

# 招商 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金 2023 年中期报告

2023 年 06 月 30 日

基金管理人：招商基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介.....	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
§4 管理人报告.....	7
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	11
§5 托管人报告.....	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告.....	40
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	41
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	57
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	59
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	59
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	59
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	59
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	59
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	59
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	59

7.12 投资组合报告附注.....	60
§8 基金份额持有人信息.....	61
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	61
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	61
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	62
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.....	62
§9 开放式基金份额变动.....	62
§10 重大事件揭示.....	62
10.1 基金份额持有人大会决议.....	62
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.....	62
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	63
10.4 基金投资策略的改变.....	63
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	63
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.....	63
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	63
10.8 其他重大事件.....	66
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	68
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	68
§12 备查文件目录.....	69
12.1 备查文件目录.....	69
12.2 存放地点.....	69
12.3 查阅方式.....	69

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	招商 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	招商 MSCI 中国 A 股国际通 ETF
场内简称	MSCI 招商 (扩位证券简称: MSCI 中国 ETF 招商)
基金主代码	515160
交易代码	515160
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020 年 2 月 3 日
基金管理人	招商基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	657,955,051.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2020 年 3 月 2 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	<p>本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份券组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份券及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情形导致基金无法完全投资于标的指数成份券时，基金管理人可采取包括成份券替代策略在内的其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到紧密跟踪标的指数的目的。特殊情形包括但不限于：（1）法律法规的限制；（2）标的指数成份券流动性严重不足；（3）标的指数的成份券长期停牌；（4）标的指数成份券进行配股或增发；（5）标的指数成份券派发现金股息；（6）标的指数编制方法发生变化；（7）其他可能严重限制本基金跟踪标的指数的合理原因等。本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 以内。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。本基金其他投资策略包括：债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、融资及转融通投资策略和存托凭证投资策略。</p>
业绩比较基准	MSCI 中国 A 股国际通指数 (MSCI China A Inclusion RMB Index) 收益率
风险收益特征	<p>本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金、货币市场基金。</p> <p>本基金为被动式投资的股票型指数基金，主要采用完全复制策略，跟踪 MSCI 中国 A 股国际通指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场</p>

	组合的风险收益特征相似。
--	--------------

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	招商基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	潘西里
	联系电话	0755-83196666
	电子邮箱	cmf@cmfchina.com
客户服务电话	400-887-9555	95566
传真	0755-83196475	010-66594942
注册地址	深圳市福田区深南大道 7088 号	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址	深圳市福田区深南大道 7088 号	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	518040	100818
法定代表人	王小青	葛海蛟

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.cmfchina.com">http://www.cmfchina.com</a>
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日 - 2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-3,678,104.12
本期利润	-8,547,831.29
加权平均基金份额本期利润	-0.0129
本期加权平均净值利润率	-1.02%
本期基金份额净值增长率	-1.20%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	144,008,052.15
期末可供分配基金份额利润	0.2189

期末基金资产净值	801,963,103.15
期末基金份额净值	1.2189
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	21.89%

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

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

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

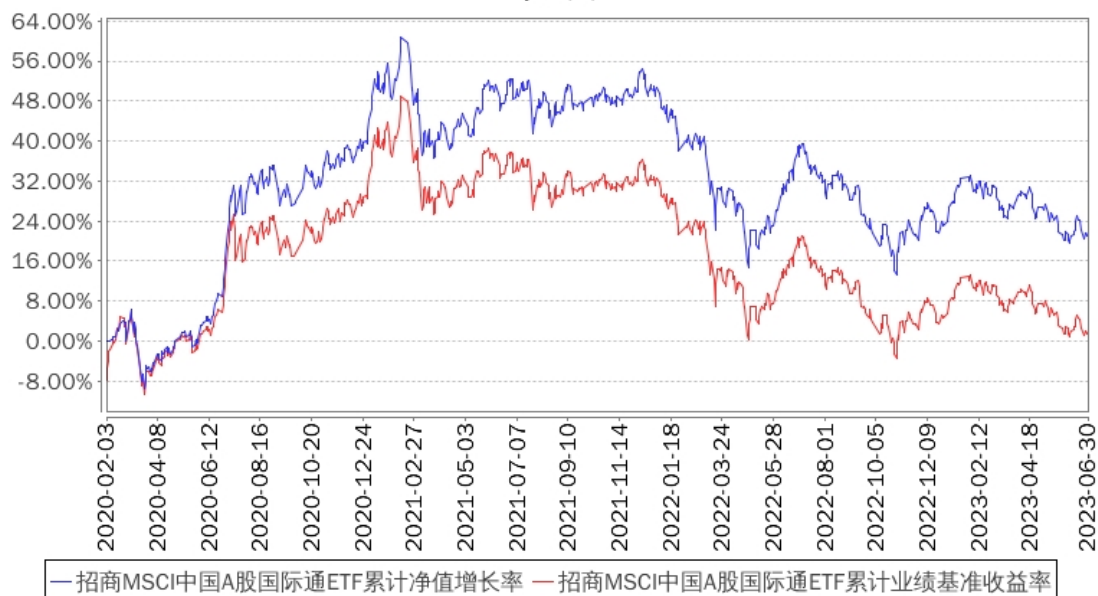
## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.35%	0.86%	0.43%	0.86%	0.92%	0.00%
过去三个月	-4.89%	0.78%	-6.34%	0.79%	1.45%	-0.01%
过去六个月	-1.20%	0.78%	-2.71%	0.79%	1.51%	-0.01%
过去一年	-12.35%	0.94%	-15.40%	0.95%	3.05%	-0.01%
过去三年	10.11%	1.15%	-4.83%	1.19%	14.94%	-0.04%
自基金合同生效起至今	21.89%	1.16%	1.99%	1.24%	19.90%	-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MSCI中国A股国际通ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



## § 4 管理人报告

## 4.1 基金管理人及基金经理情况

## 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

## 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王超	本基金基金经理	2020 年 9 月 23 日	-	15	男，博士。2007 年加入长盛基金管理有限公司先后担任金融工程研究员、基金经理，具有多年量化分析研究，以及基金产品投资管理经验，2019 年加入招商基金管理有限公司国际业务部，现任招商 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式



					指数证券投资基金、招商 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金、招商沪港深科技创新主题精选灵活配置混合型证券投资基金、招商港股通核心精选股票型证券投资基金基金经理。
范刚强	本基金基金经理	2023 年 5 月 23 日	-	11	男，硕士。2011 年起先后任职于中证鹏元资信评估股份有限公司及华夏银行股份有限公司深圳分行南山支行，2012 年 3 月再次加入中证鹏元资信评估股份有限公司，历任信用评级分析师、证券评级部总经理助理、评审委员会委员、技术政策委员会委员，2016 年 6 月加入招商基金管理有限公司，曾任国际业务部高级研究员、招商招裕纯债债券型证券投资基金基金经理，现任招商招华纯债债券型证券投资基金、招商招旺纯债债券型证券投资基金、招商招兴 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、招商 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金、招商 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金、招商普盛全球配置证券投资基金（QDII）基金经理。
白海峰	本基金基金经理	2020 年 2 月 3 日	-	13	男，博士。曾任职于新东方教育科技集团；2010 年加入国泰基金管理有限公司，历任管理培训生、宏观经济研究高级经理、首席经济学家助理、国际业务部负责人；2015 年加入招商基金管理有限公司，曾任招商标普金砖四国指数证券投资基金(LOF)、招商全球资源股票型证券投资基金、招商中国信用机会定期开放债券型证券投资基金(QDII)基金经理，现任招商沪港深科技创新主题精选灵活配置混合型证券投资基金、招商 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金、招商普盛全球配置证券投资基金（QDII）、招商 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金、招商港股通核心精选股票型证券投资基金基金经理。

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

2、证券从业年限计算标准遵从中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定；

3、报告截止日至批准送出日期间，自 2023 年 7 月 7 日起白海峰先生离任本基金的基金经理。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，本基金各项交易均严格按照相关法律法规、基金合同的有关要求执行，公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 18 次，其中 14 次为旗下指数及量化组合因投资策略需要而发生

反向交易，4 次为不同基金经理管理的基金因投资策略不同而发生的反向交易。报告期内未发现有可能导致不公平交易和利益输送的重大异常交易行为。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年，美国通胀虽有所回落但韧性十足，联储继续加息以遏制通胀，受此影响美元指数偏强，给新兴市场国家货币带来了一定的压力。国内方面，疫后微观经济主体信心稍显不足，消费及投资动力疲弱，同时在海外需求不足的拖累下，出口数据也有所走弱，国内大部分经济数据走软，叠加短期内政策刺激力度也低于市场预期，市场风险偏好回落。上半年 MSCI 中国 A 股国际通指数（人民币）下跌 2.71%。

报告期内，本基金作为 ETF 基金，实现了对业绩基准指数的良好跟踪。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金份额净值增长率为-1.20%，同期业绩基准增长率为-2.71%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年，美联储加息会接近尾声，人民币汇率贬值压力会减轻。国内方面，随着各项稳经济政策的陆续落地，财政会更加积极，叠加地产市场的企稳，固定资产投资有望反弹，政策的落地会促进就业的改善，叠加资产价格的企稳，居民部门信心可能会有所修复，消费数据回升可期，经济基本面也大概率会止跌回稳。资本市场方面，A 股估值处于较低的位置，叠加后续各项活跃资本市场政策的出台，A 股市场可能会有一定的表现机会。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

投资和研究部门以及基金核算部共同负责关注相关投资品种的动态，评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种；投资和研究部门定期审核公允价值的确认和计量；研究部提出合理的数量分析模型对需要进行估值测算或者调整的投资品种进行公允价值定价与计量并定期对估值政策和程序进

行评价，以保证其持续适用；基金核算部定期审核估值政策和程序的一致性，并负责与托管行沟通估值调整事项；风险管理部负责估值委员会工作流程中的风险控制；法律合规部负责日常的基金估值调整结果的事后复核监督工作；法律合规部与基金核算部共同负责估值调整事项的信息披露工作。

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

#### 4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金

份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

## § 6 半年度财务会计报告(未经审计)

### 6.1 资产负债表

会计主体:招商 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日:2023 年 6 月 30 日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产:			
银行存款	6.4.7.1	12,631,961.90	23,854,891.31
结算备付金		390,220.89	133,400.47
存出保证金		86,692.02	12,823.22
交易性金融资产	6.4.7.2	789,788,980.27	827,667,139.33
其中:股票投资		789,788,980.27	827,588,258.00
基金投资		-	-
债券投资		-	78,881.33
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中:债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		687,908.19	1,064,188.64
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-

