

招商中证 500 增强策略交易型开放式 指数证券投资基金 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：国投证券股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	4
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
§4 管理人报告	6
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	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	8
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	8
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	9
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	9
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	9
§5 托管人报告	10
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	10
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	10
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	10
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	10
6.1 资产负债表	10
6.2 利润表	12
6.3 净资产变动表	13
6.4 报表附注	15
§7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况	35
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	35
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	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	45
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	45
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	45
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	45
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	45
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	45

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	46
7.12 投资组合报告附注	46
§8 基金份额持有人信息	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	47
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	47
§9 开放式基金份额变动	47
§10 重大事件揭示	48
10.1 基金份额持有人大会决议	48
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	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	48
10.4 基金投资策略的改变	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	48
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	48
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	49
10.8 其他重大事件	49
§11 影响投资者决策的其他重要信息	51
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	51
§12 备查文件目录	51
12.1 备查文件目录	51
12.2 存放地点	51
12.3 查阅方式	52

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	招商中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	招商中证 500 增强策略 ETF
场内简称	500 增强 A（扩位证券简称：中证 500 增强 ETF 招商）
基金主代码	561950
交易代码	561950
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023 年 3 月 29 日
基金管理人	招商基金管理有限公司
基金托管人	国投证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	78,156,000.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2023 年 4 月 24 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过科学的投资方法与严格的投资纪律约束，力争控制本基金份额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 0.35%，年化跟踪误差不超过 6.5%，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	本基金采用指数增强策略，在标的指数成份券权重的基础上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。 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、衍生品投资策略、资产支持证券投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略、存托凭证投资策略。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金。

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	国投证券股份有限公司
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
		tgfw@sdicsc.com.cn

客户服务电话	400-887-9555	0755-81682208
传真	0755—83196475	-
注册地址	深圳市福田区深南大道 7088 号	深圳市福田区福田街道福华一路 119 号安信金融大厦
办公地址	深圳市福田区深南大道 7088 号	深圳市福田区福田街道福华一路 119 号安信金融大厦 15 层资产托管部
邮政编码	518040	518046
法定代表人	王颖	王苏望

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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 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

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	24,026,929.09
本期利润	13,955,852.72
加权平均基金份额本期利润	0.1325
本期加权平均净值利润率	9.07%
本期基金份额净值增长率	7.78%
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	37,984,198.21
期末可供分配基金份额利润	0.4860
期末基金资产净值	116,140,198.21
期末基金份额净值	1.4860
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	48.60%

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

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	9.71%	1.53%	18.56%	1.65%	-8.85%	-0.12%
过去六个月	7.78%	1.52%	20.97%	1.66%	-13.19%	-0.14%
过去一年	33.38%	1.29%	52.68%	1.42%	-19.30%	-0.13%
过去三年	56.14%	1.39%	50.55%	1.49%	5.59%	-0.10%
自基金合同 生效起至今	48.60%	1.35%	43.81%	1.44%	4.79%	-0.09%

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

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



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 （助理）期限		证券 从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
邓童	本基金 基金经 理	2023 年 3 月 29 日	-	13	男，硕士。2012 年 7 月加入招商基金管理有限公司量化投资部，曾任研究员，招商中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金、招商安康债券型证券投资基金、招商中证红利低波动 100 指数型发起式证券投资基金基金经理，现任招商中证 500 指数增强型证券投资基金、招商中证大宗商品股票指数证券投资基金（LOF）、招商中证煤炭等权指数证券投资基金、招商北证 50 成份指数型发起式证券投资基金、招商中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、招商国证 2000 指数增强型证券投资基金、招商安和债券型证券投资基金、招商上证科创板 50 成份增强策略交易型开放式指数证券投资基金、招商上证综合指数增强型发起式证券投资基金、招商中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、招商中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金、招商中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、招商丰泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金经理。

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

基金管理人已建立较完善的研究方法和投资决策流程，确保各投资组合享有公平的投资决策机会。基金管理人建立了所有组合适用的投资对象备选库，制定明确的备选库建立、维护程序。基金管理人拥有健全的投资授权制度，明确投资决策委员会、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限划分，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。基金管理人的相关研究成果向内部所有投资组合开放，在投资研究层面不存在各投资组合间不公平的问题。

