

招商中证 500 指数增强型证券投资基金 2025 年年度报告

2025 年 12 月 31 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 3 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 3 月 30 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。

本报告财务资料已经审计，德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了 2025 年度无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2025 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
3.3 过去三年基金的利润分配情况	8
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.9 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	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	13
§6 审计报告	13
6.1 审计报告的基本内容	14
§7 年度财务报表	15
7.1 资产负债表	16
7.2 利润表	17
7.3 净资产变动表	18
7.4 报表附注	20
§8 投资组合报告	50
8.1 期末基金资产组合情况	50
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	50
8.3 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	52
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	66
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	69
8.6 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	69

8.7	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	70
8.8	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	70
8.9	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	70
8.10	本基金投资股指期货的投资政策	70
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	70
8.12	投资组合报告附注	71
§9	基金份额持有人信息	71
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	71
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	72
9.3	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	72
§10	开放式基金份额变动	72
§11	重大事件揭示	73
11.1	基金份额持有人大会决议	73
11.2	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	73
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	74
11.4	基金投资策略的改变	74
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	74
11.6	管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	74
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	75
11.8	其他重大事件	79
§12	备查文件目录	82
12.1	备查文件目录	82
12.2	存放地点	82
12.3	查阅方式	82

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	招商中证 500 指数增强型证券投资基金	
基金简称	招商中证 500 指数增强	
基金主代码	004192	
交易代码	004192	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 5 月 17 日	
基金管理人	招商基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	312,627,657.19 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 指数增强 A	招商中证 500 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	004192	004193
报告期末下属分级基金的份 额总额	164,662,744.46 份	147,964,912.73 份

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	招商基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	潘西里
	联系电话	0755-83196666
	电子邮箱	cmf@cmfchina.com
		许俊
		010-66596688
		fxjd_hq@bank-of-china.com

客户服务电话	400-887-9555	95566
传真	0755—83196475	010-66594942
注册地址	深圳市福田区深南大道 7088 号	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址	深圳市福田区深南大道 7088 号	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	518040	100818
法定代表人	王颖	葛海蛟

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.cmfchina.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）	中国上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

单位：人民币元

1、招商中证 500 指数增强 A

3.1.1 期间数据和指标	2025 年	2024 年	2023 年
本期已实现收益	31,572,159.69	10,308,472.78	-1,854,561.80
本期利润	45,083,594.99	12,972,086.28	-2,792,741.97
加权平均基金份额本期利润	0.4661	0.1933	-0.0467
本期加权平均净值利润率	28.85%	15.47%	-3.58%
本期基金份额净值增长率	35.13%	11.14%	-3.28%
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末	2024 年末	2023 年末
期末可供分配利润	113,006,885.86	26,459,522.71	14,566,858.52
期末可供分配基金份额利润	0.6863	0.3645	0.2378
期末基金资产净值	306,202,428.75	99,891,577.94	75,838,076.17
期末基金份额净值	1.8596	1.3762	1.2383
3.1.3 累计期末指标	2025 年末	2024 年末	2023 年末
基金份额累计净值增长率	85.96%	37.62%	23.83%

2、招商中证 500 指数增强 C

3.1.1 期间数据和指标	2025 年	2024 年	2023 年
本期已实现收益	29,183,711.29	9,737,915.46	-1,403,477.23
本期利润	40,236,819.10	15,499,092.04	-885,298.81
加权平均基金份额本期利润	0.4413	0.2023	-0.0161
本期加权平均净值利润率	28.04%	16.59%	-1.25%
本期基金份额净值增长率	34.59%	10.69%	-3.67%
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末	2024 年末	2023 年末
期末可供分配利润	94,845,247.33	23,548,437.43	12,826,010.46
期末可供分配基金份额利润	0.6410	0.3331	0.2140
期末基金资产净值	268,071,815.74	95,168,624.96	72,874,942.42
期末基金份额净值	1.8117	1.3461	1.2161
3.1.3 累计期末指标	2025 年末	2024 年末	2023 年末
基金份额累计净值增长率	81.17%	34.61%	21.61%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

招商中证 500 指数增强 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.41%	1.02%	0.71%	1.18%	1.70%	-0.16%
过去六个月	25.75%	0.96%	24.81%	1.11%	0.94%	-0.15%
过去一年	35.13%	1.08%	28.81%	1.20%	6.32%	-0.12%
过去三年	45.25%	1.21%	26.25%	1.30%	19.00%	-0.09%
过去五年	44.08%	1.18%	16.99%	1.23%	27.09%	-0.05%
自基金合同生效起至今	85.96%	1.25%	24.13%	1.30%	61.83%	-0.05%

招商中证 500 指数增强 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

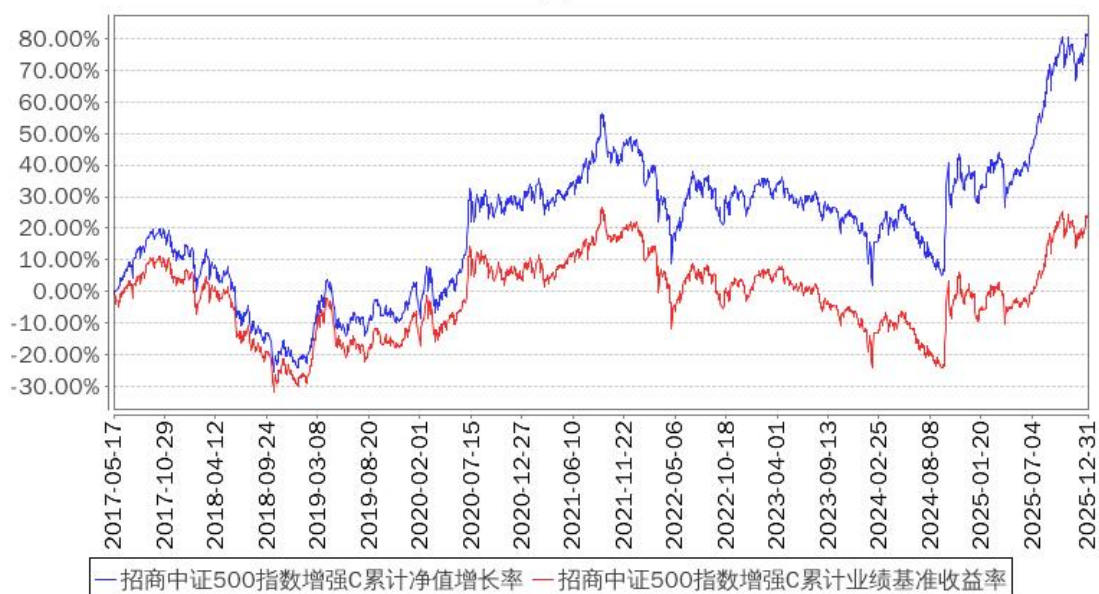
过去三个月	2.30%	1.02%	0.71%	1.18%	1.59%	-0.16%
过去六个月	25.50%	0.96%	24.81%	1.11%	0.69%	-0.15%
过去一年	34.59%	1.08%	28.81%	1.20%	5.78%	-0.12%
过去三年	43.51%	1.21%	26.25%	1.30%	17.26%	-0.09%
过去五年	41.22%	1.18%	16.99%	1.23%	24.23%	-0.05%
自基金合同生效起至今	81.17%	1.25%	24.13%	1.30%	57.04%	-0.05%

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

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

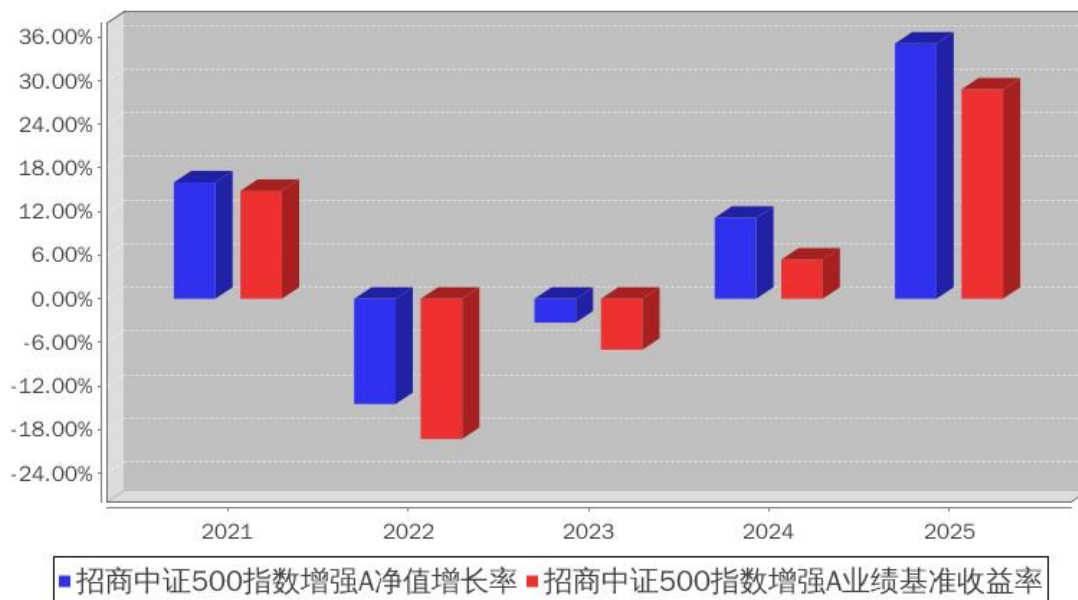


招商中证500指数增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

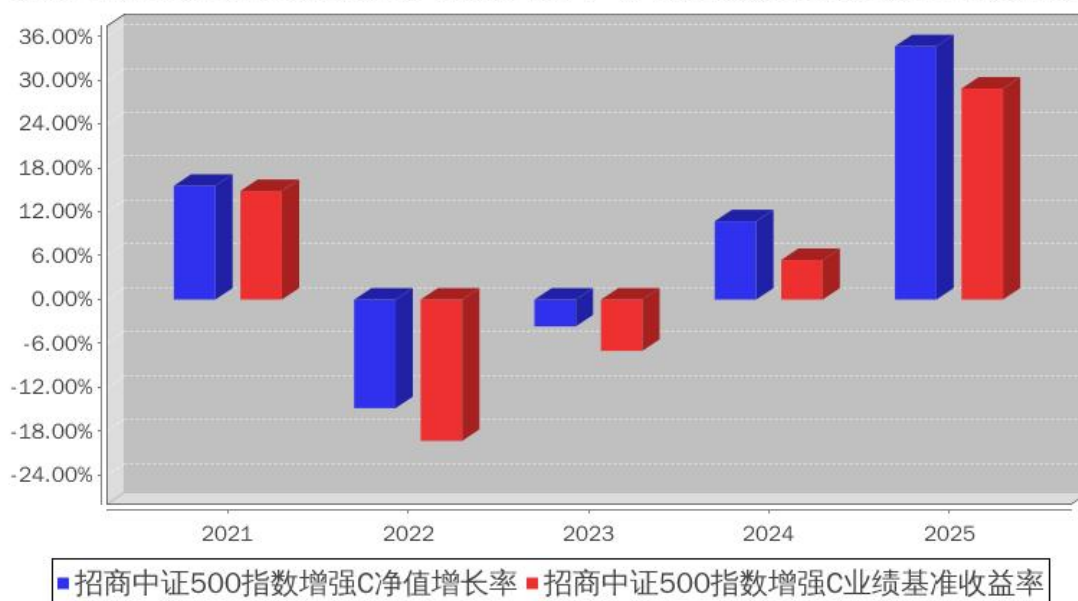


3.2.3 过去五年以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

招商中证500指数增强A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



招商中证500指数增强C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

§ 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,公司注册资本为人民币 13.1 亿元,招商银行股份有限公司持有公司全部股权的 55%,招商证券股份有限公司持有公司全部股权的 45%。

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
邓童	本基金基金经理	2021 年 11 月 23 日	-	13	男, 硕士。2012 年 7 月加入招商基金管理有限公司量化投资部, 曾任研究员, 现任招商中证 500 指数增强型证券投资基金、招商中证大宗商品股票指数证券投资基金 (LOF)、招商中证煤炭等权指数证券投资基金、招商北证 50 成份指数型发起式证券投资基金、招商中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、招商中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金、招商国证 2000 指数增强型证券投资基金、招商安和债券型证券投资基金、招商安康债券型证券投资基金、招商中证红利低波动 100 指数型发起式证券投资基金、招商上证科创板 50 成份增强策略交易型开放式指数证券投资基金、招商上证综合指数增强型发起式证券投资基金、招商中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、招商中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金、招商中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理, 兼任投资经理。

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

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

报告期末，邓童已无同时管理私募资产管理计划的情况。

4.1.4 基金经理薪酬机制

公司基金经理薪酬由固定薪酬及变动奖金等组成。对于基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的，其薪酬奖励结合其管理产品长期投资业绩、综合贡献及合规风控情况等因素综合评定。

