

招商中证 2000 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：中信银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	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	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
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	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	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	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	39
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	51
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	51
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	52
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	52
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	52
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	52

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	52
7.12 投资组合报告附注	52
§8 基金份额持有人信息	53
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	54
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	54
§9 开放式基金份额变动	54
§10 重大事件揭示	55
10.1 基金份额持有人大会决议	55
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	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	55
10.4 基金投资策略的改变	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	55
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	55
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	56
10.8 其他重大事件	57
§11 备查文件目录	57
11.1 备查文件目录	57
11.2 存放地点	58
11.3 查阅方式	58

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	招商中证 2000 指数增强型证券投资基金	
基金简称	招商中证 2000 指数增强	
基金主代码	019918	
交易代码	019918	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2024 年 1 月 2 日	
基金管理人	招商基金管理有限公司	
基金托管人	中信银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,075,653,697.96 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 2000 指数增强 A	招商中证 2000 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	019918	019919
报告期末下属分级基金的份 额总额	356,346,944.27 份	719,306,753.69 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	本基金作为增强指数型基金，以跟踪标的指数为主，一般情况下保持各类资产配置的基本稳定，与此同时，在综合考量系统性风险、各类资产收益风险比值、股票资产估值、流动性要求、申购赎回以及分红等因素后，在有效控制基金跟踪误差的前提下，对基金资产进行合理配置。 本基金其他主要投资策略包括：股票投资策略、债券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、股票期权投资策略、资产支持证券投资策略、存托凭证投资策略、参与融资及转融通证券出借业务投资策略。
业绩比较基准	中证 2000 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		中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	潘西里	滕菲菲
	联系电话	0755—83196666	4006800000

	电子邮箱	cmf@cmfchina.com	tengfeifei@citicbank.com
客户服务电话		400-887-9555	95558
传真		0755—83196475	010-85230024
注册地址		深圳市福田区深南大道 7088 号	北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层
办公地址		深圳市福田区深南大道 7088 号	北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层
邮政编码		518040	100020
法定代表人		王颖	方合英

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 2000 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	109,063,548.18
本期利润	110,951,082.72
加权平均基金份额本期利润	0.3221
本期加权平均净值利润率	16.72%
本期基金份额净值增长率	20.08%
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	337,637,760.20
期末可供分配基金份额利润	0.9475
期末基金资产净值	736,252,817.23
期末基金份额净值	2.0661
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	106.61%

2、招商中证 2000 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	226,264,349.36
本期利润	207,647,995.85
加权平均基金份额本期利润	0.2872
本期加权平均净值利润率	15.04%
本期基金份额净值增长率	19.90%
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	670,935,145.19
期末可供分配基金份额利润	0.9328
期末基金资产净值	1,475,216,341.72
期末基金份额净值	2.0509
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	105.09%

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 2000 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	16.43%	1.68%	7.43%	1.54%	9.00%	0.14%
过去六个月	20.08%	1.64%	8.72%	1.60%	11.36%	0.04%
过去一年	43.63%	1.35%	27.67%	1.35%	15.96%	0.00%
自基金合同 生效起至今	106.61%	1.85%	43.82%	1.89%	62.79%	-0.04%

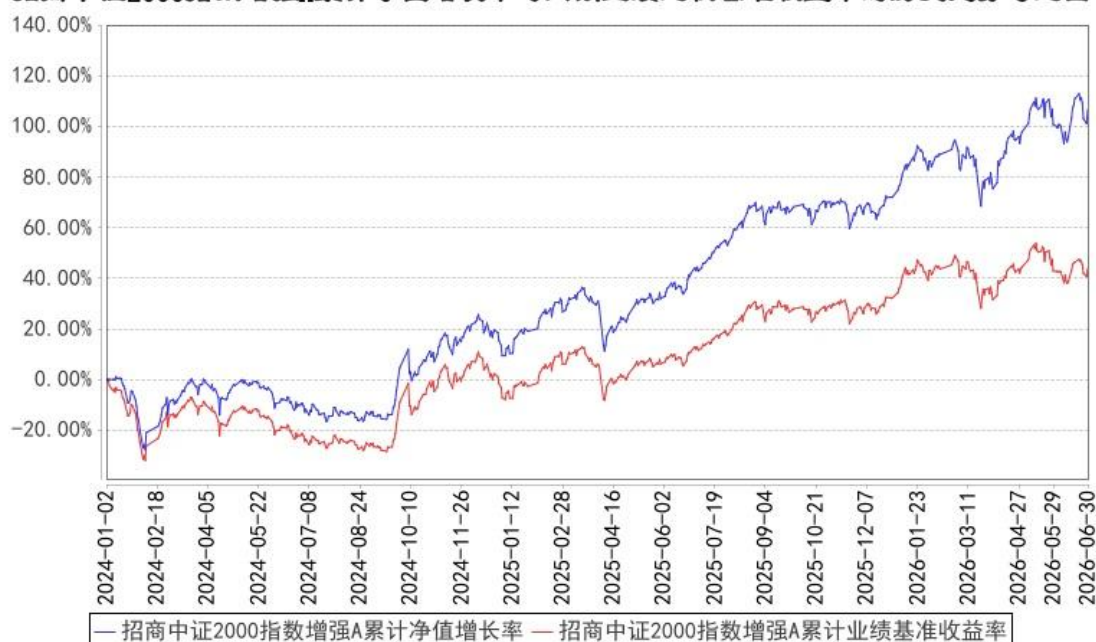
招商中证 2000 指数增强 C

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	16.35%	1.68%	7.43%	1.54%	8.92%	0.14%
过去六个月	19.90%	1.64%	8.72%	1.60%	11.18%	0.04%
过去一年	43.20%	1.35%	27.67%	1.35%	15.53%	0.00%

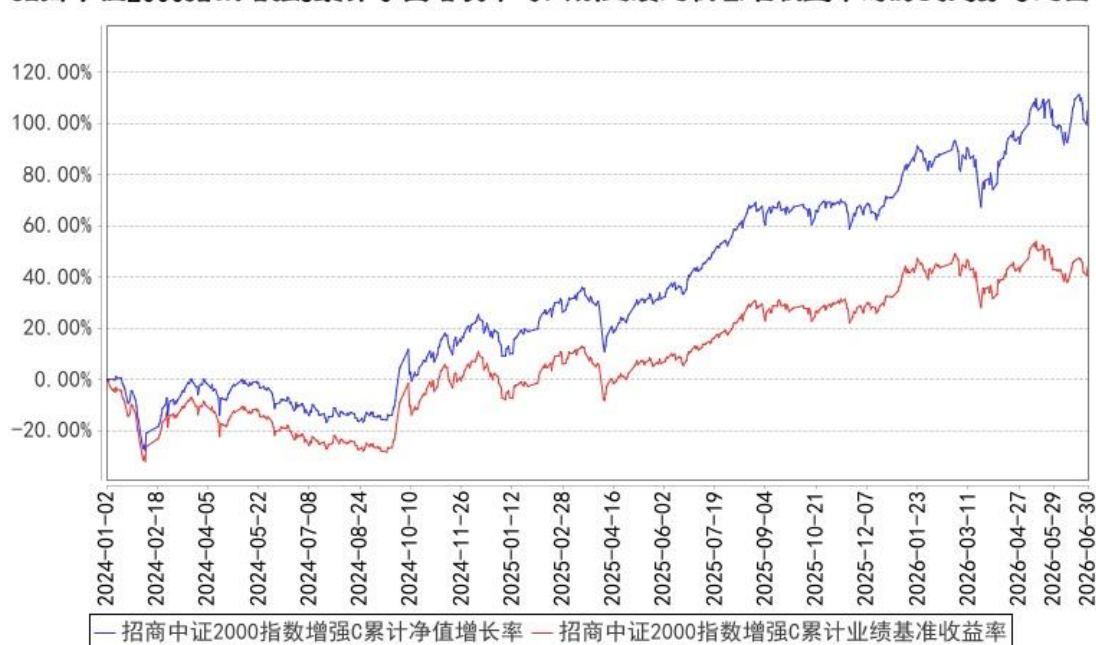
自基金合同生效起至今	105.09%	1.85%	43.82%	1.89%	61.27%	-0.04%
------------	---------	-------	--------	-------	--------	--------

