

招商中证 500 指数增强型证券投资基金 2026 年中期报告

2026 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：2026 年 8 月 31 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 28 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 2026 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	4
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	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	10
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	11
§5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	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	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	38
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	39
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	57
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	57
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	57
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	57
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	57

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	58
§8 基金份额持有人信息	59
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	59
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	59
8.3 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	60
§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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	60
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	61
10.8 其他重大事件	66
§11 备查文件目录	67
11.1 备查文件目录	67
11.2 存放地点	67
11.3 查阅方式	67

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	招商中证 500 指数增强型证券投资基金	
基金简称	招商中证 500 指数增强	
基金主代码	004192	
交易代码	004192	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 5 月 17 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	511,953,324.61 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	招商中证 500 指数增强 A	招商中证 500 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	004192	004193
报告期末下属分级基金的份 额总额	272,183,078.62 份	239,770,245.99 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型股票指数基金，通过数量化的投资方法与严格的投资纪律约束，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%，同时力求实现超越标的指数的业绩表现，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金为增强型指数产品，在标的指数成份券权重的基础上根据量化模型对行业配置及个股权重等进行主动调整，力争在控制跟踪误差的基础上获取超越标的指数的投资收益。 具体包括：1、股票投资策略；2、债券投资策略；3、股指期货投资策略；4、国债期货投资策略；5、权证投资策略；6、资产支持证券投资策略；7、融资及转融通证券出借业务投资策略；8、存托凭证投资策略。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，属于较高风险、较高预期收益的基金品种，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

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
		许俊
		010-66596688
		fxjd_hq@bank-of-china.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	王颖	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
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.cmfcchina.com
基金中期报告置备地点	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	招商基金管理有限公司	深圳市福田区深南大道 7088 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

1、招商中证 500 指数增强 A

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	56,400,247.10
本期利润	34,726,293.06
加权平均基金份额本期利润	0.1197
本期加权平均净值利润率	5.94%
本期基金份额净值增长率	10.40%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	244,297,207.12
期末可供分配基金份额利润	0.8975
期末基金资产净值	558,789,494.72
期末基金份额净值	2.0530
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	105.30%

2、招商中证 500 指数增强 C

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	44,723,041.06

本期利润	29,476,737.01
加权平均基金份额本期利润	0.1236
本期加权平均净值利润率	6.30%
本期基金份额净值增长率	10.18%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	202,070,949.64
期末可供分配基金份额利润	0.8428
期末基金资产净值	478,634,099.02
期末基金份额净值	1.9962
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	99.62%

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

招商中证 500 指数增强 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	8.80%	1.34%	17.61%	1.56%	-8.81%	-0.22%
过去六个月	10.40%	1.41%	19.93%	1.58%	-9.53%	-0.17%
过去一年	38.83%	1.20%	49.68%	1.35%	-10.85%	-0.15%
过去三年	56.35%	1.31%	48.15%	1.41%	8.20%	-0.10%
过去五年	48.81%	1.23%	31.61%	1.30%	17.20%	-0.07%
过去七年	125.55%	1.24%	78.59%	1.29%	46.96%	-0.05%
自基金合同 生效起至今	105.30%	1.26%	48.87%	1.31%	56.43%	-0.05%

招商中证 500 指数增强 C

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	8.70%	1.34%	17.61%	1.56%	-8.91%	-0.22%

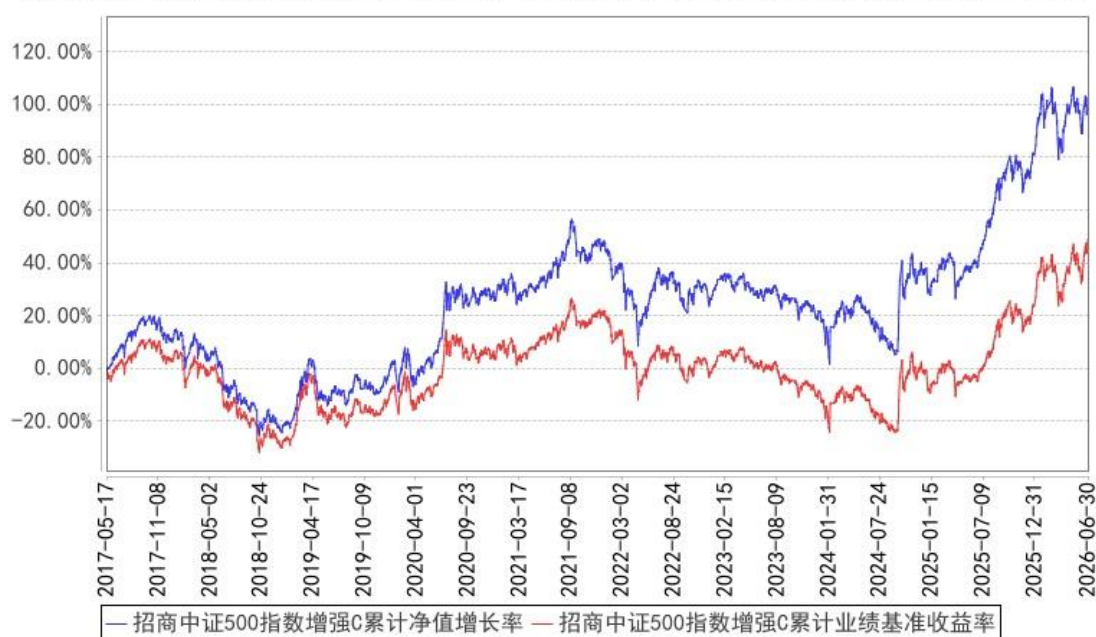
过去六个月	10.18%	1.41%	19.93%	1.58%	-9.75%	-0.17%
过去一年	38.28%	1.20%	49.68%	1.35%	-11.40%	-0.15%
过去三年	54.48%	1.31%	48.15%	1.41%	6.33%	-0.10%
过去五年	45.86%	1.23%	31.61%	1.30%	14.25%	-0.07%
过去七年	119.31%	1.24%	78.59%	1.29%	40.72%	-0.05%
自基金合同生效起至今	99.62%	1.26%	48.87%	1.31%	50.75%	-0.05%

3.2.2 自基金合同生效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500指数增强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500指数增强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



§ 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		
邓童	本基金基金经理	2021 年 11 月 23 日	-	13	男，硕士。2012 年 7 月加入招商基金管理有限公司量化投资部，曾任研究员，招商中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金、招商安康债券型证券投资基金、招商中证红利低波动 100 指数型发起式证券投资基金基金经理，现任招商中证 500 指数增强型证券投资基金、招商中证大宗商品股票指数证券投资基金（LOF）、招商中证煤炭等权指数证券投资基金、招商北证 50 成份指数型发起式证券投资基金、招商中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、招商国证 2000 指数增强型证券投资基金、招商安和债券型证券投资基金、招商上证科创板 50 成份增强策略交易型开放式指数证券投资基金、招商上证综合指数增强型发起式证券投资基金、招商中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、招商中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金、招商中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、招商丰泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)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 15 次，为旗下指数及量化等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

报告期内中证 500 指数震荡上涨，但成分股内风格分化非常极致，成长风格快速拉升，但其余风格个股持续承压。本组合的超额收益在报告期内也出现了大幅回撤，持续回撤的幅度创下了近年来的最大值。虽然有市场风格较为极致的客观原因，但近期的持续回撤也暴露出组合的稳健性问题，虽然在组合层面我们采取多模型的方案，但近期几种主要模型同步出现了回撤，具体来讲在基本面模型方面，有效的成长因子数量较少且与本轮行情风格不匹配；机器学习模型也偏向低波低流动性，新研发的适应高波动市场的机器学习模型近期表现良好但占比偏低。

4.4.2 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 10.40%，同期业绩基准增长率为 19.93%，C 类份额净值增长率为 10.18%，同期业绩基准增长率为 19.93%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年成长风格大幅领先于其他风格，部分个股走出了强趋势行情，给指数增强模型带来了较大挑战，不过展望未来，我们对本组合多模型的配置方式依然有信心，当前较为极致的市场行情难以长期维持，一旦高成长个股的虹吸效应减弱，各模型的超额收益有望同步回暖。但无论如何，市场的极致走势未来可能会持续发生，本基金将依托多模型配置框架，持续迭代模型，力争在控制跟踪误差的前提下稳健获取超额收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。本基金管理人设有估值委员会，估值委员会成员均具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备相应的专业胜任能力和相关工作经历。估值委员会负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，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。

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。

本基金管理人已与第三方定价服务机构签署服务协议，由其按合同约定提供相关投资品种的估值数据。

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，符合相关法规及基金合同的约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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，完全尽职尽责的履行了应尽的义务。

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的复核，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）、投资组合报告等财务数据真实、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：招商中证 500 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	68,370,402.21	38,128,436.71

结算备付金		52,105,190.63	33,633,471.29
存出保证金		7,857,262.25	4,912,799.29
交易性金融资产	6.4.7.2	921,192,029.99	502,973,600.84
其中：股票投资		920,469,584.62	502,884,082.55
基金投资		-	-
债券投资		722,445.37	89,518.29
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		1,114,395.74	4,357,824.08
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		1,050,639,280.82	584,006,132.21
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 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		-	6,030,465.34
应付赎回款		11,571,016.95	2,857,407.03
应付管理人报酬		1,057,519.26	553,701.70
应付托管费		132,189.92	69,212.71
应付销售服务费		161,025.09	84,965.04
应付投资顾问费		-	-
应交税费		2.33	28,537.15
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	293,933.53	107,598.75
负债合计		13,215,687.08	9,731,887.72
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	511,953,324.61	312,627,657.19