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 公平交易制度和控制方法

基金管理人根据《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》和《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》（2011 年修订）的规定，制定了《招商基金管理有限公司公平交易管理办法》，对投资决策的内部控制、交易执行的内部控制、公平交易实施情况的监控与检查稽核、异常交易的监控等进行了规定。为保证各投资组合在投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会，基金管理人合理设置了各类资产管理业务之间以及各类资产管理业务内部的组织结构，建立了科学的投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 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。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

根据相关法律法规及监管规定要求，针对基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情形，公司严格执行公平交易管理相关的内部控制措施，并加强事后监测分析工作，包括：对相关投资组合收益率进行分析、扩大同向交易价差分析时间窗口等。报告期内，上述内部控制措施正常运作，未发现同一基金经理管理的公募基金、私募资产管理计划之间存在不公平交易或可能导致利益输送的异常交易。

4.3.3 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 23 次，为旗下指数及量化等组合因投资策略需要而发生反向交易。报告期内未发现有可能导致不公平交易和利益输送的重大异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内中证 500 指数上涨明显，虽然二季度初在外部因素影响下指数有一定幅度的回调，但是三季度再度拉升，指数全年涨幅超过 30%，创下近几年最大的单年度涨幅。从风格看，全年市场总体偏向成长风格，价值风格和红利风格在连续占优后 2025 年度回调明显，在风格因子中表现靠后。传统多因子模型在风格切换背景下，2025 年度超额收益面临一定压力，尤其是前期贡献较多超额收益的价值类因子和偏向低波类因子表现较差拖累组合超额收益表现，但部分新研发的因子表现较好，本组合相对基准依然有一定的超额收益。

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 35.13%，同期业绩基准增长率为 28.81%，C 类份额净值增长率为 34.59%，同期业绩基准增长率为 28.81%。

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，成长风格在落后于价值风格数年后其反转的持续周期可能也会较长，热点持续轮动下传统多因子框架可能继续面临超额收益回撤的压力，本产品会继续采用多模型分散化配置的框架，力争在较低的跟踪误差下创造出持续的超额收益。我们也将持续加强新因子及新方法的研究，尽力保持策略超额收益的持续性和多元性。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人本着诚实信用、勤勉尽责、合法经营和保障基金持有人利益的原则，经营管理和业务运作稳健、合规，基金的投资、交易、后台等运作规范有序。基金管理人的风险管理及合规控制部门依据独立、客观、公正的原则，主要从以下几个方面进一步加强了公司内部控制和基金投资风险管理工作：

1、公司实施了员工全面培训和形式多样的专题培训，包括不定期推送监管动态和风险案例，持续整理风险点录入系统定期推送，定期或不定期组织法规考试，不定期开展各类合规主题培训等，丰富培训形式，不断提升员工合规与风控意识；

2、公司合规风控部门通过事中合规控制系统、事后投资风险管理系统、风险管理模型等对基金投资合规情况及风险情况进行严格的内部监控和管理；

3、定期稽核方面，除了每季度会对各业务领域进行一次全面的稽核，公司合规审计部门还根据监察稽核计划，对公司的关键业务部门及业务流程进行了专项稽核和检查；

4、根据法律法规的更新及业务的发展变化情况，公司各业务部门对相关内部控制制度提出修改意见和建议，并关注内部控制制度的健全性和有效性，进一步完善了公司内控制度体系，更好的防范法律风险和合规风险。

报告期内，本基金的投资运作符合国家相关法律法规、监管部门的有关规定以及公司相关制度的规定。本基金的投资目标、投资决策依据和投资管理程序均符合相关基金合同和招募说明书的约定，未发现重大异常交易、利益输送、内幕交易及其他有损基金投资者利益的情形。报告期内，本基金若曾因市场波动、申购赎回等原因出现了相关投资比例限制被动突破的情形，均在法规规定的时间内完成了调整，符合法律法规和基金合同的规定和要求。报告期内，本基金未出现因权证未行权、可转债未及时卖出或转股等有损基金份额持有人利益的投资失误行为。本基金管理人承诺将一如既往本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产，在规范经营、控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。

4.7 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。

4.8 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。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本托管人在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责的履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度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 审计报告

6.1 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	招商中证 500 指数增强型证券投资基金全体持有人
审计意见	<p>我们审计了招商中证 500 指数增强型证券投资基金的财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表，2025 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了招商中证 500 指数增强型证券投资基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照《中国注册会计师独立性准则第 1 号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》和中国注册会计师职业道德守则，我们独立于招商中证 500 指数增强型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们在审计中遵循了对公众利益实体审计的独立性要求。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>招商基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括招商中证 500 指数增强型证券投资基金年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估招商中证 500 指数增强型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非</p>

	<p>基金管理人管理层计划清算招商中证 500 指数增强型证券投资基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督招商中证 500 指数增强型证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2)了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3)评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4)对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对招商中证 500 指数增强型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致招商中证 500 指数增强型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5)评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	江丽雅 林婷婷
会计师事务所的地址	中国上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼
审计报告日期	2026 年 3 月 30 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：招商中证 500 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	38,128,436.71	11,782,236.05
结算备付金		33,633,471.29	2,358,311.62
存出保证金		4,912,799.29	177,006.52
交易性金融资产	7.4.7.2	502,973,600.84	183,214,300.45
其中：股票投资		502,884,082.55	183,109,809.56
基金投资		-	-
债券投资		89,518.29	104,490.89
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
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		-	2,489,688.31
应收股利		-	-
应收申购款		4,357,824.08	171,979.91
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		584,006,132.21	200,193,522.86
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		6,030,465.34	-
应付赎回款		2,857,407.03	4,755,494.38
应付管理人报酬		553,701.70	208,874.25
应付托管费		69,212.71	26,109.28

应付销售服务费		84,965.04	34,590.21
应付投资顾问费		-	-
应交税费		28,537.15	2.30
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	107,598.75	108,249.54
负债合计		9,731,887.72	5,133,319.96
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	312,627,657.19	143,284,442.58
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	261,646,587.30	51,775,760.32
净资产合计		574,274,244.49	195,060,202.90
负债和净资产总计		584,006,132.21	200,193,522.86

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，招商中证 500 指数增强 A 份额净值 1.8596 元，基金份额总额 164,662,744.46 份；招商中证 500 指数增强 C 份额净值 1.8117 元，基金份额总额 147,964,912.73 份；总份额合计 312,627,657.19 份。

7.2 利润表

会计主体：招商中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
一、营业总收入		90,080,447.20	31,601,557.86
1.利息收入		174,393.90	76,579.25
其中：存款利息收入	7.4.7.9	174,393.90	76,579.25
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）		64,718,975.42	22,603,029.88
其中：股票投资收益	7.4.7.10	55,831,307.11	18,897,451.17
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	40,694.02	44,200.28
资产支持证券投资	7.4.7.12	-	-
收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.13	-	-

衍生工具收益	7.4.7.14	4,896,470.36	635,311.41
股利收益	7.4.7.15	3,950,503.93	3,026,067.02
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）	7.4.7.16	24,564,543.11	8,424,790.08
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	622,534.77	497,158.65
减：二、营业总支出		4,760,033.11	3,130,379.54
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	3,571,651.14	2,137,939.60
其中：暂估管理人报酬		-	-
2.托管费	7.4.10.2.2	446,456.30	267,242.41
3.销售服务费	7.4.10.2.3	570,600.24	375,584.50
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	7.4.7.18	-	-
7.税金及附加		17,744.45	4,551.80
8.其他费用	7.4.7.19	153,580.98	345,061.23
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		85,320,414.09	28,471,178.32
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		85,320,414.09	28,471,178.32
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		85,320,414.09	28,471,178.32

7.3 净资产变动表

会计主体：招商中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	143,284,442.58	-	51,775,760.32	195,060,202.90

加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	143,284,442.58	-	51,775,760.32	195,060,202.90
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	169,343,214.61	-	209,870,826.98	379,214,041.59
（一）、综合收益总额	-	-	85,320,414.09	85,320,414.09
（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）	169,343,214.61	-	124,550,412.89	293,893,627.50
其中：1.基金申购款	385,388,291.63	-	260,349,134.27	645,737,425.90
2.基金赎回款	-216,045,077.02	-	-135,798,721.38	-351,843,798.40
（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	312,627,657.19	-	261,646,587.30	574,274,244.49
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 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	121,171,725.87	-	27,541,292.72	148,713,018.59
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	121,171,725.87	-	27,541,292.72	148,713,018.59
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	22,112,716.71	-	24,234,467.60	46,347,184.31
（一）、综合收益总额	-	-	28,471,178.32	28,471,178.32
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产	22,112,716.71	-	-4,236,710.72	17,876,005.99

减少以“-”号填列)				
其中: 1.基金申购款	173,573,852.76	-	40,533,868.55	214,107,721.31
2.基金赎回款	-151,461,136.05	-	-44,770,579.27	-196,231,715.32
(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	143,284,442.58	-	51,775,760.32	195,060,202.90

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

招商中证 500 指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人招商基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》《招商中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规的规定,经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]3114 号文准予公开募集注册。本基金为契约型开放式基金,存续期限为不定期。根据销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为 A 类基金份额和 C 类基金份额。本基金首次设立募集基金份额为 332,908,992.33 份,经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了编号为德师报(验)字(17)第 00144 号验资报告。《招商中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)于 2017 年 5 月 17 日正式生效。本基金的基金管理人为招商基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及截至报告期末最新公告的招募说明书的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票和存托凭证(包括主板、中小板、创业板和其他经中国证监会核准上市的股票和存托凭证)、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转债(含可分离交易可转换债)、可交换债、次级债、短期融资券、中期票据等)、债券回购、同业存单、银行存款、货币市场工具、资产支持证券、权证、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金可以参与融资和转融通证

券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金投资于股票、存托凭证资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于中证 500 指数成份券及其备选成份券的资产不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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

7.4.2 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。

7.4.3 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 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1) 金融资产的分类

根据本基金的金融资产业务模式和金融资产的合同现金流量特征，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产，暂无金融资产划分为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

金融资产的合同条款规定在特定日期产生的现金流量仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付，且本基金管理该金融资产业务模式是以收取合同现金流量为目标，

则本基金将该金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产。此类金融资产主要包括货币资金、各类应收款项、买入返售金融资产等。

不符合分类为以摊余成本计量的金融资产以及公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产条件的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产计入“衍生金融资产”外，其他以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产计入“交易性金融资产”。

2) 金融负债的分类

本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。对于以常规方式购买或出售金融资产的，在交易日确认将收到的资产和为此将承担的负债，或者在交易日终止确认已出售的资产。金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券或资产支持证券已到付息期但尚未领取的利息，单独确认为应收项目。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失以及与该金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，发生减值或终止确认产生的利得或损失，计入当期损益。

本基金对分类为以摊余成本计量的金融资产以预期信用损失为基础确认损失准备。除购买或源生的已发生信用减值的金融资产外，本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后的变动情况。若该金融工具的信用风险自初始确认后已显著增加，本基金按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备；若该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加，本基金按照相当于该金融工具未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备。信用损失准备的增加或转回金额，作为减值损失或利得计入当期损益。

本基金在前一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著

增加的情形的，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

本基金利用可获得的合理且有依据的前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止、该金融资产已转移且其所有权上几乎所有的风险和报酬已转移或虽然既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是未保留对该金融资产的控制，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。若本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有风险和报酬，且保留了对该金融资产控制的，则按照其继续涉入被转移金融资产的程度继续确认该被转移金融资产，并相应确认相关负债。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价（包括转出的非现金资产或承担的新金融负债）之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，将其公允价值划分为三个层次。第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值是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；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值原则如下：

(1) 对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市价不能真实反映公允价值的，应对市价进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当投资品种不存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照

实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

(3) 经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整，确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

1) 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

2) 投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本与相关交易费用的差额确认。

债券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖债券价差收入。除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利

息收入。买卖债券价差收入为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

资产支持证券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖资产支持证券价差收入。资产支持证券利息收入在持有期内,按资产支持证券的票面价值和预计收益率计算的利息逐日确认资产支持证券利息收入。在收到资产支持证券支付的款项时,其中属于证券投资收益的部分冲减应计利息(若有)后的差额,确认资产支持证券利息收入。买卖资产支持证券价差收入为卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本、相关交易费用与税费后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额确认,由上市公司代扣代缴的个人所得税于卖出交易日按实际代扣代缴金额确认。

转融通证券出借业务利息收入在转融通证券实际出借期间内,按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息,实际发生时计入当期损益。出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为当期损益。

3) 公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认,并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

