招商沪港深科技创新主题精选灵活配置混合型证券投资基金 2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人：招商基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 31 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 1
1.1 重要提示 1
1.2 目录 2
§2 基金简介 4
2.1 基金基本情况 4
2.2 基金产品说明 4
2.3 基金管理人和基金托管人 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 6
3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 7
§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遵规守信情况的说明 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 11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 12
4.8 报告期内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 12
§5 托管人报告 12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 12
§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 14
6.3 净资产变动表 15
6.4 报表附注 17
§7 投资组合报告 38
7.1 期末基金资产组合情况 38
7.2 报告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所有股票投资明细 40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 46
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 47
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 47
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 47
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 47
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 47

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 48
7.12 投资组合报告附注 48
§8 基金份额持有人信息 49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 49
8.2 盈利投资者数量占比 49
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 49
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 50
§9 开放式基金份额变动 50
§10 重大事件揭示 50
10.1 基金份额持有人大会决议 50
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 50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 51
10.4 基金投资策略的改变 51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 51
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 51
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 51
10.8 其他重大事件 56
§11 影响投资者决策的其他重要信息 57
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 57
§12 备查文件目录 58
12.1 备查文件目录 58
12.2 存放地点 58
12.3 查阅方式 58

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	招商沪港深科技创新主题精选灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	招商沪港深科技创新混合	
基金主代码	004266	
交易代码	004266	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年4月26日	
基金管理人	招商基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	27,208,893.52份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	招商沪港深科技创新混合A	招商沪港深科技创新混合C
下属分级基金的交易代码	004266	010754
报告期末下属分级基金的份额总额	17,132,968.28份	10,075,925.24份

注：本基金从2021年1月21日起新增C类份额，C类份额自2021年1月22日起存续。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过对优质企业基本面全面深入的研究、把握沪港深股票市场的投资机会，在严格控制投资组合风险的前提下，谋求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	资产配置策略:本基金将结合对包括宏观经济形势、政策走势、证券市场环境等在内的因素的分析，主动判断市场时机，进行积极的资产配置策略，合理确定基金在股票、债券等各类资产上的投资比例，最大限度地降低投资组合的风险，提高收益。 股票投资策略:本基金将运用“价值为本、成长为重”的投资策略来确定具体选股标准。 债券投资策略:本基金采用的固定收益品种主要投资策略包括：久期策略、期限结构策略和个券选择策略等。 权证投资策略:本基金在进行权证投资时，将通过对权证标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型寻求其合理估值水平，主要考虑运用的策略包括：价值挖掘策略、杠杆策略、获利保护策略、价差策略、双向权证策略、买入保护性的认沽权证策略、卖空保护性的认购权证策略等。 期货投资策略:为更好地实现投资目标，本基金在注重风险管理的前提下，以套期保值为目的，适度运用股指期货、国债期货等金融衍生品。 中小企业私募债券投资策略:中小企业私募债具有票面利率较高、信用风险较大、二级市场流动性较差等特点。因此本基金审慎投资中小企业私募债券。 资产支持证券的投资策略:本基金将在利率基本面分析、市场流动性分析

	和信用评级支持的基础上，辅以与国债、企业债等债券品种的相对价值比较，审慎投资资产支持证券类资产。
业绩比较基准	中国战略新兴产业成份指数收益率*50%+恒生综合指数收益率(经汇率调整后)*30%+中国人民银行人民币活期存款利率(税后)*20%
风险收益特征	本基金是混合型基金，在证券投资基金中属于预期风险收益水平中等的投资品种，预期收益和预期风险高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。 本基金除了投资于 A 股市场优质企业外，还可在法律法规规定的范围内投资香港联合交易所上市的股票。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

注：根据《招商基金管理有限公司关于旗下部分基金调整业绩比较基准并修订基金合同等法律文件的公告》，本基金业绩比较基准自 2026 年 7 月 27 日起变更为“中国战略新兴产业成份指数收益率×45%+中证港股通科技指数（人民币）收益率×35%+中债-综合全价（1-3 年）指数收益率×15%+活期存款基准利率×5%”。

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	许俊
	联系电话	0755－83196666	010-66596688
	电子邮箱	cmf@cmfchina.com	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		400-887-9555	95566
传真		0755－83196475	010-66594942
注册地址		深圳市福田区深南大道 7088 号	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		深圳市福田区深南大道 7088 号	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		518040	100818
法定代表人		王颖	葛海蛟

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
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、招商沪港深科技创新混合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	10,397,742.66
本期利润	11,575,166.83
加权平均基金份额本期利润	0.5139
本期加权平均净值利润率	28.13%
本期基金份额净值增长率	32.44%
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	19,942,305.86
期末可供分配基金份额利润	1.1640
期末基金资产净值	37,075,274.14
期末基金份额净值	2.1640
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	135.62%

2、招商沪港深科技创新混合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	1,551,347.09
本期利润	2,194,434.82
加权平均基金份额本期利润	0.5379
本期加权平均净值利润率	30.30%
本期基金份额净值增长率	32.35%
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	11,262,891.03
期末可供分配基金份额利润	1.1178
期末基金资产净值	21,338,816.27
期末基金份额净值	2.1178
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	13.37%

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

招商沪港深科技创新混合 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	33.63%	2.14%	24.35%	1.40%	9.28%	0.74%
过去六个月	32.44%	1.99%	19.44%	1.28%	13.00%	0.71%
过去一年	44.21%	1.68%	50.13%	1.24%	-5.92%	0.44%
过去三年	58.21%	1.56%	72.63%	0.92%	-14.42%	0.64%
过去五年	11.49%	1.49%	45.94%	0.85%	-34.45%	0.64%
过去七年	137.57%	1.41%	78.74%	0.82%	58.83%	0.59%
自基金合同生效起至今	135.62%	1.28%	101.65%	0.78%	33.97%	0.50%

招商沪港深科技创新混合 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	33.68%	2.14%	24.35%	1.40%	9.33%	0.74%
过去六个月	32.35%	2.00%	19.44%	1.28%	12.91%	0.72%
过去一年	43.82%	1.68%	50.13%	1.24%	-6.31%	0.44%
过去三年	56.34%	1.56%	72.63%	0.92%	-16.29%	0.64%
过去五年	9.29%	1.49%	45.94%	0.85%	-36.65%	0.64%
自基金合同生效起至今	13.37%	1.49%	41.99%	0.85%	-28.62%	0.64%

