

招商上证港股通交易型开放式指数证 券投资基金 2022 年中期报告

2022 年 06 月 30 日

基金管理人：招商基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介.....	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§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.....	12
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.....	14
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	17
§7 投资组合报告.....	36
7.1 期末基金资产组合情况.....	36
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	37
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.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	42
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	42
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	43
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	43
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	43
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	43

7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	43
7.12	投资组合报告附注.....	43
§8	基金份额持有人信息.....	45
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	45
8.2	期末上市基金前十名持有人.....	45
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	45
8.4	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	45
§9	开放式基金份额变动.....	46
§10	重大事件揭示.....	46
10.1	基金份额持有人大会决议.....	46
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	46
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	46
10.4	基金投资策略的改变.....	46
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	46
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	46
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	47
10.8	其他重大事件.....	47
§11	备查文件目录.....	49
11.1	备查文件目录.....	49
11.2	存放地点.....	49
11.3	查阅方式.....	49

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	招商上证港股通交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	招商上证港股通 ETF
场内简称	港股通综
基金主代码	513990
交易代码	513990
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020 年 8 月 3 日
基金管理人	招商基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	73,000,000.00 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 8 月 18 日

注：本基金自 2021 年 1 月 26 日起变更扩位证券简称为“港股通 ETF”。

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>1、股票投资策略</p> <p>本基金通过港股通投资标的指数的成份股、备选成份股。本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股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股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股时，基金管理人可采取包括成份股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。</p> <p>2、债券投资策略</p> <p>本基金管理人将基于对国内外宏观经济形势的深入分析、国内财政政策与货币市场政策等因素对债券市场的影响，进行合理的利率预期，判断债券市场的基本走势，制定久期控制下的资产类属配置策略。在债券投资组合构建和管理过程中，本基金管理人将具体采用期限结构配置、市场转换、信用利差和相对价值判断、信用风险评估、现金管理等管理手段进行个券选择。本基金债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，降低跟踪误差。</p> <p>3、资产支持证券投资策略</p> <p>本基金将在宏观经济和基本面分析的基础上，对资产支持证券标的资产的质量和构成、利率风险、信用风险、流动性风险和提前偿付风险等进行分析，评估其相对投资价值并作出相应的投资决策。</p> <p>4、股指期货投资策略</p> <p>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</p>

	<p>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。</p> <p>5、国债期货投资策略</p> <p>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。</p> <p>6、融资及转融通投资策略</p> <p>在条件许可的情况下，基金管理人可在不改变本基金既有投资目标、策略和风险收益特征并在控制风险的前提下，根据相关法律法规，参与融资及转融通证券出借业务，以提高投资效率及进行风险管理。届时基金参与融资及转融通证券出借业务的风险控制原则、具体参与比例限制、费用收支、信息披露、估值方法及其他相关事项按照中国证监会的规定及其他相关法律法规的要求执行。</p> <p>7、存托凭证投资策略</p> <p>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。</p>
业绩比较基准	上证港股通指数收益率
风险收益特征	<p>本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金、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，跟踪上证港股通指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。</p> <p>本基金主要通过港股通机制投资于香港证券市场中具有良好流动性的金融工具。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</p>

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	兴业银行股份有限公司
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	95561
传真	0755-83196475	021-62159217

注册地址	深圳市福田区深南大道 7088 号	福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦
办公地址	深圳市福田区深南大道 7088 号	上海市银城路 167 号兴业大厦 4 楼
邮政编码	518040	200120
法定代表人	王小青	吕家进

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.cmfcchina.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022 年 1 月 1 日 - 2022 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	144,629.89
本期利润	-2,069,738.83
加权平均基金份额本期利润	-0.0285
本期加权平均净值利润率	-3.39%
本期基金份额净值增长率	-2.88%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-10,039,295.86
期末可供分配基金份额利润	-0.1375
期末基金资产净值	62,960,704.14
期末基金份额净值	0.8625
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-13.75%

