

招商 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金 2024 年中期报告

2024 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：2024 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 2024 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 2024 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遵规守信情况的说明.....	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	8
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	9
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.....	10
4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	10
§5 托管人报告.....	11
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	11
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	11
6.1 资产负债表.....	11
6.2 利润表.....	13
6.3 净资产变动表.....	14
6.4 报表附注.....	16
§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.....	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	52
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.....	52
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.....	53
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.....	53
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.....	53
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	53

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
7.12 投资组合报告附注	53
§8 基金份额持有人信息	55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
8.2 期末上市基金前十名持有人	55
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
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	56
§9 开放式基金份额变动	56
§10 重大事件揭示	56
10.1 基金份额持有人大会决议	56
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	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
10.4 基金投资策略的改变	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	57
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	57
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	57
10.8 其他重大事件	61
§11 影响投资者决策的其他重要信息	62
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	62
§12 备查文件目录	63
12.1 备查文件目录	63
12.2 存放地点	63
12.3 查阅方式	63

§ 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	613,955,051.00 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。</p> <p>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组合的风险收益特征相似。</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	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	http://www.cmfchina.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(2024 年 1 月 1 日 - 2024 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-27,139,243.99
本期利润	8,958,295.26
加权平均基金份额本期利润	0.0143
本期加权平均净值利润率	1.27%
本期基金份额净值增长率	1.21%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	76,255,371.67
期末可供分配基金份额利润	0.1242
期末基金资产净值	690,210,422.67
期末基金份额净值	1.1242

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	12.42%

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

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

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

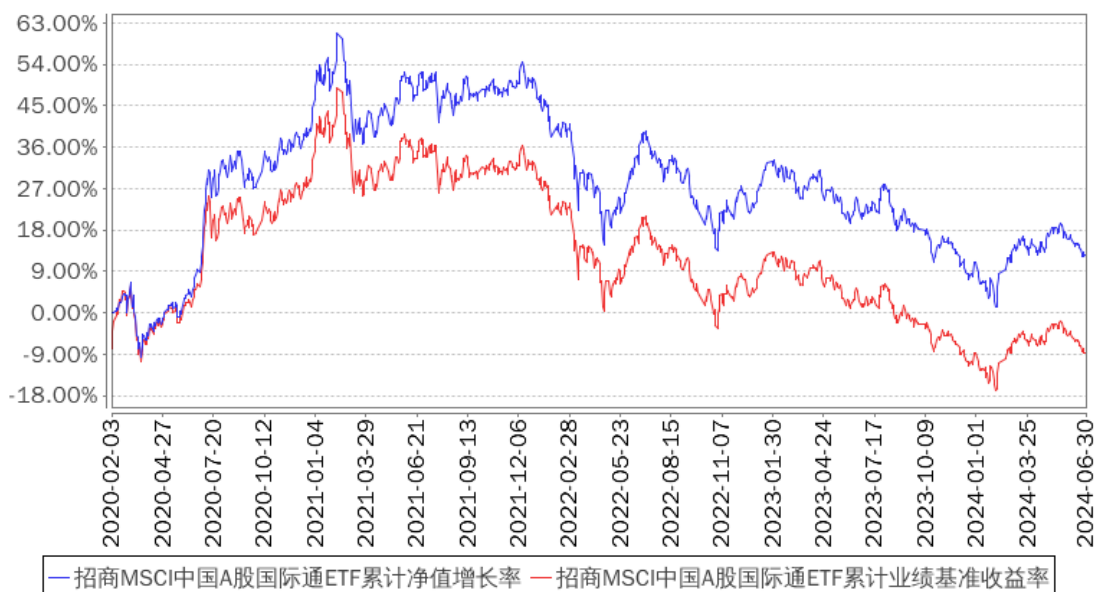
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-2.95%	0.51%	-3.88%	0.51%	0.93%	0.00%
过去三个月	-1.39%	0.78%	-2.61%	0.79%	1.22%	-0.01%
过去六个月	1.21%	0.97%	0.00%	0.98%	1.21%	-0.01%
过去一年	-7.77%	0.90%	-10.40%	0.91%	2.63%	-0.01%
过去三年	-26.21%	1.02%	-33.59%	1.04%	7.38%	-0.02%
自基金合同生效起至今	12.42%	1.11%	-8.62%	1.17%	21.04%	-0.06%

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拥有公开募集证券投资基金管理、基金销售、全国社会保障基金境内委托管理、企业年金和职业年金基金投资管理、合格境内机构投资者、特定客户资产管理、保险资金投资管理、基本养老保险基金投资管理、公募基金投资顾问业务试点资格。

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		
范刚强	本基金基金经理	2023 年 5 月 23 日	-	12	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。
王超	本基金基金经理（已离任）	2020 年 9 月 23 日	2024 年 6 月 27 日	16	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，曾任招商 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。

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合规守信情况的说明

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 6 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。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，在政策转向预期及现实宏观数据走弱的反复拉扯下，A 股市场冲高回落。外部环境方面，美国通胀数据短暂反弹后重返回落通道，美联储 9 月份降息概率大增，叠加经济继续展现强劲的韧性，投资者对美国经济软着陆的信心得到进一步加强。国内方面，地产托底政策陆续出台但效果暂未显现，叠加政府化债对政府支出产生的约束，需求不振，投资者信心普遍不足，市场风险偏好暂时难以提振，风险资产价格依旧疲软。报告期内 MSCI 中国 A 股国际通指数与年初基本持平。

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 1.21%，同期业绩基准增长率为 0.00%。

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，随着大选临近，外围地缘政治压力缓和的概率不大。国内方面，海外需求仍强的背景下预计出口会维持高位，地产政策及基建投资也会温和加强，但微观经济主体的信心积弱难振，如无超预期政策的推出，红利及资源类板块预计仍会持续跑赢。

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办法》进行。基金核算部负责日常的基金资产的估值业务，执行基金估值政策。另外，公司设立由投资和研究部门、风险管理部、基金核算部、法律合规部负责人和基金经理代表组成的估值委员会。公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历。公司估值委员会主要负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，定期评价现有估值政策和程序的适用性及对估值程序执行情况进行监督。

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

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，本托管人在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：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	14,620,122.25	7,294,115.68
结算备付金		154,904.87	132,555.77
存出保证金		10,078.85	18,255.19
交易性金融资产	6.4.7.2	677,239,985.10	702,637,822.92
其中：股票投资		677,239,985.10	702,637,822.92
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		-	151,764.40
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		692,025,091.07	710,234,513.96
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 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		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		289,021.28	298,240.05
应付托管费		57,804.28	59,648.02
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	1,467,842.84	1,245,868.75
负债合计		1,814,668.40	1,603,756.82
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	613,955,051.00	637,955,051.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	76,255,371.67	70,675,706.14
净资产合计		690,210,422.67	708,630,757.14
负债和净资产总计		692,025,091.07	710,234,513.96

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.1242 元，基金份额总额 613,955,051.00 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		11,329,845.40	-5,729,887.26
1.利息收入		16,823.13	13,879.07
其中：存款利息收入	6.4.7.9	16,823.13	13,879.07
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		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-24,826,702.30	-884,818.32
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-33,394,551.62	-10,259,163.54
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	14,595.39	76,556.69
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	8,553,253.93	9,297,788.53
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	36,097,539.25	-4,869,727.17
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	42,185.32	10,779.16
减：二、营业总支出		2,371,550.14	2,817,944.03
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	1,756,455.33	2,085,164.50
其中：暂估管理人报酬		-	-
2.托管费	6.4.10.2.2	351,291.12	417,032.95
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		0.03	0.30
8.其他费用	6.4.7.19	263,803.66	315,746.28
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		8,958,295.26	-8,547,831.29
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		8,958,295.26	-8,547,831.29
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		8,958,295.26	-8,547,831.29

