

招商中证 500 等权重指数增强型证券 投资基金 2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人：招商基金管理有限公司

基金托管人：中信证券股份有限公司

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。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	4
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	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	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	13
6.3 净资产变动表	14
6.4 报表附注	16
§7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	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	41
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	53
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	53
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	53
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	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	54
7.12 投资组合报告附注	54
§8 基金份额持有人信息	55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
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	56
§9 开放式基金份额变动	56
§10 重大事件揭示	57
10.1 基金份额持有人大会决议	57
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	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	57
10.4 基金投资策略的改变	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	57
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	57
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	58
10.8 其他重大事件	58
§11 影响投资者决策的其他重要信息	60
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	60
§12 备查文件目录	60
12.1 备查文件目录	60
12.2 存放地点	61
12.3 查阅方式	61

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	招商中证 500 等权重指数增强型证券投资基金	
基金简称	招商中证 500 等权重指数增强	
基金主代码	009726	
交易代码	009726	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 12 月 23 日	
基金管理人	招商基金管理有限公司	
基金托管人	中信证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	319,281,868.19 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	招商中证 500 等权重指数增强 A	招商中证 500 等权重指数增强 C
下属分级基金的交易代码	009726	009727
报告期末下属分级基金的份额总额	217,866,894.20 份	101,414,973.99 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 7.75%。
投资策略	大类资产配置策略：本基金作为增强指数型基金，以跟踪中证 500 等权重指数为主，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。 其他投资策略包括：（1）股票投资策略；（2）债券投资策略；（3）股指期货投资策略；（4）国债期货投资策略；（5）资产支持证券投资策略；（6）参与融资及转融通证券出借业务策略；（7）存托凭证投资策略。
业绩比较基准	中证 500 等权重指数收益率*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。

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	中信证券股份有限公司

信息披露负责人	姓名	潘西里	杨军智
	联系电话	0755—83196666	010-60834299
	电子邮箱	cmf@cmfchina.com	yjz@citics.com
客户服务电话		400-887-9555	010-60836588
传真		0755—83196475	010-60834004
注册地址		深圳市福田区深南大道 7088 号	广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座
办公地址		深圳市福田区深南大道 7088 号	北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦 5 层
邮政编码		518040	100125
法定代表人		王颖	张佑君

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 500 等权重指数增强 A

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	70,685,549.21
本期利润	37,913,135.53
加权平均基金份额本期利润	0.1499
本期加权平均净值利润率	8.25%
本期基金份额净值增长率	8.65%
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	185,925,422.66
期末可供分配基金份额利润	0.8534
期末基金资产净值	403,792,316.86
期末基金份额净值	1.8534
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	85.34%

2、招商中证 500 等权重指数增强 C

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	67,608,010.21
本期利润	40,165,420.85
加权平均基金份额本期利润	0.1684
本期加权平均净值利润率	9.65%
本期基金份额净值增长率	8.21%
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	78,455,760.10
期末可供分配基金份额利润	0.7736
期末基金资产净值	179,870,734.09
期末基金份额净值	1.7736
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	77.36%

注：1、基金业绩指标不包括持有人认（申）购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

招商中证 500 等权重指数增强 A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	8.35%	1.43%	6.45%	1.32%	1.90%	0.11%
过去六个月	8.65%	1.41%	8.53%	1.38%	0.12%	0.03%
过去一年	32.21%	1.20%	32.02%	1.20%	0.19%	0.00%
过去三年	46.10%	1.34%	31.38%	1.36%	14.72%	-0.02%
过去五年	59.40%	1.26%	25.55%	1.25%	33.85%	0.01%
自基金合同 生效起至今	85.34%	1.23%	34.52%	1.22%	50.82%	0.01%

招商中证 500 等权重指数增强 C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标	业绩比较 基准收益	业绩比较 基准收益	①-③	②-④
----	--------------	--------------	--------------	--------------	-----	-----

		准差②	率③	率标准差 ④		
过去三个月	8.12%	1.43%	6.45%	1.32%	1.67%	0.11%
过去六个月	8.21%	1.41%	8.53%	1.38%	-0.32%	0.03%
过去一年	31.14%	1.20%	32.02%	1.20%	-0.88%	0.00%
过去三年	42.63%	1.34%	31.38%	1.36%	11.25%	-0.02%
过去五年	53.17%	1.26%	25.55%	1.25%	27.62%	0.01%
自基金合同 生效起至今	77.36%	1.23%	34.52%	1.22%	42.84%	0.01%

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

招商中证500等权重指数增强A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



招商中证500等权重指数增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

招商基金管理有限公司拥有公开募集证券投资基金管理、基金销售、全国社会保障基金境内委托管理、企业年金和职业年金基金投资管理、合格境内机构投资者、特定客户资产管理、保险资金投资管理、基本养老保险基金投资管理、公募基金投资顾问业务试点资格。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
蔡振	本基金基金经理	2025 年 4 月 23 日	-	11	男，硕士。2014 年 7 月加入招商基金管理有限公司量化投资部,曾任 ETF 专员、研究员,主要从事量化投资策略的研究,曾任招商安福 1 年定期开放债券型发起式证券投资基金、招商盛合灵活配置混合型证券投资基金基金经理,现任招商安阳债券型证券投资基金、招商安盈债

					券型证券投资基金、招商中证 1000 指数增强型证券投资基金、招商安嘉债券型证券投资基金、招商中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、招商安凯债券型证券投资基金、招商兴福灵活配置混合型证券投资基金、招商沪深 300 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、招商中证 500 等权重指数增强型证券投资基金、招商红利量化选股混合型证券投资基金、招商沪深 300 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、招商上证科创板综合价格指数增强型发起式证券投资基金、招商安琪债券型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

招商中证 500 等权指数增强 A 份额在上半年上涨 8.65%，C 份额在上半年上涨 8.21%。今年以来产品主要沿着两个方向努力实现收益的增强，第一个方向是常规的指增，组合通过趋势跟踪模型进行超额收益的增强，但报告期内趋势模型表现异常艰难，一季度在有色和微盘的干扰下，模型无法确定市场的趋势主线在哪里，二季度市场主线回归到成长风格上，一方面成长的域走得非常窄，同时趋势模型识别成长风格有一定的滞后，因而未能抓住这段投资机会。第二个方向是长期配置增强，组合通过将中证 500 等权指数内的成分股进行分割，构建偏成长的增强模型和偏价值的增强模型，然后再基于我们设计的长周期配置策略对两个子模型进行配置。其中，成长子模型获得一定的超额收益，但价值子模型大幅跑输基准指数，而二者的配置比例各约 50%，使得最终的综合收益并不理想。组合的长周期配置模型会在市场的底部不断增加进攻性策略的配置，在市场的顶部不断增加防守性策略的配置，其作用周期相对较长，短期的配置效果会不太显著。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金 A 类份额净值增长率为 8.65%，同期业绩基准增长率为 8.53%，C 类份额净值增长率为 8.21%，同期业绩基准增长率为 8.53%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从截止报告期末资金的集聚程度和二季报持仓集中度看，TMT 的拥挤度比我们想象中还要大，后续资金的博弈可能会更加激烈，这使得 AI+半导体中的强势个股难以获得类似之前

的合力。我们认为风格将适当走向均衡，但切换为价值的时间点可能还未到来，如果成长风格更加分散，将有望改善我们策略的投资环境。

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，本托管人在对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，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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，管理人在本基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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