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。

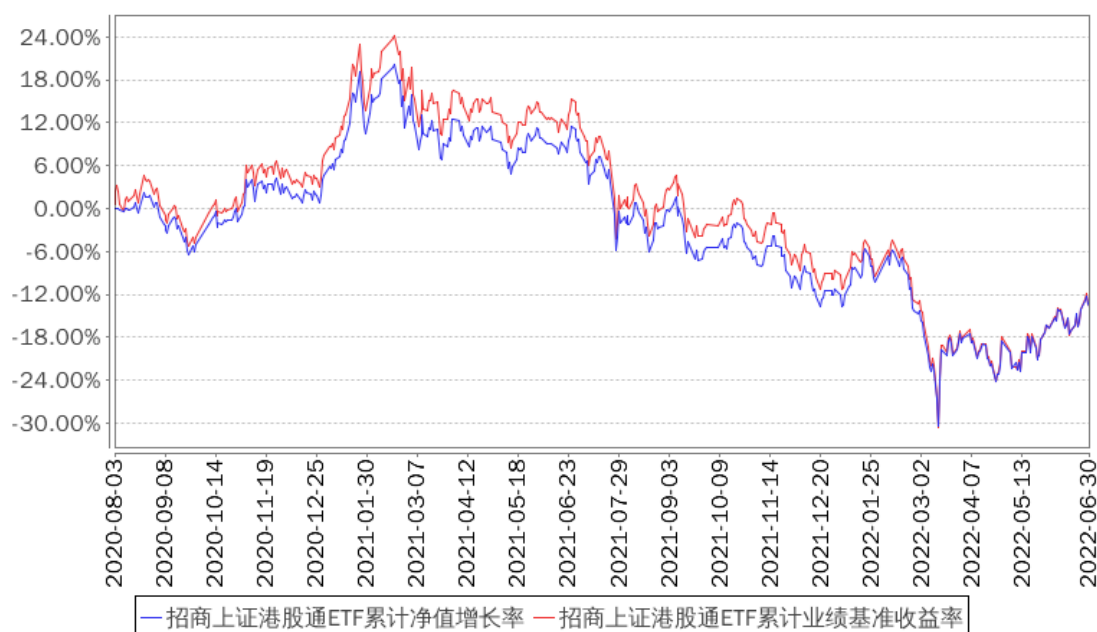
3.2 基金净值表现

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	3.13%	1.41%	3.08%	1.47%	0.05%	-0.06%
过去三个月	6.05%	1.69%	5.64%	1.75%	0.41%	-0.06%
过去六个月	-2.88%	1.99%	-5.46%	2.08%	2.58%	-0.09%
过去一年	-21.16%	1.68%	-23.69%	1.76%	2.53%	-0.08%
自基金合同生效起至今	-13.75%	1.46%	-13.72%	1.54%	-0.03%	-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

招商上证港股通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资格；2004 年获得全国社保基金投资管理人资格；同时拥有 QDII(合格境内机构投资者)资格、专户理财（特定客户资产管理业务）资格、公募基金投顾业务资格，在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、海外投资、FOF 投资等领域全面布局。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
苏燕青	本基金基金经理	2020 年 8 月 3 日	-	10	女，硕士。2012 年 1 月加入招商基金管理有限公司量化投资部，曾任 ETF 专员，协助指数类基金产品的投资管理工作，上证消费 80 交易型开放式指数证券投资基金、招商上证消费 80 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、招商沪深 300 地产等权重指数证券投资基金、招商沪深 300 高贝塔指数证券投资基金、招商中证全指证券公司指数证券投资基金、招商富时中国 A-H50 指数型证券投资基金（LOF）基金经理，现任深证电子信息传媒产业(TMT)50 交易型开放式指数证券投资基金、招商深证电子信息传媒产业(TMT)50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、招商创业板大盘交易型开放式指数证券投资基金、招商上证港股通交易型开放式指数证券投资基金、招商中证全指医疗器械交易型开放式指数证券投资基金、招商中证全指软件交易型开放式指数证券投资基金、招商中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金、招商中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、招商中证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金、招商沪深 300 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、招商中证香港科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）、招商中证云计算与大数据主题交易型开放式指数证券投资基金、招商创业板大盘交易型开放式指数

					证券投资基金联接基金基金经理。
--	--	--	--	--	-----------------

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作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% 的情形共发生过五次，原因是指数量化投资组合为满足投资策略需要而发生反向交易。报告期内未发现有可能导致不公平交易和利益输送的重大异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，港股市场 2022 年上半年整体震荡下行，期间恒生指数、恒生国企指数分别下跌 6.57%、6.91%。恒生科技跌幅较大为 14.12%。行业上来看，能源业和电讯业逆势上行，涨幅分别为 18.92% 和 4.53%，工业、医疗保健和公用事业跌幅最大，跌幅分别为 20.20%、19.56% 和 18.14%。本基金跟踪的标的指数上证港股通（人民币）指数报告期内下跌 5.46%。

关于本基金的运作，股票仓位维持在 95.33% 左右的水平，基本完成了对基准的跟踪。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金份额净值增长率为-2.88%，同期业绩基准增长率为-5.46%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

