

招商上证综合指数增强型发起式证券投资基金 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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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	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	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	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内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）	12
6.1 资产负债表	12
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	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	52
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	53
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	53
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	53
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	53

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
7.12 投资组合报告附注	53
§8 基金份额持有人信息	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
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	55
8.4 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况	55
§9 开放式基金份额变动	56
§10 重大事件揭示	56
10.1 基金份额持有人大会决议	56
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
10.4 基金投资策略的改变	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	57
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	57
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	57
10.8 其他重大事件	59
§11 影响投资者决策的其他重要信息	60
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	60
§12 备查文件目录	61
12.1 备查文件目录	61
12.2 存放地点	61
12.3 查阅方式	61

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	招商上证综合指数增强型发起式证券投资基金	
基金简称	招商上证综合指数增强发起式	
基金主代码	018383	
交易代码	018383	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 1 月 16 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	181,775,176.74 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	招商上证综合指数增强发起式 A	招商上证综合指数增强发起式 C
下属分级基金的交易代码	018383	018384
报告期末下属分级基金的份额总额	40,317,554.51 份	141,457,622.23 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过数量化的投资方法与严格的投资纪律约束，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。同时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 8.0%。
投资策略	本基金作为增强指数型基金，以跟踪标的指数为主，一般情况下保持各类资产配置的基本稳定，与此同时，在综合考量系统性风险、各类资产收益风险比值、股票资产估值、流动性要求、申购赎回以及分红等因素后，在有效控制基金跟踪误差的前提下，对基金资产进行合理配置。 本基金其他主要投资策略包括：股票投资策略、港股投资策略、债券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、股票期权投资策略、资产支持证券投资策略、存托凭证投资策略、参与融资及转融通证券出借业务投资策略。
业绩比较基准	上证综合指数收益率×95%+中国人民银行人民币活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金是股票型基金，其预期风险收益水平高于债券型基金及货币市场基金。 本基金资产投资于港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险（港股市场实行 T+0 回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动可能对基金的投资收益造成损失）、港股通机制下交易日不连

	贯可能带来的风险（在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险）等。
--	---

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
	联系电话	0755-83196666
	电子邮箱	cmf@cmfchina.com
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	王颖	廖林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.cmfchina.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、招商上证综合指数增强发起式 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	3,773,333.93
本期利润	2,913,507.12
加权平均基金份额本期利润	0.1052
本期加权平均净值利润率	7.92%
本期基金份额净值增长率	8.71%
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	13,450,369.31
期末可供分配基金份额利润	0.3336
期末基金资产净值	55,070,001.73
期末基金份额净值	1.3659
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	36.59%

2、招商上证综合指数增强发起式 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	6,700,211.77
本期利润	6,929,106.21
加权平均基金份额本期利润	0.1309
本期加权平均净值利润率	9.85%
本期基金份额净值增长率	8.55%
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	46,384,129.71
期末可供分配基金份额利润	0.3279
期末基金资产净值	192,421,565.64
期末基金份额净值	1.3603
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	36.03%

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

招商上证综合指数增强发起式 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	8.04%	0.96%	4.96%	0.89%	3.08%	0.07%
过去六个月	8.71%	0.94%	3.04%	0.91%	5.67%	0.03%
过去一年	24.08%	0.81%	17.91%	0.79%	6.17%	0.02%
自基金合同 生效起至今	36.59%	0.86%	25.49%	0.82%	11.10%	0.04%

招商上证综合指数增强发起式 C

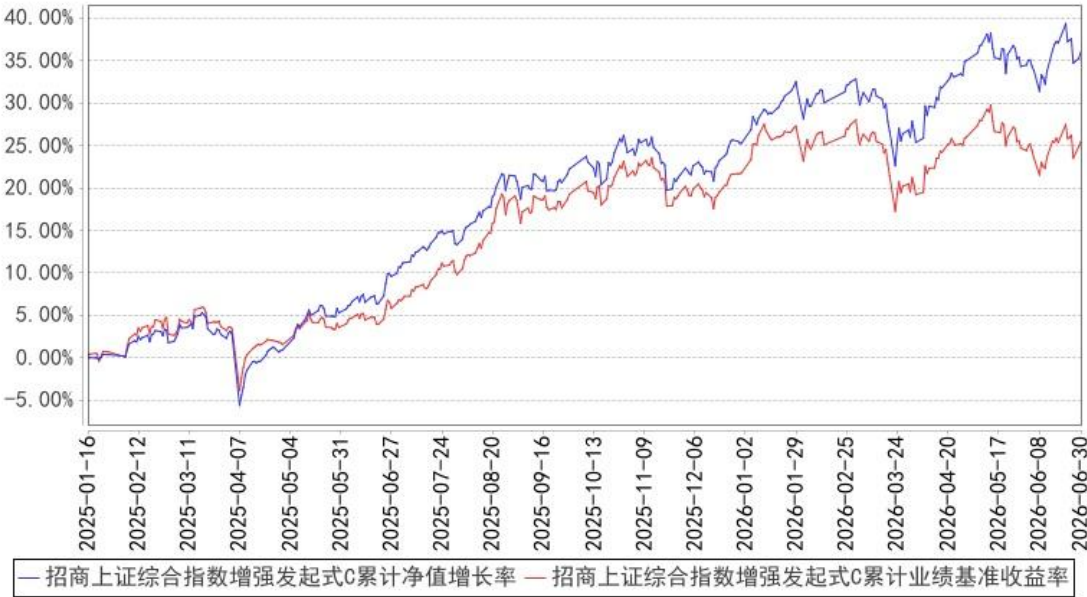
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	7.95%	0.96%	4.96%	0.89%	2.99%	0.07%
过去六个月	8.55%	0.94%	3.04%	0.91%	5.51%	0.03%
过去一年	23.72%	0.81%	17.91%	0.79%	5.81%	0.02%
自基金合同 生效起至今	36.03%	0.86%	25.49%	0.82%	10.54%	0.04%

3.2.2 自基金合同生效/自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

招商上证综合指数增强发起式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



招商上证综合指数增强发起式C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金建仓期为 6 个月，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		
邓童	本基金基金经理	2025 年 1 月 16 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《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

基金管理人声明：在本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关法律法规及其各项实施准则的规定以及本基金的基金合同等基金法律文件的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的前提下，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围以及投资运作符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

基金管理人已建立较完善的研究方法和投资决策流程，确保各投资组合享有公平的投资决策机会。基金管理人建立了所有组合适用的投资对象备选库，制定明确的备选库建立、维护程序。基金管理人拥有健全的投资授权制度，明确投资决策委员会、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限划分，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。基金管理人的相关研究成果向内部所有投资组合开放，在投资研究层面不存在各投资组合间不公平的问题。

基金管理人按照法规要求，对连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合间的同向交易的交易价差进行分析，相关投资组合经理也对分析中发现的价格差异次数占比超过正常范围的情况进行了合理性解释。报告期内，公司旗下投资组合同向交易价差分析中未发现异常情形。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

基金管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。确因投资组合的投资策略或流动性等需要而发生的同日反向交易，基金管理人要求相关投资组合经理提供决策依据，并留存记录备查，完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合等除外。

