

招商中证 A500 交易型开放式指数证券 投资基金 2025 年中期报告

2025 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2025 年 8 月 28 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 8 月 27 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 2025 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	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	12
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	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	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	16
§7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	40
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	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	56
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	56
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	56
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	56
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	56
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	56

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	57
7.12 投资组合报告附注	57
§8 基金份额持有人信息	58
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	58
8.2 期末上市基金前十名持有人	58
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	59
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	59
§9 开放式基金份额变动	59
§10 重大事件揭示	60
10.1 基金份额持有人大会决议	60
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	60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	60
10.4 基金投资策略的改变	60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	60
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	60
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	61
10.8 其他重大事件	61
§11 影响投资者决策的其他重要信息	63
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	63
§12 备查文件目录	63
12.1 备查文件目录	63
12.2 存放地点	64
12.3 查阅方式	64

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	招商中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	招商中证 A500ETF
场内简称	A500 指数（扩位证券简称：A500 指数 ETF）
基金主代码	560610
交易代码	560610
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2024 年 9 月 26 日
基金管理人	招商基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	9,034,988,393.00 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	2024 年 10 月 15 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。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。</p>

业绩比较基准	中证 A500 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。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名 潘西里	郭明
	联系电话 0755-83196666	(010) 66105799
	电子邮箱 cmf@cmfchina.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话	400-887-9555	95588
传真	0755-83196475	(010) 66105798
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 55 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 55 号
邮政编码	518040	100140
法定代表人	王小青	廖林

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(2025 年 1 月 1 日 - 2025 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-241,730,324.74
本期利润	87,410,111.23
加权平均基金份额本期利润	0.0071

本期加权平均净值利润率	0.76%
本期基金份额净值增长率	1.62%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-301,180,786.50
期末可供分配基金份额利润	-0.0333
期末基金资产净值	8,733,807,606.50
期末基金份额净值	0.9667
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-3.22%

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。

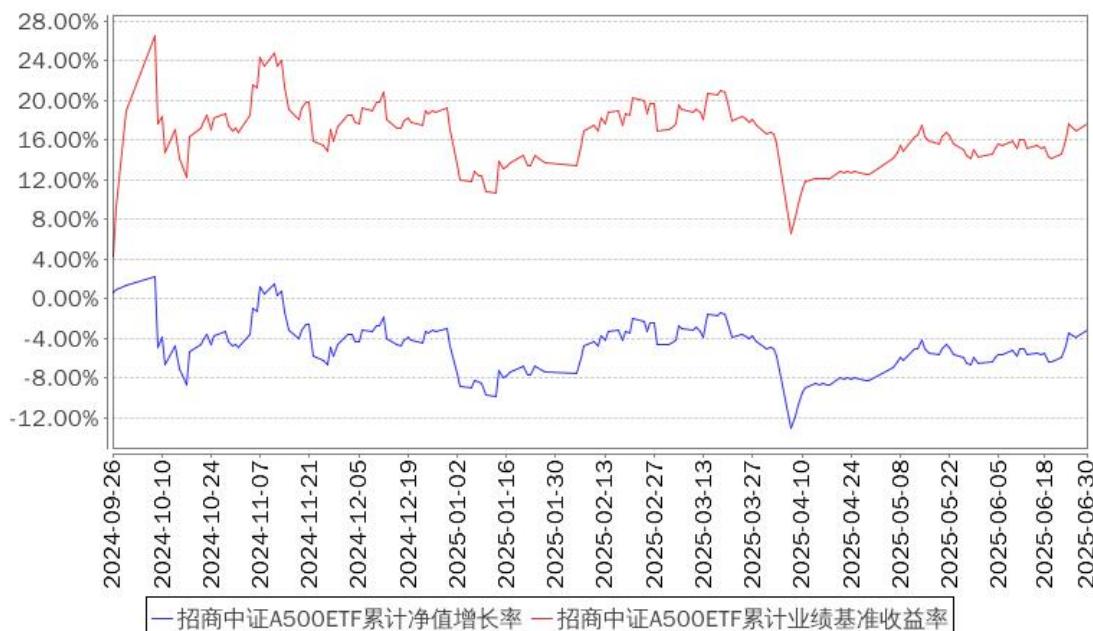
3.2 基金净值表现

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	3.53%	0.59%	2.82%	0.60%	0.71%	-0.01%
过去三个月	1.86%	1.19%	0.84%	1.20%	1.02%	-0.01%
过去六个月	1.62%	1.10%	0.47%	1.10%	1.15%	0.00%
自基金合同生效起至今	-3.22%	1.27%	17.60%	1.58%	-20.82%	-0.31%

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

招商中证A500ETF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 2024 年 9 月 26 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 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

招商基金管理有限公司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		
刘重杰	本基金基金经理	2024 年 9 月 26 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、招商沪深300ESG基准交易型开放式指 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A100交易型开 放式指 数证券投资基 金、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 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A500交易型 开放式指 数证券投资基 金、招商中证A500交 易型开 放式指 数证券投资基 金发起式联接基 金、招商利安新兴 亚洲精选交易型开 放式指 数证券投资基 金(QDII)、招商中
--	--	--	--	---

					证全指红利质量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）、招商中证香港科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）基金经理。
许荣漫	本基金 基金经理	2024年10 月 26 日	-	10	女，硕士。2013 年 7 月加入广东倍智网络科技有限公司工作，任咨询顾问；2015 年加入招商基金管理有限公司，曾任品牌推广经理、研究员、高级研究员，招商富时中国 A-H50 指数型证券投资基金（LOF）、招商中证沪港深消费龙头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、招商中证生物科技主题交易型开放式指数证券投资基金、招商中证上海环交所碳中和交易型开放式指数证券投资基金、招商中证疫苗与生物技术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发起式联接基金、招商中证上海环交所碳中和交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，现任招商国证生物医药指数证券投资基金、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、招商中证电池主题交易型开放式指数证券投资基金、招商中证光伏产业指数型证券投资基金、招商中证沪港深 500 医药卫生交易型开放式指数证券投资基金、招商中证电池主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金、招商中证机器人指数型发起式证券投资基金、招商中证 A100 交易型开放式指数证券投资基金、招商中证 A100 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、招商中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、招商恒生港股通高股息低波动交易型开放式指数证券投资基金、招商华证价值优选 50 指数型发起式证券投资基金、招商中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金、招商中证全球中国互联网交易型开放式指数证券

					投资基金 (QDII)、招商中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金、招商中证卫星产业交易型开放式指数证券投资基金、招商恒生港股通高股息低波动交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

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

基金管理人严格执行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 12 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

报告期内受海外贸易摩擦、局部地缘冲突等因素影响，市场波动较大，伴随宏观政策持续发力，以及关税谈判取得初步进展，市场风险偏好逐步修复，主要宽基指数走势总体呈现宽幅震荡，其中小微盘股走势相对较强，行业表现分化明显，申万一级行业指数中有色金属、银行、国防军工、传媒、通信等行业领涨，煤炭、食品饮料、房地产、石油石化等行业走势相对较弱。中证 A500 指数报告期内上涨 0.47%。关于本基金的运作，仓位维持在 99.5%左右的水平，基本完成了对基准的跟踪。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金份额净值增长率为 1.62%，同期业绩基准增长率为 0.47%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年国内经济运行总体保持稳中有进，下半年宏观增量政策有望持续落地，“反内卷”引导低效供给退出，助力产能出清，基建及扩内需有望拉动需求端改善，政策及企业盈利改善趋势下，权益市场尤其是各行业龙头投资机会依然值得重视。

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。截至报告期末本基金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

本基金本报告期内实施的利润分配金额为 12,205,990.03 元，符合相关法规及基金合同的约定。

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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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，本基金的管理人在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现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

本托管人依法对管理人编制和披露的本报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、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：招商中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	50,225,777.87	77,641,143.32
结算备付金		13,345,032.97	-
存出保证金		1,688,169.60	-
交易性金融资产	6.4.7.2	8,685,265,801.83	13,749,817,537.07
其中：股票投资		8,685,072,689.98	13,749,817,537.07
基金投资		-	-
债券投资		193,111.85	-
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		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		8,750,524,782.27	13,827,458,680.39
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 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		14,636,220.63	38,484,132.05
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,191,875.48	1,872,830.52
应付托管费		397,291.82	624,276.84
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		3,968.69	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	487,819.15	94,262.30
负债合计		16,717,175.77	41,075,501.71
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	9,034,988,393.00	14,476,988,393.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-301,180,786.50	-690,605,214.32
净资产合计		8,733,807,606.50	13,786,383,178.68
负债和净资产总计		8,750,524,782.27	13,827,458,680.39

注：报告截止日 2025 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.9667 元，基金份额总额 9,034,988,393.00 份。

6.2 利润表

会计主体：招商中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		99,176,094.45
1.利息收入		41,396.18
其中：存款利息收入	6.4.7.9	41,396.18
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		-236,489,841.09