港股年初在稳经济的预期下大幅上涨。2 月中旬至 3 月中旬，港股出现流动性冲击，期间海外地缘冲突的爆发引发了市场关于中美关系及中国被潜在制裁的担忧。3 月 10 日，美国 SEC 将 5 家中概股列入预定退市名单，进一步加剧了外资对港股的非理性抛售。3 月 16 日国务院金融委会议的召开是重要市场转折点，会议指出“关于中概股，目前中美双方监管机构保持了良好沟通，已取得积极进展”，“关于香港金融市场稳定问题，内地与香港两地监管机构要加强沟通协作”，预示政策底的出现，此背景下港股出现明显反弹。4 月，国内新冠疫情的再度反复和蔓延是重要的影响因素，叠加中概股退市风险以及美联储加息等因素干扰，港股持续回调；5 月初，港股延续下跌，主要受到海外市场持续调整所拖累；但 5 月中旬起至 6 月末港股持续回暖，主要因为国内复工复产稳步推进，叠加政策端积极发力。

展望下半年，在防控政策明显放松的催化下，港股市场仍处于上升通道。但需要关注下半年美联储超预期的加息节奏，虽然美国基本面仍未迈进衰退，但居民生活质量下降抬升了中期选举压力，对应通胀是第三季度的核心点。预计在海外流动性收紧与国内经济修复的对冲下，港股大概率呈现震荡上行的走势。

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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 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：招商上证港股通交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	2,960,963.55	1,129,188.22
结算备付金		9.24	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	60,020,305.70	61,415,745.36
其中：股票投资		60,020,305.70	61,415,745.36
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-

衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		438,302.59	1,295.38
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	354.62
资产总计		63,419,581.08	62,546,583.58
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		13.20	13.26
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		10,146.70	10,363.45
应付托管费		2,536.68	2,590.89
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	446,180.36	366,730.89
负债合计		458,876.94	379,698.49
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	73,000,000.00	70,000,000.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-10,039,295.86	-7,833,114.91
净资产合计		62,960,704.14	62,166,885.09
负债和净资产总计		63,419,581.08	62,546,583.58

注：1、报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.8625 元，基金份额总额 73,000,000.00 份；

2、以下比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》中的资产负债表格式的要求进行列示：上年度资产负债表中“应收利息”与“其

他资产”项目“本期末”余额合并列示在本期资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，上年度资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额中。

6.2 利润表

会计主体：招商上证港股通交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-1,797,251.92	-1,461,343.27
1.利息收入		4,603.99	29,117.58
其中：存款利息收入	6.4.7.9	4,603.99	29,117.58
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		401,082.05	2,272,238.23
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-817,159.55	750,118.38
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-
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	119.43	-
股利收益	6.4.7.15	1,218,122.17	1,522,119.85
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	-2,214,368.72	-3,914,849.57
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	11,430.76	152,150.49

减：二、营业总支出		272,486.91	676,161.16
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	60,767.53	146,206.43
2.托管费	6.4.10.2.2	15,191.89	36,551.53
3.销售服务费		-	-
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7.税金及附加		-	-
8.其他费用	6.4.7.19	196,527.49	493,403.20
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-2,069,738.83	-2,137,504.43
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-2,069,738.83	-2,137,504.43
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-2,069,738.83	-2,137,504.43

注：以下比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》中的利润表格式的要求进行列示：上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：招商上证港股通交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	70,000,000.00	-	-7,833,114.91	62,166,885.09
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）	70,000,000.00	-	-7,833,114.91	62,166,885.09
三、本期增减变动额（减少以“-”	3,000,000.00	-	-2,206,180.95	793,819.05

号填列)				
(一)、综合收益总额	-	-	-2,069,738.83	-2,069,738.83
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	3,000,000.00	-	-136,442.12	2,863,557.88
其中: 1.基金申购款	6,000,000.00	-	-804,105.26	5,195,894.74
2.基金赎回款	-3,000,000.00	-	667,663.14	-2,332,336.86
(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)	73,000,000.00	-	-10,039,295.86	62,960,704.14
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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)	61,000,000.00	-	2,812,245.25	63,812,245.25
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)	61,000,000.00	-	2,812,245.25	63,812,245.25
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	54,000,000.00	-	7,997,360.63	61,997,360.63
(一)、综合收益总额	-	-	-2,137,504.43	-2,137,504.43
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	54,000,000.00	-	10,134,865.06	64,134,865.06

