

招商中证 A500 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	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	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	39
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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	54
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	54
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	54
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	54
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	54
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	54

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55
7.12 投资组合报告附注	55
§8 基金份额持有人信息	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	56
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	57
8.4 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况	57
§9 开放式基金份额变动	57
§10 重大事件揭示	58
10.1 基金份额持有人大会决议	58
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	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
10.4 基金投资策略的改变	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	58
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	58
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	59
10.8 其他重大事件	59
§11 备查文件目录	60
11.1 备查文件目录	60
11.2 存放地点	60
11.3 查阅方式	60

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	招商中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金	
基金简称	招商中证 A500 指数增强发起式	
基金主代码	022670	
交易代码	022670	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2024 年 12 月 24 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	224,264,676.95 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 A500 指数增强发起式 A	招商中证 A500 指数增强发起式 C
下属分级基金的交易代码	022670	022671
报告期末下属分级基金的份额总额	135,198,369.06 份	89,066,307.89 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	中证 A500 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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	潘西里
	联系电话	0755-83196666
	电子邮箱	cmf@cmfchina.com
客户服务电话	400-887-9555	95566
传真	0755-83196475	010-66594942
注册地址	深圳市福田区深南大道 7088 号	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址	深圳市福田区深南大道 7088 号	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	518040	100818
法定代表人	王颖	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	证券时报
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、招商中证 A500 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	24,822,795.96
本期利润	10,894,540.93
加权平均基金份额本期利润	0.0671
本期加权平均净值利润率	5.08%
本期基金份额净值增长率	5.27%
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	44,631,117.82
期末可供分配基金份额利润	0.3301
期末基金资产净值	179,829,486.88
期末基金份额净值	1.3301
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	33.01%

2、招商中证 A500 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	15,475,430.12
本期利润	5,792,432.65
加权平均基金份额本期利润	0.0564
本期加权平均净值利润率	4.28%
本期基金份额净值增长率	5.12%
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	28,863,977.98
期末可供分配基金份额利润	0.3241
期末基金资产净值	117,930,285.87
期末基金份额净值	1.3241
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	32.41%

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 A500 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	6.49%	1.23%	13.54%	1.34%	-7.05%	-0.11%
过去六个月	5.27%	1.20%	11.34%	1.22%	-6.07%	-0.02%
过去一年	26.65%	1.04%	34.41%	1.09%	-7.76%	-0.05%
自基金合同 生效起至今	33.01%	1.01%	34.59%	1.07%	-1.58%	-0.06%

招商中证 A500 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	6.42%	1.23%	13.54%	1.34%	-7.12%	-0.11%
过去六个月	5.12%	1.20%	11.34%	1.22%	-6.22%	-0.02%
过去一年	26.29%	1.04%	34.41%	1.09%	-8.12%	-0.05%
自基金合同 生效起至今	32.41%	1.01%	34.59%	1.07%	-2.18%	-0.06%

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



招商中证A500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



§ 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 4 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 A500 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 5.27%，同期业绩基准增长率为 11.34%，C 类份额净值增长率为 5.12%，同期业绩基准增长率为 11.34%。

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 A500 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	18,280,603.57	21,198,036.92
结算备付金		2,437,795.24	3,628,409.81
存出保证金		420,547.20	536,774.40
交易性金融资产	6.4.7.2	276,758,438.91	300,440,718.35
其中：股票投资		276,758,438.91	300,440,718.35
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		774,067.69	1,364,046.34
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		298,671,452.61	327,167,985.82
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		-	-
应付赎回款		581,071.47	4,374,007.97
应付管理人报酬		200,184.99	220,232.03
应付托管费		25,023.13	27,528.99
应付销售服务费		28,629.40	30,858.12
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	5,826.95
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	76,770.87	38,184.00
负债合计		911,679.86	4,696,638.06
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	224,264,676.95	255,525,397.23
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	73,495,095.80	66,945,950.53
净资产合计		297,759,772.75	322,471,347.76
负债和净资产总计		298,671,452.61	327,167,985.82

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，招商中证 A500 指数增强发起式 A 份额净值 1.3301 元，基金份额总额 135,198,369.06 份；招商中证 A500 指数增强发起式 C 份额净值 1.3241 元，基金份额总额 89,066,307.89 份；总份额合计 224,264,676.95 份。

6.2 利润表

会计主体：招商中证 A500 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 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		18,527,491.87	41,557,738.12
1.利息收入		49,400.87	380,053.32
其中：存款利息收入	6.4.7.9	49,400.87	356,822.18
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	23,231.14
其他利息收入		-	-

2.投资收益（损失以“-”填列）		42,064,025.41	27,714,349.95
其中：股票投资收益	6.4.7.10	38,655,433.09	18,264,532.92
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-
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	589,497.31	-
股利收益	6.4.7.15	2,819,095.01	9,449,817.03
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	-23,611,252.50	13,442,199.25
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	25,318.09	21,135.60
减：二、营业总支出		1,840,518.29	3,989,381.69
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	1,390,882.99	3,173,918.40
其中：暂估管理人报酬		-	-
2.托管费	6.4.10.2.2	173,860.45	396,739.81
3.销售服务费	6.4.10.2.3	201,418.85	329,849.44
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		2,602.60	-
8.其他费用	6.4.7.19	71,753.40	88,874.04
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		16,686,973.58	37,568,356.43
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		16,686,973.58	37,568,356.43
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		16,686,973.58	37,568,356.43

6.3 净资产变动表

会计主体：招商中证 A500 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	255,525,397.23	-	66,945,950.53	322,471,347.76
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	255,525,397.23	-	66,945,950.53	322,471,347.76
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-31,260,720.28	-	6,549,145.27	-24,711,575.01
（一）、综合收益总额	-	-	16,686,973.58	16,686,973.58
（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）	-31,260,720.28	-	-10,137,828.31	-41,398,548.59
其中：1.基金申购款	187,859,193.56	-	60,885,631.11	248,744,824.67
2.基金赎回款	-219,119,913.84	-	-71,023,459.42	-290,143,373.26
（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	224,264,676.95	-	73,495,095.80	297,759,772.75
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	1,206,953,876.77	-	-2,120,908.15	1,204,832,968.62
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,206,953,876.77	-	-2,120,908.15	1,204,832,968.62

三、本期增减变动 额（减少以“-”号 填列）	-535,120,618.82	-	35,663,349.92	-499,457,268.90
（一）、综合收益总 额	-	-	37,568,356.43	37,568,356.43
（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）	-535,120,618.82	-	-1,905,006.51	-537,025,625.33
其中：1.基金申购款	659,149,225.65	-	23,420,336.93	682,569,562.58
2.基金赎回 款	-1,194,269,844.47	-	-25,325,343.44	-1,219,595,187.91
（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	671,833,257.95	-	33,542,441.77	705,375,699.72