4) 信用减值损失

本基金对于以摊余成本计量的金融资产,以预期信用损失为基础确认信用损失准备。本基金所计提的信用减值损失计入当期损益。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬、基金托管费和销售服务费(如适用)按基金合同及相关公告约定的费率和计算方法逐日计提。

卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率逐日计提。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

1) 在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为 12 次,每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%,若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配;

2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3) 基金收益分配后各类基金份额的基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额的基金份额净值减去该类每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4) A 类基金份额和 C 类基金份额之间由于 A 类基金份额不收取而 C 类基金份额收取销售服务费将导致在可供分配利润上有所不同；本基金同一类别的每份基金份额享有同等分配权；

5) 基金可供分配利润为正的情况下，方可进行收益分配；

6) 法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，与所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策与计量基础一致。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》（中基协发[2017]6号），在估值日按照该通知规定的流通受限股票公允价值计算模型进行估值。

(2) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，根据《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（中国证监会公告[2017]13号）及《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》（中基协发[2013]13号）相关规定，本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(3)对于中国证券投资基金业协会《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》(中基协字[2022]566号)所规定的固定收益品种,本基金按照相关规定,对以公允价值计量的固定收益品种选取第三方估值基准服务机构提供估值全价进行估值;对以摊余成本计量的固定收益品种用第三方估值基准服务机构提供的预期信用损失减值计量结果。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继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[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]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、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》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)2018年1月1日起,公开募集证券投资基金管理人运营公开募集证券投资基金过程中发生的资管产品运营业务,以基金管理人为增值税纳税人,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。

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、债券免征增值税,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。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。

(2)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，暂不计缴企业所得税。

(3)对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。

(4)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，对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。

(5)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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
活期存款	38,128,436.71	11,782,236.05
等于：本金	38,124,676.42	11,781,037.39
加：应计利息	3,760.29	1,198.66
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	38,128,436.71	11,782,236.05

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		475,873,290.90	-	502,884,082.55	27,010,791.65
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	61,299.60	193.33	89,518.29	28,025.36
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	61,299.60	193.33	89,518.29	28,025.36
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		475,934,590.50	193.33	502,973,600.84	27,038,817.01
项目		上年度末 2024 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		178,425,828.04	-	183,109,809.56	4,683,981.52
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	88,899.46	168.20	104,490.89	15,423.23
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	88,899.46	168.20	104,490.89	15,423.23
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		178,514,727.50	168.20	183,214,300.45	4,699,404.75

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 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	38,001,495.78	-	-	-
其中：股指期货投资	38,001,495.78	-	-	-

其他衍生工具	-	-	-	-
合计	38,001,495.78	-	-	-
项目	上年度末 2024 年 12 月 31 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	1,170,586.66	-	-	-
其中：股指期货投资	1,170,586.66	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	1,170,586.66	-	-	-

7.4.7.3.2 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
IC2601	中证 500 期货 2601	21.00	31,311,840.00	2,178,024.22
IC2602	中证 500 期货 2602	6.00	8,887,920.00	20,240.00
合计				2,198,264.22
减：可抵销期货暂收款				2,198,264.22
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。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末无各项买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	3,195.58	236.80
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	84,403.17	38,012.74

其中：交易所市场	84,403.17	38,012.74
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	20,000.00	20,000.00
应付指数使用费	-	50,000.00
合计	107,598.75	108,249.54

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

招商中证 500 指数增强 A		
项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	72,585,963.28	72,585,963.28
本期申购	180,203,142.54	180,203,142.54
本期赎回（以“-”号填列）	-88,126,361.36	-88,126,361.36
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	164,662,744.46	164,662,744.46

招商中证 500 指数增强 C		
项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	70,698,479.30	70,698,479.30
本期申购	205,185,149.09	205,185,149.09
本期赎回（以“-”号填列）	-127,918,715.66	-127,918,715.66
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	147,964,912.73	147,964,912.73

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。

7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

招商中证 500 指数增强 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	26,459,522.71	846,091.95	27,305,614.66
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	26,459,522.71	846,091.95	27,305,614.66
本期利润	31,572,159.69	13,511,435.30	45,083,594.99
本期基金份额交易产生的变动数	54,975,203.46	14,175,271.18	69,150,474.64
其中：基金申购款	102,241,512.24	23,485,786.36	125,727,298.60
基金赎回款	-47,266,308.78	-9,310,515.18	-56,576,823.96
本期已分配利润	-	-	-

本期末	113,006,885.86	28,532,798.43	141,539,684.29
-----	----------------	---------------	----------------

招商中证 500 指数增强 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	23,548,437.43	921,708.23	24,470,145.66
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	23,548,437.43	921,708.23	24,470,145.66
本期利润	29,183,711.29	11,053,107.81	40,236,819.10
本期基金份额交易产生的变动数	42,113,098.61	13,286,839.64	55,399,938.25
其中：基金申购款	106,842,924.60	27,778,911.07	134,621,835.67
基金赎回款	-64,729,825.99	-14,492,071.43	-79,221,897.42
本期已分配利润	-	-	-
本期末	94,845,247.33	25,261,655.68	120,106,903.01

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	105,212.38	47,640.96
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	68,735.78	28,555.02
其他	445.74	383.27
合计	174,393.90	76,579.25

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	55,831,307.11	18,897,451.17
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	55,831,307.11	18,897,451.17

7.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	851,590,836.06	635,955,192.57
减：卖出股票成本总额	795,015,382.33	616,495,235.73
减：交易费用	744,146.62	562,505.67
买卖股票差价收入	55,831,307.11	18,897,451.17

7.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无股票赎回差价收入。

7.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无股票申购差价收入。

7.4.7.10.5 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无证券出借差价收入。

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
债券投资收益——利息收入	715.00	2,540.44
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	39,979.02	41,659.84
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	40,694.02	44,200.28

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	175,932.17	801,767.22
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	135,899.49	749,483.79
减：应计利息总额	46.65	10,611.53
减：交易费用	7.01	12.06
买卖债券差价收入	39,979.02	41,659.84

7.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无债券赎回差价收入。

7.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无债券申购差价收入。

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

7.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无买卖资产支持证券差价收入。

7.4.7.12.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券赎回差价收入。

7.4.7.12.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券申购差价收入。

7.4.7.13 贵金属投资收益

7.4.7.13.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.13.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无买卖贵金属差价收入。

7.4.7.13.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属赎回差价收入。

7.4.7.13.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属申购差价收入。

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具买卖权证差价收入。

7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

股指期货投资收益	4,896,470.36	635,311.41
----------	--------------	------------

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	3,950,503.93	3,026,067.02
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	3,950,503.93	3,026,067.02

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	22,339,612.23	8,607,136.74
——股票投资	22,327,010.10	8,654,256.35
——债券投资	12,602.13	-47,119.61
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	2,224,930.88	-182,346.66
——权证投资	-	-
——期货投资	2,224,930.88	-182,346.66
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	24,564,543.11	8,424,790.08

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	622,534.77	497,158.65
合计	622,534.77	497,158.65

7.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内及上年度可比期间无信用减值损失。

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
----	--	---

审计费用	20,000.00	20,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
其他	13,580.98	205,061.23
合计	153,580.98	345,061.23

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

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
招融资本私募股权基金管理(深圳)有限责任公司	基金管理人的全资子公司
招商财富资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司
博时基金(国际)有限公司	基金管理人的参股经营机构

注：1、本报告期内，招融资本私募股权基金管理(深圳)有限责任公司变更为本基金管理人全资子公司。

2、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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 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。

7.4.10.1.4 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。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,571,651.14	2,137,939.60
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,556,526.46	771,728.44
应支付基金管理人的净管理费	2,015,124.68	1,366,211.16

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：

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

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	446,456.30	267,242.41

注：支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值×0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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

7.4.10.2.3 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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	招商中证 500 指数增强 A	招商中证 500 指数增强 C	合计
招商基金管理有限公司	-	6,775.49	6,775.49
招商银行	-	293,715.12	293,715.12
招商证券	-	446.14	446.14
中国银行	-	3,161.72	3,161.72
合计	-	304,098.47	304,098.47

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	招商中证 500 指数增强 A	招商中证 500 指数增强 C	合计
招商基金管理有限公司	-	106,166.88	106,166.88
招商银行	-	125,571.11	125,571.11
招商证券	-	291.72	291.72
中国银行	-	-	-
合计	-	232,029.71	232,029.71

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

其计算公式为：

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

7.4.10.3 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。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 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。

7.4.10.5.2 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。

7.4.10.6 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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
-------	-------------------------------------	--

	月 31 日		2024 年 12 月 31 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	38,128,436.71	105,212.38	11,782,236.05	47,640.96

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。

7.4.10.7 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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 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
招商证券	301632	广东建科	网下申购	6,557	43,013.92
招商证券	001386	马可波罗	网下申购	3,236	44,495.00
招商证券	301638	南网数字	网下申购	17,706	100,747.14
招商证券	301449	天溯计量	网下申购	1,118	41,142.40
招商证券、中银国际证券	688795	摩尔线程	网下申购	304	34,741.12
中银国际证券	603409	汇通控股	网下申购	776	18,763.68

上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 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	688692	达梦数据	网下申购	628	54,610.88
招商证券	301631	壹连科技	网下申购	949	69,267.51

注：本表已包含托管人的关联方承销期内承销的证券。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2025 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
001221	悍高集团	2025 年 7 月 23 日	6 个月	新股流通受限	15.43	56.94	160	2,468.80	9,110.40	-
001233	海安集团	2025 年 11 月 18 日	6 个月	新股流通受限	48.00	51.88	333	15,984.00	17,276.04	-

		日								
001280	中国铀业	2025 年 11 月 25 日	6 个月	新股流通 受限	17.89	45.36	1,996	35,708.44	90,538.56	-
001285	瑞立科密	2025 年 9 月 23 日	6 个月	新股流通 受限	42.28	56.08	89	3,762.92	4,991.12	-
001369	双欣环保	2025 年 12 月 23 日	6 个月	新股流通 受限	6.85	12.89	897	6,144.45	11,562.33	-
001386	马可波罗	2025 年 10 月 15 日	6 个月	新股流通 受限	13.75	18.53	971	13,351.25	17,992.63	-
001388	信通电子	2025 年 6 月 24 日	6 个月	新股流通 受限	16.42	42.94	94	1,543.48	4,036.36	-
001396	誉帆科技	2025 年 12 月 23 日	6 个月	新股流通 受限	22.29	35.39	69	1,538.01	2,441.91	-
301449	天溯计量	2025 年 12 月 16 日	6 个月	新股流通 受限	36.80	65.23	112	4,121.60	7,305.76	-
301491	汉桑科技	2025 年 7 月 29 日	6 个月	新股流通 受限	28.91	55.11	201	5,810.91	11,077.11	-
301563	云汉芯城	2025 年 9 月 23 日	6 个月	新股流通 受限	27.00	133.69	110	2,970.00	14,705.90	-
301575	艾芬达	2025 年 9 月 3 日	6 个月	新股流通 受限	27.69	49.55	126	3,488.94	6,243.30	-
301584	建发致新	2025 年 9 月 18 日	6 个月	新股流通 受限	7.05	26.82	447	3,151.35	11,988.54	-
301609	山大电力	2025 年 7 月 16 日	6 个月	新股流通 受限	14.66	40.99	277	4,060.82	11,354.23	-
301632	广东建科	2025 年 8 月 5 日	6 个月	新股流通 受限	6.56	23.68	656	4,303.36	15,534.08	-
301638	南网数字	2025 年 11 月 11 日	6 个月	新股流通 受限	5.69	14.21	1,771	10,076.99	25,165.91	-
301656	联合动力	2025 年	6 个月	新股流通	12.48	25.46	2,265	28,267.20	57,666.90	-

		9月17日		受限							
301667	纳百川	2025年12月10日	6个月	新股流通受限	22.63	57.07	151	3,417.13	8,617.57	-	
301668	昊创瑞通	2025年9月15日	6个月	新股流通受限	21.00	44.80	165	3,465.00	7,392.00	-	
301687	新广益	2025年12月24日	6个月	新股流通受限	21.93	54.39	195	4,276.35	10,606.05	-	
600930	华电新能	2025年7月9日	6个月	新股流通受限	3.18	6.24	44,947	142,931.46	280,469.28	-	
601026	道生天合	2025年10月9日	6个月	新股流通受限	5.98	14.28	451	2,696.98	6,440.28	-	
603092	德力佳	2025年10月30日	6个月	新股流通受限	46.68	55.66	113	5,274.84	6,289.58	-	
603175	超颖电子	2025年10月17日	6个月	新股流通受限	17.08	48.56	169	2,886.52	8,206.64	-	
603248	锡华科技	2025年12月16日	6个月	新股流通受限	10.10	16.30	260	2,626.00	4,238.00	-	
603262	技源集团	2025年7月16日	6个月	新股流通受限	10.88	28.10	155	1,686.40	4,355.50	-	
603334	丰倍生物	2025年10月29日	6个月	新股流通受限	24.49	32.82	88	2,155.12	2,888.16	-	
603370	华新精科	2025年8月27日	6个月	新股流通受限	18.60	46.35	82	1,525.20	3,800.70	-	
603376	大明电子	2025年10月28日	6个月	新股流通受限	12.55	26.21	111	1,393.05	2,909.31	-	
603406	天富龙	2025年7月30日	6个月	新股流通受限	23.60	40.16	105	2,478.00	4,216.80	-	
603418	友升股份	2025年9月16日	6个月	新股流通受限	46.36	59.06	90	4,172.40	5,315.40	-	