其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		803,585,763.27	852,732,442.97
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	19,838,980.37
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		328,288.14	275,973.58
应付托管费		65,657.63	55,194.71
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	0.44
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	1,228,714.35	1,104,676.62
负债合计		1,622,660.12	21,274,825.72
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	657,955,051.00	673,955,051.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	144,008,052.15	157,502,566.25
净资产合计		801,963,103.15	831,457,617.25
负债和净资产总计		803,585,763.27	852,732,442.97

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.2189 元，基金份额总额 657,955,051.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：招商 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-5,729,887.26	-57,794,178.98
1.利息收入		13,879.07	19,405.50
其中：存款利息收入	6.4.7.9	13,879.07	19,405.50
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息		-	-

收入			
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-884,818.32	-3,360,395.90
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-10,259,163.54	-10,085,206.67
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	76,556.69	405,808.92
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	9,297,788.53	6,319,001.85
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-4,869,727.17	-54,386,223.64
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	10,779.16	-66,964.94
减：二、营业总支出		2,817,944.03	2,331,263.13
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	2,085,164.50	1,704,348.27
2.托管费	6.4.10.2.2	417,032.95	340,869.67
3.销售服务费		-	-
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7.税金及附加		0.30	0.46
8.其他费用	6.4.7.19	315,746.28	286,044.73
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-8,547,831.29	-60,125,442.11
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-8,547,831.29	-60,125,442.11
五、其他综合收益的税后净额		-	-

六、综合收益总额		-8,547,831.29	-60,125,442.11
----------	--	---------------	----------------

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：招商 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	673,955,051.00	-	157,502,566.25	831,457,617.25
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	673,955,051.00	-	157,502,566.25	831,457,617.25
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-16,000,000.00	-	-13,494,514.10	-29,494,514.10
（一）、综合收益总额	-	-	-8,547,831.29	-8,547,831.29
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-16,000,000.00	-	-4,946,682.81	-20,946,682.81
其中：1.基金申购款	8,000,000.00	-	2,005,904.15	10,005,904.15
2.基金赎回款	-24,000,000.00	-	-6,952,586.96	-30,952,586.96
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	657,955,051.00	-	144,008,052.15	801,963,103.15
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	517,955,051.00	-	262,440,161.39	780,395,212.39
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	517,955,051.00	-	262,440,161.39	780,395,212.39



三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	2,000,000.00	-	-59,285,961.40	-57,285,961.40
（一）、综合收益总额	-	-	-60,125,442.11	-60,125,442.11
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	2,000,000.00	-	839,480.71	2,839,480.71
其中：1.基金申购款	14,000,000.00	-	4,535,433.89	18,535,433.89
2.基金赎回款	-12,000,000.00	-	-3,695,953.18	-15,695,953.18
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	519,955,051.00	-	203,154,199.99	723,109,250.99

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

\_\_\_\_\_ 徐勇 \_\_\_\_\_ 欧志明 \_\_\_\_\_ 何剑萍 \_\_\_\_\_  
 基金管理人负责人      主管会计工作负责人      会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

招商 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）系由基金管理人招商基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《招商 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规的规定，经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2019]2081 号文准予公开募集注册。本基金为交易型开放式基金，存续期限为不定期。本基金首次设立募集基金份额为 507,955,051.00 份，经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）验证，并出具了编号为德师报（验）字（20）第 00037 号验资报告。《招商 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）于 2020 年 2 月 3 日正式生效。本基金的基金管理人为招商基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及截至报告期末最新公告的《招商 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份券和备选成份券。为更好地实现基金的投资目标，本基金可能会少量投资于国内依法发行上市的非成份券（包括中小板、创业板及其他中国证监会允许投资的股票和存托凭证）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业

债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、货币市场工具、同业存单、债券回购、资产支持证券、银行存款、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金将根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。基金的投资组合比例为:本基金投资于标的指数成份券和备选成份券的资产比例不低于基金资产净值的 90%,且不低于非现金基金资产的 80%;股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为 MSCI 中国 A 股国际通指数(MSCI China A Inclusion RMB Index) 收益率。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策,会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间未发生重大会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期间未发生重大会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	12,631,961.90
等于：本金	12,631,118.46
加：应计利息	843.44
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-

减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	12,631,961.90

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	893,488,469.58	-	789,788,980.27	-103,699,489.31
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	893,488,469.58	-	789,788,980.27	-103,699,489.31

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融工具。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	23,731.99
其中：交易所市场	23,731.99
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	250,645.98
应付指数使用费	954,336.38
合计	1,228,714.35

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	673,955,051.00	673,955,051.00
本期申购	8,000,000.00	8,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-24,000,000.00	-24,000,000.00
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	657,955,051.00	657,955,051.00

注：本期申购含红利再投、转换入份（金）额，本期赎回含转换出份（金）额。

#### 6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	277,626,019.48	-120,123,453.23	157,502,566.25
本期利润	-3,678,104.12	-4,869,727.17	-8,547,831.29
本期基金份额交易产生的变动数	-6,542,061.30	1,595,378.49	-4,946,682.81
其中：基金申购款	3,226,350.61	-1,220,446.46	2,005,904.15
基金赎回款	-9,768,411.91	2,815,824.95	-6,952,586.96
本期已分配利润	-	-	-
本期末	267,405,854.06	-123,397,801.91	144,008,052.15

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	11,083.90
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,993.75

其他	801.42
合计	13,879.07

### 6.4.7.10 股票投资收益

#### 6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-9,221,624.22
股票投资收益——赎回差价收入	-1,037,539.32
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-10,259,163.54

#### 6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	112,606,399.93
减：卖出股票成本总额	121,656,482.98
减：交易费用	171,541.17
买卖股票差价收入	-9,221,624.22

#### 6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	30,952,586.96
减：现金支付赎回款总额	12,318,346.96
减：赎回股票成本总额	19,671,779.32
减：交易费用	-
赎回差价收入	-1,037,539.32

#### 6.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无股票申购差价收入。

#### 6.4.7.10.5 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内无证券出借差价收入。

### 6.4.7.11 债券投资收益

#### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	63.09
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债	76,493.60

券到期兑付) 差价收入	
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	76,556.69

#### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	453,184.58
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	376,597.87
减：应计利息总额	74.98
减：交易费用	18.13
买卖债券差价收入	76,493.60

#### 6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

#### 6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券申购差价收入。

#### 6.4.7.12 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

##### 6.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内无买卖资产支持证券差价收入。

##### 6.4.7.12.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券赎回差价收入。

##### 6.4.7.12.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券申购差价收入。

#### 6.4.7.13 贵金属投资收益

##### 6.4.7.13.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

##### 6.4.7.13.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

**6.4.7.13.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

本基金本报告期内无贵金属赎回差价收入。

**6.4.7.13.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期内无贵金属申购差价收入。

**6.4.7.14 衍生工具收益****6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期内无衍生工具买卖权证差价收入。

**6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益**

本基金本报告期内无衍生工具其他投资收益。

**6.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	9,297,788.53
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	9,297,788.53

**6.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-4,869,727.17
——股票投资	-4,858,853.19
——债券投资	-10,873.98
——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	-4,869,727.17

**6.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

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



替代损益	10,779.16
合计	10,779.16

#### 6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	20,851.62
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
IOPV 服务费	24,795.19
银行费用	2,075.63
指数使用费	208,516.47
合计	315,746.28

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报告批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
招商基金管理有限公司	基金管理人
中国银行股份有限公司	基金托管人
招商证券股份有限公司(以下简称“招商证券”)	基金管理人的股东
招商 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“招商 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 联接”)	本基金的基金管理人管理的其他基金

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

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
招商证券	134,832,414.55	66.68%	80,646,031.89	64.37%

#### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
招商证券	387,167.86	85.43%	2,775,494.70	96.06%

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

#### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
招商证券	31,187.60	77.90%	19,661.23	82.85%
关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
招商证券	18,654.20	76.09%	10,454.02	71.74%

注：1、本基金与关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立；

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

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
----	------------------------------------	---

当期发生的基金应支付的管理费	2,085,164.50	1,704,348.27
其中：支付销售机构的客户维护费	168.38	328.32
支付投资顾问的投资顾问费	-	-

注：支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值×0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	417,032.95	340,869.67

注：支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值×0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

##### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
招商 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 联接	470,000,000.00	71.43%	484,000,000.00	71.81%
招商证券股份有限公司	3,905,950.00	0.59%	3,538,150.00	0.52%

注：表格中的比例为四舍五入的结果。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行-活期	12,631,961.90	11,083.90	8,205,755.19	18,062.94

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

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

单位：人民币元

本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
招商证券	301305	朗坤环境	新股获配	7,523	189,955.75
招商证券	301428	世纪恒通	新股获配	2,289	60,315.15

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

注：本表已包含托管人的关联方承销期内承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

于 2023 年 6 月 30 日，本基金因指数成份股原因被动持有招商银行（600036）415,440 股，市值为人民币 13,609,814.40 元，占本基金资产净值的比例为 1.70%（2022 年 6 月 30

日：持有 347,240 股，市值为人民币 14,653,528.00 元，占本基金资产净值的比例为 2.03%）。

于 2023 年 6 月 30 日，本基金因指数成份股原因被动持有中国银行（601988）707,300 股，市值为人民币 2,765,543.00 元，占本基金资产净值的比例为 0.34%（2022 年 6 月 30 日：持有 589,000 股，市值为人民币 1,920,140.00 元，占本基金资产净值的比例为 0.27%）。

于 2023 年 6 月 30 日，本基金因指数成份股原因被动持有招商证券（600999）149,480 股，市值为人民币 2,028,443.60 元，占本基金资产净值的比例为 0.25%（2022 年 6 月 30 日：持有 124,880 股，市值为人民币 1,799,520.80 元，占本基金资产净值的比例为 0.25%）。

## 6.4.11 利润分配情况

### 6.4.11.1 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

## 6.4.12 期末（2023 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001282	三联锻造	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	-
001286	陕西能源	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
001287	中电港	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股流通受限	11.88	21.02	1,222	14,517.36	25,686.44	-
001324	长青科技	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股流通受限	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-
001328	登康口腔	2023 年 3 月 29 日	6 个月	新股流通受限	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-
001360	南矿集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	-
001367	海森药业	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股流通受限	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-