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2000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2000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		
王平	本基金基金经理	2024 年 1 月 2 日	-	20	男，管理学硕士，FRM。2006 年加入招商基金管理有限公司，曾任投资风险管理部助理数量分析师、风险管理部数量分析师、高级风控经理，主要负责公司投资风险管理、金融工程研究等工作，曾任招商深证 100 指数证券投资基金、上证消费 80 交易型开放式指数证券投资基金、招商上证消费 80 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、深证电子信息传媒产业(TMT)50 交易型开放式指数证券投资基金、招商深证电子信息传媒产业(TMT)50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、招商中证大宗商品股票指数证券投资基金（LOF）、招商央视财经 50 指数证券投资基金、招商中证煤炭等权指数分级证券投资基金、招商中证银行指数分级证券投资基金、招商国证生物医药指数分级证券投资基金、招商中证白酒指数分级证券投资基金、招商稳荣定期开放灵活配置混合型证券投资基金、招商财经大数据策略股票型证券投资基金、招商中证 1000 指数增强型证券投资基金、招商盛合灵活配置混合型证券投资基金、招商中证 500 指数增强型证券投资基金、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、招商中证银行 AH 价格优选交易型开放式指数证券投资基金、招商中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券

					投资基金、招商中证银行 AH 价格优选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，现任量化投资部总监兼招商量化精选股票型发起式证券投资基金、招商沪深 300 指数增强型证券投资基金、招商中证红利交易型开放式指数证券投资基金、招商中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金、招商中证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金、招商中证 800 指数增强型证券投资基金、招商中证 2000 指数增强型证券投资基金、招商成长量化选股股票型证券投资基金基金经理。
刘浒	本基金基金经理	2025 年 9 月 22 日	-	7	男，硕士。2019 年 3 月加入招商基金管理有限公司量化投资部,曾任助理研究员、研究员，现任招商盛合灵活配置混合型证券投资基金、招商中证 2000 指数增强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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

基金管理人已建立较完善的研究方法和投资决策流程，确保各投资组合享有公平的投资决策机会。基金管理人建立了所有组合适用的投资对象备选库，制定明确的备选库建立、维护程序。基金管理人拥有健全的投资授权制度，明确投资决策委员会、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限划分，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的

操作需要经过严格的审批程序。基金管理人的相关研究成果向内部所有投资组合开放，在投资研究层面不存在各投资组合间不公平的问题。

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，本基金各项交易均严格按照相关法律法规、基金合同的有关要求执行，公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 15 次，为旗下指数及量化等组合因投资策略需要而发生反向交易。报告期内未发现有可能导致不公平交易和利益输送的重大异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年上半年，A 股市场演绎出成交额不断集中的极致结构分化行情。中证 2000 指数上半年涨 9.10%：一季度先扬后抑，累计涨 1.22%，2 月下旬涨至阶段性顶部后，受美伊冲突引发的滞胀风险担忧影响，持续回落；二季度中证 2000 指数先抑后扬：4 月初探底后，中东局势缓和，原油价格回落，风险偏好持续修复。同时 AI 上游硬件产业链业绩预期持续向好，带动指数升至年内高位，季度上涨 7.78%。二季度的行情主要由硬科技的预期向好驱动，资金持续从内需景气度资产向科技景气方向切换。

在上半年的 A 股风格极致 K 型分化的背景下，本基金 A 份额上半年上涨 20.08%，跑赢中证 2000 指数 10.98%。本基金的量化模型在上半年较好的把握住市场中的结构性机会，及时暴露了合适的成长类硬科技标的敞口，取得了较好的收益。

本基金为指数增强型产品，未来将继续控制跟踪误差基础上，秉持稳健均衡、控制风格因子暴露，持续优化量化因子、降低交易损耗，努力控制回撤，为投资者创造稳定可持续的超额收益。

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 20.08%，同期业绩基准增长率为 8.72%，C 类份额净值增长率为 19.90%，同期业绩基准增长率为 8.72%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前国内经济“K 型”分化格局未改，外需持续向好，但内需形势较为严峻。新兴行业特别是硬科技景气度持续好于传统行业，经济基本面回暖的基础仍需巩固，接下来可关注政策上的边际变量。二级市场环境依旧维持较为充裕的流动性，货币政策延续“适度宽松”，国债利率仍处低位区间，10 年期国债收益率仍保持在 1.7% 附近。展望下半年，外部环境有望企稳，美伊方面局势一方面趋于缓和，另一方面对市场的边际影响越来越小。美伊局势的缓和也将进一步对美联储货币政策产生影响，加息预期有望降温，海外流动性存在边际缓和空间；内需经济端仍需观察政策端特别是财政是否发力，观察强出口弱内需的经济格局对产业上下游的影响。总体来看，货币宽松的大背景仍将持续，需要密切观察内部流动性的流向能否转化为内需的拐点，若经济基本面有所好转，需要密切关注内需改善带来的市场风格切换机会。

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

作为本基金的托管人，本托管人严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金报告期的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，管理人的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的报告期内的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

§ 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 2000 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	201,217,893.47	81,814,878.18
结算备付金		12,674,652.27	9,139,469.92
存出保证金		6,051,105.60	3,546,172.80
交易性金融资产	6.4.7.2	2,033,979,367.73	1,461,866,037.67
其中：股票投资		2,033,781,362.52	1,459,845,844.79
基金投资		-	-
债券投资		198,005.21	2,020,192.88
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		-	109.08
应收股利		-	-
应收申购款		26,053,465.71	71,923,347.75
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		2,279,976,484.78	1,628,290,015.40
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		66,263,272.70	51,697,651.93
应付管理人报酬		1,478,483.12	948,226.59
应付托管费		184,810.39	118,528.31
应付销售服务费		375,169.02	229,525.03
应付投资顾问费		-	-
应交税费		71,239.39	16,168.28
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	134,351.21	57,000.00
负债合计		68,507,325.83	53,067,100.14
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	1,075,653,697.96	919,219,205.75
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	1,135,815,460.99	656,003,709.51
净资产合计		2,211,469,158.95	1,575,222,915.26
负债和净资产总计		2,279,976,484.78	1,628,290,015.40

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，招商中证 2000 指数增强 A 份额净值 2.0661 元，基金份额总额 356,346,944.27 份；招商中证 2000 指数增强 C 份额净值 2.0509 元，基金份额总额 719,306,753.69 份；总份额合计 1,075,653,697.96 份。