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

____ 钟文岳 ____ 欧志明 ____ 何剑萍 ____
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

招商中证 A500 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》、《招商中证 A500 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]1593 号《关于准予招商中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金注册的批复》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 2024 年 12 月 2 日至 2024 年 12 月 20 日，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,206,140,342.16 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(24)第 00260 号验资报告。《招商中证 A500 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 2024 年 12 月 24 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,206,953,876.77 份基金份额，其中认购资金利息

折合 813,534.61 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，基金托管人为中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）。

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《招商中证 A500 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：中证 A500 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	11,744,200.83
等于：本金	11,742,618.61

加：应计利息	1,582.22
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	6,536,402.74
等于：本金	6,536,070.29
加：应计利息	332.45
减：坏账准备	-
合计	18,280,603.57

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		279,516,033.39	-	276,758,438.91	-2,757,594.48
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		279,516,033.39	-	276,758,438.91	-2,757,594.48

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	3,305,480.00	-	-	-
其中：股指期货投资	3,305,480.00	-	-	-

其他衍生工具	-	-	-	-
合计	3,305,480.00	-	-	-

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	2.00	3,504,560.00	199,080.00
合计				199,080.00
减：可抵销期货暂收款				199,080.00
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	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	68,200.32
其他	8,570.55
合计	76,770.87

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

招商中证 A500 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	158,674,736.24	158,674,736.24
本期申购	95,692,729.41	95,692,729.41
本期赎回（以“-”号填列）	-119,169,096.59	-119,169,096.59
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	135,198,369.06	135,198,369.06

招商中证 A500 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	96,850,660.99	96,850,660.99
本期申购	92,166,464.15	92,166,464.15
本期赎回（以“-”号填列）	-99,950,817.25	-99,950,817.25
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	89,066,307.89	89,066,307.89

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 A500 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	44,638,783.55	-2,834,430.55	41,804,353.00
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	44,638,783.55	-2,834,430.55	41,804,353.00
本期利润	24,822,795.96	-13,928,255.03	10,894,540.93
本期基金份额交易产生的变动数	-10,332,462.33	2,264,686.22	-8,067,776.11
其中：基金申购款	32,638,229.04	-1,321,835.08	31,316,393.96
基金赎回款	-42,970,691.37	3,586,521.30	-39,384,170.07
本期已分配利润	-	-	-
本期末	59,129,117.18	-14,497,999.36	44,631,117.82

招商中证 A500 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	26,863,635.83	-1,722,038.30	25,141,597.53
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	26,863,635.83	-1,722,038.30	25,141,597.53
本期利润	15,475,430.12	-9,682,997.47	5,792,432.65

本期基金份额交易产生的变动数	-3,964,855.37	1,894,803.17	-2,070,052.20
其中：基金申购款	30,959,325.30	-1,390,088.15	29,569,237.15
基金赎回款	-34,924,180.67	3,284,891.32	-31,639,289.35
本期已分配利润	-	-	-
本期末	38,374,210.58	-9,510,232.60	28,863,977.98

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	32,015.25
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	6,072.60
结算备付金利息收入	10,988.58
其他	324.44
合计	49,400.87

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	38,655,433.09
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	38,655,433.09

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	608,228,110.60
减：卖出股票成本总额	569,075,234.29
减：交易费用	497,443.22
买卖股票差价收入	38,655,433.09

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

本基金本报告期内无债券投资收益。

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	589,497.31

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	2,819,095.01
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	2,819,095.01

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	-23,582,236.50
——股票投资	-23,582,236.50
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-29,016.00
——权证投资	-
——期货投资	-29,016.00
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	-23,611,252.50

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	25,318.09
合计	25,318.09

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	8,692.95
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
其他	3,553.08
合计	71,753.40

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	1,390,882.99	3,173,918.40
其中：应支付销售机构的客户维护费	602,571.24	1,035,530.30
应支付基金管理人的净管理费	788,311.75	2,138,388.10

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 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	173,860.45	396,739.81

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		
	招商中证 A500 指数增强发起式 A	招商中证 A500 指数增强发起式 C	合计
招商基金管理有限公司	-	266.71	266.71
招商银行	-	46,528.63	46,528.63

招商证券	-	500.67	500.67
中国银行	-	36,700.92	36,700.92
合计	-	83,996.93	83,996.93
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 A500 指数增强发起式 A	招商中证 A500 指数增强发起式 C	合计
招商基金管理有限公司	-	476.53	476.53
招商银行	-	13,530.66	13,530.66
招商证券	-	15.50	15.50
中国银行	-	186,744.57	186,744.57
合计	-	200,767.26	200,767.26

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	
	招商中证 A500 指数增强发起式 A	招商中证 A500 指数增强发起式 C
基金合同生效日（2024 年 12 月 24 日）持有的基金份额	-	-

报告期初持有的基金份额	10,009,000.90	-
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	10,009,000.90	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	7.40%	-

项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	招商中证 A500 指数增强发起式 A	招商中证 A500 指数增强发起式 C
基金合同生效日（2024 年 12 月 24 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,009,000.90	-
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	10,009,000.90	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.75%	-

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	11,744,200.83	32,015.25	2,735,214.69	22,200.65

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	2,587	45,789.90
招商证券	001365	天海电子	网下申购	1,382	37,576.58

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	1,000	24,180.00

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 日	6 个月	新股流通受限	53.26	58.74	168	8,947.68	9,868.32	-
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	10,911	110,310.21	110,310.21	-
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	4,676	47,274.36	47,274.36	-
001257	盛龙股份	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股流通受限	7.82	20.74	1,697	13,270.54	35,195.78	-
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	415	11,283.85	12,993.65	-
001393	维通利	2026 年 5 月 8 日	6 个月	新股流通受限	30.38	38.99	291	8,840.58	11,346.09	-

		日								
001399	惠科股份	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通 受限	10.12	27.73	1,700	17,204.00	47,141.00	-
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	601	27,694.08	278,461.33	-
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	381	26,540.46	60,982.86	-
301683	慧谷新材	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股流通 受限	78.38	121.77	92	7,210.96	11,202.84	-
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	329	3,678.22	5,787.11	-
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	71	2,377.79	2,409.03	-
603352	至信股份	2026 年	6 个月	新股流通	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-