001380	华纬科技	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新股流通 受限	28.84	30.78	170	4,902.80	5,232.60	-
300804	广康生化	2023 年 6 月 15 日	6 个月	新股流通 受限	42.45	32.97	226	9,593.70	7,451.22	-
301141	中科磁业	2023 年 3 月 27 日	6 个月	新股流通 受限	41.20	42.69	262	10,794.40	11,184.78	-
301157	华塑科技	2023 年 3 月 1 日	6 个月	新股流通 受限	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-
301170	锡南科技	2023 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通 受限	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	-
301202	朗威股份	2023 年 6 月 28 日	6 个月	新股流通 受限	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	-
301202	朗威股份	2023 年 6 月 28 日	1 个月 内(含)	新股流通 受限	25.82	25.82	2,754	71,108.28	71,108.28	-
301203	国泰环保	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股流通 受限	46.13	34.40	225	10,379.25	7,740.00	-
301232	飞沃科技	2023 年 6 月 8 日	6 个月	新股流通 受限	72.50	58.42	165	11,962.50	9,639.30	-
301246	宏源药业	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新股流通 受限	50.00	30.71	931	46,550.00	28,591.01	-
301261	恒工精密	2023 年 6 月 29 日	6 个月	新股流通 受限	36.90	36.90	198	7,306.20	7,306.20	-
301261	恒工精密	2023 年 6 月 29 日	1 个月 内(含)	新股流通 受限	36.90	36.90	1,775	65,497.50	65,497.50	-
301292	海科新源	2023 年 6 月 29 日	6 个月	新股流通 受限	19.99	19.99	583	11,654.17	11,654.17	-
301292	海科新源	2023 年 6 月 29 日	1 个月 内(含)	新股流通 受限	19.99	19.99	5,241	104,767.59	104,767.59	-
301293	三博脑科	2023 年 4 月	6 个月	新股流通 受限	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-

		25 日								
301295	美硕科技	2023 年 6 月 19 日	6 个月	新股流通受限	37.40	36.07	215	8,041.00	7,755.05	-
301301	川宁生物	2022 年 12 月 20 日	6 个月	新股流通受限	5.00	8.96	3,574	17,870.00	32,023.04	-
301305	朗坤环境	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	25.25	19.69	753	19,013.25	14,826.57	-
301315	威士顿	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新股流通受限	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-
301320	豪江智能	2023 年 6 月 1 日	6 个月	新股流通受限	13.06	20.62	642	8,384.52	13,238.04	-
301322	绿通科技	2023 年 2 月 27 日	6 个月	新股流通受限	131.11	53.24	392	34,219.71	20,870.08	-
301323	新莱福	2023 年 5 月 29 日	6 个月	新股流通受限	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08	-
301325	曼恩斯特	2023 年 5 月 4 日	6 个月	新股流通受限	76.80	107.95	364	27,955.20	39,293.80	-
301332	德尔玛	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新股流通受限	14.81	13.73	1,122	16,616.82	15,405.06	-
301337	亚华电子	2023 年 5 月 16 日	6 个月	新股流通受限	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-
301345	涛涛车业	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新股流通受限	73.45	46.64	266	19,537.70	12,406.24	-
301355	南王科技	2023 年 6 月 2 日	6 个月	新股流通受限	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	-
301357	北方长龙	2023 年 4 月 11 日	6 个月	新股流通受限	50.00	48.39	190	9,500.00	9,194.10	-
301358	湖南裕能	2023 年 2 月 1 日	6 个月	新股流通受限	23.77	42.89	1,061	25,219.97	45,506.29	-
301360	荣旗科技	2023	6 个月	新股流通	71.88	92.60	134	9,631.92	12,408.40	-

		年 4 月 17 日		受限						
301373	凌玮科技	2023 年 1 月 20 日	6 个月	新股流通 受限	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45	-
301376	致欧科技	2023 年 6 月 14 日	6 个月	新股流通 受限	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	-
301386	未来电器	2023 年 3 月 21 日	6 个月	新股流通 受限	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62	-
301408	华人健康	2023 年 2 月 22 日	6 个月	新股流通 受限	16.24	16.95	879	14,274.96	14,899.05	-
301419	阿莱德	2023 年 2 月 2 日	6 个月	新股流通 受限	24.80	43.85	330	8,184.00	14,470.50	-
301428	世纪恒通	2023 年 5 月 10 日	6 个月	新股流通 受限	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-
301439	泓淋电力	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新股流通 受限	19.99	16.90	949	18,970.51	16,038.10	-
301486	致尚科技	2023 年 6 月 30 日	6 个月	新股流通 受限	57.66	57.66	482	27,792.12	27,792.12	-
301486	致尚科技	2023 年 6 月 30 日	1 个月 内(含)	新股流通 受限	57.66	57.66	4,338	250,129.08	250,129.08	-
301488	豪恩汽电	2023 年 6 月 26 日	6 个月	新股流通 受限	39.78	39.78	262	10,422.36	10,422.36	-
301488	豪恩汽电	2023 年 6 月 26 日	1 个月 内(含)	新股流通 受限	39.78	39.78	2,356	93,721.68	93,721.68	-
601061	中信金属	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股流通 受限	6.58	7.58	2,667	17,548.86	20,215.86	-
601065	江盐集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通 受限	10.36	11.84	875	9,065.00	10,360.00	-
601133	柏诚股份	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通 受限	11.66	12.26	664	7,742.24	8,140.64	-



601916	浙商银行	2023年6月27日	1个月内(含)	配股未上市	2.02	2.64	100,320	202,646.40	264,844.80	-
603125	常青科技	2023年3月30日	6个月	新股流通受限	25.98	24.53	160	4,156.80	3,924.80	-
603137	恒尚节能	2023年4月10日	6个月	新股流通受限	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51	-
603172	万丰股份	2023年4月28日	6个月	新股流通受限	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-
688146	中船特气	2023年4月13日	6个月	新股流通受限	36.15	38.13	816	29,498.40	31,114.08	-
688249	晶合集成	2023年4月24日	6个月	新股流通受限	19.86	18.06	5,208	103,430.88	94,056.48	-
688334	西高院	2023年6月9日	6个月	新股流通受限	14.16	16.21	888	12,574.08	14,394.48	-
688352	硕中科技	2023年4月11日	6个月	新股流通受限	12.10	12.07	2,361	28,568.10	28,497.27	-
688361	中科飞测	2023年5月12日	6个月	新股流通受限	23.60	64.67	821	19,375.60	53,094.07	-
688429	时创能源	2023年6月20日	6个月	新股流通受限	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-
688433	华曙高科	2023年4月7日	6个月	新股流通受限	26.66	31.50	418	11,143.88	13,167.00	-
688458	美芯晟	2023年5月15日	6个月	新股流通受限	75.00	90.76	221	16,575.00	20,057.96	-
688469	中芯集成	2023年4月28日	6个月	新股流通受限	5.69	5.41	9,812	55,830.28	53,082.92	-
688478	晶升股份	2023年4月13日	6个月	新股流通受限	32.52	42.37	402	13,073.04	17,032.74	-
688479	友车科技	2023年5月	6个月	新股流通受限	33.99	29.49	332	11,284.68	9,790.68	-

		4 日								
688485	九州一轨	2023 年 1 月 11 日	6 个月	新股流通受限	17.47	15.17	3,580	62,542.60	54,308.60	-
688486	龙迅股份	2023 年 2 月 10 日	6 个月	新股流通受限	64.76	105.13	1,887	122,202.12	198,380.31	-
688507	索辰科技	2023 年 4 月 10 日	6 个月	新股流通受限	245.56	122.11	215	35,606.20	26,253.65	-
688512	慧智微	2023 年 5 月 8 日	6 个月	新股流通受限	20.92	19.16	721	15,083.32	13,814.36	-
688523	航天环宇	2023 年 5 月 26 日	6 个月	新股流通受限	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20	-
688531	日联科技	2023 年 3 月 24 日	6 个月	新股流通受限	152.38	135.97	283	43,123.54	38,479.51	-
688535	华海诚科	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股流通受限	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-
688543	国科军工	2023 年 6 月 14 日	6 个月	新股流通受限	43.67	53.05	410	17,904.70	21,750.50	-
688562	航天软件	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06	-
688570	天玛智控	2023 年 5 月 29 日	6 个月	新股流通受限	30.26	25.33	884	26,749.84	22,391.72	-
688581	安杰思	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股流通受限	125.80	118.03	163	20,505.40	19,238.89	-
688582	芯动联科	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新股流通受限	26.74	40.68	648	17,327.52	26,360.64	-
688593	新相微	2023 年 5 月 25 日	6 个月	新股流通受限	11.18	14.59	959	10,721.62	13,991.81	-
688603	天承科技	2023 年 6 月 30 日	6 个月	新股流通受限	55.00	55.00	140	7,700.00	7,700.00	-
688603	天承科技	2023	1 个月	新股流通	55.00	55.00	1,251	68,805.00	68,805.00	-

		年 6 月 30 日	内(含)	受限						
688620	安凯微	2023 年 6 月 15 日	6 个月	新股流通受限	10.68	12.34	1,016	10,850.88	12,537.44	-
688623	双元科技	2023 年 5 月 31 日	6 个月	新股流通受限	125.88	86.79	178	22,406.64	15,448.62	-
688629	华丰科技	2023 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通受限	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	-
688631	莱斯信息	2023 年 6 月 19 日	6 个月	新股流通受限	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

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

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人从事风险管理的目标是提升本基金风险调整后收益水平，保证本基金的基金资产安全，维护基金份额持有人利益。基于该风险管理目标，本基金的基金管理人风险管理的基本策略是识别和分析本基金运作时本基金面临各种类型的风险，确定适当的风

险容忍度，并及时可靠地对各种风险进行监督，将风险控制在限定的范围之内。本基金目前面临的主要风险包括：市场风险、信用风险和流动性风险。

本基金的基金管理人建立了以全面、独立、互相制约以及定性和定量相结合为原则的，监事会、董事会及下设风险控制委员会、督察长、风险管理委员会、法律合规部和风险管理部等多层次的风险管理组织架构体系。

#### 6.4.13.2 信用风险

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

本基金的银行存款存放于本基金的基金托管人，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在证券交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并采用券款对付交割方式，以控制相应的信用风险。