其中：1.基金申购款	117,000,000.00	-	17,439,313.42	134,439,313.42
2.基金赎回款	-63,000,000.00	-	-7,304,448.36	-70,304,448.36
(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）	115,000,000.00	-	10,809,605.88	125,809,605.88

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

招商上证港股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》、《招商上证港股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]2159 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 232,000,000.00 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 00351 号验资报告。《招商上证港股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 8 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，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

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《招商上证港股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，本基金的投资范围主要为标的指数成份券和备选成份券。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份券(包括港股通标的股票和其它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)。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上证港股通指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)以及中国证监会发布的基金行业实务操作的有关规定编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告不一致,具体请见 6.4.5.1 会计政策变更的说明。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(以下简称“新金融工具准则”)相关规定,以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》,公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。本基金在编制本中期财务报表时已采用新金融工具准则,并采用准则允许的实务简便方法,调整期初基金净值,2021 年的比较数据将不作重述。

于首次执行日,本基金因执行新金融工具准则调减期初基金净值人民币 0.00 元,本基金执行新金融工具准则的影响如下:

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融工具包括银行存款、结算备付金和应收利息,金额分别为人民币 1,129,188.22 元、人民币 0.00 元和人民币 354.62 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融工具包括银行存款、结算备付金和其他资产-应收利息。本基金将

基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在银行存款和结算备付金等项目中，不单独列示应收利息项目或应付利息项目。新金融工具准则下，银行存款、结算备付金和其他资产-应收利息的金额分别为人民币 1,129,439.63 元、人民币 103.21 元和人民币 0.00 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融工具为交易性金融资产，金额为人民币 61,415,745.36 元，归属于交易性金融资产的应收利息金额为人民币 0.00 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融工具为交易性金融资产，金额为人民币 61,415,745.36 元。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008年9月18日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

(3)对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司抵扣代缴个人所得税；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。对基金通过港股通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册，H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过港股通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

(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，受让方不再缴纳印花税。对于基金通过港股通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	2,960,963.55
等于：本金	2,960,707.53
加：应计利息	256.02
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	2,960,963.55

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
----	---------------------

		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		75,619,008.74	-	60,020,305.70	-15,598,703.04
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		75,619,008.74	-	60,020,305.70	-15,598,703.04

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融工具。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	49.56
其中：交易所市场	49.56
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	341,130.80
应付指数使用费	105,000.00
合计	446,180.36

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	70,000,000.00	70,000,000.00
本期申购	6,000,000.00	6,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-3,000,000.00	-3,000,000.00
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	73,000,000.00	73,000,000.00

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
本期期初	-2,253,084.77	-5,580,030.14	-7,833,114.91
本期利润	144,629.89	-2,214,368.72	-2,069,738.83
本期基金份额交易产生的变动数	-55,879.86	-80,562.26	-136,442.12
其中：基金申购款	-169,351.03	-634,754.23	-804,105.26
基金赎回款	113,471.17	554,191.97	667,663.14
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,164,334.74	-7,874,961.12	-10,039,295.86

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	4,142.24
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	440.79
其他	20.96
合计	4,603.99

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-817,159.55
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	-817,159.55

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	2,187,308.90
减：卖出股票成本总额	2,993,779.98
减：交易费用	10,688.47
买卖股票差价收入	-817,159.55

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无股票赎回差价收入。

6.4.7.10.4 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

本基金本报告期内及上年度可比期间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**

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期内无买卖债券差价收入。

6.4.7.11.3 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**

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出权证成交总额	119.43
减：卖出权证成本总额	-
减：交易费用	-
减：买卖权证差价收入应缴纳增值税额	-
买卖权证差价收入	119.43

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具其他投资收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,218,122.17
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	1,218,122.17

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
------	------------------------------------

1.交易性金融资产	-2,214,368.72
——股票投资	-2,214,368.72
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-2,214,368.72

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	11,430.76
合计	11,430.76

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	14,876.39
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
IOPV 服务费	49,588.57
证券组合费	2,353.79
银行费用	201.37
指数使用费	70,000.00
合计	196,527.49

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
兴业银行股份有限公司	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

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

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	60,767.53	146,206.43
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-
支付投资顾问的投资顾问费	-	-

注：支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值×0.20%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：

$$\text{日基金管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	15,191.89	36,551.53

注：支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值×0.05%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：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

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自有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间基金管理人无运用自有资金投资本基金的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例

招商证券股份有限公司	2,226,800.00	3.05%	2,984,300.00	4.26%
------------	--------------	-------	--------------	-------