其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	525,470,269.13	261,646,587.30
净资产合计		1,037,423,593.74	574,274,244.49
负债和净资产总计		1,050,639,280.82	584,006,132.21

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，招商中证 500 指数增强 A 份额净值 2.0530 元，基金份额总额 272,183,078.62 份；招商中证 500 指数增强 C 份额净值 1.9962 元，基金份额总额 239,770,245.99 份；总份额合计 511,953,324.61 份。

6.2 利润表

会计主体：招商中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		72,291,419.52	16,484,152.03
1.利息收入		397,406.97	42,432.39
其中：存款利息收入	6.4.7.9	397,406.97	42,432.39
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）		106,907,768.01	12,251,948.65
其中：股票投资收益	6.4.7.10	86,622,222.39	9,810,034.48
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	359.74	10,408.60
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	12,012,568.35	252,991.65
股利收益	6.4.7.15	8,272,617.53	2,178,513.92
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	-36,920,258.09	4,072,376.90
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	1,906,502.63	117,394.09
减：二、营业总支出		8,088,389.45	1,640,320.81
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	6,234,944.31	1,217,289.57
其中：暂估管理人报酬		-	-
2.托管费	6.4.10.2.2	779,368.05	152,161.12
3.销售服务费	6.4.10.2.3	924,656.46	196,154.17
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		53,937.55	1,177.51
8.其他费用	6.4.7.19	95,483.08	73,538.44
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列)		64,203,030.07	14,843,831.22
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列)		64,203,030.07	14,843,831.22
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		64,203,030.07	14,843,831.22

6.3 净资产变动表

会计主体：招商中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 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	312,627,657.19	-	261,646,587.30	574,274,244.49
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	312,627,657.19	-	261,646,587.30	574,274,244.49
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列)	199,325,667.42	-	263,823,681.83	463,149,349.25
（一）、综合收益总	-	-	64,203,030.07	64,203,030.07

额				
(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)	199,325,667.42	-	199,620,651.76	398,946,319.18
其中: 1.基金申购款	597,397,590.59	-	598,004,267.43	1,195,401,858.02
2.基金赎回款	-398,071,923.17	-	-398,383,615.67	-796,455,538.84
(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	511,953,324.61	-	525,470,269.13	1,037,423,593.74
项目	上年度可比期间 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	143,284,442.58	-	51,775,760.32	195,060,202.90
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	143,284,442.58	-	51,775,760.32	195,060,202.90
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	6,154,185.15	-	17,236,312.21	23,390,497.36
(一)、综合收益总额	-	-	14,843,831.22	14,843,831.22
(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)	6,154,185.15	-	2,392,480.99	8,546,666.14
其中: 1.基金申购款	62,733,479.12	-	24,471,073.28	87,204,552.40
2.基金赎回款	-56,579,293.97	-	-22,078,592.29	-78,657,886.26
(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	149,438,627.73	-	69,012,072.53	218,450,700.26

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 500 指数增强型证券投资基金(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 500 指数增强型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[2016]3114 号文准予公开募集注册。本基金为契约型开放式基金，存续期限为不定期。根据销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为 A 类基金份额和 C 类基金份额。本基金首次设立募集基金份额为 332,908,992.33 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(17)第 00144 号验资报告。《招商中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)于 2017 年 5 月 17 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，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票和存托凭证(包括主板、中小板、创业板和其他经中国证监会核准上市的股票和存托凭证)、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转债(含可分离交易可转换债)、可交换债、次级债、短期融资券、中期票据等)、债券回购、同业存单、银行存款、货币市场工具、资产支持证券、权证、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相关规定)。本基金可以参与融资和转融通证券出借业务。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。基金的投资组合比例为：本基金投资于股票、存托凭证资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于中证 500 指数成份券及其备选成份券的资产不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金的业绩比较基准：中证 500 指数收益率×95%+同期银行活期存款利率(税后)×5%。

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 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2026 年 1 月 1 日至 2026 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》、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[2021]33 号《关于北京证券交易所税收政策适用问题的公告》、财税[2024]8 号《关于延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[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》、财税[2025]4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10 号《关于增值税法施行

后增值税优惠政策衔接事项的公告》、财税[2026]12 号《关于明确增值税应税交易销售额计算口径的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，公开募集证券投资基金管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，以基金管理人为增值税纳税人，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对公募证券投资基金(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、债券取得的收入以及金融同业往来利息收入免征增值税。

(2) 对证券投资基金取得的自 2025 年 8 月 8 日之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税；取得的在 2025 年 8 月 8 日之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

(3) 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，暂不征收企业所得税。

(4) 对证券投资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。其中，对基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所挂牌交易的上市公司限售股，解禁后取得的股息红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(5) 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。

(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 2026 年 6 月 30 日
活期存款	68,370,402.21
等于：本金	68,363,670.08
加：应计利息	6,732.13
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	68,370,402.21

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		931,801,098.90	-	920,469,584.62	-11,331,514.28
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	602,497.23	566.58	722,445.37	119,381.56
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	602,497.23	566.58	722,445.37	119,381.56
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		932,403,596.13	566.58	921,192,029.99	-11,212,132.72

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 2026 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	59,553,124.14	-	-	-
其中：股指期货投资	59,553,124.14	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	59,553,124.14	-	-	-

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
IC2609	中证 500 期货 2609	36.00	63,082,080.00	3,528,955.86
合计				3,528,955.86
减：可抵销期货暂收款				3,528,955.86
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 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	5,715.95
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	202,731.26
其中：交易所市场	202,731.26
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	85,486.32
合计	293,933.53

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

招商中证 500 指数增强 A		
项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	164,662,744.46	164,662,744.46
本期申购	329,701,726.86	329,701,726.86
本期赎回（以“-”号填列）	-222,181,392.70	-222,181,392.70

基金份额折算变动份额	-	-
本期末	272,183,078.62	272,183,078.62

招商中证 500 指数增强 C		
项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	147,964,912.73	147,964,912.73
本期申购	267,695,863.73	267,695,863.73
本期赎回（以“-”号填列）	-175,890,530.47	-175,890,530.47
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	239,770,245.99	239,770,245.99

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

招商中证 500 指数增强 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	113,006,885.86	28,532,798.43	141,539,684.29
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	113,006,885.86	28,532,798.43	141,539,684.29
本期利润	56,400,247.10	-21,673,954.04	34,726,293.06
本期基金份额交易产生的变动数	74,890,074.16	35,450,364.59	110,340,438.75
其中：基金申购款	256,052,173.10	82,313,676.41	338,365,849.51
基金赎回款	-181,162,098.94	-46,863,311.82	-228,025,410.76
本期已分配利润	-	-	-
本期末	244,297,207.12	42,309,208.98	286,606,416.10

招商中证 500 指数增强 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	94,845,247.33	25,261,655.68	120,106,903.01
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	94,845,247.33	25,261,655.68	120,106,903.01
本期利润	44,723,041.06	-15,246,304.05	29,476,737.01
本期基金份额交易产生的变动数	62,502,661.25	26,777,551.76	89,280,213.01
其中：基金申购款	196,678,246.68	62,960,171.24	259,638,417.92
基金赎回款	-134,175,585.43	-36,182,619.48	-170,358,204.91
本期已分配利润	-	-	-

本期末	202,070,949.64	36,792,903.39	238,863,853.03
-----	----------------	---------------	----------------

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	182,593.23
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	212,790.40
其他	2,023.34
合计	397,406.97

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	86,622,222.39
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	86,622,222.39

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,692,215,832.30
减：卖出股票成本总额	1,604,132,550.74
减：交易费用	1,461,059.17
买卖股票差价收入	86,622,222.39

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无股票赎回差价收入。

6.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无股票申购差价收入。

6.4.7.10.5 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	359.74
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	359.74

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期内无买卖债券差价收入。

6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券申购差价收入。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内无买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.12.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券赎回差价收入。

6.4.7.12.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券申购差价收入。

6.4.7.13 贵金属投资收益

6.4.7.13.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.13.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

6.4.7.13.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无贵金属赎回差价收入。

6.4.7.13.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无贵金属申购差价收入。

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

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	12,012,568.35

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	8,272,617.53
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	8,272,617.53

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-38,250,949.73
——股票投资	-38,342,305.93
——债券投资	91,356.20
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	1,330,691.64
——权证投资	-
——期货投资	1,330,691.64
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	-36,920,258.09

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	1,906,502.63
合计	1,906,502.63

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	25,978.95
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
其他	9,996.76
合计	95,483.08

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，本基金无需要说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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
招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)	基金管理人的股东
招商证券股份有限公司(以下简称“招商证券”)	基金管理人的股东

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

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 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	6,234,944.31	1,217,289.57
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,884,499.97	519,137.99
应支付基金管理人的净管理费	3,350,444.34	698,151.58

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×1.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日基金管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.20\% \div \text{当年天数}$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 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	779,368.05	152,161.12

注：支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值×0.15%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：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	招商中证 500 指数增强 A	招商中证 500 指数增强 C	合计
招商基金管理有限公司	-	8,162.14	8,162.14

招商银行	-	633,715.00	633,715.00
招商证券	-	944.27	944.27
中国银行	-	41,130.26	41,130.26
合计	-	683,951.67	683,951.67
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	招商中证 500 指数增强 A	招商中证 500 指数增强 C	合计
招商基金管理有限公司	-	3,125.66	3,125.66
招商银行	-	81,068.36	81,068.36
招商证券	-	354.05	354.05
中国银行	-	-	-
合计	-	84,548.07	84,548.07