本报告期，由基金管理人编制并经托管人复核审查的有关本基金本报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：招商中证 500 等权重指数增强型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	32,101,388.65	61,885,373.79
结算备付金		5,714,930.13	9,232,503.69
存出保证金		420,547.20	1,066,550.40
交易性金融资产	6.4.7.2	549,288,901.10	889,596,645.91
其中：股票投资		549,288,901.10	889,596,645.91
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		3,571,449.29	3,763,082.92
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		591,097,216.37	965,544,156.71
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		6,539,290.67	14,246,707.56
应付管理人报酬		583,870.03	1,002,933.49
应付托管费		97,311.68	167,155.59
应付销售服务费		121,624.43	361,188.12
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	92,068.61	66,523.58
负债合计		7,434,165.42	15,844,508.34
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	319,281,868.19	568,390,786.13
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	264,381,182.76	381,308,862.24
净资产合计		583,663,050.95	949,699,648.37
负债和净资产总计		591,097,216.37	965,544,156.71

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，招商中证 500 等权重指数增强 A 份额净值 1.8534 元，基金份额总额 217,866,894.20 份；招商中证 500 等权重指数增强 C 份额净值 1.7736 元，基金份额总额 101,414,973.99 份；总份额合计 319,281,868.19 份。

6.2 利润表

会计主体：招商中证 500 等权重指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		85,975,608.20	86,619,214.56
1.利息收入		248,724.94	304,457.44
其中：存款利息收入	6.4.7.9	248,724.94	304,457.44
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-

其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		144,693,879.13	80,644,065.72
其中：股票投资收益	6.4.7.10	137,874,988.66	66,916,248.70
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	55,311.68	-
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	1,762,336.41	2,321,133.29
股利收益	6.4.7.15	5,001,242.38	11,406,683.73
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	-60,215,003.04	4,123,478.22
4.汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.17	1,248,007.17	1,547,213.18
减：二、营业总支出		7,897,051.82	10,150,418.24
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	5,255,561.89	7,463,846.40
其中：暂估管理人报酬		-	-
2.托管费	6.4.10.2.2	875,927.01	1,243,974.40
3.销售服务费	6.4.10.2.3	1,677,116.93	1,296,434.69
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		7,040.41	8,405.97
8.其他费用	6.4.7.19	81,405.58	137,756.78
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		78,078,556.38	76,468,796.32
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		78,078,556.38	76,468,796.32
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		78,078,556.38	76,468,796.32

6.3 净资产变动表

会计主体：招商中证 500 等权重指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	568,390,786.13	-	381,308,862.24	949,699,648.37
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	568,390,786.13	-	381,308,862.24	949,699,648.37
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-249,108,917.94	-	-116,927,679.48	-366,036,597.42
（一）、综合收益总额	-	-	78,078,556.38	78,078,556.38
（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）	-249,108,917.94	-	-195,006,235.86	-444,115,153.80
其中：1.基金申购款	284,918,279.14	-	225,528,227.15	510,446,506.29
2.基金赎回款	-534,027,197.08	-	-420,534,463.01	-954,561,660.09
（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	319,281,868.19	-	264,381,182.76	583,663,050.95
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	1,025,082,729.67	-	303,848,528.76	1,328,931,258.43
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,025,082,729.67	-	303,848,528.76	1,328,931,258.43

产				
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-322,079,492.87	-	-30,495,231.24	-352,574,724.11
（一）、综合收益总额	-	-	76,468,796.32	76,468,796.32
（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）	-322,079,492.87	-	-106,964,027.56	-429,043,520.43
其中：1.基金申购款	448,042,677.02	-	139,047,656.45	587,090,333.47
2.基金赎回款	-770,122,169.89	-	-246,011,684.01	-1,016,133,853.90
（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	703,003,236.80	-	273,353,297.52	976,356,534.32

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

招商中证 500 等权重指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人招商基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《招商中证 500 等权重指数增强型证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规的规定,经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2020]1060 号文准予公开募集注册。本基金为契约型开放式基金,存续期限为不定期。根据销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为 A 类基金份额和 C 类基金份额。本基金首次设立募集基金份额为 252,827,541.95 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(20)第 00722 号验资报告。《招商中证 500 等权重指数增强型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)于 2020 年 12 月 23 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,基金托管人为中信证券股份有限公司(以下简称“中信证券”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及截至报告期末最新公告的招募说明书的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票和存托凭证(包括主板、中小板、创业板及其他中国证监会允许投资的股票和存托凭证)、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、政府支持债券、地方政府债、可转换债券、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、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为:本基金投资于股票、存托凭证资产的比例不低于基金资产的 80%,投资于标的指数成份券及其备选成份券的资产不低于非现金基金资产的 80%;每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%,其中,现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。股指期货、国债期货的投资比例遵循国家相关法律法规。如果法律法规对基金合同约定投资组合比例限制进行变更的,待履行相应程序后,以变更后的规定为准。

本基金的业绩比较基准为:中证 500 等权重指数收益率 $\times$ 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[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2021]33号《关于北京证券交易所税收政策适用问题的公告》、财税[2024]8号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财税[2025]4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》、财税[2026]12号《关于明确增值税应税交易销售额计算口径的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

(3) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(4) 对证券投资基金取得的股票股息红利所得，由上市公司代扣代缴个人所得税；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利

所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。其中，对基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所挂牌交易的上市公司限售股，解禁后取得的股息红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(5) 对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，受让方不再缴纳印花税；自 2023 年 8 月 28 日起，出让方减按 0.05%的税率缴纳证券(股票)交易印花税。

(6) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	2,413,661.47
等于：本金	2,411,990.17
加：应计利息	1,671.30
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	29,687,727.18
等于：本金	29,685,442.77
加：应计利息	2,284.41
减：坏账准备	-
合计	32,101,388.65

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	560,798,101.58	-	549,288,901.10	-11,509,200.48
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		560,798,101.58	-	549,288,901.10	-11,509,200.48

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	3,257,960.00	-	-	-
其中：股指期货 投资	3,257,960.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	3,257,960.00	-	-	-

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	246,600.00
合计				246,600.00
减：可抵销期货暂收款				246,600.00
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	2,675.41
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	81,405.58
其他	7,987.62
合计	92,068.61

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

招商中证 500 等权重指数增强 A		
项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	269,968,655.40	269,968,655.40
本期申购	152,848,271.57	152,848,271.57
本期赎回（以“-”号填列）	-204,950,032.77	-204,950,032.77
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	217,866,894.20	217,866,894.20

招商中证 500 等权重指数增强 C		
项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	298,422,130.73	298,422,130.73
本期申购	132,070,007.57	132,070,007.57
本期赎回（以“-”号填列）	-329,077,164.31	-329,077,164.31
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	101,414,973.99	101,414,973.99

注：本期申购含红利再投、转换入份（金）额，本期赎回含转换出份（金）额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

招商中证 500 等权重指数增强 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计

上年度末	195,779,999.68	-5,199,942.70	190,580,056.98
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	195,779,999.68	-5,199,942.70	190,580,056.98
本期利润	70,685,549.21	-32,772,413.68	37,913,135.53
本期基金份额交易产生的变动数	-46,101,928.11	3,534,158.26	-42,567,769.85
其中：基金申购款	136,714,399.60	-11,554,780.33	125,159,619.27
基金赎回款	-182,816,327.71	15,088,938.59	-167,727,389.12
本期已分配利润	-	-	-
本期末	220,363,620.78	-34,438,198.12	185,925,422.66

招商中证 500 等权重指数增强 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	196,921,493.81	-6,192,688.55	190,728,805.26
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	196,921,493.81	-6,192,688.55	190,728,805.26
本期利润	67,608,010.21	-27,442,589.36	40,165,420.85
本期基金份额交易产生的变动数	-170,467,917.46	18,029,451.45	-152,438,466.01
其中：基金申购款	106,605,023.72	-6,236,415.84	100,368,607.88
基金赎回款	-277,072,941.18	24,265,867.29	-252,807,073.89
本期已分配利润	-	-	-
本期末	94,061,586.56	-15,605,826.46	78,455,760.10