注：根据最新《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：上年度可比期间“证券出借利息收入”项目的“本期”金额列示于本期“其他利息收入”项目的“上年度可比期间”金额中。

6.3 净资产变动表

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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	637,955,051.00	-	70,675,706.14	708,630,757.14
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	637,955,051.00	-	70,675,706.14	708,630,757.14
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-24,000,000.00	-	5,579,665.53	-18,420,334.47
（一）、综合收益总额	-	-	8,958,295.26	8,958,295.26
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-24,000,000.00	-	-3,378,629.73	-27,378,629.73

其中：1.基金申购款	4,000,000.00	-	204,722.19	4,204,722.19
2.基金赎回款	-28,000,000.00	-	-3,583,351.92	-31,583,351.92
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	613,955,051.00	-	76,255,371.67	690,210,422.67
项目	上年度可比期间 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	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	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净资产变动数（净资产减少以“-”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净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	657,955,051.00	-	144,008,052.15	801,963,103.15

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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的业绩比较基准为：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”)、中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

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 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策,会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期间未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008年9月18日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[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[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资

产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》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管理人运营公开募集证券投资基金过程中发生的资管产品运营业务，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。

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

(3) 对基金取得的股票股息红利所得，由上市公司代扣代缴个人所得税：从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4) 对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税；自 2023 年 8 月 28 日起，出让方减按 0.05%的税率缴纳证券(股票)交易印花税。

(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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	14,620,122.25
等于：本金	14,618,951.82
加：应计利息	1,170.43
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	14,620,122.25
----	---------------

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	810,000,810.91	-	677,239,985.10	-132,760,825.81
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	810,000,810.91	-	677,239,985.10	-132,760,825.81

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 2024 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	8,879.44
其中：交易所市场	8,879.44

银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	137,181.36
应付指数使用费	1,321,782.04
合计	1,467,842.84

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	637,955,051.00	637,955,051.00
本期申购	4,000,000.00	4,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-28,000,000.00	-28,000,000.00
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期末	613,955,051.00	613,955,051.00

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	254,896,987.24	-184,221,281.10	70,675,706.14
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	254,896,987.24	-184,221,281.10	70,675,706.14
本期利润	-27,139,243.99	36,097,539.25	8,958,295.26
本期基金份额交易产生的变动数	-8,944,216.64	5,565,586.91	-3,378,629.73
其中：基金申购款	1,589,509.86	-1,384,787.67	204,722.19
基金赎回款	-10,533,726.50	6,950,374.58	-3,583,351.92
本期已分配利润	-	-	-
本期末	218,813,526.61	-142,558,154.94	76,255,371.67

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	16,196.83
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	527.77
其他	98.53
合计	16,823.13

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-30,817,217.62
股票投资收益——赎回差价收入	-2,577,334.00
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	-33,394,551.62

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	48,369,234.96
减：卖出股票成本总额	79,139,291.78
减：交易费用	47,160.80
买卖股票差价收入	-30,817,217.62

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	31,583,351.92
减：现金支付赎回款总额	10,938,791.92
减：赎回股票成本总额	23,221,894.00
减：交易费用	-
赎回差价收入	-2,577,334.00

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	5.63
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	14,589.76
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	14,595.39

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	54,597.80
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	39,999.75
减：应计利息总额	6.11
减：交易费用	2.18
买卖债券差价收入	14,589.76

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	8,553,253.93
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	8,553,253.93

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	36,097,539.25
——股票投资	36,097,539.25
——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	36,097,539.25

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	42,185.32
合计	42,185.32

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	17,564.54
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
其他	186,566.78
合计	263,803.66

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”)	本基金的联接基金

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票	成交金额	占当期股票

		成交总额的 比例		成交总额的 比例
招商证券	51,996,969.09	61.44%	134,832,414.55	66.68%

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	54,597.80	100.00%	387,167.86	85.43%

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	12,787.53	72.87%	6,650.44	74.90%
关联方名称	上年度可比期间 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%

注：1、本报告期内，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、本报告期内，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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,756,455.33	2,085,164.50
其中：应支付销售机构的客	371.04	168.38

户维护费		
应支付基金管理人的净管理费	1,756,084.29	2,084,996.12
应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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	351,291.12	417,032.95

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 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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	432,000,000.00	70.36%	452,000,000.00	70.85%
招商证券股份有限公司	4,672,250.00	0.76%	3,530,950.00	0.55%

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	14,620,122.25	16,196.83	12,631,961.90	11,083.90

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	688692	达梦数据	新股获配	1,745	151,745.20

上年度可比期间 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

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 2024 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）391,840 股，市值为人民币 13,397,009.60 元，占本基金资产净值的比例为 1.94%（2023 年 6 月 30 日：持有 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%）。

于 2024 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）667,300 股，市值为人民币 3,082,926.00 元，占本基金资产净值的比例为 0.45%（2023 年 6 月 30 日：持有 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%）。

于 2024 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）140,980 股，市值为人民币 1,961,031.80 元，占本基金资产净值的比例为 0.28%（2023 年 6 月 30 日：持有 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%）。

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（2024 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
001359	平安电工	2024 年 3 月 19 日	6 个月	新股流通受限	17.39	20.60	184	3,199.76	3,790.40	-
001379	腾达科技	2024 年 1 月 11 日	6 个月	新股流通受限	16.98	13.48	213	3,616.74	2,871.24	-
001387	雪祺电气	2024 年 1 月 4 日	6 个月	新股流通受限	15.38	15.25	173	2,045.54	2,638.25	-
001389	广合科技	2024 年 3 月 26 日	6 个月	新股流通受限	17.43	34.56	222	3,869.46	7,672.32	-
301392	汇成真空	2024 年 5 月 28 日	6 个月	新股流通受限	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-
301502	华阳智能	2024 年 1 月 26 日	6 个月	新股流通受限	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-
301536	星辰科技	2024 年 3 月 20 日	6 个月	新股流通受限	16.16	32.27	481	7,772.96	15,521.87	-

301538	骏鼎达	2024 年 3 月 13 日	6 个月	新股流通 受限	55.82	91.24	150	5,972.74	13,686.00	-
301539	宏鑫科技	2024 年 4 月 3 日	6 个月	新股流通 受限	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-
301565	中仑新材	2024 年 6 月 13 日	6 个月	新股流通 受限	11.88	18.98	711	8,446.68	13,494.78	-
301566	达利凯普	2023 年 12 月 22 日	6 个月	新股流通 受限	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	-
301580	爱迪特	2024 年 6 月 19 日	6 个月	新股流通 受限	44.95	65.93	202	9,079.90	13,317.86	-
301587	中瑞股份	2024 年 3 月 27 日	6 个月	新股流通 受限	21.73	25.26	306	6,649.38	7,729.56	-
301588	美新科技	2024 年 3 月 6 日	6 个月	新股流通 受限	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-
301589	诺瓦星云	2024 年 2 月 1 日	6 个月	新股流通 受限	126.89	188.01	1,244	87,680.99	233,884.44	-
301591	肯特股份	2024 年 2 月 20 日	6 个月	新股流通 受限	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	-
603082	北自科技	2024 年 1 月 23 日	6 个月	新股流通 受限	21.28	29.49	107	2,276.96	3,155.43	-
603285	键邦股份	2024 年 6 月 28 日	1 个月 内(含)	新股流通 受限	18.65	18.65	1,158	21,596.70	21,596.70	-
603285	键邦股份	2024 年 6 月 28 日	6 个月	新股流通 受限	18.65	18.65	129	2,405.85	2,405.85	-
603312	西典新能	2024 年 1 月 4 日	6 个月	新股流通 受限	29.02	25.36	130	3,772.60	3,296.80	-
603325	博隆技术	2024 年 1 月 3 日	6 个月	新股流通 受限	72.46	68.06	66	4,782.36	4,491.96	-
603341	龙旗科技	2024 年 2 月 23	6 个月	新股流通 受限	26.00	37.49	298	7,748.00	11,172.02	-