对于与债券投资、资产支持证券投资等投资品种相关的信用风险，本基金的基金管理人通过对投资品种的信用等级评估来选择适当的投资对象，并限制单个投资品种的持有比例来管理信用风险。附注 6.4.13.2.1 至 6.4.13.2.6 列示了本基金所持有的债券投资及资产支持证券投资的信用评级，该信用评级不包括本基金所持有的国债、央行票据、政策性金融债。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

##### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

##### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	78,881.33
未评级	-	-
合计	-	78,881.33

注：上述评级均由经中国证监会核准从事证券市场资信评级业务的评级机构做出。

##### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

### 6.4.13.3 流动性风险

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金流动性风险来源于基金约定开放日兑付赎回资金的流动性风险，以及因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险以及因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。本基金所持有的金融资产主要在证券交易所和银行间同业市场交易。除附注 6.4.12 所披露的流通受限不能自由转让的基金资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。除卖出回购金融资产外，本基金所持有的金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人在基金合同约定巨额赎回条款，设计了非常情况下赎回资金的处理模式，控制因开放模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

日常流动性风险管理中，本基金的基金管理人每日监控和预测本基金的流动性指标，通过对投资品种的流动性指标来持续地评估、选择、跟踪和控制基金投资的流动性风险。同时，本基金通过预留一定的现金头寸，并且在需要时可通过卖出回购金融资产方式融入短期资金，以缓解流动性风险。

本基金按合同约定申购赎回可采用一篮子股票的形式或现金替代方式，流动性风险相对较低。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

## 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	12,631,961.90	-	-	-	12,631,961.90
结算备付金	390,220.89	-	-	-	390,220.89
存出保证金	86,692.02	-	-	-	86,692.02
交易性金融资产	-	-	-	789,788,980.27	789,788,980.27
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	687,908.19	687,908.19
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	13,108,874.81	-	-	790,476,888.46	803,585,763.27
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	328,288.14	328,288.14
应付托管费	-	-	-	65,657.63	65,657.63
应付清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,228,714.35	1,228,714.35
负债总计	-	-	-	1,622,660.12	1,622,660.12
利率敏感度缺口	13,108,874.81	-	-	788,854,228.34	801,963,103.15
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	23,854,891.31	-	-	-	23,854,891.31
结算备付金	133,400.47	-	-	-	133,400.47
存出保证金	12,823.22	-	-	-	12,823.22
交易性金融资产	-	-	78,881.33	827,588,258.00	827,667,139.33
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-

应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	1,064,188.64	1,064,188.64
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	24,001,115.00	-	78,881.33	828,652,446.64	852,732,442.97
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	275,973.58	275,973.58
应付托管费	-	-	-	55,194.71	55,194.71
应付清算款	-	-	-	19,838,980.37	19,838,980.37
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	0.44	0.44
其他负债	-	-	-	1,104,676.62	1,104,676.62
负债总计	-	-	-	21,274,825.72	21,274,825.72
利率敏感度缺口	24,001,115.00	-	78,881.33	807,377,620.92	831,457,617.25

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1.若市场利率平行上升或下降 50 个基点		
	2.其他市场变量保持不变		
	3.仅存在公允价值变动对基金资产净值的影响		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
		1. 市场利率平行上升 50 个基点	-
	2. 市场利率平行下降 50 个基点	-	2,357.21

#### 6.4.13.4.2 其他价格风险

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

##### 6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产-股票投资	789,788,980.27	98.48	827,588,258.00	99.53
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	789,788,980.27	98.48	827,588,258.00	99.53

#### 6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1.若对市场价格敏感的权益性投资的市场价格上升或下降 5%		
	2.其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	1. 权益性投资的市场价格上升 5%	39,489,449.01	41,379,412.90
	2. 权益性投资的市场价格下降 5%	-39,489,449.01	-41,379,412.90

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日
第一层次	787,656,992.35
第二层次	726,804.90
第三层次	1,405,183.02
合计	789,788,980.27

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动



本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无需要说明有助于理解和分析会计报表的其他事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	789,788,980.27	98.28
	其中：股票	789,788,980.27	98.28
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	13,022,182.79	1.62
8	其他资产	774,600.21	0.10
9	合计	803,585,763.27	100.00

注：此处的股票投资项含可退替代款估值增值。

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	8,425,667.30	1.05
B	采矿业	34,799,292.34	4.34
C	制造业	444,694,506.73	55.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	30,414,192.80	3.79
E	建筑业	17,805,858.20	2.22
F	批发和零售业	8,618,011.88	1.07
G	交通运输、仓储和邮政业	26,476,226.88	3.30
H	住宿和餐饮业	1,211,560.00	0.15
I	信息传输、软件和信息技术服务业	38,789,405.51	4.84
J	金融业	140,740,106.77	17.55
K	房地产业	12,011,054.08	1.50
L	租赁和商务服务业	7,265,889.00	0.91
M	科学研究和技术服务业	5,343,113.07	0.67
N	水利、环境和公共设施管理业	1,042,605.70	0.13
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	583,740.00	0.07
Q	卫生和社会工作	5,373,797.05	0.67
R	文化、体育和娱乐业	2,964,655.00	0.37
S	综合	1,065,287.00	0.13
	合计	787,624,969.31	98.21

### 7.2.2 期末积极投资按行业分类境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,844,855.21	0.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.00
E	建筑业	10,516.15	0.00
F	批发和零售业	70,255.55	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	87,884.07	0.01
J	金融业	-	-

K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	14,394.48	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	76,875.17	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	23,782.86	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,164,010.96	0.27

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	25,367	42,895,597.00	5.35
2	300750	宁德时代	88,620	20,275,369.80	2.53
3	600036	招商银行	415,440	13,609,814.40	1.70
4	000858	五粮液	78,100	12,774,817.00	1.59
5	600900	长江电力	476,500	10,511,590.00	1.31
6	601318	中国平安	218,200	10,124,480.00	1.26
7	002594	比亚迪	36,500	9,426,855.00	1.18
8	300760	迈瑞医疗	24,480	7,339,104.00	0.92
9	601166	兴业银行	418,300	6,546,395.00	0.82
10	000568	泸州老窖	29,700	6,224,229.00	0.78
11	600276	恒瑞医药	128,432	6,151,892.80	0.77
12	601398	工商银行	1,266,600	6,105,012.00	0.76
13	601288	农业银行	1,714,100	6,050,773.00	0.75
14	600309	万华化学	63,196	5,551,136.64	0.69
15	601138	工业富联	199,900	5,037,480.00	0.63
16	600030	中信证券	246,620	4,878,143.60	0.61
17	601668	中国建筑	844,400	4,846,856.00	0.60
18	601899	紫金矿业	414,600	4,714,002.00	0.59
19	002475	立讯精密	143,469	4,655,569.05	0.58
20	002714	牧原股份	110,062	4,639,113.30	0.58
21	601328	交通银行	790,200	4,583,160.00	0.57

22	600809	山西汾酒	24,595	4,551,796.65	0.57
23	300059	东方财富	319,313	4,534,244.60	0.57
24	002352	顺丰控股	98,600	4,445,874.00	0.55
25	000001	平安银行	390,700	4,387,561.00	0.55
26	601012	隆基绿能	152,735	4,378,912.45	0.55
27	603288	海天味业	93,303	4,371,245.55	0.55
28	688111	金山办公	9,200	4,344,424.00	0.54
29	601888	中国中免	39,300	4,343,829.00	0.54
30	600000	浦发银行	590,900	4,278,116.00	0.53
31	601088	中国神华	132,808	4,083,846.00	0.51
32	600028	中国石化	638,500	4,060,860.00	0.51
33	002304	洋河股份	30,400	3,993,040.00	0.50
34	600406	国电南瑞	161,694	3,735,131.40	0.47
35	000063	中兴通讯	80,100	3,647,754.00	0.45
36	600887	伊利股份	128,800	3,647,616.00	0.45
37	601601	中国太保	137,800	3,580,044.00	0.45
38	601225	陕西煤业	195,200	3,550,688.00	0.44
39	600436	片仔癀	12,300	3,522,228.00	0.44
40	300274	阳光电源	29,950	3,493,068.50	0.44
41	300015	爱尔眼科	187,851	3,484,636.05	0.43
42	601816	京沪高铁	659,100	3,466,866.00	0.43
43	002371	北方华创	10,600	3,367,090.00	0.42
44	002142	宁波银行	132,930	3,363,129.00	0.42
45	601857	中国石油	434,600	3,246,462.00	0.40
46	603259	药明康德	51,737	3,223,732.47	0.40
47	601766	中国中车	489,800	3,183,700.00	0.40
48	002230	科大讯飞	46,700	3,173,732.00	0.40
49	600048	保利发展	240,900	3,138,927.00	0.39
50	601390	中国中铁	413,700	3,135,846.00	0.39
51	600905	三峡能源	576,400	3,095,268.00	0.39
52	000725	京东方 A	755,100	3,088,359.00	0.39
53	600050	中国联通	640,500	3,074,400.00	0.38
54	600690	海尔智家	127,000	2,981,960.00	0.37
55	600150	中国船舶	90,100	2,965,191.00	0.37
56	601818	光大银行	934,400	2,868,608.00	0.36
57	601658	邮储银行	585,400	2,862,606.00	0.36
58	600438	通威股份	82,800	2,840,868.00	0.35
59	600031	三一重工	168,900	2,808,807.00	0.35
60	002459	晶澳科技	66,428	2,770,047.60	0.35
61	601988	中国银行	707,300	2,765,543.00	0.34
62	000002	万科 A	195,800	2,745,116.00	0.34
63	002129	TCL 中环	81,475	2,704,970.00	0.34
64	601985	中国核电	380,000	2,679,000.00	0.33