列)		
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-362,179,125.84
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	224,980.98
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-
衍生工具收益	6.4.7.14	117,062.08
股利收益	6.4.7.15	125,347,241.69
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	329,140,435.97
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	6,484,103.39
减：二、营业总支出		11,765,983.22
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	8,628,833.48
其中：暂估管理人报酬		-
2.托管费	6.4.10.2.2	2,876,277.84
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		425.72
8.其他费用	6.4.7.19	260,446.18
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		87,410,111.23
减：所得税费用		-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		87,410,111.23
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		87,410,111.23

6.3 净资产变动表

会计主体：招商中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	14,476,988,393.00	-	-690,605,214.32	13,786,383,178.68
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	14,476,988,393.00	-	-690,605,214.32	13,786,383,178.68
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-5,442,000,000.00	-	389,424,427.82	-5,052,575,572.18
(一)、综合收益总额	-	-	87,410,111.23	87,410,111.23
(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）	-5,442,000,000.00	-	314,220,306.62	-5,127,779,693.38
其中：1.基金申购款	5,580,000,000.00	-	-321,748,205.71	5,258,251,794.29
2.基金赎回款	-11,022,000,000.00	-	635,968,512.33	-10,386,031,487.67
(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）	-	-	-12,205,990.03	-12,205,990.03
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	9,034,988,393.00	-	-301,180,786.50	8,733,807,606.50

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：

钟文岳 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

招商中证 A500 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》、《招商中证 A500 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[2024]1264号文准予公开募集注册。本基金为交易型开放式，存续期限为不定期。本基金首次设立募集基金份额为1,999,988,393.00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(24)第00185号验资报告。《招商中证A500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2024年9月26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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称“中国工商银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及截至报告期末最新公告的《招商中证A500交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定本基金主要投资于标的指数成份券(含存托凭证，下同)和备选成份券(含存托凭证，下同)。为更好地实现基金的投资目标，本基金可少量投资于国内依法发行上市的非标的指数成份券(包括主板、创业板及其他中国证监会允许基金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、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、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(含可分离交易可转债)、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、股票期权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)。本基金可根据相关法律法规和基金合同的约定，参与融资业务和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%。每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。股指期货、国债期货和股票期权的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如法律法规或中国证监会以后允许基金投资其他品种或变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围或调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为：中证A500指数收益率。

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 2025 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2025 年 1 月 1 日至 2025 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

本基金在本报告期内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]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[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[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。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；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。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) 基金在境外证券交易所进行交易或取得的源自境外证券市场的收益，其涉及的税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行。

(6) 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 2025 年 6 月 30 日
活期存款	6,000,877.62
等于： 本金	6,000,541.95
加： 应计利息	335.67
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	44,224,900.25
等于： 本金	44,223,850.64
加： 应计利息	1,049.61
减： 坏账准备	-
合计	50,225,777.87

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	8,751,327,967.30	-	8,685,072,689.98	-66,255,277.32
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	193,099.15	12.70	193,111.85
	银行间市场	-	-	-
	合计	193,099.15	12.70	193,111.85
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	8,751,521,066.45	12.70	8,685,265,801.83	-66,255,277.32

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

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	13,668,150.00	-	-	-
其中： 股指期货投资	13,668,150.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	13,668,150.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IF2507	IF2507	12.00	14,068,080.00	399,930.00
合计				399,930.00
减： 可抵销期货暂收款				399,930.00
净额				-

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

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 2025 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	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	248,070.42
其他	239,748.73
合计	487,819.15

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	14,476,988,393.00	14,476,988,393.00
本期申购	5,580,000,000.00	5,580,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-11,022,000,000.00	-11,022,000,000.00
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	9,034,988,393.00	9,034,988,393.00

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	-57,188,310.83	-633,416,903.49	-690,605,214.32
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-57,188,310.83	-633,416,903.49	-690,605,214.32
本期利润	-241,730,324.74	329,140,435.97	87,410,111.23
本期基金份额交易产生的变动数	101,350,405.65	212,869,900.97	314,220,306.62
其中：基金申购款	-68,264,500.71	-253,483,705.00	-321,748,205.71
基金赎回款	169,614,906.36	466,353,605.97	635,968,512.33
本期已分配利润	-12,205,990.03	-	-12,205,990.03
本期末	-209,774,219.95	-91,406,566.55	-301,180,786.50

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	6,055.66
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	22,673.23
结算备付金利息收入	12,667.29
其他	-
合计	41,396.18

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-221,816,447.54
股票投资收益——赎回差价收入	-140,362,678.30
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	-362,179,125.84

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	5,175,278,862.58
减：卖出股票成本总额	5,393,223,904.48
减：交易费用	3,871,405.64
买卖股票差价收入	-221,816,447.54

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	10,386,031,487.67
减：现金支付赎回款总额	4,583,939,186.67
减：赎回股票成本总额	5,942,454,979.30
减：交易费用	-
赎回差价收入	-140,362,678.30

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	152.28
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	224,828.70
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	224,980.98

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,727,542.66
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,502,493.41
减：应计利息总额	151.48
减：交易费用	69.07
买卖债券差价收入	224,828.70

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

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	117,062.08

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	125,347,241.69

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	125,347,241.69

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	328,740,505.97
——股票投资	328,740,505.97
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	399,930.00
——权证投资	-
——期货投资	399,930.00
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	329,140,435.97

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	6,484,103.39
合计	6,484,103.39

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	100,000.00
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
其他	100,938.81
合计	260,446.18

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

2025 年 7 月 10 日，本基金管理人发布《招商中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年度第二次分红公告》，收益分配基准日为 2025 年 6 月 30 日，权益登记日为 2025 年 7 月 14 日、除息日为 2025 年 7 月 15 日，现金红利发放日为 2025 年 7 月 18 日，收益分配方案为招商中证 A500ETF 每 10 份基金份额派发红利人民币 0.080 元。

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
中国工商银行股份有限公司	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
招商中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(以下简称“招商中证 A500ETF 发起式联接”)	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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
招商证券	8,259,758,810.94	100.00%

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
招商证券	1,727,542.66	100.00%

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内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 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	754,067.77	100.00%	-	-

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、根据《公开募集证券投资基金管理费管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

3、本报告期内，基金对该类交易的佣金的计算方式是按相关协议约定的佣金费率计算。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为基金提供研究服务（被动股票型基金自 2024 年 7 月 1 日起不适用）。

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	8,628,833.48
其中：应支付销售机构的客户维护费	810,587.62
应支付基金管理人的净管理费	7,818,245.86

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×0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日基金管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,876,277.84

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

		份额单位：份
项目		本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2024 年 09 月 26 日）持有的基金份额		-
报告期初持有的基金份额		53,709,500.00
报告期内申购/买入总份额		-
报告期内因拆分变动份额		-
减：报告期内赎回/卖出总份额		-
报告期末持有的基金份额		53,709,500.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例		0.59%

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

关联方名称	本期末 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024 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	299,052,041.00	3.31%	179,089,730.00	1.24%
招商中证 A500ETF 发起式联接	4,391,927,689.00	48.61%	4,451,221,336.00	30.75%

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

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
工商银行-活期	6,000,877.62	6,055.66

招商证券-其他存款	44,224,900.25	22,673.23
-----------	---------------	-----------

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司和基金管理人的股东招商证券股份有限公司保管，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 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	001388	信通电子	网下申购	937	15,385.54

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

于 2025 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)4,661,300 股，市值为人民币 214,186,735.00 元，占本基金资产净值的比例为 2.45%。

于 2025 年 6 月 30 日，本基金因指数成份股原因被动持有工商银行(601398)13,203,461 股，市值为人民币 100,214,268.99 元，占本基金资产净值的比例为 1.15%。

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

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	场内除息日	场外除息日	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
1	2025 年 4 月 15 日	2025 年 4 月 16 日	-	0.0100	12,205,990.03	-	12,205,990.03	-
合计	-	-	-	0.0100	12,205,990.03	-	12,205,990.03	-

6.4.12 期末（2025 年 6 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
001335	信凯科技	2025 年 4 月 2 日	6 个月	新股流通受限	12.80	28.05	80	1,024.00	2,244.00	-