		日								
603344	星德胜	2024 年 3 月 13 日	6 个月	新股流通 受限	19.18	22.66	182	3,490.76	4,124.12	-
603350	安乃达	2024 年 6 月 26 日	1 个月 内(含)	新股流通 受限	20.56	20.56	945	19,429.20	19,429.20	-
603350	安乃达	2024 年 6 月 26 日	6 个月	新股流通 受限	20.56	20.56	106	2,179.36	2,179.36	-
603375	盛景微	2024 年 1 月 17 日	6 个月	新股流通 受限	38.18	38.90	72	2,748.96	2,800.80	-
603381	永臻股份	2024 年 6 月 19 日	6 个月	新股流通 受限	23.35	25.13	178	4,156.30	4,473.14	-
688530	欧莱新材	2024 年 4 月 29 日	6 个月	新股流通 受限	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-
688584	上海合晶	2024 年 2 月 1 日	6 个月	新股流通 受限	22.66	15.89	866	19,623.56	13,760.74	-
688691	灿芯股份	2024 年 4 月 2 日	6 个月	新股流通 受限	19.86	42.51	247	4,905.42	10,499.97	-
688692	达梦数据	2024 年 6 月 4 日	6 个月	新股流通 受限	86.96	174.93	175	15,218.00	30,612.75	-
688695	中创股份	2024 年 3 月 6 日	6 个月	新股流通 受限	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-
688709	成都华微	2024 年 1 月 31 日	6 个月	新股流通 受限	15.69	18.79	1,045	16,396.05	19,635.55	-

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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

注：对于在流通受限期内发生送股的股票，上表列示的数量为原受限股票数量与送股数量的加总。

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

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 2024 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	14,620,122.25	-	-	-	14,620,122.25
结算备付金	154,904.87	-	-	-	154,904.87
存出保证金	10,078.85	-	-	-	10,078.85
交易性金融资产	-	-	-	677,239,985.10	677,239,985.10
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	14,785,105.97	-	-	677,239,985.10	692,025,091.07
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	289,021.28	289,021.28
应付托管费	-	-	-	57,804.28	57,804.28
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	-	-	-	1,467,842.84	1,467,842.84
负债总计	-	-	-	1,814,668.40	1,814,668.40
利率敏感度缺口	14,785,105.97	-	-	675,425,316.70	690,210,422.67
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	7,294,115.68	-	-	-	7,294,115.68
结算备付金	132,555.77	-	-	-	132,555.77
存出保证金	18,255.19	-	-	-	18,255.19
交易性金融资产	-	-	-	702,637,822.92	702,637,822.92
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	-	-	-	151,764.40	151,764.40
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	7,444,926.64	-	-	702,789,587.32	710,234,513.96
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	298,240.05	298,240.05
应付托管费	-	-	-	59,648.02	59,648.02
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	-	-	-	1,245,868.75	1,245,868.75
负债总计	-	-	-	1,603,756.82	1,603,756.82
利率敏感度缺口	7,444,926.64	-	-	701,185,830.50	708,630,757.14

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末无利率风险的敏感性分析。

6.4.13.4.2 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险，该风险可能与特定投资品种相关，也有可能与整体投资品种相关。本基金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 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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	677,239,985.10	98.12	702,637,822.92	99.15
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	677,239,985.10	98.12	702,637,822.92	99.15

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（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	1. 权益性投资的市场价格上升 5%	33,861,999.26	35,131,891.15
	2. 权益性投资的市场价格下降 5%	-33,861,999.26	-35,131,891.15

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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	676,715,503.60	701,587,295.57
第二层次	45,611.11	-
第三层次	478,870.39	1,050,527.35
合计	677,239,985.10	702,637,822.92

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	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	677,239,985.10	97.86

	其中：股票	677,239,985.10	97.86
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	14,775,027.12	2.14
8	其他各项资产	10,078.85	0.00
9	合计	692,025,091.07	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	7,410,030.20	1.07
B	采矿业	44,644,728.77	6.47
C	制造业	361,598,759.24	52.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,674,262.00	5.17
E	建筑业	14,231,641.80	2.06
F	批发和零售业	4,494,362.88	0.65
G	交通运输、仓储和邮政业	28,508,600.32	4.13
H	住宿和餐饮业	395,256.00	0.06
I	信息传输、软件和信息技术服务业	24,254,331.45	3.51
J	金融业	135,742,387.53	19.67
K	房地产业	6,385,121.40	0.93
L	租赁和商务服务业	5,232,880.00	0.76
M	科学研究和技术服务业	2,743,486.53	0.40
N	水利、环境和公共设施管理业	662,058.60	0.10
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,057,805.32	0.30
R	文化、体育和娱乐业	2,264,353.80	0.33
S	综合	400,576.00	0.06
	合计	676,700,641.84	98.04

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	492,362.24	0.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	46,981.02	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	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	539,343.26	0.08

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	23,667	34,728,719.13	5.03
2	300750	宁德时代	82,920	14,928,087.60	2.16
3	600036	招商银行	391,840	13,397,009.60	1.94
4	600900	长江电力	461,800	13,355,256.00	1.93
5	000858	五粮液	73,300	9,385,332.00	1.36

6	002594	比亚迪	34,200	8,558,550.00	1.24
7	601318	中国平安	203,000	8,396,080.00	1.22
8	601288	农业银行	1,606,700	7,005,212.00	1.01
9	601166	兴业银行	392,100	6,908,802.00	1.00
10	601138	工业富联	250,000	6,850,000.00	0.99
11	601899	紫金矿业	388,600	6,827,702.00	0.99
12	601398	工商银行	1,187,200	6,767,040.00	0.98
13	300760	迈瑞医疗	22,880	6,656,020.80	0.96
14	601328	交通银行	740,700	5,533,029.00	0.80
15	601088	中国神华	124,509	5,524,464.33	0.80
16	002475	立讯精密	135,569	5,329,217.39	0.77
17	601816	京沪高铁	926,500	4,975,305.00	0.72
18	600809	山西汾酒	22,995	4,849,185.60	0.70
19	600309	万华化学	59,296	4,794,674.56	0.69
20	601225	陕西煤业	183,000	4,715,910.00	0.68
21	600276	恒瑞医药	120,332	4,627,968.72	0.67
22	600000	浦发银行	554,000	4,559,420.00	0.66
23	002714	牧原股份	103,262	4,502,223.20	0.65
24	000333	美的集团	65,800	4,244,100.00	0.61
25	600030	中信证券	231,020	4,211,494.60	0.61
26	601857	中国石油	407,600	4,206,432.00	0.61
27	601668	中国建筑	785,400	4,170,474.00	0.60
28	000568	泸州老窖	27,800	3,989,022.00	0.58
29	600028	中国石化	612,500	3,871,000.00	0.56
30	601985	中国核电	356,300	3,798,158.00	0.55
31	600406	国电南瑞	151,594	3,783,786.24	0.55
32	601919	中远海控	240,720	3,728,752.80	0.54
33	000001	平安银行	366,200	3,716,930.00	0.54
34	601601	中国太保	129,200	3,599,512.00	0.52
35	601766	中国中车	459,100	3,447,841.00	0.50
36	600150	中国船舶	84,400	3,435,924.00	0.50
37	600690	海尔智家	119,000	3,377,220.00	0.49
38	002352	顺丰控股	92,400	3,297,756.00	0.48
39	002371	北方华创	10,100	3,230,889.00	0.47
40	300059	东方财富	297,813	3,144,905.28	0.46
41	600887	伊利股份	120,100	3,103,384.00	0.45
42	601988	中国银行	667,300	3,082,926.00	0.45
43	688041	海光信息	43,700	3,072,984.00	0.45
44	603288	海天味业	87,403	3,012,781.41	0.44
45	300308	中际旭创	21,180	2,920,298.40	0.42
46	000725	京东方 A	697,500	2,852,775.00	0.41
47	603993	洛阳钼业	333,400	2,833,900.00	0.41
48	600050	中国联通	600,100	2,820,470.00	0.41