6.2 利润表

会计主体：招商中证 2000 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		329,925,006.88	152,200,034.07
1.利息收入		496,519.56	183,100.37
其中：存款利息收入	6.4.7.9	496,519.56	183,100.37
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）		345,609,696.17	98,395,414.86
其中：股票投资收益	6.4.7.10	333,211,714.08	92,002,939.53
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	749,688.33	26,069.08
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	5,685,497.47	-120,166.02
股利收益	6.4.7.15	5,962,796.29	6,486,572.27
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	-16,728,818.97	53,043,562.53
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	547,610.12	577,956.31
减：二、营业总支出		11,325,928.31	3,603,192.91
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	8,114,356.65	2,522,102.10
其中：暂估管理人报酬		-	-
2.托管费	6.4.10.2.2	1,014,294.53	315,262.74
3.销售服务费	6.4.10.2.3	2,057,358.43	683,799.32
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		20,481.36	1,333.44
8.其他费用	6.4.7.19	119,437.34	80,695.31
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		318,599,078.57	148,596,841.16
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		318,599,078.57	148,596,841.16
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		318,599,078.57	148,596,841.16

6.3 净资产变动表

会计主体：招商中证 2000 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	919,219,205.75	-	656,003,709.51	1,575,222,915.26
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	919,219,205.75	-	656,003,709.51	1,575,222,915.26
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	156,434,492.21	-	479,811,751.48	636,246,243.69
（一）、综合收益总额	-	-	318,599,078.57	318,599,078.57
（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）	156,434,492.21	-	161,212,672.91	317,647,165.12
其中：1.基金申购款	2,188,698,500.04	-	2,031,195,054.46	4,219,893,554.50
2.基金赎回款	-2,032,264,007.83	-	-1,869,982,381.55	-3,902,246,389.38
（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	1,075,653,697.96	-	1,135,815,460.99	2,211,469,158.95
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	292,343,595.73	-	44,219,662.48	336,563,258.21
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	292,343,595.73	-	44,219,662.48	336,563,258.21
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	366,626,858.26	-	241,991,873.34	608,618,731.60
（一）、综合收益总额	-	-	148,596,841.16	148,596,841.16
（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）	366,626,858.26	-	93,395,032.18	460,021,890.44
其中：1.基金申购款	1,845,840,007.02	-	511,019,503.65	2,356,859,510.67
2.基金赎回款	-1,479,213,148.76	-	-417,624,471.47	-1,896,837,620.23
（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	658,970,453.99	-	286,211,535.82	945,181,989.81

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 2000 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 2000 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[2023]2361 号文准予公开募集注册。本基金为契约型开放式基金,存续期限为不定期。本基金根据是否收取认购费、申购费、销售服务费的不同,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 442,794,278.22 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(23)第 00322 号验资报告。《招商中证 2000 指数增强型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)于 2024 年 1 月 2 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,基金托管人为中信银行股份有限公司(以下简称“中信银行”)。

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、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、可交换债券及其他中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款、通知存款及其他银行存款)、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。本基金可根据相关法律法规的规定,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。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(含存托凭证,下同)及其备选成份券(含存托凭证,下同)的资产不低于非现金基金资产的 80%;每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后,基金保留的现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。股指期货、国债期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照国家相关法律法规或监管机构的规定执行。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 2000 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	20,599,640.99
等于：本金	20,593,163.45
加：应计利息	6,477.54
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	180,618,252.48
等于：本金	180,611,583.63
加：应计利息	6,668.85
减：坏账准备	-
合计	201,217,893.47

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		2,032,849,671.93	-	2,033,781,362.52	931,690.59
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	197,999.13	6.08	198,005.21	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	197,999.13	6.08	198,005.21	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		2,033,047,671.06	6.08	2,033,979,367.73	931,690.59

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	48,965,980.00	-	-	-
其中：股指期货投资	48,965,980.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	48,965,980.00	-	-	-

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
IF2609	沪深 300 期货	2.00	2,909,880.00	43,860.00

	2609			
IM2609	中证 1000 期货 2609	28.00	47,516,000.00	1,416,040.00
合计				1,459,900.00
减：可抵销期货暂收款				1,459,900.00
净额				-

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	110,222.16
其他	24,129.05
合计	134,351.21

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

招商中证 2000 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	288,227,309.46	288,227,309.46
本期申购	457,509,971.12	457,509,971.12

本期赎回（以“-”号填列）	-389,390,336.31	-389,390,336.31
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	356,346,944.27	356,346,944.27

招商中证 2000 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	630,991,896.29	630,991,896.29
本期申购	1,731,188,528.92	1,731,188,528.92
本期赎回（以“-”号填列）	-1,642,873,671.52	-1,642,873,671.52
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	719,306,753.69	719,306,753.69

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 2000 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	180,221,475.25	27,481,535.64	207,703,010.89
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	180,221,475.25	27,481,535.64	207,703,010.89
本期利润	109,063,548.18	1,887,534.54	110,951,082.72
本期基金份额交易产生的变动数	48,352,736.77	12,899,042.58	61,251,779.35
其中：基金申购款	358,515,101.73	68,927,020.49	427,442,122.22
基金赎回款	-310,162,364.96	-56,027,977.91	-366,190,342.87
本期已分配利润	-	-	-
本期末	337,637,760.20	42,268,112.76	379,905,872.96

招商中证 2000 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	388,363,959.78	59,936,738.84	448,300,698.62
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	388,363,959.78	59,936,738.84	448,300,698.62
本期利润	226,264,349.36	-18,616,353.51	207,647,995.85
本期基金份额交易产生的变动数	56,306,836.05	43,654,057.51	99,960,893.56
其中：基金申购款	1,343,047,304.11	260,705,628.13	1,603,752,932.24
基金赎回款	-1,286,740,468.06	-217,051,570.62	-1,503,792,038.68

本期已分配利润	-	-	-
本期末	670,935,145.19	84,974,442.84	755,909,588.03

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	279,079.09
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	153,620.10
结算备付金利息收入	54,382.72
其他	9,437.65
合计	496,519.56

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	333,211,714.08
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	333,211,714.08

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	6,114,029,778.15
减：卖出股票成本总额	5,775,149,675.32
减：交易费用	5,668,388.75
买卖股票差价收入	333,211,714.08

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	7,912.60
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	741,775.73
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	749,688.33

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	4,032,191.73
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	3,262,815.64
减：应计利息总额	27,507.65
减：交易费用	92.71
买卖债券差价收入	741,775.73

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	5,685,497.47

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	5,962,796.29
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	5,962,796.29

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	-16,858,378.97
——股票投资	-16,858,798.97
——债券投资	420.00
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	129,560.00
——权证投资	-
——期货投资	129,560.00
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	-16,728,818.97

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	547,610.12
合计	547,610.12

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	50,714.79
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
其他	9,215.18
合计	119,437.34

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
中信银行股份有限公司	基金托管人
招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)	基金管理人的股东
招商证券股份有限公司(以下简称“招商证券”)	基金管理人的股东

注：基金的主要关联方包含基金管理人、基金管理人的股东及子公司、基金托管人等。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	8,114,356.65	2,522,102.10
其中：应支付销售机构的客户维护费	3,081,938.30	1,097,130.18
应支付基金管理人的净管理费	5,032,418.35	1,424,971.92

注：支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值×0.80%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,014,294.53	315,262.74