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内中证 500 指数震荡上涨，但成分股内风格分化非常极致，成长风格快速拉升但其余风格个股持续承压，本组合的超额收益在报告期内也出现了大幅回撤，持续回撤的幅度创下了近年来的最大值。虽然有市场风格较为极致的客观原因，但近期的持续回撤也暴露出组合的稳健性问题，虽然在组合层面我们采取多模型的方案，但近期几种主要模型同步出现了回撤，具体来讲在基本面模型方面，有效的成长因子数量较少且与本轮行情风格不匹配；机器学习模型也偏向低波低流动性，新研发的适应高波动市场的机器学习模型近期表现良好，但由于观察时间较短，实际占比偏低。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金份额净值增长率为 7.78%，同期业绩基准增长率为 20.97%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年成长风格大幅领先于其他风格，部分个股走出了强趋势行情，给指数增强模型带来了较大挑战，不过展望未来，我们对本组合多模型的配置方式依然有信心，当前较为极致的市场行情难以长期维持，一旦高成长个股的虹吸效应减弱，各模型的超额收益有望同步回暖。但无论如何，市场的极致走势未来可能会持续发生，本基金将依托多模型配置框架，持续迭代模型，力争在控制跟踪误差的前提下稳健获取超额收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。本基金管理人设有估值委员会，估值委员会成员均具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备相应的专业胜任能力和相关工作经历。估值委员会负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，评价现有估值政策和程序的适用性及对估值程序执行情况进行监督。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与第三方定价服务机构签署服务协议，由其按合同约定提供相关投资品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配，符合相关法规及基金合同的约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况(如有)、财务会计报告、投资组合报告等内容,认为其真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:招商中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

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	473,272.18	617,096.50
结算备付金		189,264.57	102,856.63
存出保证金		107,947.00	189,413.86
交易性金融资产	6.4.7.2	115,688,947.14	177,176,602.46
其中:股票投资		115,688,947.14	177,176,602.46

基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	2,160,673.96
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		116,459,430.89	180,246,643.41
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		146,836.33	2,031,697.41
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		51,408.10	71,327.00
应付托管费		10,281.61	14,265.40
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	110,706.64	65,184.40
负债合计		319,232.68	2,182,474.21
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	78,156,000.00	129,156,000.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	37,984,198.21	48,908,169.20
净资产合计		116,140,198.21	178,064,169.20
负债和净资产总计		116,459,430.89	180,246,643.41

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.4860 元，基金份额总额 78,156,000.00 份。

6.2 利润表

会计主体：招商中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		14,488,252.56	6,434,810.14
1.利息收入		6,743.73	4,297.16
其中：存款利息收入	6.4.7.9	6,743.73	4,297.16
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）		24,350,996.00	5,270,600.72
其中：股票投资收益	6.4.7.10	23,151,123.35	4,343,624.84
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	1,135.47
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	-	-
股利收益	6.4.7.15	1,199,872.65	925,840.41
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	-10,071,076.37	1,116,293.25
4.汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.17	201,589.20	43,619.01
减：二、营业总支出		532,399.84	274,608.32
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	382,624.37	185,966.78

其中：暂估管理人报酬		-	-
2.托管费	6.4.10.2.2	76,524.83	37,193.40
3.销售服务费		-	-
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		-	-
8.其他费用	6.4.7.19	73,250.64	51,448.14
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		13,955,852.72	6,160,201.82
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		13,955,852.72	6,160,201.82
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		13,955,852.72	6,160,201.82

6.3 净资产变动表

会计主体：招商中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

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	129,156,000.00	-	48,908,169.20	178,064,169.20
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	129,156,000.00	-	48,908,169.20	178,064,169.20
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-51,000,000.00	-	-10,923,970.99	-61,923,970.99
（一）、综合收益总额	-	-	13,955,852.72	13,955,852.72
（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）	-51,000,000.00	-	-24,879,823.71	-75,879,823.71