本报告期内，本基金各项交易均严格按照相关法律法规、基金合同的有关要求执行，公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 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

报告期内上证综合指数震荡上涨，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较大波动。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 8.71%，同期业绩基准增长率为 3.04%，C 类份额净值增长率为 8.55%，同期业绩基准增长率为 3.04%。

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

本基金为发起式基金，且截至本报告期末，本基金基金合同生效未满 3 年，不适用《公开募集证券投资基金运作管理办法》关于“基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元”的披露规定。

§ 5 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：招商上证综合指数增强型发起式证券投资基金

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	27,555,246.91	1,502,059.62
结算备付金		2,855,331.00	230,739.89
存出保证金		1,965,235.33	18,363.54
交易性金融资产	6.4.7.2	218,490,245.11	38,859,328.45
其中：股票投资		217,882,883.14	38,254,897.11
基金投资		-	-
债券投资		607,361.97	604,431.34
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		-	1,433,864.99
应收股利		-	-
应收申购款		5,392,790.28	527,998.81
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		256,258,848.63	42,572,355.30
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		28,022.28	-
应付赎回款		8,482,426.44	2,042,911.13
应付管理人报酬		132,052.89	33,678.98
应付托管费		16,506.62	4,209.85
应付销售服务费		37,136.04	7,303.80
应付投资顾问费		-	-
应交税费		2,375.27	335.11
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	68,761.72	22,950.88
负债合计		8,767,281.26	2,111,389.75
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	181,775,176.74	32,241,902.79
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	65,716,390.63	8,219,062.76
净资产合计		247,491,567.37	40,460,965.55
负债和净资产总计		256,258,848.63	42,572,355.30

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，招商上证综合指数增强发起式 A 份额净值 1.3659 元，基金份额总额 40,317,554.51 份；招商上证综合指数增强发起式 C 份额净值 1.3603 元，基金份额总额 141,457,622.23 份；总份额合计 181,775,176.74 份。

6.2 利润表

会计主体：招商上证综合指数增强型发起式证券投资基金

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 16 日（基金合同生 效日）至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		10,447,112.47	1,225,864.67
1.利息收入		23,665.04	4,525.97
其中：存款利息收入	6.4.7.9	23,665.04	4,525.97
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）		10,951,629.64	644,941.76
其中：股票投资收益	6.4.7.10	9,018,936.74	500,616.02
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	4,699.56	481.26
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	423,429.42	-
股利收益	6.4.7.15	1,504,563.92	143,844.48
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	-630,932.37	575,898.56
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	102,750.16	498.38
减：二、营业总支出		604,499.14	48,156.66
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	418,630.59	40,754.96
其中：暂估管理人报酬		-	-
2.托管费	6.4.10.2.2	52,328.90	5,094.32
3.销售服务费	6.4.10.2.3	102,786.66	1,137.11
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		1,534.16	-
8.其他费用	6.4.7.19	29,218.83	1,170.27
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		9,842,613.33	1,177,708.01
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		9,842,613.33	1,177,708.01
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		9,842,613.33	1,177,708.01

6.3 净资产变动表

会计主体：招商上证综合指数增强型发起式证券投资基金

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	32,241,902.79	-	8,219,062.76	40,460,965.55
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	32,241,902.79	-	8,219,062.76	40,460,965.55
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	149,533,273.95	-	57,497,327.87	207,030,601.82
（一）、综合收益总额	-	-	9,842,613.33	9,842,613.33
（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）	149,533,273.95	-	47,654,714.54	197,187,988.49
其中：1.基金申购款	360,215,780.34	-	117,433,494.45	477,649,274.79
2.基金赎回款	-210,682,506.39	-	-69,778,779.91	-280,461,286.30
（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	181,775,176.74	-	65,716,390.63	247,491,567.37
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 16 日（基金合同生效日）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	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	10,016,387.39	-	-	10,016,387.39

产				
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	2,575,270.58	-	1,266,565.08	3,841,835.66
（一）、综合收益总额	-	-	1,177,708.01	1,177,708.01
（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）	2,575,270.58	-	88,857.07	2,664,127.65
其中：1.基金申购款	9,269,301.27	-	489,749.22	9,759,050.49
2.基金赎回款	-6,694,030.69	-	-400,892.15	-7,094,922.84
（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	12,591,657.97	-	1,266,565.08	13,858,223.05

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

招商上证综合指数增强型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）系由基金管理人招商基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《招商上证综合指数增强型发起式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]1422号《关于准予招商动力领航1年持有期混合型证券投资基金变更注册的批复》准予公开募集注册。本基金为契约型开放式，存续期限为不定期。募集期间为2025年1月9日至2025年1月14日，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币10,015,553.37元，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(25)第00013号验资报告。《招商上证综合指数增强型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）于2025年1月16日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为10,016,387.39份基金份额，其中认购资金利息折合834.02份

基金份额。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”）。

本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。收取认购、申购费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；不收取认购、申购费用，但从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算并公告基金份额净值。投资者可自行选择认购、申购的基金份额类别。本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及截至报告期末最新公告的《招商上证综合指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》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、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）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券（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）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款、通知存款及其他银行存款）、货币市场工具、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。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%，其中港股通标的股票投资比例不超过本基金股票资产的 50%；投资于标的指数成份券（含存托凭证，下同）及其备选成份券（含存托凭证，下同）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、股指期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，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及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股通标的股票或选择不将基金资产投资于港股通标的股票，基金资产并非必然投资港股通标的股票。本基金的业绩比较基准为：上证综合指数收益率 $\times$ 95%+中国人民银行人民币活期存款利率（税后） $\times$ 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[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[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[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]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》、国务院令第 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。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。

(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。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。

(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	27,555,246.91
等于：本金	27,552,872.94

加：应计利息	2,373.97
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	27,555,246.91

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		218,707,077.24	-	217,882,883.14	-824,194.10
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	600,096.00	7,191.97	607,361.97	74.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	600,096.00	7,191.97	607,361.97	74.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		219,307,173.24	7,191.97	218,490,245.11	-824,120.10

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	15,240,000.00	-	-	-
其中：股指期货投资	15,240,000.00	-	-	-

其他衍生工具	-	-	-	-
合计	15,240,000.00	-	-	-

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
IC2609	中证 500 期货 2609	5.00	8,761,400.00	629,480.00
IF2607	沪深 300 期货 2607	1.00	1,476,600.00	78,420.00
IF2609	沪深 300 期货 2609	4.00	5,819,760.00	109,860.00
合计				817,760.00
减：可抵销期货暂收款				817,760.00
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 2026 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	41,350.14
其中：交易所市场	41,350.14
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	27,411.58
合计	68,761.72

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

招商上证综合指数增强发起式 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	17,107,131.24	17,107,131.24
本期申购	47,963,834.53	47,963,834.53
本期赎回（以“-”号填列）	-24,753,411.26	-24,753,411.26
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	40,317,554.51	40,317,554.51

招商上证综合指数增强发起式 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	15,134,771.55	15,134,771.55
本期申购	312,251,945.81	312,251,945.81
本期赎回（以“-”号填列）	-185,929,095.13	-185,929,095.13
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	141,457,622.23	141,457,622.23