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

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

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	招商中证 2000 指数增强 A	招商中证 2000 指数增强 C	合计
招商基金管理有限公司	-	206,613.28	206,613.28
招商银行	-	172,632.41	172,632.41
招商证券	-	2,237.16	2,237.16
中信银行	-	124,686.26	124,686.26
合计	-	506,169.11	506,169.11
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 2000 指数增强 A	招商中证 2000 指数增强 C	合计
招商基金管理有限公司	-	13,530.10	13,530.10
招商银行	-	60,568.58	60,568.58
招商证券	-	1,120.65	1,120.65
中信银行	-	16,100.15	16,100.15
合计	-	91,319.48	91,319.48

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

其计算公式为：

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明**6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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
中信银行-活期	20,599,640.99	279,079.09	58,924,129.19	118,111.83

注：本基金的银行存款由基金托管人中信银行股份有限公司保管，按银行约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

单位：人民币元

本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
招商证券	603459	红板科技	网下申购	3,300	58,410.00
招商证券	001365	天海电子	网下申购	2,394	65,092.86

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

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	证券名称	成功认	受限期	流通受限	认购价	期末估	数量（单	期末成本总	期末估值总	备

码		购日		类型	格	值单价	位：股)	额	额	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	58,873	595,206.03	595,206.03	-
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	25,231	255,085.41	255,085.41	-
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	6,488	65,658.56	179,912.24	-
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	6 个月	新股流通	58.00	112.16	117	6,786.00	13,122.72	-

		2 月 27 日		受限						
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 日	6 个月	新股流通受限	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-
301696	三瑞智能	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-
601112	振石股份	2026 年 1 月 21 日	6 个月	新股流通受限	11.18	17.59	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	-
688765	禾元生物	2025 年 10 月 16 日	9 个月	新股流通受限	29.06	48.56	16,470	478,618.20	799,783.20	-

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 4 月 1 日	6 个月	新股流通 受限	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-
688813	泰金新能	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股流通 受限	26.28	172.09	234	6,149.52	40,269.06	-
688816	易思维	2026 年 2 月 4 日	6 个月	新股流通 受限	55.95	57.10	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	2,391	47,054.88	338,302.59	-

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
118072	鼎通转债	2026 年 6 月 24 日	1 个月 内（含）	新债未上 市	100.00	100.00	1,980	197,999.13	198,005.21	-

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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	198,005.21	-
未评级	-	-
合计	198,005.21	-

注：债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

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	201,217,893.47	-	-	-	201,217,893.47
结算备付金	12,674,652.27	-	-	-	12,674,652.27
存出保证金	-	-	-	6,051,105.60	6,051,105.60
交易性金融资产	-	-	198,005.21	2,033,781,362.52	2,033,979,367.73
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	-	-	-	26,053,465.71	26,053,465.71
应收清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	213,892,545.74	-	198,005.21	2,065,885,933.83	2,279,976,484.78
负债					
应付赎回款	-	-	-	66,263,272.70	66,263,272.70
应付管理人报酬	-	-	-	1,478,483.12	1,478,483.12
应付托管费	-	-	-	184,810.39	184,810.39
应付清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	375,169.02	375,169.02
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	71,239.39	71,239.39
其他负债	-	-	-	134,351.21	134,351.21
负债总计	-	-	-	68,507,325.83	68,507,325.83
利率敏感度缺口	213,892,545.74	-	198,005.21	1,997,378,608.00	2,211,469,158.95
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	81,814,878.18	-	-	-	81,814,878.18
结算备付金	9,139,469.92	-	-	-	9,139,469.92
存出保证金	-	-	-	3,546,172.80	3,546,172.80
交易性金融资产	2,020,192.88	-	-	1,459,845,844.79	1,461,866,037.67
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	-	-	-	71,923,347.75	71,923,347.75
应收清算款	-	-	-	109.08	109.08
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	92,974,540.98	-	-	1,535,315,474.42	1,628,290,015.40
负债					
应付赎回款	-	-	-	51,697,651.93	51,697,651.93
应付管理人报酬	-	-	-	948,226.59	948,226.59
应付托管费	-	-	-	118,528.31	118,528.31
应付清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	229,525.03	229,525.03
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	16,168.28	16,168.28
其他负债	-	-	-	57,000.00	57,000.00
负债总计	-	-	-	53,067,100.14	53,067,100.14
利率敏感度缺口	92,974,540.98	-	-	1,482,248,374.28	1,575,222,915.26

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1.若市场利率平行上升或下降 50 个基点		
	2.其他市场变量保持不变		
	3.仅存在公允价值变动对基金资产净值的影响		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（ 2026 年 6 月 30 日 ）	上年度末（ 2025 年 12 月 31 日 ）
	1. 市场利率平行上升 50 个基点	-5,582.33	-2,866.13
	2. 市场利率平行下降 50 个基点	5,773.86	2,875.26

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	2,033,781,362.52	91.97	1,459,845,844.79	92.68
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	2,033,781,362.52	91.97	1,459,845,844.79	92.68

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%	101,689,068.13	72,992,292.24
	2. 权益性投资的市场价格下降 5%	-101,689,068.13	-72,992,292.24

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	2,029,962,063.50	1,456,374,051.69
第二层次	1,048,296.65	2,020,192.88
第三层次	2,969,007.58	3,471,793.10
合计	2,033,979,367.73	1,461,866,037.67

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	2,033,781,362.52	89.20

	其中：股票	2,033,781,362.52	89.20
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	198,005.21	0.01
	其中：债券	198,005.21	0.01
	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	213,892,545.74	9.38
8	其他各项资产	32,104,571.31	1.41
9	合计	2,279,976,484.78	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	11,923,335.00	0.54
B	采矿业	8,774,994.00	0.40
C	制造业	1,374,407,367.73	62.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,749,608.00	0.49
E	建筑业	6,068,309.00	0.27
F	批发和零售业	41,047,454.00	1.86
G	交通运输、仓储和邮政业	20,289,569.00	0.92
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	115,292,612.22	5.21
J	金融业	-	-
K	房地产业	11,903,702.00	0.54
L	租赁和商务服务业	5,417,660.00	0.24
M	科学研究和技术服务业	36,166,820.15	1.64
N	水利、环境和公共设施管理业	20,223,053.00	0.91
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	1,662,264,484.10	75.17

7.2.2 期末积极投资按行业分类境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	21,397,233.82	0.97
C	制造业	292,976,833.54	13.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	850,291.44	0.04
E	建筑业	4,935,001.00	0.22
F	批发和零售业	6,885,261.00	0.31
G	交通运输、仓储和邮政业	1,583.46	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,899,768.16	0.85
J	金融业	10,342,926.00	0.47
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	487,800.00	0.02
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	10,038,050.00	0.45
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	4,702,130.00	0.21
S	综合	-	-
	合计	371,516,878.42	16.80

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	688416	恒烁股份	123,782	17,329,480.00	0.78
2	603629	利通电子	94,900	16,969,069.00	0.77
3	600520	三佳科技	413,200	16,408,172.00	0.74
4	688378	奥来德	256,403	15,896,986.00	0.72
5	688059	华锐精密	76,066	15,191,140.86	0.69
6	300277	汽轮科技	1,001,700	15,065,568.00	0.68
7	688320	禾川科技	360,982	14,962,703.90	0.68