65	600016	民生银行	714,000	2,677,500.00	0.33
66	600019	宝钢股份	448,300	2,519,446.00	0.31
67	300014	亿纬锂能	41,113	2,487,336.50	0.31
68	300498	温氏股份	131,900	2,420,365.00	0.30
69	601919	中远海控	256,620	2,412,228.00	0.30
70	300308	中际旭创	16,200	2,388,690.00	0.30
71	002493	荣盛石化	203,774	2,371,929.36	0.30
72	603501	韦尔股份	23,915	2,344,626.60	0.29
73	688036	传音控股	15,800	2,322,600.00	0.29
74	600893	航发动力	53,700	2,269,362.00	0.28
75	601006	大秦铁路	299,300	2,223,799.00	0.28
76	600104	上汽集团	156,868	2,222,819.56	0.28
77	600919	江苏银行	297,440	2,186,184.00	0.27
78	000625	长安汽车	166,708	2,155,534.44	0.27
79	300122	智飞生物	48,200	2,130,440.00	0.27
80	601211	国泰君安	151,400	2,118,086.00	0.26
81	601066	中信建投	87,309	2,112,877.80	0.26
82	000166	申万宏源	453,700	2,096,094.00	0.26
83	000792	盐湖股份	109,300	2,095,281.00	0.26
84	002466	天齐锂业	29,800	2,083,318.00	0.26
85	000651	格力电器	56,700	2,070,117.00	0.26
86	601688	华泰证券	148,200	2,040,714.00	0.25
87	001979	招商蛇口	155,900	2,031,377.00	0.25
88	600346	恒力石化	141,700	2,030,561.00	0.25
89	000596	古井贡酒	8,200	2,028,516.00	0.25
90	600999	招商证券	149,480	2,028,443.60	0.25
91	601669	中国电建	346,900	1,991,206.00	0.25
92	002027	分众传媒	290,800	1,980,348.00	0.25
93	002460	赣锋锂业	32,460	1,978,761.60	0.25
94	601169	北京银行	425,700	1,970,991.00	0.25
95	601628	中国人寿	56,015	1,958,284.40	0.24
96	688012	中微公司	12,300	1,924,335.00	0.24
97	300896	爱美客	4,300	1,913,285.00	0.24
98	600585	海螺水泥	80,400	1,908,696.00	0.24
99	600886	国投电力	150,200	1,900,030.00	0.24
100	000538	云南白药	36,140	1,896,627.20	0.24
101	603993	洛阳钼业	355,700	1,895,881.00	0.24
102	300033	同花顺	10,800	1,893,024.00	0.24
103	688223	晶科能源	134,200	1,886,852.00	0.24
104	300316	晶盛机电	26,400	1,871,760.00	0.23
105	688599	天合光能	43,900	1,870,579.00	0.23
106	600989	宝丰能源	147,800	1,863,758.00	0.23
107	000938	紫光股份	57,600	1,834,560.00	0.23

108	600845	宝信软件	35,589	1,808,277.09	0.23
109	601360	三六零	143,800	1,803,252.00	0.22
110	601689	拓普集团	22,300	1,799,610.00	0.22
111	600837	海通证券	194,400	1,792,368.00	0.22
112	000776	广发证券	119,200	1,753,432.00	0.22
113	002812	恩捷股份	18,100	1,743,935.00	0.22
114	600111	北方稀土	72,700	1,743,346.00	0.22
115	600089	特变电工	78,200	1,743,078.00	0.22
116	601100	恒立液压	26,982	1,735,752.06	0.22
117	600703	三安光电	100,400	1,730,896.00	0.22
118	002920	德赛西威	11,100	1,729,491.00	0.22
119	300124	汇川技术	26,800	1,720,828.00	0.21
120	600011	华能国际	184,600	1,709,396.00	0.21
121	600547	山东黄金	72,708	1,707,183.84	0.21
122	000895	双汇发展	69,700	1,706,953.00	0.21
123	000338	潍柴动力	136,500	1,700,790.00	0.21
124	600570	恒生电子	38,220	1,692,763.80	0.21
125	601009	南京银行	208,200	1,665,600.00	0.21
126	601229	上海银行	285,994	1,644,465.50	0.21
127	600010	包钢股份	917,800	1,642,862.00	0.20
128	000425	徐工机械	237,800	1,609,906.00	0.20
129	002049	紫光国微	17,240	1,607,630.00	0.20
130	002709	天赐材料	38,720	1,594,876.80	0.20
131	600085	同仁堂	27,600	1,588,656.00	0.20
132	002311	海大集团	33,400	1,564,456.00	0.20
133	688256	寒武纪	8,300	1,560,400.00	0.19
134	002555	三七互娱	44,600	1,555,648.00	0.19
135	603659	璞泰来	40,530	1,549,056.60	0.19
136	601336	新华保险	41,900	1,540,663.00	0.19
137	600188	兖矿能源	51,200	1,531,904.00	0.19
138	000963	华东医药	35,300	1,530,961.00	0.19
139	601868	中国能建	652,900	1,527,786.00	0.19
140	600600	青岛啤酒	14,400	1,492,272.00	0.19
141	000100	TCL 科技	378,090	1,489,674.60	0.19
142	000301	东方盛虹	125,200	1,479,864.00	0.18
143	603799	华友钴业	32,194	1,478,026.54	0.18
144	601600	中国铝业	266,000	1,460,340.00	0.18
145	600958	东方证券	150,424	1,459,112.80	0.18
146	688303	大全能源	36,000	1,456,200.00	0.18
147	600660	福耀玻璃	40,300	1,444,755.00	0.18
148	600015	华夏银行	266,900	1,443,929.00	0.18
149	600039	四川路桥	146,320	1,435,399.20	0.18
150	603986	兆易创新	13,508	1,435,225.00	0.18

151	000977	浪潮信息	29,532	1,432,302.00	0.18
152	601618	中国中冶	359,500	1,427,215.00	0.18
153	600588	用友网络	69,060	1,415,730.00	0.18
154	600926	杭州银行	119,500	1,404,125.00	0.18
155	603806	福斯特	37,462	1,393,211.78	0.17
156	601995	中金公司	39,200	1,392,384.00	0.17
157	688396	华润微	26,400	1,383,624.00	0.17
158	600795	国电电力	359,200	1,375,736.00	0.17
159	600029	南方航空	226,100	1,363,383.00	0.17
160	600674	川投能源	89,900	1,352,995.00	0.17
161	603369	今世缘	25,300	1,335,840.00	0.17
162	002236	大华股份	67,000	1,323,250.00	0.17
163	601865	福莱特	34,200	1,317,042.00	0.16
164	600196	复星医药	42,600	1,316,340.00	0.16
165	600221	海航控股	831,900	1,314,402.00	0.16
166	600426	华鲁恒升	42,650	1,306,369.50	0.16
167	688008	澜起科技	22,700	1,303,434.00	0.16
168	605117	德业股份	8,640	1,292,112.00	0.16
169	601111	中国国航	156,200	1,287,088.00	0.16
170	300413	芒果超媒	37,600	1,286,296.00	0.16
171	601607	上海医药	56,000	1,254,960.00	0.16
172	601633	长城汽车	49,800	1,253,466.00	0.16
173	601788	光大证券	78,600	1,248,954.00	0.16
174	600745	闻泰科技	25,100	1,227,390.00	0.15
175	002241	歌尔股份	68,400	1,214,100.00	0.15
176	000999	华润三九	20,000	1,213,200.00	0.15
177	601939	建设银行	193,200	1,209,432.00	0.15
178	601877	正泰电器	43,200	1,194,480.00	0.15
179	300433	蓝思科技	100,100	1,177,176.00	0.15
180	600741	华域汽车	63,500	1,172,210.00	0.15
181	601727	上海电气	254,801	1,164,440.57	0.15
182	300999	金龙鱼	29,100	1,163,709.00	0.15
183	688126	沪硅产业	55,100	1,151,590.00	0.14
184	601916	浙商银行	434,720	1,147,660.80	0.14
185	600009	上海机场	25,118	1,140,859.56	0.14
186	600023	浙能电力	225,000	1,140,750.00	0.14
187	603392	万泰生物	17,084	1,140,698.68	0.14
188	600176	中国巨石	80,525	1,140,234.00	0.14
189	002602	世纪华通	150,120	1,139,410.80	0.14
190	601021	春秋航空	19,800	1,137,906.00	0.14
191	300408	三环集团	38,600	1,132,910.00	0.14
192	600732	爱旭股份	36,740	1,129,755.00	0.14
193	002736	国信证券	129,000	1,126,170.00	0.14

194	603260	合盛硅业	16,000	1,120,320.00	0.14
195	600584	长电科技	35,800	1,115,886.00	0.14
196	601319	中国人保	190,600	1,113,104.00	0.14
197	601127	赛力斯	30,200	1,110,454.00	0.14
198	600027	华电国际	164,600	1,101,174.00	0.14
199	000661	长春高新	8,076	1,100,758.80	0.14
200	600115	中国东航	229,742	1,093,571.92	0.14
201	600522	中天科技	68,700	1,093,017.00	0.14
202	002050	三花智控	36,100	1,092,386.00	0.14
203	601901	方正证券	164,700	1,077,138.00	0.13
204	000876	新希望	91,400	1,067,552.00	0.13
205	601377	兴业证券	173,770	1,063,472.40	0.13
206	601825	沪农商行	194,200	1,058,390.00	0.13
207	600875	东方电气	56,000	1,044,400.00	0.13
208	000983	山西焦煤	114,420	1,041,222.00	0.13
209	601238	广汽集团	99,100	1,032,622.00	0.13
210	300782	卓胜微	10,656	1,029,689.28	0.13
211	601117	中国化学	123,100	1,019,268.00	0.13
212	002252	上海莱士	135,700	1,019,107.00	0.13
213	002648	卫星化学	67,747	1,013,495.12	0.13
214	600233	圆通速递	69,300	1,009,008.00	0.13
215	600489	中金黄金	97,600	1,008,208.00	0.13
216	601881	中国银河	86,600	1,005,426.00	0.13
217	000733	振华科技	10,400	996,840.00	0.12
218	600803	新奥股份	52,100	988,858.00	0.12
219	002074	国轩高科	35,800	988,796.00	0.12
220	601699	潞安环能	60,300	984,096.00	0.12
221	002600	领益智造	141,600	978,456.00	0.12
222	002180	纳思达	28,500	976,125.00	0.12
223	300418	昆仑万维	24,100	970,748.00	0.12
224	603833	欧派家居	10,120	969,496.00	0.12
225	600918	中泰证券	140,300	969,473.00	0.12
226	000157	中联重科	142,800	963,900.00	0.12
227	002001	新和成	62,208	958,003.20	0.12
228	002841	视源股份	14,200	949,128.00	0.12
229	601872	招商轮船	163,600	947,244.00	0.12
230	300751	迈为股份	5,588	946,495.44	0.12
231	002938	鹏鼎控股	38,900	944,881.00	0.12
232	600415	小商品城	110,400	941,712.00	0.12
233	300454	深信服	8,300	939,975.00	0.12
234	300832	新产业	15,900	938,100.00	0.12
235	600515	海南机场	230,000	933,800.00	0.12
236	600061	国投资本	129,400	921,328.00	0.11