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

招商上证综合指数增强发起式 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,357,217.03	1,030,701.13	4,387,918.16
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	3,357,217.03	1,030,701.13	4,387,918.16
本期利润	3,773,333.93	-859,826.81	2,913,507.12
本期基金份额交易产生的变动数	6,319,818.35	1,131,203.59	7,451,021.94
其中：基金申购款	13,285,041.13	2,499,772.33	15,784,813.46
基金赎回款	-6,965,222.78	-1,368,568.74	-8,333,791.52
本期已分配利润	-	-	-
本期末	13,450,369.31	1,302,077.91	14,752,447.22

招商上证综合指数增强发起式 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,919,734.03	911,410.57	3,831,144.60
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-

本期期初	2,919,734.03	911,410.57	3,831,144.60
本期利润	6,700,211.77	228,894.44	6,929,106.21
本期基金份额交易产生的变动数	36,764,183.91	3,439,508.69	40,203,692.60
其中：基金申购款	88,971,541.23	12,677,139.76	101,648,680.99
基金赎回款	-52,207,357.32	-9,237,631.07	-61,444,988.39
本期已分配利润	-	-	-
本期末	46,384,129.71	4,579,813.70	50,963,943.41

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	16,348.08
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	7,161.69
其他	155.27
合计	23,665.04

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	9,018,936.74
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	9,018,936.74

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	212,963,445.74
减：卖出股票成本总额	203,739,295.51
减：交易费用	205,213.49
买卖股票差价收入	9,018,936.74

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	4,694.56
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	5.00
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	4,699.56

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	303,900.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	299,995.00
减：应计利息总额	3,900.00
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	5.00

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	423,429.42

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	1,504,563.92
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,504,563.92

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	-1,448,692.37
——股票投资	-1,448,520.37
——债券投资	-172.00
——资产支持证券投资	-

—— 贵金属投资	-
—— 其他	-
2.衍生工具	817,760.00
—— 权证投资	-
—— 期货投资	817,760.00
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	-630,932.37

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	102,750.16
合计	102,750.16

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	2,616.39
信息披露费	24,795.19
证券出借违约金	-
其他	1,807.25
合计	29,218.83

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

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 16 日(基金合同生效日) 至 2025 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
招商证券	-	-	4,644,430.80	17.34%

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	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	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2025 年 1 月 16 日(基金合同生效日) 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	464.29	17.35%	-	-

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证券交易费用管理规定》，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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 16 日(基金合同生效日)至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	418,630.59	40,754.96
其中:应支付销售机构的客户维护费	177,740.58	1,409.21
应支付基金管理人的净管理费	240,890.01	39,345.75

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×0.80%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:

$$\text{日基金管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

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 16 日(基金合同生效日)至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	52,328.90	5,094.32

注:支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值×0.10%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

6.4.10.2.3 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		
	招商上证综合指数增强发起式 A	招商上证综合指数增强发起式 C	合计
工商银行	-	865.25	865.25

招商基金管理有限公司	-	1,280.26	1,280.26
合计	-	2,145.51	2,145.51
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 16 日(基金合同生效日)至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	招商上证综合指数增强发起式 A	招商上证综合指数增强发起式 C	合计
工商银行	-	-	-
招商基金管理有限公司	-	21.43	21.43
合计	-	21.43	21.43

注：本基金的 C 类基金份额的年销售服务费率为 0.30%，逐日累计至每月月底，按月支付。
其计算公式为：

$$C \text{ 类份额日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金资产净值} \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

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

份额单位：份

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	招商上证综合指数增强发起式 A	招商上证综合指数增强发起式 C
基金合同生效日（2025 年 1 月 16 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,000,833.41	-

报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,000,833.41	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	24.81%	-

项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 16 日(基金合同生效日)至 2025 年 6 月 30 日	
	招商上证综合指数增强发起式 A	招商上证综合指数增强发起式 C
基金合同生效日（2025 年 1 月 16 日）持有的基金份额	10,000,833.41	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,000,833.41	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	97.18%	-

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 16 日（基金合同生效日）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
工商银行-活期	27,555,246.91	16,348.08	923,627.13	4,125.79

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保管，按银行约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.11 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
603293	埃泰克	2026 年 4 月 9 日	6 个月	新股流通受限	33.49	33.93	14	468.86	475.02	-
603407	长裕集团	2026 年 4 月 29 日	6 个月	新股流通受限	13.86	73.46	88	1,219.68	6,464.48	-
603435	嘉德利	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	15.76	46.71	61	961.36	2,849.31	-
688635	长进光子	2026 年 5 月 20 日	6 个月	新股流通受限	40.98	308.19	55	2,253.90	16,950.45	-
688797	臻宝科技	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通受限	44.56	468.67	58	2,584.48	27,182.86	-
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	35	2,865.80	55,451.55	-
688820	盛合晶微	2026 年 4 月 13 日	6 个月	新股流通受限	19.68	141.49	113	2,223.84	15,988.37	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

注：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

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

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金流动性风险来源于基金约定开放日兑付赎回资金的流动性风险，以及因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险以及因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。本基金所持有的金融资产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	27,555,246.91	-	-	-	27,555,246.91
结算备付金	2,855,331.00	-	-	-	2,855,331.00
存出保证金	38,304.13	-	-	1,926,931.20	1,965,235.33
交易性金融资产	607,361.97	-	-	217,882,883.14	218,490,245.11
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	-	-	-	5,392,790.28	5,392,790.28
应收清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	31,056,244.01	-	-	225,202,604.62	256,258,848.63
负债					
应付赎回款	-	-	-	8,482,426.44	8,482,426.44
应付管理人报酬	-	-	-	132,052.89	132,052.89
应付托管费	-	-	-	16,506.62	16,506.62
应付清算款	-	-	-	28,022.28	28,022.28
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	37,136.04	37,136.04
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	2,375.27	2,375.27
其他负债	-	-	-	68,761.72	68,761.72
负债总计	-	-	-	8,767,281.26	8,767,281.26
利率敏感度缺口	31,056,244.01	-	-	216,435,323.36	247,491,567.37
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	1,502,059.62	-	-	-	1,502,059.62
结算备付金	230,739.89	-	-	-	230,739.89
存出保证金	18,363.54	-	-	-	18,363.54
交易性金融资产	604,431.34	-	-	38,254,897.11	38,859,328.45
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	-	-	-	527,998.81	527,998.81
应收清算款	-	-	-	1,433,864.99	1,433,864.99
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	2,355,594.39	-	-	40,216,760.91	42,572,355.30
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,042,911.13	2,042,911.13
应付管理人报酬	-	-	-	33,678.98	33,678.98
应付托管费	-	-	-	4,209.85	4,209.85
应付清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	7,303.80	7,303.80
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	335.11	335.11
其他负债	-	-	-	22,950.88	22,950.88
负债总计	-	-	-	2,111,389.75	2,111,389.75
利率敏感度缺口	2,355,594.39	-	-	38,105,371.16	40,460,965.55

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	-317.65	-1,405.77
	2. 市场利率平行下降 50 个基点	318.57	1,411.01

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	217,882,883.14	88.04	38,254,897.11	94.55
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	217,882,883.14	88.04	38,254,897.11	94.55