		1 月 8 日		受限						
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	259	4,584.30	21,838.88	-
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	1,458	25,544.16	52,371.36	-
688781	视涯科技	2026 年 3 月 18 日	6 个月	新股流通受限	22.68	47.61	131	2,971.08	6,236.91	-
688785	恒运昌	2026 年 1 月 20 日	6 个月	新股流通受限	92.18	463.15	88	8,111.84	40,757.20	-
688797	臻宝科技	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通受限	44.56	468.67	127	5,659.12	59,521.09	-
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	98	8,024.24	155,264.34	-
688811	有研复材	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	144	8,056.80	8,222.40	-
688818	电科蓝天	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股流通受限	9.47	70.14	1,043	9,877.21	73,156.02	-
688820	盛合晶微	2026 年 4 月 13 日	6 个月	新股流通受限	19.68	141.49	571	11,237.28	80,790.79	-

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同约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值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	18,280,603.57	-	-	-	18,280,603.57
结算备付金	2,437,795.24	-	-	-	2,437,795.24
存出保证金	-	-	-	420,547.20	420,547.20
交易性金融资产	-	-	-	276,758,438.91	276,758,438.91
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	-	-	-	774,067.69	774,067.69
应收清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	20,718,398.81	-	-	277,953,053.80	298,671,452.61
负债					
应付赎回款	-	-	-	581,071.47	581,071.47
应付管理人报酬	-	-	-	200,184.99	200,184.99
应付托管费	-	-	-	25,023.13	25,023.13
应付清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资	-	-	-	-	-

产款					
应付销售服务费	-	-	-	28,629.40	28,629.40
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	76,770.87	76,770.87
负债总计	-	-	-	911,679.86	911,679.86
利率敏感度缺口	20,718,398.81	-	-	277,041,373.94	297,759,772.75
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	21,198,036.92	-	-	-	21,198,036.92
结算备付金	3,628,409.81	-	-	-	3,628,409.81
存出保证金	-	-	-	536,774.40	536,774.40
交易性金融资产	-	-	-	300,440,718.35	300,440,718.35
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	-	-	-	1,364,046.34	1,364,046.34
应收清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	24,826,446.73	-	-	302,341,539.09	327,167,985.82
负债					
应付赎回款	-	-	-	4,374,007.97	4,374,007.97
应付管理人报酬	-	-	-	220,232.03	220,232.03
应付托管费	-	-	-	27,528.99	27,528.99
应付清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资 产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	30,858.12	30,858.12
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	5,826.95	5,826.95
其他负债	-	-	-	38,184.00	38,184.00
负债总计	-	-	-	4,696,638.06	4,696,638.06
利率敏感度缺口	24,826,446.73	-	-	297,644,901.03	322,471,347.76

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末无利率风险的敏感性分析。

6.4.13.4.2 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险，该风险可能与特定投资品种相关，也有可能与整体投资品种相关。

本基金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	276,758,438.91	92.95	300,440,718.35	93.17
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	276,758,438.91	92.95	300,440,718.35	93.17

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%	13,837,921.95	15,022,035.92
	2. 权益性投资的市场价格下降 5%	-13,837,921.95	-15,022,035.92

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	275,405,660.03	297,350,039.35
第二层次	157,584.57	1,473,747.00
第三层次	1,195,194.31	1,616,932.00
合计	276,758,438.91	300,440,718.35

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	276,758,438.91	92.66

	其中：股票	276,758,438.91	92.66
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	20,718,398.81	6.94
8	其他各项资产	1,194,614.89	0.40
9	合计	298,671,452.61	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	591,099.00	0.20
B	采矿业	13,139,087.52	4.41
C	制造业	152,140,642.23	51.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,367,008.00	1.13
E	建筑业	7,064,933.00	2.37
F	批发和零售业	3,836,607.00	1.29
G	交通运输、仓储和邮政业	5,235,007.00	1.76
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,784,499.26	4.63
J	金融业	16,546,185.00	5.56
K	房地产业	2,376,404.00	0.80
L	租赁和商务服务业	2,544,928.00	0.85
M	科学研究和技术服务业	2,811,930.00	0.94
N	水利、环境和公共设施管理业	1,836,850.00	0.62
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	225,275,180.01	75.66

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	19,712.00	0.01
B	采矿业	2,887,588.98	0.97
C	制造业	36,839,662.97	12.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	225,552.57	0.08
E	建筑业	515,910.00	0.17
F	批发和零售业	502,698.00	0.17
G	交通运输、仓储和邮政业	106,292.46	0.04
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,921,626.36	0.98
J	金融业	5,047,674.00	1.70
K	房地产业	407,979.00	0.14
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,214,040.58	0.41
N	水利、环境和公共设施管理业	794,521.98	0.27
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	51,483,258.90	17.29

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	300308	中际旭创	5,700	7,239,000.00	2.43
2	300750	宁德时代	14,560	5,722,225.60	1.92
3	600519	贵州茅台	2,626	3,113,096.74	1.05
4	300502	新易盛	4,800	2,913,600.00	0.98
5	002415	海康威视	78,000	2,667,600.00	0.90
6	603986	兆易创新	3,200	2,608,000.00	0.88
7	601899	紫金矿业	103,600	2,604,504.00	0.87

8	600150	中国船舶	71,300	2,409,227.00	0.81
9	000933	神火股份	112,500	2,385,000.00	0.80
10	601318	中国平安	47,400	2,262,876.00	0.76
11	002384	东山精密	8,600	2,256,210.00	0.76
12	600741	华域汽车	144,800	2,247,296.00	0.75
13	002493	荣盛石化	194,300	2,088,725.00	0.70
14	603799	华友钴业	41,200	1,988,312.00	0.67
15	601117	中国化学	256,500	1,885,275.00	0.63
16	002414	高德红外	138,900	1,841,814.00	0.62
17	002236	大华股份	109,700	1,808,953.00	0.61
18	600309	万华化学	26,400	1,806,024.00	0.61
19	600885	宏发股份	50,760	1,750,712.40	0.59
20	601168	西部矿业	64,200	1,742,388.00	0.59
21	000333	美的集团	22,800	1,722,084.00	0.58
22	601857	中国石油	197,900	1,717,772.00	0.58
23	600570	恒生电子	80,900	1,714,271.00	0.58
24	002558	巨人网络	62,200	1,714,232.00	0.58
25	002648	卫星化学	72,700	1,707,723.00	0.57
26	002916	深南电路	3,700	1,694,230.00	0.57
27	601328	交通银行	255,800	1,644,794.00	0.55
28	603259	药明康德	13,200	1,643,532.00	0.55
29	300014	亿纬锂能	25,200	1,638,756.00	0.55
30	601233	桐昆股份	75,400	1,632,410.00	0.55
31	688002	睿创微纳	10,126	1,566,390.94	0.53
32	600196	复星医药	69,100	1,552,677.00	0.52
33	300223	北京君正	6,200	1,543,180.00	0.52
34	002064	华峰化学	161,400	1,531,686.00	0.51
35	600346	恒力石化	85,900	1,521,289.00	0.51
36	601398	工商银行	214,000	1,512,980.00	0.51
37	600549	厦门钨业	17,600	1,499,520.00	0.50
38	600031	三一重工	86,100	1,487,808.00	0.50
39	600030	中信证券	51,600	1,482,468.00	0.50
40	300475	香农芯创	4,900	1,470,000.00	0.49
41	600183	生益科技	8,400	1,456,560.00	0.49
42	002008	大族激光	9,500	1,426,045.00	0.48
43	601166	兴业银行	85,700	1,419,192.00	0.48
44	601677	明泰铝业	84,800	1,407,680.00	0.47
45	300857	协创数据	4,120	1,400,388.00	0.47
46	000977	浪潮信息	18,500	1,295,000.00	0.43
47	601058	赛轮轮胎	111,700	1,287,901.00	0.43
48	601288	农业银行	212,100	1,287,447.00	0.43
49	600875	东方电气	44,700	1,286,019.00	0.43
50	300037	新宙邦	13,600	1,262,760.00	0.42