49	601658	邮储银行	548,700	2,781,909.00	0.40
50	601818	光大银行	875,700	2,775,969.00	0.40
51	600019	宝钢股份	417,400	2,775,710.00	0.40
52	002142	宁波银行	124,630	2,749,337.80	0.40
53	600031	三一重工	160,200	2,643,300.00	0.38
54	601127	赛力斯	28,500	2,596,920.00	0.38
55	600919	江苏银行	346,340	2,573,306.20	0.37
56	600886	国投电力	140,600	2,564,544.00	0.37
57	600016	民生银行	669,300	2,536,647.00	0.37
58	601390	中国中铁	387,700	2,527,804.00	0.37
59	300498	温氏股份	125,600	2,489,392.00	0.36
60	300274	阳光电源	39,310	2,438,399.30	0.35
61	600989	宝丰能源	138,300	2,396,739.00	0.35
62	601006	大秦铁路	331,400	2,372,824.00	0.34
63	600905	三峡能源	540,200	2,355,272.00	0.34
64	600436	片仔癀	11,300	2,341,021.00	0.34
65	601169	北京银行	399,100	2,330,744.00	0.34
66	601888	中国中免	36,900	2,305,881.00	0.33
67	002304	洋河股份	28,400	2,293,016.00	0.33
68	603501	韦尔股份	22,915	2,277,063.55	0.33
69	000063	中兴通讯	75,900	2,122,923.00	0.31
70	000625	长安汽车	156,208	2,097,873.44	0.30
71	000651	格力电器	53,100	2,082,582.00	0.30
72	000338	潍柴动力	128,000	2,078,720.00	0.30
73	601009	南京银行	195,300	2,029,167.00	0.29
74	688111	金山办公	8,900	2,024,750.00	0.29
75	600104	上汽集团	145,568	2,017,572.48	0.29
76	600795	国电电力	336,600	2,016,234.00	0.29
77	601012	隆基绿能	142,935	2,003,948.70	0.29
78	600048	保利发展	226,000	1,979,760.00	0.29
79	600999	招商证券	140,980	1,961,031.80	0.28
80	601229	上海银行	267,994	1,945,636.44	0.28
81	601211	国泰君安	141,700	1,920,035.00	0.28
82	601600	中国铝业	249,500	1,903,685.00	0.28
83	002230	科大讯飞	43,800	1,881,210.00	0.27
84	603259	药明康德	47,937	1,878,651.03	0.27
85	600547	山东黄金	68,308	1,870,273.04	0.27
86	600346	恒力石化	132,900	1,853,955.00	0.27
87	002493	荣盛石化	191,174	1,846,740.84	0.27
88	600893	航发动力	50,200	1,834,810.00	0.27
89	000166	申万宏源	425,200	1,832,612.00	0.27
90	601669	中国电建	325,100	1,817,309.00	0.26
91	300015	爱尔眼科	175,951	1,815,814.32	0.26

92	600660	福耀玻璃	37,800	1,810,620.00	0.26
93	000792	盐湖股份	102,600	1,790,370.00	0.26
94	600585	海螺水泥	75,600	1,783,404.00	0.26
95	002938	鹏鼎控股	43,900	1,745,464.00	0.25
96	000538	云南白药	33,940	1,736,031.00	0.25
97	600674	川投能源	92,000	1,725,000.00	0.25
98	688271	联影医疗	15,700	1,722,290.00	0.25
99	300433	蓝思科技	94,100	1,717,325.00	0.25
100	601688	华泰证券	137,900	1,708,581.00	0.25
101	600011	华能国际	172,900	1,663,298.00	0.24
102	688012	中微公司	11,700	1,652,742.00	0.24
103	002027	分众传媒	272,600	1,651,956.00	0.24
104	000596	古井贡酒	7,800	1,646,346.00	0.24
105	600188	兖矿能源	72,300	1,643,379.00	0.24
106	688036	传音控股	21,420	1,639,486.80	0.24
107	601628	中国人寿	52,315	1,624,380.75	0.24
108	600438	通威股份	84,900	1,622,439.00	0.24
109	601111	中国国航	219,600	1,620,648.00	0.23
110	600015	华夏银行	250,300	1,601,920.00	0.23
111	000425	徐工机械	223,000	1,594,450.00	0.23
112	688256	寒武纪	8,000	1,589,360.00	0.23
113	601066	中信建投	81,609	1,570,157.16	0.23
114	600837	海通证券	182,200	1,559,632.00	0.23
115	000895	双汇发展	65,400	1,554,558.00	0.23
116	300014	亿纬锂能	38,713	1,545,422.96	0.22
117	000100	TCL 科技	354,390	1,530,964.80	0.22
118	001979	招商蛇口	170,900	1,502,211.00	0.22
119	600023	浙能电力	210,900	1,499,499.00	0.22
120	601881	中国银河	136,400	1,481,304.00	0.21
121	002311	海大集团	31,400	1,477,370.00	0.21
122	600926	杭州银行	111,900	1,460,295.00	0.21
123	300502	新易盛	13,300	1,403,815.00	0.20
124	003816	中国广核	297,000	1,375,110.00	0.20
125	605499	东鹏饮料	6,300	1,359,225.00	0.20
126	601995	中金公司	45,900	1,359,099.00	0.20
127	000776	广发证券	111,600	1,358,172.00	0.20
128	600489	中金黄金	91,500	1,354,200.00	0.20
129	601939	建设银行	181,100	1,340,140.00	0.19
130	600089	特变电工	95,400	1,323,198.00	0.19
131	002463	沪电股份	36,120	1,318,380.00	0.19
132	603392	万泰生物	19,884	1,309,957.92	0.19
133	600845	宝信软件	40,807	1,302,967.51	0.19
134	601872	招商轮船	153,800	1,299,610.00	0.19