688727	恒坤新材	2025 年 11 月 11 日	6 个月	新股流通受限	14.99	34.87	563	8,439.37	19,631.81	-
688729	屹唐股份	2025 年 7 月 1 日	6 个月	新股流通受限	8.45	24.28	1,039	8,779.55	25,226.92	-
688759	必贝特	2025 年 10 月 21 日	6 个月	新股流通受限	17.78	25.11	367	6,525.26	9,215.37	-
688765	禾元生物	2025 年 10 月 16 日	6 个月	新股流通受限	29.06	52.62	103	2,993.18	5,419.86	-
688790	昂瑞微	2025 年 12 月 9 日	6 个月	新股流通受限	83.06	117.19	58	4,817.48	6,797.02	-
688795	摩尔线程	2025 年 11 月 26 日	6 个月	新股流通受限	114.28	416.18	61	6,971.08	25,386.98	-
688796	百奥赛图	2025 年 12 月 2 日	6 个月	新股流通受限	26.68	42.25	423	11,285.64	17,871.75	-
688802	沐曦股份	2025 年 12 月 9 日	6 个月	新股流通受限	104.66	399.31	37	3,872.42	14,774.47	-
688805	健信超导	2025 年 12 月 17 日	6 个月	新股流通受限	18.58	32.37	265	4,923.70	8,578.05	-
688807	优迅股份	2025 年 12 月 10 日	6 个月	新股流通受限	51.66	135.56	131	6,767.46	17,758.36	-
688809	强一股份	2025 年 12 月 23 日	6 个月	新股流通受限	85.09	203.31	167	14,210.03	33,952.77	-

7.4.12.1.2 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。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票	停牌日期	停牌	期末	复牌	复牌开	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	----	------	----	----	----	-----	-------	--------	--------	----

码	名称		原因	估值 单价	日期	盘单价				
002049	紫光 国微	2025 年 12 月 30 日	重大 事项 停牌	78.81	2026 年 1 月 15 日	86.69	9,200	693,340.20	725,052.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 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。

7.4.12.3.2 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。

7.4.12.4 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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、债券投资及其他。

本基金的银行存款存放在本基金的基金托管人开立的托管账户中，因此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。本基金参与转融通证券出借业务，其中非约定申报出借证券均为通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司出借证券，本基金的基金管理人对约定申报的借券证券公司的偿

付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理,对不同的债券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整,债券证券公司最近 1 年的分类结果应为 A 类。因此,本基金面临的违约风险可能性很小。

对于与债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。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参见附注 7.4.13.2.1 至 7.4.13.2.6,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。

7.4.13.2.1 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。

7.4.13.2.2 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。

7.4.13.2.3 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。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位:人民币元

长期信用评级	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	89,518.29	104,490.89
未评级	-	-
合计	89,518.29	104,490.89

注:债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

7.4.13.2.5 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。

7.4.13.2.6 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。

7.4.13.3 流动性风险

7.4.13.3.1 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 7.4.12 所披露的流通受限不能自由转让的基金资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。除卖出回购金融资产外，本基金所持有的金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

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

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

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	38,128,436.71	-	-	-	38,128,436.71
结算备付金	33,633,471.29	-	-	-	33,633,471.29
存出保证金	88,828.09	-	-	4,823,971.20	4,912,799.29
交易性金融资产	-	89,518.29	-	502,884,082.55	502,973,600.84
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	4,357,824.08	4,357,824.08
应收清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-

资产总计	71,850,736.09	89,518.29	-	512,065,877.83	584,006,132.21
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,857,407.03	2,857,407.03
应付管理人报酬	-	-	-	553,701.70	553,701.70
应付托管费	-	-	-	69,212.71	69,212.71
应付清算款	-	-	-	6,030,465.34	6,030,465.34
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	84,965.04	84,965.04
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	28,537.15	28,537.15
其他负债	-	-	-	107,598.75	107,598.75
负债总计	-	-	-	9,731,887.72	9,731,887.72
利率敏感度缺口	71,850,736.09	89,518.29	-	502,333,990.11	574,274,244.49
上年度末 2024 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	11,782,236.05	-	-	-	11,782,236.05
结算备付金	2,358,311.62	-	-	-	2,358,311.62
存出保证金	39,736.12	-	-	137,270.40	177,006.52
交易性金融资产	-	98,084.69	6,406.20	183,109,809.56	183,214,300.45
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	171,979.91	171,979.91
应收清算款	-	-	-	2,489,688.31	2,489,688.31
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	14,180,283.79	98,084.69	6,406.20	185,908,748.18	200,193,522.86
负债					
应付赎回款	-	-	-	4,755,494.38	4,755,494.38
应付管理人报酬	-	-	-	208,874.25	208,874.25
应付托管费	-	-	-	26,109.28	26,109.28
应付清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	34,590.21	34,590.21
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	2.30	2.30
其他负债	-	-	-	108,249.54	108,249.54
负债总计	-	-	-	5,133,319.96	5,133,319.96
利率敏感度缺口	14,180,283.79	98,084.69	6,406.20	180,775,428.22	195,060,202.90

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。

7.4.13.4.1.2 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（2025 年 12 月 31 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	1. 市场利率平行上升 50 个基点	-1,325.66	-2,060.52
	2. 市场利率平行下降 50 个基点	1,353.30	2,113.69

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日		上年度末 2024 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	502,884,082.55	87.57	183,109,809.56	93.87
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	502,884,082.55	87.57	183,109,809.56	93.87

7.4.13.4.2.2 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（2025 年 12 月 31 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	1. 权益性投资的市场价格上升 5%	25,144,204.13	9,155,490.48
	2. 权益性投资的市场价格下降 5%	-25,144,204.13	-9,155,490.48

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	501,388,246.13	182,842,383.04
第二层次	726,005.00	22,859.30
第三层次	859,349.71	349,058.11
合计	502,973,600.84	183,214,300.45

7.4.14.2.2 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。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	349,058.11	349,058.11

当期购买	-	540,474.76	540,474.76
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	2,201.70	2,201.70
转出第三层次	-	806,073.50	806,073.50
当期利得或损失总额	-	773,688.64	773,688.64
其中：计入损益的利得或损失	-	773,688.64	773,688.64
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	859,349.71	859,349.71
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	452,027.57	452,027.57
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	423,338.93	423,338.93
当期购买	-	244,891.92	244,891.92
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	560,401.35	560,401.35
当期利得或损失总额	-	241,228.61	241,228.61
其中：计入损益的利得或损失	-	241,228.61	241,228.61
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	349,058.11	349,058.11
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	213,009.44	213,009.44

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

金额单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票投资	859,349.71	平均价格亚式期权模型	流通受限股票 预期波动率	0.0000-3.0791	负相关

项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票投资	349,058.11	平均价格亚式期权模型	流通受限股票预期波动率	0.2665-5.7444	负相关

7.4.14.3 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。

7.4.14.4 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。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内及上年度可比期间无需要说明有助于理解和分析会计报表的其他事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	502,884,082.55	86.11
	其中：股票	502,884,082.55	86.11
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	89,518.29	0.02
	其中：债券	89,518.29	0.02
	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	71,761,908.00	12.29
8	其他各项资产	9,270,623.37	1.59
9	合计	584,006,132.21	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	746,785.00	0.13
B	采矿业	14,048,488.20	2.45
C	制造业	306,076,101.88	53.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	17,586,257.00	3.06
E	建筑业	4,837,428.00	0.84
F	批发和零售业	8,963,728.84	1.56
G	交通运输、仓储和邮政业	6,749,233.00	1.18
H	住宿和餐饮业	457,387.00	0.08
I	信息传输、软件和信息技术服务业	33,027,201.28	5.75
J	金融业	18,323,769.00	3.19
K	房地产业	1,114,954.00	0.19
L	租赁和商务服务业	3,087,830.00	0.54
M	科学研究和技术服务业	7,534,979.58	1.31
N	水利、环境和公共设施管理业	851,356.00	0.15
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,075,008.00	0.19
R	文化、体育和娱乐业	2,454,996.00	0.43
S	综合	-	-
	合计	426,935,502.78	74.34

8.2.2 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	467,064.00	0.08
B	采矿业	538,114.56	0.09
C	制造业	52,208,920.55	9.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,022,626.09	0.70
E	建筑业	1,008,159.00	0.18
F	批发和零售业	1,132,051.18	0.20
G	交通运输、仓储和邮政业	745,181.88	0.13
H	住宿和餐饮业	328,300.00	0.06
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,312,795.34	1.10
J	金融业	3,878,371.00	0.68
K	房地产业	872,120.00	0.15
L	租赁和商务服务业	1,890,167.44	0.33

M	科学研究和技术服务业	2,387,697.65	0.42
N	水利、环境和公共设施管理业	157,011.08	0.03
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	75,948,579.77	13.23

8.2.3 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。

8.3 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

8.3.1 报告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

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	000050	深天马 A	816,301	7,371,198.03	1.28
2	600166	福田汽车	2,347,100	6,853,532.00	1.19
3	601231	环旭电子	213,600	6,408,000.00	1.12
4	300496	中科创达	92,100	6,216,750.00	1.08
5	601717	中创智领	248,100	6,090,855.00	1.06
6	002202	金风科技	296,500	6,048,600.00	1.05
7	300373	扬杰科技	87,300	5,936,400.00	1.03
8	002436	兴森科技	272,766	5,774,456.22	1.01
9	600699	均胜电子	181,700	5,698,112.00	0.99
10	002008	大族激光	137,200	5,651,268.00	0.98
11	300012	华测检测	405,400	5,493,170.00	0.96
12	002414	高德红外	368,200	5,401,494.00	0.94
13	600060	海信视像	212,500	5,159,500.00	0.90
14	300454	深信服	44,400	5,113,104.00	0.89
15	002624	完美世界	306,500	5,023,535.00	0.87
16	002080	中材科技	134,500	4,887,730.00	0.85
17	600098	广州发展	737,300	4,821,942.00	0.84
18	603816	顾家家居	156,100	4,798,514.00	0.84
19	300073	当升科技	78,200	4,519,960.00	0.79
20	600282	南钢股份	849,800	4,469,948.00	0.78
21	002558	巨人网络	100,600	4,354,974.00	0.76
22	601168	西部矿业	154,400	4,267,616.00	0.74
23	600143	金发科技	216,000	4,220,640.00	0.73
24	000932	华菱钢铁	747,700	4,202,074.00	0.73

25	600378	昊华科技	131,000	4,186,760.00	0.73
26	000887	中鼎股份	177,800	4,126,738.00	0.72
27	600549	厦门钨业	99,300	4,077,258.00	0.71
28	600685	中船防务	143,300	4,076,885.00	0.71
29	600704	物产中大	723,300	4,028,781.00	0.70
30	603486	科沃斯	49,800	4,017,864.00	0.70
31	300003	乐普医疗	253,400	4,006,254.00	0.70
32	000657	中钨高新	141,600	3,923,736.00	0.68
33	000825	太钢不锈	797,900	3,901,731.00	0.68
34	601212	白银有色	652,700	3,818,295.00	0.66
35	300458	全志科技	89,900	3,778,497.00	0.66
36	001696	宗申动力	170,200	3,691,638.00	0.64
37	002056	横店东磁	188,900	3,683,550.00	0.64
38	000703	恒逸石化	336,800	3,627,336.00	0.63
39	688002	睿创微纳	34,119	3,439,195.20	0.60
40	000959	首钢股份	677,200	3,318,280.00	0.58
41	600170	上海建工	1,183,100	3,135,215.00	0.55
42	002508	老板电器	159,400	3,084,390.00	0.54
43	600801	华新建材	124,000	3,042,960.00	0.53
44	002223	鱼跃医疗	79,600	3,041,516.00	0.53
45	002603	以岭药业	177,900	3,036,753.00	0.53
46	000709	河钢股份	1,300,100	3,003,231.00	0.52
47	603529	爱玛科技	97,500	2,895,750.00	0.50
48	002185	华天科技	257,400	2,823,678.00	0.49
49	600126	杭钢股份	341,900	2,789,904.00	0.49
50	002085	万丰奥威	168,800	2,702,488.00	0.47
51	000539	粤电力 A	606,000	2,678,520.00	0.47
52	000951	中国重汽	157,700	2,665,130.00	0.46
53	300919	中伟新材	57,300	2,654,709.00	0.46
54	000060	中金岭南	449,800	2,631,330.00	0.46
55	000783	长江证券	321,900	2,623,485.00	0.46
56	301200	大族数控	21,300	2,529,801.00	0.44
57	603379	三美股份	41,300	2,507,736.00	0.44
58	600329	达仁堂	54,500	2,486,290.00	0.43
59	688772	珠海冠宇	112,649	2,425,332.97	0.42
60	300207	欣旺达	89,900	2,350,885.00	0.41
61	603341	龙旗科技	53,600	2,265,136.00	0.39
62	002410	广联达	177,400	2,231,692.00	0.39
63	603160	汇顶科技	28,000	2,212,000.00	0.39
64	688301	奕瑞科技	21,851	2,209,354.61	0.38
65	600380	健康元	188,000	2,171,400.00	0.38
66	603444	吉比特	5,100	2,161,635.00	0.38
67	600487	亨通光电	87,000	2,151,510.00	0.37