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%	10,894,144.16	1,912,744.86
	2. 权益性投资的市场价格下降 5%	-10,894,144.16	-1,912,744.86

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	217,757,521.10	38,254,897.11

第二层次	607,361.97	604,431.34
第三层次	125,362.04	-
合计	218,490,245.11	38,859,328.45

6.4.14.2 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	217,882,883.14	85.02
	其中：股票	217,882,883.14	85.02
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	607,361.97	0.24
	其中：债券	607,361.97	0.24
	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	30,410,577.91	11.87
8	其他各项资产	7,358,025.61	2.87
9	合计	256,258,848.63	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	-	-
B	采矿业	12,526,207.00	5.06
C	制造业	98,247,442.22	39.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,313,823.00	1.34
E	建筑业	4,824,172.00	1.95
F	批发和零售业	2,186,030.00	0.88
G	交通运输、仓储和邮政业	4,041,403.00	1.63
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,479,494.77	4.64
J	金融业	37,149,425.00	15.01
K	房地产业	4,712,855.00	1.90
L	租赁和商务服务业	1,397,809.00	0.56
M	科学研究和技术服务业	1,005,165.00	0.41
N	水利、环境和公共设施管理业	1,772,732.00	0.72
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	983,808.00	0.40
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	183,640,365.99	74.20

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	1,058,504.00	0.43
C	制造业	25,887,579.15	10.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	650,292.00	0.26
E	建筑业	652,658.00	0.26
F	批发和零售业	640,976.00	0.26
G	交通运输、仓储和邮政业	119,130.00	0.05

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	892,550.00	0.36
J	金融业	2,633,582.00	1.06
K	房地产业	639,331.00	0.26
L	租赁和商务服务业	108,775.00	0.04
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	959,140.00	0.39
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	34,242,517.15	13.84

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	601288	农业银行	1,186,400	7,201,448.00	2.91
2	600519	贵州茅台	4,300	5,097,607.00	2.06
3	601138	工业富联	66,900	4,826,835.00	1.95
4	601857	中国石油	485,300	4,212,404.00	1.70
5	601988	中国银行	730,000	4,175,600.00	1.69
6	603986	兆易创新	4,300	3,504,500.00	1.42
7	601318	中国平安	72,700	3,470,698.00	1.40
8	600183	生益科技	17,800	3,086,520.00	1.25
9	601166	兴业银行	174,900	2,896,344.00	1.17
10	688041	海光信息	6,400	2,369,920.00	0.96
11	600919	江苏银行	213,500	2,301,530.00	0.93
12	601998	中信银行	301,500	2,089,395.00	0.84
13	688002	睿创微纳	13,264	2,051,808.16	0.83
14	688378	奥来德	29,205	1,810,710.00	0.73
15	688388	嘉元科技	40,653	1,788,732.00	0.72
16	601899	紫金矿业	69,000	1,734,660.00	0.70
17	601233	桐昆股份	77,600	1,680,040.00	0.68

18	605289	罗曼股份	10,520	1,525,400.00	0.62
19	603256	宏和科技	5,700	1,512,381.00	0.61
20	600000	浦发银行	167,400	1,441,314.00	0.58
21	601009	南京银行	144,500	1,429,105.00	0.58
22	600030	中信证券	47,300	1,358,929.00	0.55
23	600150	中国船舶	39,800	1,344,842.00	0.54
24	601328	交通银行	207,900	1,336,797.00	0.54
25	688498	源杰科技	690	1,301,340.00	0.53
26	601939	建设银行	133,500	1,285,605.00	0.52
27	603993	洛阳钼业	72,000	1,263,600.00	0.51
28	600487	亨通光电	11,300	1,235,542.00	0.50
29	600309	万华化学	17,700	1,210,857.00	0.49
30	601688	华泰证券	58,300	1,202,146.00	0.49
31	601088	中国神华	30,100	1,175,104.00	0.47
32	601211	国泰海通	64,100	1,166,620.00	0.47
33	603661	恒林股份	29,000	1,160,000.00	0.47
34	601869	长飞光纤	2,100	1,146,390.00	0.46
35	603379	三美股份	15,100	1,145,939.00	0.46
36	688582	芯动联科	17,600	1,144,000.00	0.46
37	600522	中天科技	18,500	1,122,580.00	0.45
38	600926	杭州银行	77,100	1,114,095.00	0.45
39	601838	成都银行	62,300	1,102,710.00	0.45
40	688525	佰维存储	2,200	1,088,406.00	0.44
41	688600	皖仪科技	32,603	1,085,027.84	0.44
42	603124	江南新材	5,800	1,084,484.00	0.44
43	688766	普冉股份	1,400	1,073,240.00	0.43
44	688369	致远互联	50,497	1,060,941.97	0.43
45	601186	中国铁建	178,100	1,059,695.00	0.43
46	688130	晶华微	37,147	1,044,573.64	0.42
47	688061	灿瑞科技	21,022	1,044,162.74	0.42
48	688521	芯原股份	2,800	1,039,192.00	0.42
49	688052	纳芯微	3,600	1,037,916.00	0.42
50	600741	华域汽车	66,400	1,030,528.00	0.42
51	600259	中稀有色	10,100	1,026,261.00	0.41
52	688700	东威科技	11,260	1,006,644.00	0.41
53	600027	华电国际	225,900	1,005,255.00	0.41
54	600166	福田汽车	341,900	994,929.00	0.40
55	601117	中国化学	134,700	990,045.00	0.40
56	603091	众鑫股份	20,300	990,031.00	0.40
57	601628	中国人寿	27,900	986,265.00	0.40
58	600064	南京高科	138,100	984,653.00	0.40
59	600455	博通股份	44,800	983,808.00	0.40
60	688217	睿昂基因	47,605	983,519.30	0.40

61	600716	凤凰股份	290,700	976,752.00	0.39
62	603365	水星家纺	62,400	971,568.00	0.39
63	688420	美腾科技	45,979	968,777.53	0.39
64	688528	秦川物联	105,933	968,227.62	0.39
65	688651	盛邦安全	29,991	966,310.02	0.39
66	603073	彩蝶实业	64,500	961,695.00	0.39
67	688310	迈得医疗	62,561	961,562.57	0.39
68	688681	科汇股份	68,770	961,404.60	0.39
69	688638	誉辰智能	30,791	959,755.47	0.39
70	688659	元琛科技	91,841	958,820.04	0.39
71	600448	华纺股份	380,100	957,852.00	0.39
72	603506	南都物业	102,500	957,350.00	0.39
73	603041	美思德	92,300	957,151.00	0.39
74	600533	栖霞建设	506,100	956,529.00	0.39
75	601886	江河集团	118,100	948,343.00	0.38
76	603326	我乐家居	153,900	948,024.00	0.38
77	603307	扬州金泉	40,525	946,258.75	0.38
78	688296	和达科技	82,647	945,481.68	0.38
79	688090	瑞松科技	8,840	941,018.00	0.38
80	600887	伊利股份	39,000	934,440.00	0.38
81	601872	招商轮船	53,000	931,210.00	0.38
82	603172	万丰股份	56,300	925,009.00	0.37
83	605117	德业股份	8,700	923,766.00	0.37
84	688267	中触媒	45,596	898,241.20	0.36
85	688110	东芯股份	4,400	896,280.00	0.36
86	600900	长江电力	33,600	889,392.00	0.36
87	600026	中远海能	49,400	886,236.00	0.36
88	601061	中信金属	82,000	883,140.00	0.36
89	600601	方正科技	62,700	867,768.00	0.35
90	600015	华夏银行	133,200	851,148.00	0.34
91	603799	华友钴业	17,600	849,376.00	0.34
92	688111	金山办公	3,928	836,860.40	0.34
93	688519	南亚新材	2,186	830,767.44	0.34
94	688372	伟测科技	4,400	818,400.00	0.33
95	600489	中金黄金	45,200	815,860.00	0.33
96	603659	璞泰来	28,000	810,040.00	0.33
97	688536	思瑞浦	2,214	806,095.26	0.33
98	688127	蓝特光学	8,221	802,369.60	0.32
99	601658	邮储银行	162,400	800,632.00	0.32
100	688630	芯碁微装	1,452	797,714.28	0.32
101	688559	海目星	9,400	788,848.00	0.32
102	600137	浪莎股份	48,500	787,155.00	0.32
103	688396	华润微	7,800	760,890.00	0.31