135	601868	中国能建	612,100	1,297,652.00	0.19
136	600115	中国东航	322,942	1,294,997.42	0.19
137	300124	汇川技术	25,200	1,292,760.00	0.19
138	000002	万科 A	183,500	1,271,655.00	0.18
139	300122	智飞生物	45,300	1,269,759.00	0.18
140	002241	歌尔股份	64,100	1,250,591.00	0.18
141	600029	南方航空	212,000	1,248,680.00	0.18
142	688008	澜起科技	21,700	1,240,372.00	0.18
143	600160	巨化股份	50,900	1,228,217.00	0.18
144	601825	沪农商行	182,000	1,223,040.00	0.18
145	000938	紫光股份	53,900	1,204,665.00	0.17
146	601901	方正证券	155,300	1,200,469.00	0.17
147	600010	包钢股份	856,700	1,199,380.00	0.17
148	603986	兆易创新	12,508	1,196,014.96	0.17
149	601633	长城汽车	46,900	1,186,570.00	0.17
150	601336	新华保险	39,400	1,183,182.00	0.17
151	601100	恒立液压	25,282	1,177,635.56	0.17
152	600111	北方稀土	68,300	1,174,760.00	0.17
153	601689	拓普集团	21,900	1,174,059.00	0.17
154	002648	卫星化学	63,547	1,142,575.06	0.17
155	601916	浙商银行	406,620	1,122,271.20	0.16
156	002001	新和成	58,308	1,119,513.60	0.16
157	688223	晶科能源	157,300	1,116,830.00	0.16
158	600027	华电国际	160,700	1,115,258.00	0.16
159	600703	三安光电	94,200	1,104,024.00	0.16
160	000983	山西焦煤	107,020	1,103,376.20	0.16
161	601838	成都银行	72,100	1,095,199.00	0.16
162	603369	今世缘	23,600	1,090,320.00	0.16
163	600066	宇通客车	41,900	1,081,020.00	0.16
164	600039	四川路桥	136,920	1,080,298.80	0.16
165	601788	光大证券	73,800	1,078,956.00	0.16
166	600584	长电科技	33,800	1,071,798.00	0.16
167	600958	东方证券	140,924	1,071,022.40	0.16
168	600426	华鲁恒升	40,150	1,069,596.00	0.15
169	300033	同花顺	10,200	1,057,740.00	0.15
170	300408	三环集团	36,200	1,056,678.00	0.15
171	002736	国信证券	120,900	1,050,621.00	0.15
172	601618	中国中冶	336,900	1,044,390.00	0.15
173	601021	春秋航空	18,400	1,036,472.00	0.15
174	601360	三六零	134,900	1,036,032.00	0.15
175	002916	深南电路	9,740	1,030,199.80	0.15
176	000999	华润三九	24,180	1,029,584.40	0.15
177	000157	中联重科	134,000	1,029,120.00	0.15

178	600026	中远海能	65,600	1,024,016.00	0.15
179	601699	潞安环能	56,400	1,022,532.00	0.15
180	600522	中天科技	64,500	1,022,325.00	0.15
181	600233	圆通速递	65,000	1,017,250.00	0.15
182	001965	招商公路	85,700	1,016,402.00	0.15
183	600803	新奥股份	48,700	1,012,960.00	0.15
184	000977	浪潮信息	27,732	1,008,612.84	0.15
185	601607	上海医药	52,500	1,003,275.00	0.15
186	300896	爱美客	5,780	994,738.00	0.14
187	000301	东方盛虹	124,800	994,656.00	0.14
188	300832	新产业	14,700	991,368.00	0.14
189	600085	同仁堂	25,900	989,639.00	0.14
190	002252	上海莱士	125,500	981,410.00	0.14
191	600741	华域汽车	59,500	974,610.00	0.14
192	600600	青岛啤酒	13,300	967,841.00	0.14
193	600875	东方电气	52,400	966,780.00	0.14
194	688169	石头科技	2,460	965,796.00	0.14
195	002028	思源电气	14,400	963,360.00	0.14
196	002236	大华股份	62,200	961,612.00	0.14
197	601117	中国化学	115,200	949,248.00	0.14
198	000786	北新建材	31,900	946,154.00	0.14
199	002600	领益智造	132,300	941,976.00	0.14
200	688396	华润微	25,117	940,380.48	0.14
201	600183	生益科技	44,600	939,276.00	0.14
202	603195	公牛集团	12,155	937,393.60	0.14
203	300394	天孚通信	10,540	931,946.80	0.14
204	601567	三星医疗	26,600	931,000.00	0.13
205	600362	江西铜业	39,200	928,256.00	0.13
206	000963	华东医药	33,100	920,511.00	0.13
207	601319	中国人保	178,600	919,790.00	0.13
208	002422	科伦药业	30,200	915,966.00	0.13
209	002920	德赛西威	10,500	914,445.00	0.13
210	600161	天坛生物	37,320	910,608.00	0.13
211	002128	电投能源	42,400	894,640.00	0.13
212	600196	复星医药	40,100	887,814.00	0.13
213	000807	云铝股份	65,500	884,905.00	0.13
214	601727	上海电气	238,801	883,563.70	0.13
215	000617	中油资本	159,100	878,232.00	0.13
216	300628	亿联网络	23,800	875,126.00	0.13
217	002460	赣锋锂业	30,460	872,679.00	0.13
218	601058	赛轮轮胎	62,100	869,400.00	0.13
219	000708	中信特钢	63,700	864,409.00	0.13
220	000630	铜陵有色	239,100	863,151.00	0.13

221	000933	神火股份	42,500	859,775.00	0.12
222	000975	山金国际	52,280	851,641.20	0.12
223	600733	北汽蓝谷	105,200	850,016.00	0.12
224	600985	淮北矿业	50,700	848,718.00	0.12
225	600219	南山铝业	221,000	842,010.00	0.12
226	300999	金龙鱼	30,700	839,645.00	0.12
227	002049	紫光国微	15,940	838,444.00	0.12
228	601077	渝农商行	166,900	837,838.00	0.12
229	002601	龙佰集团	45,100	837,507.00	0.12
230	600398	海澜之家	90,600	837,144.00	0.12
231	600176	中国巨石	75,625	835,656.25	0.12
232	605117	德业股份	11,236	835,284.24	0.12
233	002466	天齐锂业	27,900	834,489.00	0.12
234	600221	海航控股	815,700	832,014.00	0.12
235	600256	广汇能源	124,000	830,800.00	0.12
236	601377	兴业证券	163,070	825,134.20	0.12
237	600642	申能股份	92,300	815,009.00	0.12
238	688009	中国通号	135,700	814,200.00	0.12
239	300782	卓胜微	10,156	789,527.44	0.11
240	601168	西部矿业	43,900	788,005.00	0.11
241	601878	浙商证券	73,300	785,776.00	0.11
242	000876	新希望	85,700	783,298.00	0.11
243	601179	中国西电	96,800	778,272.00	0.11
244	600332	白云山	26,500	777,245.00	0.11
245	601877	正泰电器	40,600	773,836.00	0.11
246	600415	小商品城	103,600	768,712.00	0.11
247	600018	上港集团	131,900	762,382.00	0.11
248	600009	上海机场	23,418	755,230.50	0.11
249	000423	东阿阿胶	12,020	752,452.00	0.11
250	600918	中泰证券	131,600	746,172.00	0.11
251	300418	昆仑万维	22,900	738,296.00	0.11
252	300413	芒果超媒	35,300	737,770.00	0.11
253	002078	太阳纸业	52,700	735,165.00	0.11
254	600487	亨通光电	46,500	733,305.00	0.11
255	300661	圣邦股份	8,830	730,947.40	0.11
256	601233	桐昆股份	45,500	726,180.00	0.11
257	603806	福斯特	49,227	723,636.90	0.10
258	601238	广汽集团	93,000	719,820.00	0.10
259	601865	福莱特	35,800	719,580.00	0.10
260	603198	迎驾贡酒	12,500	718,750.00	0.10
261	000408	藏格矿业	29,800	717,286.00	0.10
262	688126	沪硅产业	51,800	715,358.00	0.10
263	300866	安克创新	10,040	714,948.40	0.10

