

招商中证国新央企股东回报交易型开 放式指数证券投资基金发起式联接基金 2024 年第 3 季度报告

2024 年 09 月 30 日

基金管理人：招商基金管理有限公司

基金托管人：中信建投证券股份有限公司

送出日期：2024 年 10 月 24 日

§ 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。

基金托管人中信建投证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 10 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 招商中证国新央企股东回报 ETF 发起式联接 |
| 基金主代码 | 019544 |
| 交易代码 | 019544 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2023 年 12 月 29 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 15,610,217.70 份 |
| 投资目标 | 通过对目标 ETF 基金份额的投资，追求跟踪标的指数，获得与指数收益相似的回报。 |
| 投资策略 | 本基金为目标 ETF 的联接基金，以目标 ETF 作为主要投资标的，方便投资人通过本基金投资目标 ETF，本基金并不参与目标 ETF 的管理。本基金力争将日均跟踪偏离度控制在 0.35% 以内，年化跟踪误差控制在 4% 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。 本基金的投资策略由目标 ETF 投资策略、股票投资策略、债券投资策略、可转换债券和可交换债券投资策略、金融衍生品投资策略、资产支持证券投资策略、参与融资及转融通证券出借业务的投资策略、存托凭证投资策略等部分组成。 |
| 业绩比较基准 | 中证国新央企股东回报指数收益率×95%+中国人民银行人 |

| | | |
|-----------------|--|--------------------------|
| | 民币活期存款利率（税后）×5% | |
| 风险收益特征 | 本基金为 ETF 联接基金，目标 ETF 为股票型指数基金，本基金预期收益及预期风险水平高于债券型基金、货币市场基金。本基金主要通过投资于目标 ETF 跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的证券市场相似的风险收益特征。 | |
| 基金管理人 | 招商基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中信建投证券股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 招商中证国新央企股东回报 ETF 发起式联接 A | 招商中证国新央企股东回报 ETF 发起式联接 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 019544 | 019545 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 12,954,662.55 份 | 2,655,555.15 份 |

2.1.1 目标基金基本情况

| | |
|--------------|----------------------------|
| 基金名称 | 招商中证国新央企股东回报交易型开放式指数证券投资基金 |
| 基金主代码 | 561960 |
| 基金运作方式 | 交易型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2023 年 5 月 24 日 |
| 基金份额上市的证券交易所 | 上海证券交易所 |
| 上市日期 | 2023 年 6 月 6 日 |
| 基金管理人名称 | 招商基金管理有限公司 |
| 基金托管人名称 | 中信建投证券股份有限公司 |

2.1.2 目标基金产品说明

| | |
|------|---|
| 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。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。 |
| 投资策略 | <p>本基金采取完全复制法，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。</p> <p>对于出现市场流动性不足、因法律法规原因个别成份券被限制投资等情况，导致本基金无法获得足够数量的成份券时，基金管理人将通过投资成份券、备选成份券、非成份券、成份券衍生品等进行替代，运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近标的指数的表现。</p> <p>本基金其他主要投资策略包括：债券投资策略、可转换债券和可交换债券投</p> |

| | |
|--------|--|
| | 资策略、资产支持证券投资策略、衍生品投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略、存托凭证投资策略。 |
| 业绩比较基准 | 中证国新央企股东回报指数收益率 |
| 风险收益特征 | 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与货币市场基金。 本基金为被动式投资的股票型指数基金，采用完全复制策略跟踪标的指数的表现，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。 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2024 年 7 月 1 日－2024 年 9 月 30 日） | |
|----------------|-------------------------------------|--------------------------|
| | 招商中证国新央企股东回报 ETF 发起式联接 A | 招商中证国新央企股东回报 ETF 发起式联接 C |
| 1.本期已实现收益 | 76,236.02 | 14,499.09 |
| 2.本期利润 | 1,545,088.76 | 312,635.09 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.1253 | 0.1202 |
| 4.期末基金资产净值 | 15,714,299.51 | 3,211,917.58 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.2130 | 1.2095 |

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

招商中证国新央企股东回报 ETF 发起式联接 A

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去三个月 | 10.95% | 1.38% | 8.91% | 1.42% | 2.04% | -0.04% |
| 过去六个月 | 12.88% | 1.17% | 10.25% | 1.20% | 2.63% | -0.03% |
| 自基金合同生效起至今 | 21.30% | 1.19% | 20.69% | 1.22% | 0.61% | -0.03% |