51	002120	韵达股份	198,100	1,259,916.00	0.42
52	600372	中航机载	116,100	1,259,685.00	0.42
53	002128	电投能源	54,400	1,257,728.00	0.42
54	600019	宝钢股份	224,300	1,217,949.00	0.41
55	600522	中天科技	19,800	1,201,464.00	0.40
56	002475	立讯精密	16,900	1,189,760.00	0.40
57	600166	福田汽车	406,000	1,181,460.00	0.40
58	600487	亨通光电	10,700	1,169,938.00	0.39
59	300012	华测检测	84,300	1,168,398.00	0.39
60	002266	浙富控股	230,100	1,164,306.00	0.39
61	002074	国轩高科	42,200	1,160,922.00	0.39
62	000408	藏格矿业	16,400	1,136,848.00	0.38
63	002532	天山铝业	105,000	1,126,650.00	0.38
64	601600	中国铝业	136,000	1,117,920.00	0.38
65	000001	平安银行	110,900	1,114,545.00	0.37
66	600820	隧道股份	213,400	1,111,814.00	0.37
67	002244	滨江集团	144,800	1,100,480.00	0.37
68	600489	中金黄金	60,700	1,095,635.00	0.37
69	000938	紫光股份	37,100	1,070,706.00	0.36
70	600690	海尔智家	51,800	1,057,238.00	0.36
71	002001	新和成	35,300	1,003,226.00	0.34
72	600177	雅戈尔	133,000	1,001,490.00	0.34
73	600352	浙江龙盛	81,300	984,543.00	0.33
74	002271	东方雨虹	82,000	973,340.00	0.33
75	300450	先导智能	23,800	969,136.00	0.33
76	300418	昆仑万维	23,700	956,532.00	0.32
77	600176	中国巨石	13,100	954,728.00	0.32
78	600026	中远海能	52,800	947,232.00	0.32
79	300458	全志科技	24,000	947,040.00	0.32
80	601100	恒立液压	8,800	946,528.00	0.32
81	603019	中科曙光	8,800	943,624.00	0.32
82	000878	云南铜业	59,400	943,272.00	0.32
83	000415	渤海租赁	230,000	936,100.00	0.31
84	600588	用友网络	101,285	929,796.30	0.31
85	002410	广联达	113,900	929,424.00	0.31
86	300073	当升科技	19,300	927,172.00	0.31
87	601186	中国铁建	155,400	924,630.00	0.31
88	300118	东方日升	73,900	920,055.00	0.31
89	600887	伊利股份	38,300	917,668.00	0.31
90	688111	金山办公	4,200	894,810.00	0.30
91	300408	三环集团	5,300	884,570.00	0.30
92	300454	深信服	9,100	875,420.00	0.29
93	600233	圆通速递	55,500	874,125.00	0.29

94	600704	物产中大	184,300	869,896.00	0.29
95	601601	中国太保	29,600	844,192.00	0.28
96	000657	中钨高新	8,700	832,764.00	0.28
97	600584	长电科技	8,000	828,400.00	0.28
98	601225	陕西煤业	40,500	824,175.00	0.28
99	300059	东方财富	40,300	821,314.00	0.28
100	600039	四川路桥	104,600	817,972.00	0.27
101	000425	徐工机械	101,100	817,899.00	0.27
102	600028	中国石化	183,100	816,626.00	0.27
103	688396	华润微	8,340	813,567.00	0.27
104	605117	德业股份	7,568	803,570.24	0.27
105	688521	芯原股份	2,164	803,146.96	0.27
106	000338	潍柴动力	29,400	801,150.00	0.27
107	601658	邮储银行	160,900	793,237.00	0.27
108	600460	士兰微	14,400	787,104.00	0.26
109	300604	长川科技	2,300	785,266.00	0.26
110	002049	紫光国微	8,700	772,125.00	0.26
111	601211	国泰海通	41,900	762,580.00	0.26
112	000975	山金国际	44,200	751,400.00	0.25
113	002185	华天科技	33,400	745,154.00	0.25
114	600660	福耀玻璃	14,700	741,468.00	0.25
115	000651	格力电器	19,500	731,250.00	0.25
116	601985	中国核电	79,900	721,497.00	0.24
117	600674	川投能源	50,700	718,419.00	0.24
118	002138	顺络电子	9,800	716,380.00	0.24
119	000932	华菱钢铁	204,700	710,309.00	0.24
120	601319	中国人保	104,900	709,124.00	0.24
121	000623	吉林敖东	39,800	705,654.00	0.24
122	300124	汇川技术	10,600	703,098.00	0.24
123	600000	浦发银行	81,600	702,576.00	0.24
124	603816	顾家家居	31,400	702,104.00	0.24
125	600499	科达制造	50,300	694,140.00	0.23
126	300496	中科创达	11,200	692,048.00	0.23
127	600406	国电南瑞	30,100	687,785.00	0.23
128	000157	中联重科	98,400	685,848.00	0.23
129	002821	凯莱英	4,200	680,400.00	0.23
130	688099	晶晨股份	6,600	679,140.00	0.23
131	688525	佰维存储	1,368	676,790.64	0.23
132	300457	赢合科技	31,643	667,034.44	0.22
133	000683	博源化工	115,400	664,704.00	0.22
134	002938	鹏鼎控股	6,100	642,818.00	0.22
135	600219	南山铝业	160,400	639,996.00	0.21
136	603486	科沃斯	12,500	634,375.00	0.21