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	127,394.20
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	65,755.54
结算备付金利息收入	52,736.74
其他	2,838.46
合计	248,724.94

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	137,874,988.66

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	137,874,988.66

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	2,489,741,591.95
减：卖出股票成本总额	2,349,560,491.61
减：交易费用	2,306,111.68
买卖股票差价收入	137,874,988.66

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	3.30
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	55,308.38
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	55,311.68

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	95,515.92
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	40,199.91
减：应计利息总额	3.39
减：交易费用	4.24

买卖债券差价收入	55,308.38
----------	-----------

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	1,762,336.41

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	5,001,242.38
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	5,001,242.38

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	-60,177,683.04
——股票投资	-60,177,683.04
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-37,320.00
——权证投资	-
——期货投资	-37,320.00
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	-60,215,003.04

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	1,248,007.17
合计	1,248,007.17

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	21,898.21
信息披露费	59,507.37

证券出借违约金	-
合计	81,405.58

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
中信证券股份有限公司	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
中信证券	748,116,086.02	16.42%	212,579,261.13	3.64%

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中信证券	71,034.05	9.24%	-	-
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
中信证券	20,026.47	1.70%	-	-

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	5,255,561.89	7,463,846.40
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,946,147.45	2,919,095.62
应支付基金管理人的净管理费	3,309,414.44	4,544,750.78

注：支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值×1.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	875,927.01	1,243,974.40

注：支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值×0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	招商中证 500 等权重指数增强 A	招商中证 500 等权重指数增强 C	合计
招商基金管理有限公司	-	88,230.25	88,230.25
招商银行	-	55,999.20	55,999.20
招商证券	-	325.21	325.21
中信证券	-	142,086.45	142,086.45
合计	-	286,641.11	286,641.11
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	招商中证 500 等权重指数增强 A	招商中证 500 等权重指数增强 C	合计
招商基金管理有限公司	-	131,400.30	131,400.30
招商银行	-	67,502.99	67,502.99
招商证券	-	264.76	264.76
中信证券	-	104,560.12	104,560.12
合计	-	303,728.17	303,728.17

注：本基金的 C 类基金份额的年销售服务费率为 0.80%，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{C 类份额日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金资产净值} \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信证券-活期	2,413,661.47	127,394.20	13,489,686.02	96,636.78
中信证券-其他存款	24,318,580.36	47,425.84	65,644,689.24	137,768.74

注：本基金的托管人为中信证券股份有限公司，银行存款存放在具有基金托管资格的银行，按银行约定利率计息；其他存款为本基金存放在证券公司的证券交易结算资金，按协议约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

单位：人民币元

本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
招商证券	603459	红板科技	网下申购	3,300	58,410.00
招商证券	001365	天海电子	网下申购	2,394	65,092.86
中信证券	688820	盛合晶微	网下申购	15,058	296,341.44
中信证券	688785	恒运昌	网下申购	1,155	106,467.90
中信证券	301683	慧谷新材	网下申购	952	74,617.76
中信证券	688811	有研复材	网下申购	8,337	53,440.17
中信证券	001312	福恩股份	网下申购	1,333	24,500.54

中信证券	123267	珂玛转债	可转债优先配售	402	40,200.00
中信证券	688808	联讯仪器	网下申购	1,624	132,973.12
中信证券	301669	高特电子	网下申购	5,455	38,621.40
中信证券	688797	臻宝科技	网下申购	2,070	92,239.20
中信证券	001248	华润新能源	网下申购	30,501	308,365.11

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
中信建投证券	603202	天有为	网下申购	1,657	154,929.50
中信证券	688758	赛分科技	网下申购	7,768	33,557.76
中信证券	688583	思看科技	网下申购	1,742	58,287.32
中信证券	603124	江南新材	网下申购	879	9,264.66
中信证券	603257	中国瑞林	网下申购	780	16,005.60
中信证券	301662	宏工科技	网下申购	1,429	38,011.40
中信证券	688755	汉邦科技	网下申购	2,023	46,063.71
中信证券	688775	影石创新	网下申购	5,725	270,620.75

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	285	15,179.10	16,740.90	-
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	21,351	215,858.61	215,858.61	-

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	9,150	92,506.50	92,506.50	-
001257	盛龙股份	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股流通 受限	7.82	20.74	1,743	13,630.26	36,149.82	-
001312	福恩股份	2026 年 4 月 14 日	6 个月	新股流通 受限	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-
001365	天海电子	2026 年 5 月 11 日	6 个月	新股流通 受限	27.19	31.31	719	19,549.61	22,511.89	-
001393	维通利	2026 年 5 月 8 日	6 个月	新股流通 受限	30.38	38.99	387	11,757.06	15,089.13	-
001399	惠科股份	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通 受限	10.12	27.73	3,309	33,487.08	91,758.57	-
301513	尚水智能	2026 年 4 月 10 日	6 个月	新股流通 受限	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-
301531	春光集团	2026 年 4 月 28 日	6 个月	新股流通 受限	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-
301599	理奇智能	2026 年 4 月 22 日	6 个月	新股流通 受限	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-
301666	大普微	2026 年 4 月 8 日	6 个月	新股流通 受限	46.08	463.33	1,220	56,217.60	565,262.60	-
301669	高特电子	2026 年 6 月 2 日	6 个月	新股流通 受限	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-
301680	固德电材	2026 年 2 月 27 日	6 个月	新股流通 受限	58.00	112.16	117	6,786.00	13,122.72	-
301682	宏明电子	2026 年 3 月 18 日	6 个月	新股流通 受限	69.66	160.06	714	49,737.24	114,282.84	-
301683	慧谷新材	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股流通 受限	78.38	121.77	96	7,524.48	11,689.92	-
301687	新广益	2025 年 12 月 24	6 个月	新股流通 受限	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-

		日								
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	775	8,664.50	13,632.25	-
603284	林平发展	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股流通 受限	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-
603293	埃泰克	2026 年 4 月 9 日	6 个月	新股流通 受限	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-
603352	至信股份	2026 年 1 月 8 日	6 个月	新股流通 受限	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-
603407	长裕集团	2026 年 4 月 29 日	6 个月	新股流通 受限	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	-
603435	嘉德利	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通 受限	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603459	红板科技	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通 受限	17.70	84.32	330	5,841.00	27,825.60	-
688635	长进光子	2026 年 5 月 20 日	6 个月	新股流通 受限	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-
688712	北芯生命	2026 年 1 月 28 日	6 个月	新股流通 受限	17.52	35.92	1,500	26,280.00	53,880.00	-
688781	视涯科技	2026 年 3 月 18 日	6 个月	新股流通 受限	22.68	47.61	217	4,921.56	10,331.37	-
688785	恒运昌	2026 年 1 月 20 日	6 个月	新股流通 受限	92.18	463.15	116	10,692.88	53,725.40	-
688797	臻宝科技	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通 受限	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	-
688808	联讯仪器	2026 年 4 月 16 日	6 个月	新股流通 受限	81.88	1,584.33	163	13,346.44	258,245.79	-
688811	有研复材	2026 年	6 个月	新股流通	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-

		4 月 1 日		受限						
688816	易思维	2026 年 2 月 4 日	6 个月	新股流通受限	55.95	57.10	177	9,903.15	10,106.70	-
688818	电科蓝天	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股流通受限	9.47	70.14	1,717	16,259.99	120,430.38	-
688820	盛合晶微	2026 年 4 月 13 日	6 个月	新股流通受限	19.68	141.49	1,506	29,638.08	213,083.94	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金的基金管理人建立了以全面、独立、互相制约以及定性和定量相结合为原则的，董事会及下设审计委员会、风险控制委员会、督察长、风险管理委员会、监察稽核部门和风险管理部门等多层次的风险管理组织架构体系。