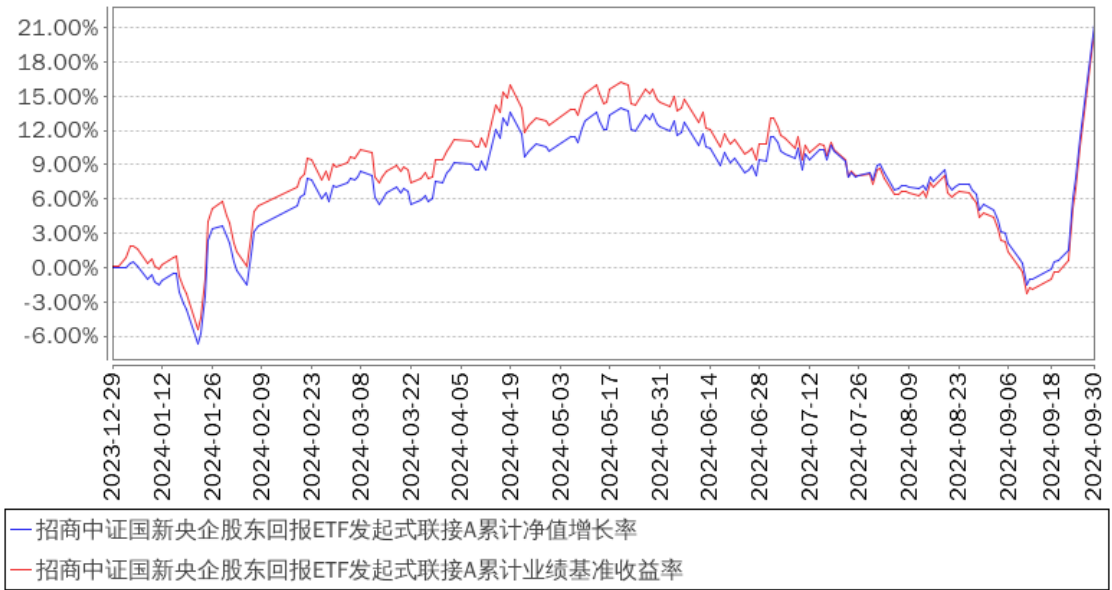
招商中证国新央企股东回报 ETF 发起式联接 C

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差 | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差 | ①-③ | ②-④ |
|----|----------|------------|------------|--------------|-----|-----|
|----|----------|------------|------------|--------------|-----|-----|

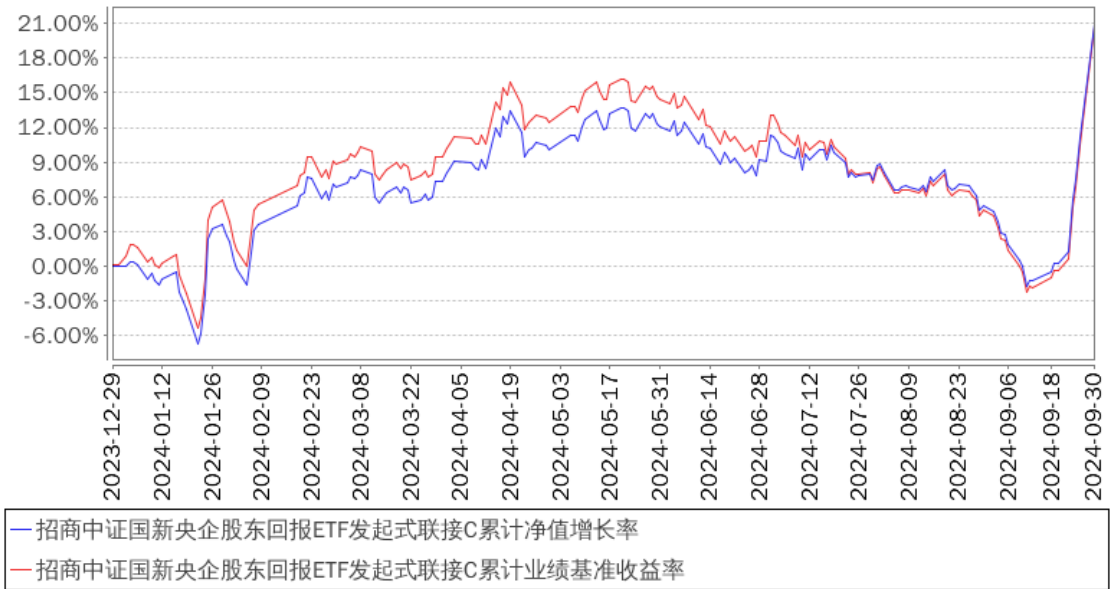
| | | ② | | 准差④ | | |
|------------|--------|-------|--------|-------|-------|--------|
| 过去三个月 | 10.83% | 1.38% | 8.91% | 1.42% | 1.92% | -0.04% |
| 过去六个月 | 12.66% | 1.17% | 10.25% | 1.20% | 2.41% | -0.03% |
| 自基金合同生效起至今 | 20.95% | 1.19% | 20.69% | 1.22% | 0.26% | -0.03% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

