	0.01%
过去三年	87.72%	1.19%	51.76%	1.19%	35.96%	0.00%
自基金合同生效起至今	65.52%	1.23%	31.49%	1.22%	34.03%	0.01%

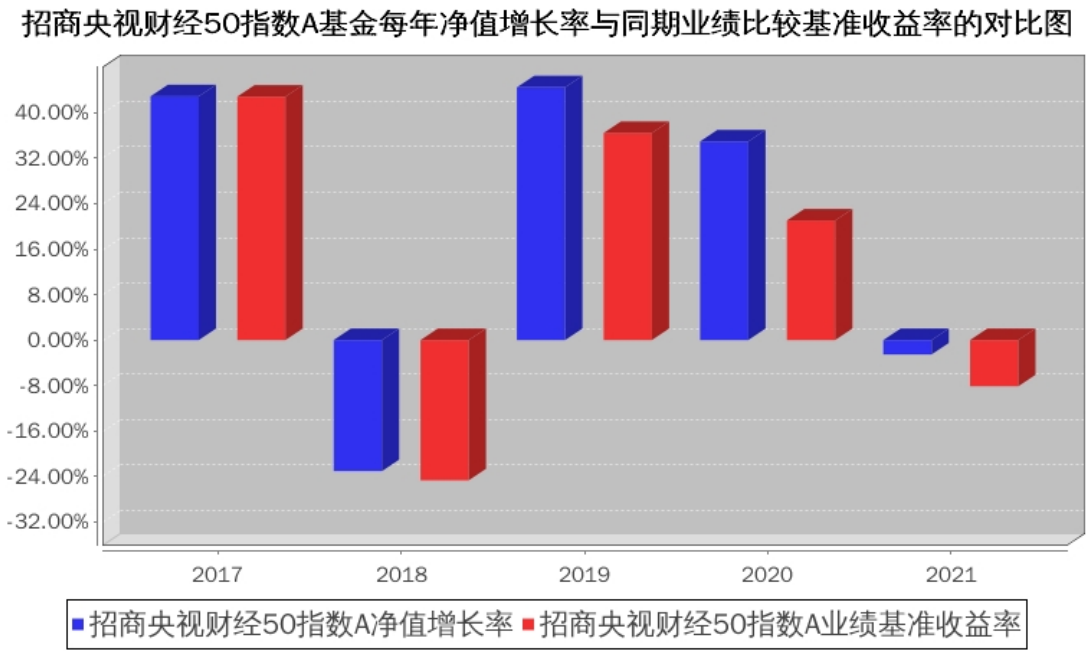
3.2.2 自基金合同生效/自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

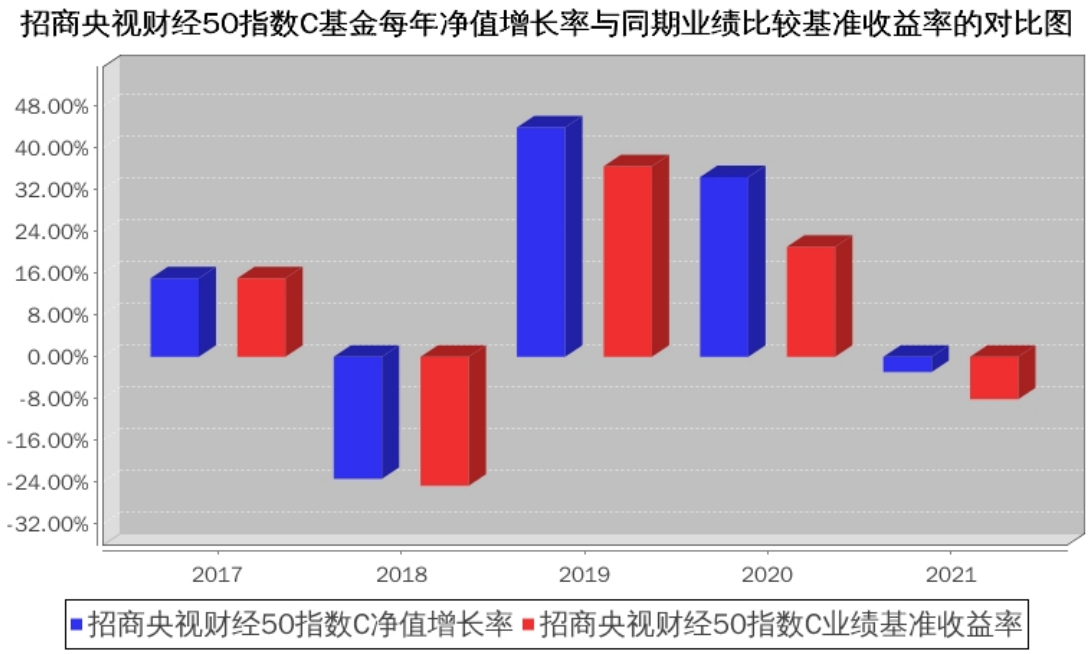
招商央视财经50指数A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金从 2017 年 2 月 23 日起新增 C 类份额，C 类份额自 2017 年 8 月 18 日起存续。

3.2.3 过去五年以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较





注：本基金从 2017 年 2 月 23 日起新增 C 类份额，C 类份额自 2017 年 8 月 18 日起存续，故存续起始当年净值增长率按当年实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

招商基金管理有限公司首批获得企业年金基金投资管理人资格、基本养老保险基金投资管理资格；2004 年获得全国社保基金投资管理人资格；同时拥有 QDII(合格境内机构投资者)资格、专户理财（特定客户资产管理业务）资格、公募基金投顾业务资格，在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、海外投资、FOF 投资等领域全面布局。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限	证券从业	说明

		任职日期	离任日期	年限	
侯昊	本基金基金经理	2017年9月5日	-	12	男，硕士。2009年7月加入招商基金管理有限公司，曾任风险管理部风控经理，量化投资部助理投资经理、投资经理，现任量化投资部副总监兼招商中证白酒指数证券投资基金、招商国证生物医药指数证券投资基金、招商深证100指数证券投资基金、招商央视财经50指数证券投资基金、招商中证大宗商品股票指数证券投资基金（LOF）、招商中证煤炭等权指数证券投资基金、招商中证银行指数证券投资基金、招商中证消费龙头指数增强型证券投资基金、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基金经理。

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》（2011年修订）的规定，制定了《招商基金管理有限公司公平交易管理办法》，对投资决策的内部控制、交易执行的内部控制、公平交易实施情况的监控与检查稽核、异常交易的监控等进行了规定。为保证各投资组合在投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会，基金管理人合理设置了各类资产管理业务之间以及各类资产管理业务内部的组织结构，建立了科学的投资决策体系，

加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，本基金各项交易均严格按照相关法律法规、基金合同的有关要求执行，公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情形共发生过七次，原因是指数量化投资组合为满足投资策略需要而发生反向交易。报告期内未发现有可能导致不公平交易和利益输送的重大异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内央视50由于受到外部环境影响代表着大盘质量的央视50指数表现不佳；经过去年估值消化的过程现阶段央视50估值比较合理，去年分红高、估值低的股票相对表现更好，展望未来，代表着有质量的大盘蓝筹公司是具备配置价值的，随着外部环境边际变好，盈利的提升会带来央视50中股票更好的投资机会；关于本基金的运作，股票仓位维持在94.5%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A类份额净值增长率为-2.53%，同期业绩基准增长率为-8.12%，C类份额净值增长率为-2.92%，同期业绩基准增长率为-8.12%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2021年制造业PMI数值在3月份见顶后呈现持续回落态势，11月份有所回升。总体经济走弱的同时，经济结构不均衡的问题依然突出，出口一枝独秀，制造业投资改善但幅度有限，基建投资、消费持续弱势，地产投资面临考验。从投向实体经济的流动性角度看，代表性指标社融存量增速得益于央行在二季度末、三季度初的积极鼓励政策和财政地方债发力后置等因素自10月开始企稳回升。价格方面，CPI同比呈现温和上扬趋势，PPI同比因为供给侧受限而在10月达到13.5%的超高水平、之后受政策保供稳价影响开始逐步回落。当前来看，2022年经济下行压力依旧存在，后续需观察稳增长政策的进一步落地。此外考虑到目前经济仍处于回落周期中，PPI对CPI的传导相对滞后，预计PPI后续开始回落，CPI将继续上升。