264	603799	华友钴业	32,294	714,666.22	0.10
265	688188	柏楚电子	3,864	713,101.20	0.10
266	002532	天山铝业	87,800	712,058.00	0.10
267	300316	晶盛机电	24,700	709,631.00	0.10
268	002223	鱼跃医疗	18,800	706,880.00	0.10
269	002625	光启技术	40,700	706,145.00	0.10
270	002180	纳思达	26,700	705,414.00	0.10
271	000661	长春高新	7,676	704,426.52	0.10
272	601991	大唐发电	233,900	704,039.00	0.10
273	002459	晶澳科技	62,428	699,193.60	0.10
274	688599	天合光能	41,000	693,720.00	0.10
275	688303	大全能源	34,000	693,260.00	0.10
276	603260	合盛硅业	14,800	691,308.00	0.10
277	600061	国投资本	121,200	684,780.00	0.10
278	688187	时代电气	13,800	681,444.00	0.10
279	600348	华阳股份	68,150	678,774.00	0.10
280	600515	海南机场	215,600	676,984.00	0.10
281	600096	云天化	34,700	673,874.00	0.10
282	002353	杰瑞股份	19,200	673,536.00	0.10
283	002050	三花智控	35,300	673,524.00	0.10
284	002064	华峰化学	93,700	671,829.00	0.10
285	002384	东山精密	32,300	668,610.00	0.10
286	300765	新诺威	26,500	668,595.00	0.10
287	603568	伟明环保	32,170	662,058.60	0.10
288	600745	闻泰科技	23,400	661,050.00	0.10
289	002129	TCL 中环	76,175	658,913.75	0.10
290	688072	拓荆科技	5,476	657,722.36	0.10
291	000027	深圳能源	89,700	654,810.00	0.09
292	600418	江淮汽车	41,300	654,192.00	0.09
293	300442	润泽科技	27,000	646,650.00	0.09
294	600588	用友网络	64,560	645,600.00	0.09
295	002074	国轩高科	33,700	645,355.00	0.09
296	002156	通富微电	28,600	640,354.00	0.09
297	002709	天赐材料	36,320	637,779.20	0.09
298	601958	金钼股份	60,900	633,969.00	0.09
299	600570	恒生电子	35,820	632,581.20	0.09
300	300751	迈为股份	5,288	631,810.24	0.09
301	603606	东方电缆	12,900	629,649.00	0.09
302	301236	软通动力	17,850	628,498.50	0.09
303	600177	雅戈尔	87,400	622,288.00	0.09
304	601577	长沙银行	75,900	620,862.00	0.09
305	002340	格林美	97,000	617,890.00	0.09
306	600060	海信视像	24,600	608,604.00	0.09

307	601799	星宇股份	5,400	605,016.00	0.09
308	600970	中材国际	49,800	600,588.00	0.09
309	603160	汇顶科技	8,700	598,125.00	0.09
310	601216	君正集团	159,300	587,817.00	0.09
311	603338	浙江鼎力	9,648	582,932.16	0.08
312	002812	恩捷股份	18,400	582,360.00	0.08
313	603979	金诚信	11,500	581,095.00	0.08
314	601108	财通证券	87,620	579,168.20	0.08
315	000932	华菱钢铁	130,400	577,672.00	0.08
316	600282	南钢股份	115,400	574,692.00	0.08
317	002595	豪迈科技	15,000	572,550.00	0.08
318	603659	璞泰来	40,430	571,275.90	0.08
319	688777	中控技术	15,100	569,270.00	0.08
320	002409	雅克科技	9,000	566,190.00	0.08
321	000988	华工科技	18,900	565,677.00	0.08
322	600038	中直股份	13,700	563,207.00	0.08
323	688120	华海清科	2,969	562,863.02	0.08
324	000921	海信家电	17,400	560,976.00	0.08
325	603939	益丰药房	22,832	560,525.60	0.08
326	002294	信立泰	21,000	559,230.00	0.08
327	601231	环旭电子	34,800	558,540.00	0.08
328	600132	重庆啤酒	9,200	558,440.00	0.08
329	002444	巨星科技	22,600	558,220.00	0.08
330	002281	光迅科技	14,900	556,813.00	0.08
331	600873	梅花生物	55,500	556,110.00	0.08
332	601555	东吴证券	93,743	553,083.70	0.08
333	600460	士兰微	31,400	549,814.00	0.08
334	600566	济川药业	17,300	548,583.00	0.08
335	600546	山煤国际	37,500	548,250.00	0.08
336	002555	三七互娱	41,900	546,795.00	0.08
337	300919	中伟股份	17,640	546,663.60	0.08
338	002007	华兰生物	34,590	546,176.10	0.08
339	603899	晨光股份	17,400	544,272.00	0.08
340	600895	张江高科	29,300	541,464.00	0.08
341	600582	天地科技	77,900	536,731.00	0.08
342	601990	南京证券	69,600	534,528.00	0.08
343	300207	欣旺达	35,200	533,984.00	0.08
344	000066	中国长城	60,900	532,875.00	0.08
345	301269	华大九天	6,900	531,645.00	0.08
346	600968	海油发展	128,500	529,420.00	0.08
347	600109	国金证券	70,100	529,255.00	0.08
348	600079	人福医药	30,800	528,836.00	0.08
349	600352	浙江龙盛	61,400	527,426.00	0.08

350	300003	乐普医疗	35,500	526,820.00	0.08
351	002085	万丰奥威	39,700	525,628.00	0.08
352	600021	上海电力	53,100	525,159.00	0.08
353	601928	凤凰传媒	47,900	524,984.00	0.08
354	002673	西部证券	84,300	521,817.00	0.08
355	688363	华熙生物	9,200	520,444.00	0.08
356	300759	康龙化成	27,975	519,775.50	0.08
357	002966	苏州银行	69,300	519,750.00	0.08
358	601666	平煤股份	46,400	519,680.00	0.08
359	603833	欧派家居	9,620	515,247.20	0.07
360	600497	驰宏锌锗	96,200	513,708.00	0.07
361	600988	赤峰黄金	31,400	513,076.00	0.07
362	002032	苏泊尔	10,200	511,020.00	0.07
363	601966	玲珑轮胎	27,769	510,116.53	0.07
364	002939	长城证券	76,000	509,200.00	0.07
365	688065	凯赛生物	11,200	508,368.00	0.07
366	000831	中国稀土	20,000	507,000.00	0.07
367	600153	建发股份	56,700	506,331.00	0.07
368	603156	养元饮品	23,800	506,226.00	0.07
369	603486	科沃斯	10,700	504,826.00	0.07
370	300223	北京君正	9,100	504,504.00	0.07
371	000783	长江证券	104,400	504,252.00	0.07
372	603658	安图生物	10,900	502,163.00	0.07
373	000728	国元证券	82,240	498,374.40	0.07
374	002739	万达电影	41,200	498,108.00	0.07
375	000738	航发控制	24,800	497,736.00	0.07
376	603816	顾家家居	15,410	497,588.90	0.07
377	600157	永泰能源	419,200	494,656.00	0.07
378	688728	格科微	40,800	494,088.00	0.07
379	600583	海油工程	83,400	492,894.00	0.07
380	002185	华天科技	60,400	492,260.00	0.07
381	000703	恒逸石化	69,270	491,124.30	0.07
382	002152	广电运通	46,700	488,482.00	0.07
383	000683	远兴能源	70,400	486,464.00	0.07
384	601198	东兴证券	60,990	485,480.40	0.07
385	002603	以岭药业	31,540	483,508.20	0.07
386	600536	中国软件	16,160	483,507.20	0.07
387	002602	世纪华通	140,520	481,983.60	0.07
388	601866	中远海发	186,700	481,686.00	0.07
389	002456	欧菲光	61,500	480,315.00	0.07
390	000960	锡业股份	31,000	480,190.00	0.07
391	601696	中银证券	52,800	479,424.00	0.07
392	002465	海格通信	46,100	477,596.00	0.07