104	688257	新锐股份	7,400	754,060.00	0.30
105	688308	欧科亿	4,096	744,693.76	0.30
106	688155	先惠技术	9,200	744,188.00	0.30
107	688778	厦钨新能	13,663	743,267.20	0.30
108	688297	中无人机	17,768	738,260.40	0.30
109	688648	中邮科技	19,889	726,942.95	0.29
110	600109	国金证券	82,300	722,594.00	0.29
111	688045	必易微	8,927	721,123.06	0.29
112	601021	春秋航空	15,800	720,164.00	0.29
113	688059	华锐精密	3,600	718,956.00	0.29
114	600515	海南机场	262,000	717,880.00	0.29
115	688275	万润新能	5,600	714,280.00	0.29
116	600536	中国软件	25,400	714,248.00	0.29
117	688779	五矿新能	88,000	713,680.00	0.29
118	603588	高能环境	37,100	712,320.00	0.29
119	600685	中船防务	27,600	702,144.00	0.28
120	603196	璞源材料	28,700	701,428.00	0.28
121	600595	中孚实业	123,600	694,632.00	0.28
122	600028	中国石化	155,700	694,422.00	0.28
123	603737	三棵树	28,600	689,260.00	0.28
124	603225	新凤鸣	34,900	685,785.00	0.28
125	688321	微芯生物	25,953	683,342.49	0.28
126	600775	南京熊猫	71,200	680,672.00	0.28
127	600751	海航科技	233,700	680,067.00	0.27
128	603606	东方电缆	16,360	679,103.60	0.27
129	601069	西部黄金	30,800	677,600.00	0.27
130	600787	中储股份	160,900	672,562.00	0.27
131	600815	厦工股份	261,600	672,312.00	0.27
132	603826	坤彩科技	26,300	672,228.00	0.27
133	688717	艾罗能源	8,091	668,073.87	0.27
134	600395	盘江股份	146,100	666,216.00	0.27
135	688156	路德科技	22,000	665,500.00	0.27
136	603507	振江股份	20,200	664,378.00	0.27
137	601218	吉鑫科技	154,300	663,490.00	0.27
138	688087	英科再生	19,852	663,453.84	0.27
139	603615	茶花股份	41,000	662,150.00	0.27
140	600148	长春一东	45,500	660,205.00	0.27
141	600755	厦门国贸	121,600	659,072.00	0.27
142	605599	菜百股份	48,000	657,600.00	0.27
143	603759	海天股份	95,100	654,288.00	0.26
144	688737	中自科技	34,073	652,157.22	0.26
145	603719	良品铺子	74,600	645,290.00	0.26
146	600882	妙可蓝多	40,200	642,798.00	0.26

147	600801	华新建材	41,200	642,720.00	0.26
148	600191	华资实业	69,700	634,270.00	0.26
149	603317	天味食品	39,700	516,497.00	0.21
150	601888	中国中免	8,900	478,019.00	0.19
151	688097	博众精工	7,000	441,350.00	0.18
152	600292	电投水电	32,800	394,912.00	0.16
153	600157	永泰能源	228,300	367,563.00	0.15
154	688329	艾隆科技	17,878	361,314.38	0.15
155	688597	煜邦电力	52,000	338,000.00	0.14
156	688256	寒武纪	200	319,110.00	0.13
157	603030	全筑股份	151,100	300,689.00	0.12
158	600549	厦门钨业	2,700	230,040.00	0.09
159	601788	光大证券	15,000	216,450.00	0.09
160	603259	药明康德	1,500	186,765.00	0.08
161	601728	中国电信	35,100	182,169.00	0.07
162	601698	中国卫通	5,300	160,325.00	0.06
163	688032	禾迈股份	1,841	155,601.32	0.06
164	600025	华能水电	17,400	154,686.00	0.06
165	600879	航天电子	7,200	153,288.00	0.06
166	688008	澜起科技	493	152,780.70	0.06
167	601919	中远海控	11,400	151,164.00	0.06
168	688213	思特威	1,400	149,898.00	0.06
169	688668	鼎通科技	400	149,320.00	0.06
170	600113	浙江东日	4,500	149,310.00	0.06
171	600989	宝丰能源	7,300	148,409.00	0.06
172	688209	英集芯	5,000	145,400.00	0.06
173	600019	宝钢股份	26,700	144,981.00	0.06
174	688099	晶晨股份	1,400	144,060.00	0.06
175	688568	中科星图	3,400	140,998.00	0.06
176	600875	东方电气	4,900	140,973.00	0.06
177	600938	中国海油	5,100	138,465.00	0.06
178	688516	奥特维	2,400	137,736.00	0.06
179	603125	常青科技	4,200	137,508.00	0.06
180	603063	禾望电气	2,500	132,225.00	0.05
181	688125	安达智能	800	130,800.00	0.05
182	600362	江西铜业	3,000	129,900.00	0.05
183	600105	永鼎股份	1,900	128,212.00	0.05
184	603083	剑桥科技	500	127,435.00	0.05
185	601106	中国一重	38,600	127,380.00	0.05
186	600418	江淮汽车	4,900	126,567.00	0.05
187	601606	长城军工	4,600	126,454.00	0.05
188	600219	南山铝业	31,600	126,084.00	0.05
189	601212	白银有色	24,800	125,984.00	0.05