8	300756	金马游乐	447,460	14,788,553.00	0.67
9	301086	鸿富瀚	69,880	14,624,486.40	0.66
10	688231	隆达股份	394,438	14,487,707.74	0.66
11	300745	欣锐科技	334,799	14,135,213.78	0.64
12	001314	亿道信息	226,300	13,985,340.00	0.63
13	002283	天润工业	1,445,800	13,951,970.00	0.63
14	002805	丰元股份	485,740	13,887,306.60	0.63
15	688090	瑞松科技	130,369	13,877,780.05	0.63
16	300681	英搏尔	477,200	13,657,464.00	0.62
17	002810	山东赫达	546,900	13,508,430.00	0.61
18	603061	金海通	26,555	13,336,452.10	0.60
19	688609	九联科技	1,209,607	13,317,773.07	0.60
20	300975	商络电子	255,800	13,237,650.00	0.60
21	300700	岱勒新材	620,400	13,202,112.00	0.60
22	301369	联动科技	52,945	12,971,525.00	0.59
23	688710	益诺思	188,613	12,674,793.60	0.57
24	301246	宏源药业	469,800	12,637,620.00	0.57
25	300490	华自科技	940,000	12,436,200.00	0.56
26	001266	宏英智能	252,900	12,417,390.00	0.56
27	002134	天津普林	406,300	12,359,646.00	0.56
28	300399	天利科技	638,200	12,176,856.00	0.55
29	600230	沧州大化	929,400	12,100,788.00	0.55
30	301265	华新科技	434,700	11,975,985.00	0.54
31	688678	福立旺	494,027	11,940,632.59	0.54
32	301129	瑞纳智能	567,900	11,852,073.00	0.54
33	002645	华宏科技	430,060	11,830,950.60	0.53
34	002752	昇兴股份	2,139,500	11,810,040.00	0.53
35	688155	先惠技术	144,770	11,710,445.30	0.53
36	002111	威海广泰	1,249,100	11,241,900.00	0.51
37	688275	万润新能	87,952	11,218,277.60	0.51
38	002169	智光电气	738,300	10,808,712.00	0.49
39	301608	博实结	212,951	10,702,917.26	0.48
40	601700	风范股份	2,433,500	10,610,060.00	0.48
41	002079	苏州固锝	635,200	9,547,056.00	0.43
42	301349	信德新材	128,880	9,485,568.00	0.43
43	603928	兴业股份	632,570	9,362,036.00	0.42
44	688518	联赢激光	297,598	9,195,778.20	0.42
45	688620	安凯微	549,385	8,900,037.00	0.40
46	300302	同有科技	171,000	8,750,070.00	0.40
47	603125	常青科技	265,061	8,678,097.14	0.39
48	301603	乔锋智能	59,900	8,613,620.00	0.39
49	688179	阿拉丁	308,056	8,536,231.76	0.39
50	688257	新锐股份	83,600	8,518,840.00	0.39

51	688653	康希通信	488,729	8,494,110.02	0.38
52	603985	恒润股份	351,800	8,450,236.00	0.38
53	688135	利扬芯片	200,107	8,420,502.56	0.38
54	002975	博杰股份	58,520	8,309,840.00	0.38
55	001298	好上好	399,680	8,293,360.00	0.38
56	301122	采纳股份	273,800	8,052,458.00	0.36
57	688293	奥浦迈	192,545	8,027,201.05	0.36
58	605100	华丰股份	197,940	8,000,734.80	0.36
59	002213	大为股份	216,600	7,957,884.00	0.36
60	603333	福华尚纬	986,400	7,950,384.00	0.36
61	688308	欧科亿	43,529	7,914,007.49	0.36
62	301305	朗坤科技	276,900	7,897,188.00	0.36
63	603683	晶华新材	256,100	7,893,002.00	0.36
64	301021	英诺激光	64,474	7,859,380.60	0.36
65	300358	楚天科技	980,435	7,843,480.00	0.35
66	600367	红星发展	123,800	7,790,734.00	0.35
67	603701	德宏股份	351,900	7,734,762.00	0.35
68	002606	大连电瓷	576,300	7,728,183.00	0.35
69	688458	美芯晟	184,949	7,723,470.24	0.35
70	002930	宏川智慧	839,400	7,722,480.00	0.35
71	002956	西麦食品	370,340	7,688,258.40	0.35
72	688410	山外山	534,719	7,678,564.84	0.35
73	300890	翔丰华	230,600	7,649,002.00	0.35
74	301069	凯盛新材	379,900	7,613,196.00	0.34
75	301210	金杨精密	250,440	7,513,200.00	0.34
76	300590	移为通信	522,100	7,492,135.00	0.34
77	300871	回盛生物	338,700	7,471,722.00	0.34
78	603196	璞源材料	305,200	7,459,088.00	0.34
79	688148	芳源股份	868,741	7,453,797.78	0.34
80	301152	天力锂能	314,900	7,453,683.00	0.34
81	002741	光华科技	207,900	7,430,346.00	0.34
82	688159	有方科技	166,680	7,398,925.20	0.33
83	603527	众源新材	619,000	7,378,480.00	0.33
84	300067	安诺其	1,356,200	7,350,604.00	0.33
85	688171	纬德信息	166,684	7,327,428.64	0.33
86	301176	逸豪新材	107,100	7,282,800.00	0.33
87	601218	吉鑫科技	1,692,300	7,276,890.00	0.33
88	300903	科翔股份	71,400	7,233,534.00	0.33
89	300350	华鹏飞	1,808,300	7,178,951.00	0.32
90	688255	凯尔达	256,312	7,125,473.60	0.32
91	002772	众兴菌业	626,600	7,118,176.00	0.32
92	001316	润贝航科	215,700	7,113,786.00	0.32
93	688087	英科再生	211,949	7,083,335.58	0.32

94	001311	多利科技	432,490	6,976,063.70	0.32
95	300818	耐普矿机	369,050	6,975,045.00	0.32
96	603273	天元智能	530,700	6,872,565.00	0.31
97	301026	浩通科技	338,700	6,848,514.00	0.31
98	300697	电工合金	448,500	6,794,775.00	0.31
99	603711	香飘飘	610,599	6,783,754.89	0.31
100	603738	泰晶科技	112,200	6,737,610.00	0.30
101	300715	凯伦股份	404,700	6,661,362.00	0.30
102	301456	盘古智能	293,400	6,624,972.00	0.30
103	301518	长华化学	251,000	6,576,200.00	0.30
104	688456	有研粉材	47,071	6,571,111.60	0.30
105	300842	帝科股份	73,600	6,562,912.00	0.30
106	300786	国林科技	260,300	6,525,721.00	0.30
107	688168	安博通	94,156	6,473,225.00	0.29
108	688499	利元亨	121,973	6,409,681.15	0.29
109	002132	恒星科技	1,177,100	6,368,111.00	0.29
110	300843	胜蓝股份	40,700	6,359,375.00	0.29
111	300801	泰和科技	193,600	6,253,280.00	0.28
112	688230	芯导科技	78,517	6,187,924.77	0.28
113	002446	盛路通信	568,300	6,103,542.00	0.28
114	300057	万顺新材	702,300	6,095,964.00	0.28
115	301235	华康洁净	80,900	6,068,309.00	0.27
116	002057	中钢天源	487,000	6,053,410.00	0.27
117	688108	赛诺医疗	324,818	6,018,877.54	0.27
118	002297	博云新材	207,500	6,015,425.00	0.27
119	301568	思泰克	53,900	6,015,240.00	0.27
120	603011	合锻智能	181,100	5,990,788.00	0.27
121	603038	华立股份	380,700	5,938,920.00	0.27
122	300840	酷特智能	282,300	5,823,849.00	0.26
123	300648	星云股份	132,600	5,730,972.00	0.26
124	300985	致远新能	148,400	5,713,400.00	0.26
125	300959	线上线下	38,600	5,705,466.00	0.26
126	002348	高乐股份	541,100	5,703,194.00	0.26
127	301150	中一科技	89,920	5,674,851.20	0.26
128	603006	联明股份	398,000	5,671,500.00	0.26
129	300467	迅游科技	152,200	5,658,796.00	0.26
130	600189	泉阳泉	751,500	5,658,795.00	0.26
131	300016	北陆药业	736,800	5,651,256.00	0.26
132	603990	麦迪科技	264,900	5,639,721.00	0.26
133	600310	广西能源	1,329,600	5,610,912.00	0.25
134	600501	航天晨光	355,400	5,590,442.00	0.25
135	603538	美诺华	171,100	5,569,305.00	0.25
136	688719	爱科赛博	72,232	5,561,864.00	0.25