其中：1.基金申购款	31,500,000.00	-	14,259,082.40	45,759,082.40
2.基金赎回款	-82,500,000.00	-	-39,138,906.11	-121,638,906.11
（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	78,156,000.00	-	37,984,198.21	116,140,198.21
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	67,656,000.00	-	2,234,878.10	69,890,878.10
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	67,656,000.00	-	2,234,878.10	69,890,878.10
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	4,500,000.00	-	5,999,802.63	10,499,802.63
（一）、综合收益总额	-	-	6,160,201.82	6,160,201.82
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	4,500,000.00	-	-160,399.19	4,339,600.81
其中：1.基金申购款	25,500,000.00	-	1,539,174.83	27,039,174.83
2.基金赎回款	-21,000,000.00	-	-1,699,574.02	-22,699,574.02
（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	72,156,000.00	-	8,234,680.73	80,390,680.73

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

招商中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金(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 增强策略交易型开放式指数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]429 号文准予公开募集注册。本基金为交易型开放式基金,存续期限为不定期。本基金首次设立募集基金份额为 376,656,000.00 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 00092 号验资报告。《招商中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)于 2023 年 3 月 29 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,基金托管人为国投证券股份有限公司(以下简称“国投证券”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及截至报告期末最新公告的基金招募说明书的有关规定,本基金主要投资于标的指数成份券(含存托凭证,下同)和备选成份券(含存托凭证,下同)。为更好地实现基金的投资目标,本基金可能会少量投资于国内依法发行上市的非标的指数成份券(包括主板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票和存托凭证)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券(含可分离交易可转债)、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、货币市场工具、同业存单、债券回购、资产支持证券、银行存款、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)。本基金可以根据有关法律法规和基金合同的约定参与融资和转融通证券出借业务。基金的投资组合比例为:本基金所持有的股票、存托凭证资产占基金资产的比例不低于 80%,其中投资于标的指数成份券及其备选成份券的比例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合约、股指期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金,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法律法规或监管机构的规定执行。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种或变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围或调整上述投资品种的投资比例。

本基金的业绩比较基准:中证 500 指数收益率。

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	473,272.18
等于：本金	473,032.17
加：应计利息	240.01
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	473,272.18

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		116,101,973.33	-	115,688,947.14	-413,026.19
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		116,101,973.33	-	115,688,947.14	-413,026.19

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融工具。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	17,456.00
其中：交易所市场	17,456.00
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	93,250.64
合计	110,706.64

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	129,156,000.00	129,156,000.00
本期申购	31,500,000.00	31,500,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-82,500,000.00	-82,500,000.00
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	78,156,000.00	78,156,000.00

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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	36,815,404.63	12,092,764.57	48,908,169.20
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	36,815,404.63	12,092,764.57	48,908,169.20
本期利润	24,026,929.09	-10,071,076.37	13,955,852.72
本期基金份额交易产生的变动数	-21,399,359.91	-3,480,463.80	-24,879,823.71
其中：基金申购款	14,225,673.45	33,408.95	14,259,082.40
基金赎回款	-35,625,033.36	-3,513,872.75	-39,138,906.11
本期已分配利润	-	-	-
本期末	39,442,973.81	-1,458,775.60	37,984,198.21

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	5,992.16
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	477.72
其他	273.85
合计	6,743.73

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	22,758,599.50
股票投资收益——赎回差价收入	392,523.85
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	23,151,123.35

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	234,733,149.41
减：卖出股票成本总额	211,786,304.89
减：交易费用	188,245.02
买卖股票差价收入	22,758,599.50

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	121,638,906.11
减：现金支付赎回款总额	63,547,552.11
减：赎回股票成本总额	57,698,830.15
减：交易费用	-
赎回差价收入	392,523.85

6.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无股票申购差价收入。

6.4.7.10.5 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内无证券出借差价收入。

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期内无买卖债券差价收入。

6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券申购差价收入。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内无买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.12.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券赎回差价收入。

6.4.7.12.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券申购差价收入。

6.4.7.13 贵金属投资收益

6.4.7.13.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.13.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

6.4.7.13.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无贵金属赎回差价收入。

6.4.7.13.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无贵金属申购差价收入。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具买卖权证差价收入。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具其他投资收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,199,872.65
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	1,199,872.65