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

注：本基金从 2021 年 1 月 21 日起新增 C 类份额，C 类份额自 2021 年 1 月 22 日起存续。

§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		
晏磊	本基金基金经理	2021年11月13日	-	19	男，硕士。曾就职于国泰君安证券股份有限公司、上海英高咨询有限公司、上海亚鑫投资咨询有限公司、香港宝桥投资管理有限公司、中国人保资产管理有限公司。2021年3月加入招商基金管理有限公司国际业务部，现任招商港股通核心精选股票型证券投资基金、招商沪港深科技创新主题精选灵活配置混合型证券投资基金、招商回报优选混合型发起式证券投资基金基金经理。

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

2、证券从业年限计算标准遵从中国证监会《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 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

2026年上半年，A股与港股的"科技板块"走出截然相反的两条曲线， 同样冠以"科技"之名，A股科技（以AI硬件、算力、半导体为主）演绎了一轮由业绩兑现+杠杆资金双击驱动的极致行情，而港股科技（以互联网平台、应用端为主）却在盈利下修+错失AI硬件+外资流出三重压制下逆势大跌，成为拖累恒生指数跑输全球其他主要市场的主要原因。上半年A股科创50上涨64.25%、创业板指上涨35.58%，而港股恒生科技指数下跌18.92%、恒生综合资讯科技业下跌19.56%。两地科技资产的收益差高达80-100个百分点，本质分歧不在"是否科技"，而在科技的"成色"——是算力硬件的卖水人，还是互联网应用的价格战参与者。A股科技之所以整体强，是因为其指数成分高度富集AI硬件；港股科技之所以整体弱，是因为恒生科技权重被互联网平台主导。这是"指数结构错配"，而非"中国科技资产整体被抛弃"。

在此背景下，本基金遵从价值投资原则，通过对优质企业基本面全面深入研究，选择经营稳健业绩良好的优质股票构建投资组合，我们目前权益仓位相对平稳，主要的配置方向为电子、机械设备和计算机等行业，阶段性把握住AI 硬件爆发式增长带来的机会，同时也保持组合的分散性以应对海外宏观的高波动。同时，我们也对一些前期涨幅居前的股票进行了止盈，包括通信和汽车行业中的个股。我们会根据市场的变化情况，不断反思组合管理操作上的得失，做好应对方案，去芜存菁，争取为委托人创造较好的回报。

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32.44%，同期业绩基准增长率为19.44%，C类份额净值增长率为32.35%，同期业绩基准增长率为19.44%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2026年下半年，我们认为三条关键变量决定下半年走向：一是AI算力景气持续性与中报验证——若7-8月中报继续验证光模块、存储、半导体设备材料、国产算力链高增长，则科技主线可以从"拔估值"切换为"赚业绩"，反之高估值板块面临更剧烈的去杠杆去拥挤调整；二是7月政治局会议与政策边际变化，我们会特别注意高层对国内科技发展高屋建瓴的形势判断；三是外部流动性与海外科技股的波动，主要是市场针对美联储利率调控预期反复、海外AI链回撤会放大A股科技赛道波动。总体来看，国内股票市场波动会加大，部分行业在经历大幅上涨后，风险收益比已明显弱于上半年初的水平。若下半年出现外部冲击或高拥挤赛道快速回调，反而可能为中期主线提供更有性价比的再布局窗口。同时，虽然上半年港股跌幅加大，但是随着港股市场流动性相比过往大幅抬升，而且大量新经济优质企业在港上市，提高了港股市场的配置吸引力，我们反而对港股不悲观。

权益市场主要的风险点在于：1）地缘政治走向的不确定性；2）海外美联储降息时间的延后；3）全球AI资本开支放缓。

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

本基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，相关解决方案已经上报证监会。

§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：招商沪港深科技创新主题精选灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	8,293,578.68	3,563,843.06
结算备付金		3,105,098.01	1,391,181.90
存出保证金		65,573.35	45,016.80
交易性金融资产	6.4.7.2	46,896,938.69	48,471,359.71
其中：股票投资		46,391,782.01	47,865,301.85
基金投资		-	-
债券投资		505,156.68	606,057.86
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		-	245,777.11
应收股利		13,152.00	-
应收申购款		10,514,589.46	24,451.43
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		68,888,930.19	53,741,630.01
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		9,572,152.92	1,220,110.83
应付赎回款		716,634.41	55,523.60
应付管理人报酬		20,516.91	26,281.74
应付托管费		3,419.48	4,380.29
应付销售服务费		2,076.11	2,396.48
应付投资顾问费		-	-
应交税费		4.57	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	160,035.38	197,960.68
负债合计		10,474,839.78	1,506,653.62
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	27,208,893.52	32,059,865.17
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	31,205,196.89	20,175,111.22
净资产合计		58,414,090.41	52,234,976.39
负债和净资产总计		68,888,930.19	53,741,630.01

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，招商沪港深科技创新混合 A 份额净值 2.1640 元，基金份额总额 17,132,968.28 份；招商沪港深科技创新混合 C 份额净值 2.1178 元，基金份额总额 10,075,925.24 份；总份额合计 27,208,893.52 份。

6.2 利润表

会计主体：招商沪港深科技创新主题精选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		14,011,500.97	3,107,143.54
1.利息收入		12,275.12	19,600.80
其中：存款利息收入	6.4.7.9	12,275.12	19,025.46
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		-	575.34
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		12,096,142.00	328,620.00
其中：股票投资收益	6.4.7.10	12,002,484.12	157,623.78
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	1,016.06	13,559.17
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	-	-
股利收益	6.4.7.15	92,641.82	157,437.05
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	1,820,511.90	2,623,983.38
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	82,571.95	134,939.36
减：二、营业总支出		241,899.32	231,488.81
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	144,902.65	151,865.06
其中：暂估管理人报酬		-	-
2.托管费	6.4.10.2.2	24,150.40	25,310.87
3.销售服务费	6.4.10.2.3	14,524.03	20,078.87
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		7.72	-
8.其他费用	6.4.7.19	58,314.52	34,234.01
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		13,769,601.65	2,875,654.73
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		13,769,601.65	2,875,654.73
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		13,769,601.65	2,875,654.73