237	601838	成都银行	75,100	916,971.00	0.11
238	688777	中控技术	14,500	910,310.00	0.11
239	600256	广汇能源	132,100	906,206.00	0.11
240	600332	白云山	28,300	902,204.00	0.11
241	603486	科沃斯	11,600	902,132.00	0.11
242	600161	天坛生物	33,200	901,380.00	0.11
243	000066	中国长城	64,900	897,567.00	0.11
244	600132	重庆啤酒	9,700	893,952.00	0.11
245	002384	东山精密	34,400	890,960.00	0.11
246	300628	亿联网络	25,400	890,778.00	0.11
247	000807	云铝股份	69,800	888,554.00	0.11
248	300496	中科创达	9,200	886,420.00	0.11
249	600079	人福医药	32,900	886,326.00	0.11
250	600026	中远海能	70,000	884,800.00	0.11
251	002422	科伦药业	29,600	878,528.00	0.11
252	603345	安井食品	5,900	866,120.00	0.11
253	002603	以岭药业	33,640	864,211.60	0.11
254	600460	士兰微	28,500	862,695.00	0.11
255	603198	迎驾贡酒	13,500	861,300.00	0.11
256	300142	沃森生物	32,400	856,980.00	0.11
257	688363	华熙生物	9,600	855,936.00	0.11
258	300003	乐普医疗	37,800	854,658.00	0.11
259	300223	北京君正	9,600	847,776.00	0.11
260	603899	晨光股份	18,800	839,232.00	0.10
261	688009	中国通号	144,600	838,680.00	0.10
262	000786	北新建材	34,000	833,340.00	0.10
263	600702	舍得酒业	6,700	830,465.00	0.10
264	300763	锦浪科技	7,900	822,390.00	0.10
265	002007	华兰生物	36,690	822,222.90	0.10
266	300146	汤臣倍健	34,200	820,116.00	0.10
267	603688	石英股份	7,200	819,648.00	0.10
268	600536	中国软件	17,360	813,836.80	0.10
269	002821	凯莱英	6,840	806,162.40	0.10
270	002463	沪电股份	38,120	798,232.80	0.10
271	002601	龙佰集团	48,000	792,000.00	0.10
272	600362	江西铜业	41,700	791,466.00	0.10
273	300724	捷佳伟创	7,000	786,450.00	0.10
274	300037	新宙邦	15,120	784,576.80	0.10
275	600754	锦江酒店	18,500	783,290.00	0.10
276	002916	深南电路	10,240	771,788.80	0.10
277	000988	华工科技	20,300	771,603.00	0.10
278	601615	明阳智能	45,700	771,416.00	0.10
279	601878	浙商证券	78,000	770,640.00	0.10

280	002568	百润股份	21,168	769,456.80	0.10
281	300759	康龙化成	20,050	767,514.00	0.10
282	300661	圣邦股份	9,230	758,059.90	0.09
283	300957	贝泰妮	8,500	755,480.00	0.09
284	603939	益丰药房	20,410	755,170.00	0.09
285	600160	巨化股份	54,400	749,632.00	0.09
286	600018	上港集团	140,500	737,625.00	0.09
287	002202	金风科技	69,400	737,028.00	0.09
288	603290	斯达半导	3,400	731,680.00	0.09
289	002223	鱼跃医疗	20,300	730,597.00	0.09
290	600487	亨通光电	49,800	730,068.00	0.09
291	002028	思源电气	15,600	728,832.00	0.09
292	002738	中矿资源	14,288	727,830.72	0.09
293	000069	华侨城 A	165,100	726,440.00	0.09
294	688122	西部超导	13,020	725,604.60	0.09
295	601958	金钼股份	65,000	724,750.00	0.09
296	002558	巨人网络	40,300	722,579.00	0.09
297	688521	芯原股份	10,000	719,200.00	0.09
298	000408	藏格矿业	31,800	717,726.00	0.09
299	002340	格林美	103,300	713,803.00	0.09
300	000423	东阿阿胶	13,320	711,954.00	0.09
301	600219	南山铝业	235,700	711,814.00	0.09
302	688561	奇安信	13,700	709,797.00	0.09
303	603882	金域医学	9,400	709,700.00	0.09
304	000729	燕京啤酒	56,800	708,296.00	0.09
305	601799	星宇股份	5,700	704,520.00	0.09
306	601058	赛轮轮胎	61,700	702,763.00	0.09
307	002294	信立泰	22,500	701,775.00	0.09
308	688063	派能科技	3,532	700,219.00	0.09
309	688099	晶晨股份	8,300	699,856.00	0.09
310	601555	东吴证券	100,843	699,850.42	0.09
311	601216	君正集团	169,800	696,180.00	0.09
312	603737	三棵树	10,584	692,405.28	0.09
313	002409	雅克科技	9,500	692,360.00	0.09
314	600642	申能股份	98,800	690,612.00	0.09
315	002156	通富微电	30,500	689,300.00	0.09
316	600884	杉杉股份	45,500	688,870.00	0.09
317	603444	吉比特	1,400	687,554.00	0.09
318	603885	吉祥航空	44,500	686,635.00	0.09
319	002064	华峰化学	99,900	685,314.00	0.09
320	002430	杭氧股份	19,900	683,764.00	0.09
321	600004	白云机场	47,600	682,584.00	0.09
322	603606	东方电缆	13,900	681,517.00	0.08

323	600705	中航产融	177,700	680,591.00	0.08
324	600970	中材国际	53,300	679,575.00	0.08
325	000629	钒钛股份	173,200	677,212.00	0.08
326	601108	财通证券	93,520	677,084.80	0.08
327	300919	中伟股份	11,200	674,800.00	0.08
328	002756	永兴材料	10,770	674,309.70	0.08
329	002080	中材科技	32,600	668,952.00	0.08
330	002414	高德红外	86,089	668,911.53	0.08
331	600183	生益科技	47,000	667,400.00	0.08
332	000932	华菱钢铁	139,100	663,507.00	0.08
333	002939	长城证券	81,400	661,782.00	0.08
334	601966	玲珑轮胎	29,769	661,467.18	0.08
335	002625	光启技术	43,300	660,758.00	0.08
336	600153	建发股份	60,500	660,055.00	0.08
337	002624	完美世界	39,050	659,554.50	0.08
338	000723	美锦能源	87,200	657,488.00	0.08
339	600383	金地集团	90,900	655,389.00	0.08
340	000975	银泰黄金	55,980	654,966.00	0.08
341	300144	宋城演艺	52,760	654,224.00	0.08
342	601155	新城控股	45,288	652,600.08	0.08
343	603596	伯特利	8,200	649,932.00	0.08
344	600109	国金证券	74,900	649,383.00	0.08
345	600606	绿地控股	235,800	648,450.00	0.08
346	000738	航发控制	26,500	646,600.00	0.08
347	000783	长江证券	111,200	644,960.00	0.08
348	603233	大参林	23,014	644,622.14	0.08
349	601233	桐昆股份	48,400	641,300.00	0.08
350	002153	石基信息	45,679	639,506.00	0.08
351	601077	渝农商行	178,000	639,020.00	0.08
352	600298	安琪酵母	17,600	637,296.00	0.08
353	002372	伟星新材	31,000	636,740.00	0.08
354	600157	永泰能源	447,400	635,308.00	0.08
355	603816	顾家家居	16,610	633,671.50	0.08
356	688220	翱捷科技	8,400	633,276.00	0.08
357	000027	深圳能源	95,800	631,322.00	0.08
358	600096	云天化	36,900	629,883.00	0.08
359	603156	养元饮品	25,500	629,850.00	0.08
360	601577	长沙银行	80,900	627,784.00	0.08
361	000021	深科技	31,400	627,686.00	0.08
362	000009	中国宝安	52,000	627,640.00	0.08
363	300487	蓝晓科技	10,050	627,321.00	0.08
364	002850	科达利	4,700	621,575.00	0.08
365	600763	通策医疗	6,400	619,904.00	0.08

366	600563	法拉电子	4,500	617,850.00	0.08
367	603658	安图生物	11,900	615,587.00	0.08
368	000630	铜陵有色	212,000	612,680.00	0.08
369	600352	浙江龙盛	65,500	612,425.00	0.08
370	300207	欣旺达	37,500	612,000.00	0.08
371	000032	深桑达 A	18,600	611,940.00	0.08
372	600021	上海电力	56,800	611,736.00	0.08
373	603185	上机数控	8,200	611,310.00	0.08
374	688169	石头科技	1,900	609,292.00	0.08
375	300769	德方纳米	5,520	608,469.60	0.08
376	688187	时代电气	14,500	606,970.00	0.08
377	601990	南京证券	74,200	606,956.00	0.08
378	300390	天华新能	16,830	602,514.00	0.08
379	603589	口子窖	12,200	602,070.00	0.08
380	002078	太阳纸业	56,300	601,847.00	0.08
381	002056	横店东磁	32,800	597,288.00	0.07
382	601696	中银证券	56,000	596,960.00	0.07
383	603568	伟明环保	34,070	596,565.70	0.07
384	600511	国药股份	15,300	594,405.00	0.07
385	002185	华天科技	64,500	593,400.00	0.07
386	601880	辽港股份	379,100	591,396.00	0.07
387	688180	君实生物	15,300	589,662.00	0.07
388	300118	东方日升	23,000	589,490.00	0.07
389	000933	神火股份	45,300	588,900.00	0.07
390	300604	长川科技	12,400	588,876.00	0.07
391	600177	雅戈尔	93,200	588,092.00	0.07
392	002152	广电运通	50,100	587,172.00	0.07
393	002240	盛新锂能	18,400	586,408.00	0.07
394	000831	中国稀土	19,800	586,080.00	0.07
395	000799	酒鬼酒	6,500	585,975.00	0.07
396	600872	中炬高新	15,900	584,961.00	0.07
397	688516	奥特维	3,100	584,040.00	0.07
398	688390	固德威	3,500	584,010.00	0.07
399	002607	中公教育	124,200	583,740.00	0.07
400	600998	九州通	56,173	583,075.74	0.07
401	688032	禾迈股份	1,639	582,090.85	0.07
402	600378	昊华科技	15,400	579,656.00	0.07
403	600779	水井坊	9,800	578,102.00	0.07
404	600546	山煤国际	39,900	577,353.00	0.07
405	688301	奕瑞科技	2,040	576,157.20	0.07
406	600985	淮北矿业	50,000	576,000.00	0.07
407	600848	上海临港	48,140	575,273.00	0.07
408	002128	电投能源	43,500	575,070.00	0.07