68	000039	中集集团	212,200	2,141,098.00	0.37
69	002156	通富微电	56,500	2,130,050.00	0.37
70	600879	航天电子	92,800	1,978,496.00	0.34
71	002340	格林美	235,800	1,971,288.00	0.34
72	002152	广电运通	142,100	1,962,401.00	0.34
73	688819	天能股份	56,370	1,872,611.40	0.33
74	600499	科达制造	131,300	1,821,131.00	0.32
75	601108	财通证券	198,200	1,728,304.00	0.30
76	002138	顺络电子	46,200	1,641,486.00	0.29
77	600339	中油工程	484,600	1,623,410.00	0.28
78	600909	华安证券	235,500	1,596,690.00	0.28
79	600141	兴发集团	44,900	1,552,642.00	0.27
80	603885	吉祥航空	104,200	1,550,496.00	0.27
81	603737	三棵树	33,360	1,543,567.20	0.27
82	600352	浙江龙盛	141,100	1,504,126.00	0.26
83	600873	梅花生物	148,100	1,500,253.00	0.26
84	002841	视源股份	37,800	1,498,014.00	0.26
85	000027	深圳能源	226,800	1,478,736.00	0.26
86	600655	豫园股份	288,100	1,477,953.00	0.26
87	603899	晨光股份	54,200	1,466,652.00	0.26
88	600498	烽火通信	45,700	1,466,056.00	0.26
89	600153	建发股份	157,400	1,455,950.00	0.25
90	000415	渤海租赁	356,000	1,441,800.00	0.25
91	002273	水晶光电	56,700	1,424,304.00	0.25
92	603766	隆鑫通用	86,000	1,385,460.00	0.24
93	300735	光弘科技	55,200	1,372,272.00	0.24
94	002739	万达电影	121,000	1,369,720.00	0.24
95	601139	深圳燃气	206,900	1,365,540.00	0.24
96	300888	稳健医疗	35,600	1,347,104.00	0.23
97	000997	新大陆	47,300	1,339,536.00	0.23
98	601958	金钼股份	85,300	1,328,974.00	0.23
99	603979	金诚信	17,300	1,317,395.00	0.23
100	300676	华大基因	28,600	1,297,296.00	0.23
101	603927	中科软	67,500	1,288,575.00	0.22
102	600739	辽宁成大	113,900	1,273,402.00	0.22
103	600885	宏发股份	41,760	1,269,504.00	0.22
104	688336	三生国健	21,100	1,256,927.00	0.22
105	605589	圣泉集团	44,300	1,253,690.00	0.22
106	688728	格科微	82,491	1,232,415.54	0.21
107	002078	太阳纸业	78,000	1,228,500.00	0.21
108	600820	隧道股份	188,800	1,225,312.00	0.21
109	002155	湖南黄金	57,980	1,222,798.20	0.21
110	600528	中铁工业	149,000	1,218,820.00	0.21

111	000960	锡业股份	42,800	1,193,264.00	0.21
112	002831	裕同科技	41,600	1,186,016.00	0.21
113	600079	人福医药	65,200	1,180,772.00	0.21
114	600369	西南证券	261,100	1,169,728.00	0.20
115	600348	华阳股份	141,000	1,164,660.00	0.20
116	601228	广州港	357,300	1,157,652.00	0.20
117	600435	北方导航	74,800	1,153,416.00	0.20
118	600096	云天化	34,200	1,142,622.00	0.20
119	603298	杭叉集团	42,800	1,137,196.00	0.20
120	000528	柳工	95,700	1,135,959.00	0.20
121	300136	信维通信	17,900	1,109,800.00	0.19
122	301358	湖南裕能	17,000	1,099,220.00	0.19
123	688183	生益电子	11,308	1,082,062.52	0.19
124	002044	美年健康	203,600	1,075,008.00	0.19
125	002312	川发龙蟒	97,300	1,063,489.00	0.19
126	600332	白云山	39,600	1,019,304.00	0.18
127	601162	天风证券	242,800	1,010,048.00	0.18
128	000921	海信家电	40,700	1,009,767.00	0.18
129	600998	九州通	194,372	995,184.64	0.17
130	000513	丽珠集团	28,800	992,448.00	0.17
131	688100	威胜信息	24,857	976,880.10	0.17
132	603858	步长制药	60,300	943,092.00	0.16
133	603129	春风动力	3,300	919,644.00	0.16
134	300604	长川科技	8,900	901,659.00	0.16
135	601966	玲珑轮胎	62,000	900,860.00	0.16
136	002673	西部证券	109,100	860,799.00	0.15
137	000009	中国宝安	87,000	856,950.00	0.15
138	688052	纳芯微	5,081	803,712.58	0.14
139	002281	光迅科技	11,100	776,445.00	0.14
140	000733	振华科技	14,700	770,427.00	0.13
141	002318	久立特材	26,500	767,175.00	0.13
142	688475	萤石网络	25,350	763,288.50	0.13
143	603659	璞泰来	27,800	760,052.00	0.13
144	300679	电连技术	15,600	759,408.00	0.13
145	600707	彩虹股份	116,800	758,032.00	0.13
146	301536	星辰科技	12,600	754,866.00	0.13
147	003031	中瓷电子	10,256	750,328.96	0.13
148	688213	思特威	7,833	744,839.97	0.13
149	300450	先导智能	14,900	744,702.00	0.13
150	601865	福莱特	46,400	727,088.00	0.13
151	601233	桐昆股份	42,100	724,541.00	0.13
152	600109	国金证券	73,700	685,410.00	0.12
153	300474	景嘉微	9,400	675,578.00	0.12

154	002926	华西证券	72,600	673,728.00	0.12
155	600906	财达证券	99,000	660,330.00	0.11
156	002195	岩山科技	93,000	659,370.00	0.11
157	002335	科华数据	11,800	655,254.00	0.11
158	300054	鼎龙股份	17,400	654,240.00	0.11
159	601608	中信重工	97,600	643,184.00	0.11
160	002595	豪迈科技	7,600	642,276.00	0.11
161	600583	海油工程	115,900	636,291.00	0.11
162	000987	越秀资本	77,600	631,664.00	0.11
163	600968	海油发展	163,100	626,304.00	0.11
164	002517	恺英网络	28,100	614,547.00	0.11
165	688561	奇安信	17,135	609,663.30	0.11
166	600131	国网信通	37,100	598,794.00	0.10
167	002444	巨星科技	17,300	588,546.00	0.10
168	300567	精测电子	6,400	583,680.00	0.10
169	600995	南网储能	45,600	573,192.00	0.10
170	002025	航天电器	11,400	571,482.00	0.10
171	688778	厦钨新能	7,351	568,746.87	0.10
172	688295	中复神鹰	17,281	566,989.61	0.10
173	301308	江波龙	2,300	563,132.00	0.10
174	603699	纽威股份	10,800	561,276.00	0.10
175	601216	君正集团	111,700	538,394.00	0.09
176	000750	国海证券	126,100	534,664.00	0.09
177	601000	唐山港	135,600	520,704.00	0.09
178	600884	杉杉股份	38,100	514,731.00	0.09
179	601019	山东出版	59,200	511,488.00	0.09
180	603568	伟明环保	19,900	505,062.00	0.09
181	000830	鲁西化工	30,000	497,100.00	0.09
182	600295	鄂尔多斯	40,200	496,872.00	0.09
183	603156	养元饮品	17,000	488,750.00	0.09
184	300627	华测导航	14,000	488,740.00	0.09
185	002385	大北农	121,900	487,600.00	0.08
186	600578	京能电力	95,200	485,520.00	0.08
187	300487	蓝晓科技	7,800	481,650.00	0.08
188	600970	中材国际	45,900	476,901.00	0.08
189	688563	航材股份	8,156	476,718.20	0.08
190	000683	博源化工	62,800	467,232.00	0.08
191	300142	沃森生物	42,800	466,948.00	0.08
192	600298	安琪酵母	10,600	463,644.00	0.08
193	000582	北部湾港	49,200	461,496.00	0.08
194	000893	亚钾国际	9,600	460,512.00	0.08
195	600486	扬农化工	6,600	457,974.00	0.08
196	002850	科达利	2,900	457,794.00	0.08

197	600754	锦江酒店	18,100	457,387.00	0.08
198	002271	东方雨虹	33,300	452,547.00	0.08
199	000898	鞍钢股份	177,600	449,328.00	0.08
200	002299	圣农发展	27,100	448,234.00	0.08
201	603606	东方电缆	7,500	448,125.00	0.08
202	300146	汤臣倍健	37,200	446,772.00	0.08
203	600598	北大荒	29,800	445,510.00	0.08
204	600177	雅戈尔	58,600	445,360.00	0.08
205	000623	吉林敖东	22,800	445,284.00	0.08
206	601577	长沙银行	45,900	445,230.00	0.08
207	002966	苏州银行	53,700	445,173.00	0.08
208	600032	浙江新能	60,000	444,600.00	0.08
209	002244	滨江集团	44,100	443,205.00	0.08
210	600901	江苏金租	72,400	443,088.00	0.08
211	600959	江苏有线	128,700	442,728.00	0.08
212	000591	太阳能	99,400	441,336.00	0.08
213	603233	大参林	25,000	440,500.00	0.08
214	601866	中远海发	174,700	440,244.00	0.08
215	600008	首创环保	146,600	439,800.00	0.08
216	600871	石化油服	203,500	439,560.00	0.08
217	601880	辽港股份	274,600	439,360.00	0.08
218	000739	普洛药业	27,000	439,290.00	0.08
219	600582	天地科技	75,300	438,999.00	0.08
220	000563	陕国投 A	127,200	438,840.00	0.08
221	002007	华兰生物	29,000	438,770.00	0.08
222	601990	南京证券	55,400	438,768.00	0.08
223	000598	兴蓉环境	61,100	438,087.00	0.08
224	601198	东兴证券	31,500	437,220.00	0.08
225	001213	中铁特货	107,900	436,995.00	0.08
226	000937	冀中能源	81,100	436,318.00	0.08
227	002500	山西证券	72,800	436,072.00	0.08
228	603345	安井食品	5,500	436,040.00	0.08
229	000883	湖北能源	96,000	435,840.00	0.08
230	601155	新城控股	31,200	435,240.00	0.08
231	601997	贵阳银行	74,000	434,380.00	0.08
232	601991	大唐发电	124,400	434,156.00	0.08
233	600511	国药股份	15,100	434,125.00	0.08
234	600535	天士力	28,800	434,016.00	0.08
234	601128	常熟银行	61,650	434,016.00	0.08
235	601016	节能风电	147,100	433,945.00	0.08
236	002958	青农商行	139,900	433,690.00	0.08
237	000537	绿发电力	52,800	433,488.00	0.08
238	601921	浙版传媒	55,400	433,228.00	0.08