6.3 净资产变动表

会计主体：招商沪港深科技创新主题精选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	32,059,865.17	-	20,175,111.22	52,234,976.39
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

二、本期期初净资产	32,059,865.17	-	20,175,111.22	52,234,976.39
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-4,850,971.65	-	11,030,085.67	6,179,114.02
（一）、综合收益总额	-	-	13,769,601.65	13,769,601.65
（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）	-4,850,971.65	-	-2,739,515.98	-7,590,487.63
其中：1.基金申购款	16,506,326.75	-	14,845,171.83	31,351,498.58
2.基金赎回款	-21,357,298.40	-	-17,584,687.81	-38,941,986.21
（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	27,208,893.52	-	31,205,196.89	58,414,090.41
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	29,541,768.51	-	10,979,692.14	40,521,460.65
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	29,541,768.51	-	10,979,692.14	40,521,460.65
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	7,240,443.81	-	7,231,802.02	14,472,245.83
（一）、综合收益总额	-	-	2,875,654.73	2,875,654.73
（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）	7,240,443.81	-	4,356,147.29	11,596,591.10
其中：1.基金申购款	23,546,117.57	-	12,898,368.30	36,444,485.87
2.基金赎回	-16,305,673.76	-	-8,542,221.01	-24,847,894.77

款				
（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	36,782,212.32	-	18,211,494.16	54,993,706.48

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

招商沪港深科技创新主题精选灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人招商基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《招商沪港深科技创新主题精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规的规定，经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]1666 号文准予公开募集注册。本基金为契约型开放式基金，存续期限为不定期。本基金首次设立募集基金份额为 200,090,030.36 份，经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证，并出具了编号为德师报(验)字(17)第 00117 号验资报告。《招商沪港深科技创新主题精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)于 2017 年 4 月 26 日正式生效。本基金的基金管理人为招商基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”)。

根据《招商沪港深科技创新主题精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《招商基金管理有限公司关于招商沪港深科技创新主题精选灵活配置混合型证券投资基金增加基金份额类别并修改基金合同和托管协议的公告》的有关规定，本基金自 2021 年 1 月 21 日起增设 C 类基金份额，C 类基金份额在投资者申购基金份额时不收取申购费用、赎回时收取赎回费用，同时从本类别基金资产中计提销售服务费；原有的基金份额自动转换为招商沪港深科技创新主题精选灵活配置混合型证券投资基金 A 类基金份额后的收费模式不变。

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《招商沪港深科技创新主题精选灵活配置混合型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(含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票等)、沪港股票市场交易互联互通机制下允许买

卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(以下简称“港股通标的股票”)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、企业债、公司债、次级债、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券(含超短期融资券)、可交换债券、中小企业私募债券、证券公司发行的短期公司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、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、权证、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。基金的投资组合比例为：本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的0-95%(其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的0-95%，投资于港股通标的股票的比例占基金资产的0-95%)，其中投资于本基金定义的“科技创新主题”相关上市公司证券不低于非现金基金资产的80%；权证投资占基金资产净值的比例为0%-3%；每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金和到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金投资于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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种或对投资比例要求有变更的，基金管理人在履行适当程序后，可以做出相应调整。

本基金的业绩比较基准为：中国战略新兴产业成份指数收益率×50%+恒生综合指数收益率(经汇率调整后)×30%+中国人民银行人民币活期存款利率(税后)×20%。

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	8,293,578.68
等于：本金	8,293,063.33
加：应计利息	515.35
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	8,293,578.68

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		44,510,399.35	-	46,391,782.01	1,881,382.66
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	502,770.00	1,506.68	505,156.68	880.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	502,770.00	1,506.68	505,156.68	880.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		45,013,169.35	1,506.68	46,896,938.69	1,882,262.66

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

本基金本报告期末无衍生金融工具。

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	1,158.66
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	122,948.17
其中：交易所市场	122,948.17
银行间市场	-
应付利息	-

预提费用	35,928.55
合计	160,035.38

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

招商沪港深科技创新混合 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	27,573,815.53	27,573,815.53
本期申购	3,324,944.07	3,324,944.07
本期赎回（以“-”号填列）	-13,765,791.32	-13,765,791.32
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	17,132,968.28	17,132,968.28

招商沪港深科技创新混合 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	4,486,049.64	4,486,049.64
本期申购	13,181,382.68	13,181,382.68
本期赎回（以“-”号填列）	-7,591,507.08	-7,591,507.08
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	10,075,925.24	10,075,925.24

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

招商沪港深科技创新混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	23,715,915.51	-6,233,190.65	17,482,724.86
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	23,715,915.51	-6,233,190.65	17,482,724.86
本期利润	10,397,742.66	1,177,424.17	11,575,166.83
本期基金份额交易产生的变动数	-11,017,250.25	1,901,664.42	-9,115,585.83
其中：基金申购款	3,344,734.26	-551,643.71	2,793,090.55
基金赎回款	-14,361,984.51	2,453,308.13	-11,908,676.38
本期已分配利润	-	-	-
本期末	23,096,407.92	-3,154,102.06	19,942,305.86

招商沪港深科技创新混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计

上年度末	3,719,009.40	-1,026,623.04	2,692,386.36
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	3,719,009.40	-1,026,623.04	2,692,386.36
本期利润	1,551,347.09	643,087.73	2,194,434.82
本期基金份额交易产生的变动数	7,859,471.45	-1,483,401.60	6,376,069.85
其中：基金申购款	15,007,076.45	-2,954,995.17	12,052,081.28
基金赎回款	-7,147,605.00	1,471,593.57	-5,676,011.43
本期已分配利润	-	-	-
本期末	13,129,827.94	-1,866,936.91	11,262,891.03

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	9,971.05
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	2,135.59
其他	168.48
合计	12,275.12

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	12,002,484.12
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	12,002,484.12

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	289,310,373.55
减：卖出股票成本总额	276,762,574.79
减：交易费用	545,314.64
买卖股票差价收入	12,002,484.12

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	3,168.06
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-2,152.00
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	1,016.06

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	3,102,584.30
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	3,091,026.00
减：应计利息总额	13,710.30
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-2,152.00