393	600521	华海药业	27,990	477,229.50	0.07
394	002414	高德红外	80,489	474,080.21	0.07
395	688082	盛美上海	5,600	473,256.00	0.07
396	688122	西部超导	12,320	472,102.40	0.07
397	000729	燕京啤酒	53,200	469,756.00	0.07
398	688099	晶晨股份	7,900	468,628.00	0.07
399	603893	瑞芯微	7,900	467,443.00	0.07
400	300251	光线传媒	55,300	465,073.00	0.07
401	600998	九州通	95,266	464,898.08	0.07
402	002372	伟星新材	30,000	462,600.00	0.07
403	600549	厦门钨业	26,700	460,575.00	0.07
404	603885	吉祥航空	41,900	460,481.00	0.07
405	000800	一汽解放	58,300	456,489.00	0.07
406	600298	安琪酵母	16,300	455,259.00	0.07
407	600369	西南证券	125,500	449,290.00	0.07
408	002262	恩华药业	18,900	448,686.00	0.07
409	002831	裕同科技	17,500	447,825.00	0.06
410	000937	冀中能源	66,700	446,890.00	0.06
411	603529	爱玛科技	16,200	442,746.00	0.06
412	603596	伯特利	11,320	440,348.00	0.06
413	603589	口子窖	11,200	438,928.00	0.06
414	000629	钒钛股份	175,300	438,250.00	0.06
415	600486	扬农化工	7,760	438,052.00	0.06
416	002202	金风科技	65,100	437,472.00	0.06
417	601880	辽港股份	355,000	436,650.00	0.06
418	000733	振华科技	10,500	436,065.00	0.06
419	601456	国联证券	45,200	435,728.00	0.06
420	300146	汤臣倍健	32,100	434,955.00	0.06
421	600511	国药股份	14,100	434,139.00	0.06
422	688538	和辉光电	218,000	431,640.00	0.06
423	002821	凯莱英	6,540	430,332.00	0.06
424	000513	丽珠集团	11,500	427,915.00	0.06
425	600704	物产中大	98,100	425,754.00	0.06
426	600004	白云机场	44,700	423,756.00	0.06
427	002120	韵达股份	54,740	423,687.60	0.06
428	600598	北大荒	33,500	418,415.00	0.06
429	000009	中国宝安	48,600	417,960.00	0.06
430	603345	安井食品	5,600	416,136.00	0.06
431	603000	人民网	20,800	415,792.00	0.06
432	600848	上海临港	45,340	413,047.40	0.06
433	002430	杭氧股份	18,500	411,625.00	0.06
434	600378	昊华科技	14,200	410,380.00	0.06
435	300454	深信服	8,000	404,240.00	0.06

436	002797	第一创业	79,300	403,637.00	0.06
437	300037	新宙邦	14,120	403,267.20	0.06
438	600673	东阳光	56,900	400,576.00	0.06
439	300487	蓝晓科技	9,550	398,808.00	0.06
440	300496	中科创达	8,700	396,633.00	0.06
441	300144	宋城演艺	49,360	396,360.80	0.06
442	600754	锦江酒店	17,200	395,256.00	0.06
443	600380	健康元	35,300	394,301.00	0.06
444	600699	均胜电子	26,560	393,619.20	0.06
445	002080	中材科技	30,500	393,450.00	0.06
446	002508	老板电器	17,800	393,380.00	0.06
447	000987	越秀资本	78,915	391,418.40	0.06
448	300957	贝泰妮	8,100	391,392.00	0.06
449	600839	四川长虹	87,000	390,630.00	0.06
450	002850	科达利	5,100	389,538.00	0.06
451	603290	斯达半导	4,520	389,217.20	0.06
452	000723	美锦能源	81,700	388,892.00	0.06
453	002517	恺英网络	40,700	388,685.00	0.06
454	300699	光威复材	15,620	387,844.60	0.06
455	002841	视源股份	13,100	386,843.00	0.06
456	600637	东方明珠	63,500	386,080.00	0.06
457	600072	中船科技	28,400	383,968.00	0.06
458	002056	横店东磁	30,700	382,829.00	0.06
459	600977	中国电影	35,300	379,828.00	0.06
460	600655	豫园股份	73,600	379,040.00	0.05
461	000709	河钢股份	195,100	378,494.00	0.05
462	688114	华大智造	7,900	374,539.00	0.05
463	600705	中航产融	166,600	369,852.00	0.05
464	002756	永兴材料	10,270	367,460.60	0.05
465	002738	中矿资源	13,688	366,838.40	0.05
466	000825	太钢不锈	107,900	364,702.00	0.05
467	600170	上海建工	167,400	359,910.00	0.05
468	600702	舍得酒业	6,300	357,021.00	0.05
469	601162	天风证券	163,600	356,648.00	0.05
470	600779	水井坊	9,300	349,959.00	0.05
471	600884	杉杉股份	42,700	346,724.00	0.05
472	300347	泰格医药	7,100	345,060.00	0.05
473	300142	沃森生物	30,300	344,814.00	0.05
474	600166	福田汽车	150,900	339,525.00	0.05
475	600872	中炬高新	14,700	333,543.00	0.05
476	600563	法拉电子	4,300	327,574.00	0.05
477	300601	康泰生物	20,980	327,497.80	0.05
478	603728	鸣志电器	8,000	321,840.00	0.05

479	300763	锦浪科技	7,600	316,464.00	0.05
480	600732	爱旭股份	34,540	312,587.00	0.05
481	603233	大参林	21,414	306,220.20	0.04
482	603688	石英股份	10,250	303,502.50	0.04
483	002271	东方雨虹	23,700	292,458.00	0.04
484	603077	和邦生物	166,500	274,725.00	0.04
485	603882	金域医学	8,900	241,991.00	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	301589	诺瓦星云	1,244	233,884.44	0.03
2	688692	达梦数据	175	30,612.75	0.00
3	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.00
4	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.00
5	688709	成都华微	1,045	19,635.55	0.00
6	301536	星辰科技	481	15,521.87	0.00
7	688584	上海合晶	866	13,760.74	0.00
8	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.00
9	301565	中仑新材	711	13,494.78	0.00
10	301580	爱迪特	202	13,317.86	0.00
11	603341	龙旗科技	298	11,172.02	0.00
12	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
13	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
14	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
15	301413	安培龙	213	8,807.55	0.00
16	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
17	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
18	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
19	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
20	301578	辰奕智能	153	6,054.21	0.00
21	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
22	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
23	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
24	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
25	603325	博隆技术	66	4,491.96	0.00
26	603381	永臻股份	178	4,473.14	0.00
27	603344	星德胜	182	4,124.12	0.00
28	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
29	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00