注：本基金的 C 类基金份额的年销售服务费率为 0.40%，逐日累计至每月月底，按月支付。
其计算公式为：

$$C \text{ 类份额日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金资产净值} \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

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

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	68,370,402.21	182,593.23	19,012,764.44	31,282.29

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 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	603459	红板科技	网下申购	3,300	58,410.00
招商证券	001365	天海电子	网下申购	2,394	65,092.86

上年度可比期间 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
中银国际证券	603409	汇通控股	网下申购	776	18,763.68

注：本表已包含托管人的关联方承销期内承销的证券。

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（2026 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
001220	世盟股份	2026 年 1 月 27 日	6 个月	新股流通受限	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-
001237	惠康科技	2026 年 5 月 15	6 个月	新股流通受限	53.26	58.74	285	15,179.10	16,740.90	-

		日								
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	6 个月	新股流通 受限	10.11	10.11	39,014	394,431.54	394,431.54	-
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	1 个月 内(含)	新股流通 受限	10.11	10.11	16,719	169,029.09	169,029.09	-
001257	盛龙股份	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股流通 受限	7.82	20.74	1,743	13,630.26	36,149.82	-
001312	福恩股份	2026 年 4 月 14 日	6 个月	新股流通 受限	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-
001365	天海电子	2026 年 5 月 11 日	6 个月	新股流通 受限	27.19	31.31	719	19,549.61	22,511.89	-
001393	维通利	2026 年 5 月 8 日	6 个月	新股流通 受限	30.38	38.99	387	11,757.06	15,089.13	-
001399	惠科股份	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通 受限	10.12	27.73	6,066	61,387.92	168,210.18	-
301513	尚水智能	2026 年 4 月 10 日	6 个月	新股流通 受限	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-
301531	春光集团	2026 年 4 月 28 日	6 个月	新股流通 受限	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-
301599	理奇智能	2026 年 4 月 22 日	6 个月	新股流通 受限	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-
301666	大普微	2026 年 4 月 8 日	6 个月	新股流通 受限	46.08	463.33	1,220	56,217.60	565,262.60	-
301669	高特电子	2026 年 6 月 2 日	6 个月	新股流通 受限	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-
301680	固德电材	2026 年 2 月 27 日	6 个月	新股流通 受限	58.00	112.16	117	6,786.00	13,122.72	-
301682	宏明电子	2026 年 3 月 18 日	6 个月	新股流通 受限	69.66	160.06	714	49,737.24	114,282.84	-
301683	慧谷新材	2026 年	6 个月	新股流通	78.38	121.77	96	7,524.48	11,689.92	-

		3 月 24 日		受限						
301687	新广益	2025 年 12 月 24 日	6 个月	新股流通受限	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-
301696	三瑞智能	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-
601112	振石股份	2026 年 1 月 21 日	6 个月	新股流通受限	11.18	17.59	588	6,573.84	10,342.92	-
603284	林平发展	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股流通受限	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-
603293	埃泰克	2026 年 4 月 9 日	6 个月	新股流通受限	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-
603352	至信股份	2026 年 1 月 8 日	6 个月	新股流通受限	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-
603407	长裕集团	2026 年 4 月 29 日	6 个月	新股流通受限	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	-
603435	嘉德利	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603459	红板科技	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	17.70	84.32	330	5,841.00	27,825.60	-
688635	长进光子	2026 年 5 月 20 日	6 个月	新股流通受限	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-
688712	北芯生命	2026 年 1 月 28 日	6 个月	新股流通受限	17.52	35.92	1,500	26,280.00	53,880.00	-
688781	视涯科技	2026 年 3 月 18 日	6 个月	新股流通受限	22.68	47.61	217	4,921.56	10,331.37	-
688785	恒运昌	2026 年 1 月 20 日	6 个月	新股流通受限	92.18	463.15	116	10,692.88	53,725.40	-
688797	臻宝科技	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通受限	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	-

688808	联讯仪器	2026 年 4 月 16 日	6 个月	新股流通受限	81.88	1,584.33	163	13,346.44	258,245.79	-
688811	有研新材	2026 年 4 月 1 日	6 个月	新股流通受限	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-
688813	泰金新能	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股流通受限	26.28	172.09	234	6,149.52	40,269.06	-
688816	易思维	2026 年 2 月 4 日	6 个月	新股流通受限	55.95	57.10	177	9,903.15	10,106.70	-
688818	电科蓝天	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股流通受限	9.47	70.14	1,717	16,259.99	120,430.38	-
688820	盛合晶微	2026 年 4 月 13 日	6 个月	新股流通受限	19.68	141.49	1,803	35,483.04	255,106.47	-

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
118072	鼎通转债	2026 年 6 月 24 日	1 个月内（含）	新债未上市	100.00	100.00	120	11,999.95	12,000.32	-
127114	宣化转债	2026 年 6 月 26 日	1 个月内（含）	新债未上市	100.00	100.00	5,292	529,197.68	529,209.28	-

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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
400174	中天 3	2023 年 8 月 30 日	重大事项停牌	0.01	尚未复牌	-	95,300	72,428.00	953.00	-

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

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, 董事会及下设审计委员会、风险控制委员会、督察长、风险管理委员会、监察稽核部门和风险管理部门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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	722,445.37	89,518.29
未评级	-	-
合计	722,445.37	89,518.29

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分别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。

此外，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中约定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。

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负债的账面价值，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 2026 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	68,370,402.21	-	-	-	68,370,402.21
结算备付金	52,105,190.63	-	-	-	52,105,190.63
存出保证金	287,412.65	-	-	7,569,849.60	7,857,262.25
交易性金融资产	-	181,235.77	541,209.60	920,469,584.62	921,192,029.99
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	-	-	-	1,114,395.74	1,114,395.74
应收清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	120,763,005.49	181,235.77	541,209.60	929,153,829.96	1,050,639,280.82
负债					
应付赎回款	-	-	-	11,571,016.95	11,571,016.95
应付管理人报酬	-	-	-	1,057,519.26	1,057,519.26
应付托管费	-	-	-	132,189.92	132,189.92
应付清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	161,025.09	161,025.09
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	2.33	2.33
其他负债	-	-	-	293,933.53	293,933.53
负债总计	-	-	-	13,215,687.08	13,215,687.08
利率敏感度缺口	120,763,005.49	181,235.77	541,209.60	915,938,142.88	1,037,423,593.74
上年度末 2025 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	38,128,436.71	-	-	-	38,128,436.71
结算备付金	33,633,471.29	-	-	-	33,633,471.29
存出保证金	88,828.09	-	-	4,823,971.20	4,912,799.29
交易性金融资产	-	89,518.29	-	502,884,082.55	502,973,600.84
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	-	-	-	4,357,824.08	4,357,824.08
应收清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	71,850,736.09	89,518.29	-	512,065,877.83	584,006,132.21
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,857,407.03	2,857,407.03
应付管理人报酬	-	-	-	553,701.70	553,701.70
应付托管费	-	-	-	69,212.71	69,212.71
应付清算款	-	-	-	6,030,465.34	6,030,465.34
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	84,965.04	84,965.04
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	28,537.15	28,537.15
其他负债	-	-	-	107,598.75	107,598.75
负债总计	-	-	-	9,731,887.72	9,731,887.72
利率敏感度缺口	71,850,736.09	89,518.29	-	502,333,990.11	574,274,244.49

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1.若市场利率平行上升或下降 50 个基点		
	2.其他市场变量保持不变		
	3.仅存在公允价值变动对基金资产净值的影响		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（ 2026 年 6 月 30 日 ）	上年度末（ 2025 年 12 月 31 日 ）
	1. 市场利率平行上升 50 个基点	-18,491.32	-1,325.66
	2. 市场利率平行下降 50 个基点	19,102.96	1,353.30

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 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 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	920,469,584.62	88.73	502,884,082.55	87.57
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	920,469,584.62	88.73	502,884,082.55	87.57

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（ 2026 年 6 月 30 日 ）	上年度末（ 2025 年 12 月 31 日 ）
	1. 权益性投资的市场价格上升 5%	46,023,479.23	25,144,204.13
	2. 权益性投资的市场价格下降 5%	-46,023,479.23	-25,144,204.13

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	918,015,369.89	501,388,246.13
第二层次	1,104,670.23	726,005.00
第三层次	2,071,989.87	859,349.71
合计	921,192,029.99	502,973,600.84

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	920,469,584.62	87.61

	其中：股票	920,469,584.62	87.61
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	722,445.37	0.07
	其中：债券	722,445.37	0.07
	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	120,475,592.84	11.47
8	其他各项资产	8,971,657.99	0.85
9	合计	1,050,639,280.82	100.00

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	533,328.00	0.05
B	采矿业	46,184,771.60	4.45
C	制造业	543,906,942.89	52.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	18,208,779.00	1.76
E	建筑业	12,589,303.00	1.21
F	批发和零售业	14,323,453.48	1.38
G	交通运输、仓储和邮政业	15,113,090.00	1.46
H	住宿和餐饮业	647,640.00	0.06
I	信息传输、软件和信息技术服务业	65,784,840.43	6.34
J	金融业	25,509,143.90	2.46
K	房地产业	768,550.00	0.07
L	租赁和商务服务业	5,002,202.00	0.48
M	科学研究和技术服务业	13,339,341.58	1.29
N	水利、环境和公共设施管理业	10,285,724.00	0.99
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	2,809,920.00	0.27
S	综合	-	-
	合计	775,007,029.88	74.70