001356	富岭股份	2025年1月16日	6个月	新股流通受限	5.30	14.44	709	3,757.70	10,237.96	-
001382	新亚电缆	2025年3月13日	6个月	新股流通受限	7.40	20.21	366	2,708.40	7,396.86	-
001388	信通电子	2025年6月24日	1个月内(含)	新股流通受限	16.42	16.42	843	13,842.06	13,842.06	-
001388	信通电子	2025年6月24日	6个月	新股流通受限	16.42	16.42	94	1,543.48	1,543.48	-
001390	古麒绒材	2025年5月21日	6个月	新股流通受限	12.08	18.12	178	2,150.24	3,225.36	-
001395	亚联机械	2025年1月20日	6个月	新股流通受限	19.08	47.25	80	1,526.40	3,780.00	-
301173	毓恬冠佳	2025年2月24日	6个月	新股流通受限	28.33	44.98	173	4,901.09	7,781.54	-
301275	汉朔科技	2025年3月4日	6个月	新股流通受限	27.50	56.19	397	10,917.50	22,307.43	-
301458	钧崴电子	2025年1月2日	6个月	新股流通受限	10.40	34.11	701	7,290.40	23,911.11	-
301479	弘景光电	2025年3月6日	6个月	新股流通受限	41.90	77.87	182	5,447.00	14,172.34	-
301501	恒鑫生活	2025年3月11日	6个月	新股流通受限	39.92	45.22	349	9,620.72	15,781.78	-
301535	浙江华远	2025年3月18日	6个月	新股流通受限	4.92	18.99	734	3,611.28	13,938.66	-
301560	众捷汽车	2025年4月17日	6个月	新股流通受限	16.50	27.45	190	3,135.00	5,215.50	-
301590	优优绿能	2025年5月28日	6个月	新股流通受限	89.60	139.48	73	6,540.80	10,182.04	-
301595	太力科技	2025年5月12日	6个月	新股流通受限	17.05	29.10	196	3,341.80	5,703.60	-

		日								
301601	惠通科技	2025年1月8日	6个月	新股流通受限	11.80	33.85	342	4,035.60	11,576.70	-
301602	超研股份	2025年1月15日	6个月	新股流通受限	6.70	24.80	658	4,408.60	16,318.40	-
301636	泽润新能	2025年4月30日	6个月	新股流通受限	33.06	47.46	128	4,231.68	6,074.88	-
301658	首航新能	2025年3月26日	6个月	新股流通受限	11.80	22.98	437	5,156.60	10,042.26	-
301662	宏工科技	2025年4月10日	6个月	新股流通受限	26.60	82.50	143	3,803.80	11,797.50	-
301665	泰禾股份	2025年4月2日	6个月	新股流通受限	10.27	22.39	393	4,036.11	8,799.27	-
301678	新恒汇	2025年6月13日	6个月	新股流通受限	12.80	44.54	382	4,889.60	17,014.28	-
603014	威高血净	2025年5月12日	6个月	新股流通受限	26.50	32.68	205	5,432.50	6,699.40	-
603049	中策橡胶	2025年5月27日	6个月	新股流通受限	46.50	42.85	724	33,666.00	31,023.40	-
603072	天和磁材	2024年12月24日	6个月	新股流通受限	12.30	54.45	226	2,779.80	12,305.70	-
603120	肯特催化	2025年4月9日	6个月	新股流通受限	15.00	33.43	65	975.00	2,172.95	-
603124	江南新材	2025年3月12日	6个月	新股流通受限	10.54	46.31	88	927.52	4,075.28	-
603202	天有为	2025年4月16日	6个月	新股流通受限	93.50	90.66	166	15,521.00	15,049.56	-
603210	泰鸿万立	2025年4月1日	6个月	新股流通受限	8.60	15.61	286	2,459.60	4,464.46	-
603257	中国瑞林	2025年	6个月	新股流通	20.52	37.47	78	1,600.56	2,922.66	-

		3月28日		受限						
603271	永杰新材	2025年3月4日	6个月	新股流通受限	20.60	35.08	126	2,595.60	4,420.08	-
603382	海阳科技	2025年6月5日	6个月	新股流通受限	11.50	22.39	105	1,207.50	2,350.95	-
603400	华之杰	2025年6月12日	6个月	新股流通受限	19.88	43.81	57	1,133.16	2,497.17	-
603409	汇通控股	2025年2月25日	6个月	新股流通受限	24.18	33.32	100	2,418.00	3,332.00	-
688411	海博思创	2025年1月20日	6个月	新股流通受限	19.38	83.49	560	10,852.80	46,754.40	-
688545	兴福电子	2025年1月15日	6个月	新股流通受限	11.68	26.95	994	11,609.92	26,788.30	-
688583	思看科技	2025年1月8日	6个月	新股流通受限	33.46	79.68	227	5,855.50	18,087.36	-
688755	汉邦科技	2025年5月9日	6个月	新股流通受限	22.77	39.33	203	4,622.31	7,983.99	-
688757	胜科纳米	2025年3月18日	6个月	新股流通受限	9.08	25.94	536	4,866.88	13,903.84	-
688758	赛分科技	2025年1月2日	6个月	新股流通受限	4.32	16.97	777	3,356.64	13,185.69	-
688775	影石创新	2025年6月4日	6个月	新股流通受限	47.27	124.16	573	27,085.71	71,143.68	-

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
123257	安克转债	2025年6月16日	1个月内(含)	新债未上市	100.00	100.01	1,931	193,099.15	193,111.85	-

注：基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，则此新增股票的流通受限期和估值价格与相应原股票一致。

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、债券投资等。与这些金融工具有关的风险，以及本基金的基金管理人管理这些风险所采取的风险管理政策如下所述。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	193,111.85	-
未评级	-	-
合计	193,111.85	-

注：债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

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约约

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 2025 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	50,225,777.87	-	-	-	50,225,777.87
结算备付金	13,345,032.97	-	-	-	13,345,032.97
存出保证金	-	-	-	1,688,169.60	1,688,169.60
交易性金融资产	-	-	193,111.85	8,685,072,689.98	8,685,265,801.83
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	63,570,810.84	-	193,111.85	8,686,760,859.58	8,750,524,782.27
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	1,191,875.48	1,191,875.48
应付托管费	-	-	-	397,291.82	397,291.82
应付清算款	-	-	-	14,636,220.63	14,636,220.63
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	-	-	-	3,968.69	3,968.69
其他负债	-	-	-	487,819.15	487,819.15
负债总计	-	-	-	16,717,175.77	16,717,175.77
利率敏感度缺口	63,570,810.84	-	193,111.85	8,670,043,683.81	8,733,807,606.50
上年度末 2024 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	77,641,143.32	-	-	-	77,641,143.32
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	13,749,817,537.07	13,749,817,537.07
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	77,641,143.32	-	-	13,749,817,537.07	13,827,458,680.39
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-

应付管理人 报酬	-	-	-	1,872,830.52	1,872,830.52
应付托管费	-	-	-	624,276.84	624,276.84
应付清算款	-	-	-	38,484,132.05	38,484,132.05
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	-	-	-	94,262.30	94,262.30
负债总计	-	-	-	41,075,501.71	41,075,501.71
利率敏感度 缺口	77,641,143.32	-	-	13,708,742,035.36	13,786,383,178.68

注：上表按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1.若市场利率平行上升或下降 50 个基点		
	2.其他市场变量保持不变		
	3.仅存在公允价值变动对基金资产净值的影响		
分析	相关风险变量的变动		
			对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单 位：人民币元）
	本期末（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）	
1.	市场利率平行上升 50 个基点	-5,468.88	-
	市场利率平行下降 50 个基点	5,657.45	-

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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的债券和股票，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。

6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产	公允价值	占基金资产

		净值比例 (%)		净值比例(%)
交易性金融资产-股票投资	8,685,072,689.98	99.44	13,749,817,537.07	99.73
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	8,685,072,689.98	99.44	13,749,817,537.07	99.73

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(2025 年 6 月 30 日)	上年度末(2024 年 12 月 31 日)	
1.	权益性投资的市场价格上升 5%	434,253,634.50	687,490,876.85
2.	权益性投资的市场价格下降 5%	-434,253,634.50	-687,490,876.85

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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	8,684,540,642.10	13,727,676,356.91
第二层次	208,497.39	21,944,768.50
第三层次	516,662.34	196,411.66
合计	8,685,265,801.83	13,749,817,537.07

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

本基金本报告期末及上年度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

本基金本报告期内及上年度可比期间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	8,685,072,689.98	99.25
	其中：股票	8,685,072,689.98	99.25
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	193,111.85	0.00
	其中：债券	193,111.85	0.00
	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	63,570,810.84	0.73
8	其他各项资产	1,688,169.60	0.02

9	合计	8,750,524,782.27	100.00
---	----	------------------	--------

注：此处的股票投资项含可退替代款估值增值。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	47,607,863.00	0.55
B	采矿业	437,426,634.56	5.01
C	制造业	5,047,298,695.12	57.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	267,096,950.92	3.06
E	建筑业	164,238,695.00	1.88
F	批发和零售业	61,225,149.25	0.70
G	交通运输、仓储和邮政业	301,516,349.43	3.45
H	住宿和餐饮业	7,332,921.00	0.08
I	信息传输、软件和信息技术服务业	580,586,645.10	6.65
J	金融业	1,400,728,249.87	16.04
K	房地产业	90,788,620.32	1.04
L	租赁和商务服务业	96,722,077.92	1.11
M	科学研究和技术服务业	96,818,427.00	1.11
N	水利、环境和公共设施管理业	18,900,829.73	0.22
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	5,692,824.00	0.07
Q	卫生和社会工作	33,319,024.88	0.38
R	文化、体育和娱乐业	27,240,685.00	0.31
S	综合	-	-
	合计	8,684,540,642.10	99.44