2021年中盘凭借优异的盈利优势，全年跑赢大盘风格。2021年前三季度累计沪深300、中证500、中证1000指数的归母净利润增长率分别为22.00%、42.83%和30.14%，中证500盈利增速优势明显，三季度沪深300、中证500与中证1000归母净利润增速分别为-3.62%、23.69%和3.31%，尽管增速较Q2有明显回落，但中证500优势依旧明显。展望2022年，全年来看大盘风格或将更为占优：一方面，2022年经济下行压力加大的环境下市场将进一步追求盈利稳定性，而2022年大盘盈利预期较为稳定，但小盘盈利预期较2021年大幅下行优势不再；另一方面，经历了2021年的持续上行后，中小盘估值性价比已有所下降，而大盘在经历持续震荡后估值性价比逐渐提升，且筹码结构已恢复相对合理。

伴随疫情防控体系进一步完善，消费行业有望受益于疫情冲击的边际减弱以及国内稳增长政策的实施，带来估值及业绩修复。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

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

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

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

基金经理代表向估值委员会提供估值参考信息，参与估值政策讨论；对需采用特别估值程序的证券，基金及时启动特别估值程序，由公司估值委员会集体讨论议定特别估值方案，咨询会计事务所的专业意见，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，本基金报告期未进行利润分配。在符合分红条件的前提下，本基金已实现尚未分配的可供分配收益部分，将严格按照基金合同的约定适时向投资者予以分配。

4.9 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在招商央视财经 50 指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§6 审计报告

6.1 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	招商央视财经 50 指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了后附的招商央视财经 50 指数证券投资基金(以下简称“招商央视财经 50 指数基金”)财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表、2021 年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、在财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了招商央视财经 50 指数基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则(以下简称“审计准则”)的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于招商央视财经 50 指数基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	招商央视财经 50 指数基金管理人招商基金管理有限公司管理层对其他信息负责。其他信息包括招商央视财经 50 指数基金 2021 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项

	需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	招商央视财经50指数基金管理人招商基金管理有限公司管理层负责按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则及财务报表附注7.4.2中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，招商央视财经50指数基金管理人招商基金管理有限公司管理层负责评估招商央视财经50指数基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非招商央视财经50指数基金计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。 招商央视财经50指数基金管理人招商基金管理有限公司治理层负责监督招商央视财经50指数基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： (1)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 (2)了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 (3)评价招商央视财经50指数基金管理人招商基金管理有限公司管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 (4)对招商央视财经50指数基金管理人招商基金管理有限公司管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对招商央视财经50指数基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们

	应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致招商央视财经50指数基金不能持续经营。 (5)评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与招商央视财经50指数基金管理人招商基金管理有限公司治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	吴钟鸣	吴巧莉
会计师事务所的地址	中国北京市东长安街1号东方广场毕马威大楼8楼	
审计报告日期	2022年3月29日	

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：招商央视财经50指数证券投资基金

报告截止日：2021年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末2021年12月31日	上年度末2020年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	1,527,381.93	32,550,866.40
结算备付金		75,002.16	366,633.00
存出保证金		23,823.63	65,239.17
交易性金融资产	7.4.7.2	626,047,314.29	658,130,811.65
其中：股票投资		590,436,912.88	652,138,611.65
基金投资		-	-
债券投资		35,610,401.41	5,992,200.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		571,994.56	240,689.96
应收利息	7.4.7.5	693,068.76	62,899.24
应收股利		-	-
应收申购款		755,502.23	1,969,529.53
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		629,694,087.56	693,386,668.95

负债和所有者权益	附注号	本期末2021年12月31日	上年度末2020年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		3,300,000.00	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		883,345.65	3,372,059.89
应付管理人报酬		398,140.03	421,542.13
应付托管费		79,628.00	84,308.43
应付销售服务费		8,144.36	16,695.35
应付交易费用	7.4.7.7	31,185.03	82,509.81
应交税费		0.35	-
应付利息		-1,265.75	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	414,113.73	342,836.32
负债合计		5,113,291.40	4,319,951.93
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	205,562,735.87	221,142,760.10
未分配利润	7.4.7.10	419,018,060.29	467,923,956.92
所有者权益合计		624,580,796.16	689,066,717.02
负债和所有者权益总计		629,694,087.56	693,386,668.95

注：报告截止日2021年12月31日，招商央视财经50指数A份额净值3.0405元，基金份额总额197,454,918.77份；招商央视财经50指数C份额净值2.9860元，基金份额总额8,107,817.10份；总份额合计205,562,735.87份。

7.2 利润表

会计主体：招商央视财经50指数证券投资基金

本报告期：2021年1月1日至2021年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间2020年1月1日至2020年12月31日
一、收入		-5,318,928.15	188,812,576.67
1.利息收入		551,813.14	231,281.08
其中：存款利息收入	7.4.7.11	54,088.55	154,844.69
债券利息收入		497,724.59	76,436.39
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）		78,457,314.80	104,821,780.65
其中：股票投资收益	7.4.7.12	64,305,226.75	90,862,738.49
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-336.50	16,459.63
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	14,152,424.55	13,942,582.53
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-84,962,269.99	82,453,932.85
4.汇兑收益（损失以“－”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	634,213.90	1,305,582.09
减：二、费用		6,923,035.06	7,016,695.71
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	4,714,983.28	4,462,530.52
2.托管费	7.4.10.2.2	942,996.66	892,506.12
3.销售服务费	7.4.10.2.3	122,397.09	76,361.16
4.交易费用	7.4.7.19	615,679.52	1,076,123.38
5.利息支出		3,330.73	-
其中：卖出回购金融资产支出		3,330.73	-
6.税金及附加		0.81	0.16
7.其他费用	7.4.7.20	523,646.97	509,174.37
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-12,241,963.21	181,795,880.96
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-12,241,963.21	181,795,880.96

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：招商央视财经50指数证券投资基金

本报告期：2021年1月1日至2021年12月31日

单位：人民币元

项目	本期2021年1月1日至2021年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计

一、期初所有者权益（基金净值）	221,142,760.10	467,923,956.92	689,066,717.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-12,241,963.21	-12,241,963.21
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）	-15,580,024.23	-36,663,933.42	-52,243,957.65
其中：1.基金申购款	159,217,874.14	328,533,792.33	487,751,666.47
2.基金赎回款	-174,797,898.37	-365,197,725.75	-539,995,624.12
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）	205,562,735.87	419,018,060.29	624,580,796.16
项目	上年度可比期间2020年1月1日至2020年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	252,119,605.68	330,574,002.40	582,693,608.08
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	181,795,880.96	181,795,880.96
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）	-30,976,845.58	-44,445,926.44	-75,422,772.02
其中：1.基金申购款	354,220,740.73	526,481,090.22	880,701,830.95
2.基金赎回款	-385,197,586.31	-570,927,016.66	-956,124,602.97
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）	221,142,760.10	467,923,956.92	689,066,717.02

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

____王小青___　　____欧志明_____　　____何剑萍____

基金管理人负责人　　主管会计工作负责人　　会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

招商央视财经50指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于核准招商央视财经50指数证券投资基金募集的批复》(证监许可[2012]1309号文)批准，由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》及其配套规则和《招商央视财经50指数证券投资基金基金合同》发售，基金合同于2013年2月5日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集规模为1,319,259,082.36份基金份额。本基金的基金管理人为招商基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”)。

本基金于2013年1月10日至2013年1月31日募集，募集期间净认购资金人民币1,319,070,820.91元，认购资金在募集期间产生的利息人民币188,261.45元，募集的有效认购份额及利息结转的基金份额合计1,319,259,082.36份。上述募集资金已由毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)验证，并出具了毕马威华振验字第1300008号验资报告。

根据中国证监会2017年8月31日发布的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《流动性风险管理规定》”)，对已经存续的开放式证券投资基金且基金合同内容不符合《流动性风险管理规定》要求的，应当在《流动性风险管理规定》施行之日起6个月内予以调整。根据《流动性风险管理规定》等法律法规，经与基金托管人协商一致，招商基金管理有限公司对本基金合同相关条款进行修订，修订后的合同的全部条款已于2018年3月31日起正式实施。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《招商央视财经50指数证券投资基金基金合同》和截至报告期末最新公告的《招商央视财经50指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括央视财经50指数的成份股、备选成份股、新股(含首次公开发行和增发)、存托凭证、债券、债券回购、权证、股指期货、资产支持证券、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许本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)。本基金投资于股票、存托凭证的资产比例为基金资产的85%-95%，投资于央视财经50指数成份股和备选成份股的资产不低于股票、存托凭证资产的90%；现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资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。如法律法规或中国证监会以后允许基金投资其他金融工具，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金股票资产的标的指数为央视财经50指数。本基金业绩比较基准：央视财经50指数收益率×95％＋金融机构人民币活期存款基准利率(税后)×5%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础编制财务报表。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基