239	003035	南网能源	94,500	432,810.00	0.08
240	600004	白云机场	45,500	430,430.00	0.07
241	601598	中国外运	70,400	426,624.00	0.07
242	600863	内蒙华电	94,200	422,016.00	0.07
243	603565	中谷物流	42,000	421,680.00	0.07
244	601918	新集能源	63,600	420,396.00	0.07
245	002608	江苏国信	56,500	417,535.00	0.07
246	600483	福能股份	43,500	411,945.00	0.07
247	001286	陕西能源	44,200	411,502.00	0.07
248	002064	华峰化学	33,400	367,400.00	0.06
249	688188	柏楚电子	2,700	366,903.00	0.06
250	002532	天山铝业	22,500	364,050.00	0.06
251	300857	协创数据	2,100	354,228.00	0.06
252	300748	金力永磁	9,900	337,689.00	0.06
253	600497	驰宏锌锗	46,100	336,991.00	0.06
254	002402	和而泰	8,500	332,520.00	0.06
255	600862	中航高科	14,000	330,820.00	0.06
256	000738	航发控制	15,400	328,174.00	0.06
257	601156	东航物流	17,600	324,016.00	0.06
258	000933	神火股份	11,500	315,905.00	0.06
259	003022	联泓新科	15,900	314,979.00	0.05
260	002262	恩华药业	13,000	313,690.00	0.05
261	601061	中信金属	21,700	312,480.00	0.05
262	688248	南网科技	6,967	311,703.58	0.05
263	000728	国元证券	36,500	304,775.00	0.05
264	600563	法拉电子	2,900	304,355.00	0.05
265	600299	安迪苏	33,700	302,289.00	0.05
266	002939	长城证券	29,600	301,920.00	0.05
267	000155	川能动力	25,900	301,735.00	0.05
268	601118	海南橡胶	51,500	301,275.00	0.05
269	688099	晶晨股份	3,432	299,373.36	0.05
270	601099	太平洋	72,700	298,797.00	0.05
271	000958	电投产融	45,500	294,385.00	0.05
272	600516	方大炭素	51,500	293,035.00	0.05
273	600546	山煤国际	29,000	292,610.00	0.05
274	603228	景旺电子	4,000	292,360.00	0.05
275	600642	申能股份	36,600	284,748.00	0.05
276	002432	九安医疗	7,100	284,284.00	0.05
277	600566	济川药业	10,700	281,410.00	0.05
278	600663	陆家嘴	29,900	236,509.00	0.04
279	002429	兆驰股份	28,000	207,760.00	0.04
280	600967	内蒙一机	11,700	196,560.00	0.03
281	300070	碧水源	50,000	196,000.00	0.03

282	603596	伯特利	3,800	194,826.00	0.03
283	600038	中直股份	5,300	191,489.00	0.03
284	300058	蓝色光标	16,500	190,080.00	0.03
285	688425	铁建重工	37,400	189,618.00	0.03
286	300558	贝达药业	4,000	186,760.00	0.03
287	601799	星宇股份	1,500	185,055.00	0.03
288	300699	光威复材	4,600	181,516.00	0.03
289	600580	卧龙电驱	3,500	171,850.00	0.03
290	603225	新凤鸣	8,300	161,518.00	0.03
291	300140	节能环境	22,200	150,294.00	0.03
292	688065	凯赛生物	3,000	149,400.00	0.03
293	002353	杰瑞股份	2,100	148,743.00	0.03
294	688278	特宝生物	1,767	147,862.56	0.03
295	002265	建设工业	5,500	147,510.00	0.03
296	688578	艾力斯	1,389	144,664.35	0.03
297	000831	中国稀土	3,100	143,964.00	0.03
298	002984	森麒麟	6,800	143,956.00	0.03
299	603000	人民网	7,500	142,875.00	0.02
300	601928	凤凰传媒	14,000	140,560.00	0.02
301	601333	广深铁路	45,900	139,536.00	0.02
302	600062	华润双鹤	7,600	139,004.00	0.02
303	601666	平煤股份	17,500	137,725.00	0.02
304	600157	永泰能源	87,700	137,689.00	0.02
305	603338	浙江鼎力	2,400	135,936.00	0.02
306	002461	珠江啤酒	14,500	134,705.00	0.02
307	600985	淮北矿业	12,100	134,431.00	0.02
308	000729	燕京啤酒	11,500	129,145.00	0.02
309	301498	乖宝宠物	1,253	81,632.95	0.01
310	688617	惠泰医疗	328	79,792.56	0.01
311	002203	海亮股份	4,100	51,906.00	0.01
312	688702	盛科通信	103	14,594.07	0.00
313	688017	绿的谐波	66	12,678.60	0.00
314	688582	芯动联科	191	12,627.01	0.00
315	001221	悍高集团	160	9,110.40	0.00
316	603049	中策橡胶	104	5,818.80	0.00
317	688114	华大智造	47	2,855.72	0.00
318	002465	海格通信	100	1,575.00	0.00
319	603939	益丰药房	60	1,303.20	0.00

8.3.2 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	600262	北方股份	143,500	3,735,305.00	0.65
2	002768	国恩股份	55,800	2,939,544.00	0.51
3	002048	宁波华翔	93,100	2,928,926.00	0.51
4	300041	回天新材	227,300	2,518,484.00	0.44
5	300138	晨光生物	197,700	2,453,457.00	0.43
6	300573	兴齐眼药	29,200	2,052,468.00	0.36
7	000600	建投能源	221,000	1,885,130.00	0.33
8	600361	创新新材	331,300	1,404,712.00	0.24
9	000938	紫光股份	54,800	1,348,080.00	0.23
10	603259	药明康德	13,900	1,259,896.00	0.22
11	002668	TCL 智家	118,500	1,230,030.00	0.21
12	002555	三七互娱	49,600	1,170,560.00	0.20
13	002376	新北洋	151,000	1,165,720.00	0.20
14	688321	微芯生物	38,400	1,122,048.00	0.20
15	603187	海容冷链	71,300	1,118,697.00	0.19
16	002011	盾安环境	85,500	1,084,140.00	0.19
17	600057	厦门象屿	123,100	1,048,812.00	0.18
18	688045	必易微	26,575	1,028,186.75	0.18
19	601456	国联民生	98,500	1,001,745.00	0.17
20	600011	华能国际	133,000	992,180.00	0.17
21	000919	金陵药业	102,800	817,260.00	0.14
22	688060	云涌科技	18,300	774,639.00	0.13
23	688450	光格科技	27,544	759,663.52	0.13
24	688479	友车科技	40,000	753,200.00	0.13
25	300418	昆仑万维	17,700	738,090.00	0.13
26	000066	中国长城	51,000	734,910.00	0.13
27	002236	大华股份	38,800	734,872.00	0.13
28	300059	东方财富	31,500	730,170.00	0.13
29	002049	紫光国微	9,200	725,052.00	0.13
30	300633	开立医疗	27,400	723,908.00	0.13
31	600839	四川长虹	79,500	723,450.00	0.13
32	601117	中国化学	95,100	716,103.00	0.12
33	600406	国电南瑞	31,600	710,368.00	0.12
34	000543	皖能电力	88,300	701,985.00	0.12
35	603296	华勤技术	7,700	698,698.00	0.12
36	600928	西安银行	183,400	678,580.00	0.12
37	688084	晶品特装	7,058	584,402.40	0.10
38	000863	三湘印象	92,400	575,652.00	0.10
39	300858	科拓生物	33,600	563,472.00	0.10
40	002276	万马股份	33,300	563,103.00	0.10
41	002111	威海广泰	53,500	562,820.00	0.10

42	688089	嘉必优	24,163	562,514.64	0.10
43	300428	立中集团	23,900	558,065.00	0.10
44	603556	海兴电力	15,300	556,920.00	0.10
45	603008	喜临门	26,700	546,816.00	0.10
46	600066	宇通客车	16,600	542,820.00	0.09
47	301080	百普赛斯	9,960	537,840.00	0.09
48	600989	宝丰能源	24,800	486,824.00	0.08
49	600309	万华化学	6,300	483,084.00	0.08
50	601318	中国平安	7,000	478,800.00	0.08
51	000998	隆平高科	49,900	467,064.00	0.08
52	002027	分众传媒	61,800	455,466.00	0.08
53	002999	天禾股份	65,500	447,365.00	0.08
54	688296	和达科技	33,543	444,444.75	0.08
55	000157	中联重科	51,400	443,582.00	0.08
56	002687	乔治白	91,700	441,994.00	0.08
57	601288	农业银行	57,100	438,528.00	0.08
58	002507	涪陵榨菜	33,800	436,358.00	0.08
59	002667	威领股份	32,300	422,807.00	0.07
60	000990	诚志股份	50,000	396,000.00	0.07
61	002010	传化智联	66,000	383,460.00	0.07
62	002151	北斗星通	8,400	381,612.00	0.07
63	688502	茂莱光学	922	367,924.10	0.06
64	301088	戎美股份	20,700	355,005.00	0.06
65	600258	首旅酒店	19,600	328,300.00	0.06
66	301638	南网数字	17,706	324,903.26	0.06
67	000708	中信特钢	19,600	320,852.00	0.06
68	001217	华尔泰	23,000	319,700.00	0.06
69	002612	朗姿股份	15,500	316,820.00	0.06
70	301507	民生健康	20,438	313,927.68	0.05
71	603073	彩蝶实业	16,300	306,277.00	0.05
72	605567	春雪食品	27,800	305,800.00	0.05
73	002918	蒙娜丽莎	21,400	304,522.00	0.05
74	001366	播恩集团	22,700	303,499.00	0.05
75	603029	天鹅股份	16,500	300,960.00	0.05
76	600031	三一重工	14,000	295,820.00	0.05
77	000006	深振业 A	29,700	295,515.00	0.05
78	002753	永东股份	41,400	295,182.00	0.05
79	000828	东莞控股	27,400	294,824.00	0.05
80	603739	蔚蓝生物	20,800	294,320.00	0.05
81	002817	黄山胶囊	38,700	294,120.00	0.05
82	605399	晨光新材	21,700	293,384.00	0.05
83	601518	吉林高速	103,500	291,870.00	0.05
84	601898	中煤能源	22,800	283,632.00	0.05

85	603019	中科曙光	3,300	282,612.00	0.05
86	600930	华电新能	44,947	280,469.28	0.05
87	601963	重庆银行	25,300	273,999.00	0.05
88	688727	恒坤新材	5,630	261,682.40	0.05
89	002779	中坚科技	2,200	249,832.00	0.04
90	688807	优迅股份	1,303	237,273.96	0.04
91	301608	博实结	2,500	226,350.00	0.04
92	300224	正海磁材	14,500	224,170.00	0.04
93	600022	山东钢铁	146,300	220,913.00	0.04
94	688796	百奥赛图	4,222	217,699.15	0.04
95	002284	亚太股份	13,800	206,034.00	0.04
96	688153	唯捷创芯	5,467	205,777.88	0.04
97	603170	宝立食品	14,300	204,204.00	0.04
98	000877	天山股份	37,000	196,840.00	0.03
99	002230	科大讯飞	3,900	196,131.00	0.03
100	002967	广电计量	8,900	195,889.00	0.03
101	300415	伊之密	7,500	195,450.00	0.03
102	002204	大连重工	25,000	191,250.00	0.03
103	002452	长高电新	23,200	190,936.00	0.03
104	600039	四川路桥	19,100	190,045.00	0.03
105	600741	华域汽车	9,400	188,000.00	0.03
106	600372	中航机载	13,866	186,081.72	0.03
107	601319	中国人保	20,100	179,895.00	0.03
108	002475	立讯精密	3,000	170,130.00	0.03
109	001326	联域股份	3,559	168,055.98	0.03
110	688141	杰华特	3,800	165,034.00	0.03
111	601969	海南矿业	13,800	163,944.00	0.03
112	605100	华丰股份	3,600	161,892.00	0.03
113	600236	桂冠电力	20,500	160,515.00	0.03
114	002320	海峡股份	12,800	155,776.00	0.03
115	001301	尚太科技	1,800	154,458.00	0.03
116	603355	莱克电气	4,800	152,304.00	0.03
117	688686	奥普特	1,200	148,956.00	0.03
118	603226	菲林格尔	4,700	148,614.00	0.03
119	603353	和顺石油	5,300	144,849.00	0.03
120	601100	恒立液压	1,300	142,883.00	0.02
121	001259	利仁科技	4,700	141,047.00	0.02
122	000726	鲁泰 A	19,800	140,976.00	0.02
123	600593	大连圣亚	3,400	140,828.00	0.02
124	603808	歌力思	16,500	140,580.00	0.02
125	002381	双箭股份	21,200	139,708.00	0.02
126	002763	汇洁股份	19,300	139,346.00	0.02
127	003008	开普检测	6,400	137,920.00	0.02