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	501,400.68	0.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,244.00	0.00
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	-	-
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	28,403.20	0.00
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	532,047.88	0.01

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	235,320	331,688,246.40	3.80
2	300750	宁德时代	997,338	251,548,590.36	2.88
3	601318	中国平安	4,052,519	224,833,754.12	2.57
4	600036	招商银行	4,661,300	214,186,735.00	2.45
5	601166	兴业银行	6,261,912	146,153,026.08	1.67
6	600900	长江电力	4,616,600	139,144,324.00	1.59
7	000333	美的集团	1,856,700	134,053,740.00	1.53
8	601899	紫金矿业	6,202,900	120,956,550.00	1.38
9	002594	比亚迪	342,103	113,547,406.73	1.30
10	300059	东方财富	4,763,160	110,171,890.80	1.26
11	600030	中信证券	3,683,285	101,732,331.70	1.16
12	601398	工商银行	13,203,461	100,214,268.99	1.15
13	000858	五 粮 液	734,062	87,279,971.80	1.00
14	600276	恒瑞医药	1,680,710	87,228,849.00	1.00
15	601328	交通银行	10,049,050	80,392,400.00	0.92
16	000651	格力电器	1,686,200	75,744,104.00	0.87
17	601288	农业银行	12,036,200	70,772,856.00	0.81
18	002475	立讯精密	1,920,117	66,608,858.73	0.76

19	600887	伊利股份	2,383,600	66,454,768.00	0.76
20	600919	江苏银行	5,526,493	65,986,326.42	0.76
21	688981	中芯国际	746,320	65,803,034.40	0.75
22	603259	药明康德	945,200	65,738,660.00	0.75
23	601816	京沪高铁	11,054,200	63,561,650.00	0.73
24	600000	浦发银行	4,422,687	61,386,895.56	0.70
25	000725	京东方 A	13,846,200	55,246,338.00	0.63
26	002371	北方华创	117,200	51,827,012.00	0.59
27	300760	迈瑞医疗	227,100	51,040,725.00	0.58
28	601088	中国神华	1,245,000	50,472,300.00	0.58
29	688041	海光信息	357,134	50,459,462.86	0.58
30	300308	中际旭创	337,700	49,256,922.00	0.56
31	601601	中国太保	1,298,100	48,691,731.00	0.56
32	300502	新易盛	380,780	48,366,675.60	0.55
33	688256	寒武纪	80,191	48,234,886.50	0.55
34	300124	汇川技术	720,300	46,509,771.00	0.53
35	601728	中国电信	5,848,300	45,324,325.00	0.52
36	601668	中国建筑	7,785,800	44,924,066.00	0.51
37	002352	顺丰控股	908,500	44,298,460.00	0.51
38	000001	平安银行	3,657,500	44,146,025.00	0.51
39	002714	牧原股份	1,040,800	43,724,008.00	0.50
40	002230	科大讯飞	870,217	41,665,989.96	0.48
41	601127	赛力斯	308,100	41,383,992.00	0.47
42	603501	豪威集团	322,350	41,147,977.50	0.47
43	600031	三一重工	2,241,850	40,241,207.50	0.46
44	000063	中兴通讯	1,215,300	39,485,097.00	0.45
45	600309	万华化学	719,000	39,012,940.00	0.45
46	603019	中科曙光	550,400	38,748,160.00	0.44
47	600941	中国移动	343,700	38,683,435.00	0.44
48	002415	海康威视	1,389,900	38,541,927.00	0.44
49	300274	阳光电源	546,300	37,022,751.00	0.42
50	601857	中国石油	4,275,600	36,556,380.00	0.42
51	601919	中远海控	2,375,000	35,720,000.00	0.41
52	688008	澜起科技	428,470	35,134,540.00	0.40
53	600690	海尔智家	1,412,400	34,999,272.00	0.40
54	600660	福耀玻璃	603,500	34,405,535.00	0.39
55	601012	隆基绿能	2,284,861	34,318,612.22	0.39
56	600406	国电南瑞	1,514,500	33,939,945.00	0.39
57	601766	中国中车	4,581,700	32,255,168.00	0.37
58	603986	兆易创新	249,100	31,518,623.00	0.36
59	600050	中国联通	5,881,800	31,408,812.00	0.36
60	000338	潍柴动力	2,039,963	31,374,630.94	0.36
61	000568	泸州老窖	276,600	31,366,440.00	0.36

62	600028	中国石化	5,497,800	31,007,592.00	0.36
63	000100	TCL 科技	7,082,000	30,665,060.00	0.35
64	688012	中微公司	168,030	30,631,869.00	0.35
65	300476	胜宏科技	226,100	30,383,318.00	0.35
66	601988	中国银行	5,398,360	30,338,783.20	0.35
67	601006	大秦铁路	4,561,700	30,107,220.00	0.34
68	601985	中国核电	3,108,301	28,969,365.32	0.33
69	601225	陕西煤业	1,458,751	28,066,369.24	0.32
70	600104	上汽集团	1,744,390	27,997,459.50	0.32
71	002027	分众传媒	3,804,100	27,769,930.00	0.32
72	600150	中国船舶	840,900	27,362,886.00	0.31
73	600418	江淮汽车	662,500	26,559,625.00	0.30
74	601628	中国人寿	629,400	25,924,986.00	0.30
75	605499	东鹏饮料	80,000	25,124,000.00	0.29
76	688111	金山办公	89,032	24,933,411.60	0.29
77	600760	中航沈飞	424,980	24,912,327.60	0.29
78	603288	海天味业	630,808	24,544,739.28	0.28
79	688271	联影医疗	189,934	24,262,169.16	0.28
80	000425	徐工机械	3,104,700	24,123,519.00	0.28
81	000625	长安汽车	1,875,600	23,932,656.00	0.27
82	600111	北方稀土	958,400	23,864,160.00	0.27
83	000792	盐湖股份	1,392,400	23,782,192.00	0.27
84	600938	中国海油	902,400	23,561,664.00	0.27
85	600436	片仔癀	115,800	23,161,158.00	0.27
86	600905	三峡能源	5,386,810	22,947,810.60	0.26
87	600089	特变电工	1,911,678	22,806,318.54	0.26
88	601888	中国中免	374,000	22,802,780.00	0.26
89	601658	邮储银行	4,152,200	22,712,534.00	0.26
90	002625	光启技术	566,700	22,656,666.00	0.26
91	300033	同花顺	82,700	22,577,927.00	0.26
92	603993	洛阳钼业	2,647,900	22,295,318.00	0.26
93	002050	三花智控	843,200	22,243,616.00	0.25
94	600547	山东黄金	687,604	21,955,195.72	0.25
95	600048	保利发展	2,710,000	21,951,000.00	0.25
96	300015	爱尔眼科	1,758,400	21,944,832.00	0.25
97	600019	宝钢股份	3,303,100	21,767,429.00	0.25
98	601390	中国中铁	3,862,800	21,670,308.00	0.25
99	600415	小商品城	1,045,100	21,612,668.00	0.25
100	002463	沪电股份	505,800	21,536,964.00	0.25
101	002241	歌尔股份	923,300	21,531,356.00	0.25
102	300014	亿纬锂能	459,700	21,058,857.00	0.24
103	601600	中国铝业	2,991,200	21,058,048.00	0.24
104	000977	浪潮信息	396,000	20,148,480.00	0.23