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金流动性风险来源于基金约定开放日兑付赎回资金的流动性风险，以及因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险以及因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。本基金所持有的金融资产分别在证券交易所和银行间同业市场交易，除附注 6.4.12 所披露的流通受限不能自由转让的基金资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。除卖出回购金融资产外，本基金所持有的金融负债的合约约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

此外，针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人在基金合同中约定了非常情况下赎回资金的处理模式，控制因开放模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

日常流动性风险管理中，本基金的基金管理人每日监控和预测本基金的流动性指标，通过对投资品种的流动性指标来持续地评估、选择、跟踪和控制基金投资的流动性风险。同时，本基金通过预留一定的现金头寸，并且在需要时可通过卖出回购金融资产方式融入短期资金，以缓解流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的基金管理人日常通过对利率水平的预测、分析收益率曲线及优化利率重新定价日组合等方法对上述利率风险进行管理。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	32,101,388.65	-	-	-	32,101,388.65
结算备付金	5,714,930.13	-	-	-	5,714,930.13
存出保证金	-	-	-	420,547.20	420,547.20
交易性金融资产	-	-	-	549,288,901.10	549,288,901.10
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	-	-	-	3,571,449.29	3,571,449.29
应收清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	37,816,318.78	-	-	553,280,897.59	591,097,216.37
负债					
应付赎回款	-	-	-	6,539,290.67	6,539,290.67
应付管理人报酬	-	-	-	583,870.03	583,870.03
应付托管费	-	-	-	97,311.68	97,311.68
应付清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	121,624.43	121,624.43
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	92,068.61	92,068.61
负债总计	-	-	-	7,434,165.42	7,434,165.42
利率敏感度缺口	37,816,318.78	-	-	545,846,732.17	583,663,050.95
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	61,885,373.79	-	-	-	61,885,373.79
结算备付金	9,232,503.69	-	-	-	9,232,503.69
存出保证金	-	-	-	1,066,550.40	1,066,550.40
交易性金融资产	-	-	-	889,596,645.91	889,596,645.91
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	-	-	-	3,763,082.92	3,763,082.92
应收清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	71,117,877.48	-	-	894,426,279.23	965,544,156.71
负债					
应付赎回款	-	-	-	14,246,707.56	14,246,707.56
应付管理人报酬	-	-	-	1,002,933.49	1,002,933.49
应付托管费	-	-	-	167,155.59	167,155.59
应付清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资	-	-	-	-	-

产款					
应付销售服务费	-	-	-	361,188.12	361,188.12
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	66,523.58	66,523.58
负债总计	-	-	-	15,844,508.34	15,844,508.34
利率敏感度缺口	71,117,877.48	-	-	878,581,770.89	949,699,648.37

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	549,288,901.10	94.11	889,596,645.91	93.67
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	549,288,901.10	94.11	889,596,645.91	93.67

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%	27,464,445.06	44,479,832.30
	2. 权益性投资的市场价格下降 5%	-27,464,445.06	-44,479,832.30

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	547,064,952.99	887,419,343.94
第二层次	308,365.11	-
第三层次	1,915,583.00	2,177,301.97
合计	549,288,901.10	889,596,645.91

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	549,288,901.10	92.93
	其中：股票	549,288,901.10	92.93
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	37,816,318.78	6.40
8	其他各项资产	3,991,996.49	0.68
9	合计	591,097,216.37	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	1,518,684.00	0.26
B	采矿业	10,762,903.00	1.84
C	制造业	329,570,295.83	56.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,863,177.38	2.03
E	建筑业	3,162,821.00	0.54
F	批发和零售业	17,812,363.10	3.05
G	交通运输、仓储和邮政业	11,958,513.76	2.05
H	住宿和餐饮业	636,846.00	0.11

I	信息传输、软件和信息技术服务业	21,756,955.54	3.73
J	金融业	29,654,340.00	5.08
K	房地产业	89,262.00	0.02
L	租赁和商务服务业	4,452,666.00	0.76
M	科学研究和技术服务业	3,729,446.00	0.64
N	水利、环境和公共设施管理业	8,764,825.00	1.50
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	455,733,098.61	78.08

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	478,256.00	0.08
B	采矿业	3,261,417.82	0.56
C	制造业	62,444,524.21	10.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	308,365.11	0.05
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	7,094,847.75	1.22
G	交通运输、仓储和邮政业	1,730,309.46	0.30
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,344,390.69	1.60
J	金融业	1,610,676.00	0.28
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	6,560,000.00	1.12
M	科学研究和技术服务业	411,801.60	0.07
N	水利、环境和公共设施管理业	136,320.00	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	141,840.00	0.02
Q	卫生和社会工作	2,831.85	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	30,222.00	0.01
	合计	93,555,802.49	16.03

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	002841	视源股份	228,600	7,893,558.00	1.35
2	688002	睿创微纳	50,769	7,853,456.61	1.35
3	688266	泽璟制药	62,449	7,285,300.34	1.25
4	000878	云南铜业	422,500	6,709,300.00	1.15
5	000951	中国重汽	338,798	6,609,948.98	1.13
6	688220	翱捷科技	45,831	5,697,709.92	0.98
7	002266	浙富控股	1,122,400	5,679,344.00	0.97
8	300953	震裕科技	41,780	5,585,986.00	0.96
9	301536	星宸科技	42,300	5,444,433.00	0.93
10	002414	高德红外	409,800	5,433,948.00	0.93
11	002008	大族激光	31,900	4,788,509.00	0.82
12	603444	吉比特	13,300	4,766,986.00	0.82
13	688475	萤石网络	172,557	4,719,433.95	0.81
14	300073	当升科技	97,500	4,683,900.00	0.80
15	300458	全志科技	117,600	4,640,496.00	0.80
16	001309	德明利	4,900	4,620,210.00	0.79
17	600801	华新建材	285,300	4,450,680.00	0.76
18	603225	新凤鸣	219,200	4,307,280.00	0.74
19	300373	扬杰科技	26,400	4,150,872.00	0.71
20	601108	财通证券	474,600	4,105,290.00	0.70
21	000739	普洛药业	246,300	4,103,358.00	0.70
22	300919	中伟新材	92,300	4,038,125.00	0.69
23	600166	福田汽车	1,382,300	4,022,493.00	0.69
24	300604	长川科技	11,600	3,960,472.00	0.68
25	002821	凯莱英	23,900	3,871,800.00	0.66
26	688235	百济神州	15,104	3,845,629.44	0.66
27	688778	厦钨新能	70,369	3,828,073.60	0.66
28	603606	东方电缆	91,993	3,818,629.43	0.65
29	300972	万辰集团	21,800	3,780,338.00	0.65
30	300857	协创数据	10,892	3,702,190.80	0.63
31	002407	多氟多	71,600	3,596,468.00	0.62
32	300748	金力永磁	114,100	3,519,985.00	0.60
33	300496	中科创达	55,000	3,398,450.00	0.58
34	600008	首创环保	1,236,400	3,363,008.00	0.58
35	603345	安井食品	41,100	3,295,809.00	0.56