128	603151	邦基科技	7,600	136,952.00	0.02
129	301687	新广益	1,942	135,202.09	0.02
130	002780	三夫户外	9,400	134,984.00	0.02
131	688656	浩欧博	800	123,040.00	0.02
132	301511	德福科技	3,270	117,033.30	0.02
133	688805	健信超导	2,643	108,786.97	0.02
134	601186	中国铁建	13,300	102,011.00	0.02
135	300033	同花顺	300	96,654.00	0.02
136	603236	移远通信	1,000	95,410.00	0.02
137	301223	中荣股份	5,100	93,687.00	0.02
138	301589	诺瓦星云	567	93,299.85	0.02
139	001280	中国铀业	1,996	90,538.56	0.02
140	000576	甘化科工	8,500	89,505.00	0.02
141	603092	德力佳	1,124	69,466.97	0.01
142	001233	海安集团	1,109	63,572.20	0.01
143	605208	永茂泰	4,600	62,468.00	0.01
144	301533	威马农机	1,442	58,415.42	0.01
145	301656	联合动力	2,265	57,666.90	0.01
146	688573	信宇人	2,234	50,912.86	0.01
147	600567	山鹰国际	30,000	50,700.00	0.01
148	300308	中际旭创	80	48,800.00	0.01
149	688775	影石创新	185	43,456.50	0.01
150	688790	昂瑞微	289	40,934.20	0.01
151	603376	大明电子	1,106	39,634.76	0.01
152	688132	邦彦技术	2,000	36,840.00	0.01
153	688809	强一股份	167	33,952.77	0.01
154	688693	锆威特	857	32,086.08	0.01
155	301018	申菱环境	451	28,647.52	0.00
156	300394	天孚通信	140	28,424.20	0.00
157	301550	斯菱智驱	196	27,185.20	0.00
158	688603	天承科技	361	27,060.56	0.00
159	688169	石头科技	168	25,546.08	0.00
160	603312	西典新能	544	25,459.20	0.00
161	688795	摩尔线程	61	25,386.98	0.00
162	688729	屹唐股份	1,039	25,226.92	0.00
163	301678	新恒汇	344	22,091.68	0.00
164	688583	思看科技	227	21,154.13	0.00
165	603325	博隆技术	269	20,920.13	0.00
166	301489	思泉新材	105	20,895.00	0.00
167	301488	豪恩汽电	135	20,661.75	0.00
168	301413	安培龙	151	20,354.80	0.00
169	301487	盟固利	867	19,013.31	0.00
170	001387	雪祺电气	1,331	18,394.42	0.00

171	001386	马可波罗	971	17,992.63	0.00
172	301292	海科新源	261	16,811.01	0.00
173	301526	国际复材	2,395	16,765.00	0.00
174	301421	波长光电	158	16,455.70	0.00
175	301632	广东建科	656	15,534.08	0.00
176	688802	沐曦股份	37	14,774.47	0.00
177	301563	云汉芯城	110	14,705.90	0.00
178	688648	中邮科技	232	14,258.72	0.00
179	301486	致尚科技	106	13,149.30	0.00
180	301584	建发致新	447	11,988.54	0.00
181	688652	京仪装备	121	11,895.51	0.00
182	603119	浙江荣泰	101	11,682.67	0.00
183	001369	双欣环保	897	11,562.33	0.00
184	300866	安克创新	100	11,439.00	0.00
185	301609	山大电力	277	11,354.23	0.00
186	300904	威力传动	178	11,144.58	0.00
187	301491	汉桑科技	201	11,077.11	0.00
188	301261	恒工精密	99	10,155.42	0.00
189	301517	陕西华达	143	9,935.64	0.00
190	301529	福赛科技	87	9,839.70	0.00
191	001230	劲旅环境	450	9,805.50	0.00
192	301595	太力科技	196	9,613.80	0.00
193	301590	优优绿能	54	9,574.20	0.00
194	688759	必贝特	367	9,215.37	0.00
195	688005	容百科技	255	9,027.00	0.00
196	688591	泰凌微	208	8,852.48	0.00
197	688720	艾森股份	124	8,727.12	0.00
198	301667	纳百川	151	8,617.57	0.00
199	603175	超颖电子	169	8,206.64	0.00
200	688755	汉邦科技	203	8,036.77	0.00
201	688549	中巨芯	855	7,797.60	0.00
202	301566	达利凯普	400	7,772.00	0.00
203	301668	昊创瑞通	165	7,392.00	0.00
204	301449	天溯计量	112	7,305.76	0.00
205	301516	中远通	449	7,008.89	0.00
206	301459	丰茂股份	155	6,878.90	0.00
207	301508	中机认检	213	6,658.38	0.00
208	301518	长华化学	186	6,616.02	0.00
209	301348	蓝箭电子	324	6,541.56	0.00
210	301015	百洋医药	275	6,490.00	0.00
211	601026	道生天合	451	6,440.28	0.00
212	301568	思泰克	130	6,308.90	0.00
213	301636	泽润新能	128	6,259.20	0.00

214	301575	艾芬达	126	6,243.30	0.00
215	301381	赛维时代	303	6,238.77	0.00
216	301555	惠柏新材	176	5,883.68	0.00
217	688249	晶合集成	171	5,675.49	0.00
218	301370	国科恒泰	469	5,477.92	0.00
219	688765	禾元生物	103	5,419.86	0.00
220	301202	朗威股份	133	5,373.20	0.00
221	603418	友升股份	90	5,315.40	0.00
222	001285	瑞立科密	89	4,991.12	0.00
223	301558	三态股份	607	4,947.05	0.00
224	688651	盛邦安全	104	4,578.08	0.00
225	601096	宏盛华源	1,099	4,560.85	0.00
226	603014	威高血净	115	4,557.45	0.00
227	688716	中研股份	107	4,531.45	0.00
228	301469	恒达新材	145	4,403.65	0.00
229	301578	辰奕智能	129	4,357.62	0.00
230	603262	技源集团	155	4,355.50	0.00
231	001390	古麒绒材	178	4,353.88	0.00
232	688653	康希通信	354	4,301.10	0.00
233	603248	锡华科技	260	4,238.00	0.00
234	603406	天富龙	105	4,216.80	0.00
235	301505	苏州规划	189	4,209.03	0.00
236	301509	金凯生科	123	4,154.94	0.00
237	301528	多浦乐	60	4,080.00	0.00
238	001388	信通电子	94	4,036.36	0.00
239	301525	儒竞科技	45	3,885.30	0.00
240	603370	华新精科	82	3,800.70	0.00
241	301548	崇德科技	68	3,761.08	0.00
242	688671	碧兴物联	148	3,665.96	0.00
243	688719	爱科赛博	83	3,664.45	0.00
244	301372	科净源	143	3,626.48	0.00
245	301500	飞南资源	230	3,608.70	0.00
246	301393	昊帆生物	71	3,598.99	0.00
247	688371	菲沃泰	190	3,509.30	0.00
248	603382	海阳科技	105	3,385.20	0.00
249	688646	逸飞激光	91	3,247.79	0.00
250	603273	天元智能	142	2,980.58	0.00
251	603400	华之杰	57	2,980.53	0.00
252	603334	丰倍生物	88	2,888.16	0.00
253	301418	协昌科技	79	2,883.50	0.00
254	688602	康鹏科技	332	2,881.76	0.00
255	301559	中集环科	177	2,812.53	0.00
256	301519	舜禹股份	205	2,751.10	0.00

257	601083	锦江航运	243	2,711.88	0.00
258	688657	浩辰软件	50	2,660.50	0.00
259	688612	威迈斯	79	2,604.63	0.00
260	301296	新巨丰	305	2,598.60	0.00
261	001306	夏厦精密	29	2,581.00	0.00
262	603193	润本股份	102	2,471.46	0.00
263	001396	誉帆科技	69	2,441.91	0.00
264	301371	敷尔佳	103	2,440.07	0.00
265	603373	安邦护卫	64	2,429.44	0.00
266	301515	港通医疗	119	2,387.14	0.00
267	001378	德冠新材	100	2,358.00	0.00
268	001210	金房能源	137	2,346.81	0.00
269	001239	永达股份	142	2,317.44	0.00
270	301520	万邦医药	58	2,304.34	0.00
271	603270	金帝股份	82	2,216.46	0.00
272	603004	鼎龙科技	77	1,807.19	0.00
273	603107	上海汽配	104	1,542.32	0.00
274	001358	兴欣新材	59	1,522.79	0.00
275	603276	恒兴新材	86	1,427.60	0.00
276	603075	热威股份	59	1,288.56	0.00
277	603231	索宝蛋白	68	1,245.76	0.00
278	400174	中天 3	95,300	953.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	600685	中船防务	8,766,957.00	4.49
2	300012	华测检测	8,475,591.00	4.35
3	600166	福田汽车	8,002,722.00	4.10
4	002202	金风科技	7,912,810.00	4.06
5	603816	顾家家居	7,741,663.00	3.97
6	001696	宗申动力	7,089,151.05	3.63
7	600060	海信视像	6,781,692.00	3.48
8	601717	中创智领	6,697,186.00	3.43
9	300496	中科创达	6,668,120.00	3.42
10	002008	大族激光	6,603,512.00	3.39
11	300207	欣旺达	6,520,369.00	3.34
12	300573	兴齐眼药	6,456,081.20	3.31
13	300454	深信服	6,444,291.00	3.30
14	002056	横店东磁	6,376,868.27	3.27

15	000050	深天马 A	6,365,802.00	3.26
16	002624	完美世界	6,268,893.00	3.21
17	601168	西部矿业	6,259,786.00	3.21
18	002603	以岭药业	6,010,156.00	3.08
19	000709	河钢股份	6,002,898.00	3.08
20	600282	南钢股份	5,955,930.00	3.05
21	601231	环旭电子	5,856,769.00	3.00
22	600143	金发科技	5,849,159.00	3.00
23	600298	安琪酵母	5,780,206.00	2.96
24	600170	上海建工	5,774,571.00	2.96
25	600801	华新建材	5,730,228.00	2.94
26	002436	兴森科技	5,716,776.04	2.93
27	002508	老板电器	5,708,098.00	2.93
28	002414	高德红外	5,677,748.00	2.91
29	002185	华天科技	5,617,944.00	2.88
30	000825	太钢不锈	5,546,552.00	2.84
31	600699	均胜电子	5,540,423.00	2.84
32	002558	巨人网络	5,540,176.00	2.84
33	002831	裕同科技	5,469,725.35	2.80
34	300567	精测电子	5,397,271.00	2.77
35	300373	扬杰科技	5,381,292.62	2.76
36	002821	凯莱英	5,377,621.00	2.76
37	002080	中材科技	5,332,775.00	2.73
38	000887	中鼎股份	5,208,346.00	2.67
39	002223	鱼跃医疗	5,195,581.00	2.66
40	300073	当升科技	5,172,315.00	2.65
41	600098	广州发展	5,158,043.00	2.64
42	002353	杰瑞股份	5,130,179.00	2.63
43	603486	科沃斯	5,037,001.00	2.58
44	000932	华菱钢铁	4,875,315.00	2.50
45	600499	科达制造	4,696,791.00	2.41
46	600879	航天电子	4,660,941.00	2.39
47	300138	晨光生物	4,629,240.00	2.37
48	300003	乐普医疗	4,605,481.00	2.36
49	000066	中国长城	4,504,672.00	2.31
50	300458	全志科技	4,471,320.80	2.29
51	600536	中国软件	4,450,995.94	2.28
52	603529	爱玛科技	4,435,293.03	2.27
53	000039	中集集团	4,413,886.00	2.26
54	600873	梅花生物	4,404,584.00	2.26
55	601233	桐昆股份	4,393,367.00	2.25
56	600380	健康元	4,362,781.00	2.24
57	000513	丽珠集团	4,351,178.00	2.23

58	600704	物产中大	4,323,481.00	2.22
59	000600	建投能源	4,270,682.00	2.19
60	000988	华工科技	4,238,335.00	2.17
61	600486	扬农化工	4,154,894.60	2.13
62	000997	新大陆	4,113,663.00	2.11
63	600329	达仁堂	4,105,081.00	2.10
64	600378	昊华科技	4,058,895.00	2.08
65	000959	首钢股份	4,046,912.00	2.07
66	000539	粤电力 A	4,037,085.00	2.07
67	600141	兴发集团	4,026,154.00	2.06
68	600549	厦门钨业	3,980,081.00	2.04
69	002385	大北农	3,941,071.00	2.02
70	600820	隧道股份	3,914,410.00	2.01

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。

8.4.2 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	600298	安琪酵母	7,501,262.00	3.85
2	000988	华工科技	7,464,738.00	3.83
3	002353	杰瑞股份	7,292,313.00	3.74
4	002202	金风科技	6,796,278.09	3.48
5	002831	裕同科技	6,591,762.95	3.38
6	300567	精测电子	5,896,125.00	3.02
7	300456	赛微电子	5,693,552.00	2.92
8	300476	胜宏科技	5,612,185.00	2.88
9	600685	中船防务	5,478,404.00	2.81
10	002821	凯莱英	5,473,769.00	2.81
11	300207	欣旺达	5,364,955.00	2.75
12	301165	锐捷网络	5,277,856.20	2.71
13	600141	兴发集团	5,227,529.00	2.68
14	600143	金发科技	5,063,387.00	2.60
15	600486	扬农化工	4,940,549.00	2.53
16	600885	宏发股份	4,847,136.00	2.48
17	300573	兴齐眼药	4,736,209.68	2.43
18	601168	西部矿业	4,610,987.00	2.36
19	000039	中集集团	4,576,949.00	2.35
20	002385	大北农	4,568,064.00	2.34