105	601989	中国重工	4,305,600	19,977,984.00	0.23
106	600585	海螺水泥	905,400	19,438,938.00	0.22
107	002384	东山精密	512,500	19,357,125.00	0.22
108	600893	航发动力	501,200	19,316,248.00	0.22
109	002179	中航光电	476,100	19,215,396.00	0.22
110	600570	恒生电子	569,900	19,114,446.00	0.22
111	603799	华友钴业	511,900	18,950,538.00	0.22
112	000538	云南白药	338,900	18,907,231.00	0.22
113	600584	长电科技	538,100	18,128,589.00	0.21
114	000988	华工科技	385,400	18,117,654.00	0.21
115	000938	紫光股份	752,200	18,045,278.00	0.21
116	601727	上海电气	2,384,700	17,622,933.00	0.20
117	600438	通威股份	1,030,800	17,265,900.00	0.20
118	002028	思源电气	233,100	16,995,321.00	0.19
119	300408	三环集团	504,900	16,863,660.00	0.19
120	002049	紫光国微	254,629	16,769,865.94	0.19
121	300433	蓝思科技	748,500	16,691,550.00	0.19
122	000002	万科 A	2,564,500	16,464,090.00	0.19
123	600795	国电电力	3,370,875	16,315,035.00	0.19
124	600489	中金黄金	1,096,000	16,034,480.00	0.18
125	601669	中国电建	3,238,100	15,769,547.00	0.18
126	600988	赤峰黄金	629,000	15,649,520.00	0.18
127	601689	拓普集团	329,100	15,549,975.00	0.18
128	002422	科伦药业	432,700	15,542,584.00	0.18
129	600010	包钢股份	8,525,100	15,259,929.00	0.17
130	300339	润和软件	300,100	15,254,083.00	0.17
131	002456	欧菲光	1,256,400	14,888,340.00	0.17
132	600009	上海机场	465,100	14,776,227.00	0.17
133	002460	赣锋锂业	435,900	14,720,343.00	0.17
134	600160	巨化股份	508,300	14,578,044.00	0.17
135	601100	恒立液压	199,900	14,392,800.00	0.16
136	000768	中航西飞	522,600	14,287,884.00	0.16
137	688036	传音控股	175,656	13,999,783.20	0.16
138	601186	中国铁建	1,735,700	13,902,957.00	0.16
139	300394	天孚通信	173,720	13,869,804.80	0.16
140	002252	上海莱士	2,005,000	13,774,350.00	0.16
141	600183	生益科技	455,800	13,742,370.00	0.16
142	601360	三六零	1,331,400	13,580,280.00	0.16
143	002074	国轩高科	418,200	13,574,772.00	0.16
144	000157	中联重科	1,877,000	13,570,710.00	0.16
145	600839	四川长虹	1,393,800	13,547,736.00	0.16
146	000963	华东医药	333,100	13,443,916.00	0.15
147	600886	国投电力	907,300	13,373,602.00	0.15

148	600989	宝丰能源	828,400	13,370,376.00	0.15
149	601058	赛轮轮胎	997,700	13,089,824.00	0.15
150	600115	中国东航	3,218,800	12,971,764.00	0.15
151	300442	润泽科技	258,500	12,803,505.00	0.15
152	002466	天齐锂业	397,300	12,729,492.00	0.15
153	000408	藏格矿业	296,400	12,647,388.00	0.14
154	002517	恺英网络	649,900	12,549,569.00	0.14
155	000807	云铝股份	782,800	12,509,144.00	0.14
156	688169	石头科技	79,660	12,470,773.00	0.14
157	600066	宇通客车	500,000	12,430,000.00	0.14
158	002340	格林美	1,943,700	12,342,495.00	0.14
159	002001	新和成	577,100	12,274,917.00	0.14
160	600426	华鲁恒升	560,800	12,152,536.00	0.14
161	002195	岩山科技	2,139,000	12,042,570.00	0.14
162	600029	南方航空	2,036,600	12,015,940.00	0.14
163	600674	川投能源	749,000	12,013,960.00	0.14
164	001979	招商蛇口	1,366,400	11,983,328.00	0.14
165	600196	复星医药	476,700	11,960,403.00	0.14
166	002558	巨人网络	507,600	11,953,980.00	0.14
167	000975	山金国际	628,200	11,898,108.00	0.14
168	601800	中国交建	1,337,100	11,886,819.00	0.14
169	000661	长春高新	119,300	11,832,174.00	0.14
170	002236	大华股份	744,800	11,827,424.00	0.14
171	600011	华能国际	1,656,400	11,826,696.00	0.14
172	688213	思特威	115,299	11,785,863.78	0.13
173	301236	软通动力	214,200	11,703,888.00	0.13
174	300661	圣邦股份	160,440	11,675,218.80	0.13
175	002156	通富微电	454,400	11,641,728.00	0.13
176	688126	沪硅产业	621,404	11,632,682.88	0.13
177	600487	亨通光电	755,600	11,560,680.00	0.13
178	600346	恒力石化	792,400	11,299,624.00	0.13
179	688608	恒玄科技	32,285	11,234,534.30	0.13
180	300418	昆仑万维	333,900	11,229,057.00	0.13
181	600460	士兰微	450,951	11,192,603.82	0.13
182	300207	欣旺达	557,300	11,179,438.00	0.13
183	601111	中国国航	1,413,459	11,152,191.51	0.13
184	300251	光线传媒	549,400	11,136,338.00	0.13
185	600745	闻泰科技	330,700	11,088,371.00	0.13
186	002648	卫星化学	637,340	11,045,102.20	0.13
187	002916	深南电路	102,240	11,022,494.40	0.13
188	600372	中航机载	910,400	10,979,424.00	0.13
189	000066	中国长城	739,600	10,946,080.00	0.13
190	601868	中国能建	4,887,200	10,898,456.00	0.12

191	688777	中控技术	242,648	10,897,321.68	0.12
192	002920	德赛西威	106,300	10,856,419.00	0.12
193	003816	中国广核	2,961,600	10,780,224.00	0.12
194	688120	华海清科	63,471	10,707,557.70	0.12
195	302132	中航成飞	121,600	10,693,504.00	0.12
196	601117	中国化学	1,374,800	10,544,716.00	0.12
197	600096	云天化	479,900	10,543,403.00	0.12
198	600879	航天电子	1,004,400	10,516,068.00	0.12
199	600741	华域汽车	595,800	10,515,870.00	0.12
200	688002	睿创微纳	150,719	10,508,128.68	0.12
201	601319	中国人保	1,205,900	10,503,389.00	0.12
202	300450	先导智能	422,500	10,499,125.00	0.12
203	601168	西部矿业	630,600	10,486,878.00	0.12
204	002273	水晶光电	521,200	10,408,364.00	0.12
205	688617	惠泰医疗	34,954	10,381,338.00	0.12
206	002465	海格通信	744,100	10,372,754.00	0.12
207	600256	广汇能源	1,716,000	10,330,320.00	0.12
208	688235	百济神州	44,144	10,313,804.16	0.12
209	600588	用友网络	771,140	10,310,141.80	0.12
210	600176	中国巨石	902,100	10,283,940.00	0.12
211	000786	北新建材	388,200	10,279,536.00	0.12
212	002601	龙佰集团	633,800	10,273,898.00	0.12
213	300347	泰格医药	191,800	10,226,776.00	0.12
214	300896	爱美客	58,140	10,163,453.40	0.12
215	601021	春秋航空	182,300	10,144,995.00	0.12
216	000831	中国稀土	280,400	10,128,048.00	0.12
217	600885	宏发股份	452,520	10,095,721.20	0.12
218	002555	三七互娱	582,700	10,074,883.00	0.12
219	601633	长城汽车	468,600	10,065,528.00	0.12
220	600482	中国动力	435,700	10,051,599.00	0.12
221	600219	南山铝业	2,623,925	10,049,632.75	0.12
222	600352	浙江龙盛	987,800	10,036,048.00	0.11
223	300866	安克创新	87,790	9,972,944.00	0.11
224	300017	网宿科技	925,800	9,924,576.00	0.11
225	300782	卓胜微	138,468	9,882,461.16	0.11
226	688099	晶晨股份	139,119	9,878,840.19	0.11
227	000933	神火股份	593,100	9,869,184.00	0.11
228	002294	信立泰	207,600	9,825,708.00	0.11
229	688506	百利天恒	33,163	9,820,227.56	0.11
230	300454	深信服	103,900	9,785,302.00	0.11
231	002185	华天科技	968,700	9,783,870.00	0.11
232	600039	四川路桥	987,100	9,772,290.00	0.11
233	688122	西部超导	186,696	9,685,788.48	0.11

234	000630	铜陵有色	2,886,400	9,640,576.00	0.11
235	688396	华润微	203,597	9,601,634.52	0.11
236	603129	春风动力	43,800	9,482,700.00	0.11
237	002493	荣盛石化	1,142,600	9,460,728.00	0.11
238	601877	正泰电器	415,200	9,412,584.00	0.11
239	002129	TCL 中环	1,222,600	9,389,568.00	0.11
240	300474	景嘉微	128,500	9,380,500.00	0.11
241	600362	江西铜业	398,600	9,339,198.00	0.11
242	600085	同仁堂	258,600	9,325,116.00	0.11
243	001965	招商公路	771,800	9,261,600.00	0.11
244	002130	沃尔核材	387,100	9,220,722.00	0.11
245	002709	天赐材料	501,300	9,083,556.00	0.10
246	002085	万丰奥威	561,900	8,928,591.00	0.10
247	300002	神州泰岳	752,600	8,880,680.00	0.10
248	002131	利欧股份	2,536,700	8,878,450.00	0.10
249	002281	光迅科技	180,000	8,877,600.00	0.10
250	688072	拓荆科技	57,517	8,840,938.07	0.10
251	688047	龙芯中科	66,181	8,827,883.59	0.10
252	300122	智飞生物	448,100	8,778,279.00	0.10
253	300058	蓝色光标	1,337,282	8,772,569.92	0.10
254	000423	东阿阿胶	167,400	8,755,020.00	0.10
255	002532	天山铝业	1,053,100	8,751,261.00	0.10
256	002180	纳思达	380,900	8,737,846.00	0.10
257	002738	中矿资源	271,400	8,728,224.00	0.10
258	002595	豪迈科技	147,300	8,723,106.00	0.10
259	688578	艾力斯	92,817	8,635,693.68	0.10
260	002138	顺络电子	304,900	8,573,788.00	0.10
261	600161	天坛生物	445,500	8,549,145.00	0.10
262	002128	电投能源	431,400	8,533,092.00	0.10
263	002078	太阳纸业	633,500	8,526,910.00	0.10
264	300223	北京君正	123,200	8,525,440.00	0.10
265	603392	万泰生物	139,611	8,516,271.00	0.10
266	002472	双环传动	253,528	8,490,652.72	0.10
267	002436	兴森科技	637,500	8,440,500.00	0.10
268	000301	东方盛虹	1,009,100	8,405,803.00	0.10
269	600233	圆通速递	651,500	8,397,835.00	0.10
270	002410	广联达	623,580	8,362,207.80	0.10
271	002938	鹏鼎控股	260,600	8,347,018.00	0.10
272	603596	伯特利	157,800	8,314,482.00	0.10
273	300832	新产业	145,760	8,267,507.20	0.09
274	600188	兖矿能源	678,030	8,251,625.10	0.09
275	600862	中航高科	316,300	8,249,104.00	0.09
276	300136	信维通信	368,200	8,247,680.00	0.09