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	5,173,103.02	0.50
C	制造业	112,542,734.29	10.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,379,404.71	0.13
E	建筑业	1,934,666.00	0.19
F	批发和零售业	4,349,030.22	0.42
G	交通运输、仓储和邮政业	3,998.88	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,427,169.14	1.20
J	金融业	128,700.00	0.01
K	房地产业	124,003.00	0.01
L	租赁和商务服务业	1,441,977.60	0.14
M	科学研究和技术服务业	829,638.90	0.08
N	水利、环境和公共设施管理业	5,128,128.98	0.49
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	145,462,554.74	14.02

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股票投资明细

7.3.1 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	002185	华天科技	531,900	11,866,689.00	1.14
2	300458	全志科技	297,580	11,742,506.80	1.13
3	300223	北京君正	42,000	10,453,800.00	1.01
4	300012	华测检测	745,500	10,332,630.00	1.00
5	002008	大族激光	67,800	10,177,458.00	0.98
6	002266	浙富控股	2,005,700	10,148,842.00	0.98
7	000739	普洛药业	586,000	9,762,760.00	0.94

8	600801	华新建材	624,100	9,735,960.00	0.94
9	300496	中科创达	156,400	9,663,956.00	0.93
10	300919	中伟新材	209,600	9,170,000.00	0.88
11	002414	高德红外	665,200	8,820,552.00	0.85
12	300054	鼎龙股份	80,000	8,477,600.00	0.82
13	002271	东方雨虹	678,900	8,058,543.00	0.78
14	000709	河钢股份	4,020,600	7,799,964.00	0.75
15	300073	当升科技	162,300	7,796,892.00	0.75
16	600499	科达制造	540,300	7,456,140.00	0.72
17	300037	新宙邦	77,600	7,205,160.00	0.69
18	600339	中油工程	2,232,300	6,853,161.00	0.66
19	301536	星宸科技	52,200	6,718,662.00	0.65
20	601233	桐昆股份	307,200	6,650,880.00	0.64
21	600535	天士力	500,300	6,618,969.00	0.64
22	000519	中兵红箭	299,200	6,304,144.00	0.61
23	002410	广联达	771,900	6,298,704.00	0.61
24	600166	福田汽车	2,140,500	6,228,855.00	0.60
25	600699	均胜电子	287,200	6,206,392.00	0.60
26	002064	华峰化学	646,200	6,132,438.00	0.59
27	300857	协创数据	17,920	6,091,008.00	0.59
28	000951	中国重汽	309,000	6,028,590.00	0.58
29	600546	山煤国际	548,500	5,995,105.00	0.58
30	601139	深圳燃气	1,040,700	5,890,362.00	0.57
31	002624	完美世界	466,700	5,796,414.00	0.56
32	300373	扬杰科技	36,700	5,770,341.00	0.56
33	601699	潞安环能	403,600	5,763,408.00	0.56
34	603486	科沃斯	112,500	5,709,375.00	0.55
35	300604	长川科技	16,500	5,633,430.00	0.54
36	001309	德明利	5,891	5,554,623.90	0.54
37	603225	新凤鸣	275,600	5,415,540.00	0.52
38	600595	中孚实业	963,600	5,415,432.00	0.52
39	603160	汇顶科技	87,700	5,411,967.00	0.52
40	600348	华阳股份	702,200	5,371,830.00	0.52
41	000800	一汽解放	901,200	5,362,140.00	0.52
42	000960	锡业股份	125,500	5,357,595.00	0.52
43	600498	烽火通信	71,900	5,291,840.00	0.51
44	002340	格林美	799,500	5,284,695.00	0.51
45	600282	南钢股份	1,135,500	5,211,945.00	0.50
46	600985	淮北矿业	369,000	5,184,450.00	0.50
47	688002	睿创微纳	33,285	5,148,856.65	0.50
48	002841	视源股份	147,900	5,106,987.00	0.49
49	000060	中金岭南	667,900	5,056,003.00	0.49
50	600170	上海建工	2,264,500	5,027,190.00	0.48

51	300475	香农芯创	16,600	4,980,000.00	0.48
52	600820	隧道股份	943,200	4,914,072.00	0.47
53	688099	晶晨股份	47,577	4,895,673.30	0.47
54	300454	深信服	50,300	4,838,860.00	0.47
55	002583	海能达	615,300	4,731,657.00	0.46
56	601212	白银有色	922,661	4,687,117.88	0.45
57	000783	长江证券	477,100	4,651,725.00	0.45
58	002120	韵达股份	725,200	4,612,272.00	0.44
59	601666	平煤股份	620,100	4,433,715.00	0.43
60	300620	光库科技	11,600	4,387,120.00	0.42
61	001389	广合科技	18,100	4,294,225.00	0.41
62	301358	湖南裕能	54,500	4,134,915.00	0.40
63	600536	中国软件	145,300	4,085,836.00	0.39
64	603816	顾家家居	181,900	4,067,284.00	0.39
65	600060	海信视像	142,000	3,957,540.00	0.38
66	300953	震裕科技	29,580	3,954,846.00	0.38
67	600298	安琪酵母	108,200	3,916,840.00	0.38
68	603444	吉比特	10,800	3,870,936.00	0.37
69	300207	欣旺达	202,200	3,839,778.00	0.37
70	600685	中船防务	150,000	3,816,000.00	0.37
71	603699	纽威股份	75,100	3,777,530.00	0.36
72	688498	源杰科技	2,000	3,772,000.00	0.36
73	603341	龙旗科技	88,700	3,768,863.00	0.36
74	002444	巨星科技	116,100	3,610,710.00	0.35
75	000983	山西焦煤	620,600	3,599,480.00	0.35
76	003022	联泓新科	138,500	3,587,150.00	0.35
77	300735	光弘科技	157,000	3,570,180.00	0.34
78	000027	深圳能源	571,800	3,545,160.00	0.34
79	600143	金发科技	220,000	3,399,000.00	0.33
80	601717	中创智领	243,200	3,382,912.00	0.33
81	002402	和而泰	129,800	3,352,734.00	0.32
82	300002	神州泰岳	424,200	3,313,002.00	0.32
83	603049	中策橡胶	73,888	3,310,921.28	0.32
84	002487	大金重工	56,500	3,275,305.00	0.32
85	000034	神州数码	114,480	3,176,820.00	0.31
86	688213	思特威	29,333	3,140,684.31	0.30
87	000050	深天马 A	302,601	2,998,775.91	0.29
88	600486	扬农化工	59,000	2,991,300.00	0.29
89	002850	科达利	15,800	2,990,940.00	0.29
90	000415	渤海租赁	719,300	2,927,551.00	0.28
91	002273	水晶光电	82,000	2,909,360.00	0.28
92	000039	中集集团	358,400	2,906,624.00	0.28
93	600967	内蒙一机	267,000	2,896,950.00	0.28

94	002281	光迅科技	11,100	2,852,034.00	0.27
95	600380	健康元	299,200	2,818,464.00	0.27
96	002739	儒意电影	292,700	2,809,920.00	0.27
97	601108	财通证券	324,100	2,803,465.00	0.27
98	601966	玲珑轮胎	272,200	2,773,718.00	0.27
99	600601	方正科技	200,400	2,773,536.00	0.27
100	688568	中科星图	66,514	2,758,335.58	0.27
101	300972	万辰集团	15,700	2,722,537.00	0.26
102	603728	鸣志电器	44,611	2,717,702.12	0.26
103	301200	大族数控	7,400	2,668,810.00	0.26
104	600873	梅花生物	363,000	2,668,050.00	0.26
105	002195	岩山科技	406,300	2,657,202.00	0.26
106	603345	安井食品	32,740	2,625,420.60	0.25
107	000703	恒逸石化	192,600	2,613,582.00	0.25
108	002603	以岭药业	173,900	2,608,500.00	0.25
109	000528	柳工	338,500	2,555,675.00	0.25
110	300748	金力永磁	79,600	2,455,660.00	0.24
111	603885	吉祥航空	238,400	2,453,136.00	0.24
112	601162	天风证券	725,700	2,445,609.00	0.24
113	000921	海信家电	89,300	2,439,676.00	0.24
114	601865	福莱特	231,100	2,428,861.00	0.23
115	603298	杭叉集团	101,500	2,421,790.00	0.23
116	688778	厦钨新能	44,089	2,398,441.60	0.23
117	688037	芯源微	5,374	2,359,454.70	0.23
118	002152	广电运通	248,500	2,330,930.00	0.22
119	688709	成都华微	60,912	2,320,138.08	0.22
120	688385	复旦微电	32,544	2,320,061.76	0.22
121	603256	宏和科技	8,700	2,308,371.00	0.22
122	688052	纳芯微	7,976	2,299,560.56	0.22
123	000967	盈峰环境	218,000	2,295,540.00	0.22
124	000997	新大陆	136,900	2,231,470.00	0.22
125	600398	海澜之家	426,100	2,228,503.00	0.21
126	688475	萤石网络	81,259	2,222,433.65	0.21
127	688728	格科微	104,365	2,195,839.60	0.21
128	600884	杉杉股份	162,000	2,195,100.00	0.21
129	600171	上海贝岭	67,000	2,139,980.00	0.21
130	300432	富临精工	106,000	2,129,540.00	0.21
131	688347	华虹宏力	6,257	2,104,229.10	0.20
132	603308	应流股份	34,700	2,095,880.00	0.20
133	688120	华海清科	6,040	1,945,967.20	0.19
134	002065	东华软件	269,900	1,927,086.00	0.19
135	002335	科华数据	45,275	1,921,923.75	0.19
136	601611	中国核建	171,500	1,912,225.00	0.18