36	688180	君实生物	97,324	3,291,497.68	0.56
37	300037	新宙邦	34,600	3,212,610.00	0.55
38	002271	东方雨虹	270,000	3,204,900.00	0.55
39	301358	湖南裕能	40,900	3,103,083.00	0.53
40	001389	广合科技	13,000	3,084,250.00	0.53
41	601555	东吴证券	389,200	3,082,464.00	0.53
42	600535	天士力	230,200	3,045,546.00	0.52
43	300012	华测检测	219,500	3,042,270.00	0.52
44	603699	纽威股份	60,332	3,034,699.60	0.52
45	603233	大参林	201,870	3,034,106.10	0.52
46	001286	陕西能源	294,067	2,981,839.38	0.51
47	688578	艾力斯	26,886	2,935,951.20	0.50
48	603659	璞泰来	101,400	2,933,502.00	0.50
49	002340	格林美	442,200	2,922,942.00	0.50
50	002126	银轮股份	58,500	2,913,300.00	0.50
51	603308	应流股份	47,400	2,862,960.00	0.49
52	600109	国金证券	325,900	2,861,402.00	0.49
53	600332	白云山	142,200	2,849,688.00	0.49
54	600970	中材国际	399,100	2,845,583.00	0.49
55	600141	兴发集团	59,500	2,794,715.00	0.48
56	000034	神州数码	99,280	2,755,020.00	0.47
57	000737	北方铜业	206,400	2,728,608.00	0.47
58	600927	永安期货	218,500	2,720,325.00	0.47
59	600901	江苏金租	472,500	2,716,875.00	0.47
60	600595	中孚实业	474,200	2,665,004.00	0.46
61	000623	吉林敖东	148,100	2,625,813.00	0.45
62	300223	北京君正	10,300	2,563,670.00	0.44
63	600392	盛和资源	84,800	2,524,496.00	0.43
64	600292	电投水电	209,500	2,522,380.00	0.43
65	603379	三美股份	33,100	2,511,959.00	0.43
66	000967	盈峰环境	235,200	2,476,656.00	0.42
67	600704	物产中大	521,400	2,461,008.00	0.42
68	600517	国网英大	523,500	2,449,980.00	0.42
69	601156	东航物流	150,873	2,432,072.76	0.42
70	300432	富临精工	120,000	2,410,800.00	0.41
71	688166	博瑞医药	68,166	2,386,491.66	0.41
72	002064	华峰化学	250,600	2,378,194.00	0.41
73	600998	九州通	505,300	2,369,857.00	0.41
74	601233	桐昆股份	108,200	2,342,530.00	0.40
75	000629	钒钛股份	690,100	2,304,934.00	0.39
76	600499	科达制造	166,800	2,301,840.00	0.39
77	000415	渤海租赁	564,000	2,295,480.00	0.39
78	301377	鼎泰高科	4,070	2,242,163.00	0.38

79	000703	恒逸石化	161,700	2,194,269.00	0.38
80	000155	川能动力	183,000	2,192,340.00	0.38
81	002261	拓维信息	78,000	2,184,780.00	0.37
82	300570	太辰光	8,700	2,146,377.00	0.37
83	601615	明阳智能	182,100	2,106,897.00	0.36
84	600497	驰宏锌锗	173,100	2,096,241.00	0.36
85	002120	韵达股份	324,400	2,063,184.00	0.35
86	600153	建发股份	257,800	2,044,354.00	0.35
87	002195	岩山科技	310,400	2,030,016.00	0.35
88	688385	复旦微电	28,311	2,018,291.19	0.35
89	002299	圣农发展	132,400	2,007,184.00	0.34
90	603565	中谷物流	203,400	1,995,354.00	0.34
91	600369	西南证券	480,700	1,932,414.00	0.33
92	600601	方正科技	137,900	1,908,536.00	0.33
93	002152	广电运通	199,200	1,868,496.00	0.32
94	300146	汤臣倍健	205,900	1,861,336.00	0.32
95	300475	香农芯创	6,100	1,830,000.00	0.31
96	300207	欣旺达	96,300	1,828,737.00	0.31
97	002402	和而泰	70,500	1,821,015.00	0.31
98	002683	广东宏大	61,800	1,810,122.00	0.31
99	002603	以岭药业	119,800	1,797,000.00	0.31
100	000429	粤高速 A	127,600	1,741,740.00	0.30
101	605358	立昂微	22,300	1,730,480.00	0.30
102	000921	海信家电	61,100	1,669,252.00	0.29
103	000728	国元证券	218,200	1,634,318.00	0.28
104	688213	思特威	15,237	1,631,425.59	0.28
105	000060	中金岭南	210,300	1,591,971.00	0.27
106	603156	养元饮品	31,500	1,545,705.00	0.26
107	688120	华海清科	4,760	1,533,576.80	0.26
108	600598	北大荒	140,100	1,518,684.00	0.26
109	002130	沃尔核材	79,000	1,497,840.00	0.26
110	601696	中银证券	117,600	1,487,640.00	0.25
111	600546	山煤国际	133,300	1,456,969.00	0.25
112	000088	盐田港	356,200	1,456,858.00	0.25
113	002078	太阳纸业	115,800	1,446,342.00	0.25
114	600316	洪都航空	50,800	1,419,352.00	0.24
115	600157	永泰能源	878,900	1,415,029.00	0.24
116	688052	纳芯微	4,898	1,412,142.38	0.24
117	000423	东阿阿胶	31,100	1,410,696.00	0.24
118	603298	杭叉集团	58,700	1,400,582.00	0.24
119	002851	麦格米特	8,300	1,387,594.00	0.24
120	603858	步长制药	94,800	1,384,080.00	0.24
121	603885	吉祥航空	134,500	1,384,005.00	0.24

122	000528	柳工	180,900	1,365,795.00	0.23
123	002410	广联达	167,000	1,362,720.00	0.23
124	603596	伯特利	54,592	1,356,065.28	0.23
125	601666	平煤股份	188,500	1,347,775.00	0.23
126	600363	联创光电	37,400	1,338,172.00	0.23
127	001221	悍高集团	32,835	1,320,623.70	0.23
128	600143	金发科技	84,600	1,307,070.00	0.22
129	601699	潞安环能	90,200	1,288,056.00	0.22
130	601717	中创智领	92,200	1,282,502.00	0.22
131	601665	齐鲁银行	221,400	1,277,478.00	0.22
132	000709	河钢股份	654,100	1,268,954.00	0.22
133	688692	达梦数据	5,133	1,253,940.57	0.21
134	600879	航天电子	57,300	1,219,917.00	0.21
135	002738	中矿资源	20,500	1,209,295.00	0.21
136	688361	中科飞测	2,798	1,203,140.00	0.21
137	601212	白银有色	236,800	1,202,944.00	0.21
138	603256	宏和科技	4,500	1,193,985.00	0.20
139	688301	奕瑞科技	9,446	1,171,304.00	0.20
140	002756	永兴材料	20,400	1,155,456.00	0.20
141	300390	天华新能	12,300	1,150,173.00	0.20
142	000893	亚钾国际	27,900	1,140,831.00	0.20
143	600988	赤峰黄金	43,100	1,134,392.00	0.19
144	688498	源杰科技	600	1,131,600.00	0.19
145	301200	大族数控	3,100	1,118,015.00	0.19
146	688629	华丰科技	5,962	1,117,934.62	0.19
147	600380	健康元	117,901	1,110,627.42	0.19
148	600562	国睿科技	52,300	1,109,806.00	0.19
149	600295	鄂尔多斯	100,900	1,081,648.00	0.19
150	688676	金盘科技	12,758	1,079,837.12	0.19
151	300718	长盛轴承	17,700	1,079,169.00	0.18
152	000932	华菱钢铁	310,900	1,078,823.00	0.18
153	300136	信维通信	9,000	1,073,250.00	0.18
154	300395	菲利华	8,000	1,069,840.00	0.18
155	000960	锡业股份	24,900	1,062,981.00	0.18
156	002423	中粮资本	121,700	1,001,591.00	0.17
157	003022	联泓新科	38,400	994,560.00	0.17
158	300454	深信服	10,000	962,000.00	0.16
159	600884	杉杉股份	70,900	960,695.00	0.16
160	002465	海格通信	74,200	947,534.00	0.16
161	603688	石英股份	11,100	916,971.00	0.16
162	002487	大金重工	15,800	915,926.00	0.16
163	603816	顾家家居	40,400	903,344.00	0.15
164	300888	稳健医疗	32,000	895,680.00	0.15