金信息披露XBRL模板第3号<年度和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金2021年12月31日的财务状况以及自2021年1月1日至2021年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的，把金融资产和金融负债分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。本基金现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

本基金目前持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

初始确认后，金融资产和金融负债的后续计量如下：

-以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。

-应收款项以实际利率法按摊余成本计量。

-除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债采用实际利率法按摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

-收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

-该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；

-该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

-所转移金融资产的账面价值

-因转移而收到的对价

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据《企业会计准则》的规定采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

-本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；

-本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。

债券投资收益/(损失)于卖出债券成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税(如适用)后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息收入。

利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本基金的交易费用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本基金的其他费用如无需在受益期内预提或分摊，则于发生时直接计入基金损益；如需采用预提或待摊的方法，预提或待摊时计入基金损益。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

基金可供分配利润为正的情况下，方可进行利益分配。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益分配采用现金分红或红利再投资方式，基金份额持有人可选择现金分红或将现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资，基金份额持有人事先未做出选择的，本基金默认的收益分配方式为现金分红。在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 20%。若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

7.4.4.12 外币交易

本基金本报告期内无外币交易。

7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证券监督管理委员会关于证

券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据中基协发[2017]6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）>的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》（以下简称“估值处理标准”），在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《财政部、国家税务总局、证监会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》、财税[2015]101号《财政部、国家税务总局、证监会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》、《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》（财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号）、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》、上证交字[2008]16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《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[2008]1号文《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》、财税[2016]36号文《财政部、国家税务总局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]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《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号文《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》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a)对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(b)自2016年5月1日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税(以下称营改增)试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

2018年1月1日(含)以后，资管产品管理人(以下称管理人)运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以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。对资管产品在2018年1月1日以前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(c)基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d)对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入个人所得税应纳税所得额。对基金从全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息、红利所得，由挂牌公司代扣代缴20%的个人所得税。对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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，其股息红利所得暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。

(e)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(f)对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(g)对基金在2018年1月1日(含)以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末2021年12月31日	上年度末2020年12月31日
活期存款	1,527,381.93	32,550,866.40
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	1,527,381.93	32,550,866.40

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末2021年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		538,892,847.68	590,436,912.88	51,544,065.20
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	35,443,582.61	35,610,401.41	166,818.80
	银行间市场	-	-	-
	合计	35,443,582.61	35,610,401.41	166,818.80
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		574,336,430.29	626,047,314.29	51,710,884.00
项目		上年度末2020年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		515,479,257.66	652,138,611.65	136,659,353.99
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	5,978,400.00	5,992,200.00	13,800.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	5,978,400.00	5,992,200.00	13,800.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		521,457,657.66	658,130,811.65	136,673,153.99

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融工具。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末无各项买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末2021年12月31日	上年度末2020年12月31日
应收活期存款利息	318.93	2,976.17
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	33.70	165.00
应收债券利息	692,705.43	59,728.77
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	10.70	29.30
合计	693,068.76	62,899.24

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末2021年12月31日	上年度末2020年12月31日
交易所市场应付交易费用	31,185.03	82,509.81
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	31,185.03	82,509.81

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末2021年12月31日	上年度末2020年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	2,203.29	10,375.86
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	180,000.00	180,000.00
应付指数使用费	231,910.44	152,460.46
合计	414,113.73	342,836.32

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

招商央视财经 50 指数 A		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	203,845,022.44	203,845,022.44
本期申购	144,612,854.52	144,612,854.52
本期赎回（以“-”号填列）	-151,002,958.19	-151,002,958.19
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	197,454,918.77	197,454,918.77

招商央视财经 50 指数 C		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	17,297,737.66	17,297,737.66
本期申购	14,605,019.62	14,605,019.62
本期赎回（以“-”号填列）	-23,794,940.18	-23,794,940.18
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	8,107,817.10	8,107,817.10

注：本期申购含红利再投、转换入份（金）额，本期赎回含转换出份（金）额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

招商央视财经 50 指数 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	363,376,155.39	68,639,312.36	432,015,467.75
本期利润	68,958,522.02	-81,181,493.71	-12,222,971.69
本期基金份额交易产生的变动数	-10,740,209.46	-6,136,262.98	-16,876,472.44
其中：基金申购款	287,616,680.87	11,192,416.62	298,809,097.49
基金赎回款	-298,356,890.33	-17,328,679.60	-315,685,569.93
本期已分配利润	-	-	-
本期末	421,594,467.95	-18,678,444.33	402,916,023.62

招商央视财经 50 指数 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	24,262,269.84	11,646,219.33	35,908,489.17
本期利润	3,761,784.76	-3,780,776.28	-18,991.52
本期基金份额交易产生的变动数	-13,936,681.35	-5,850,779.63	-19,787,460.98
其中：基金申购款	23,204,581.62	6,520,113.22	29,724,694.84
基金赎回款	-37,141,262.97	-12,370,892.85	-49,512,155.82

本期已分配利润	-	-	-
本期末	14,087,373.25	2,014,663.42	16,102,036.67

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间2020年1月1日至2020年12月31日
活期存款利息收入	50,878.00	150,565.35
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	2,482.40	3,187.41
其他	728.15	1,091.93
合计	54,088.55	154,844.69

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间2020年1月1日至2020年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	64,305,226.75	90,862,738.49
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	64,305,226.75	90,862,738.49

7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间2020年1月1日至2020年12月31日
卖出股票成交总额	206,605,160.02	345,536,309.07
减：卖出股票成本总额	142,299,933.27	254,673,570.58
买卖股票差价收入	64,305,226.75	90,862,738.49

7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无股票赎回差价收入。

7.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无股票申购差价收入。

7.4.7.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无证券出借差价收入。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间2020年1月1日至2020年12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-336.50	16,459.63
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	-336.50	16,459.63

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间2020年1月1日至2020年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	38,153,419.51	10,053,244.04
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	37,219,401.48	9,780,097.12
减：应收利息总额	934,354.53	256,687.29
买卖债券差价收入	-336.50	16,459.63

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无债券赎回差价收入。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无债券申购差价收入。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无买卖贵金属差价收入。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属赎回差价收入。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属申购差价收入。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具买卖权证差价收入。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具其他投资收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间2020年1月1日至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	14,152,424.55	13,942,582.53
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	14,152,424.55	13,942,582.53

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间2020年1月1日至2020年12月31日
1.交易性金融资产	-84,962,269.99	82,453,932.85
——股票投资	-85,115,288.79	82,445,142.85
——债券投资	153,018.80	8,790.00
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-84,962,269.99	82,453,932.85

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间2020年1月1日至2020年12月31日
基金赎回费收入	634,213.90	1,305,582.09
合计	634,213.90	1,305,582.09

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间2020年1月1日至2020年12月31日
交易所市场交易费用	615,679.52	1,076,123.38
银行间市场交易费用	-	-
合计	615,679.52	1,076,123.38

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间2020年1月1日至2020年12月31日
审计费用	60,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	11,314.89	13,672.25
指数使用费	314,332.08	297,502.12
其他	18,000.00	18,000.00
合计	523,646.97	509,174.37

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报告批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
招商基金管理有限公司	基金管理人
中国银行股份有限公司	基金托管人
招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)	基金管理人的股东
招商证券股份有限公司(以下简称“招商证券”)	基金管理人的股东
招商财富资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司
招商资产管理（香港）有限公司	基金管理人的全资子公司

注：1、本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

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

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间2020年1月1日至2020年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
招商证券	11,638,483.73	3.33%	88,403,598.74	15.16%

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间2020年1月1日至2020年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
招商证券	3,388,305.00	5.23%	106,379.00	1.70%

7.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期2021年1月1日至2021年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
招商证券	10,838.62	3.50%	-	-
关联方名称	上年度可比期间2020年1月1日至2020年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
招商证券	82,333.98	15.21%	9,792.76	11.87%

注：1、本基金与关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立；

2、基金对该类交易的佣金的计算方式是按合同约定的佣金率计算。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供研究成果和市场信息等证券综合服务，并不收取额外对价。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间2020年1月1日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	4,714,983.28	4,462,530.52
其中：支付销售机构的客户维护费	1,865,230.55	1,780,091.01
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×0.75%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×0.75%÷当年天数

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间2020年1月1日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	942,996.66	892,506.12

注：支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值×0.15%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×0.15%÷当年天数