137	300724	捷佳伟创	26,300	1,856,780.00	0.18
138	300001	特锐德	47,900	1,812,057.00	0.17
139	601106	中国一重	542,200	1,789,260.00	0.17
140	002312	川发龙蟒	195,100	1,789,067.00	0.17
141	600871	石化油服	876,300	1,778,889.00	0.17
142	603737	三棵树	72,812	1,754,769.20	0.17
143	300339	润和软件	45,300	1,744,503.00	0.17
144	600583	海油工程	345,100	1,735,853.00	0.17
145	300676	华大基因	49,400	1,731,964.00	0.17
146	603920	世运电路	35,900	1,724,636.00	0.17
147	002821	凯莱英	10,600	1,717,200.00	0.17
148	301606	绿联科技	28,000	1,708,560.00	0.16
149	002131	利欧股份	356,300	1,692,425.00	0.16
150	300757	罗博特科	2,700	1,671,300.00	0.16
151	688313	仕佳光子	8,839	1,632,121.35	0.16
152	600566	济川药业	72,200	1,602,118.00	0.15
153	000932	华菱钢铁	461,400	1,601,058.00	0.15
154	600332	白云山	78,400	1,571,136.00	0.15
155	000021	深科技	24,100	1,548,907.00	0.15
156	600299	安迪苏	195,300	1,533,105.00	0.15
157	301377	鼎泰高科	2,700	1,487,430.00	0.14
158	000893	亚钾国际	35,800	1,463,862.00	0.14
159	000878	云南铜业	92,000	1,460,960.00	0.14
160	000629	钒钛股份	435,900	1,455,906.00	0.14
161	600352	浙江龙盛	118,100	1,430,191.00	0.14
162	002683	广东宏大	48,800	1,429,352.00	0.14
163	300567	精测电子	4,500	1,429,200.00	0.14
164	601000	唐山港	344,000	1,427,600.00	0.14
165	688188	柏楚电子	13,355	1,424,978.50	0.14
166	002436	兴森科技	26,500	1,350,175.00	0.13
167	600704	物产中大	283,500	1,338,120.00	0.13
168	601399	国机重装	380,000	1,330,000.00	0.13
169	300677	英科医疗	33,700	1,320,029.00	0.13
170	600483	福能股份	128,100	1,305,339.00	0.13
171	605358	立昂微	16,700	1,295,920.00	0.12
172	600885	宏发股份	37,560	1,295,444.40	0.12
173	300474	景嘉微	21,300	1,288,224.00	0.12
174	603806	福斯特	75,800	1,272,682.00	0.12
175	600563	法拉电子	6,600	1,259,280.00	0.12
176	600879	航天电子	59,000	1,256,110.00	0.12
177	600642	申能股份	143,300	1,251,009.00	0.12
178	002126	银轮股份	25,100	1,249,980.00	0.12
179	003035	南网能源	214,500	1,248,390.00	0.12

180	300136	信维通信	10,200	1,216,350.00	0.12
181	002409	雅克科技	5,400	1,212,300.00	0.12
182	600390	五矿资本	261,700	1,193,352.00	0.12
183	601577	长沙银行	135,200	1,177,592.00	0.11
184	603087	甘李药业	20,700	1,174,932.00	0.11
185	601997	贵阳银行	228,400	1,171,692.00	0.11
186	603659	璞泰来	38,800	1,122,484.00	0.11
187	002025	航天电器	14,600	1,112,812.00	0.11
188	002299	圣农发展	73,200	1,109,712.00	0.11
189	300699	光威复材	36,600	1,048,590.00	0.10
190	603688	石英股份	12,600	1,040,886.00	0.10
191	000429	粤高速 A	75,800	1,034,670.00	0.10
192	600363	联创光电	28,800	1,030,464.00	0.10
193	600109	国金证券	117,000	1,027,260.00	0.10
194	300558	贝达药业	15,700	1,021,599.00	0.10
195	002032	苏泊尔	25,500	1,009,800.00	0.10
196	300146	汤臣倍健	111,200	1,005,248.00	0.10
197	300017	网宿科技	77,100	1,003,071.00	0.10
198	300003	乐普医疗	84,000	995,400.00	0.10
199	603290	斯达半导	6,500	994,110.00	0.10
200	688349	三一重能	64,877	984,832.86	0.09
201	688561	奇安信	40,459	970,206.82	0.09
202	688336	三生国健	18,173	964,986.30	0.09
203	300142	沃森生物	73,100	949,569.00	0.09
204	603338	浙江鼎力	22,200	943,500.00	0.09
205	002056	横店东磁	30,900	941,832.00	0.09
206	688318	财富趋势	13,069	931,950.39	0.09
207	300115	长盈精密	32,200	899,668.00	0.09
208	002966	苏州银行	127,300	886,008.00	0.09
209	600098	广州发展	149,500	883,545.00	0.09
210	601958	金钼股份	31,100	874,221.00	0.08
211	688676	金盘科技	10,141	858,334.24	0.08
212	603766	隆鑫通用	71,100	848,223.00	0.08
213	600105	永鼎股份	12,500	843,500.00	0.08
214	002851	麦格米特	5,000	835,900.00	0.08
215	000987	越秀资本	106,300	831,266.00	0.08
216	000423	东阿阿胶	18,200	825,552.00	0.08
217	600816	建元信托	337,500	823,500.00	0.08
218	601869	长飞光纤	1,500	818,850.00	0.08
219	688019	安集科技	2,367	803,501.82	0.08
220	300548	长芯博创	2,800	778,400.00	0.08
221	601001	晋控煤业	44,700	777,333.00	0.07
222	600578	京能电力	117,200	755,940.00	0.07

223	300487	蓝晓科技	12,800	753,280.00	0.07
224	000959	首钢股份	214,400	752,544.00	0.07
225	002155	湖南黄金	31,180	744,266.60	0.07
226	300570	太辰光	3,000	740,130.00	0.07
227	600970	中材国际	103,200	735,816.00	0.07
228	600350	山东高速	65,900	733,467.00	0.07
229	300623	捷捷微电	16,200	728,838.00	0.07
230	600177	雅戈尔	96,400	725,892.00	0.07
231	300395	菲利华	5,400	722,142.00	0.07
232	000623	吉林敖东	40,500	718,065.00	0.07
233	002318	久立特材	30,000	717,000.00	0.07
234	600369	西南证券	176,600	709,932.00	0.07
235	601990	南京证券	107,200	704,304.00	0.07
236	600998	九州通	147,372	691,174.68	0.07
237	688692	达梦数据	2,800	684,012.00	0.07
238	000831	中国稀土	12,300	682,527.00	0.07
239	603565	中谷物流	69,200	678,852.00	0.07
240	002078	太阳纸业	54,300	678,207.00	0.07
241	601156	东航物流	42,000	677,040.00	0.07
242	002926	华西证券	82,300	672,391.00	0.06
243	000598	兴蓉环境	104,300	669,606.00	0.06
244	600995	南网储能	54,000	664,200.00	0.06
245	000582	北部湾港	61,900	664,187.00	0.06
246	601128	常熟银行	112,595	655,302.90	0.06
247	600901	江苏金租	113,600	653,200.00	0.06
248	603233	大参林	43,300	650,799.00	0.06
249	600754	锦江酒店	36,000	647,640.00	0.06
250	000883	湖北能源	146,000	630,720.00	0.06
251	600008	首创环保	231,700	630,224.00	0.06
252	600132	重庆啤酒	15,200	627,760.00	0.06
253	601598	中国外运	126,500	627,440.00	0.06
254	001286	陕西能源	61,300	621,582.00	0.06
255	000683	博源化工	106,300	612,288.00	0.06
256	600968	海油发展	183,800	612,054.00	0.06
257	688065	凯赛生物	12,500	598,125.00	0.06
258	000539	粤电力 A	87,500	595,875.00	0.06
259	600988	赤峰黄金	22,600	594,832.00	0.06
260	300763	锦浪科技	6,500	587,275.00	0.06
261	600295	鄂尔多斯	54,300	582,096.00	0.06
262	601099	太平洋	171,000	576,270.00	0.06
263	000009	中国宝安	92,300	575,029.00	0.06
264	601555	东吴证券	72,600	574,992.00	0.06
265	002517	恺英网络	35,200	572,000.00	0.06