165	300054	鼎龙股份	8,200	868,954.00	0.15
166	600339	中油工程	279,400	857,758.00	0.15
167	002568	百润股份	50,400	852,768.00	0.15
168	000683	博源化工	147,800	851,328.00	0.15
169	002517	恺英网络	52,200	848,250.00	0.15
170	000559	万向钱潮	65,600	848,208.00	0.15
171	600685	中船防务	33,000	839,520.00	0.14
172	301526	国际复材	17,800	830,726.00	0.14
173	300142	沃森生物	62,700	814,473.00	0.14
174	600329	达仁堂	21,600	803,952.00	0.14
175	601958	金钼股份	27,600	775,836.00	0.13
176	600906	财达证券	102,700	766,142.00	0.13
177	300757	罗博特科	1,200	742,800.00	0.13
178	600566	济川药业	33,400	741,146.00	0.13
179	603650	彤程新材	7,400	725,052.00	0.12
180	000983	山西焦煤	124,900	724,420.00	0.12
181	002850	科达利	3,700	700,410.00	0.12
182	600688	上海石化	235,200	689,136.00	0.12
183	300676	华大基因	19,600	687,176.00	0.12
184	688313	仕佳光子	3,600	664,740.00	0.11
185	603119	浙江荣泰	10,000	663,400.00	0.11
186	000062	深圳华强	20,500	652,310.00	0.11
187	300487	蓝晓科技	10,900	641,465.00	0.11
188	600754	锦江酒店	35,400	636,846.00	0.11
189	600298	安琪酵母	17,500	633,500.00	0.11
190	600536	中国软件	22,400	629,888.00	0.11
191	601577	长沙银行	72,300	629,733.00	0.11
192	002185	华天科技	26,800	597,908.00	0.10
193	601990	南京证券	91,000	597,870.00	0.10
194	300677	英科医疗	14,900	583,633.00	0.10
195	601106	中国一重	173,700	573,210.00	0.10
196	300140	节能环保	113,300	563,101.00	0.10
197	002312	川发龙蟒	60,100	551,117.00	0.09
198	000783	长江证券	54,800	534,300.00	0.09
199	603979	金诚信	9,000	531,270.00	0.09
200	600642	申能股份	59,900	522,927.00	0.09
201	688728	格科微	24,800	521,792.00	0.09
202	600282	南钢股份	110,400	506,736.00	0.09
203	300699	光威复材	17,500	501,375.00	0.09
204	300763	锦浪科技	5,300	478,855.00	0.08
205	600352	浙江龙盛	38,600	467,446.00	0.08
206	600511	国药股份	17,900	466,116.00	0.08
207	600655	豫园股份	112,800	463,608.00	0.08

208	601298	青岛港	57,400	462,070.00	0.08
209	300735	光弘科技	20,300	461,622.00	0.08
210	688017	绿的谐波	1,091	455,885.26	0.08
211	002265	建设工业	26,000	452,400.00	0.08
212	002945	华林证券	33,500	449,905.00	0.08
213	600021	上海电力	29,700	447,579.00	0.08
214	601001	晋控煤业	25,200	438,228.00	0.08
215	688037	芯源微	983	431,586.15	0.07
216	603737	三棵树	16,520	398,132.00	0.07
217	688563	航材股份	7,600	389,348.00	0.07
218	002432	九安医疗	5,500	388,740.00	0.07
219	000800	一汽解放	64,900	386,155.00	0.07
220	002926	华西证券	47,100	384,807.00	0.07
221	600060	海信视像	13,500	376,245.00	0.06
222	601880	辽港股份	270,000	372,600.00	0.06
223	002273	水晶光电	10,200	361,896.00	0.06
224	600038	中直股份	14,300	361,647.00	0.06
225	600132	重庆啤酒	8,700	359,310.00	0.06
226	301606	绿联科技	5,600	341,712.00	0.06
227	600378	昊华科技	4,500	339,210.00	0.06
228	002444	巨星科技	10,900	338,990.00	0.06
229	600863	华能蒙电	72,100	338,870.00	0.06
230	000997	新大陆	20,600	335,780.00	0.06
231	002065	东华软件	46,800	334,152.00	0.06
232	688599	天合光能	23,600	333,232.00	0.06
233	600582	天地科技	73,500	327,075.00	0.06
234	600808	马钢股份	130,700	326,750.00	0.06
235	600100	同方股份	47,700	326,745.00	0.06
236	603077	和邦生物	140,800	326,656.00	0.06
237	000786	北新建材	18,000	325,620.00	0.06
238	603486	科沃斯	6,400	324,800.00	0.06
239	600967	内蒙一机	29,800	323,330.00	0.06
240	600170	上海建工	142,900	317,238.00	0.05
241	002025	航天电器	4,100	312,502.00	0.05
242	688281	华秦科技	6,098	306,302.54	0.05
243	601139	深圳燃气	52,700	298,282.00	0.05
244	600390	五矿资本	64,400	293,664.00	0.05
245	000050	深天马 A	29,500	292,345.00	0.05
246	688411	海博思创	1,000	291,200.00	0.05
247	600765	中航重机	22,000	284,240.00	0.05
248	300957	贝泰妮	9,000	283,590.00	0.05
249	688347	华虹宏力	834	280,474.20	0.05
250	688349	三一重能	16,766	254,507.88	0.04