137	600989	宝丰能源	31,200	634,296.00	0.21
138	300803	指南针	6,800	623,356.00	0.21
139	002195	岩山科技	95,100	621,954.00	0.21
140	000963	华东医药	22,100	621,452.00	0.21
141	600418	江淮汽车	24,000	619,920.00	0.21
142	002131	利欧股份	128,300	609,425.00	0.20
143	600008	首创环保	216,100	587,792.00	0.20
144	600585	海螺水泥	34,400	583,080.00	0.20
145	600153	建发股份	73,300	581,269.00	0.20
146	600362	江西铜业	13,400	580,220.00	0.19
147	301358	湖南裕能	7,500	569,025.00	0.19
148	601766	中国中车	109,200	567,840.00	0.19
149	002371	北方华创	640	566,118.40	0.19
150	000301	东方盛虹	49,300	564,485.00	0.19
151	301308	江波龙	800	563,040.00	0.19
152	600426	华鲁恒升	23,500	562,120.00	0.19
153	000960	锡业股份	13,100	559,239.00	0.19
154	600482	中国动力	17,000	557,600.00	0.19
155	002273	水晶光电	15,700	557,036.00	0.19
156	300438	鹏辉能源	6,600	546,810.00	0.18
157	000066	中国长城	28,600	544,830.00	0.18
158	601390	中国中铁	130,300	543,351.00	0.18
159	600699	均胜电子	24,500	529,445.00	0.18
160	600170	上海建工	237,600	527,472.00	0.18
161	601668	中国建筑	121,300	526,442.00	0.18
162	600535	天士力	39,200	518,616.00	0.17
163	688041	海光信息	1,400	518,420.00	0.17
164	002756	永兴材料	9,100	515,424.00	0.17
165	000999	华润三九	22,730	511,197.70	0.17
166	688390	固德威	4,600	499,146.00	0.17
167	002241	歌尔股份	21,600	486,648.00	0.16
168	601088	中国神华	12,288	479,723.52	0.16
169	600900	长江电力	18,000	476,460.00	0.16
170	601238	广汽集团	93,000	472,440.00	0.16
171	600938	中国海油	17,200	466,980.00	0.16
172	002460	赣锋锂业	7,100	464,340.00	0.16
173	300001	特锐德	12,100	457,743.00	0.15
174	603605	珀莱雅	7,500	449,400.00	0.15
175	000063	中兴通讯	12,200	441,518.00	0.15
176	000967	盈峰环境	41,600	438,048.00	0.15
177	000100	TCL 科技	75,000	436,500.00	0.15
178	601155	新城控股	42,400	435,024.00	0.15
179	601872	招商轮船	24,700	433,979.00	0.15

180	600795	国电电力	92,900	433,843.00	0.15
181	603885	吉祥航空	42,100	433,209.00	0.15
182	601216	君正集团	97,100	433,066.00	0.15
183	600064	南京高科	60,400	430,652.00	0.14
184	000032	深桑达 A	17,200	429,140.00	0.14
185	600160	巨化股份	8,000	424,080.00	0.14
186	002517	恺英网络	25,900	420,875.00	0.14
187	601567	三星电气	27,500	410,850.00	0.14
188	600988	赤峰黄金	15,600	410,592.00	0.14
189	300724	捷佳伟创	5,800	409,480.00	0.14
190	000547	航天发展	21,300	407,895.00	0.14
191	600547	山东黄金	17,600	406,384.00	0.14
192	600765	中航重机	31,400	405,688.00	0.14
193	000998	隆平高科	53,800	405,652.00	0.14
194	601012	隆基绿能	30,900	405,408.00	0.14
195	300115	长盈精密	14,500	405,130.00	0.14
196	600392	盛和资源	13,600	404,872.00	0.14
197	002603	以岭药业	26,900	403,500.00	0.14
198	002156	通富微电	5,300	402,111.00	0.14
199	000035	中国天楹	83,200	401,856.00	0.13
200	600816	建元信托	164,600	401,624.00	0.13
201	601615	明阳智能	34,700	401,479.00	0.13
202	688005	容百科技	13,000	397,800.00	0.13
203	002436	兴森科技	7,800	397,410.00	0.13
204	300017	网宿科技	30,500	396,805.00	0.13
205	300409	道氏技术	19,900	396,607.00	0.13
206	002600	领益智造	22,300	386,682.00	0.13
207	688188	柏楚电子	3,520	375,584.00	0.13
208	688008	澜起科技	1,200	371,880.00	0.12
209	600332	白云山	17,900	358,716.00	0.12
210	688981	中芯国际	2,241	355,915.62	0.12
211	000426	兴业银锡	10,700	352,672.00	0.12
212	600018	上港集团	73,800	348,336.00	0.12
213	300972	万辰集团	2,000	346,820.00	0.12
214	688009	中国通号	72,200	343,672.00	0.12
215	688347	华虹宏力	1,000	336,300.00	0.11
216	300207	欣旺达	17,700	336,123.00	0.11
217	603659	璞泰来	11,500	332,695.00	0.11
218	688256	寒武纪	200	319,110.00	0.11
219	600050	中国联通	78,100	312,400.00	0.10
220	601727	上海电气	44,400	310,800.00	0.10
221	300661	圣邦股份	2,100	301,308.00	0.10
222	300136	信维通信	2,500	298,125.00	0.10