30	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
31	001379	腾达科技	213	2,871.24	0.00
32	603375	盛景微	72	2,800.80	0.00
33	001387	雪祺电气	173	2,638.25	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	000333	美的集团	4,276,701.00	0.60
2	600519	贵州茅台	1,501,826.00	0.21
3	000708	中信特钢	967,392.00	0.14
4	001965	招商公路	950,900.00	0.13
5	601567	三星医疗	742,424.00	0.10
6	000921	海信家电	714,135.00	0.10
7	603979	金诚信	655,105.00	0.09
8	601881	中国银河	633,860.00	0.09
9	688041	海光信息	627,037.15	0.09
10	601666	平煤股份	606,525.00	0.09
11	600282	南钢股份	601,869.00	0.08
12	002085	万丰奥威	596,935.00	0.08
13	688114	华大智造	572,847.23	0.08
14	600582	天地科技	557,582.00	0.08
15	600968	海油发展	539,404.00	0.08
16	300750	宁德时代	527,260.00	0.07
17	603392	万泰生物	359,524.00	0.05
18	601006	大秦铁路	358,414.00	0.05
19	600900	长江电力	337,858.00	0.05
20	300760	迈瑞医疗	320,641.00	0.05

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

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	750,212.00	0.11
2	002244	滨江集团	506,876.00	0.07

3	601155	新城控股	467,588.00	0.07
4	002568	百润股份	450,050.08	0.06
5	603737	三棵树	444,815.96	0.06
6	601615	明阳智能	444,287.00	0.06
7	300724	捷佳伟创	436,762.00	0.06
8	601933	永辉超市	432,239.00	0.06
9	000069	华侨城 A	426,445.00	0.06
10	002138	顺络电子	425,061.00	0.06
11	600606	绿地控股	417,209.00	0.06
12	300760	迈瑞医疗	409,675.00	0.06
13	688692	达梦数据	408,749.50	0.06
14	000021	深科技	403,619.00	0.06
15	688180	君实生物	403,030.84	0.06
16	002926	华西证券	400,730.00	0.06
17	002558	巨人网络	399,726.00	0.06
18	000591	太阳能	399,694.00	0.06
19	002299	圣农发展	399,371.00	0.06
20	688032	禾迈股份	399,092.88	0.06

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	38,096,278.71
卖出股票收入（成交）总额	48,369,234.96

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农业银行（证券代码 601288）、兴业银行（证券代码 601166）、招商银行（证券代码 600036）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、农业银行（证券代码 601288）

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

2、兴业银行（证券代码 601166）

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

3、招商银行（证券代码 600036）

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

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	10,078.85
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,078.85

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	301589	诺瓦星云	233,884.44	0.03	新股流通受限
2	688692	达梦数据	30,612.75	0.00	新股流通受限
3	603285	键邦股份	24,002.55	0.00	新股流通受限
4	603350	安乃达	21,608.56	0.00	新股流通受限
5	688709	成都华微	19,635.55	0.00	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
437	1,404,931.47	604,488,250.00	98.46%	9,466,801.00	1.54%	432,000,000.00	70.36%

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	26.40%
2	招商证券股份有限公司	4,672,250.00	0.76%
3	广发证券股份有限公司	2,470,100.00	0.40%
4	中信证券股份有限公司	1,711,800.00	0.28%
5	张永峰	1,000,000.00	0.16%
6	兴证全球基金-招商证券股份有限公司-兴全-华茂 1 号 FOF 单一资产管理计划	783,600.00	0.13%
7	海通证券股份有限公司	775,000.00	0.13%
8	梁维灿	600,000.00	0.10%
9	王喆	300,000.00	0.05%
10	陈长安	202,000.00	0.03%
-	招商 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 联接	432,000,000.00	70.36%

注：以上数据由中国证券登记结算公司提供，前十名持有人均为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(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	637,955,051.00
本报告期基金总申购份额	4,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	28,000,000.00
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	613,955,051.00

§ 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

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，经中国银行股份有限公司研究决定，郭德秋先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

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	6	51,996,969.09	61.44%	12,787.53	72.87%	-
方正证券	7	32,634,000.89	38.56%	4,762.01	27.13%	-
财通证券	3	-	-	-	-	-
长城证券	3	-	-	-	-	-
长江证券	4	-	-	-	-	-
诚通证券	1	-	-	-	-	-
大通证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	4	-	-	-	-	-
第一创业	3	-	-	-	-	-
东北证券	3	-	-	-	-	-
东方财富	3	-	-	-	-	-
东方证券	3	-	-	-	-	-
东海证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	6	-	-	-	-	-
东兴证券	3	-	-	-	-	-
光大证券	3	-	-	-	-	-
广发证券	7	-	-	-	-	-
国海证券	3	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	4	-	-	-	-	-

国盛证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	3	-	-	-	-	-
国投证券	6	-	-	-	-	-
国新证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	3	-	-	-	-	-
国元证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	4	-	-	-	-	-
宏信证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	5	-	-	-	-	-
华宝证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	4	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	4	-	-	-	-	-
华泰证券	4	-	-	-	-	-
华西证券	3	-	-	-	-	-
华源证券	2	-	-	-	-	-
华鑫证券	2	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	5	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	3	-	-	-	-	-
瑞信方正	2	-	-	-	-	-
山西证券	6	-	-	-	-	-
上海证券	2	-	-	-	-	-
申港证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
首创证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证 券	2	-	-	-	-	-
天风证券	5	-	-	-	-	-
万和证券	1	-	-	-	-	-
五矿证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	3	-	-	-	-	-
信达证券	7	-	-	-	-	-
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	5	-	-	-	-	-
中泰证券	3	-	-	-	-	-
中信建投 证券	5	-	-	-	-	-
中信证券	11	-	-	-	-	-
中银国际 证券	4	-	-	-	-	-
中邮证券	2	-	-	-	-	-
甬兴证券	2	-	-	-	-	-

注：本报告期内，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	54,597.80	100.00%	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
诚通证券	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-

国联证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
国新证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
华源证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证 券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
万和证券	-	-	-	-	-	-
五矿证券	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-
甬兴证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	招商基金管理有限公司旗下部分基金增加民生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	2024-01-15
2	招商基金管理有限公司关于终止北京中期时代基金销售有限公司办理旗下基金销售业务的公告	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	2024-01-18
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 2023 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	2024-01-19
4	招商基金管理有限公司旗下基金 2023 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	2024-01-19
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	2024-02-02
6	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（二零二四年第一号）	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	2024-02-02
7	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增加华泰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	2024-02-07
8	招商基金管理有限公司旗下部分基金增加申万宏源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	2024-02-28
9	招商基金管理有限公司旗下部分基金增加申万宏源西部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	2024-02-28

10	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	2024-03-29
11	招商基金管理有限公司旗下基金 2023 年年度报告提示性公告	上海证券报及基金管理人网站	2024-03-29
12	招商基金管理有限公司旗下基金 2024 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	2024-04-19
13	招商 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金 2024 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	2024-04-19
14	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	2024-05-18
15	招商基金管理有限公司旗下部分基金增加东方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	2024-05-29
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	2024-06-05
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	2024-06-27
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	2024-06-28

§ 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	20240101-20240630	452,000,000.00	-	20,000,000.00	432,000,000.00	70.36%

机构	1	20240101- 20240630	162,075,500.00	-	-	162,075,500.00	26.40%
----	---	-----------------------	----------------	---	---	----------------	--------

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、红利再投资或者买入等业务增加的份额，赎回份额包含赎回、转换转出或者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

2024 年 8 月 30 日