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

本基金本报告期内无衍生工具其他投资收益。

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	92,641.82
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	92,641.82

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	1,820,511.90
——股票投资	1,819,715.90
——债券投资	796.00

——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
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	1,820,511.90

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	82,571.95
合计	82,571.95

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	1,078.93
信息披露费	34,849.62
证券出借违约金	-
其他	22,385.97
合计	58,314.52

注：本报告期内，基金管理人自主承担了本基金迷你期间的相关固定费用。

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

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 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
招商证券	45,843,610.60	8.15%	4,357,875.52	0.76%

6.4.10.1.2 债券交易

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 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
招商证券	2,488,760.00	40.92%	-	-

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	21,455.65	8.33%	21,455.65	17.45%
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	1,943.37	0.72%	1,943.37	1.44%

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 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	144,902.65	151,865.06
其中：应支付销售机构的客户维护费	46,491.92	50,208.55
应支付基金管理人的净管理费	98,410.73	101,656.51

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×0.60%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：

日基金管理人报酬＝前一日基金资产净值×0.60%÷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	24,150.40	25,310.87

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：

日基金托管费＝前一日基金资产净值×0.10%÷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

	招商沪港深科技创新混合 A	招商沪港深科技创新混合 C	合计
招商基金管理有限公司	-	5,415.07	5,415.07
招商银行	-	3,538.66	3,538.66
招商证券	-	0.14	0.14
合计	-	8,953.87	8,953.87
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		
	招商沪港深科技创新混合 A	招商沪港深科技创新混合 C	合计
招商基金管理有限公司	-	9,926.88	9,926.88
招商银行	-	3,506.69	3,506.69
招商证券	-	9.76	9.76
合计	-	13,443.33	13,443.33

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

C 类份额日销售服务费=前一日 C 类基金资产净值×0.40%÷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	
	招商沪港深科技创新混合 A	招商沪港深科技创新混合 C

基金合同生效日（2017 年 4 月 26 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	7,489,249.97	-
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	3,961,166.43	-
报告期末持有的基金份额	3,528,083.54	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	20.59%	-

项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	招商沪港深科技创新混合 A	招商沪港深科技创新混合 C
基金合同生效日（2017 年 4 月 26 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	3,961,166.43	-
报告期间申购/买入总份额	3,528,083.54	-
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	7,489,249.97	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	25.31%	-

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	8,293,578.68	9,971.05	3,961,363.11	15,381.50

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

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

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

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	8,293,578.68	-	-	-	8,293,578.68
结算备付金	3,105,098.01	-	-	-	3,105,098.01
存出保证金	65,573.35	-	-	-	65,573.35
交易性金融资产	400,658.30	-	104,498.38	46,391,782.01	46,896,938.69
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	13,152.00	13,152.00
应收申购款	-	-	-	10,514,589.46	10,514,589.46
应收清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	11,864,908.34	-	104,498.38	56,919,523.47	68,888,930.19
负债					
应付赎回款	-	-	-	716,634.41	716,634.41
应付管理人报酬	-	-	-	20,516.91	20,516.91
应付托管费	-	-	-	3,419.48	3,419.48
应付清算款	-	-	-	9,572,152.92	9,572,152.92
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	2,076.11	2,076.11
应付投资顾问费	-	-	-	-	-

应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	4.57	4.57
其他负债	-	-	-	160,035.38	160,035.38
负债总计	-	-	-	10,474,839.78	10,474,839.78
利率敏感度缺口	11,864,908.34	-	104,498.38	46,444,683.69	58,414,090.41
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	3,563,843.06	-	-	-	3,563,843.06
结算备付金	1,391,181.90	-	-	-	1,391,181.90
存出保证金	45,016.80	-	-	-	45,016.80
交易性金融资产	606,057.86	-	-	47,865,301.85	48,471,359.71
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	-	-	-	24,451.43	24,451.43
应收清算款	-	-	-	245,777.11	245,777.11
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	5,606,099.62	-	-	48,135,530.39	53,741,630.01
负债					
应付赎回款	-	-	-	55,523.60	55,523.60
应付管理人报酬	-	-	-	26,281.74	26,281.74
应付托管费	-	-	-	4,380.29	4,380.29
应付清算款	-	-	-	1,220,110.83	1,220,110.83
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	2,396.48	2,396.48
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	197,960.68	197,960.68
负债总计	-	-	-	1,506,653.62	1,506,653.62
利率敏感度缺口	5,606,099.62	-	-	46,628,876.77	52,234,976.39

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	-5,464.27	-859.84
	2. 市场利率平行下降 50 个基点	5,552.76	862.58

6.4.13.4.2 外汇风险

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
货币资金	-	-	-	-
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	-	9,175,727.01	-	9,175,727.01
衍生金融资产	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	9,175,727.01	-	9,175,727.01
以外币计价的负债				
应付清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	9,175,727.01	-	9,175,727.01

项目	上年度末 2025 年 12 月 31 日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
货币资金	-	-	-	-
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	-	12,261,030.85	-	12,261,030.85

衍生金融资产	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	12,261,030.85	-	12,261,030.85
以外币计价的负债				
应付清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	12,261,030.85	-	12,261,030.85

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的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. 所有外币相对人民币升值 5%	458,786.35	613,051.54
	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-458,786.35	-613,051.54

6.4.13.4.3 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。

6.4.13.4.3.1 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	46,391,782.01	79.42	47,865,301.85	91.63
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	46,391,782.01	79.42	47,865,301.85	91.63

6.4.13.4.3.2 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%	2,319,589.10	2,393,265.09
	2. 权益性投资的市场价格下降 5%	-2,319,589.10	-2,393,265.09

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	46,391,782.01	47,865,301.85
第二层次	505,156.68	606,057.86
第三层次	-	-
合计	46,896,938.69	48,471,359.71

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	46,391,782.01	67.34
	其中：股票	46,391,782.01	67.34
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	505,156.68	0.73
	其中：债券	505,156.68	0.73
	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	11,398,676.69	16.55
8	其他各项资产	10,593,314.81	15.38
9	合计	68,888,930.19	100.00