137	300278	华昌达	1,419,800	5,508,824.00	0.25
138	603686	福龙马	425,500	5,497,460.00	0.25
139	301179	泽宇智能	268,500	5,493,510.00	0.25
140	603861	白云电器	423,400	5,466,094.00	0.25
141	603135	中重科技	450,880	5,455,648.00	0.25
142	002029	七匹狼	713,900	5,454,196.00	0.25
143	300252	金信诺	316,100	5,452,725.00	0.25
144	600477	杭萧钢构	2,360,300	5,452,293.00	0.25
145	002210	飞马国际	2,555,500	5,417,660.00	0.24
146	300541	先进数通	561,200	5,415,580.00	0.24
147	600020	中原高速	1,460,200	5,388,138.00	0.24
148	600571	信雅达	549,200	5,354,700.00	0.24
149	301261	恒工精密	68,500	5,349,850.00	0.24
150	301329	信音电子	220,100	5,346,229.00	0.24
151	300516	久之洋	163,180	5,345,776.80	0.24
152	600693	东百集团	680,900	5,338,256.00	0.24
153	002328	新朋股份	727,200	5,337,648.00	0.24
154	300250	初灵信息	365,900	5,334,822.00	0.24
155	688269	凯立新材	168,196	5,333,495.16	0.24
156	300161	华中数控	182,800	5,323,136.00	0.24
157	000036	华联控股	1,212,900	5,300,373.00	0.24
158	300479	神思电子	391,400	5,299,556.00	0.24
159	001313	粤海饲料	746,500	5,292,685.00	0.24
160	002523	天桥起重	1,771,300	5,278,474.00	0.24
161	002593	日上集团	1,315,900	5,250,441.00	0.24
162	300658	延江股份	459,260	5,249,341.80	0.24
163	002377	国创高新	2,077,000	5,234,040.00	0.24
164	601121	宝地矿业	925,900	5,222,076.00	0.24
165	688162	巨一科技	220,682	5,216,922.48	0.24
166	002782	可立克	247,700	5,214,085.00	0.24
167	001360	南矿集团	294,500	5,209,705.00	0.24
168	603579	荣泰健康	306,500	5,201,305.00	0.24
169	300575	中旗股份	1,050,600	5,168,952.00	0.23
170	601798	蓝科高新	711,300	5,149,812.00	0.23
171	600903	贵州燃气	773,900	5,138,696.00	0.23
172	600980	北矿科技	273,300	5,124,375.00	0.23
173	301149	隆华新材	482,500	5,104,850.00	0.23
174	301116	益客食品	596,300	5,104,328.00	0.23
175	003016	欣贺股份	831,000	5,094,030.00	0.23
176	301136	招标股份	463,000	5,083,740.00	0.23
177	002090	金智科技	574,700	5,080,348.00	0.23
178	605299	舒华体育	380,400	5,078,340.00	0.23
179	301439	泓淋电力	322,400	5,068,128.00	0.23

180	301190	善水科技	315,400	5,055,862.00	0.23
181	301360	荣旗科技	73,700	5,047,713.00	0.23
182	002862	实丰文化	391,300	5,020,379.00	0.23
183	301159	三维天地	172,500	5,019,750.00	0.23
184	002757	南兴股份	277,800	5,014,290.00	0.23
185	603390	通达电气	476,200	4,971,528.00	0.22
186	603897	长城科技	153,100	4,969,626.00	0.22
187	300956	英力股份	441,840	4,966,281.60	0.22
188	000514	渝开发	1,385,200	4,959,016.00	0.22
189	688246	嘉和美康	241,084	4,954,276.20	0.22
190	300774	倍杰特	459,900	4,943,925.00	0.22
191	300647	超频三	828,700	4,930,765.00	0.22
192	603178	圣龙股份	348,500	4,826,725.00	0.22
193	300511	雪榕生物	955,300	4,805,159.00	0.22
194	300504	天邑股份	297,500	4,798,675.00	0.22
195	600530	交大昂立	972,600	4,794,918.00	0.22
196	688610	埃科光电	17,987	4,737,775.80	0.21
197	688311	盟升电子	170,017	4,452,745.23	0.20
198	301529	福赛科技	45,400	4,374,744.00	0.20
199	002560	通达股份	539,400	4,013,136.00	0.18
200	603051	鹿山新材	205,500	3,962,040.00	0.18
201	002969	嘉美包装	274,200	3,860,736.00	0.17
202	300407	凯发电气	330,800	3,572,640.00	0.16
203	300483	首华燃气	202,100	3,552,918.00	0.16
204	002394	联发股份	386,300	3,445,796.00	0.16
205	301251	威尔高	64,000	3,409,920.00	0.15
206	300414	中光防雷	302,300	3,331,346.00	0.15
207	300596	利安隆	61,800	3,243,264.00	0.15
208	300489	光智科技	10,300	3,213,085.00	0.15
209	688401	路维光电	31,400	3,013,772.00	0.14
210	002990	盛视科技	35,300	2,788,700.00	0.13
211	301248	杰创智能	31,500	2,643,795.00	0.12
212	300508	维宏股份	44,700	2,567,121.00	0.12
213	300263	隆华科技	153,800	2,506,940.00	0.11
214	300429	强力新材	136,700	2,422,324.00	0.11
215	002644	佛慈制药	354,700	2,415,507.00	0.11
216	300424	航新科技	153,000	2,408,220.00	0.11
217	002803	吉宏股份	92,700	2,395,368.00	0.11
218	301307	美利信	31,500	2,371,635.00	0.11
219	000017	深中华 A	383,400	2,346,408.00	0.11
220	688261	东微半导	22,315	2,341,512.95	0.11
221	688512	慧智微	145,936	2,330,597.92	0.11
222	603206	嘉环科技	141,400	2,252,502.00	0.10