251	003021	兆威机电	2,800	244,580.00	0.04
252	688122	西部超导	3,600	226,116.00	0.04
253	002966	苏州银行	31,500	219,240.00	0.04
254	600177	雅戈尔	28,300	213,099.00	0.04
255	600885	宏发股份	6,100	210,389.00	0.04
256	601991	大唐发电	28,800	203,904.00	0.03
257	002223	鱼跃医疗	7,900	202,714.00	0.03
258	688777	中控技术	1,644	193,170.00	0.03
259	603589	口子窖	10,200	190,536.00	0.03
260	002007	华兰生物	15,500	188,945.00	0.03
261	300339	润和软件	4,900	188,699.00	0.03
262	600398	海澜之家	35,900	187,757.00	0.03
263	002032	苏泊尔	4,700	186,120.00	0.03
264	601966	玲珑轮胎	18,000	183,420.00	0.03
265	603000	人民网	12,400	183,396.00	0.03
266	601997	贵阳银行	34,500	176,985.00	0.03
267	600095	湘财股份	23,000	173,190.00	0.03
268	300627	华测导航	6,000	170,400.00	0.03
269	688234	天岳先进	915	158,761.65	0.03
270	601162	天风证券	47,100	158,727.00	0.03
271	600583	海油工程	28,100	141,343.00	0.02
272	600348	华阳股份	17,000	130,050.00	0.02
273	300058	蓝色光标	8,200	112,832.00	0.02
274	300003	乐普医疗	9,400	111,390.00	0.02
275	601155	新城控股	8,700	89,262.00	0.02
276	000519	中兵红箭	3,700	77,959.00	0.01
277	601865	福莱特	6,900	72,519.00	0.01
278	600985	淮北矿业	5,000	70,250.00	0.01
279	603658	安图生物	2,100	60,942.00	0.01
280	600098	广州发展	9,900	58,509.00	0.01
281	600871	石化油服	27,800	56,434.00	0.01
282	002281	光迅科技	200	51,388.00	0.01
283	601000	唐山港	12,200	50,630.00	0.01
284	688099	晶晨股份	400	41,160.00	0.01
285	600032	浙江新能	5,800	40,890.00	0.01
286	003031	中瓷电子	100	18,030.00	0.00
287	601112	振石股份	775	13,632.25	0.00
288	688387	信科移动	400	7,936.00	0.00
289	301301	川宁生物	74	587.56	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	688525	佰维存储	6,689	3,309,248.97	0.57
2	000810	创维数字	230,600	3,055,450.00	0.52
3	688620	安凯微	164,637	2,667,119.40	0.46
4	300842	帝科股份	29,100	2,594,847.00	0.44
5	002805	丰元股份	89,300	2,553,087.00	0.44
6	001298	好上好	121,465	2,520,398.75	0.43
7	688173	希荻微	128,787	2,464,983.18	0.42
8	300277	汽轮科技	151,371	2,276,619.84	0.39
9	605599	菜百股份	164,400	2,252,280.00	0.39
10	603906	龙蟠科技	84,200	2,233,826.00	0.38
11	002837	英维克	27,370	2,177,557.20	0.37
12	300308	中际旭创	1,700	2,159,000.00	0.37
13	000906	浙商中拓	423,500	2,134,440.00	0.37
14	603598	引力传媒	123,300	2,114,595.00	0.36
15	688269	凯立新材	65,505	2,077,163.55	0.36
16	300769	德方纳米	29,800	1,981,700.00	0.34
17	688159	有方科技	44,282	1,965,677.98	0.34
18	000534	万泽股份	69,700	1,906,992.00	0.33
19	002716	湖南白银	228,800	1,850,992.00	0.32
20	600755	厦门国贸	336,200	1,822,204.00	0.31
21	001339	智微智能	17,030	1,741,828.40	0.30
22	600361	创新新材	471,100	1,695,960.00	0.29
23	300450	先导智能	40,900	1,665,448.00	0.29
24	002558	巨人网络	60,200	1,659,112.00	0.28
25	002961	瑞达期货	80,700	1,580,106.00	0.27
26	600026	中远海能	87,900	1,576,926.00	0.27
27	600768	宁波富邦	103,500	1,550,430.00	0.27
28	300153	科泰电源	50,800	1,149,096.00	0.20
29	001287	中电港	35,800	1,115,170.00	0.19
30	000933	神火股份	52,300	1,108,760.00	0.19
31	002156	通富微电	14,000	1,062,180.00	0.18
32	688400	凌云光	14,110	934,082.00	0.16
33	688216	气派科技	21,543	905,021.43	0.16
34	002532	天山铝业	72,800	781,144.00	0.13
35	688111	金山办公	3,583	763,358.15	0.13
36	601061	中信金属	68,700	739,899.00	0.13
37	002297	博云新材	24,400	707,356.00	0.12
38	301308	江波龙	1,000	703,800.00	0.12
39	002439	启明星辰	55,600	703,340.00	0.12
40	605376	博迁新材	2,500	678,250.00	0.12

41	600549	厦门钨业	7,900	673,080.00	0.12
42	000657	中钨高新	6,800	650,896.00	0.11
43	000809	和展能源	201,900	640,023.00	0.11
44	301666	大普微	1,220	565,262.60	0.10
45	688059	华锐精密	2,816	562,383.36	0.10
46	301012	扬电科技	23,900	561,411.00	0.10
47	301396	宏景科技	1,660	550,456.00	0.09
48	301087	可孚医疗	11,500	547,975.00	0.09
49	600506	统一股份	39,300	545,877.00	0.09
50	000695	滨海能源	41,600	520,000.00	0.09
51	601888	中国中免	9,100	488,761.00	0.08
52	603013	亚普股份	30,800	486,332.00	0.08
53	002772	众兴菌业	42,100	478,256.00	0.08
54	300459	汤姆猫	140,400	475,956.00	0.08
55	301219	腾远钴业	8,680	475,664.00	0.08
56	000506	招金黄金	40,500	474,660.00	0.08
57	603719	良品铺子	54,000	467,100.00	0.08
58	600489	中金黄金	25,800	465,690.00	0.08
59	002557	洽洽食品	25,700	461,572.00	0.08
60	002128	电投能源	19,900	460,088.00	0.08
61	002213	大为股份	12,500	459,250.00	0.08
62	601918	新集能源	52,600	451,834.00	0.08
63	002956	西麦食品	21,760	451,737.60	0.08
64	600150	中国船舶	12,600	425,754.00	0.07
65	603259	药明康德	3,300	410,883.00	0.07
66	603986	兆易创新	500	407,500.00	0.07
67	688221	前沿生物	17,722	396,972.80	0.07
68	000989	九芝堂	47,900	372,183.00	0.06
69	603711	香飘飘	31,400	348,854.00	0.06
70	603507	振江股份	10,600	348,634.00	0.06
71	601088	中国神华	8,800	343,552.00	0.06
72	301122	采纳股份	11,300	332,333.00	0.06
73	601899	紫金矿业	13,200	331,848.00	0.06
74	001248	华润新能源	30,501	308,365.11	0.05
75	603195	公牛集团	6,800	266,220.00	0.05
76	002595	豪迈科技	5,620	261,892.00	0.04
77	000603	盛达资源	11,200	258,720.00	0.04
78	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.04
79	002111	威海广泰	27,700	249,300.00	0.04
80	002810	山东赫达	10,000	247,000.00	0.04
81	603701	德宏股份	11,200	246,176.00	0.04
82	001218	丽臣实业	10,800	238,248.00	0.04
83	000599	青岛双星	52,700	222,394.00	0.04

84	601857	中国石油	25,500	221,340.00	0.04
85	000426	兴业银锡	6,600	217,536.00	0.04
86	300590	移为通信	15,000	215,250.00	0.04
87	688820	盛合晶微	1,506	213,083.94	0.04
88	603799	华友钴业	4,400	212,344.00	0.04
89	002493	荣盛石化	19,100	205,325.00	0.04
90	688379	华光新材	2,400	201,672.00	0.03
91	601700	风范股份	44,500	194,020.00	0.03
92	300512	中亚股份	27,400	186,868.00	0.03
93	002354	天娱数科	19,400	180,420.00	0.03
94	600118	中国卫星	2,000	164,100.00	0.03
95	603630	拉芳家化	12,800	163,584.00	0.03
96	000973	佛塑科技	11,000	157,850.00	0.03
97	002653	海思科	2,294	152,183.96	0.03
98	688519	南亚新材	400	152,016.00	0.03
99	601333	广深铁路	55,200	151,800.00	0.03
100	600612	老凤祥	4,700	151,105.00	0.03
101	300933	中辰股份	24,800	150,784.00	0.03
102	301510	固高科技	4,700	150,071.00	0.03
103	000408	藏格矿业	2,100	145,572.00	0.02
104	688308	欧科亿	800	145,448.00	0.02
105	301511	德福科技	1,000	143,850.00	0.02
106	002833	弘亚数控	7,400	142,746.00	0.02
107	002607	中公教育	78,800	141,840.00	0.02
108	603588	高能环境	7,100	136,320.00	0.02
109	300613	富瀚微	1,700	136,136.00	0.02
110	300399	天利科技	6,900	131,652.00	0.02
111	603933	睿能科技	5,800	130,790.00	0.02
112	002645	华宏科技	4,700	129,297.00	0.02
113	688008	澜起科技	400	123,960.00	0.02
114	688818	电科蓝天	1,717	120,430.38	0.02
115	301682	宏明电子	714	114,282.84	0.02
116	002752	昇兴股份	19,300	106,536.00	0.02
117	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.02
118	001399	惠科股份	3,309	91,758.57	0.02
119	002080	中材科技	1,000	90,000.00	0.02
120	605117	德业股份	800	84,944.00	0.01
121	688239	航宇科技	1,284	76,821.72	0.01
122	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.01
123	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.01
124	001226	拓山重工	1,100	52,195.00	0.01
125	688635	长进光子	128	39,448.32	0.01
126	002054	德美化工	5,900	39,235.00	0.01