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期2021年1月1日至2021年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	招商央视财经50指数A	招商央视财经50指数C	合计
招商基金管理有限公司	-	13,985.67	13,985.67
招商银行	-	47,150.90	47,150.90
合计	-	61,136.57	61,136.57
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间2020年1月1日至2020年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	招商央视财经50指数A	招商央视财经50指数C	合计
招商基金管理有限公司	-	11,148.95	11,148.95
招商银行	-	33,742.48	33,742.48
合计	-	44,891.43	44,891.43

注：本基金的C类基金份额的年销售服务费率为0.40%，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

C类份额日销售服务费=前一日C类基金资产净值×0.40%÷当年天数

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间2020年1月1日至2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行-活期	1,527,381.93	50,878.00	32,550,866.40	150,565.35

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行股份有限公司保管，按银行约定利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2021年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001234	泰慕士	2021年12月31日	2022年1月11日	新股流通受限	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
300774	倍杰特	2021年7月26日	2022年2月7日	新股流通受限	4.57	21.08	444	2,029.08	9,359.52	-
300814	中富电路	2021年8月4日	2022年2月14日	新股流通受限	8.40	23.88	328	2,755.20	7,832.64	-
300854	中兰环保	2021年9月8日	2022年3月16日	新股流通受限	9.96	27.29	203	2,021.88	5,539.87	-
301018	申菱环境	2021年6月28日	2022年1月7日	新股流通受限	8.29	26.06	782	6,482.78	20,378.92	-
301020	密封科技	2021年6月28日	2022年1月6日	新股流通受限	10.64	30.44	421	4,479.44	12,815.24	-
301021	英诺激光	2021年6月28日	2022年1月6日	新股流通受限	9.46	41.43	290	2,743.40	12,014.70	-
301025	读客文化	2021年7月6日	2022年1月19日	新股流通受限	1.55	20.88	403	624.65	8,414.64	-
301026	浩通科技	2021年7月8日	2022年1月17日	新股流通受限	18.03	62.73	203	3,660.09	12,734.19	-
301027	华蓝集团	2021年7月8日	2022年1月17日	新股流通受限	11.45	16.65	286	3,274.70	4,761.90	-
301028	东亚机械	2021年7月12日	2022年1月20日	新股流通受限	5.31	13.50	733	3,892.23	9,895.50	-
301029	怡合达	2021年7月	2022年1月	新股流通	14.14	89.87	462	6,532.68	41,519.94	-

		14日	24日	受限						
301030	仕净科技	2021年7月15日	2022年1月24日	新股流通受限	6.10	31.52	242	1,476.20	7,627.84	-
301032	新柴股份	2021年7月15日	2022年1月24日	新股流通受限	4.97	12.51	513	2,549.61	6,417.63	-
301033	迈普医学	2021年7月15日	2022年1月26日	新股流通受限	15.14	59.97	108	1,635.12	6,476.76	-
301035	润丰股份	2021年7月21日	2022年1月28日	新股流通受限	22.04	56.28	644	14,193.76	36,244.32	-
301036	双乐股份	2021年7月21日	2022年2月7日	新股流通受限	23.38	29.93	205	4,792.90	6,135.65	-
301037	保立佳	2021年7月21日	2022年2月7日	新股流通受限	14.82	24.26	193	2,860.26	4,682.18	-
301038	深水规院	2021年7月22日	2022年2月7日	新股流通受限	6.68	20.23	266	1,776.88	5,381.18	-
301040	中环海陆	2021年7月26日	2022年2月7日	新股流通受限	13.57	38.51	241	3,270.37	9,280.91	-
301041	金百泽	2021年8月2日	2022年2月11日	新股流通受限	7.31	28.21	215	1,571.65	6,065.15	-
301045	天禄科技	2021年8月6日	2022年2月14日	新股流通受限	15.81	28.37	335	5,296.35	9,503.95	-
301046	能辉科技	2021年8月10日	2022年2月17日	新股流通受限	8.34	48.99	290	2,418.60	14,207.10	-
301048	金鹰重工	2021年8月11日	2022年2月18日	新股流通受限	4.13	12.96	843	3,481.59	10,925.28	-
301049	超越科技	2021年8月17日	2022年2月24日	新股流通受限	19.34	32.92	196	3,790.64	6,452.32	-
301050	雷电微力	2021年8月17日	2022年2月24日	新股流通受限	60.64	234.74	233	14,129.12	54,694.42	-
301052	果麦文化	2021	2022	新股	8.11	33.64	252	2,043.72	8,477.28	-

		年8月23日	年3月1日	流通受限						
301053	远信工业	2021年8月25日	2022年3月1日	新股流通受限	11.87	28.78	155	1,839.85	4,460.90	-
301055	张小泉	2021年8月26日	2022年3月7日	新股流通受限	6.90	21.78	355	2,449.50	7,731.90	-
301056	森赫股份	2021年8月27日	2022年3月7日	新股流通受限	3.93	11.09	572	2,247.96	6,343.48	-
301057	汇隆新材	2021年8月31日	2022年3月9日	新股流通受限	8.03	19.02	218	1,750.54	4,146.36	-
301058	中粮工科	2021年9月1日	2022年3月9日	新股流通受限	3.55	18.24	1,386	4,920.30	25,280.64	-
301059	金三江	2021年9月3日	2022年3月14日	新股流通受限	8.09	19.30	259	2,095.31	4,998.70	-
301062	上海艾录	2021年9月7日	2022年3月14日	新股流通受限	3.31	17.01	523	1,731.13	8,896.23	-
301063	海锅股份	2021年9月9日	2022年3月24日	新股流通受限	17.40	36.11	153	2,662.20	5,524.83	-
301066	万事利	2021年9月13日	2022年3月22日	新股流通受限	5.24	22.84	344	1,802.56	7,856.96	-
301068	大地海洋	2021年9月16日	2022年3月28日	新股流通受限	13.98	28.38	144	2,013.12	4,086.72	-
301069	凯盛新材	2021年9月16日	2022年3月28日	新股流通受限	5.17	44.21	539	2,786.63	23,829.19	-
301072	中捷精工	2021年9月22日	2022年3月29日	新股流通受限	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	-
301073	君亭酒店	2021年9月22日	2022年3月30日	新股流通受限	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	-
301079	邵阳液压	2021年10月11	2022年4月19日	新股流通受限	11.92	24.82	140	1,668.80	3,474.80	-

		日								
301081	严牌股份	2021年10月13日	2022年4月20日	新股流通受限	12.95	17.44	380	4,921.00	6,627.20	-
301087	可孚医疗	2021年10月15日	2022年4月25日	新股流通受限	93.09	75.34	366	34,070.94	27,574.44	-
301088	戎美股份	2021年10月19日	2022年4月28日	新股流通受限	33.16	24.67	649	21,520.84	16,010.83	-
301089	拓新药业	2021年10月20日	2022年4月27日	新股流通受限	19.11	67.93	220	4,204.20	14,944.60	-
301090	华润材料	2021年10月19日	2022年4月26日	新股流通受限	10.45	11.22	2,323	24,275.35	26,064.06	-
301092	争光股份	2021年10月21日	2022年5月5日	新股流通受限	36.31	35.52	323	11,728.13	11,472.96	-
301093	华兰股份	2021年10月21日	2022年5月5日	新股流通受限	58.08	49.85	372	21,605.76	18,544.20	-
301099	雅创电子	2021年11月10日	2022年5月23日	新股流通受限	21.99	71.36	310	6,816.90	22,121.60	-
301101	明月镜片	2021年12月9日	2022年6月16日	新股流通受限	26.91	43.36	371	9,983.61	16,086.56	-
301108	洁雅股份	2021年11月25日	2022年6月6日	新股流通受限	57.27	53.71	266	15,233.82	14,286.86	-
301111	粤万年青	2021年11月30日	2022年6月7日	新股流通受限	10.48	36.68	379	3,971.92	13,901.72	-

301126	达嘉维康	2021年11月30日	2022年6月7日	新股流通受限	12.37	19.23	662	8,188.94	12,730.26	-
301133	金钟股份	2021年11月19日	2022年5月26日	新股流通受限	14.33	26.95	286	4,098.38	7,707.70	-
301136	招标股份	2021年12月31日	2022年1月11日	新股流通受限	10.52	10.52	7,172	75,449.44	75,449.44	-
301138	华研精机	2021年12月8日	2022年6月15日	新股流通受限	26.17	44.86	285	7,458.45	12,785.10	-
301155	海力风电	2021年11月17日	2022年5月24日	新股流通受限	60.66	96.75	463	28,085.58	44,795.25	-
301166	优宁维	2021年12月21日	2022年6月28日	新股流通受限	86.06	94.50	249	21,428.94	23,530.50	-
301177	迪阿股份	2021年12月8日	2022年6月15日	新股流通受限	116.88	116.08	304	35,531.52	35,288.32	-
301179	泽宇智能	2021年12月1日	2022年6月8日	新股流通受限	43.99	50.77	295	12,977.05	14,977.15	-
301182	凯旺科技	2021年12月16日	2022年6月23日	新股流通受限	27.12	30.58	294	7,973.28	8,990.52	-
301188	力诺特玻	2021年11月4日	2022年5月11日	新股流通受限	13.00	20.48	647	8,411.00	13,250.56	-
301189	奥尼电子	2021年12月21日	2022年6月28日	新股流通受限	66.18	56.62	396	26,207.28	22,421.52	-
301190	善水科技	2021年12月17日	2022年6月24日	新股流通受限	27.85	27.46	575	16,013.75	15,789.50	-