277	300759	康龙化成	335,600	8,235,624.00	0.09
278	688266	泽璟制药	76,563	8,231,288.13	0.09
279	300346	南大光电	258,824	8,189,191.36	0.09
280	600143	金发科技	792,304	8,168,654.24	0.09
281	603605	珀莱雅	98,200	8,129,978.00	0.09
282	002065	东华软件	845,400	8,115,840.00	0.09
283	300024	机器人	471,200	8,095,216.00	0.09
284	300054	鼎龙股份	282,200	8,093,496.00	0.09
285	000034	神州数码	213,600	8,039,904.00	0.09
286	002353	杰瑞股份	229,300	8,025,500.00	0.09
287	002223	鱼跃医疗	224,900	8,006,440.00	0.09
288	002202	金风科技	778,400	7,978,600.00	0.09
289	601618	中国中冶	2,673,200	7,966,136.00	0.09
290	601615	明阳智能	689,700	7,924,653.00	0.09
291	300395	菲利华	154,000	7,869,400.00	0.09
292	603606	东方电缆	152,100	7,865,091.00	0.09
293	688223	晶科能源	1,510,709	7,840,579.71	0.09
294	002271	东方雨虹	729,500	7,827,535.00	0.09
295	000999	华润三九	249,320	7,798,729.60	0.09
296	002008	大族激光	319,500	7,786,215.00	0.09
297	603659	璞泰来	413,700	7,769,286.00	0.09
298	300383	光环新网	541,800	7,747,740.00	0.09
299	300496	中科创达	135,400	7,747,588.00	0.09
300	002624	完美世界	510,400	7,742,768.00	0.09
301	600845	宝信软件	327,200	7,728,464.00	0.09
302	600515	海南机场	2,164,500	7,662,330.00	0.09
303	601872	招商轮船	1,223,292	7,657,807.92	0.09
304	002405	四维图新	893,700	7,632,198.00	0.09
305	600549	厦门钨业	364,100	7,616,972.00	0.09
306	002155	湖南黄金	424,250	7,572,862.50	0.09
307	688180	君实生物	221,492	7,526,298.16	0.09
308	300459	汤姆猫	1,342,100	7,515,760.00	0.09
309	600895	张江高科	292,100	7,506,970.00	0.09
310	002459	晶澳科技	747,300	7,458,054.00	0.09
311	300012	华测检测	635,700	7,431,333.00	0.09
312	000426	兴业银锡	467,700	7,389,660.00	0.08
313	300604	长川科技	163,700	7,351,767.00	0.08
314	601799	星宇股份	58,800	7,350,000.00	0.08
315	002821	凯莱英	82,600	7,289,450.00	0.08
316	603087	甘李药业	132,900	7,280,262.00	0.08
317	300627	华测导航	205,300	7,185,500.00	0.08
318	688599	天合光能	493,463	7,170,017.39	0.08
319	000733	振华科技	143,100	7,162,155.00	0.08

320	605589	圣泉集团	255,600	7,092,900.00	0.08
321	300253	卫宁健康	668,800	7,089,280.00	0.08
322	605117	德业股份	133,740	7,042,748.40	0.08
323	601216	君正集团	1,271,600	7,019,232.00	0.08
324	000617	中油资本	952,600	6,953,980.00	0.08
325	600332	白云山	263,700	6,951,132.00	0.08
326	000519	中兵红箭	316,000	6,917,240.00	0.08
327	300699	光威复材	218,400	6,916,728.00	0.08
328	600392	盛和资源	524,100	6,902,397.00	0.08
329	600153	建发股份	664,000	6,885,680.00	0.08
330	000932	华菱钢铁	1,557,700	6,853,880.00	0.08
331	300037	新宙邦	194,300	6,839,360.00	0.08
332	002444	巨星科技	267,900	6,834,129.00	0.08
333	300003	乐普医疗	491,300	6,770,114.00	0.08
334	601233	桐昆股份	637,300	6,755,380.00	0.08
335	000878	云南铜业	529,400	6,733,968.00	0.08
336	600803	新奥股份	354,500	6,700,050.00	0.08
337	002389	航天彩虹	261,200	6,686,720.00	0.08
338	300001	特锐德	278,400	6,673,248.00	0.08
339	300142	沃森生物	605,100	6,656,100.00	0.08
340	300316	晶盛机电	244,300	6,632,745.00	0.08
341	600699	均胜电子	380,200	6,630,688.00	0.08
342	002414	高德红外	644,300	6,604,075.00	0.08
343	002007	华兰生物	420,800	6,593,936.00	0.08
344	300073	当升科技	150,200	6,589,274.00	0.08
345	300628	亿联网络	189,000	6,569,640.00	0.08
346	002409	雅克科技	117,700	6,437,013.00	0.07
347	600521	华海药业	345,400	6,434,802.00	0.07
348	300568	星源材质	506,500	6,422,420.00	0.07
349	603979	金诚信	138,000	6,408,720.00	0.07
350	002812	恩捷股份	218,800	6,408,652.00	0.07
351	600177	雅戈尔	875,800	6,393,340.00	0.07
352	600118	中国卫星	221,600	6,331,112.00	0.07
353	688188	柏楚电子	47,783	6,291,109.78	0.07
354	300315	掌趣科技	1,034,500	6,279,415.00	0.07
355	601238	广汽集团	836,900	6,268,381.00	0.07
356	600398	海澜之家	899,300	6,259,128.00	0.07
357	002152	广电运通	464,200	6,238,848.00	0.07
358	603260	合盛硅业	130,900	6,204,660.00	0.07
359	000738	航发控制	298,900	6,202,175.00	0.07
360	600704	物产中大	1,175,600	6,195,412.00	0.07
361	000623	吉林敖东	365,000	6,186,750.00	0.07
362	300413	芒果超媒	283,200	6,179,424.00	0.07

363	300724	捷佳伟创	113,600	6,168,480.00	0.07
364	300757	罗博特科	41,100	6,163,767.00	0.07
365	600765	中航重机	364,000	6,144,320.00	0.07
366	000009	中国宝安	688,400	6,112,992.00	0.07
367	600497	驰宏锌锗	1,151,700	6,092,493.00	0.07
368	002044	美年健康	1,178,300	6,056,462.00	0.07
369	600563	法拉电子	55,400	6,043,586.00	0.07
370	600141	兴发集团	292,500	6,005,025.00	0.07
371	600316	洪都航空	159,000	5,994,300.00	0.07
372	300558	贝达药业	103,400	5,992,030.00	0.07
373	002318	久立特材	255,100	5,966,789.00	0.07
374	600018	上港集团	1,042,500	5,952,675.00	0.07
375	601567	三星医疗	264,400	5,927,848.00	0.07
376	600038	中直股份	150,800	5,852,548.00	0.07
377	000400	许继电气	267,900	5,832,183.00	0.07
378	600486	扬农化工	100,100	5,805,800.00	0.07
379	002025	航天电器	112,300	5,773,343.00	0.07
380	601677	明泰铝业	464,237	5,765,823.54	0.07
381	000960	锡业股份	376,400	5,758,920.00	0.07
382	300919	中伟股份	175,100	5,757,288.00	0.07
383	002245	蔚蓝锂芯	446,400	5,727,312.00	0.07
384	002607	中公教育	1,860,400	5,692,824.00	0.07
385	601607	上海医药	317,600	5,678,688.00	0.07
386	300763	锦浪科技	98,600	5,658,654.00	0.06
387	688303	大全能源	264,909	5,647,859.88	0.06
388	300088	长信科技	946,900	5,643,524.00	0.06
389	600637	东方明珠	752,600	5,621,922.00	0.06
390	600498	烽火通信	265,600	5,585,568.00	0.06
391	603939	益丰药房	227,301	5,562,055.47	0.06
392	300182	捷成股份	1,007,500	5,551,325.00	0.06
393	603486	科沃斯	95,200	5,543,496.00	0.06
394	000039	中集集团	700,900	5,509,074.00	0.06
395	600529	山东药玻	247,500	5,479,650.00	0.06
396	002407	多氟多	447,200	5,451,368.00	0.06
397	002739	万达电影	476,400	5,445,252.00	0.06
398	300068	南都电源	340,900	5,427,128.00	0.06
399	600026	中远海能	523,800	5,410,854.00	0.06
400	002841	视源股份	155,200	5,369,920.00	0.06
401	601018	宁波港	1,455,200	5,326,032.00	0.06
402	600763	通策医疗	128,821	5,317,730.88	0.06
403	300285	国瓷材料	303,000	5,257,050.00	0.06
404	000887	中鼎股份	298,100	5,243,579.00	0.06
405	301358	湖南裕能	167,600	5,227,444.00	0.06