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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
兴业银行-活期	2,960,963.55	4,142.24	8,796,262.26	9,752.07

注：本基金的银行存款由基金托管人兴业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

本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

于 2022 年 6 月 30 日，本基金因指数成份股原因被动持有招商银行(03968)20,500 股，市值为人民币 920,398.24 元，占本基金资产净值的比例为 1.46%(2021 年 6 月 30 日：持有 30,500 股，市值为人民币 1,681,321.65 元，占基金资产净值的比例为 1.34%)。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2022 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

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

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,960,963.55	-	-	-	2,960,963.55
结算备付金	9.24	-	-	-	9.24
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	60,020,305.70	60,020,305.70
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	438,302.59	438,302.59
应收申购款	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	2,960,972.79	-	-	60,458,608.29	63,419,581.08
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	10,146.70	10,146.70
应付托管费	-	-	-	2,536.68	2,536.68
应付清算款	-	-	-	13.20	13.20
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	-	-	-	446,180.36	446,180.36
负债总计	-	-	-	458,876.94	458,876.94
利率敏感度缺口	2,960,972.79	-	-	59,999,731.35	62,960,704.14
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,129,188.22	-	-	-	1,129,188.22

结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	61,415,745.36	61,415,745.36
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	354.62	354.62
应收股利	-	-	-	1,295.38	1,295.38
应收申购款	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,129,188.22	-	-	61,417,395.36	62,546,583.58
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	10,363.45	10,363.45
应付托管费	-	-	-	2,590.89	2,590.89
应付证券清算款	-	-	-	13.26	13.26
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	4,572.42	4,572.42
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	362,158.47	362,158.47
负债总计	-	-	-	379,698.49	379,698.49
利率敏感度缺口	1,129,188.22	-	-	61,037,696.87	62,166,885.09

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末无利率风险的敏感性分析。

6.4.13.4.2 外汇风险

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日					合计
	美元折合人民币	港币折合人民币	欧元折合人民币	日元折合人民币	其他币种折合人民币	
以外币计价的资产						
银行存款	-	-	-	-	-	-
结算备付	-	-	-	-	-	-

金						
存出保证金	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	60,020,305.70	-	-	-	60,020,305.70
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	438,302.59	-	-	-	438,302.59
应收申购款	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-
其它资产	-	-	-	-	-	-
资产合计	-	60,458,608.29	-	-	-	60,458,608.29
以外币计价的负债						
应付清算款	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-	-	-
资产负债表外汇率风险敞口净额	-	60,458,608.29	-	-	-	60,458,608.29

项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日					合计
	美元折合人民币	港币折合人民币	欧元折合人民币	日元折合人民币	其他币种折合人民币	
以外币计价的资产						
银行存款	-	-	-	-	-	-
结算备付	-	-	-	-	-	-

金						
存出保证金	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	61,415,745.36	-	-	-	61,415,745.36
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	1,295.38	-	-	-	1,295.38
应收利息	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-
其它资产	-	-	-	-	-	-
资产合计	-	61,417,040.74	-	-	-	61,417,040.74
以外币计价的负债						
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	61,417,040.74	-	-	-	61,417,040.74

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	3,022,930.41	3,070,852.04

	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-3,022,930.41	-3,070,852.04
--	-------------------	---------------	---------------

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指以交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险，该风险可能与特定投资品种相关，也有可能与整体投资品种相关。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的基金、债券和股票，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金在构建资产配置和基金资产投资组合的基础上，通过建立事前和事后跟踪误差的方式，对基金资产的市场价格风险进行管理。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	60,020,305.70	95.33	61,415,745.36	98.79
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	60,020,305.70	95.33	61,415,745.36	98.79

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1.若对市场价格敏感的权益性投资的市场价格上升或下降 5%		
	2.其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
	1. 权益性投资的市场价格上升 5%	3,001,015.29	3,070,787.27
	2. 权益性投资的市场价格下降 5%	-3,001,015.29	-3,070,787.27

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日
第一层次	60,020,305.70
第二层次	-
第三层次	-
合计	60,020,305.70

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其公允价值和账面价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无需要说明有助于理解和分析会计报表的其他事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
----	----	-------	--------------

1	权益投资	60,020,305.70	94.64
	其中：股票	60,020,305.70	94.64
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	2,960,972.79	4.67
8	其他资产	438,302.59	0.69
9	合计	63,419,581.08	100.00