190	600578	京能电力	19,500	125,775.00	0.05
191	603016	新宏泰	3,700	124,912.00	0.05
192	603538	美诺华	3,800	123,690.00	0.05
193	605299	舒华体育	9,200	122,820.00	0.05
194	688141	杰华特	800	122,800.00	0.05
195	600722	金牛化工	15,000	121,800.00	0.05
196	603619	中曼石油	6,500	121,615.00	0.05
197	603216	梦天家居	5,900	121,363.00	0.05
198	688253	英诺特	2,000	120,560.00	0.05
199	600773	西藏城投	9,300	119,691.00	0.05
200	600714	金瑞矿业	5,700	117,021.00	0.05
201	600903	贵州燃气	17,600	116,864.00	0.05
202	603355	莱克电气	4,400	116,072.00	0.05
203	688800	瑞可达	1,200	115,164.00	0.05
204	688182	灿勤科技	2,672	115,083.04	0.05
205	600299	安迪苏	14,600	114,610.00	0.05
206	605168	三人行	2,200	111,408.00	0.05
207	600031	三一重工	2,600	44,928.00	0.02
208	688262	国芯科技	1,000	43,230.00	0.02
209	688529	豪森智能	1,405	22,100.65	0.01
210	688671	碧兴物联	120	4,268.40	0.00
211	688012	中微公司	8	3,748.00	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	300408	三环集团	7,000	1,168,300.00	0.47
2	300373	扬杰科技	7,400	1,163,502.00	0.47
3	920489	佳先股份	53,740	1,122,091.20	0.45
4	000776	广发证券	44,100	1,031,940.00	0.42
5	002415	海康威视	29,700	1,015,740.00	0.41
6	000651	格力电器	26,800	1,005,000.00	0.41
7	000333	美的集团	13,000	981,890.00	0.40
8	300886	华业香料	48,900	973,110.00	0.39
9	301519	舜禹股份	88,400	959,140.00	0.39
10	000657	中钨高新	10,000	957,200.00	0.39
11	000157	中联重科	137,300	956,981.00	0.39
12	301037	保立佳	79,600	955,200.00	0.39
13	301086	鸿富瀚	4,560	954,316.80	0.39
14	002948	青岛银行	184,900	939,292.00	0.38

15	000630	铜陵有色	144,500	919,020.00	0.37
16	920976	视声智能	56,046	901,219.68	0.36
17	300857	协创数据	2,400	815,760.00	0.33
18	000589	贵州轮胎	179,000	726,740.00	0.29
19	002384	东山精密	2,700	708,345.00	0.29
20	000519	中兵红箭	33,100	697,417.00	0.28
21	000688	国城矿业	20,300	694,869.00	0.28
22	002975	博杰股份	4,800	681,600.00	0.28
23	002414	高德红外	50,700	672,282.00	0.27
24	300750	宁德时代	1,700	668,117.00	0.27
25	300059	东方财富	32,500	662,350.00	0.27
26	300432	富临精工	32,900	660,961.00	0.27
27	001309	德明利	700	660,030.00	0.27
28	300490	华自科技	49,800	658,854.00	0.27
29	002028	思源电气	3,800	657,400.00	0.27
30	002558	巨人网络	23,800	655,928.00	0.27
31	002487	大金重工	11,300	655,061.00	0.26
32	002482	广田集团	553,100	652,658.00	0.26
33	000408	藏格矿业	9,400	651,608.00	0.26
34	000958	电投产融	115,300	650,292.00	0.26
35	000905	厦门港务	82,600	640,976.00	0.26
36	000036	华联控股	146,300	639,331.00	0.26
37	300308	中际旭创	500	635,000.00	0.26
38	003022	联泓新科	21,700	562,030.00	0.23
39	300953	震裕科技	3,200	427,840.00	0.17
40	688797	臻宝科技	571	381,209.29	0.15
41	002001	新和成	8,600	244,412.00	0.10
42	920876	慧为智能	13,500	229,500.00	0.09
43	002342	巨力索具	13,100	137,681.00	0.06
44	002643	万润股份	6,500	136,175.00	0.06
45	002506	协鑫集成	40,800	129,744.00	0.05
46	000603	盛达资源	5,400	124,740.00	0.05
47	000890	法尔胜	15,200	122,512.00	0.05
48	300164	通源石油	15,000	120,000.00	0.05
49	002320	海峡股份	19,000	119,130.00	0.05
50	300191	潜能恒信	4,300	118,895.00	0.05
51	002195	岩山科技	18,100	118,374.00	0.05
52	300959	线上线下	800	118,248.00	0.05
53	002379	宏桥控股	7,900	116,683.00	0.05
54	002455	百川股份	16,200	116,640.00	0.05
55	300596	利安隆	2,200	115,456.00	0.05
56	301511	德福科技	800	115,080.00	0.05
57	300903	科翔股份	1,100	111,441.00	0.05

58	301377	鼎泰高科	200	110,180.00	0.04
59	002131	利欧股份	22,900	108,775.00	0.04
60	300073	当升科技	1,900	91,276.00	0.04
61	688808	联讯仪器	35	55,451.55	0.02
62	300749	顶固集创	700	18,795.00	0.01
63	688635	长进光子	55	16,950.45	0.01
64	688820	盛合晶微	113	15,988.37	0.01
65	603407	长裕集团	88	6,464.48	0.00
66	603435	嘉德利	61	2,849.31	0.00
67	603293	埃泰克	14	475.02	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	601288	农业银行	8,337,710.00	20.61
2	601857	中国石油	7,094,460.00	17.53
3	601138	工业富联	5,288,538.92	13.07
4	600519	贵州茅台	5,259,894.00	13.00
5	601988	中国银行	4,384,449.00	10.84
6	601318	中国平安	4,161,852.00	10.29
7	601899	紫金矿业	3,479,982.00	8.60
8	600183	生益科技	3,113,172.00	7.69
9	601998	中信银行	3,074,257.00	7.60
10	601166	兴业银行	3,062,113.00	7.57
11	601088	中国神华	2,829,551.00	6.99
12	603986	兆易创新	2,539,746.65	6.28
13	601009	南京银行	2,451,050.00	6.06
14	688002	睿创微纳	2,444,013.14	6.04
15	600000	浦发银行	2,402,307.00	5.94
16	601939	建设银行	2,307,986.00	5.70
17	600919	江苏银行	2,270,572.00	5.61
18	600011	华能国际	2,213,187.00	5.47
19	601233	桐昆股份	2,115,670.00	5.23
20	688041	海光信息	1,919,180.00	4.74
21	600028	中国石化	1,915,496.00	4.73
22	603225	新凤鸣	1,846,738.00	4.56
23	600926	杭州银行	1,820,636.00	4.50
24	688127	蓝特光学	1,807,058.83	4.47
25	601628	中国人寿	1,783,674.00	4.41
26	600795	国电电力	1,773,948.00	4.38