注：上表权益投资中通过港股通交易机制投资的港股金额人民币 9,175,727.01 元，占基金净值比例 15.71%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	33,330,260.00	57.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,445,795.00	4.19
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,440,000.00	2.47
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	37,216,055.00	63.71

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
通信服务	1,679,862.56	2.88
非日常生活消费品	1,189,913.50	2.04
日常消费品	-	-
能源	-	-
金融	-	-
医疗保健	255,701.12	0.44
工业	789,077.68	1.35
信息技术	5,261,172.15	9.01
原材料	-	-
房地产	-	-
公用事业	-	-
合计	9,175,727.01	15.71

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	002475	立讯精密	25,000	1,760,000.00	3.01
2	00700	腾讯控股	4,500	1,679,862.56	2.88
3	300476	胜宏科技	3,000	1,039,290.00	1.78
3	02476	胜宏科技	2,000	606,942.74	1.04
4	688200	华峰测控	2,960	1,554,296.00	2.66
5	301188	力诺药包	22,000	1,471,800.00	2.52
6	300347	泰格医药	30,000	1,440,000.00	2.47
7	688167	炬光科技	4,000	1,416,840.00	2.43
8	000977	浪潮信息	20,000	1,400,000.00	2.40
9	688531	日联科技	7,500	1,333,800.00	2.28
10	603011	合锻智能	40,000	1,323,200.00	2.27
11	300274	阳光电源	8,000	1,272,160.00	2.18
12	300757	罗博特科	2,000	1,238,000.00	2.12
13	03690	美团-W	20,000	1,189,913.50	2.04
14	688322	奥比中光	9,000	1,174,950.00	2.01
15	688702	盛科通信	3,000	1,169,970.00	2.00
16	00981	中芯国际	15,000	1,164,725.55	1.99
17	603019	中科曙光	10,000	1,072,300.00	1.84
18	600183	生益科技	6,000	1,040,400.00	1.78
19	06613	蓝思科技	40,000	971,386.32	1.66
20	688352	颀中科技	40,000	967,200.00	1.66
21	688170	德龙激光	10,000	960,100.00	1.64
22	603308	应流股份	15,000	906,000.00	1.55
23	300394	天孚通信	2,800	847,504.00	1.45
24	301486	致尚科技	4,000	833,280.00	1.43
25	01304	FORTIOR	4,000	488,472.52	0.84
25	688279	峰岹科技	1,500	336,660.00	0.58
26	03200	大族数控	5,000	789,077.68	1.35
27	06166	剑桥科技	6,000	786,385.17	1.35
28	688409	富创精密	2,500	765,625.00	1.31
29	000066	中国长城	40,000	762,000.00	1.30
30	301307	美利信	10,000	752,900.00	1.29
31	00992	联想集团	36,000	719,784.76	1.23
32	300604	长川科技	2,000	682,840.00	1.17
33	688392	骄成超声	3,000	681,540.00	1.17
34	002436	兴森科技	13,000	662,350.00	1.13
35	301629	矽电股份	1,500	645,600.00	1.11

36	605358	立昂微	8,000	620,800.00	1.06
37	300408	三环集团	3,000	500,700.00	0.86
38	688256	寒武纪	300	478,665.00	0.82
39	688141	杰华特	3,000	460,500.00	0.79
40	688700	东威科技	5,000	447,000.00	0.77
41	688135	利扬芯片	10,000	420,800.00	0.72
42	688603	天承科技	2,000	415,900.00	0.71
43	300308	中际旭创	300	381,000.00	0.65
44	300136	信维通信	3,000	357,750.00	0.61
45	02631	天岳先进	4,000	351,241.62	0.60
46	300482	万孚生物	20,000	332,200.00	0.57
47	002735	王子新材	20,000	324,600.00	0.56
48	688655	迅捷兴	6,000	321,360.00	0.55
49	300179	四方达	5,000	297,150.00	0.51
50	688127	蓝特光学	3,000	292,800.00	0.50
51	300811	铂科新材	3,000	284,670.00	0.49
52	002850	科达利	1,500	283,950.00	0.49
53	02595	劲方医药-B	10,000	255,701.12	0.44
54	688686	奥普特	1,500	252,585.00	0.43
55	688048	长光华芯	500	251,000.00	0.43
56	301588	美新科技	5,000	218,800.00	0.37
57	601208	东材科技	3,000	212,370.00	0.36
58	601126	四方股份	3,000	189,600.00	0.32
59	300400	劲拓股份	5,000	188,250.00	0.32
60	002028	思源电气	1,000	173,000.00	0.30
61	01888	建滔积层板	2,000	172,233.47	0.29

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	688167	炬光科技	5,530,067.77	10.59
2	02865	钧达股份	4,948,522.04	9.47
3	00700	腾讯控股	4,920,852.59	9.42
4	000066	中国长城	2,985,041.00	5.71
5	06166	剑桥科技	2,933,397.93	5.62
6	688516	奥特维	2,857,340.65	5.47
7	300274	阳光电源	2,777,044.00	5.32
8	688234	天岳先进	1,396,080.67	2.67
8	02631	天岳先进	1,374,854.30	2.63
9	300418	昆仑万维	2,649,437.00	5.07