招商中证国新央企股东回报ETF发起式联接A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



招商中证国新央企股东回报ETF发起式联接C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金合同于 2023 年 12 月 29 日生效，截至本报告期末基金成立未满一年；自基金成立日起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|---------|------------------|------|--------|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 刘重杰 | 本基金基金经理 | 2023 年 12 月 29 日 | - | 14 | 男，学士。曾任职于成都商报社、西南财经大学金融数据中心、南京大学金陵学院；2010 年 7 月加入华西期货有限责任公司，历任金融工程部高级研究员、部门负责人；2014 年 3 月加入西南证券股份有限公司，历任衍生品业务岗、平仓处置岗、策略研究岗、投资者教育及培训岗；2017 年 9 月加入招商基金管理有限公司，曾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、招商深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、招商中证浙江 100 交易型开放式指数证券投资基金、招商中证生物科技主题交易型开放式指数证券投资基金、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、招商中证物联网主题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 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，现任招商深证 100 交易型开放式指数证券投资基金、招商中证红利交易型开放式指数证券投资基金、招商国证食品饮料行业交易型开放式指数证券投资基金、招商中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金、招商沪深 300ESG 基准交易型开放式指数证券投资基金、招商中证新能源汽车指数型证券投资基金、招商中证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金、招商中证银行 AH 价格优选交易型开放式指数证券投资基金、招商中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金联接基金、招商中证银行 AH 价格优选交易型 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|--|
| | | | | | 开放式指数证券投资基金发起式联接基金、招商纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）、招商中证国新央企股东回报交易型开放式指数证券投资基金、招商纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）、招商中证国新央企股东回报交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、招商中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。 |
|--|--|--|--|--|--|

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

2、证券从业年限计算标准遵从中国证监会《证券基金经营机构董事、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 公平交易专项说明

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。

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 11 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 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内 A 股整体上呈现出反弹的态势，普遍获得较大幅度涨幅，市场情绪更是在季末显著快速升温；沪深 300 指数上涨 16.07%，中证 500 指数上涨 16.19%，中证 1000 指数上涨 16.60%。各个行业均有不同程度涨幅，行业间的分化依然明显，涨幅靠前的为非银金融、房地产和综合等行业，涨幅分别为 41.67%、33.05%、31.20%；涨幅相对靠后的为煤炭、石油石化、公用事业等行业，上涨幅度分别为 1.24%、2.00%、2.95%。本基金的基准指数中证国新央企股东回报指数报告期内上涨 9.36%。关于本基金的运作，仓位维持在 94.2% 左右的水平，基本完成了对基准的跟踪。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金 A 类份额净值增长率为 10.95%，同期业绩基准增长率为 8.91%，C 类份额净值增长率为 10.83%，同期业绩基准增长率为 8.91%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金为发起式基金，且截至本报告期末，本基金基金合同生效未满 3 年，不适用《公开募集证券投资基金运作管理办法》关于“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”的披露规定。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告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 | 201,840.00 | 1.04 |
| | 其中：股票 | 201,840.00 | 1.04 |
| 2 | 基金投资 | 17,531,575.33 | 90.46 |
| 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 | 1,106,821.64 | 5.71 |
| 8 | 其他资产 | 539,200.54 | 2.78 |
| 9 | 合计 | 19,379,437.51 | 100.00 |

5.2 期末投资目标基金明细

| 序号 | 基金名称 | 基金类型 | 运作方式 | 管理人 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|------|-------------|------------|---------------|--------------|
| 1 | 招商中证国新央企股东回报 ETF | ETF | 交易型开放式(ETF) | 招商基金管理有限公司 | 17,531,575.33 | 92.63 |

5.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.3.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | 41,753.00 | 0.22 |
| C | 制造业 | 75,540.00 | 0.40 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 22,636.00 | 0.12 |
| E | 建筑业 | 25,965.00 | 0.14 |
| F | 批发和零售业 | 7,600.00 | 0.04 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 13,706.00 | 0.07 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 3,210.00 | 0.02 |
| J | 金融业 | 7,018.00 | 0.04 |
| K | 房地产业 | 4,412.00 | 0.02 |
| 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 | 201,840.00 | 1.07 |

5.3.2 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。

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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 | 601088 | 中国神华 | 300 | 13,080.00 | 0.07 |
| 2 | 000830 | 鲁西化工 | 700 | 8,757.00 | 0.05 |
| 3 | 600028 | 中国石化 | 1,100 | 7,656.00 | 0.04 |
| 4 | 600019 | 宝钢股份 | 1,100 | 7,634.00 | 0.04 |
| 5 | 601857 | 中国石油 | 700 | 6,314.00 | 0.03 |
| 6 | 600900 | 长江电力 | 200 | 6,010.00 | 0.03 |
| 7 | 002128 | 电投能源 | 300 | 5,943.00 | 0.03 |
| 8 | 601898 | 中煤能源 | 400 | 5,900.00 | 0.03 |
| 9 | 601668 | 中国建筑 | 900 | 5,562.00 | 0.03 |
| 10 | 600710 | 苏美达 | 600 | 5,514.00 | 0.03 |