223	600143	金发科技	19,200	296,640.00	0.10
224	603766	隆鑫通用	24,800	295,864.00	0.10
225	601000	唐山港	70,100	290,915.00	0.10
226	600104	上汽集团	29,600	288,896.00	0.10
227	300919	中伟新材	6,600	288,750.00	0.10
228	601607	上海医药	18,700	287,980.00	0.10
229	002281	光迅科技	1,100	282,634.00	0.09
230	002463	沪电股份	1,800	275,040.00	0.09
231	600803	新奥股份	17,400	274,920.00	0.09
232	000792	盐湖股份	9,100	274,729.00	0.09
233	603568	伟明环保	17,600	270,688.00	0.09
234	600663	陆家嘴	42,900	269,412.00	0.09
235	002202	金风科技	11,100	265,290.00	0.09
236	002555	三七互娱	13,800	260,406.00	0.09
237	300568	星源材质	13,800	258,336.00	0.09
238	002027	分众传媒	53,100	257,004.00	0.09
239	688122	西部超导	3,679	231,077.99	0.08
240	000630	铜陵有色	36,100	229,596.00	0.08
241	002353	杰瑞股份	1,500	228,750.00	0.08
242	300274	阳光电源	1,400	222,628.00	0.07
243	000807	云铝股份	10,000	221,400.00	0.07
244	300432	富临精工	10,800	216,972.00	0.07
245	603979	金诚信	3,600	212,508.00	0.07
246	300760	迈瑞医疗	1,400	190,162.00	0.06
247	601919	中远海控	14,100	186,966.00	0.06
248	002714	牧原股份	5,300	185,447.00	0.06
249	002459	晶澳科技	20,400	165,240.00	0.06
250	601728	中国电信	31,600	164,004.00	0.06
251	300033	同花顺	680	163,880.00	0.06
252	601888	中国中免	3,000	161,130.00	0.05
253	600038	中直股份	6,300	159,327.00	0.05
254	600011	华能国际	20,300	154,077.00	0.05
255	601618	中国中冶	62,800	153,232.00	0.05
256	603288	海天味业	4,600	152,536.00	0.05
257	601880	辽港股份	110,400	152,352.00	0.05
258	601018	宁波港	48,200	151,830.00	0.05
259	600655	豫园股份	36,900	151,659.00	0.05
260	000538	云南白药	3,200	151,584.00	0.05
261	601866	中远海发	68,400	151,164.00	0.05
262	000423	东阿阿胶	3,300	149,688.00	0.05
263	601800	中国交建	25,500	145,605.00	0.05
264	600515	海南机场	51,400	140,836.00	0.05
265	002466	天齐锂业	2,200	134,904.00	0.05

266	603833	欧派家居	4,200	126,462.00	0.04
267	600066	宇通客车	3,900	104,559.00	0.04
268	000034	神州数码	3,200	88,800.00	0.03
269	300433	蓝思科技	1,500	80,490.00	0.03
270	603129	春风动力	300	76,740.00	0.03
271	600141	兴发集团	1,500	70,455.00	0.02
272	002028	思源电气	400	69,200.00	0.02
273	002831	裕同科技	1,542	54,833.52	0.02
274	002594	比亚迪	600	47,820.00	0.02
275	300573	兴齐眼药	1,170	47,689.20	0.02
276	002179	中航光电	900	41,580.00	0.01
277	601877	正泰电器	1,500	37,605.00	0.01
278	002230	科大讯飞	900	36,756.00	0.01
279	605499	东鹏饮料	260	32,091.80	0.01
280	002444	巨星科技	1,000	31,100.00	0.01
281	000858	五粮液	400	29,600.00	0.01
282	002318	久立特材	1,200	28,680.00	0.01
283	603501	豪威集团	300	28,455.00	0.01
284	000039	中集集团	3,400	27,574.00	0.01
285	002595	豪迈科技	580	27,028.00	0.01
286	000568	泸州老窖	300	23,256.00	0.01
287	300866	安克创新	200	20,900.00	0.01
288	601127	赛力斯	300	18,375.00	0.01
289	600276	恒瑞医药	300	15,612.00	0.01
290	000725	京东方 A	1,400	12,152.00	0.00
291	601816	京沪高铁	1,100	4,983.00	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	001309	德明利	1,800	1,697,220.00	0.57
2	301536	星宸科技	9,100	1,171,261.00	0.39
3	688766	普冉股份	1,400	1,073,240.00	0.36
4	000708	中信特钢	82,200	1,037,364.00	0.35
5	603444	吉比特	2,500	896,050.00	0.30
6	688797	臻宝科技	1,262	842,795.94	0.28
7	002841	视源股份	23,700	818,361.00	0.27
8	601998	中信银行	111,700	774,081.00	0.26
9	601138	工业富联	10,500	757,575.00	0.25
10	601688	华泰证券	34,400	709,328.00	0.24

11	601939	建设银行	73,600	708,768.00	0.24
12	600926	杭州银行	47,700	689,265.00	0.23
13	920212	智新电子	76,861	687,905.95	0.23
14	920976	视声智能	41,886	673,526.88	0.23
15	600801	华新建材	38,600	602,160.00	0.20
16	300628	亿联网络	17,200	581,704.00	0.20
17	688807	优迅股份	1,303	524,366.29	0.18
18	300428	立中集团	28,700	521,766.00	0.18
19	002624	完美世界	41,600	516,672.00	0.17
20	600502	安徽建工	118,600	515,910.00	0.17
21	000404	长虹华意	65,300	513,258.00	0.17
22	601212	白银有色	101,000	513,080.00	0.17
23	601699	潞安环能	35,800	511,224.00	0.17
24	002541	鸿路钢构	29,500	510,940.00	0.17
25	000951	中国重汽	26,100	509,211.00	0.17
26	000800	一汽解放	85,300	507,535.00	0.17
27	000983	山西焦煤	87,400	506,920.00	0.17
28	600810	神马股份	82,100	506,557.00	0.17
29	000553	安道麦 A	94,400	505,040.00	0.17
30	600686	金龙汽车	44,600	503,534.00	0.17
31	002283	天润工业	52,100	502,765.00	0.17
32	600399	抚顺特钢	121,800	500,598.00	0.17
33	601231	环旭电子	15,300	495,720.00	0.17
34	603901	永创智能	44,600	484,802.00	0.16
35	600919	江苏银行	43,900	473,242.00	0.16
36	603296	华勤技术	6,160	457,503.20	0.15
37	603061	金海通	900	451,998.00	0.15
38	688110	东芯股份	2,200	448,140.00	0.15
39	300905	宝丽迪	8,700	440,220.00	0.15
40	003008	开普检测	25,400	433,578.00	0.15
41	002142	宁波银行	14,500	430,505.00	0.14
42	601009	南京银行	43,300	428,237.00	0.14
43	920407	驰诚股份	33,000	427,680.00	0.14
44	920665	科强股份	46,053	424,148.13	0.14
45	300938	信测标准	8,500	423,980.00	0.14
46	300478	杭州高新	11,300	414,597.00	0.14
47	300959	线上线下	2,800	413,868.00	0.14
48	688130	晶华微	14,653	412,042.36	0.14
49	688109	品茗科技	5,400	408,780.00	0.14
50	605299	舒华体育	30,600	408,510.00	0.14
51	600773	西藏城投	31,700	407,979.00	0.14
52	603216	梦天家居	19,800	407,286.00	0.14
53	300164	通源石油	50,900	407,200.00	0.14