27	688378	奥来德	1,749,494.01	4.32
28	600309	万华化学	1,739,019.00	4.30
29	600019	宝钢股份	1,716,064.00	4.24
30	688388	嘉元科技	1,710,138.81	4.23
31	000333	美的集团	1,706,471.00	4.22
32	600027	华电国际	1,699,893.00	4.20
33	002948	青岛银行	1,689,054.00	4.17
34	603259	药明康德	1,620,417.00	4.00
35	688310	迈得医疗	1,597,817.18	3.95
36	603818	曲美家居	1,509,401.00	3.73
37	600026	中远海能	1,508,929.58	3.73
38	603588	高能环境	1,456,871.00	3.60
39	600166	福田汽车	1,456,736.00	3.60
40	688638	誉辰智能	1,441,709.88	3.56
41	601186	中国铁建	1,427,926.00	3.53
42	688786	悦安新材	1,424,572.31	3.52
43	603993	洛阳钼业	1,382,107.00	3.42
44	600900	长江电力	1,375,081.00	3.40
45	605289	罗曼股份	1,359,217.60	3.36
46	688700	东威科技	1,357,396.05	3.35
47	688052	纳芯微	1,340,723.96	3.31
48	000589	贵州轮胎	1,331,166.00	3.29
49	600030	中信证券	1,330,183.00	3.29
50	601328	交通银行	1,317,888.00	3.26
51	002475	立讯精密	1,314,883.00	3.25
52	600690	海尔智家	1,313,383.00	3.25
53	688156	路德科技	1,305,244.84	3.23
54	600533	栖霞建设	1,290,915.00	3.19
55	603379	三美股份	1,289,255.00	3.19
56	600150	中国船舶	1,286,178.00	3.18
57	600448	华纺股份	1,262,148.00	3.12
58	301519	舜禹股份	1,260,907.00	3.12
59	600716	凤凰股份	1,257,932.00	3.11
60	601588	北辰实业	1,257,040.00	3.11
61	603172	万丰股份	1,254,604.00	3.10
62	603326	我乐家居	1,254,518.00	3.10
63	600489	中金黄金	1,252,840.00	3.10
64	600887	伊利股份	1,244,622.00	3.08
65	600031	三一重工	1,235,551.00	3.05
66	688217	睿昂基因	1,234,416.42	3.05
67	603799	华友钴业	1,229,385.00	3.04
68	603663	三祥新材	1,227,147.00	3.03
69	688090	瑞松科技	1,217,015.97	3.01

70	603365	水星家纺	1,216,879.00	3.01
71	601688	华泰证券	1,200,397.00	2.97
72	300408	三环集团	1,198,607.00	2.96
73	301037	保立佳	1,196,365.00	2.96
74	688681	科汇股份	1,194,737.59	2.95
75	603661	恒林股份	1,192,797.00	2.95
76	603506	南都物业	1,190,520.00	2.94
77	600487	亨通光电	1,187,272.00	2.93
78	688111	金山办公	1,182,284.95	2.92
79	600455	博通股份	1,181,673.00	2.92
80	688296	和达科技	1,166,685.58	2.88
81	688528	秦川物联	1,164,633.75	2.88
82	603091	众鑫股份	1,153,547.00	2.85
83	603073	彩蝶实业	1,152,245.00	2.85
84	688369	致远互联	1,150,623.36	2.84
85	920770	艾能聚	1,148,915.79	2.84
86	002484	江海股份	1,141,798.00	2.82
87	688420	美腾科技	1,140,025.01	2.82
88	688671	碧兴物联	1,133,354.23	2.80
89	601886	江河集团	1,122,935.70	2.78
90	301320	豪江智能	1,120,599.00	2.77
91	603124	江南新材	1,120,468.00	2.77
92	601211	国泰海通	1,118,759.00	2.77
93	603041	美思德	1,118,702.00	2.76
94	601838	成都银行	1,116,520.00	2.76
95	600741	华域汽车	1,107,660.00	2.74
96	688600	皖仪科技	1,103,865.95	2.73
97	603307	扬州金泉	1,100,632.50	2.72
98	688651	盛邦安全	1,098,866.65	2.72
99	300308	中际旭创	1,096,890.00	2.71
100	601117	中国化学	1,091,383.00	2.70
101	600418	江淮汽车	1,088,504.00	2.69
102	688267	中触媒	1,085,102.71	2.68
103	688521	芯原股份	1,082,884.00	2.68
104	000157	中联重科	1,082,002.00	2.67
105	920357	雅葆轩	1,077,546.51	2.66
106	603031	安孚科技	1,072,275.00	2.65
107	600064	南京高科	1,067,056.00	2.64
108	601717	中创智领	1,067,011.00	2.64
109	000408	藏格矿业	1,064,620.00	2.63
110	600522	中天科技	1,060,962.00	2.62
111	600395	盘江股份	1,060,088.00	2.62
112	600137	浪莎股份	1,057,886.00	2.61

113	600259	中稀有色	1,057,819.00	2.61
114	688659	元琛科技	1,056,966.95	2.61
115	688110	东芯股份	1,054,320.00	2.61
116	688271	联影医疗	1,050,414.33	2.60
117	688450	光格科技	1,038,833.01	2.57
118	600039	四川路桥	1,029,678.00	2.54
119	605080	浙江自然	1,026,946.00	2.54
120	000651	格力电器	1,021,920.00	2.53
121	688766	普冉股份	1,021,584.00	2.52
122	300886	华业香料	1,018,142.00	2.52
123	601061	中信金属	1,015,922.00	2.51
124	688582	芯动联科	1,014,806.02	2.51
125	920976	视声智能	1,012,508.16	2.50
126	000776	广发证券	1,009,696.00	2.50
127	000630	铜陵有色	1,003,751.00	2.48
128	000657	中钨高新	1,001,816.00	2.48
129	002415	海康威视	1,000,542.00	2.47
130	600496	精工钢构	998,909.00	2.47
131	688130	晶华微	998,644.96	2.47
132	603256	宏和科技	997,015.00	2.46
133	600362	江西铜业	994,313.00	2.46
134	300373	扬杰科技	981,221.19	2.43
135	920489	佳先股份	978,072.79	2.42
136	002645	华宏科技	973,915.00	2.41
137	688061	灿瑞科技	965,935.94	2.39
138	301086	鸿富瀚	957,402.00	2.37
139	603606	东方电缆	957,217.00	2.37
140	605117	德业股份	957,190.00	2.37
141	600512	腾达建设	956,123.00	2.36
142	600536	中国软件	943,565.00	2.33
143	600801	华新建材	938,414.00	2.32
144	603737	三棵树	924,314.00	2.28
145	688778	厦钨新能	920,947.16	2.28
146	601336	新华保险	917,039.00	2.27
147	600595	中孚实业	886,923.00	2.19
148	601225	陕西煤业	878,292.00	2.17
149	301626	苏州天脉	873,142.00	2.16
150	601869	长飞光纤	868,551.00	2.15
151	600015	华夏银行	867,664.00	2.14
152	601872	招商轮船	866,085.00	2.14
153	688525	佰维存储	858,613.79	2.12
154	688779	五矿新能	855,432.89	2.11
155	603929	亚翔集成	853,147.00	2.11

156	605599	菜百股份	847,630.00	2.09
157	601577	长沙银行	838,234.00	2.07
158	600282	南钢股份	833,966.00	2.06
159	688297	中无人机	831,347.59	2.05
160	601021	春秋航空	825,792.00	2.04
161	603826	坤彩科技	819,223.00	2.02
162	601069	西部黄金	815,900.00	2.02
163	600601	方正科技	811,956.00	2.01
164	600515	海南机场	809,412.00	2.00