406	300676	华大基因	104,200	5,186,034.00	0.06
407	603806	福斯特	400,140	5,185,814.40	0.06
408	300144	宋城演艺	597,400	5,107,770.00	0.06
409	002497	雅化集团	444,900	5,071,860.00	0.06
410	002312	川发龙蟒	439,300	5,043,164.00	0.06
411	600008	首创环保	1,664,200	5,025,884.00	0.06
412	688009	中国通号	977,381	5,023,738.34	0.06
413	600820	隧道股份	823,400	5,022,740.00	0.06
414	300296	利亚德	816,800	4,982,480.00	0.06
415	002064	华峰化学	749,600	4,954,856.00	0.06
416	600998	九州通	957,027	4,919,118.78	0.06
417	603568	伟明环保	256,791	4,899,572.28	0.06
418	600516	方大炭素	1,053,100	4,886,384.00	0.06
419	300567	精测电子	80,600	4,885,166.00	0.06
420	600166	福田汽车	1,776,400	4,814,044.00	0.06
421	600170	上海建工	2,007,000	4,796,730.00	0.05
422	600208	衢州发展	1,613,900	4,777,144.00	0.05
423	002176	江特电机	651,600	4,730,616.00	0.05
424	601179	中国西电	769,300	4,723,502.00	0.05
425	600312	平高电气	306,500	4,717,035.00	0.05
426	000683	博源化工	982,900	4,708,091.00	0.05
427	601155	新城控股	342,349	4,683,334.32	0.05
428	603816	顾家家居	183,100	4,672,712.00	0.05
429	605358	立昂微	198,800	4,632,040.00	0.05
430	688005	容百科技	206,371	4,606,200.72	0.05
431	000708	中信特钢	389,700	4,582,872.00	0.05
432	002244	滨江集团	469,100	4,573,725.00	0.05
433	000830	鲁西化工	439,600	4,527,880.00	0.05
434	601000	唐山港	1,114,700	4,525,682.00	0.05
435	000629	钒钛股份	1,757,600	4,499,456.00	0.05
436	002603	以岭药业	318,700	4,493,670.00	0.05
437	603613	国联股份	189,179	4,481,650.51	0.05
438	000818	航锦科技	198,200	4,459,500.00	0.05
439	603885	吉祥航空	330,900	4,457,223.00	0.05
440	600323	瀚蓝环境	181,747	4,425,539.45	0.05
441	002432	九安医疗	120,600	4,393,458.00	0.05
442	002439	启明星辰	273,400	4,371,666.00	0.05
443	600535	天士力	278,500	4,358,525.00	0.05
444	600499	科达制造	443,600	4,347,280.00	0.05
445	603833	欧派家居	75,600	4,267,620.00	0.05
446	601880	辽港股份	2,826,000	4,239,000.00	0.05
447	002145	中核钛白	1,013,600	4,206,440.00	0.05
448	603000	人民网	208,050	4,204,690.50	0.05

449	600655	豫园股份	753,800	4,183,590.00	0.05
450	600004	白云机场	459,300	4,179,630.00	0.05
451	300390	天华新能	218,700	4,170,609.00	0.05
452	000563	陕国投 A	1,158,400	4,135,488.00	0.05
453	600859	王府井	295,000	4,097,550.00	0.05
454	000547	航天发展	483,000	4,057,200.00	0.05
455	600325	华发股份	829,100	4,037,717.00	0.05
456	600511	国药股份	138,100	4,026,996.00	0.05
457	601966	玲珑轮胎	274,500	4,026,915.00	0.05
458	603077	和邦生物	2,298,600	4,022,550.00	0.05
459	300751	迈为股份	57,500	3,999,700.00	0.05
460	600131	国网信通	224,000	3,964,800.00	0.05
461	603899	晨光股份	134,800	3,907,852.00	0.04
462	000998	隆平高科	394,300	3,883,855.00	0.04
463	300529	健帆生物	179,200	3,865,344.00	0.04
464	600754	锦江酒店	169,800	3,810,312.00	0.04
465	300601	康泰生物	249,500	3,789,905.00	0.04
466	002756	永兴材料	118,620	3,766,185.00	0.04
467	600867	通化东宝	453,700	3,720,340.00	0.04
468	601866	中远海发	1,496,900	3,697,343.00	0.04
469	300573	兴齐眼药	70,980	3,676,054.20	0.04
470	300070	碧水源	816,400	3,673,800.00	0.04
471	600667	太极实业	557,000	3,665,060.00	0.04
472	002120	韵达股份	546,600	3,662,220.00	0.04
473	002544	普天科技	151,400	3,550,330.00	0.04
474	300438	鹏辉能源	128,300	3,542,363.00	0.04
475	600258	首旅酒店	249,300	3,522,609.00	0.04
476	000069	华侨城 A	1,531,200	3,445,200.00	0.04
477	000032	深桑达 A	169,000	3,418,870.00	0.04
478	300118	东方日升	350,100	3,353,958.00	0.04
479	300457	赢合科技	145,000	3,335,000.00	0.04
480	002508	老板电器	175,400	3,334,354.00	0.04
481	002292	奥飞娱乐	336,800	3,273,696.00	0.04
482	000967	盈峰环境	468,700	3,257,465.00	0.04
483	688063	派能科技	70,949	3,198,380.92	0.04
484	002831	裕同科技	136,500	3,196,830.00	0.04
485	603650	彤程新材	97,700	3,141,055.00	0.04
486	688390	固德威	70,830	3,077,563.50	0.04
487	002266	浙富控股	989,400	3,047,352.00	0.03
488	300769	德方纳米	92,100	3,041,142.00	0.03
489	600129	太极集团	142,700	3,040,937.00	0.03
490	601636	旗滨集团	599,830	3,005,148.30	0.03
491	002572	索菲亚	213,800	2,995,338.00	0.03

492	000035	中国天楹	665,400	2,854,566.00	0.03
493	600864	哈投股份	469,000	2,799,930.00	0.03
494	002091	江苏国泰	369,200	2,684,084.00	0.03
495	600315	上海家化	122,300	2,576,861.00	0.03
496	002372	伟星新材	241,100	2,497,796.00	0.03
497	001914	招商积余	159,000	1,966,830.00	0.02
498	600007	中国国贸	84,400	1,736,952.00	0.02
499	600335	国机汽车	223,600	1,442,220.00	0.02
500	301381	赛维时代	47,700	951,615.00	0.01

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	688775	影石创新	573	71,143.68	0.00
2	688411	海博思创	560	46,754.40	0.00
3	603049	中策橡胶	724	31,023.40	0.00
4	688545	兴福电子	994	26,788.30	0.00
5	301458	钧崴电子	701	23,911.11	0.00
6	301275	汉朔科技	397	22,307.43	0.00
7	688583	思看科技	227	18,087.36	0.00
8	301678	新恒汇	382	17,014.28	0.00
9	301602	超研股份	658	16,318.40	0.00
10	301501	恒鑫生活	349	15,781.78	0.00
11	001388	信通电子	937	15,385.54	0.00
12	603202	天有为	166	15,049.56	0.00
13	301479	弘景光电	182	14,172.34	0.00
14	301535	浙江华远	734	13,938.66	0.00
15	688757	胜科纳米	536	13,903.84	0.00
16	688758	赛分科技	777	13,185.69	0.00
17	603072	天和磁材	226	12,305.70	0.00
18	301662	宏工科技	143	11,797.50	0.00
19	301601	惠通科技	342	11,576.70	0.00
20	001356	富岭股份	709	10,237.96	0.00
21	301590	优优绿能	73	10,182.04	0.00
22	301658	首航新能	437	10,042.26	0.00
23	301665	泰禾股份	393	8,799.27	0.00
24	688755	汉邦科技	203	7,983.99	0.00
25	301173	毓恬冠佳	173	7,781.54	0.00
26	001382	新亚电缆	366	7,396.86	0.00
27	603014	威高血净	205	6,699.40	0.00