54	000890	法尔胜	50,400	406,224.00	0.14
55	603619	中曼石油	21,700	406,007.00	0.14
56	605196	华通线缆	15,500	404,550.00	0.14
57	688677	海泰新光	4,000	404,520.00	0.14
58	600722	金牛化工	49,800	404,376.00	0.14
59	300427	红相股份	60,200	403,942.00	0.14
60	603538	美诺华	12,400	403,620.00	0.14
61	300986	志特新材	23,500	403,025.00	0.14
62	002455	百川股份	55,700	401,040.00	0.13
63	002653	海思科	6,000	398,040.00	0.13
64	000776	广发证券	16,600	388,440.00	0.13
65	301377	鼎泰高科	700	385,630.00	0.13
66	688208	道通科技	15,069	379,588.11	0.13
67	600388	龙净环保	25,000	363,750.00	0.12
68	600022	山东钢铁	289,600	359,104.00	0.12
69	001389	广合科技	1,500	355,875.00	0.12
70	688796	百奥赛图	3,181	348,001.40	0.12
71	603160	汇顶科技	5,500	339,405.00	0.11
72	000603	盛达资源	14,000	323,400.00	0.11
73	688090	瑞松科技	3,025	322,011.25	0.11
74	605123	派克新材	3,000	291,030.00	0.10
75	688503	聚和材料	2,188	290,347.60	0.10
76	301429	森泰股份	18,200	285,194.00	0.10
77	600391	航发科技	8,500	284,325.00	0.10
78	002487	大金重工	4,900	284,053.00	0.10
79	000703	恒逸石化	20,700	280,899.00	0.09
80	301666	大普微	601	278,461.33	0.09
81	603233	大参林	18,000	270,540.00	0.09
82	301086	鸿富瀚	1,280	267,878.40	0.09
83	688388	嘉元科技	6,000	264,000.00	0.09
84	688778	厦钨新能	4,839	263,241.60	0.09
85	301519	舜禹股份	24,200	262,570.00	0.09
86	688466	金科环境	20,206	259,242.98	0.09
87	000810	创维数字	19,400	257,050.00	0.09
88	000997	新大陆	15,700	255,910.00	0.09
89	002506	协鑫集成	79,500	252,810.00	0.08
90	002583	海能达	30,800	236,852.00	0.08
91	601898	中煤能源	18,600	226,548.00	0.08
92	601061	中信金属	20,400	219,708.00	0.07
93	301669	高特电子	5,455	217,413.57	0.07
94	600105	永鼎股份	3,200	215,936.00	0.07
95	002151	北斗星通	6,600	209,550.00	0.07
96	688659	元琛科技	20,000	208,800.00	0.07

97	601399	国机重装	58,900	206,150.00	0.07
98	600871	石化油服	101,500	206,045.00	0.07
99	601577	长沙银行	23,600	205,556.00	0.07
100	600973	宝胜股份	28,800	204,192.00	0.07
101	688275	万润新能	1,600	204,080.00	0.07
102	603699	纽威股份	3,800	191,140.00	0.06
103	688349	三一重能	12,259	186,091.62	0.06
104	002311	海大集团	4,000	178,440.00	0.06
105	688127	蓝特光学	1,800	175,680.00	0.06
106	002768	国恩股份	3,292	171,381.52	0.06
107	920639	晨光电缆	28,000	170,800.00	0.06
108	300548	长芯博创	600	166,800.00	0.06
109	300842	帝科股份	1,800	160,506.00	0.05
110	001248	华润新能源	15,587	157,584.57	0.05
111	688808	联讯仪器	98	155,264.34	0.05
112	301687	新广益	1,942	151,048.76	0.05
113	688729	屹唐股份	3,505	150,715.00	0.05
114	001399	惠科股份	4,249	144,461.82	0.05
115	600380	健康元	14,900	140,358.00	0.05
116	300953	震裕科技	1,000	133,700.00	0.04
117	300999	金龙鱼	5,700	132,582.00	0.04
118	600356	恒丰纸业	17,800	131,898.00	0.04
119	600292	电投水电	10,800	130,032.00	0.04
120	601963	重庆银行	12,800	129,024.00	0.04
121	688805	健信超导	2,643	124,141.71	0.04
122	601609	金田股份	11,100	119,880.00	0.04
123	301511	德福科技	800	115,080.00	0.04
124	600498	烽火通信	1,500	110,400.00	0.04
125	002320	海峡股份	16,700	104,709.00	0.04
126	001280	中国铀业	1,556	103,785.20	0.03
127	301217	铜冠铜箔	600	99,042.00	0.03
128	600339	中油工程	29,900	91,793.00	0.03
129	688257	新锐股份	895	91,200.50	0.03
130	301372	科净源	2,700	85,077.00	0.03
131	920768	拾比佰	12,545	84,051.50	0.03
132	688820	盛合晶微	571	80,790.79	0.03
133	688775	影石创新	573	79,446.45	0.03
134	688818	电科蓝天	1,043	73,156.02	0.02
135	601991	大唐发电	9,600	67,968.00	0.02
136	688809	强一股份	104	64,792.00	0.02
137	002948	青岛银行	12,500	63,500.00	0.02
138	002379	宏桥控股	4,200	62,034.00	0.02
139	301682	宏明电子	381	60,982.86	0.02

140	603588	高能环境	3,000	57,600.00	0.02
141	002056	横店东磁	1,800	54,864.00	0.02
142	688712	北芯生命	1,458	52,371.36	0.02
143	920906	舜宇精工	2,900	49,909.00	0.02
144	601336	新华保险	800	47,728.00	0.02
145	601808	中海油服	4,100	44,321.00	0.01
146	301125	腾亚精工	2,940	42,218.40	0.01
147	603681	永冠新材	1,800	41,130.00	0.01
148	688785	恒运昌	88	40,757.20	0.01
149	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.01
150	001233	海安集团	885	39,559.50	0.01
151	688635	长进光子	128	39,448.32	0.01
152	688253	英诺特	600	36,168.00	0.01
153	001257	盛龙股份	1,697	35,195.78	0.01
154	688795	摩尔线程	49	35,108.01	0.01
155	605189	富春染织	2,810	33,860.50	0.01
156	600060	海信视像	1,200	33,444.00	0.01
157	301678	新恒汇	382	30,116.88	0.01
158	001211	双枪科技	1,255	29,919.20	0.01
159	688013	天臣医疗	1,200	29,604.00	0.01
160	600583	海油工程	5,000	25,150.00	0.01
161	688790	昂瑞微	182	24,357.06	0.01
162	002701	奥瑞金	5,600	23,856.00	0.01
163	603459	红板科技	259	21,838.88	0.01
164	600299	安迪苏	2,700	21,195.00	0.01
165	688811	有研复材	834	20,124.42	0.01
166	600582	天地科技	4,500	20,025.00	0.01
167	688802	沐曦股份	24	19,879.20	0.01
168	300498	温氏股份	1,600	19,712.00	0.01
169	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.01
170	000877	天山股份	5,100	18,513.00	0.01
171	688296	和达科技	1,600	18,304.00	0.01
172	603049	中策橡胶	399	17,879.19	0.01
173	301531	春光集团	290	14,952.40	0.01
174	000920	沃顿科技	900	14,814.00	0.00
175	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
176	002835	同为股份	1,200	13,764.00	0.00
177	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
178	001365	天海电子	415	12,993.65	0.00
179	001298	好上好	600	12,450.00	0.00
180	001393	维通利	291	11,346.09	0.00
181	301683	慧谷新材	92	11,202.84	0.00
182	301667	纳百川	151	10,920.32	0.00