10	300394	天孚通信	2,642,615.00	5.06
11	03896	金山云	2,593,695.90	4.97
12	09988	阿里巴巴-W	2,551,837.02	4.89
13	02015	理想汽车-W	2,539,063.83	4.86
14	300757	罗博特科	2,534,973.00	4.85
15	301363	美好医疗	2,329,915.00	4.46
16	00981	中芯国际	2,269,155.70	4.34
17	01801	信达生物	2,239,039.10	4.29
18	688559	海目星	2,210,406.51	4.23
19	06088	FIT HON TENG	2,206,027.24	4.22
20	688041	海光信息	2,192,724.66	4.20
21	688365	光云科技	2,130,133.55	4.08
22	300017	网宿科技	2,121,033.00	4.06
23	688352	颀中科技	2,104,585.94	4.03
24	000977	浪潮信息	2,029,248.16	3.88
25	300316	晶盛机电	2,025,478.00	3.88
26	603019	中科曙光	2,001,983.00	3.83
27	603011	合锻智能	1,933,259.00	3.70
28	601231	环旭电子	1,890,033.00	3.62
29	688548	广钢气体	1,812,403.66	3.47
30	688106	金宏气体	1,771,404.27	3.39
31	002475	立讯精密	1,757,158.00	3.36
32	00941	中国移动	1,380,512.60	2.64
32	600941	中国移动	373,434.00	0.71
33	300058	蓝色光标	1,717,553.30	3.29
34	301128	强瑞技术	1,705,179.00	3.26
35	300476	胜宏科技	1,093,804.00	2.09
35	02476	胜宏科技	604,124.19	1.16
36	603179	新泉股份	1,667,749.00	3.19
37	603308	应流股份	1,645,067.01	3.15
38	600183	生益科技	1,616,617.00	3.09
39	300136	信维通信	1,613,767.00	3.09
40	603031	安孚科技	1,600,247.00	3.06
41	03690	美团-W	1,592,145.66	3.05
42	605376	博迁新材	1,579,064.00	3.02
43	688322	奥比中光	1,568,455.33	3.00
44	688661	和林微纳	1,566,239.92	3.00
45	688387	信科移动	1,559,119.51	2.98
46	301188	力诺药包	1,550,987.00	2.97
47	601778	晶科科技	1,505,804.00	2.88
48	01347	华虹宏力	1,504,428.11	2.88
49	688498	源杰科技	1,492,355.59	2.86
50	300570	太辰光	1,474,768.00	2.82

51	002273	水晶光电	1,470,101.00	2.81
52	301232	飞沃科技	1,466,040.00	2.81
53	301550	斯菱智驱	1,455,033.00	2.79
54	688700	东威科技	1,448,210.79	2.77
55	688311	盟升电子	1,437,346.72	2.75
56	300033	同花顺	1,418,873.00	2.72
57	688127	蓝特光学	1,411,637.18	2.70
58	03738	阜博集团	1,380,322.63	2.64
59	02013	微盟集团	1,344,236.51	2.57
60	688531	日联科技	1,342,643.72	2.57
61	688409	富创精密	1,337,918.09	2.56
62	301307	美利信	1,319,001.00	2.53
63	002837	英维克	1,311,798.90	2.51
64	300199	翰宇药业	1,302,102.00	2.49
65	300806	斯迪克	1,274,577.00	2.44
66	300285	国瓷材料	1,263,585.00	2.42
67	920394	民士达	1,259,877.76	2.41
68	01530	三生制药	1,254,830.97	2.40
69	688519	南亚新材	1,253,751.79	2.40
70	688256	寒武纪	1,236,051.00	2.37
71	688279	峰岹科技	784,550.56	1.50
71	01304	FORTIOR	444,314.96	0.85
72	301536	星宸科技	1,222,661.00	2.34
73	300870	欧陆通	1,199,881.00	2.30
74	300490	华自科技	1,183,994.00	2.27
75	300347	泰格医药	1,177,464.00	2.25
76	00992	联想集团	1,156,093.34	2.21
77	02018	瑞声科技	1,151,942.39	2.21
78	603920	世运电路	1,138,378.00	2.18
79	002465	海格通信	1,117,024.00	2.14
80	300454	深信服	1,105,120.00	2.12
81	300014	亿纬锂能	1,100,787.00	2.11
82	688205	德科立	1,096,191.82	2.10
83	01024	快手-W	1,085,082.87	2.08
84	300943	春晖智控	1,084,669.00	2.08
85	603119	浙江荣泰	1,082,240.00	2.07
86	688607	康众医疗	1,081,656.63	2.07
87	688009	中国通号	1,080,447.63	2.07
88	002290	禾盛新材	1,057,938.00	2.03
89	300604	长川科技	1,054,274.00	2.02
90	300846	首都在线	1,053,350.00	2.02
91	301338	凯格精机	1,052,430.00	2.01
92	688187	时代电气	1,045,914.67	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	688167	炬光科技	5,148,219.31	9.86
2	02865	钧达股份	5,084,582.59	9.73
3	00700	腾讯控股	3,989,671.22	7.64
4	09988	阿里巴巴-W	3,937,959.28	7.54
5	300418	昆仑万维	3,911,844.00	7.49
6	688234	天岳先进	1,936,490.30	3.71
6	02631	天岳先进	1,692,807.25	3.24
7	688516	奥特维	3,264,113.15	6.25
8	688256	寒武纪	3,201,633.69	6.13
9	03896	金山云	2,731,665.81	5.23
10	603986	兆易创新	2,677,901.00	5.13
11	688041	海光信息	2,614,700.85	5.01
12	02015	理想汽车-W	2,424,977.02	4.64
13	01801	信达生物	2,316,434.34	4.43
14	688548	广钢气体	2,307,703.49	4.42
15	002273	水晶光电	2,268,778.15	4.34
16	688008	澜起科技	2,264,812.94	4.34
17	300316	晶盛机电	2,183,166.00	4.18
18	06166	剑桥科技	2,144,112.68	4.10
19	06088	FIT HON TENG	2,126,762.30	4.07
20	688668	鼎通科技	2,099,047.50	4.02
21	601231	环旭电子	2,070,035.00	3.96
22	603031	安孚科技	2,037,418.00	3.90
23	301363	美好医疗	2,016,730.00	3.86
24	300058	蓝色光标	2,006,104.16	3.84
25	688106	金宏气体	1,990,368.36	3.81
26	603920	世运电路	1,983,373.00	3.80
27	03690	美团-W	1,942,515.16	3.72
28	688365	光云科技	1,939,537.44	3.71
29	300394	天孚通信	1,933,587.00	3.70
30	688498	源杰科技	1,898,015.73	3.63
31	605376	博迁新材	1,864,596.00	3.57
32	688559	海目星	1,853,069.95	3.55