21	002281	光迅科技	4,300,315.00	2.20
22	300037	新宙邦	4,278,979.00	2.19
23	600536	中国软件	4,177,512.00	2.14
24	002056	横店东磁	4,149,972.00	2.13
25	601233	桐昆股份	4,036,213.00	2.07
26	600879	航天电子	4,020,962.00	2.06
27	600499	科达制造	3,999,636.00	2.05
28	002683	广东宏大	3,980,867.00	2.04
29	002432	九安医疗	3,972,190.00	2.04

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。

8.4.3 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	1,092,462,845.19
卖出股票收入（成交）总额	851,590,836.06

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	89,518.29	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	89,518.29	0.02

8.6 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	123158	宙邦转债	605	88,522.94	0.02
2	123250	嘉益转债	8	995.35	0.00

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，有选择地投资于流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金在进行股指期货投资时，首先将基于对证券市场总体行情的判断和组合风险收益的分析确定投资时机，并根据风险资产投资（或拟投资）的总体规模和风险系数决定股指期货的投资比例；其次，本基金将在综合考虑证券市场和期货市场运行趋势以及股指期货流动性、收益性、风险特征和估值水平的基础上进行投资品种选择，以对冲风险资产组合的系统性风险和流动性风险。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.12 投资组合报告附注

报告期基金投资的前十名证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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。

8.12.1 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	4,912,799.29
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	4,357,824.08
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,270,623.37

8.12.2 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	123158	宙邦转债	88,522.94	0.02
2	123250	嘉益转债	995.35	0.00

8.12.3 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.3.1 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。

8.12.3.2 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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	户均持有的基	持有人结构
------	------	--------	-------

	数（户）	金份额	机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
招商中证 500 指数增强 A	11,287	14,588.71	2,157,329.56	1.31%	162,505,414.90	98.69%
招商中证 500 指数增强 C	9,537	15,514.83	25,475,914.74	17.22%	122,488,997.99	82.78%
合计	20,824	15,012.85	27,633,244.30	8.84%	284,994,412.89	91.16%

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）。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	招商中证 500 指数增强 A	4,923.72	0.0030%
	招商中证 500 指数增强 C	18,281.46	0.0124%
	合计	23,205.18	0.0074%

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）。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	招商中证 500 指数增强 A	0~10
	招商中证 500 指数增强 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	招商中证 500 指数增强 A	0
	招商中证 500 指数增强 C	0
	合计	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	招商中证 500 指数增强 A	招商中证 500 指数增强 C
----	-----------------	-----------------

基金合同生效日(2017年5月17日) 基金份额总额	124,892,139.37	208,016,852.96
本报告期期初基金份额总额	72,585,963.28	70,698,479.30
本报告期基金总申购份额	180,203,142.54	205,185,149.09
减：本报告期基金总赎回份额	88,126,361.36	127,918,715.66
本报告期间基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-	-
本报告期期末基金份额总额	164,662,744.46	147,964,912.73

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末召开基金份额持有人大会。

11.2 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

根据本基金管理人 2025 年 5 月 20 日的公告，经招商基金管理有限公司第七届董事会 2025 年第四次会议审议通过，同意徐勇先生辞任公司总经理职务，聘任钟文岳先生为公司总经理。

根据本基金管理人 2025 年 5 月 30 日的公告，经招商基金管理有限公司第七届董事会 2025 年第五次会议审议通过，同意聘任王景女士、朱红裕先生、陈方元先生为公司首席（副总经理级）。

根据本基金管理人 2025 年 6 月 19 日的公告，经招商基金管理有限公司第七届董事会 2025 年第六次会议审议通过，同意董方先生辞任公司副总经理职务。

根据本基金管理人 2025 年 6 月 27 日的公告，经招商基金管理有限公司第七届董事会 2025 年第五次会议审议通过，同意聘任于立勇先生为公司首席（副总经理级）。

根据本基金管理人 2025 年 8 月 23 日的公告，经招商基金管理有限公司第七届董事会 2025 年第六次会议审议通过，同意杨渺先生辞任公司副总经理职务。

根据本基金管理人 2025 年 8 月 26 日的公告，经招商基金管理有限公司第七届董事会 2025 年第八次会议审议通过，同意聘任谭智勇先生为副总经理。

根据本基金管理人 2025 年 9 月 24 日的公告，经招商基金管理有限公司第七届董事会 2025 年第九次会议审议通过，同意王小青先生辞任公司董事长，由公司总经理钟文岳先生代为履行公司董事长职务。

根据本基金管理人 2025 年 11 月 27 日的公告，经招商基金管理有限公司第七届董事会 2025 年第十二次会议审议通过，同意王颖女士担任公司董事长（法定代表人）。

根据本基金管理人 2025 年 12 月 31 日的公告，经招商基金管理有限公司第七届董事会 2025 年第十四次会议审议通过，同意聘任李刚先生为公司首席（副总经理级）。

本报告期内，经中国银行股份有限公司研究决定，聘任边济东先生为资产托管部总经理。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

11.3 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、基金托管业务的重大诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。本报告期内应付审计费为人民币 20,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

管理人受调查或处罚等情况	内容
受到调查或处罚等措施的主体	管理人
受到调查或处罚等措施的时间	2025 年 10 月 27 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证监会深圳监管局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施
受到的具体措施类型	责令改正
受到调查或处罚等措施的原因	合规内控
受到处罚的依据	《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》《公开募集证券投资基金运作管理办法》《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》《证券期货经营机构及其工作人员廉洁从业规定》《证券投资基金评价业务管理暂行办法》《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》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	管理人已采取完善制度、优化流程等措施完成整改，并通过监管机构验收。
其他	-

11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

管理人相关从业人员受调查或处罚等情况	内容
--------------------	----

受到调查或处罚等措施的主体	高级管理人员 1
受到调查或处罚等措施的时间	2025 年 10 月 27 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证监会深圳监管局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施
受到的具体措施类型	监管谈话
受到调查或处罚等措施的原因	合规内控
受到处罚的依据	《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	管理人已采取完善制度、优化流程等措施完成整改，并通过监管机构验收。
其他	-

11.6.3 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。

11.6.4 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华泰证券	4	467,529,930.55	24.09%	46,714.77	24.09%	-
银河证券	1	308,243,416.02	15.88%	30,796.21	15.88%	-
中信建投证券	2	272,479,159.02	14.04%	27,221.38	14.04%	本报告期减少 3 个
长江证券	4	190,705,679.55	9.83%	19,053.44	9.83%	-
兴业证券	2	169,709,360.81	8.75%	16,954.23	8.74%	-
申万宏源	2	159,634,368.88	8.23%	15,947.87	8.23%	-
中信证券	8	117,016,509.12	6.03%	11,685.53	6.03%	本报告期减少 3 个
国泰海通证券	7	89,960,473.26	4.64%	8,990.57	4.64%	-
方正证券	4	59,165,464.93	3.05%	5,910.35	3.05%	本报告期减少 3 个
广发证券	6	58,209,054.30	3.00%	5,814.87	3.00%	本报告期减少 2 个
平安证券	3	47,955,829.81	2.47%	4,790.46	2.47%	-
北京证券	2	-	-	-	-	-
财通证券	3	-	-	-	-	-

长城证券	3	-	-	-	-	-
诚通证券	1	-	-	-	-	-
大通证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	4	-	-	-	-	-
第一创业	3	-	-	-	-	-
东北证券	3	-	-	-	-	-
东方财富	3	-	-	-	-	-
东方证券	3	-	-	-	-	-
东海证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	6	-	-	-	-	-
东兴证券	3	-	-	-	-	-
光大证券	3	-	-	-	-	-
国海证券	3	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国联民生	9	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国投证券	4	-	-	-	-	-
国新证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	3	-	-	-	-	-
国元证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	本报告期减少 3 个
华宝证券	4	-	-	-	-	-
华创证券	4	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	4	-	-	-	-	-
华西证券	3	-	-	-	-	-
华源证券	2	-	-	-	-	-
华鑫证券	2	-	-	-	-	-
汇丰前海证券	2	-	-	-	-	本报告期新增
江海证券	1	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	本报告期新增
山西证券	6	-	-	-	-	-
上海证券	2	-	-	-	-	-
申港证券	1	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
首创证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	本报告期减少 1 个
天府证券	2	-	-	-	-	-
万和证券	1	-	-	-	-	-

五矿证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	2	-	-	-	-	本报告期减少 1 个
信达证券	2	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
粤开证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	5	-	-	-	-	本报告期减少 1 个
浙商证券	2	-	-	-	-	-
中航证券	2	-	-	-	-	-
中金财富证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	5	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中银国际证券	3	-	-	-	-	-
中邮证券	2	-	-	-	-	-
甬兴证券	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。

11.7.2 基金租用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
华泰证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	78,247.56	44.48%	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	25,217.55	14.33%	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通证券	30,384.63	17.27%	-	-	-	-

方正证券	42,082.43	23.92%	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
北京证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
诚通证券	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国联民生	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
国新证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
华源证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
汇丰前海证 券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-

世纪证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
天府证券	-	-	-	-	-	-
万和证券	-	-	-	-	-	-
五矿证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
中金财富证 券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中银国际证 券	-	-	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-
甬兴证券	-	-	-	-	-	-

11.8 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	关于警惕冒用招商基金管理有限公司名义进行诈骗活动的特别提示公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-01-14
2	招商基金管理有限公司旗下基金 2024 年第 4 季度报告提示性公告	上海证券报及基金管理人网站	2025-01-21
3	招商中证 500 指数增强型证券投资基金 2024 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	2025-01-21
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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-02-26
5	招商基金管理有限公司关于招融资本私募股权基金管理（深圳）有限责任公司股东变更的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-08
6	关于招商基金管理有限公司旗下部分指数基金	上海证券报、基金管	2025-03-19

	指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告	理人网站及中国证监会基金电子披露网站	
7	招商中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同（2025 年 3 月 21 日修订）	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-19
8	招商中证 500 指数增强型证券投资基金托管协议（2025 年 3 月 21 日修订）	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-19
9	招商中证 500 指数增强型证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要更新	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-21
10	招商中证 500 指数增强型证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要更新	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-21
11	招商中证 500 指数增强型证券投资基金更新的招募说明书（二零二五年第一号）	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-21
12	招商基金管理有限公司旗下基金 2024 年年度报告提示性公告	上海证券报及基金管理人网站	2025-03-28
13	招商中证 500 指数增强型证券投资基金 2024 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	2025-03-28
14	招商基金管理有限公司关于运用自有资金投资旗下公募基金的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-04-08
15	招商基金管理有限公司旗下基金 2025 年第 1 季度报告提示性公告	上海证券报及基金管理人网站	2025-04-21
16	招商中证 500 指数增强型证券投资基金 2025 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	2025-04-21
17	招商基金管理有限公司关于提醒投资者持续完善身份信息资料的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-05-09
18	招商中证 500 指数增强型证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要更新	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-05-16
19	招商中证 500 指数增强型证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要更新	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-05-16
20	招商中证 500 指数增强型证券投资基金更新的招募说明书（二零二五年第二号）	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-05-16
21	招商基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监	2025-05-20

		会基金电子披露网站	
22	招商基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-05-30
23	招商基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-06-19
24	招商基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-06-25
25	招商基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-06-27
26	招商基金管理有限公司旗下基金 2025 年第 2 季度报告提示性公告	上海证券报及基金管理人网站	2025-07-18
27	招商中证 500 指数增强型证券投资基金 2025 年第 2 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	2025-07-18
28	招商基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-08-06
29	招商基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-08-23
30	招商基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-08-26
31	招商基金管理有限公司旗下基金 2025 年中期报告提示性公告	上海证券报及基金管理人网站	2025-08-28
32	招商中证 500 指数增强型证券投资基金 2025 年中期报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-08-28
33	招商基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-09-24
34	招商基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-10-16
35	招商基金管理有限公司旗下基金 2025 年第 3 季度报告提示性公告	上海证券报及基金管理人网站	2025-10-27
36	招商中证 500 指数增强型证券投资基金 2025 年第 3 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	2025-10-27
37	招商基金管理有限公司关于终止锦州银行股份	上海证券报、基金管	2025-11-05

	有限公司办理旗下基金销售业务的公告	理人网站及中国证监会基金电子披露网站	
38	招商基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-11-12
39	招商基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-11-27
40	招商基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-11-27
41	招商基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-12-17
42	招商基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-12-31

§ 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 指数增强型证券投资基金设立的文件；
- 3、《招商中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 4、《招商中证 500 指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 5、《招商中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书》；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照。

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。

客户服务中心电话：400-887-9555

网址: <http://www.cmfcchina.com>

招商基金管理有限公司

2026 年 3 月 31 日