409	600348	华阳股份	72,550	573,870.50	0.07
410	300601	康泰生物	22,580	573,306.20	0.07
411	000728	国元证券	87,840	572,716.80	0.07
412	601933	永辉超市	182,800	572,164.00	0.07
413	002673	西部证券	90,100	572,135.00	0.07
414	603338	浙江鼎力	10,148	568,389.48	0.07
415	688536	思瑞浦	2,600	566,800.00	0.07
416	002532	天山铝业	93,700	561,263.00	0.07
417	002044	美年健康	78,700	559,557.00	0.07
418	002120	韵达股份	58,440	558,686.40	0.07
419	688188	柏楚电子	2,960	558,137.60	0.07
420	002405	四维图新	47,800	553,524.00	0.07
421	601231	环旭电子	37,000	553,520.00	0.07
422	002531	天顺风能	36,300	552,849.00	0.07
423	002244	滨江集团	62,600	552,132.00	0.07
424	601991	大唐发电	166,500	551,115.00	0.07
425	002385	大北农	83,500	551,100.00	0.07
426	600521	华海药业	29,890	550,274.90	0.07
427	002739	万达电影	43,800	549,252.00	0.07
428	300595	欧普康视	18,140	547,646.60	0.07
429	600549	厦门钨业	28,600	544,258.00	0.07
430	603613	国联股份	14,714	543,388.02	0.07
431	600566	济川药业	18,700	543,048.00	0.07
432	600486	扬农化工	6,200	542,004.00	0.07
433	002032	苏泊尔	10,800	540,000.00	0.07
434	600655	豫园股份	78,400	537,824.00	0.07
435	688385	复旦微电	10,700	536,070.00	0.07
436	000987	越秀资本	84,215	534,765.25	0.07
437	000591	太阳能	78,600	532,908.00	0.07
438	600873	梅花生物	59,300	529,549.00	0.07
439	688728	格科微	33,300	526,806.00	0.07
440	600481	双良节能	37,600	525,648.00	0.07
441	301236	软通动力	19,250	523,792.50	0.07
442	000683	远兴能源	72,800	523,432.00	0.07
443	000800	一汽解放	62,500	523,125.00	0.07
444	601198	东兴证券	65,090	522,021.80	0.07
445	600583	海油工程	89,100	521,235.00	0.06
446	002353	杰瑞股份	20,700	520,191.00	0.06
447	300699	光威复材	16,820	518,897.00	0.06
448	600704	物产中大	104,600	516,724.00	0.06
449	000960	锡业股份	33,100	514,705.00	0.06
450	603893	瑞芯微	7,000	509,950.00	0.06
451	300073	当升科技	10,100	508,333.00	0.06

452	000519	中兵红箭	28,100	508,329.00	0.06
453	300395	菲利华	10,300	506,760.00	0.06
454	605358	立昂微	13,700	503,201.00	0.06
455	601168	西部矿业	47,800	502,378.00	0.06
456	000703	恒逸石化	73,670	499,482.60	0.06
457	603456	九洲药业	18,200	498,316.00	0.06
458	300676	华大基因	8,300	497,917.00	0.06
459	600141	兴发集团	22,400	497,728.00	0.06
460	000513	丽珠集团	12,700	494,157.00	0.06
461	600380	健康元	38,800	493,148.00	0.06
462	601866	中远海发	199,300	492,271.00	0.06
463	600369	西南证券	133,800	488,370.00	0.06
464	688005	容百科技	9,000	486,180.00	0.06
465	600699	均胜电子	27,560	486,158.40	0.06
466	002508	老板电器	19,200	485,568.00	0.06
467	002797	第一创业	84,700	484,484.00	0.06
468	300347	泰格医药	7,500	484,050.00	0.06
469	600170	上海建工	179,300	482,317.00	0.06
470	002299	圣农发展	25,100	480,665.00	0.06
471	002465	海格通信	46,300	478,742.00	0.06
472	601016	节能风电	130,440	478,714.80	0.06
473	600038	中直股份	12,000	477,840.00	0.06
474	600598	北大荒	35,800	477,214.00	0.06
475	002268	电科网安	17,100	476,577.00	0.06
476	603517	绝味食品	12,800	475,520.00	0.06
477	300251	光线传媒	58,700	474,883.00	0.06
478	600516	方大炭素	76,527	474,467.40	0.06
479	002518	科士达	11,800	472,118.00	0.06
480	603712	七一二	15,600	471,276.00	0.06
481	603529	爱玛科技	14,600	470,412.00	0.06
482	000709	河钢股份	207,900	469,854.00	0.06
483	601636	旗滨集团	54,100	466,342.00	0.06
484	603858	步长制药	22,346	460,104.14	0.06
485	600688	上海石化	147,700	459,347.00	0.06
486	002145	中核钛白	77,925	458,978.25	0.06
487	002831	裕同科技	18,800	458,532.00	0.06
488	002966	苏州银行	69,900	457,845.00	0.06
489	002065	东华软件	64,600	456,076.00	0.06
490	000050	深天马 A	49,600	455,328.00	0.06
491	600392	盛和资源	35,300	454,311.00	0.06
492	000937	冀中能源	71,100	453,618.00	0.06
493	600559	老白干酒	18,500	453,435.00	0.06
494	600988	赤峰黄金	33,500	450,910.00	0.06

495	300212	易华录	13,500	448,605.00	0.06
496	000825	太钢不锈	115,500	446,985.00	0.06
497	002266	浙富控股	108,000	446,040.00	0.06
498	600499	科达制造	39,200	445,312.00	0.06
499	300568	星源材质	25,879	444,860.01	0.06
500	300438	鹏辉能源	9,200	441,968.00	0.06
501	603707	健友股份	32,597	440,059.50	0.05
502	002926	华西证券	52,900	439,599.00	0.05
503	688779	长远锂科	39,000	439,530.00	0.05
504	600673	东阳光	60,700	437,647.00	0.05
505	601456	国联证券	48,000	436,800.00	0.05
506	603077	和邦生物	177,900	432,297.00	0.05
507	000893	亚钾国际	18,800	431,272.00	0.05
508	002407	多氟多	21,660	430,167.60	0.05
509	600258	首旅酒店	22,600	428,270.00	0.05
510	000155	川能动力	29,700	427,680.00	0.05
511	002507	涪陵榨菜	23,340	427,355.40	0.05
512	000739	普洛药业	23,800	422,212.00	0.05
513	300373	扬杰科技	10,300	417,871.00	0.05
514	002497	雅化集团	23,300	414,274.00	0.05
515	002791	坚朗五金	6,400	414,144.00	0.05
516	002176	江特电机	34,400	410,048.00	0.05
517	000998	隆平高科	26,600	408,310.00	0.05
518	000830	鲁西化工	38,600	407,616.00	0.05
519	300558	贝达药业	8,400	403,452.00	0.05
520	002500	山西证券	72,210	402,931.80	0.05
521	002541	鸿路钢构	13,970	402,475.70	0.05
522	002487	大金重工	13,000	400,920.00	0.05
523	688002	睿创微纳	8,900	398,720.00	0.05
524	603218	日月股份	20,800	394,992.00	0.05
525	600056	中国医药	30,100	390,698.00	0.05
526	002138	顺络电子	16,300	389,733.00	0.05
527	000401	冀东水泥	52,500	386,925.00	0.05
528	603127	昭衍新药	9,044	369,899.60	0.05
529	300529	健帆生物	15,930	369,257.40	0.05
530	601992	金隅集团	168,000	366,240.00	0.05
531	002408	齐翔腾达	57,300	365,001.00	0.05
532	300357	我武生物	10,500	353,115.00	0.04
533	601666	平煤股份	46,500	350,610.00	0.04
534	002192	融捷股份	5,200	347,516.00	0.04
535	002092	中泰化学	52,500	338,625.00	0.04
536	600801	华新水泥	27,400	338,390.00	0.04
537	600338	西藏珠峰	18,500	337,810.00	0.04

538	600885	宏发股份	10,440	332,514.00	0.04
539	603866	桃李面包	32,162	325,479.44	0.04
540	300363	博腾股份	10,900	322,531.00	0.04
541	002030	达安基因	28,324	282,390.28	0.04

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	301486	致尚科技	4,820	277,921.20	0.03
2	688486	龙迅股份	1,887	198,380.31	0.02
3	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.01
4	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.01
5	688249	晶合集成	5,208	94,056.48	0.01
6	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.01
7	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.01
8	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.01
9	688485	九州一轨	3,580	54,308.60	0.01
10	688361	中科飞测	821	53,094.07	0.01
11	688469	中芯集成	9,812	53,082.92	0.01
12	301358	湖南裕能	1,061	45,506.29	0.01
13	301325	曼恩斯特	364	39,293.80	0.00
14	688531	日联科技	283	38,479.51	0.00
15	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00
16	301301	川宁生物	3,574	32,023.04	0.00
17	688146	中船特气	816	31,114.08	0.00
18	301246	宏源药业	931	28,591.01	0.00
19	688352	颀中科技	2,361	28,497.27	0.00
20	688582	芯动联科	648	26,360.64	0.00
21	688507	索辰科技	215	26,253.65	0.00
22	001287	中电港	1,222	25,686.44	0.00
23	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
24	688570	天玛智控	884	22,391.72	0.00
25	688543	国科军工	410	21,750.50	0.00
26	301322	绿通科技	392	20,870.08	0.00
27	601061	中信金属	2,667	20,215.86	0.00
28	688458	美芯晟	221	20,057.96	0.00
29	688581	安杰思	163	19,238.89	0.00
30	688478	晶升股份	402	17,032.74	0.00
31	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
32	301439	泓淋电力	949	16,038.10	0.00