301198	喜悦智行	2021年11月25日	2022年6月2日	新股流通受限	21.76	29.20	262	5,701.12	7,650.40	-
301199	迈赫股份	2021年11月30日	2022年6月7日	新股流通受限	29.28	32.00	402	11,770.56	12,864.00	-
301211	亨迪药业	2021年12月14日	2022年6月22日	新股流通受限	25.80	33.65	967	24,948.60	32,539.55	-
688071	华依科技	2021年7月21日	2022年2月7日	新股流通受限	13.73	62.31	1,101	15,116.73	68,603.31	-
688151	华强科技	2021年11月29日	2022年6月6日	新股流通受限	35.09	33.82	7,637	267,982.33	258,283.34	-
688187	时代电气	2021年8月30日	2022年3月7日	新股流通受限	31.38	76.65	10,216	320,578.08	783,056.40	-
688211	中科微至	2021年10月18日	2022年4月26日	新股流通受限	90.20	71.32	2,363	213,142.60	168,529.16	-
688262	国芯科技	2021年12月28日	2022年1月6日	新股流通受限	41.98	41.98	5,567	233,702.66	233,702.66	-
688265	南模生物	2021年12月21日	2022年6月28日	新股流通受限	84.62	65.03	2,374	200,887.88	154,381.22	-
688733	壹石通	2021年8月10日	2022年2月17日	新股流通受限	15.49	75.36	3,409	52,805.41	256,902.24	-
688776	国光电气	2021年8月24日	2022年3月1日	新股流通受限	51.44	184.99	1,447	74,433.68	267,680.53	-
688779	长远锂科	2021年8月3日	2022年2月11日	新股流通受限	5.65	22.86	31,822	179,794.30	727,450.92	-
688799	华纳药厂	2021	2022	新股	30.82	40.73	1,917	59,081.94	78,079.41	-

		年7月5日	年1月13日	流通受限						
7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
113052	兴业转债	2021年12月27日	2022年1月14日	新债未上市	100.00	100.00	43,770	4,376,980.81	4,376,980.81	-

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

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2021年12月31日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额3,300,000.00元，在2022年1月4日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

本基金为指数型基金，本基金的运作涉及的金融工具主要包括股票投资（主要是指数成份股、备选成份股）、银行存款等。与这些金融工具有关的风险，以及本基金的基金管理人管理这些风险所采取的风险管理政策如下所述。

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

面临的主要风险包括：市场风险、信用风险和流动性风险。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。

7.4.13.2 信用风险

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

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7.4.13.2.1至7.4.13.2.6列示了于本报告期末及上年度末本基金所持有的债券投资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。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末2021年12月31日	上年度末2020年12月31日
AAA	5,056,981.81	-
AAA以下	113,433.60	-
未评级	-	-
合计	5,170,415.41	-

注：上述评级均由经中国证监会核准从事证券市场资信评级业务的评级机构做出。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.3 流动性风险

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金流动性风险来源于开放式基金每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。本基金所持有的交易性金融资产在证券交易所交易，除附注7.4.12所披露的流通受限不能自由转让的基金资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。本基金所持有的全部金融负债无固定到期日或合约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，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。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的利率敏感性资产主要是银行存款等。本基金的基金管理人日常通过对利率水平的预测、分析收益率曲线及优化利率重新定价日组合等方法对上述利率风险进行管理。

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2021年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,527,381.93	-	-	-	1,527,381.93
结算备付金	75,002.16	-	-	-	75,002.16
存出保证金	23,823.63	-	-	-	23,823.63
交易性金融资产	30,439,986.00	-	5,170,415.41	590,436,912.88	626,047,314.29
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	693,068.76	693,068.76
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	755,502.23	755,502.23
应收证券清算款	-	-	-	571,994.56	571,994.56
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	32,066,193.72	-	5,170,415.41	592,457,478.43	629,694,087.56
负债					
应付赎回款	-	-	-	883,345.65	883,345.65
应付管理人报酬	-	-	-	398,140.03	398,140.03
应付托管费	-	-	-	79,628.00	79,628.00
应付证券清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	3,300,000.00	-	-	-	3,300,000.00
应付销售服务费	-	-	-	8,144.36	8,144.36
应付交易费用	-	-	-	31,185.03	31,185.03
应付利息	-	-	-	-1,265.75	-1,265.75
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	0.35	0.35
其他负债	-	-	-	414,113.73	414,113.73
负债总计	3,300,000.00	-	-	1,813,291.40	5,113,291.40
利率敏感度缺口	28,766,193.72	-	5,170,415.41	590,644,187.03	624,580,796.16
上年度末2020年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	32,550,866.40	-	-	-	32,550,866.40
结算备付金	366,633.00	-	-	-	366,633.00
存出保证金	65,239.17	-	-	-	65,239.17
交易性金融资产	5,992,200.00	-	-	652,138,611.65	658,130,811.65
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	62,899.24	62,899.24
应收股利	-	-	-	-	-

应收申购款	-	-	-	1,969,529.53	1,969,529.53
应收证券清算款	-	-	-	240,689.96	240,689.96
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	38,974,938.57	-	-	654,411,730.38	693,386,668.95
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,372,059.89	3,372,059.89
应付管理人报酬	-	-	-	421,542.13	421,542.13
应付托管费	-	-	-	84,308.43	84,308.43
应付证券清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	16,695.35	16,695.35
应付交易费用	-	-	-	82,509.81	82,509.81
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	342,836.32	342,836.32
负债总计	-	-	-	4,319,951.93	4,319,951.93
利率敏感度缺口	38,974,938.57	-	-	650,091,778.45	689,066,717.02

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1.若市场利率平行上升或下降50个基点		
	2.其他市场变量保持不变		
	3.仅存在公允价值变动对基金资产净值的影响		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（ 2021年12月31日 ）	上年度末（ 2020年12月31日 ）
	1. 市场利率平行上升50个基点	-156,315.08	-15,752.82
	2. 市场利率平行下降50个基点	161,313.09	15,871.86

7.4.13.4.2 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险，该风险可能与特定投资品种相关，也有可能与整体投资品种相关。本基金所持有的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金在构建资产配置和基金资产投资组合的基础上，通过建立事前和事后跟踪误差的方式，对基金资产的市场价格风险进行管理。

7.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末2021年12月31日		上年度末2020年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产-股票投资	590,436,912.88	94.53	652,138,611.65	94.64
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	590,436,912.88	94.53	652,138,611.65	94.64

7.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1.若对市场价格敏感的权益性投资的市场价格上升或下降5%		
	2.其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（ 2021年12月31日 ）	上年度末（ 2020年12月31日 ）
	1. 权益性投资的市场价格上升 5%	29,521,845.64	32,606,930.58
	2. 权益性投资的市场价格下降 5%	-29,521,845.64	-32,606,930.58

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 以公允价值计量的资产和负债

下表列示了本基金在每个资产负债表日持续和非持续以公允价值计量的资产和负债于本报告期末的公允价值信息及其公允价值计量的层次。公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

单位：人民币元

持续的公允价值计量资产	本期末(2021年12月31日)			
	合计	第一层次	第二层次	第三层次
交易性金融资产	626,047,314.29	587,244,644.05	38,802,670.24	-
-股票投资	590,436,912.88	586,451,209.45	3,985,703.43	-
-债券投资	35,610,401.41	793,434.60	34,816,966.81	-

-基金投资	-	-	-	-
-资产支持证券投资	-	-	-	-
持续以公允价值计量的资产总额	626,047,314.29	587,244,644.05	38,802,670.24	-

单位：人民币元

持续的公允价值计量资产	上年度末(2020年12月31日)			
	合计	第一层次	第二层次	第三层次
交易性金融资产	658,130,811.65	649,144,756.24	8,986,055.41	-
-股票投资	652,138,611.65	649,144,756.24	2,993,855.41	-
-债券投资	5,992,200.00	-	5,992,200.00	-
-基金投资	-	-	-	-
-资产支持证券投资	-	-	-	-
持续以公允价值计量的资产总额	658,130,811.65	649,144,756.24	8,986,055.41	-