223	688112	鼎阳科技	30,388	2,232,302.48	0.10
224	300022	吉峰科技	283,300	2,201,241.00	0.10
225	002943	宇晶股份	49,300	2,180,539.00	0.10
226	300042	朗科科技	28,400	2,163,228.00	0.10
227	002346	柘中股份	99,800	2,134,722.00	0.10
228	688539	高华科技	66,520	2,120,657.60	0.10
229	605208	永茂泰	131,800	2,102,210.00	0.10
230	300055	万邦达	322,800	2,075,604.00	0.09
231	688299	长阳科技	121,146	2,024,349.66	0.09
232	688173	希荻微	104,867	2,007,154.38	0.09
233	301322	绿通科技	37,400	1,995,290.00	0.09
234	002695	煌上煌	195,600	1,985,340.00	0.09
235	688768	容知日新	37,918	1,954,293.72	0.09
236	002903	宇环数控	42,600	1,934,892.00	0.09
237	002264	新华都	342,400	1,931,136.00	0.09
238	600215	派斯林	327,300	1,898,340.00	0.09
239	300867	圣元环保	104,000	1,884,480.00	0.09
240	002666	德联集团	473,200	1,869,140.00	0.08
241	688238	和元生物	339,928	1,842,409.76	0.08
242	002578	闽发铝业	579,000	1,823,850.00	0.08
243	920190	雷神科技	80,254	1,786,454.04	0.08
244	002875	安奈儿	120,100	1,784,686.00	0.08
245	000014	沙河股份	180,100	1,644,313.00	0.07
246	300129	泰胜风能	166,300	1,421,865.00	0.06
247	605136	丽人丽妆	196,900	1,403,897.00	0.06
248	603630	拉芳家化	89,700	1,146,366.00	0.05
249	000905	厦门港务	137,100	1,063,896.00	0.05
250	301393	昊帆生物	16,400	1,062,228.00	0.05
251	603115	海星股份	8,600	1,053,242.00	0.05
252	301391	卡莱特	12,500	713,750.00	0.03
253	300227	光韵达	58,900	700,910.00	0.03
254	605133	嵘泰股份	14,400	566,928.00	0.03
255	002885	京泉华	10,800	441,288.00	0.02
256	301285	鸿日达	3,800	419,254.00	0.02
257	002863	今飞凯达	67,700	287,048.00	0.01
258	002491	通鼎互联	5,800	187,920.00	0.01
259	002927	泰永长征	9,300	180,885.00	0.01
260	002443	金洲管道	16,000	152,480.00	0.01
261	603181	皇马科技	2,100	34,062.00	0.00
262	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
263	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
264	001396	誉帆科技	69	2,443.98	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	301308	江波龙	16,900	11,894,220.00	0.54
2	000506	招金黄金	997,700	11,693,044.00	0.53
3	002838	道恩股份	375,400	11,494,748.00	0.52
4	002414	高德红外	773,700	10,259,262.00	0.46
5	300308	中际旭创	6,700	8,509,000.00	0.38
6	688220	翱捷科技	66,917	8,319,121.44	0.38
7	688156	路德科技	266,232	8,053,518.00	0.36
8	688368	晶丰明源	35,708	7,731,496.16	0.35
9	688388	嘉元科技	172,059	7,570,596.00	0.34
10	603124	江南新材	40,100	7,497,898.00	0.34
11	300397	天和防务	484,700	7,338,358.00	0.33
12	301216	万凯新材	300,800	6,915,392.00	0.31
13	601061	中信金属	639,300	6,885,261.00	0.31
14	002591	恒大高新	1,115,400	6,826,248.00	0.31
15	688025	杰普特	14,513	6,821,110.00	0.31
16	002961	瑞达期货	344,700	6,749,226.00	0.31
17	301389	隆扬电子	77,200	6,700,188.00	0.30
18	600148	长春一东	459,300	6,664,443.00	0.30
19	603190	亚通精工	291,200	6,586,944.00	0.30
20	001339	智微智能	61,100	6,249,308.00	0.28
21	688652	京仪装备	30,823	6,169,839.91	0.28
22	300270	中威电子	473,000	6,153,730.00	0.28
23	000603	盛达资源	261,400	6,038,340.00	0.27
24	002558	巨人网络	216,500	5,966,740.00	0.27
25	688331	荣昌生物	45,533	5,931,128.58	0.27
26	001256	炜冈科技	215,700	5,886,453.00	0.27
27	301200	大族数控	15,800	5,698,270.00	0.26
28	688309	恒誉环保	87,791	5,344,716.08	0.24
29	688766	普冉股份	6,701	5,136,986.60	0.23
30	603779	威龙股份	677,200	5,085,772.00	0.23
31	002379	宏桥控股	342,600	5,060,202.00	0.23
32	300548	长芯博创	18,200	5,059,600.00	0.23
33	688390	固德威	46,497	5,045,389.47	0.23
34	002738	中矿资源	85,200	5,025,948.00	0.23
35	002384	东山精密	19,100	5,010,885.00	0.23
36	301019	宁波色母	278,700	4,969,221.00	0.22

37	301189	奥尼电子	83,940	4,946,584.20	0.22
38	603030	全筑股份	2,479,900	4,935,001.00	0.22
39	300322	硕贝德	192,500	4,851,000.00	0.22
40	000973	佛塑科技	336,500	4,828,775.00	0.22
41	920906	舜宇精工	279,696	4,813,568.16	0.22
42	301487	盟固利	250,800	4,802,820.00	0.22
43	300154	瑞凌股份	633,800	4,766,176.00	0.22
44	603317	天味食品	365,800	4,759,058.00	0.22
45	300593	新雷能	157,500	4,734,450.00	0.21
46	600961	株冶集团	141,800	4,592,902.00	0.21
47	688668	鼎通科技	12,253	4,574,044.90	0.21
48	003022	联泓新科	154,700	4,006,730.00	0.18
49	600535	天士力	300,700	3,978,261.00	0.18
50	002397	梦洁股份	1,040,300	3,973,946.00	0.18
51	603093	南华期货	198,000	3,593,700.00	0.16
52	000890	法尔胜	441,600	3,559,296.00	0.16
53	603880	南卫股份	483,200	3,411,392.00	0.15
54	601069	西部黄金	152,700	3,359,400.00	0.15
55	002532	天山铝业	312,800	3,356,344.00	0.15
56	001330	博纳影业	534,500	3,003,890.00	0.14
57	001309	德明利	2,400	2,262,960.00	0.10
58	600936	北投科技	505,100	2,171,930.00	0.10
59	688279	峰岬科技	9,450	2,120,958.00	0.10
60	002317	众生药业	85,900	2,110,563.00	0.10
61	002266	浙富控股	392,200	1,984,532.00	0.09
62	301371	敷尔佳	72,100	1,874,600.00	0.08
63	603679	华体科技	92,100	1,858,578.00	0.08
64	301097	天益医疗	51,661	1,844,297.70	0.08
65	603225	新凤鸣	93,500	1,837,275.00	0.08
66	603345	安井食品	22,900	1,836,351.00	0.08
67	301219	腾远钴业	33,430	1,831,964.00	0.08
68	301377	鼎泰高科	3,300	1,817,970.00	0.08
69	603567	珍宝岛	401,700	1,759,446.00	0.08
70	000802	北京文化	488,000	1,698,240.00	0.08
71	002721	金一文化	665,200	1,476,744.00	0.07
72	002245	蔚蓝锂芯	73,600	1,377,056.00	0.06
73	002487	大金重工	18,700	1,084,039.00	0.05
74	300645	正元智慧	77,200	908,644.00	0.04
75	001248	华润新能源	84,104	850,291.44	0.04
76	688765	禾元生物	16,470	799,783.20	0.04
77	688167	炬光科技	1,882	666,623.22	0.03
78	301666	大普微	1,220	565,262.60	0.03
79	001399	惠科股份	16,218	551,403.64	0.02