28	301636	泽润新能	128	6,074.88	0.00
29	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
30	301560	众捷汽车	190	5,215.50	0.00
31	603210	泰鸿万立	286	4,464.46	0.00
32	603271	永杰新材	126	4,420.08	0.00
33	603124	江南新材	88	4,075.28	0.00
34	001395	亚联机械	80	3,780.00	0.00
35	603409	汇通控股	100	3,332.00	0.00
36	001390	古麒绒材	178	3,225.36	0.00
37	603257	中国瑞林	78	2,922.66	0.00
38	603400	华之杰	57	2,497.17	0.00
39	603382	海阳科技	105	2,350.95	0.00
40	001335	信凯科技	80	2,244.00	0.00
41	603120	肯特催化	65	2,172.95	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	300750	宁德时代	143,225,802.00	1.04
2	000333	美的集团	87,048,512.74	0.63
3	600519	贵州茅台	79,675,509.00	0.58
4	300059	东方财富	68,498,591.01	0.50
5	002594	比亚迪	65,709,976.00	0.48
6	300760	迈瑞医疗	56,657,026.66	0.41
7	000651	格力电器	53,750,840.66	0.39
8	000858	五粮液	50,656,125.75	0.37
9	002371	北方华创	48,529,362.04	0.35
10	002475	立讯精密	42,906,216.99	0.31
11	300124	汇川技术	40,360,711.16	0.29
12	000725	京东方 A	37,106,096.00	0.27
13	002415	海康威视	30,124,127.54	0.22
14	300274	阳光电源	28,324,014.16	0.21
15	002230	科大讯飞	27,632,028.67	0.20
16	000063	中兴通讯	26,517,756.50	0.19
17	000001	平安银行	25,961,579.81	0.19
18	000568	泸州老窖	25,392,816.00	0.18
19	002352	顺丰控股	23,913,028.78	0.17
20	002714	牧原股份	21,983,524.41	0.16

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	295,026,088.86	2.14
2	000333	美的集团	166,365,179.63	1.21
3	002594	比亚迪	138,456,714.61	1.00
4	300059	东方财富	133,014,360.70	0.96
5	000858	五粮液	108,493,128.25	0.79
6	000651	格力电器	99,119,213.49	0.72
7	300760	迈瑞医疗	88,041,408.91	0.64
8	002371	北方华创	84,358,368.40	0.61
9	002475	立讯精密	83,377,474.70	0.60
10	300124	汇川技术	79,419,832.39	0.58
11	000725	京东方 A	72,239,593.00	0.52
12	002415	海康威视	54,705,537.85	0.40
13	000063	中兴通讯	52,875,424.07	0.38
14	000001	平安银行	51,729,569.96	0.38
15	300274	阳光电源	49,266,036.30	0.36
16	002352	顺丰控股	48,443,190.45	0.35
17	002714	牧原股份	46,825,919.12	0.34
18	000568	泸州老窖	45,587,187.39	0.33
19	688256	寒武纪	43,054,121.46	0.31
20	300308	中际旭创	41,427,705.39	0.30

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	3,086,819,432.28
卖出股票收入（成交）总额	5,175,278,862.58

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	193,111.85	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	193,111.85	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	123257	安克转债	1,931	193,111.85	0.00

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

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。通过对股指期货的投资，实现管理市场风险和改善投资组合风险收益特性的目的。

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

本报告期内，本基金投资国债期货符合既定的投资政策和投资目的。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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

1、兴业银行（证券代码 601166）

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

2、招商银行（证券代码 600036）

根据发布的相关公告，该证券发行人在报告期内因违规经营、未依法履行职责、违反反洗钱法、未按期申报税款等原因，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，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	1,688,169.60
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	1,688,169.60

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	688775	影石创新	71,143.68	0.00	新股流通受限
2	688411	海博思创	46,754.40	0.00	新股流通受限
3	603049	中策橡胶	31,023.40	0.00	新股流通受限
4	688545	兴福电子	26,788.30	0.00	新股流通受限
5	301458	钧威电子	23,911.11	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		招商中证 A500ETF 发起式联接	
		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
30,817	293,181.96	7,316,224,947.00	80.98%	1,718,763,446.00	19.02%	4,391,927,689.00	48.61%

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	招商证券股份有限公司	299,052,041.00	3.31%
2	大家人寿保险股份有限公司-万能产品	259,432,500.00	2.87%
3	招商信诺人寿保险有限公司-传统	255,018,010.00	2.82%
4	招商信诺人寿保险有限公司-分红保险产品	248,550,000.00	2.75%
5	中国平安人寿保险股份有限公司-自有资金	204,035,929.00	2.26%
6	中国人寿保险股份有限公司	98,041,952.00	1.09%
7	中国国际金融股份有限公司	89,635,580.00	0.99%
8	东吴人寿保险股份有限公司-自有资金	71,247,900.00	0.79%
9	招商基金管理有限公司	53,709,500.00	0.59%
10	方正证券股份有限公司	51,438,076.00	0.57%
-	招商中证 A500ETF 发起式联接	4,391,927,689.00	48.61%

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	282,000.00	0.0031%

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(2024年9月26日)基金份额总额	1,999,988,393.00
本报告期内期初基金份额总额	14,476,988,393.00
本报告期内基金总申购份额	5,580,000,000.00
减：本报告期内基金总赎回份额	11,022,000,000.00
本报告期内期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
本报告期末基金份额总额	9,034,988,393.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

根据本基金管理人 2025 年 5 月 20 日的公告，经招商基金管理有限公司第七届董事会 2025 年第四次会议审议通过，同意徐勇先生辞任公司总经理职务，聘任钟文岳先生为公司总经理。

根据本基金管理人 2025 年 5 月 30 日的公告，经招商基金管理有限公司第七届董事会 2025 年第五次会议审议通过，同意聘任王景女士、朱红裕先生、陈方元先生为公司首席（副总经理级）。

根据本基金管理人 2025 年 6 月 19 日的公告，经招商基金管理有限公司第七届董事会 2025 年第六次会议审议通过，同意董方先生辞任公司副总经理职务。

根据本基金管理人 2025 年 6 月 27 日的公告，经招商基金管理有限公司第七届董事会 2025 年第五次会议审议通过，同意聘任于立勇先生为公司首席（副总经理级）。

本报告期内，本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

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形。

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	4	8,259,758,810.94	100.00%	754,067.77	100.00%	-

注：（一）选择标准

- 1、证券公司应财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强，并通过基金管理人的尽职调查。
- 2、被动股票型基金选择佣金费率相对较低，能够提供优质证券交易服务的证券公司。
- 3、被动股票型基金以外类型基金选择能够提供优质研究服务的证券公司。

（二）选择程序

- 1、基金管理人根据上述标准进行评估并确定选用的证券公司。
- 2、基金管理人与被选择的证券公司签订交易单元租用协议/证券经纪服务协议。

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	1,727,542.66	100.00%	-	-	-	-

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基金估值变更的公告	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	2025-01-03
2	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	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	2025-01-14
3	招商基金管理有限公司旗下部分基金增加爱建	上海证券报、基金管	2025-01-21

	证券有限责任公司为场内申购赎回代办券商的公告	理人网站及中国证监会基金电子披露网站	
4	招商基金管理有限公司旗下基金 2024 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	2025-01-21
5	招商中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年第 4 季度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-01-21
6	招商基金管理有限公司旗下部分基金增加联储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	2025-02-28
7	招商基金管理有限公司关于招融资本私募股权投资管理（深圳）有限责任公司股东变更的公告	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	2025-03-08
8	招商基金管理有限公司旗下基金 2024 年年度报告提示性公告	上海证券报及基金管理人网站	2025-03-28
9	招商中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年年度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-28
10	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	2025-04-07
11	招商基金管理有限公司关于旗下基金估值变更的公告	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	2025-04-08
12	招商基金管理有限公司关于运用固有资金投资旗下公募基金的公告	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	2025-04-08
13	招商中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年度第一次分红公告	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	2025-04-11
14	招商基金管理有限公司旗下基金 2025 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	2025-04-21
15	招商中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-04-21
16	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	2025-05-09
17	招商基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-05-20
18	招商基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-05-30

19	招商基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-06-19
20	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	2025-06-25
21	招商基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-06-27

§ 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
招商中证 A500ETF 发起式联接	1	20250101-20250630	4,451,221,336.00	938,222,353.00	997,516,000.00	4,391,927,689.00	48.61%
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中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金设立的文件；

- 3、《招商中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 4、《招商中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 5、《招商中证 A500 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.cmfchina.com>

招商基金管理有限公司

2025 年 8 月 28 日