183	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
184	001237	惠康科技	168	9,868.32	0.00
185	301590	优优绿能	73	9,595.85	0.00
186	688816	易思维	144	8,222.40	0.00
187	301595	太力科技	196	7,761.60	0.00
188	001369	双欣材料	568	7,679.36	0.00
189	688755	汉邦科技	264	7,275.84	0.00
190	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
191	603014	威高血净	205	6,709.65	0.00
192	688781	视涯科技	131	6,236.91	0.00
193	301449	天溯计量	156	6,037.20	0.00
194	601112	振石股份	329	5,787.11	0.00
195	603248	锡华科技	260	5,483.40	0.00
196	301636	泽润新能	128	5,390.08	0.00
197	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
198	001390	古麒绒材	178	3,579.58	0.00
199	603400	华之杰	57	3,079.14	0.00
200	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
201	001388	信通电子	94	2,582.18	0.00
202	001396	誉帆科技	69	2,443.98	0.00
203	603293	埃泰克	71	2,409.03	0.00
204	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
205	603382	海阳科技	105	1,800.75	0.00
206	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
207	001220	世盟股份	57	1,583.46	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	300308	中际旭创	4,953,183.00	1.54
2	002493	荣盛石化	4,497,532.00	1.39
3	600183	生益科技	4,310,876.00	1.34
4	601398	工商银行	4,026,224.00	1.25
5	000100	TCL 科技	3,816,458.00	1.18
6	600150	中国船舶	3,811,574.85	1.18
7	601899	紫金矿业	3,716,134.00	1.15
8	603799	华友钴业	3,558,227.00	1.10
9	601168	西部矿业	3,545,129.00	1.10
10	601288	农业银行	3,514,294.00	1.09
11	000933	神火股份	3,325,663.00	1.03

12	600741	华域汽车	3,301,405.00	1.02
13	002558	巨人网络	3,292,483.00	1.02
14	002415	海康威视	3,284,829.00	1.02
15	601727	上海电气	3,259,856.00	1.01
16	600570	恒生电子	3,240,457.00	1.00
17	300274	阳光电源	3,216,916.02	1.00
18	601857	中国石油	3,200,731.00	0.99
19	002475	立讯精密	3,173,081.00	0.98
20	600782	新钢股份	3,103,700.00	0.96

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

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	600183	生益科技	7,383,312.00	2.29
2	002008	大族激光	6,172,428.00	1.91
3	002475	立讯精密	5,456,663.00	1.69
4	000100	TCL 科技	5,080,081.00	1.58
5	300454	深信服	5,031,574.00	1.56
6	600011	华能国际	4,912,233.00	1.52
7	300750	宁德时代	4,882,853.00	1.51
8	002202	金风科技	4,756,201.89	1.47
9	300308	中际旭创	4,543,238.00	1.41
10	603588	高能环境	4,407,988.00	1.37
11	300274	阳光电源	4,090,654.00	1.27
12	600549	厦门钨业	4,057,083.00	1.26
13	601318	中国平安	4,035,219.00	1.25
14	000157	中联重科	3,959,809.00	1.23
15	600487	亨通光电	3,815,105.00	1.18
16	600372	中航机载	3,783,734.72	1.17
17	002048	宁波华翔	3,751,059.00	1.16
18	600741	华域汽车	3,642,744.50	1.13
19	000425	徐工机械	3,539,906.01	1.10
20	600699	均胜电子	3,525,050.80	1.09

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	568,975,191.35
卖出股票收入（成交）总额	608,228,110.60

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票；

2、“买入股票成本（成交）总额”、“卖出股票收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金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,河南神火煤电股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到河南证监局的处罚。

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	420,547.20
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	774,067.69
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,194,614.89

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
招商中证 A500 指数增强发起式 A	6,094	22,185.49	14,983,738.51	11.08%	120,214,630.55	88.92%
招商中证 A500 指数增强发起式 C	2,633	33,826.93	26,680,166.71	29.96%	62,386,141.18	70.04%
合计	8,727	25,697.80	41,663,905.22	18.58%	182,600,771.73	81.42%

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 A500 指数增强发起式 A	327,231.85	0.2420%
	招商中证 A500 指数增强发起式 C	-	-
	合计	327,231.85	0.1459%

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 A500 指数增强发起式 A	0
	招商中证 A500 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	招商中证 A500 指数增强发起式 A	0
	招商中证 A500 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	持有份额占基金总份额比例（%）	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例（%）	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,009,000.90	4.46	10,009,000.90	4.46	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	10,009,000.90	4.46	10,009,000.90	4.46	-

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	招商中证 A500 指数增强发起式 A	招商中证 A500 指数增强发起式 C
基金合同生效日(2024 年 12 月 24 日)基金份额总额	650,764,078.21	556,189,798.56
本报告期期初基金份额总额	158,674,736.24	96,850,660.99
本报告期基金总申购份额	95,692,729.41	92,166,464.15
减：本报告期基金总赎回份额	119,169,096.59	99,950,817.25
本报告期基金拆分变动份额（份额	-	-

减少以“-”填列)		
本报告期末基金份额总额	135,198,369.06	89,066,307.89

§ 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，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	
广发证券	3	736,791,948.83	62.69%	73,681.13	62.71%	-
国投证券	3	438,547,209.80	37.31%	43,819.26	37.29%	-

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
广发证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-

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	证券时报及基金管理人网站	2026-01-21
2	招商中证 A500 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
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	证券时报及基金管理人网站	2026-03-31
4	招商中证 A500 指数增强型发起式证券投资基	基金管理人网站及中	2026-03-31

	金 2025 年年度报告	国证监会基金电子披露网站	
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	证券时报、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	证券时报及基金管理人网站	2026-04-22
7	招商中证 A500 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
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	证券时报、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	证券时报、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 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 A500 指数增强型发起式证券投资基金设立的文件；
- 3、《招商中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》；
- 4、《招商中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金托管协议》；
- 5、《招商中证 A500 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。

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.cmfcchina.com>

招商基金管理有限公司

2026 年 8 月 31 日