33	688623	双元科技	178	15,448.62	0.00
34	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
35	301408	华人健康	879	14,899.05	0.00
36	301305	朗坤环境	753	14,826.57	0.00
37	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
38	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
39	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
40	688512	慧智微	721	13,814.36	0.00
41	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
42	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
43	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
44	688620	安凯微	1,016	12,537.44	0.00
45	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
46	301345	涛涛车业	266	12,406.24	0.00
47	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
48	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
49	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
50	601065	江盐集团	875	10,360.00	0.00
51	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
52	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
53	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
54	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
55	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
56	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00
57	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
58	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
59	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
60	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
61	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
62	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
63	601133	柏诚股份	664	8,140.64	0.00
64	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
65	301295	美硕科技	215	7,755.05	0.00
66	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
67	300804	广康生化	226	7,451.22	0.00
68	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
69	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
70	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
71	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
72	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
73	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
74	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
75	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00

76	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
77	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
78	603172	万丰股份	122	1,967.86	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601816	京沪高铁	3,711,892.00	0.45
2	688256	寒武纪	1,985,197.64	0.24
3	600886	国投电力	1,931,022.00	0.23
4	600703	三安光电	1,890,591.00	0.23
5	688223	晶科能源	1,665,897.08	0.20
6	688303	大全能源	1,464,114.67	0.18
7	600221	海航控股	1,376,543.00	0.17
8	300418	昆仑万维	1,332,172.00	0.16
9	688126	沪硅产业	1,198,844.27	0.14
10	600023	浙能电力	1,144,832.00	0.14
11	601901	方正证券	1,128,328.00	0.14
12	601021	春秋航空	1,101,544.00	0.13
13	603688	石英股份	1,100,108.00	0.13
14	600489	中金黄金	1,068,940.00	0.13
15	600702	舍得酒业	1,037,546.00	0.12
16	688249	晶合集成	1,034,209.50	0.12
17	600732	爱旭股份	996,259.00	0.12
18	600515	海南机场	984,615.00	0.12
19	600061	国投资本	969,488.00	0.12
20	002050	三花智控	925,051.00	0.11

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

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

### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	4,978,214.00	0.60
2	300750	宁德时代	3,350,761.00	0.40
3	000858	五粮液	2,133,208.00	0.26

4	300124	汇川技术	2,046,847.00	0.25
5	600436	片仔癀	1,531,097.00	0.18
6	300760	迈瑞医疗	1,310,692.00	0.16
7	002594	比亚迪	971,557.00	0.12
8	002013	中航机电	958,333.00	0.12
9	600036	招商银行	932,810.00	0.11
10	688249	晶合集成	873,813.98	0.11
11	600809	山西汾酒	784,822.00	0.09
12	002920	德赛西威	752,565.00	0.09
13	300033	同花顺	742,867.00	0.09
14	000568	泸州老窖	732,100.00	0.09
15	300782	卓胜微	718,303.00	0.09
16	002049	紫光国微	695,282.00	0.08
17	603392	万泰生物	686,968.00	0.08
18	601318	中国平安	684,707.00	0.08
19	002812	恩捷股份	660,840.00	0.08
20	603288	海天味业	589,912.97	0.07

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

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

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	102,291,962.76
卖出股票收入（成交）总额	112,606,399.93

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

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，有选择地投资于流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金在进行股指期货投资时，首先将基于对证券市场总体行情的判断和组合风险收益的分析确定投资时机，并根据风险资产投资（或拟投资）的总体规模和风险系数决定股指期货的投资比例；其次，本基金将在综合考虑证券市场和期货市场运行趋势以及股指期货流动性、收益性、风险特征和估值水平的基础上进行投资品种选择，以对冲风险资产组合的系统性风险和流动性风险。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金参与国债期货投资是为了有效控制债券市场的系统性风险，本基金将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，适度运用国债期货提高投资组合运作效率。在国债期货投资过程中，基金管理人通过对宏观经济和利率市场走势的分析与判断，并充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置，谨慎进行投资，以调整债券组合的久期，降低投资组合的整体风险。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

报告期内基金投资的前十名证券除兴业银行（证券代码 601166）、招商银行（证券代码 600036）、中国平安（证券代码 601318）外其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

#### 1、兴业银行（证券代码 601166）

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

#### 2、招商银行（证券代码 600036）

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

#### 3、中国平安（证券代码 601318）

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

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

### 7.12.2

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

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	86,692.02
2	应收清算款	687,908.19
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	774,600.21

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

## 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	301486	致尚科技	277,921.20	0.03	新股流通受限
2	688486	龙迅股份	198,380.31	0.02	新股流通受限
3	301292	海科新源	116,421.76	0.01	新股流通受限
4	301488	豪恩汽电	104,144.04	0.01	新股流通受限
5	688249	晶合集成	94,056.48	0.01	新股流通受限

## § 8 基金份额持有人信息

## 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		招商 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 联接	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
466	1,411,920.71	647,115,250.00	98.35%	10,839,801.00	1.65%	470,000,000.00	71.43%

## 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	中国平安人寿保险股份有限公司-分红-个险分红	162,075,500.00	24.63%
2	招商证券股份有限公司	3,905,950.00	0.59%
3	广发证券股份有限公司	3,904,700.00	0.59%
4	中信证券股份有限公司	2,493,200.00	0.38%
5	方正证券股份有限公司	2,417,600.00	0.37%
6	中国平安财产保险股份有限公司-传统-普通保险产品	1,744,300.00	0.27%
7	张永峰	1,000,000.00	0.15%
8	梁维灿	600,000.00	0.09%
9	海通证券股份有限公司	474,000.00	0.07%
10	王喆	350,100.00	0.05%
-	招商 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 联接	470,000,000.00	71.43%

注：前十名持有人为除招商 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 联接基金以外的前十名持有人。

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

#### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和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(2020年2月3日)基金份额总额	507,955,051.00
本报告期期初基金份额总额	673,955,051.00
本报告期基金总申购份额	8,000,000.00
减：报告期基金总赎回份额	24,000,000.00
本报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
本报告期期末基金份额总额	657,955,051.00

### § 10 重大事件揭示

#### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末召开基金份额持有人大会。

#### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

#### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的重大诉讼事项。

#### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券	2	134,832,414.55	66.68%	31,187.60	77.90%	-
方正证券	7	67,380,004.56	33.32%	8,846.43	22.10%	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	3	-	-	-	-	-
长江证券	4	-	-	-	-	-
诚通证券	1	-	-	-	-	-
大通证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	3	-	-	-	-	-
东北证券	3	-	-	-	-	-
东方财富	3	-	-	-	-	-
东方证券	3	-	-	-	-	-
东兴证券	3	-	-	-	-	-
光大证券	3	-	-	-	-	-
广发证券	3	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	3	-	-	-	-	-
国信证券	3	-	-	-	-	-



海通证券	4	-	-	-	-	-
宏信证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	3	-	-	-	-	-
华创证券	4	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	5	-	-	-	-	-
华西证券	3	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	3	-	-	-	-	-
瑞信方正	2	-	-	-	-	-
山西证券	2	-	-	-	-	-
上海证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	4	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证 券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
万和证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	5	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
粤开证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
中航证券	2	-	-	-	-	-
中金财 富证 券	2	-	-	-	-	-
中金公司	3	-	-	-	-	-
中泰证券	3	-	-	-	-	-
中信建 投证 券	6	-	-	-	-	-
中信证 券	3	-	-	-	-	-
中银国 际证 券	4	-	-	-	-	-

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

## 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
招商证券	387,167.86	85.43%	-	-	-	-
方正证券	66,016.72	14.57%	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
诚通证券	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
瑞信方正	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-

申万宏源	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证 券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
万和证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
中金财富 证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投 证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际 证券	-	-	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	招商 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-01-18
2	招商基金管理有限公司旗下基金 2022 年第 4 季度报告提示性公告	上海证券报及基金管理人网站	2023-01-18
3	招商 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金更新的招募说明书（二零二三年第一号）	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-02-02
4	招商 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-02-02
5	招商基金管理有限公司旗下部分基金增加国金证券股份有限公司为场内申购赎回代办券商的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-03-14

6	招商基金管理有限公司旗下部分基金增加东海证券股份有限公司为场内申购赎回代办券商的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-03-14
7	招商基金管理有限公司旗下部分基金增加中国中金财富证券有限公司为场内申购赎回代办券商的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-03-23
8	招商基金管理有限公司旗下基金 2022 年年度报告提示性公告	上海证券报及基金管理人网站	2023-03-30
9	招商 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金 2022 年年度报告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-03-30
10	招商基金管理有限公司旗下部分基金增加长城证券股份有限公司为场内申购赎回代办券商的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-04-20
11	招商基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 1 季度报告提示性公告	上海证券报及基金管理人网站	2023-04-21
12	招商 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-04-21
13	招商基金管理有限公司旗下部分基金增加国泰君安证券股份有限公司为场内申购赎回代办券商的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-04-26
14	招商基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-05-11
15	招商基金管理有限公司关于提醒投资者持续完善身份信息资料的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-05-12
16	招商基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-05-16
17	关于招商 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变更的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-05-23
18	招商 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金更新的招募说明书（二零二三年第二号）	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-05-26
19	招商 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-05-26
20	招商基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-06-22
21	招商基金管理有限公司旗下部分基金增加华福	上海证券报、基金管	2023-06-27

证券有限责任公司为场内申购赎回代办券商的公告	理人网站及中国证监会基金电子披露网站
------------------------	--------------------

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
招商 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 联接	1	20230101-20230630	484,000,000.00	-	14,000,000.00	470,000,000.00	71.43%
机构	1	20230101-20230630	162,075,500.00	-	-	162,075,500.00	24.63%
产品特有风险							
本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况，可能会出现集中赎回甚至巨额赎回从而引发基金净值剧烈波动，甚至引发基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。							

注：1、报告期末持有份额占比按照四舍五入方法保留至小数点后第 2 位；

2、申购份额包含申购、定期定额投资、转换转入、红利再投资、买入等业务增加的份额，赎回份额包含赎回、转换转出、卖出等业务减少的份额。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准设立招商基金管理有限公司的文件；
- 2、中国证券监督管理委员会批准招商 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金设立的文件；
- 3、《招商 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 4、《招商 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 5、《招商 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；

6、基金管理人业务资格批件、营业执照。

## 12.2 存放地点

招商基金管理有限公司

地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

## 12.3 查阅方式

上述文件可在招商基金管理有限公司互联网站上查阅，或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

2023 年 8 月 30 日