5.5 报告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。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名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。

5.8 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。

5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

5.10.2 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。

5.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11.1 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。

5.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

5.11.3 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。

5.12 投资组合报告附注

5.12.1

报告期内基金投资的前十名证券除鲁西化工（证券代码 000830）、苏美达（证券代码 600710）、中国建筑（证券代码 601668）、中国神华（证券代码 601088）、中国石化（证券代码 600028）、中国石油（证券代码 601857）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、鲁西化工（证券代码 000830）

根据 2024 年 4 月 22 日发布的相关公告，该证券发行人因重大事故被山东省人民政府处以罚款。

根据 2024 年 6 月 5 日发布的相关公告，该证券发行人因违规经营被聊城高新技术产业开发区管理委员会处以行政处罚。

根据 2024 年 6 月 27 日发布的相关公告，该证券发行人因违反法律法规被聊城市应急管理局处以行政处罚。

2、苏美达（证券代码 600710）

根据 2024 年 4 月 1 日发布的相关公告，该证券发行人因未按期申报税款被国家税务总局北京经济技术开发区税务局博兴税务所责令改正。

根据 2024 年 4 月 1 日发布的相关公告，该证券发行人因未按期申报税款被国家税务总局北京市朝阳区税务局双井税务所责令改正。

3、中国建筑（证券代码 601668）

根据发布的相关公告，该证券发行人在报告期内因未依法履行职责、涉嫌违反法律法规、未按期申报税款等原因，多次受到监管机构的处罚。

4、中国神华（证券代码 601088）

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

5、中国石化（证券代码 600028）

根据 2023 年 10 月 8 日发布的相关公告，该证券发行人因未依法履行职责、违反交通法规被中华人民共和国九江海事局处以罚款。

根据 2023 年 11 月 3 日发布的相关公告，该证券发行人因未依法履行职责被北京市房山区生态环境局处以罚款。

根据 2023 年 12 月 26 日发布的相关公告，该证券发行人因违反安全生产行为被茂名市应急管理局处以罚款。

根据 2024 年 1 月 3 日发布的相关公告，该证券发行人因未依法履行职责被茂名市应急管理局处以罚款。

6、中国石油（证券代码 601857）

根据发布的相关公告，该证券发行人在报告期内因环境污染、未依法履行职责，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：本基金投资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。

5.12.2

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。

5.12.3 其他资产构成

金额单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|----|-------|
|----|----|-------|

| | | |
|---|-------|------------|
| 1 | 存出保证金 | 6,306.14 |
| 2 | 应收清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 532,894.40 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 539,200.54 |

5.12.4 报告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。

5.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末投资前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 招商中证国新央企股东 回报 ETF 发起式联接 A | 招商中证国新央企股东回报 ETF 发起式联接 C |
|-------------------------------|------------------------------|-----------------------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 12,534,227.35 | 3,056,331.80 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 1,493,218.31 | 1,618,948.15 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 1,072,783.11 | 2,019,724.80 |
| 报告期期间基金拆分变动份额 （份额减少以“-”填列） | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 12,954,662.55 | 2,655,555.15 |

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

| 项目 | 份额 |
|--------------------------|---------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 10,000,000.00 |
| 报告期期间买入/申购总份额 | - |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | - |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | 10,000,000.00 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 64.06 |

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的交易明细。

§ 8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目 | 持有份额总数 | 持有份额占基金总份额比例（%） | 发起份额总数 | 发起份额占基金总份额比例（%） | 发起份额承诺持有期限 |
|-------------|---------------|-----------------|---------------|-----------------|------------|
| 基金管理人固有资金 | 10,000,000.00 | 64.06 | 10,000,000.00 | 64.06 | 3 年 |
| 基金管理人高级管理人员 | - | - | - | - | - |
| 基金经理等人员 | - | - | - | - | - |
| 基金管理人股东 | - | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - | - |
| 合计 | 10,000,000.00 | 64.06 | 10,000,000.00 | 64.06 | - |

§ 9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过百分之二十的情况【份额变化情况】

| 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 |
| 机构 | 1 | 20240701-20240930 | 10,000,000.00 | - | - | 10,000,000.00 | 64.06% |
| 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。

§ 10 备查文件目录

10.1 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中证国新央企股东回报交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金设立的文件；

- 3、《招商中证国新央企股东回报交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》；
- 4、《招商中证国新央企股东回报交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金托管协议》；
- 5、《招商中证国新央企股东回报交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金招募说明书》；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照。

10.2 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

10.3 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 10 月 24 日