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	601857	中国石油	2,890,642.00	7.14
2	600011	华能国际	2,428,167.00	6.00
3	603259	药明康德	2,045,668.00	5.06
4	688786	悦安新材	1,903,337.03	4.70
5	601138	工业富联	1,889,488.00	4.67
6	601288	农业银行	1,874,252.00	4.63
7	600795	国电电力	1,872,958.00	4.63
8	603663	三祥新材	1,851,658.00	4.58
9	002484	江海股份	1,825,910.00	4.51
10	601899	紫金矿业	1,753,853.00	4.33
11	002475	立讯精密	1,674,308.00	4.14
12	601088	中国神华	1,588,098.00	3.93
13	688671	碧兴物联	1,494,299.36	3.69
14	600019	宝钢股份	1,443,509.00	3.57
15	603225	新凤鸣	1,427,924.00	3.53
16	603818	曲美家居	1,414,114.00	3.50
17	600031	三一重工	1,358,461.00	3.36
18	600578	京能电力	1,320,768.00	3.26
19	603929	亚翔集成	1,290,747.00	3.19
20	600183	生益科技	1,284,954.00	3.18
21	603588	高能环境	1,240,049.20	3.06
22	688450	光格科技	1,234,073.42	3.05
23	920357	雅葆轩	1,231,464.72	3.04
24	688127	蓝特光学	1,214,345.59	3.00

25	600028	中国石化	1,187,632.00	2.94
26	601588	北辰实业	1,184,831.00	2.93
27	601628	中国人寿	1,169,574.60	2.89
28	600690	海尔智家	1,153,680.00	2.85
29	601939	建设银行	1,139,673.00	2.82
30	601336	新华保险	1,125,881.00	2.78
31	688271	联影医疗	1,118,810.38	2.77
32	002645	华宏科技	1,102,356.00	2.72
33	601009	南京银行	1,075,622.00	2.66
34	603031	安孚科技	1,073,678.00	2.65
35	688531	日联科技	1,053,993.59	2.60
36	603986	兆易创新	1,053,774.00	2.60
37	920770	艾能聚	1,051,841.05	2.60
38	600000	浦发银行	1,045,356.00	2.58
39	601988	中国银行	1,042,549.00	2.58
40	301320	豪江智能	1,006,915.00	2.49
41	688182	灿勤科技	1,000,056.05	2.47
42	600496	精工钢构	988,437.00	2.44
43	301626	苏州天脉	985,247.00	2.44
44	002008	大族激光	982,132.00	2.43
45	601229	上海银行	980,657.00	2.42
46	601717	中创智领	958,877.00	2.37
47	600039	四川路桥	931,879.00	2.30
48	601998	中信银行	926,283.00	2.29
49	603444	吉比特	920,500.00	2.28
50	603186	华正新材	917,663.00	2.27
51	300502	新易盛	911,893.00	2.25
52	605080	浙江自然	908,788.00	2.25
53	600512	腾达建设	898,615.00	2.22
54	301536	星宸科技	898,584.00	2.22
55	600378	昊华科技	887,572.00	2.19
56	605098	行动教育	877,558.00	2.17
57	601225	陕西煤业	872,034.00	2.16
58	601577	长沙银行	867,967.00	2.15
59	000333	美的集团	867,545.00	2.14
60	601020	华钰矿业	862,098.00	2.13
61	688202	美迪西	853,676.46	2.11
62	300308	中际旭创	851,382.00	2.10
63	688156	路德科技	850,795.85	2.10
64	600507	方大特钢	833,360.00	2.06
65	688002	睿创微纳	832,785.97	2.06
66	600362	江西铜业	822,989.00	2.03
67	301372	科净源	819,882.00	2.03

68	600282	南钢股份	813,425.00	2.01
69	600704	物产中大	811,770.00	2.01

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	384,815,801.91
卖出股票收入（成交）总额	212,963,445.74

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	607,361.97	0.25
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	607,361.97	0.25

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	019785	25 国债 13	5,000	506,312.74	0.20
2	019792	25 国债 19	1,000	101,049.23	0.04

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国农业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局、国家税务总局北京市海淀区税务局第二税务所的处罚。中国银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。

本基金对上述主体所发行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。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或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	1,965,235.33
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	5,392,790.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,358,025.61

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
招商上证	5,502	7,327.80	10,000,833.41	24.81%	30,316,721.10	75.19%

综合指数增强发起式 A						
招商上证综合指数增强发起式 C	12,513	11,304.85	6,555,645.46	4.63%	134,901,976.77	95.37%
合计	18,015	10,090.21	16,556,478.87	9.11%	165,218,697.87	90.89%

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	招商上证综合指数增强发起式 A	-	-
	招商上证综合指数增强发起式 C	-	-
	合计	-	-

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	招商上证综合指数增强发起式 A	0
	招商上证综合指数增强发起式 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	招商上证综合指数增强发起式 A	0
	招商上证综合指数增强发起式 C	0
	合计	0

8.4 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占	发起份额总数	发起份额占	发起份额承
----	--------	-------	--------	-------	-------

		基金总份额 比例（%）		基金总份额 比例（%）	诺持有期限
基金管理人 固有资金	10,000,833.41	5.50	10,000,833.41	5.50	3 年
基金管理人 高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等 人员	-	-	-	-	-
基金管理人 股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,833.41	5.50	10,000,833.41	5.50	-

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	招商上证综合指数增强发起 式 A	招商上证综合指数增强发起 式 C
基金合同生效日(2025 年 1 月 16 日) 基金份额总额	10,012,860.31	3,527.08
本报告期期初基金份额总额	17,107,131.24	15,134,771.55
本报告期基金总申购份额	47,963,834.53	312,251,945.81
减：本报告期基金总赎回份额	24,753,411.26	185,929,095.13
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	40,317,554.51	141,457,622.23

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，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、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

报告期内，本基金托管人的基金托管业务部门无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

报告期内，本基金托管人相关从业人员无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	
华泰证券	2	320,857,734.67	53.69%	32,054.53	53.79%	-
中信证券	2	171,439,615.26	28.69%	17,012.31	28.55%	-
广发证券	2	61,769,422.00	10.34%	6,171.07	10.36%	-
国投证券	1	35,211,272.80	5.89%	3,517.63	5.90%	-
兴业证券	1	8,376,425.00	1.40%	837.02	1.40%	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
财信证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	本报告 期减少 2 个
东方证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-

东海证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	3	-	-	-	-	本报告 期新增
申万宏源	2	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
野村东方	1	-	-	-	-	-
招商证券	5	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中金财富 证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	3	-	-	-	-	-
中信建投 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	成交金额	占当期权证成交总额的比例

				比例		
华泰证券	300,197.00	100.00%	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
财信证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
野村东方	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中金财富 证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投 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	招商上证综合指数增强型发起式证券投资基金（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	2026-01-15

		露网站	
2	招商上证综合指数增强型发起式证券投资基金（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	2026-01-15
3	招商上证综合指数增强型发起式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	2026-01-15
4	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	证券日报及基金管理人网站	2026-01-21
5	招商上证综合指数增强型发起式证券投资基金 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
6	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	证券日报及基金管理人网站	2026-03-31
7	招商上证综合指数增强型发起式证券投资基金 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
8	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	证券日报及基金管理人网站	2026-04-22
9	招商上证综合指数增强型发起式证券投资基金 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
10	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	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-05-14

§ 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
机构	1	20260101-20260225	10,000,833.41	-	-	10,000,833.41	5.50%
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上证综合指数增强型发起式证券投资基金设立的文件；
- 3、《招商上证综合指数增强型发起式证券投资基金基金合同》；
- 4、《招商上证综合指数增强型发起式证券投资基金托管协议》；
- 5、《招商上证综合指数增强型发起式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