注：1、此处的股票投资项含可退替代款估值增值；

2、上表权益投资中通过港股通交易机制投资的港股金额人民币 60,020,305.70 元，占基金净值比例 95.33%。

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

本基金本报告期末未持有境内股票投资组合。

7.2.2 期末积极投资按行业分类境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有境内股票投资组合。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
通信服务	10,457,708.01	16.61
非日常生活消费品	9,700,912.76	15.41
日常消费品	2,181,692.33	3.47
能源	1,666,619.93	2.65
金融	21,712,848.67	34.49
医疗保健	2,767,438.46	4.40
工业	1,842,417.93	2.93
信息技术	2,301,620.74	3.66
原材料	303,301.68	0.48
房地产	5,583,415.81	8.87
公用事业	1,502,329.38	2.39
合计	60,020,305.70	95.33

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

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	00700	腾讯控股	29,700	9,001,456.28	14.30
2	00005	汇丰控股	103,600	4,576,070.38	7.27
3	01299	友邦保险	59,600	4,334,941.01	6.89
4	03690	美团-W	25,700	4,268,201.98	6.78
5	00939	建设银行	621,000	2,798,754.66	4.45
6	02318	中国平安	48,500	2,212,782.75	3.51
7	02269	药明生物	30,000	1,842,079.26	2.93
8	01398	工商银行	449,000	1,789,348.24	2.84
9	00388	香港交易所	5,400	1,782,558.04	2.83
10	03988	中国银行	413,000	1,105,495.56	1.76
11	01109	华润置地	34,000	1,064,198.44	1.69
12	00016	新鸿基地产	12,500	990,951.41	1.57
13	00941	中国移动	23,000	963,799.13	1.53
14	01810	小米集团-W	81,200	947,181.08	1.50
15	09633	农夫山泉	24,000	924,631.43	1.47
16	03968	招商银行	20,500	920,398.24	1.46
17	00027	银河娱乐	19,000	760,434.95	1.21
18	02020	安踏体育	8,400	692,498.65	1.10
19	01211	比亚迪股份	2,500	671,324.15	1.07
20	00012	恒基地产	26,000	653,707.24	1.04
21	00883	中国海洋石油	71,000	629,043.56	1.00
22	02331	李宁	10,000	621,723.13	0.99
23	00001	长和	13,500	612,465.70	0.97
24	00175	吉利汽车	39,000	595,006.99	0.95
25	01113	长实集团	12,000	569,556.54	0.90
26	03328	交通银行	119,000	551,580.45	0.88
27	00003	香港中华煤气	62,100	448,756.68	0.71
28	06098	碧桂园服务	15,000	448,333.36	0.71
29	00868	信义玻璃	26,000	418,461.57	0.66
30	01288	农业银行	165,000	417,674.80	0.66
31	00968	信义光能	40,000	414,596.11	0.66
32	01088	中国神华	21,500	413,698.16	0.66
33	06618	京东健康	7,800	410,568.17	0.65

34	00981	中芯国际	26,000	404,231.21	0.64
35	00291	华润啤酒	8,000	400,228.92	0.64
36	06690	海尔智家	15,000	372,649.04	0.59
37	00688	中国海外发展	17,500	371,152.46	0.59
38	00857	中国石油股份	112,000	358,221.99	0.57
39	02388	中银香港	13,500	357,897.02	0.57
40	06969	思摩尔国际	17,000	351,825.17	0.56
41	02382	舜宇光学科 技	3,200	350,012.16	0.56
42	00267	中信股份	50,000	339,938.03	0.54
43	00017	新世界发展	14,000	337,030.38	0.54
44	00083	信和置业	34,000	336,705.41	0.53
45	00669	创科实业	4,500	314,987.86	0.50
46	01024	快手-W	4,100	306,448.78	0.49
47	00002	中电控股	5,500	306,200.78	0.49
48	01038	长江基建集 团	7,000	287,942.47	0.46
49	01997	九龙仓置业	9,000	287,856.95	0.46
50	00881	中升控股	6,000	284,008.60	0.45
51	02313	申洲国际	3,400	276,371.75	0.44
52	03323	中国建材	38,000	272,326.70	0.43
53	00386	中国石化 工股份	88,000	265,656.22	0.42
54	01093	石药集团	38,400	255,818.12	0.41
55	00101	恒隆地产	20,000	254,504.54	0.40
56	02333	长城汽车	17,500	241,548.42	0.38
57	01658	邮储银行	45,000	239,752.52	0.38
58	02688	新奥能源	2,100	231,491.38	0.37
59	02628	中国人寿	19,000	221,956.01	0.35
60	01177	中国生物制 药	52,000	221,015.30	0.35
61	02601	中国太保	12,400	203,391.55	0.32
62	02319	蒙牛乳业	6,000	200,884.13	0.32
63	06160	百济神州	2,200	185,319.67	0.29
64	00011	恒生银行	1,500	177,665.72	0.28
65	00788	中国铁塔	204,000	176,203.35	0.28
66	00241	阿里健康	38,000	175,484.99	0.28
67	01114	BRILLIANC E CHI	28,000	174,800.84	0.28
68	01928	金沙中国有 限公司	9,200	147,284.24	0.23