266	002939	长城证券	68,000	567,120.00	0.05
267	002472	双环传动	13,600	564,536.00	0.05
268	002500	山西证券	109,100	562,956.00	0.05
269	000400	许继电气	25,100	544,670.00	0.05
270	603858	步长制药	37,200	543,120.00	0.05
271	600517	国网英大	115,000	538,200.00	0.05
272	600511	国药股份	20,500	533,820.00	0.05
273	688819	天能股份	24,024	533,332.80	0.05
274	600598	北大荒	49,200	533,328.00	0.05
275	601228	广州港	188,600	531,852.00	0.05
276	002007	华兰生物	43,600	531,484.00	0.05
277	000513	丽珠集团	18,100	522,909.00	0.05
278	000729	燕京啤酒	51,600	522,708.00	0.05
279	601608	中信重工	109,400	521,838.00	0.05
280	002508	老板电器	35,600	520,472.00	0.05
281	000830	鲁西化工	43,000	516,000.00	0.05
282	601866	中远海发	233,400	515,814.00	0.05
283	603899	晨光股份	25,000	515,750.00	0.05
284	601880	辽港股份	371,900	513,222.00	0.05
285	600497	驰宏锌锗	42,100	509,831.00	0.05
286	601155	新城控股	49,500	507,870.00	0.05
287	600004	白云机场	69,600	505,296.00	0.05
288	002432	九安医疗	7,100	501,828.00	0.05
289	000723	美锦能源	148,700	498,145.00	0.05
290	600582	天地科技	111,300	495,285.00	0.05
291	000537	绿发电力	66,900	489,039.00	0.05
292	002984	森麒麟	37,400	488,818.00	0.05
293	300285	国瓷材料	4,600	474,628.00	0.05
294	603979	金诚信	7,400	436,822.00	0.04
295	601665	齐鲁银行	71,800	414,286.00	0.04
296	600906	财达证券	55,100	411,046.00	0.04
297	600153	建发股份	48,200	382,226.00	0.04
298	600141	兴发集团	7,600	356,972.00	0.03
299	600131	国网信通	22,300	325,580.00	0.03
300	688301	奕瑞科技	2,488	308,512.00	0.03
301	688122	西部超导	4,800	301,488.00	0.03
302	600095	湘财股份	37,300	280,869.00	0.03
303	688599	天合光能	19,800	279,576.00	0.03
304	301526	国际复材	5,895	275,119.65	0.03
305	600038	中直股份	10,800	273,132.00	0.03
306	688361	中科飞测	615	264,450.00	0.03
307	002244	滨江集团	34,300	260,680.00	0.03
308	000062	深圳华强	7,200	229,104.00	0.02

309	601799	星宇股份	2,500	226,550.00	0.02
310	600435	北方导航	19,200	215,040.00	0.02
311	300751	迈为股份	700	197,722.00	0.02
312	300666	江丰电子	500	184,300.00	0.02
313	002429	兆驰股份	17,700	183,903.00	0.02
314	003031	中瓷电子	1,000	180,300.00	0.02
315	002203	海亮股份	7,600	173,660.00	0.02
316	688615	合合信息	1,500	169,650.00	0.02
317	603379	三美股份	2,200	166,958.00	0.02
318	002797	第一创业	24,500	160,965.00	0.02
319	601198	东兴证券	11,200	152,208.00	0.01
320	002673	西部证券	22,600	146,674.00	0.01
321	600157	永泰能源	88,200	142,002.00	0.01
322	600927	永安期货	11,400	141,930.00	0.01
323	002738	中矿资源	2,400	141,576.00	0.01
324	600062	华润双鹤	8,800	141,152.00	0.01
325	688777	中控技术	1,200	141,000.00	0.01
326	000738	航发控制	7,700	140,833.00	0.01
327	002812	恩捷股份	2,100	140,511.00	0.01
328	000088	盐田港	33,800	138,242.00	0.01
329	603568	伟明环保	8,900	136,882.00	0.01
330	601615	明阳智能	11,800	136,526.00	0.01
331	600312	平高电气	7,700	135,982.00	0.01
332	002756	永兴材料	2,400	135,936.00	0.01
333	000155	川能动力	11,200	134,176.00	0.01
334	002130	沃尔核材	6,300	119,448.00	0.01
335	300390	天华新能	1,100	102,861.00	0.01
336	002568	百润股份	4,900	82,908.00	0.01
337	301498	乖宝宠物	1,253	50,859.27	0.00
338	688702	盛科通信	103	40,168.97	0.00
339	688017	绿的谐波	66	27,578.76	0.00
340	688248	南网科技	381	26,357.58	0.00
341	688617	惠泰医疗	128	23,239.68	0.00
342	688278	特宝生物	332	18,060.80	0.00
343	688169	石头科技	168	15,954.96	0.00
344	688578	艾力斯	129	14,086.80	0.00
345	688582	芯动联科	191	12,415.00	0.00
346	601112	振石股份	588	10,342.92	0.00
347	603119	浙江荣泰	131	8,690.54	0.00
348	688563	航材股份	156	7,991.88	0.00
349	688772	珠海冠宇	258	5,064.54	0.00
350	688295	中复神鹰	81	4,903.74	0.00
351	688114	华大智造	47	2,400.76	0.00

352	002465	海格通信	100	1,277.00	0.00
353	002831	裕同科技	34	1,209.04	0.00
354	603939	益丰药房	60	1,078.80	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产 净值比例 （%）
1	002558	巨人网络	256,200	7,060,872.00	0.68
2	600487	亨通光电	57,000	6,232,380.00	0.60
3	000404	长虹华意	757,700	5,955,522.00	0.57
4	000938	紫光股份	171,400	4,946,604.00	0.48
5	002768	国恩股份	91,836	4,780,982.16	0.46
6	002156	通富微电	63,000	4,779,810.00	0.46
7	600549	厦门钨业	44,779	3,815,170.80	0.37
8	603588	高能环境	198,600	3,813,120.00	0.37
9	688525	佰维存储	6,340	3,136,588.20	0.30
10	600309	万华化学	37,040	2,533,906.40	0.24
11	002241	歌尔股份	109,200	2,460,276.00	0.24
12	000422	湖北宜化	174,400	2,450,320.00	0.24
13	603799	华友钴业	49,000	2,364,740.00	0.23
14	601607	上海医药	148,600	2,288,440.00	0.22
15	600741	华域汽车	144,700	2,245,744.00	0.22
16	301511	德福科技	15,470	2,225,359.50	0.21
17	603600	永艺股份	249,700	2,214,839.00	0.21
18	300903	科翔股份	21,700	2,198,427.00	0.21
19	301217	铜冠铜箔	13,300	2,195,431.00	0.21
20	000933	神火股份	100,500	2,130,600.00	0.21
21	002384	东山精密	8,000	2,098,800.00	0.20
22	301248	杰创智能	22,800	1,913,604.00	0.18
23	301308	江波龙	2,600	1,829,880.00	0.18
24	002236	大华股份	106,200	1,751,238.00	0.17
25	002202	金风科技	72,700	1,737,530.00	0.17
26	300164	通源石油	206,600	1,652,800.00	0.16
27	601231	环旭电子	47,300	1,532,520.00	0.15
28	000657	中钨高新	15,600	1,493,232.00	0.14
29	601061	中信金属	129,400	1,393,638.00	0.13
30	688797	臻宝科技	2,070	1,382,689.62	0.13
31	688321	微芯生物	49,289	1,297,779.37	0.13
32	002475	立讯精密	17,800	1,253,120.00	0.12
33	300102	乾照光电	47,400	1,234,296.00	0.12

34	603901	永创智能	111,700	1,214,179.00	0.12
35	000810	创维数字	80,800	1,070,600.00	0.10
36	300749	顶固集创	39,600	1,063,260.00	0.10
37	000426	兴业银锡	31,100	1,025,056.00	0.10
38	000100	TCL 科技	163,700	952,734.00	0.09
39	002080	中材科技	10,500	945,000.00	0.09
40	002415	海康威视	26,900	919,980.00	0.09
41	688110	东芯股份	4,400	896,280.00	0.09
42	600522	中天科技	14,600	885,928.00	0.09
43	603083	剑桥科技	3,400	866,558.00	0.08
44	000823	超声电子	33,200	851,580.00	0.08
45	000890	法尔胜	105,600	851,136.00	0.08
46	600201	生物股份	72,300	842,295.00	0.08
47	605167	利柏特	52,300	842,030.00	0.08
48	002111	威海广泰	93,200	838,800.00	0.08
49	300516	久之洋	25,560	837,345.60	0.08
50	600183	生益科技	4,700	814,980.00	0.08
51	000958	电投产融	144,300	813,852.00	0.08
52	002324	普利特	67,400	813,518.00	0.08
53	600057	厦门象屿	148,500	804,870.00	0.08
54	300478	杭州高新	21,800	799,842.00	0.08
55	300427	红相股份	117,300	787,083.00	0.08
56	605389	长龄液压	7,850	753,600.00	0.07
57	002455	百川股份	104,500	752,400.00	0.07
58	002532	天山铝业	69,200	742,516.00	0.07
59	300308	中际旭创	580	736,600.00	0.07
60	688800	瑞可达	7,360	706,339.20	0.07
61	601899	紫金矿业	28,000	703,920.00	0.07
62	300277	汽轮科技	46,300	696,352.00	0.07
63	605289	罗曼股份	4,700	681,500.00	0.07
64	301148	嘉戎技术	12,700	676,402.00	0.07
65	688668	鼎通科技	1,767	659,621.10	0.06
66	002803	吉宏股份	25,100	648,584.00	0.06
67	300835	龙磁科技	2,800	642,572.00	0.06
68	301182	凯旺科技	6,200	640,274.00	0.06
69	688502	茂莱光学	922	639,499.20	0.06
70	603016	新宏泰	18,800	634,688.00	0.06
71	002010	传化智联	141,800	633,846.00	0.06
72	300816	艾可蓝	8,500	622,200.00	0.06
73	601126	四方股份	9,800	619,360.00	0.06
74	300467	迅游科技	16,500	613,470.00	0.06
75	605299	舒华体育	45,700	610,095.00	0.06
76	603897	长城科技	18,600	603,756.00	0.06