127	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.01
128	300059	东方财富	1,500	30,570.00	0.01
129	600673	东阳光	900	30,222.00	0.01
130	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
131	688583	思看科技	318	27,274.86	0.00
132	300042	朗科科技	300	22,851.00	0.00
133	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
134	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
135	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
136	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
137	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
138	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
139	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
140	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
141	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
142	300206	理邦仪器	1,100	13,453.00	0.00
143	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
144	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
145	688781	视涯科技	217	10,331.37	0.00
146	301319	唯特偶	61	10,207.13	0.00
147	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
148	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
149	301285	鸿日达	65	7,171.45	0.00
150	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
151	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
152	301220	亚香股份	99	3,189.78	0.00
153	301176	逸豪新材	44	2,992.00	0.00
154	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
155	301239	普瑞眼科	93	2,831.85	0.00
156	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
157	301313	凡拓数创	47	2,357.52	0.00
158	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
159	301398	星源卓镁	57	2,001.27	0.00
160	301328	维峰电子	28	1,993.60	0.00
161	301161	唯万密封	46	1,776.06	0.00
162	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
163	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00
164	301368	丰立智能	37	1,540.31	0.00
165	301297	富乐德	15	918.60	0.00
166	301265	华新科技	19	523.45	0.00
167	301266	宇邦新材	22	502.48	0.00
168	301311	昆船智能	32	415.68	0.00
169	301332	德尔玛	22	168.30	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	002603	以岭药业	15,437,630.42	1.63
2	601615	明阳智能	14,963,863.00	1.58
3	300748	金力永磁	14,468,260.00	1.52
4	300373	扬杰科技	14,342,676.00	1.51
5	603659	璞泰来	14,141,439.00	1.49
6	300450	先导智能	14,111,988.00	1.49
7	688002	睿创微纳	13,481,440.62	1.42
8	000997	新大陆	12,648,090.00	1.33
9	002410	广联达	12,055,089.00	1.27
10	300136	信维通信	11,885,389.30	1.25
11	300458	全志科技	11,653,596.30	1.23
12	300207	欣旺达	11,528,431.00	1.21
13	000878	云南铜业	11,446,492.00	1.21
14	603341	龙旗科技	11,289,161.00	1.19
15	600699	均胜电子	11,246,463.00	1.18
16	601168	西部矿业	11,138,180.00	1.17
17	600549	厦门钨业	11,028,183.00	1.16
18	688220	翱捷科技	11,008,576.55	1.16
19	000951	中国重汽	10,968,818.56	1.15
20	002558	巨人网络	10,967,470.00	1.15

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	002008	大族激光	21,699,073.00	2.28
2	600549	厦门钨业	19,917,767.00	2.10
3	002603	以岭药业	19,112,387.12	2.01
4	603659	璞泰来	17,145,569.00	1.81
5	688002	睿创微纳	16,887,660.02	1.78
6	601168	西部矿业	16,764,286.00	1.77
7	300604	长川科技	16,735,506.00	1.76

8	000050	深天马 A	16,350,834.72	1.72
9	300373	扬杰科技	16,219,846.77	1.71
10	688525	佰维存储	15,987,752.52	1.68
11	600699	均胜电子	15,058,425.48	1.59
12	600166	福田汽车	14,955,321.00	1.57
13	002202	金风科技	14,929,469.60	1.57
14	601615	明阳智能	14,215,665.00	1.50
15	300207	欣旺达	14,004,172.00	1.47
16	603341	龙旗科技	13,851,145.00	1.46
17	300857	协创数据	13,736,171.17	1.45
18	300003	乐普医疗	13,522,904.00	1.42
19	688301	奕瑞科技	13,466,400.26	1.42
20	603486	科沃斯	13,458,319.00	1.42

注：1、卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票；

2、基金持有的股票分类为交易性金融资产的，本项“累计卖出金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,069,430,429.84
卖出股票收入（成交）总额	2,489,741,591.95

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，云南铜业股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家税务总局上海市普陀区税务局第十四税务所的处罚。中国重汽集团济南卡车股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到济南市章丘区城乡交通运输局的处罚。

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	3,571,449.29
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,991,996.49

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 500 等权重指数增强 A	19,261	11,311.30	30,317,014.44	13.92%	187,549,879.76	86.08%
招商中证 500 等权	20,262	5,005.18	2,542,574.63	2.51%	98,872,399.36	97.49%

重指数增强 C						
合计	39,523	8,078.38	32,859,589.07	10.29%	286,422,279.12	89.71%

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

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	招商中证 500 等权重指数增强 A	114,571.01	0.0526%
	招商中证 500 等权重指数增强 C	36.86	0.0000%
	合计	114,607.87	0.0359%

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

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	招商中证 500 等权重指数增强 A	0
	招商中证 500 等权重指数增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	招商中证 500 等权重指数增强 A	0
	招商中证 500 等权重指数增强 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	招商中证 500 等权重指数增强 A	招商中证 500 等权重指数增强 C
基金合同生效日(2020 年 12 月 23 日)基金份额总额	173,648,823.69	79,178,718.26

本报告期期初基金份额总额	269,968,655.40	298,422,130.73
本报告期基金总申购份额	152,848,271.57	132,070,007.57
减：本报告期基金总赎回份额	204,950,032.77	329,077,164.31
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	217,866,894.20	101,414,973.99

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、公募基金托管业务的重大诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

报告期内，本基金托管人的基金托管业务部门无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，本基金托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东莞证券	3	1,874,206,919.38	41.13%	348,424.85	45.32%	-
国信证券	3	1,520,306,249.15	33.37%	312,114.62	40.60%	-
中信证券	3	748,116,086.02	16.42%	71,034.05	9.24%	-
渤海证券	2	413,881,696.09	9.08%	37,204.44	4.84%	-

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
东莞证券	55,895.22	58.52%	-	-	-	-
国信证券	39,620.70	41.48%	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-

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关于旗下基金投资关联	证券时报、基金管理	2026-01-21

	方承销证券的公告	人网站及中国证监会基金电子披露网站	
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	证券时报及基金管理人网站	2026-01-21
3	招商中证 500 等权重指数增强型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-01-21
4	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	2026-03-25
5	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
6	招商中证 500 等权重指数增强型证券投资基金 2025 年年度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-31
7	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
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	2026-04-02
9	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	2026-04-14
10	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	2026-04-15
11	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	2026-04-17
12	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	2026-04-21
13	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
14	招商中证 500 等权重指数增强型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-04-22
15	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
16	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

17	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	2026-06-03
18	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	2026-06-18
19	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	2026-06-25

§ 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	20260101-20260514	127,064,259.96	-	127,064,259.96	-	-

产品特有风险							
本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况，可能会出现集中赎回甚至巨额赎回从而引发基金净值剧烈波动，甚至引发基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。							

注：1、报告期末持有份额占比按照四舍五入方法保留至小数点后第 2 位；

2、申购份额包含申购、定期定额投资、转换转入、红利再投资或者买入等业务增加的份额，赎回份额包含赎回、转换转出或者卖出等业务减少的份额。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准设立招商基金管理有限公司的文件；
- 2、中国证券监督管理委员会批准招商中证 500 等权重指数增强型证券投资基金设立的文件；
- 3、《招商中证 500 等权重指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 4、《招商中证 500 等权重指数增强型证券投资基金托管协议》；

- 5、《招商中证 500 等权重指数增强型证券投资基金招募说明书》；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照。

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.cmfcchina.com>

招商基金管理有限公司

2026 年 8 月 31 日