69	02007	碧桂园	35,000	145,467.82	0.23
70	00853	微创医疗	7,300	142,025.68	0.23
71	00168	青岛啤酒股份	2,000	139,567.01	0.22
72	06186	中国飞鹤	17,000	131,134.83	0.21
73	00066	港铁公司	3,500	122,719.77	0.19
74	00384	中国燃气	10,000	103,649.03	0.16
75	00004	九龙仓集团	4,000	97,833.74	0.16
76	01548	金斯瑞生物科技	4,000	97,320.62	0.15
77	01347	华虹半导体	4,000	97,149.58	0.15
78	00992	联想集团	11,600	72,715.10	0.12
79	01193	华润燃气	2,000	62,514.39	0.10
80	00836	华润电力	2,000	27,708.16	0.04
81	00322	康师傅控股	2,000	22,987.51	0.04
82	00006	电能实业	500	21,101.81	0.03
83	01308	海丰国际	1,000	18,985.22	0.03
84	02899	紫金矿业	2,000	16,436.75	0.03
85	00960	龙湖集团	500	15,842.39	0.03
86	00268	金蝶国际	1,000	15,735.50	0.02
87	01801	信达生物	500	14,923.07	0.02
88	00914	海螺水泥	500	14,538.23	0.02
89	02328	中国财险	2,000	13,956.70	0.02
90	00916	龙源电力	1,000	12,964.68	0.02
91	02359	药明康德	100	8,936.74	0.01
92	06030	中信证券	575	8,625.02	0.01
93	00586	海螺创业	500	7,311.87	0.01
94	00754	合生创展集团	649	6,649.12	0.01
95	09992	泡泡玛特	200	6,482.34	0.01
96	00151	中国旺旺	1,000	5,832.40	0.01
97	03888	金山软件	200	5,233.76	0.01
98	00728	中国电信	2,000	4,566.71	0.01
99	01919	中远海控	400	3,749.15	0.01
100	01821	ESR	200	3,626.01	0.01
101	00288	万洲国际	500	2,591.23	0.00
102	01929	周大福	200	2,524.52	0.00
103	01876	百威亚太	100	2,009.70	0.00
104	02618	京东物流	100	1,464.09	0.00

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	00587	海螺环保	500	2,334.67	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	00700	腾讯控股	721,187.02	1.16
2	00669	创科实业	442,517.71	0.71
3	01211	比亚迪股份	424,908.30	0.68
4	01024	快手-W	310,964.10	0.50
5	02319	蒙牛乳业	226,721.03	0.36
6	02382	舜宇光学科技	217,710.83	0.35
7	00005	汇丰控股	155,782.60	0.25
8	01299	友邦保险	147,281.66	0.24
9	03690	美团-W	144,337.49	0.23
10	00939	建设银行	106,038.94	0.17
11	02318	中国平安	67,477.47	0.11
12	00941	中国移动	62,523.58	0.10
13	01398	工商银行	62,426.28	0.10
14	00388	香港交易所	55,454.08	0.09
15	01810	小米集团-W	38,199.89	0.06
16	03988	中国银行	38,047.84	0.06
17	02331	李宁	29,158.68	0.05
18	00883	中国海洋石油	25,769.64	0.04
19	03968	招商银行	24,629.18	0.04
20	02269	药明生物	22,950.84	0.04

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	00700	腾讯控股	402,787.38	0.65
2	09618	京东集团-SW	247,840.42	0.40

3	00005	汇丰控股	154,864.71	0.25
4	01299	友邦保险	141,998.40	0.23
5	03690	美团-W	141,771.84	0.23
6	00939	建设银行	104,160.24	0.17
7	00291	华润啤酒	87,312.68	0.14
8	01211	比亚迪股份	74,486.86	0.12
9	02318	中国平安	65,444.05	0.11
10	01398	工商银行	61,919.98	0.10
11	01109	华润置地	59,880.80	0.10
12	00388	香港交易所	55,122.70	0.09
13	00669	创科实业	51,788.80	0.08
14	00941	中国移动	41,269.20	0.07
15	03988	中国银行	37,546.88	0.06
16	00016	新鸿基地产	36,717.45	0.06
17	02319	蒙牛乳业	36,414.00	0.06
18	01810	小米集团-W	35,779.58	0.06
19	00002	中电控股	31,437.42	0.05
20	02331	李宁	27,452.11	0.04