(a)第二层次的公允价值计量

对于本基金投资的证券交易所上市的证券，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时，本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑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，确定相关证券公允价值的层次。

(b)非持续的以公允价值计量的金融工具

于2021年12月31日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2020年12月31日：无)。

7.4.14.2 其他金融工具的公允价值(期末非以公允价值计量的项目)

其他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。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	590,436,912.88	93.77
	其中：股票	590,436,912.88	93.77
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	35,610,401.41	5.66
	其中：债券	35,610,401.41	5.66
	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	1,602,384.09	0.25
8	其他资产	2,044,389.18	0.32
9	合计	629,694,087.56	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	9,250,225.12	1.48
C	制造业	345,635,233.49	55.34
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	2,998,422.74	0.48
G	交通运输、仓储和邮政业	12,811,417.74	2.05
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	21,667,804.81	3.47
J	金融业	154,881,945.87	24.80
K	房地产业	20,441,996.64	3.27
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	1,935,555.19	0.31
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,151,904.14	0.34
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-

	合计	571,774,505.74	91.55

8.2.2 期末积极投资按行业分类境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	7,620,469.15	1.22
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	260,937.51	0.04
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	4,608.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	954,932.64	0.15
J	金融业	8,632,649.60	1.38
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	1,040,858.77	0.17
N	水利、环境和公共设施管理业	101,541.88	0.02
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	46,409.59	0.01
S	综合	-	-
	合计	18,662,407.14	2.99

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600887	伊利股份	1,028,343	42,635,100.78	6.83
2	600519	贵州茅台	18,833	38,607,650.00	6.18
3	601166	兴业银行	1,819,004	34,633,836.16	5.55
4	600036	招商银行	669,800	32,625,958.00	5.22
5	601318	中国平安	624,168	31,464,308.88	5.04

6	002415	海康威视	522,540	27,339,292.80	4.38
7	600276	恒瑞医药	494,616	25,081,977.36	4.02
8	601398	工商银行	5,050,241	23,382,615.83	3.74
9	000002	万科A	1,034,514	20,441,996.64	3.27
10	000333	美的集团	265,266	19,579,283.46	3.13
11	000895	双汇发展	556,806	17,567,229.30	2.81
12	300124	汇川技术	242,604	16,642,634.40	2.66
13	600563	法拉电子	68,156	15,839,454.40	2.54
14	000596	古井贡酒	60,790	14,832,760.00	2.37
15	600016	民生银行	3,431,229	13,381,793.10	2.14
16	601601	中国太保	492,687	13,361,671.44	2.14
17	002120	韵达股份	626,169	12,811,417.74	2.05
18	002230	科大讯飞	236,819	12,435,365.69	1.99
19	603986	兆易创新	69,652	12,248,304.20	1.96
20	000423	东阿阿胶	240,901	11,743,923.75	1.88
21	600104	上汽集团	515,334	10,631,340.42	1.70
22	300136	信维通信	416,843	10,554,464.76	1.69
23	000651	格力电器	255,052	9,444,575.56	1.51
24	601088	中国神华	410,756	9,250,225.12	1.48
25	002410	广联达	134,702	8,618,233.96	1.38
26	600196	复星医药	164,531	8,052,147.14	1.29
27	600522	中天科技	377,800	6,407,488.00	1.03
28	600690	海尔智家	213,336	6,376,613.04	1.02
29	002008	大族激光	115,353	6,229,062.00	1.00
30	601939	建设银行	1,029,311	6,031,762.46	0.97
31	000049	德赛电池	88,322	5,150,939.04	0.82
32	002294	信立泰	181,935	4,970,464.20	0.80
33	600585	海螺水泥	118,400	4,771,520.00	0.76
34	600085	同仁堂	104,215	4,687,590.70	0.75
35	600600	青岛啤酒	44,595	4,414,905.00	0.71
36	300003	乐普医疗	167,368	3,787,537.84	0.61
37	000848	承德露露	346,011	3,754,219.35	0.60
38	600660	福耀玻璃	77,918	3,673,054.52	0.59
39	603160	汇顶科技	30,800	3,319,316.00	0.53
40	601607	上海医药	150,902	2,998,422.74	0.48
41	000538	云南白药	26,431	2,766,004.15	0.44
42	300244	迪安诊断	64,102	2,151,904.14	0.34
43	600535	天士力	125,826	1,994,342.10	0.32
44	300070	碧水源	269,201	1,935,555.19	0.31
45	002038	双鹭药业	86,887	939,248.47	0.15
46	300024	机器人	64,152	716,577.84	0.11
47	300183	东软载波	33,692	614,205.16	0.10
48	600398	海澜之家	69,021	442,424.61	0.07

49	000726	鲁泰 A	67,254	433,788.30	0.07

注：因本基金被动复制指数成分股需要，根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定要求，经本基金管理人董事会以及本基金托管行同意，报告期内，本基金参与投资了招商银行。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000001	平安银行	375,470	6,187,745.60	0.99
2	601288	农业银行	831,600	2,444,904.00	0.39
3	688235	百济神州	7,206	1,041,339.06	0.17
4	688187	时代电气	10,216	783,056.40	0.13
5	688779	长远锂科	31,822	727,450.92	0.12
6	688608	恒玄科技	1,890	576,450.00	0.09
7	688083	中望软件	1,637	572,671.71	0.09
8	688131	皓元医药	1,955	486,169.40	0.08
9	688617	惠泰医疗	1,673	468,440.00	0.08
10	688776	国光电气	1,447	267,680.53	0.04
11	688151	华强科技	7,637	258,283.34	0.04
12	688733	壹石通	3,409	256,902.24	0.04
13	688262	国芯科技	5,567	233,702.66	0.04
14	300999	金龙鱼	3,468	218,241.24	0.03
15	688626	翔宇医疗	3,652	207,871.84	0.03
16	301093	华兰股份	3,720	193,309.80	0.03
17	688211	中科微至	2,363	168,529.16	0.03
18	301088	戎美股份	6,489	167,266.83	0.03
19	688265	南模生物	2,374	154,381.22	0.02
20	688315	诺禾致源	3,711	153,264.30	0.02
21	688317	之江生物	2,740	141,493.60	0.02
22	301189	奥尼电子	2,358	140,180.76	0.02
23	688227	品高股份	4,164	133,581.12	0.02
24	688076	诺泰生物	2,984	123,328.72	0.02
25	300901	中胤时尚	9,611	121,963.59	0.02
26	688575	亚辉龙	3,435	118,679.25	0.02
27	300957	贝泰妮	485	93,255.80	0.01
28	688355	明志科技	2,710	90,622.40	0.01
29	688185	康希诺	300	89,865.00	0.01
30	688597	煜邦电力	3,907	87,868.43	0.01
31	688113	联测科技	1,415	86,315.00	0.01

32	688628	优利德	2,789	81,689.81	0.01
33	688799	华纳药厂	1,917	78,079.41	0.01
34	301136	招标股份	7,172	75,449.44	0.01
35	688613	奥精医疗	1,317	72,777.42	0.01
36	688071	华依科技	1,101	68,603.31	0.01
37	688180	君实生物	1,000	66,980.00	0.01
38	301050	雷电微力	233	54,694.42	0.01
39	301002	崧盛股份	1,001	53,853.80	0.01
40	301190	善水科技	1,741	51,002.70	0.01
41	301133	金钟股份	1,460	50,758.28	0.01
42	688618	三旺通信	1,117	49,583.63	0.01
43	688622	禾信仪器	804	48,199.80	0.01
44	300973	立高食品	360	47,548.80	0.01
45	301155	海力风电	463	44,795.25	0.01
46	301029	怡合达	462	41,519.94	0.01
47	688679	通源环境	3,139	40,273.37	0.01
48	688565	力源科技	2,464	39,916.80	0.01
49	301035	润丰股份	644	36,244.32	0.01
50	301177	迪阿股份	304	35,288.32	0.01
51	301211	亨迪药业	967	32,539.55	0.01
52	300894	火星人	628	30,878.76	0.00
53	603230	内蒙新华	1,141	29,517.67	0.00
54	688737	中自科技	485	28,377.35	0.00
55	301040	中环海陆	701	27,680.91	0.00
56	301087	可孚医疗	366	27,574.44	0.00
57	301090	华润材料	2,323	26,064.06	0.00
58	301058	中粮工科	1,386	25,280.64	0.00
59	688697	纽威数控	1,437	24,199.08	0.00
60	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.00
61	301166	优宁维	249	23,530.50	0.00
62	301099	雅创电子	310	22,121.60	0.00
63	301018	申菱环境	782	20,378.92	0.00
64	301108	洁雅股份	366	20,303.86	0.00
65	001296	长江材料	310	18,376.80	0.00
66	301101	明月镜片	371	16,086.56	0.00
67	301179	泽宇智能	295	14,977.15	0.00
68	301089	拓新药业	220	14,944.60	0.00
69	688289	圣湘生物	252	14,868.00	0.00
70	301009	可靠股份	801	14,778.45	0.00
71	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.00
72	301111	粤万年青	379	13,901.72	0.00
73	301188	力诺特玻	647	13,250.56	0.00
74	301199	迈赫股份	402	12,864.00	0.00