80	600755	厦门国贸	90,000	487,800.00	0.02
81	688820	盛合晶微	2,391	338,302.59	0.02
82	002653	海思科	4,400	291,896.00	0.01
83	688627	精智达	400	286,000.00	0.01
84	000975	山金国际	15,900	270,300.00	0.01
85	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.01
86	688809	强一股份	259	161,357.00	0.01
87	002832	比音勒芬	5,907	121,920.48	0.01
88	688818	电科蓝天	1,717	120,430.38	0.01
89	301682	宏明电子	714	114,282.84	0.01
90	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.00
91	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.00
92	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.00
93	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.00
94	688635	长进光子	128	39,448.32	0.00
95	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.00
96	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
97	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
98	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
99	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
100	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
101	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
102	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
103	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
104	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
105	601112	振石股份	775	13,632.25	0.00
106	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
107	001369	双欣材料	897	12,127.44	0.00
108	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
109	688781	视涯科技	217	10,331.37	0.00
110	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
111	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
112	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
113	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
114	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
115	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
116	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
117	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300756	金马游乐	31,593,392.30	2.01
2	300499	高澜股份	28,485,657.00	1.81
3	301246	宏源药业	25,401,165.00	1.61
4	603629	利通电子	24,238,674.40	1.54
5	301150	中一科技	24,118,412.40	1.53
6	002454	松芝股份	23,519,658.00	1.49
7	300435	中泰股份	23,488,798.39	1.49
8	301086	鸿富瀚	23,474,291.20	1.49
9	002975	博杰股份	22,968,492.50	1.46
10	002169	智光电气	22,726,585.00	1.44
11	300548	长芯博创	22,290,255.33	1.42
12	000973	佛塑科技	22,147,465.12	1.41
13	300490	华自科技	21,659,794.00	1.38
14	688135	利扬芯片	21,623,573.32	1.37
15	688456	有研粉材	21,544,434.48	1.37
16	688710	益诺思	21,491,367.63	1.36
17	002645	华宏科技	21,467,981.00	1.36
18	300277	汽轮科技	21,419,673.12	1.36
19	688148	芳源股份	20,630,329.35	1.31
20	688668	鼎通科技	20,331,599.97	1.29

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	688668	鼎通科技	40,214,106.86	2.55
2	002824	和胜股份	36,731,923.84	2.33
3	002454	松芝股份	32,959,478.11	2.09
4	300499	高澜股份	29,711,792.00	1.89
5	300041	回天新材	28,538,625.40	1.81
6	002552	宝鼎科技	27,521,326.00	1.75
7	688531	日联科技	25,821,408.67	1.64
8	301555	惠柏新材	25,504,750.28	1.62
9	301338	凯格精机	25,480,309.84	1.62
10	301086	鸿富瀚	25,153,489.65	1.60
11	002645	华宏科技	24,224,847.40	1.54

12	301150	中一科技	23,837,204.86	1.51
13	002297	博云新材	23,796,371.00	1.51
14	002606	大连电瓷	23,630,098.00	1.50
15	002975	博杰股份	23,536,136.00	1.49
16	301548	崇德科技	23,130,375.72	1.47
17	000973	佛塑科技	23,107,414.00	1.47
18	688456	有研粉材	22,424,160.18	1.42
19	688280	精进电动	22,114,809.21	1.40
20	301322	绿通科技	22,077,035.94	1.40

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	6,365,943,992.02
卖出股票收入（成交）总额	6,114,029,778.15

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

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
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）	198,005.21	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	198,005.21	0.01

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	118072	鼎通转债	1,980	198,005.21	0.01

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，广东金马游乐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北京市西城区税务局第六税务所的处罚。

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	6,051,105.60
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	26,053,465.71
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	32,104,571.31

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	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 2000 指数增强 A	33,159	10,746.61	60,822,697.76	17.07%	295,524,246.51	82.93%
招商中证 2000 指数增强 C	52,690	13,651.67	161,284,816.21	22.42%	558,021,937.48	77.58%
合计	85,849	12,529.60	222,107,513.97	20.65%	853,546,183.99	79.35%

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 2000 指数增强 A	783,217.49	0.2198%
	招商中证 2000 指数增强 C	24,723.99	0.0034%
	合计	807,941.48	0.0751%

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 2000 指数增强 A	0
	招商中证 2000 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 2000 指数增强 A	0
	招商中证 2000 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 2000 指数增强 A	招商中证 2000 指数增强 C
----	------------------	------------------

基金合同生效日(2024 年 1 月 2 日) 基金份额总额	89,161,287.63	353,632,990.59
本报告期期初基金份额总额	288,227,309.46	630,991,896.29
本报告期基金总申购份额	457,509,971.12	1,731,188,528.92
减：本报告期基金总赎回份额	389,390,336.31	1,642,873,671.52
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	356,346,944.27	719,306,753.69

§ 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。

2026 年 6 月，经中信银行研究决定，杨璋琪任中信银行运营管理部总经理，不再任中信银行资产托管部总经理职务。

2026 年 6 月，王坚任中信银行资产托管部总经理，待获得基金从业资格并履行备案程序后正式履职。上述事项对中信银行基金业务无影响。

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	
国信证券	3	5,041,494,130.87	40.41%	1,084,965.09	60.40%	-
中信证券	3	4,871,151,809.88	39.04%	455,426.29	25.35%	-
国投证券	3	2,563,808,942.02	20.55%	255,813.60	14.24%	-
申万宏源	3	-	-	-	-	本报告期新增

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
国信证券	689,180.09	34.38%	-	-	-	-
中信证券	833,690.00	41.58%	-	-	-	-
国投证券	481,921.64	24.04%	-	-	-	-

申万宏源	-	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---	---

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	招商基金管理有限公司旗下基金 2025 年第 4 季度报告提示性公告	上海证券报及基金管理人网站	2026-01-21
2	招商中证 2000 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
3	招商基金管理有限公司旗下基金 2025 年年度报告提示性公告	上海证券报及基金管理人网站	2026-03-31
4	招商中证 2000 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
5	招商基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	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	2026-04-01
6	招商基金管理有限公司旗下基金 2026 年第 1 季度报告提示性公告	上海证券报及基金管理人网站	2026-04-22
7	招商中证 2000 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
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	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	2026-05-12
9	招商基金管理有限公司关于提醒投资者持续完善客户身份信息的公告	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	2026-05-14
10	招商基金管理有限公司关于旗下基金估值变更的公告	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	2026-06-19

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准设立招商基金管理有限公司的文件；
- 2、中国证券监督管理委员会批准招商中证 2000 指数增强型证券投资基金设立的文件；
- 3、《招商中证 2000 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 4、《招商中证 2000 指数增强型证券投资基金托管协议》；

- 5、《招商中证 2000 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。

11.2 存放地点

招商基金管理有限公司

地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

11.3 查阅方式

上述文件可在招商基金管理有限公司互联网站上查阅，或者在营业时间内到招商基金管理有限公司查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人招商基金管理有限公司。

客户服务电话：400-887-9555

网址：<http://www.cmfcchina.com>

招商基金管理有限公司

2026 年 8 月 31 日