77	601168	西部矿业	22,000	597,080.00	0.06
78	301538	骏鼎达	11,820	595,373.40	0.06
79	300418	昆仑万维	14,200	573,112.00	0.06
80	000708	中信特钢	45,300	571,686.00	0.06
81	301666	大普微	1,220	565,262.60	0.05
82	001248	华润新能源	55,733	563,460.63	0.05
83	688390	固德威	5,000	542,550.00	0.05
84	688807	优迅股份	1,303	524,366.29	0.05
85	001399	惠科股份	15,164	515,571.82	0.05
86	601918	新集能源	60,000	515,400.00	0.05
87	600019	宝钢股份	92,300	501,189.00	0.05
88	688796	百奥赛图	4,222	461,886.80	0.04
89	300014	亿纬锂能	6,900	448,707.00	0.04
90	300645	正元智慧	38,100	448,437.00	0.04
91	300590	移为通信	31,200	447,720.00	0.04
92	603296	华勤技术	5,700	423,339.00	0.04
93	601886	江河集团	51,200	411,136.00	0.04
94	600722	金牛化工	50,100	406,812.00	0.04
95	603538	美诺华	11,400	371,070.00	0.04
96	603259	药明康德	2,800	348,628.00	0.03
97	603019	中科曙光	3,200	343,136.00	0.03
98	600875	东方电气	11,600	333,732.00	0.03
99	688167	炬光科技	940	332,957.40	0.03
100	600989	宝丰能源	16,200	329,346.00	0.03
101	002600	领益智造	17,500	303,450.00	0.03
102	688061	灿瑞科技	6,035	299,758.45	0.03
103	600528	中铁工业	45,400	299,186.00	0.03
104	300428	立中集团	16,000	290,880.00	0.03
105	688659	元琛科技	27,548	287,601.12	0.03
106	002439	启明星辰	22,200	280,830.00	0.03
107	688109	品茗科技	3,600	272,520.00	0.03
108	300124	汇川技术	4,100	271,953.00	0.03
109	300191	潜能恒信	9,700	268,205.00	0.03
110	300986	志特新材	15,400	264,110.00	0.03
111	603216	梦天家居	12,800	263,296.00	0.03
112	301396	宏景科技	780	258,648.00	0.02
113	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.02
114	688820	盛合晶微	1,803	255,106.47	0.02
115	603619	中曼石油	12,900	241,359.00	0.02
116	688125	安达智能	1,447	236,584.50	0.02
117	000811	冰轮环境	4,200	236,124.00	0.02
118	601600	中国铝业	28,500	234,270.00	0.02
119	301669	高特电子	5,455	217,413.57	0.02

120	301608	博实结	4,176	209,885.76	0.02
121	300790	宇瞳光学	7,980	208,357.80	0.02
122	002595	豪迈科技	4,425	206,205.00	0.02
123	300681	英搏尔	6,600	188,892.00	0.02
124	301369	联动科技	715	175,175.00	0.02
125	002636	金安国纪	1,400	167,958.00	0.02
126	603115	海星股份	1,300	159,211.00	0.02
127	301319	唯特偶	920	153,943.60	0.01
128	301687	新广益	1,942	151,048.76	0.01
129	300596	利安隆	2,800	146,944.00	0.01
130	688766	普冉股份	184	141,054.40	0.01
131	001280	中国铀业	1,996	133,133.20	0.01
132	000776	广发证券	5,500	128,700.00	0.01
133	688805	健信超导	2,643	124,141.71	0.01
134	300573	兴齐眼药	3,040	123,910.40	0.01
135	600683	京投发展	10,700	123,050.00	0.01
136	688818	电科蓝天	1,717	120,430.38	0.01
137	301682	宏明电子	714	114,282.84	0.01
138	688809	强一股份	167	104,041.00	0.01
139	605277	新亚电子	4,840	92,250.40	0.01
140	688693	锆威特	857	89,085.15	0.01
141	000066	中国长城	4,500	85,725.00	0.01
142	301589	诺瓦星云	567	84,471.66	0.01
143	688603	天承科技	361	75,069.95	0.01
144	301018	申菱环境	631	72,949.91	0.01
145	000576	甘化科工	8,500	55,845.00	0.01
146	603185	弘元绿能	3,300	55,077.00	0.01
147	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.01
148	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.01
149	001233	海安集团	1,109	49,572.30	0.00
150	688729	屹唐股份	1,039	44,677.00	0.00
151	688795	摩尔线程	61	43,705.89	0.00
152	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.00
153	688573	信宇人	2,234	39,586.48	0.00
154	688635	长进光子	128	39,448.32	0.00
155	688790	昂瑞微	289	38,676.87	0.00
156	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.00
157	301533	威马农机	1,442	34,117.72	0.00
158	688183	生益电子	246	32,570.40	0.00
159	688549	中巨芯	855	31,472.55	0.00
160	688802	沐曦股份	37	30,647.10	0.00
161	300394	天孚通信	96	29,057.28	0.00
162	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00

163	688583	思看科技	318	27,274.86	0.00
164	301678	新恒汇	344	27,120.96	0.00
165	301550	斯菱智驱	284	25,966.12	0.00
166	688383	新益昌	137	25,761.48	0.00
167	688775	影石创新	185	25,650.25	0.00
168	688652	京仪装备	121	24,220.57	0.00
169	301489	思泉新材	147	24,193.26	0.00
170	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
171	301486	致尚科技	106	22,081.92	0.00
172	301292	海科新源	261	20,809.53	0.00
173	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
174	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
175	603312	西典新能	544	18,485.12	0.00
176	688720	艾森股份	174	17,574.00	0.00
177	301488	豪恩汽电	135	17,120.70	0.00
178	001387	雪祺电气	1,331	16,996.87	0.00
179	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
180	301487	盟固利	867	16,603.05	0.00
181	301421	波长光电	158	16,360.90	0.00
182	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
183	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
184	301566	达利凯普	400	14,832.00	0.00
185	301568	思泰克	130	14,508.00	0.00
186	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
187	301413	安培龙	196	13,892.48	0.00
188	603325	博隆技术	269	13,616.78	0.00
189	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
190	001369	双欣材料	897	12,127.44	0.00
191	301529	福赛科技	122	11,755.92	0.00
192	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
193	301667	纳百川	151	10,920.32	0.00
194	300866	安克创新	100	10,450.00	0.00
195	688781	视涯科技	217	10,331.37	0.00
196	301348	蓝箭电子	324	10,231.92	0.00
197	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
198	688249	晶合集成	171	10,094.13	0.00
199	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
200	001230	劲旅环境	630	9,676.80	0.00
201	688100	威胜信息	294	8,993.46	0.00
202	688153	唯捷创芯	267	8,576.04	0.00
203	688648	中邮科技	232	8,479.60	0.00
204	301555	惠柏新材	176	7,992.16	0.00
205	688005	容百科技	255	7,803.00	0.00

206	301595	太力科技	196	7,761.60	0.00
207	301261	恒工精密	99	7,731.90	0.00
208	688755	汉邦科技	264	7,275.84	0.00
209	300904	威力传动	178	7,225.02	0.00
210	688591	泰凌微	208	7,151.04	0.00
211	301528	多浦乐	87	7,125.30	0.00
212	301590	优优绿能	54	7,098.30	0.00
213	301517	陕西华达	143	7,097.09	0.00
214	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
215	688719	爱科赛博	83	6,391.00	0.00
216	301516	中远通	449	6,353.35	0.00
217	688450	光格科技	92	6,163.08	0.00
218	688653	康希通信	354	6,152.52	0.00
219	301449	天溯计量	157	6,075.90	0.00
220	301548	崇德科技	68	6,036.36	0.00
221	301500	飞南资源	230	5,991.50	0.00
222	301381	赛维时代	303	5,587.32	0.00
223	603248	锡华科技	260	5,483.40	0.00
224	301636	泽润新能	128	5,390.08	0.00
225	688671	碧兴物联	148	5,264.36	0.00
226	301015	百洋医药	275	5,241.50	0.00
227	301508	中机认检	213	4,928.82	0.00
228	301518	长华化学	186	4,873.20	0.00
229	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
230	301459	丰茂股份	155	4,795.70	0.00
231	601096	宏盛华源	1,099	4,769.66	0.00
232	301393	昊帆生物	71	4,598.67	0.00
233	301372	科净源	143	4,505.93	0.00
234	301202	朗威股份	133	4,432.89	0.00
235	301418	协昌科技	79	4,414.52	0.00
236	301507	民生健康	338	4,066.14	0.00
237	301469	恒达新材	145	3,999.10	0.00
238	301370	国科恒泰	469	3,794.21	0.00
239	603014	威高血净	115	3,763.95	0.00
240	301558	三态股份	607	3,745.19	0.00
241	301509	金凯生科	123	3,740.43	0.00
242	688296	和达科技	315	3,603.60	0.00
243	001390	古麒绒材	178	3,579.58	0.00
244	001326	联域股份	59	3,498.11	0.00
245	301578	辰奕智能	168	3,425.52	0.00
246	688716	中研股份	107	3,363.01	0.00
247	688651	盛邦安全	104	3,350.88	0.00
248	603373	安邦护卫	90	3,261.60	0.00