33	300017	网宿科技	1,836,089.00	3.52
34	00941	中国移动	1,417,404.43	2.71
34	600941	中国移动	374,839.00	0.72
35	688352	颀中科技	1,789,811.49	3.43
36	000066	中国长城	1,782,022.00	3.41
37	601778	晶科科技	1,704,303.00	3.26
38	000725	京东方 A	1,693,500.00	3.24
39	02423	贝壳-W	1,685,141.14	3.23
40	301128	强瑞技术	1,673,356.20	3.20
41	300570	太辰光	1,667,947.00	3.19
42	002475	立讯精密	1,630,802.00	3.12
43	301550	斯菱智驱	1,597,142.00	3.06
44	01024	快手-W	1,596,733.38	3.06
45	688661	和林微纳	1,586,700.02	3.04
46	01810	小米集团-W	1,559,395.28	2.99
47	01347	华虹宏力	1,529,929.03	2.93
48	688322	奥比中光	1,497,934.38	2.87
49	688519	南亚新材	1,473,711.64	2.82
50	301232	飞沃科技	1,461,594.80	2.80
51	300757	罗博特科	1,461,379.00	2.80
52	688629	华丰科技	1,458,508.85	2.79
53	300199	翰宇药业	1,455,300.00	2.79
54	300285	国瓷材料	1,435,856.00	2.75
55	002837	英维克	1,408,874.00	2.70
56	688387	信科移动	1,407,276.38	2.69
57	300870	欧陆通	1,400,728.00	2.68
58	688249	晶合集成	1,395,847.69	2.67
59	002001	新和成	1,393,888.00	2.67
60	688409	富创精密	1,343,924.42	2.57
61	301396	宏景科技	1,338,569.00	2.56
62	688311	盟升电子	1,320,920.67	2.53
63	603179	新泉股份	1,320,076.00	2.53
64	300033	同花顺	1,317,126.00	2.52
65	603256	宏和科技	1,309,694.00	2.51
66	688127	蓝特光学	1,305,442.79	2.50
67	300806	斯迪克	1,300,118.00	2.49
68	02192	医脉通	1,296,210.48	2.48
69	688017	绿的谐波	1,273,551.96	2.44
70	300490	华自科技	1,268,758.00	2.43
71	300750	宁德时代	1,268,532.00	2.43
72	688700	东威科技	1,250,887.06	2.39
73	02018	瑞声科技	1,245,248.62	2.38
74	688233	神工股份	1,242,441.74	2.38

75	300274	阳光电源	1,210,386.00	2.32
76	688205	德科立	1,208,575.54	2.31
77	301338	凯格精机	1,189,336.00	2.28
78	300034	钢研高纳	1,186,678.00	2.27
79	688037	芯源微	1,181,964.24	2.26
80	300846	首都在线	1,179,858.00	2.26
81	688020	方邦股份	1,175,473.30	2.25
82	300136	信维通信	1,172,318.00	2.24
83	920394	民士达	1,172,188.07	2.24
84	301117	佳缘科技	1,164,915.00	2.23
85	600498	烽火通信	1,157,865.00	2.22
86	03738	阜博集团	1,155,903.64	2.21
87	01530	三生制药	1,146,977.75	2.20
88	02359	药明康德	1,145,027.95	2.19
89	301536	星宸科技	1,144,713.00	2.19
90	02513	智谱	1,140,596.70	2.18
91	688503	聚和材料	1,111,111.28	2.13
92	02013	微盟集团	1,091,391.39	2.09
93	300699	光威复材	1,079,016.00	2.07
94	002943	宇晶股份	1,078,526.40	2.06
95	002240	盛新锂能	1,070,794.24	2.05
96	600216	浙江医药	1,062,369.00	2.03

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	273,469,339.05
卖出股票收入（成交）总额	289,310,373.55

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	505,156.68	0.86
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	505,156.68	0.86

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	019835	26国债09	4,000	400,658.30	0.69
2	019753	24国债17	1,000	104,498.38	0.18

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

为更好地实现投资目标，本基金在注重风险管理的前提下，以套期保值为目的，适度运用股指期货、国债期货等金融衍生品。本基金利用金融衍生品合约流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点，提高投资组合运作效率。本基金采取套期保值的方式参与股指期货的投资交易，以管理市场风险和调节股票仓位为主要目的。

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

为更好地实现投资目标，本基金在注重风险管理的前提下，以套期保值为目的，适度运用股指期货、国债期货等金融衍生品。本基金利用金融衍生品合约流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点，提高投资组合运作效率。

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，立讯精密工业股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家市场监督管理总局的处罚。西安炬光科技股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到西安市市场监管局高新区分局的处罚。

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	65,573.35
2	应收清算款	-
3	应收股利	13,152.00
4	应收利息	-
5	应收申购款	10,514,589.46
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,593,314.81

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

本基金本报告期末投资前十名股票中不存在流通受限情况。

§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
招商沪港深科技创新混合 A	2,016	8,498.50	3,528,180.88	20.59%	13,604,787.40	79.41%
招商沪港深科技创新混合 C	734	13,727.42	7,519,656.22	74.63%	2,556,269.02	25.37%
合计	2,750	9,894.14	11,047,837.10	40.60%	16,161,056.42	59.40%

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 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025 年 07 月 01 日-2026 年 06 月 30 日）
盈利投资者数量占比	93.71%

注：盈利投资者数量占比=盈利投资者数量/投资者总数

其中，投资者指指标计算期间持有过基金份额的投资者，盈利投资者指投资者区间净收益不小于零的投资者。

投资者区间净收益=投资者区间收益-基金交易手续费（认申购费、赎回费、转换费等）。其中，区间收益=持有期末市值-持有期初市值+（赎回+转出+非交易过户出）-（认购+申购+定投+转入+非交易过户入）+现金分红

该指标计算时剔除持有期限不满 7 日的交易。

8.3 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	招商沪港深科技创新混合A	388,731.65	2.2689%
	招商沪港深科技创新混合C	13,141.43	0.1304%
	合计	401,873.08	1.4770%

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）。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	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	招商沪港深科技创新混合A	0
	招商沪港深科技创新混合C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	招商沪港深科技创新混合A	10~50
	招商沪港深科技创新混合C	0
	合计	10~50

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	招商沪港深科技创新混合A	招商沪港深科技创新混合C
基金合同生效日(2017年4月26日)基金份额总额	200,090,030.36	-
本报告期期初基金份额总额	27,573,815.53	4,486,049.64
本报告期基金总申购份额	3,324,944.07	13,181,382.68
减：本报告期基金总赎回份额	13,765,791.32	7,591,507.08
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	17,132,968.28	10,075,925.24

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、公募基金托管业务的重大诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