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	3,476,567.33
卖出股票收入（成交）总额	2,187,308.90

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工商银行（证券代码 01398）、建设银行（证券代码 00939）、中国平安（证券代码 02318）、中国银行（证券代码 03988）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 01398）

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、建设银行（证券代码 00939）

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。

3、中国平安（证券代码 02318）

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。

4、中国银行（证券代码 03988）

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。

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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	438,302.59
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	438,302.59

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
2,181	33,470.88	19,256,400.00	26.38%	53,743,600.00	73.62%

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	BARCLAYS BANK PLC	8,853,300.00	12.13%
2	中信证券股份有限公司	3,244,500.00	4.44%
3	张燕	3,241,200.00	4.44%
4	吴震	3,000,000.00	4.11%
5	朱洁	2,917,200.00	4.00%
6	湖南省(肆号)职业年金计划-农业银行	2,713,800.00	3.72%
7	招商证券股份有限公司	2,226,800.00	3.05%
8	邵峥	2,000,000.00	2.74%
9	沙伟	661,900.00	0.91%
10	曹乐	578,600.00	0.79%

注：以上数据由中国证券登记结算公司提供，持有人为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	200.00	0.0003%

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8月3日)基金份额总额	232,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	70,000,000.00
本报告期基金总申购份额	6,000,000.00
减：报告期基金总赎回份额	3,000,000.00
本报告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	73,000,000.00

§ 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

本基金本报告期内基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的重大诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
方正证券	2	5,662,681.49	100.00%	2,215.52	100.00%	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-

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
方正证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	招商基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-01-01
2	招商基金管理有限公司旗下基金 2021 年第 4 季度报告提示性公告	证券日报及基金管理人网站	2022-01-21
3	招商上证港股通交易型开放式指数证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会	2022-01-21

		基金电子披露网站	
4	关于招商上证港股通交易型开放式指数证券投资基金 2022 年非港股通交易日暂停申购和赎回业务的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-01-24
5	招商基金管理有限公司关于公司自有资金投资旗下公募基金的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-01-27
6	关于警惕冒用招商基金管理有限公司名义进行诈骗活动的特别提示公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-03-22
7	关于招商上证港股通交易型开放式指数证券投资基金 2022 年非港股通交易日暂停申购和赎回业务的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-03-29
8	招商上证港股通交易型开放式指数证券投资基金 2021 年年度报告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-03-30
9	招商基金管理有限公司旗下基金 2021 年年度报告提示性公告	证券日报及基金管理人网站	2022-03-30
10	关于招商上证港股通交易型开放式指数证券投资基金 2022 年非港股通交易日暂停申购和赎回业务的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-04-13
11	招商上证港股通交易型开放式指数证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-04-21
12	招商基金管理有限公司旗下基金 2022 年第 1 季度报告提示性公告	证券日报及基金管理人网站	2022-04-21
13	关于招商上证港股通交易型开放式指数证券投资基金 2022 年非港股通交易日暂停申购和赎回业务的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-04-26
14	关于招商上证港股通交易型开放式指数证券投资基金 2022 年非港股通交易日暂停申购和赎回业务的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-05-06
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	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-05-13
16	招商基金管理有限公司关于养老金客户通过直销柜台申购旗下基金开展费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-06-09
17	招商基金管理有限公司关于旗下管理的上海证券交易所上市 ETF 实施申赎业务多码合一的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-06-17
18	招商上证港股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	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-06-23

19	关于招商上证港股通交易型开放式指数证券投资基金 2022 年非港股通交易日暂停申购和赎回业务的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-06-29
----	---	----------------------------	------------

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准设立招商基金管理有限公司的文件；
- 2、中国证券监督管理委员会批准招商上证港股通交易型开放式指数证券投资基金设立的文件；
- 3、《招商上证港股通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 4、《招商上证港股通交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 5、《招商上证港股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。

11.2 存放地点

招商基金管理有限公司
地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

11.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人招商基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-887-9555

网址：<http://www.cmfcchina.com>

招商基金管理有限公司
2022 年 8 月 30 日