75	301020	密封科技	421	12,815.24	0.00
76	301138	华研精机	285	12,785.10	0.00
77	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.00
78	301126	达嘉维康	662	12,730.26	0.00
79	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.00
80	301092	争光股份	323	11,472.96	0.00
81	301048	金鹰重工	843	10,925.28	0.00
82	301028	东亚机械	733	9,895.50	0.00
83	301045	天禄科技	335	9,503.95	0.00
84	300774	倍杰特	444	9,359.52	0.00
85	301182	凯旺科技	294	8,990.52	0.00
86	301062	上海艾录	523	8,896.23	0.00
87	301052	果麦文化	252	8,477.28	0.00
88	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
89	301066	万事利	344	7,856.96	0.00
90	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
91	301055	张小泉	355	7,731.90	0.00
92	301198	喜悦智行	262	7,650.40	0.00
93	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.00
94	300998	宁波方正	201	6,699.33	0.00
95	301081	严牌股份	380	6,627.20	0.00
96	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
97	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
98	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.00
99	301004	嘉益股份	312	6,389.76	0.00
100	301056	森赫股份	572	6,343.48	0.00
101	301036	双乐股份	205	6,135.65	0.00
102	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
103	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
104	301007	德迈仕	303	6,035.76	0.00
105	300854	中兰环保	203	5,539.87	0.00
106	301063	海锅股份	153	5,524.83	0.00
107	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
108	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
109	301010	晶雪节能	218	5,227.64	0.00
110	301059	金三江	259	4,998.70	0.00
111	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
112	301037	保立佳	193	4,682.18	0.00
113	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
114	301053	远信工业	155	4,460.90	0.00
115	301057	汇隆新材	218	4,146.36	0.00
116	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
117	301079	邵阳液压	140	3,474.80	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	15,694,138.00	2.28
2	600887	伊利股份	11,010,046.00	1.60
3	600276	恒瑞医药	8,668,365.68	1.26
4	000895	双汇发展	7,904,280.08	1.15
5	600036	招商银行	7,194,098.00	1.04
6	000002	万科A	7,003,053.30	1.02
7	601166	兴业银行	5,757,077.24	0.84
8	601601	中国太保	5,237,975.00	0.76
9	600519	贵州茅台	4,735,236.00	0.69
10	300124	汇川技术	4,488,132.80	0.65
11	002415	海康威视	4,410,095.08	0.64
12	000596	古井贡酒	4,219,700.00	0.61
13	002120	韵达股份	3,968,343.70	0.58
14	300136	信维通信	3,904,360.27	0.57
15	000333	美的集团	3,519,774.00	0.51
16	600563	法拉电子	3,215,455.00	0.47
17	600104	上汽集团	3,153,727.11	0.46
18	601398	工商银行	2,502,905.00	0.36
19	000651	格力电器	2,321,880.00	0.34
20	002230	科大讯飞	2,306,175.00	0.33

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

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

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601166	兴业银行	14,882,599.00	2.16
2	600887	伊利股份	12,360,911.14	1.79
3	002415	海康威视	10,973,736.80	1.59
4	600519	贵州茅台	9,707,552.00	1.41
5	600036	招商银行	9,445,521.00	1.37
6	300124	汇川技术	7,183,242.00	1.04
7	000333	美的集团	7,145,591.90	1.04

8	601318	中国平安	5,729,453.00	0.83
9	600276	恒瑞医药	5,308,644.40	0.77
10	002230	科大讯飞	4,907,159.96	0.71
11	000002	万科A	4,771,107.00	0.69
12	600016	民生银行	4,556,071.00	0.66
13	600196	复星医药	4,383,399.94	0.64
14	000651	格力电器	4,337,139.00	0.63
15	600104	上汽集团	4,308,839.00	0.63
16	002410	广联达	3,761,401.00	0.55
17	603986	兆易创新	3,284,591.00	0.48
18	000895	双汇发展	2,978,798.92	0.43
19	601088	中国神华	2,830,871.00	0.41
20	600690	海尔智家	2,642,647.00	0.38

注：1、卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票；

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	165,713,523.29
卖出股票收入（成交）总额	206,605,160.02

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票；

2、“买入股票成本（成交）总额”、“卖出股票收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	30,439,986.00	4.87
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	5,170,415.41	0.83
8	同业存单	-	-

9	其他	-	-
10	合计	35,610,401.41	5.70

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	019649	21国债01	254,300	25,435,086.00	4.07
2	113052	兴业转债	43,770	4,376,980.81	0.70
3	019613	19国债03	40,000	4,004,800.00	0.64
4	019628	20国债02	10,000	1,000,100.00	0.16
5	110079	杭银转债	3,750	467,025.00	0.07

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金管理人可运用股指期货，以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，参与股指期货的投资，以改善组合的风险收益特性。本基金主要通过对现货和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货定价模型寻求其合理估值水平，采用流动性好、交易活跃的期货合约，达到有效跟踪标的指数的目的。此外，本基金还将运用股指期货来对冲特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理，如预期大额申购赎回、大量分红等，以及对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

8.11.3 本期国债期货投资评价

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

8.12 投资组合报告附注

报告期内基金投资的前十名证券除工商银行（证券代码601398）、海康威视（证券代码002415）、恒瑞医药（证券代码600276）、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、海康威视（证券代码002415）

根据2021年10月8日发布的相关公告，该证券发行人因违反税收管理规定被国家税务总局长沙市雨花区税务局责令改正。

根据2021年11月15日发布的相关公告，该证券发行人因违反税收管理规定被国家税务总局长沙市雨花区税务局责令改正。

3、恒瑞医药（证券代码600276）

根据2021年2月19日发布的相关公告，该证券发行人因未依法履行职责被财政部处以罚款。

根据2021年4月12日发布的相关公告，该证券发行人因违规经营被中华人民共和国财政部处以罚款。

4、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。

5、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。

6、中国平安（证券代码601318）

根据2021年2月23日发布的相关公告，该证券发行人因未依法履行职责被广东省通信管理局责令改正。

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

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

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

8.12.1 期末其他各项资产构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	23,823.63
2	应收证券清算款	571,994.56
3	应收股利	-
4	应收利息	693,068.76
5	应收申购款	755,502.23
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,044,389.18

8.12.2 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	110079	杭银转债	467,025.00	0.07
2	113050	南银转债	212,976.00	0.03

8.12.3 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.3.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

8.12.3.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688187	时代电气	783,056.40	0.13	新股锁定
2	688779	长远锂科	727,450.92	0.12	新股锁定

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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
招商央视财经 50 指数 A	144,918	1,362.53	427,841.40	0.22%	197,027,077.37	99.78%
招商央视财经 50 指数 C	1,349	6,010.24	40,128.47	0.49%	8,067,688.63	99.51%
合计	146,267	1,405.39	467,969.87	0.23%	205,094,766.00	99.77%

注：机构投资者/个人投资者持有份额占总份额比例计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	招商央视财经 50 指数 A	19,044.17	0.0096%
	招商央视财经 50 指数 C	38.80	0.0005%
	合计	19,082.97	0.0093%

注：分级基金机构投资者/个人投资者持有份额占总份额比例计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

9.3 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	份额级别	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	招商央视财经 50 指数 A	0
	招商央视财经 50 指数 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	招商央视财经 50 指数 A	0~10
	招商央视财经 50 指数 C	0~10
	合计	0~10

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	招商央视财经50指数A	招商央视财经50指数C
基金合同生效日(2013年2月5日)基金份额总额	1,319,259,082.36	-
本报告期期初基金份额总额	203,845,022.44	17,297,737.66
本报告期基金总申购份额	144,612,854.52	14,605,019.62
减：报告期基金总赎回份额	151,002,958.19	23,794,940.18
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	197,454,918.77	8,107,817.10