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

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华西证券	3	54,007,474.32	9.60%	24,932.52	9.68%	-
中泰证券	2	49,538,842.48	8.80%	22,089.45	8.58%	-
招商证券	4	45,843,610.60	8.15%	21,455.65	8.33%	本报告

						期减少1 个
华源证券	2	45,748,990.17	8.13%	20,648.70	8.02%	-
平安证券	2	42,383,015.81	7.53%	18,898.66	7.34%	本报告期减少1 个
华福证券	2	37,221,414.61	6.61%	18,610.73	7.22%	-
开源证券	2	33,693,323.88	5.99%	15,024.00	5.83%	-
天风证券	2	27,710,227.13	4.92%	12,356.32	4.80%	-
东吴证券	2	26,690,804.80	4.74%	11,902.08	4.62%	本报告期减少4 个
国泰海通证券	7	26,230,098.21	4.66%	11,695.05	4.54%	-
国信证券	3	25,186,864.27	4.48%	11,230.58	4.36%	-
长江证券	4	21,857,451.50	3.88%	10,928.73	4.24%	-
国海证券	4	21,802,054.83	3.87%	10,015.76	3.89%	本报告期新增1 个
浙商证券	2	20,358,959.55	3.62%	9,078.66	3.52%	-
东北证券	3	16,875,432.30	3.00%	7,524.80	2.92%	-
兴业证券	2	14,141,623.44	2.51%	6,941.47	2.69%	-
国金证券	1	12,965,745.86	2.30%	5,781.49	2.24%	-
东方证券	3	11,868,360.88	2.11%	5,934.18	2.30%	-
华泰证券	4	9,278,150.51	1.65%	4,136.95	1.61%	-
中信证券	7	7,801,672.42	1.39%	3,244.80	1.26%	本报告期减少1 个
中金公司	5	5,567,724.52	0.99%	2,482.65	0.96%	-
光大证券	3	3,678,094.51	0.65%	1,640.04	0.64%	-
西部证券	1	2,329,776.00	0.41%	1,038.80	0.40%	-
北京证券	2	-	-	-	-	-
财通证券	3	-	-	-	-	-
诚通证券	1	-	-	-	-	-
大通证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	4	-	-	-	-	-
第一创业	3	-	-	-	-	-
东方财富	3	-	-	-	-	-
东海证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	本报告期减少1 个
方正证券	3	-	-	-	-	本报告

						期减少1个
广发证券	6	-	-	-	-	-
国联民生	4	-	-	-	-	本报告期减少5个
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国投证券	2	-	-	-	-	本报告期减少2个
国新证券	2	-	-	-	-	-
国元证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
华宝证券	2	-	-	-	-	本报告期减少2个
华创证券	4	-	-	-	-	-
华金证券	4	-	-	-	-	-
华鑫证券	2	-	-	-	-	-
汇丰前海证券	2	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	本报告期新增
南京证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	6	-	-	-	-	-
上海证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	本报告期减少1个
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
天府证券	2	-	-	-	-	-
万和证券	1	-	-	-	-	-
五矿证券	2	-	-	-	-	-
湘财证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-

甬兴证券	2	-	-	-	-	-
粤开证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	本报告期减少2个
中航证券	2	-	-	-	-	-
中金财富证券	2	-	-	-	-	-
中信建投证券	2	-	-	-	-	-
中银国际证券	2	-	-	-	-	本报告期减少1个
中邮证券	2	-	-	-	-	-

注：（一）选择标准

1、证券公司应财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强，并通过基金管理人的尽职调查。

2、被动股票型基金选择佣金费率相对较低，能够提供优质证券交易服务的证券公司。

3、被动股票型基金以外类型基金选择能够提供优质研究服务的证券公司。

（二）选择程序

1、基金管理人根据上述标准进行评估并确定选用的证券公司。

2、基金管理人与被选择的证券公司签订交易单元租用协议/证券经纪服务协议。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华西证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	2,488,760.00	40.92%	-	-	-	-
华源证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	399,780.00	6.57%	-	-	-	-
天风证券	600,114.00	9.87%	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通证券	-	-	-	-	-	-

国信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	500,660.00	8.23%	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
光大证券	2,093,260.00	34.41%	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
北京证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
诚通证券	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国联民生	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
国新证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
汇丰前海证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-

申万宏源	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
天府证券	-	-	-	-	-	-
万和证券	-	-	-	-	-	-
五矿证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
甬兴证券	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
中金财富证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	招商沪港深科技创新主题精选灵活配置混合型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-01-21
2	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	中国证券报及基金管理人网站	2026-01-21
3	招商沪港深科技创新主题精选灵活配置混合型证券投资基金 2025 年年度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-31
4	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	中国证券报及基金管理人网站	2026-03-31
5	关于旗下部分基金 2026 年 4 月 3 日、2026 年 4 月 7 日因港股通非交易日及境外主要投资市场节假日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-04-02
6	招商沪港深科技创新主题精选灵活配置混合型	基金管理人网站及中	2026-04-22

	证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	国证监会基金电子披露网站	
7	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	中国证券报及基金管理人网站	2026-04-22
8	招商沪港深科技创新主题精选灵活配置混合型证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要更新	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-04-24
9	招商沪港深科技创新主题精选灵活配置混合型证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要更新	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-04-24
10	招商沪港深科技创新主题精选灵活配置混合型证券投资基金更新的招募说明书（二零二六年第一号）	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-04-24
11	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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-05-14
12	关于旗下部分基金 2026 年 5 月 25 日因港股通非交易日及境外主要投资市场节假日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-05-21
13	招商基金管理有限公司关于旗下基金估值变更的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-06-19
14	招商沪港深科技创新主题精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同（2026 年 7 月 27 日修订）	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-06-26
15	招商基金管理有限公司关于旗下部分基金调整业绩比较基准并修订基金合同等法律文件的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-06-26
16	关于旗下部分基金 2026 年 7 月 1 日因港股通非交易日及境外主要投资市场节假日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-06-29

§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	20260101-20260310	7,489,249.97	-	3,961,166.43	3,528,083.54	12.97%
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沪港深科技创新主题精选灵活配置混合型证券投资基金设立的文件；

3、《招商沪港深科技创新主题精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；

4、《招商沪港深科技创新主题精选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；

5、《招商沪港深科技创新主题精选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；

6、基金管理人业务资格批件、营业执照。

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