249	603400	华之杰	57	3,079.14	0.00
250	301505	苏州规划	189	3,042.90	0.00
251	301525	儒竞科技	63	2,974.23	0.00
252	688309	恒誉环保	48	2,922.24	0.00
253	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
254	603270	金帝股份	82	2,747.82	0.00
255	301371	敷尔佳	103	2,678.00	0.00
256	301520	万邦医药	81	2,632.50	0.00
257	688602	康鹏科技	332	2,616.16	0.00
258	688657	浩辰软件	73	2,611.21	0.00
259	001388	信通电子	94	2,582.18	0.00
260	001396	誉帆科技	69	2,443.98	0.00
261	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
262	601083	锦江航运	243	2,415.42	0.00
263	688612	威迈斯	79	2,337.61	0.00
264	001378	德冠新材	130	2,328.30	0.00
265	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
266	301519	舜禹股份	205	2,224.25	0.00
267	301559	中集环科	177	2,157.63	0.00
268	001210	金房能源	92	2,092.08	0.00
269	301515	港通医疗	119	2,086.07	0.00
270	603193	润本股份	102	1,892.10	0.00
271	001239	永达股份	142	1,877.24	0.00
272	603004	鼎龙科技	77	1,854.93	0.00
273	603273	天元智能	142	1,838.90	0.00
274	603382	海阳科技	105	1,800.75	0.00
275	301296	新巨丰	305	1,793.40	0.00
276	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
277	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00
278	001306	夏厦精密	29	1,582.53	0.00
279	001358	兴欣新材	59	1,524.56	0.00
280	603075	热威股份	59	1,319.24	0.00
281	603276	恒兴新材	86	1,316.66	0.00
282	603107	上海汽配	104	1,180.40	0.00
283	603231	索宝蛋白	68	1,006.40	0.00
284	400174	中天 3	95,300	953.00	0.00
285	600372	中航机载	66	716.10	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	300496	中科创达	17,228,232.70	3.00
2	600801	华新建材	16,614,726.69	2.89
3	002410	广联达	16,522,160.40	2.88
4	300012	华测检测	15,449,835.00	2.69
5	000997	新大陆	13,818,767.00	2.41
6	300207	欣旺达	13,803,705.00	2.40
7	600885	宏发股份	13,707,699.00	2.39
8	000951	中国重汽	13,673,304.00	2.38
9	603341	龙旗科技	13,548,273.00	2.36
10	300919	中伟新材	12,921,157.60	2.25
11	000709	河钢股份	12,672,343.00	2.21
12	002603	以岭药业	12,650,519.00	2.20
13	600060	海信视像	12,601,557.00	2.19
14	002156	通富微电	12,514,920.00	2.18
15	600498	烽火通信	12,327,625.00	2.15
16	000933	神火股份	12,291,255.00	2.14
17	300458	全志科技	12,205,194.40	2.13
18	000050	深天马 A	12,055,057.00	2.10
19	002266	浙富控股	11,917,007.00	2.08
20	603160	汇顶科技	11,807,925.00	2.06
21	300373	扬杰科技	11,712,976.00	2.04
22	000519	中兵红箭	11,641,924.00	2.03

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	300373	扬杰科技	17,265,567.47	3.01
2	002436	兴森科技	17,088,389.94	2.98
3	601231	环旭电子	17,028,007.00	2.97
4	000050	深天马 A	14,999,262.69	2.61
5	002008	大族激光	14,749,639.24	2.57
6	600060	海信视像	14,610,032.56	2.54
7	002156	通富微电	14,322,516.94	2.49
8	601168	西部矿业	14,146,123.00	2.46
9	600885	宏发股份	13,065,239.68	2.28
10	000539	粤电力 A	12,956,241.00	2.26

11	300496	中科创达	12,678,694.95	2.21
12	002831	裕同科技	12,448,857.24	2.17
13	000951	中国重汽	12,241,104.60	2.13
14	002603	以岭药业	12,101,506.00	2.11
15	300207	欣旺达	11,896,228.00	2.07
16	600498	烽火通信	11,850,272.30	2.06
17	002185	华天科技	11,612,481.00	2.02
18	002080	中材科技	11,589,906.52	2.02
19	002138	顺络电子	11,529,185.00	2.01
20	000657	中钨高新	11,344,363.00	1.98

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	2,060,060,358.74
卖出股票收入（成交）总额	1,692,215,832.30

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

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）	722,445.37	0.07
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	722,445.37	0.07

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	127114	宜化转债	5,292	529,209.28	0.05
2	123158	宙邦转债	605	180,286.35	0.02
3	118072	鼎通转债	120	12,000.32	0.00
4	123250	嘉益转债	8	949.42	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

报告期基金投资的前十名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。

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	7,857,262.25
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,114,395.74
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,971,657.99

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	123158	宙邦转债	180,286.35	0.02
2	123250	嘉益转债	949.42	0.00

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
招商中证 500 指数增强 A	14,633	18,600.63	12,196,335.92	4.48%	259,986,742.70	95.52%
招商中证 500 指数增强 C	15,531	15,438.17	28,935,489.72	12.07%	210,834,756.27	87.93%
合计	30,164	16,972.33	41,131,825.64	8.03%	470,821,498.97	91.97%

注：机构投资者/个人投资者持有份额占总份额比例计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	招商中证 500 指数增强 A	81,413.10	0.0299%
	招商中证 500 指数增强 C	8,218.62	0.0034%
	合计	89,631.72	0.0175%

注：分级基金机构投资者/个人投资者持有份额占总份额比例计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.3 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	份额级别	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	招商中证 500 指数增强 A	0
	招商中证 500 指数增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	招商中证 500 指数增强 A	0
	招商中证 500 指数增强 C	0

	合计	0
--	----	---

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	招商中证 500 指数增强 A	招商中证 500 指数增强 C
基金合同生效日(2017 年 5 月 17 日)基金份额总额	124,892,139.37	208,016,852.96
本报告期期初基金份额总额	164,662,744.46	147,964,912.73
本报告期基金总申购份额	329,701,726.86	267,695,863.73
减：本报告期基金总赎回份额	222,181,392.70	175,890,530.47
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	272,183,078.62	239,770,245.99

§ 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

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，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、公募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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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	
兴业证券	2	828,394,537.39	22.10%	82,763.07	22.10%	-
中信证券	7	670,003,351.27	17.87%	66,938.96	17.87%	本报告期减少 1 个
长江证券	4	627,672,364.95	16.74%	62,701.31	16.74%	-
华泰证券	4	429,363,306.09	11.45%	42,895.19	11.45%	-
广发证券	6	303,591,818.41	8.10%	30,329.47	8.10%	-
国投证券	2	268,299,578.40	7.16%	26,800.71	7.16%	本报告期减少 2 个
银河证券	1	255,994,852.85	6.83%	25,569.91	6.83%	-
中信建投证券	2	226,541,987.27	6.04%	22,634.52	6.04%	-
国泰海通证券	7	139,329,446.82	3.72%	13,919.50	3.72%	-
北京证券	2	-	-	-	-	-
财通证券	3	-	-	-	-	-
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	2	-	-	-	-	本报告 期减少 4 个
东兴证券	2	-	-	-	-	本报告 期减少 1 个
方正证券	3	-	-	-	-	本报告 期减少 1 个
光大证券	3	-	-	-	-	-
国海证券	4	-	-	-	-	本报告 期新增 1 个
国金证券	1	-	-	-	-	-
国联民生	4	-	-	-	-	本报告 期减少 5 个
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国新证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	3	-	-	-	-	-
国元证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
华宝证券	2	-	-	-	-	本报告 期减少 2 个
华创证券	4	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	4	-	-	-	-	-
华西证券	3	-	-	-	-	-
华鑫证券	2	-	-	-	-	-
华源证券	2	-	-	-	-	-
汇丰前海 证券	2	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	本报告 期新增
南京证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	本报告

						期减少 1 个
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	6	-	-	-	-	-
上海证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	本报告 期减少 1 个
太平洋证 券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
天府证券	2	-	-	-	-	-
万和证券	1	-	-	-	-	-
五矿证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
甬兴证券	2	-	-	-	-	-
粤开证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	本报告 期减少 2 个
招商证券	4	-	-	-	-	本报告 期减少 1 个
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	2	-	-	-	-	-
中银国际 证券	2	-	-	-	-	本报告 期减少 1 个
中邮证券	2	-	-	-	-	-

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 基金租用或者通过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
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通证券	-	-	-	-	-	-
北京证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国联民生	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国新证券	-	-	-	-	-	-

国信证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
华源证券	-	-	-	-	-	-
汇丰前海 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	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证 券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
天府证券	-	-	-	-	-	-
万和证券	-	-	-	-	-	-
五矿证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
甬兴证券	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
中金财富 证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-

中泰证券	-	-	-	-	-	-
中银国际 证券	-	-	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-

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基金 2025 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	2026-01-21
2	招商中证 500 指数增强型证券投资基金 2025 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	2026-01-21
3	招商基金管理有限公司旗下基金 2025 年年度报告提示性公告	上海证券报及基金管理人网站	2026-03-31
4	招商中证 500 指数增强型证券投资基金 2025 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	2026-03-31
5	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	2026-04-01
6	招商基金管理有限公司旗下基金 2026 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	2026-04-22
7	招商中证 500 指数增强型证券投资基金 2026 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	2026-04-22
8	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	2026-05-12
9	招商基金管理有限公司关于提醒投资者持续完善客户身份信息的公告	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	2026-05-14
10	招商中证 500 指数增强型证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要更新	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-05-15
11	招商中证 500 指数增强型证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要更新	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-05-15
12	招商中证 500 指数增强型证券投资基金更新的招募说明书（二零二六年第一号）	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-05-15

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准设立招商基金管理有限公司的文件；
- 2、中国证券监督管理委员会批准招商中证 500 指数增强型证券投资基金设立的文件；
- 3、《招商中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 4、《招商中证 500 指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 5、《招商中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书》；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照。

11.2 存放地点

招商基金管理有限公司

地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

11.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人招商基金管理有限公司。

客户服务电话：400-887-9555

网址：<http://www.cmfchina.com>

招商基金管理有限公司

2026 年 8 月 31 日