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

根据本基金管理人2021年3月6日的公告，经招商基金管理有限公司第六届董事会2021年第二次会议审议通过，同意沙骏先生离任副总经理。

根据本基金管理人2021年6月5日的公告，经招商基金管理有限公司第六届董事会2021年第六次会议审议通过，同意选举王小青先生担任公司董事长，刘辉女士不再担任公司董事长。

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

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的重大诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金的审计事务所无变化，目前毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）已为本基金提供审计服务9年，本报告期应支付给毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)的报酬为人民币60,000.00元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华安证券	3	70,035,646.79	20.04%	52,567.83	16.95%	-
国泰君安证券	3	47,249,433.90	13.52%	44,007.41	14.19%	-
中信证券	3	46,284,248.62	13.24%	43,105.08	13.90%	-
华泰证券	5	42,222,046.52	12.08%	38,831.77	12.52%	-
天风证券	2	23,916,049.29	6.84%	22,273.19	7.18%	-
申万宏源	4	19,761,270.97	5.65%	18,404.07	5.93%	-
光大证券	3	13,172,749.03	3.77%	12,267.79	3.96%	-
开源证券	2	12,147,185.09	3.48%	11,313.55	3.65%	-
招商证券	2	11,638,483.73	3.33%	10,838.62	3.50%	-
海通证券	4	10,017,200.81	2.87%	9,329.15	3.01%	-
国信证券	3	8,884,454.54	2.54%	8,274.04	2.67%	-
华西证券	3	8,195,561.21	2.34%	7,209.04	2.32%	-
长江证券	4	7,122,166.44	2.04%	6,632.86	2.14%	-
安信证券	2	6,799,379.65	1.95%	6,332.36	2.04%	-
东方财富	3	3,797,969.82	1.09%	2,777.51	0.90%	-
平安证券	3	2,988,681.77	0.86%	2,783.33	0.90%	-
广发证券	3	2,427,968.15	0.69%	1,775.55	0.57%	-
中泰证券	3	2,400,791.00	0.69%	1,755.70	0.57%	-
银河证券	1	2,001,597.06	0.57%	1,864.08	0.60%	-
中航证券	2	1,978,846.71	0.57%	1,842.80	0.59%	-
国盛证券	2	1,792,386.61	0.51%	1,669.24	0.54%	-
中信建投证券	6	1,171,956.83	0.34%	1,091.49	0.35%	-
东北证券	3	1,082,097.12	0.31%	1,007.72	0.32%	-
东兴证券	3	918,116.61	0.26%	855.02	0.28%	-
民生证券	2	669,993.91	0.19%	489.96	0.16%	-
方正证券	7	410,273.77	0.12%	382.08	0.12%	-

长城证券	3	135,652.80	0.04%	126.35	0.04%	-
中金公司	3	128,165.64	0.04%	119.37	0.04%	-
西部证券	1	123,597.89	0.04%	115.08	0.04%	-
华创证券	4	73,690.76	0.02%	53.89	0.02%	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
大通证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	3	-	-	-	-	-
东方证券	3	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	2	-	-	-	-	-
宏信证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
瑞信方正	2	-	-	-	-	-
山西证券	2	-	-	-	-	-
上海证券	2	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
万和证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	2	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	5	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
粤开证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
中金财富证券	2	-	-	-	-	-
中银国际证券	4	-	-	-	-	-

注：基金交易佣金根据券商季度综合评分结果给与分配，券商综合评分根据研究报告质量、路演质量、联合调研质量等维度进行打分，从多家服务券商中选取符合法律规范经营的综合能力靠前的券商给与佣金分配，季度评分和佣金分配分别由专人负责。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总	成交金额	占当期债券回购成	成交金额	占当期权证成交总

		额的比例		交总额的比例		额的比例
华安证券	10,145,511.00	15.67%	-	-	-	-
国泰君安证券	9,616,157.70	14.86%	-	-	-	-
中信证券	4,401,120.00	6.80%	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	2,010,358.30	3.11%	5,800,000.00	16.43%	-	-
申万宏源	2,007,696.10	3.10%	-	-	-	-
光大证券	9,176,574.20	14.18%	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	3,388,305.00	5.23%	-	-	-	-
海通证券	20,380,217.00	31.48%	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	6,200,000.00	17.56%	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	3,501,500.00	5.41%	8,400,000.00	23.80%	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	8,800,000.00	24.93%	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	102,946.69	0.16%	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	6,100,000.00	17.28%	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-

南京证券	-	-	-	-	-	-
瑞信方正	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
万和证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中金财富证券	-	-	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	招商基金管理有限公司关于基金直销账户信息变更的公告	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	2021-01-13
2	招商基金管理有限公司旗下基金2020年第4季度报告提示性公告	证券时报及基金管理人网站	2021-01-21
3	招商央视财经 50 指数证券投资基金 2020 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	2021-01-21
4	招商基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海中欧财富为销售机构的公告	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	2021-01-27
5	招商央视财经 50 指数证券投资基金更新的招募说明书（二零二一年第一号）	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	2021-02-04
6	招商央视财经50指数证券投资基金（A类份额）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	2021-02-04
7	招商央视财经50指数证券投资基金（C类份额）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	2021-02-04

		基金电子披露网站	
8	招商基金管理有限公司关于旗下部分基金增加北京恒天明泽为销售机构的公告	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	2021-02-26
9	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	2021-03-06
10	招商基金旗下部分基金增加华瑞保险为代销机构的公告	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	2021-03-11
11	招商央视财经 50 指数证券投资基金 2020 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	2021-03-30
12	招商基金管理有限公司旗下基金 2020 年年度报告提示性公告	证券时报及基金管理人网站	2021-03-30
13	招商基金管理有限公司关于修订旗下部分公募基金基金合同的公告	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	2021-03-31
14	招商央视财经 50 指数证券投资基金基金合同（2021 年 3 月 31 日修订）	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	2021-03-31
15	招商央视财经 50 指数证券投资基金更新的招募说明书（二零二一年第二号）	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	2021-04-06
16	招商央视财经50指数证券投资基金（A类份额）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	2021-04-06
17	招商央视财经50指数证券投资基金（C类份额）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	2021-04-06
18	招商基金管理有限公司旗下部分基金增加中信证券股份有限公司、中信证券（山东）有限责任公司、中信证券华南股份有限公司、中信期货有限公司为销售机构的公告	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	2021-04-15
19	招商基金管理有限公司旗下基金2021年第1季度报告提示性公告	证券时报及基金管理人网站	2021-04-21
20	招商央视财经 50 指数证券投资基金 2021 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	2021-04-21
21	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	2021-05-07
22	招商基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中正达广为销售机构的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会	2021-05-08

		基金电子披露网站	
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、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-06-05
24	招商基金管理有限公司关于降低旗下部分基金业务最低限额的公告	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	2021-06-08
25	招商基金管理有限公司旗下部分基金增加浦领基金为销售机构及开通定投和转换业务并参与其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	2021-07-02
26	招商央视财经 50 指数证券投资基金 2021 年第 2 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	2021-07-20
27	招商基金管理有限公司旗下基金2021年第2季度报告提示性公告	证券时报及基金管理人网站	2021-07-20
28	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基金电子披露网站	2021-08-12
29	招商基金管理有限公司旗下基金 2021 年中期报告提示性公告	证券时报及基金管理人网站	2021-08-30
30	招商央视财经 50 指数证券投资基金 2021 年中期报告	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	2021-08-30
31	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	2021-09-25
32	招商央视财经 50 指数证券投资基金 2021 年第 3 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	2021-10-26
33	招商基金管理有限公司旗下基金2021年第3季度报告提示性公告	证券时报及基金管理人网站	2021-10-26
34	招商基金管理有限公司关于旗下部分公开募集证券投资基金可投资于北京证券交易所股票的公告	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	2021-11-16
35	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基金电子披露网站	2021-12-07
36	招商基金管理有限公司关于基金美元直销账户信息变更的公告	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	2021-12-31

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1、中国证券监督管理委员会批准设立招商基金管理有限公司的文件；

2、中国证券监督管理委员会批准招商央视财经50指数证券投资基金设立的文件；

3、《招商央视财经50指数证券投资基金基金合同》；

4、《招商央视财经50指数证券投资基金托管协议》；

5、《招商央视财经50指数证券投资基金招募说明书》；

6、基金管理人业务资格批件、营业执照。

12.2 存放地点

招商基金管理有限公司

地址：中国深圳深南大道7088号招商银行大厦

12.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人招商基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-887-9555

网址：http://www.cmfchina.com

招商基金管理有限公司

2022年3月30日