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	-10,071,076.37
——股票投资	-10,071,076.37
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-10,071,076.37

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	-
替代损益	201,589.20
合计	201,589.20

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	3,826.28
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
其他	9,916.99
合计	73,250.64

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
国投证券股份有限公司	基金托管人
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(以下简称“招商中证 500 增强策略 ETF 发起式联接”)	本基金的联接基金

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

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国投证券	432,101,195.33	100.00%	296,920,809.26	100.00%

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
国投证券	-	-	6,135.72	100.00%

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国投证券	43,169.73	100.00%	17,456.00	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国投证券	29,666.04	100.00%	14,394.60	100.00%

注：1、本报告期内，本基金与关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2、根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

3、本报告期内，基金对该类交易的佣金的计算方式是按相关协议约定的佣金费率计算。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为基金提供研究服务（被动股票型基金自 2024 年 7 月 1 日起不适用）。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	382,624.37	185,966.78
其中：应支付销售机构的客	22,678.19	41,394.18

户维护费		
应支付基金管理人的 净管理费	359,946.18	144,572.60

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×0.50%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：

$$\text{日基金管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

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	76,524.83	37,193.40

注：支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值×0.10%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：

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

6.4.10.3 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
-------	---------------------	-----------------------

	持有的基金份额	持有的基金份额占 基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占 基金总份额的比例
招商中证 500 增强策略ETF发起 式联接	31,498,100.00	40.30%	47,665,400.00	36.91%

注：表格中的比例为四舍五入的结果。

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
国投证券-活期	473,272.18	5,992.16	1,805,105.07	3,802.34

注：本基金的托管人为国投证券股份有限公司，银行存款存放在具有基金托管资格的银行，按银行约定利率计息。

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
国投证券	001257	盛龙股份	网下申购	2,229	17,430.78
招商证券	603459	红板科技	网下申购	1,069	18,921.30
招商证券	001365	天海电子	网下申购	587	15,960.53

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
-	-	-	-	-	-

注：本表已包含托管人的关联方承销期内承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001220	世盟股份	2026 年 1 月 27 日	6 个月	新股流通受限	28.00	27.78	49	1,372.00	1,361.22	-
001237	惠康科技	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	53.26	58.74	70	3,728.20	4,111.80	-
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	4,357	44,049.27	44,049.27	-
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	1,866	18,865.26	18,865.26	-
001257	盛龙股份	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股流通受限	7.82	20.74	669	5,231.58	13,875.06	-
001312	福恩股份	2026 年 4 月 14 日	6 个月	新股流通受限	18.38	16.78	61	1,121.18	1,023.58	-
001365	天海电子	2026 年 5 月 11 日	6 个月	新股流通受限	27.19	31.31	177	4,812.63	5,541.87	-
001393	维通利	2026 年 5 月 8 日	6 个月	新股流通受限	30.38	38.99	126	3,827.88	4,912.74	-
001399	惠科股份	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通受限	10.12	27.73	720	7,286.40	19,965.60	-
301513	尚水智能	2026 年 4 月 10 日	6 个月	新股流通受限	26.66	50.96	109	2,905.94	5,554.64	-
301531	春光集团	2026 年 4 月 28 日	6 个月	新股流通受限	13.30	51.56	200	2,660.00	10,312.00	-
301599	理奇智能	2026 年 4 月 22 日	6 个月	新股流通受限	13.91	32.47	211	2,935.01	6,851.17	-
301666	大普微	2026 年 4 月 8 日	6 个月	新股流通受限	46.08	463.33	253	11,658.24	117,222.49	-
301669	高特电子	2026 年 6 月 2 日	6 个月	新股流通受限	7.08	28.40	303	2,145.24	8,605.20	-

301682	宏明电子	2026 年 3 月 18 日	6 个月	新股流通 受限	69.66	160.06	149	10,379.34	23,848.94	-
301683	慧谷新材	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股流通 受限	78.38	121.77	37	2,900.06	4,505.49	-
301696	三瑞智能	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通 受限	24.68	86.80	103	2,542.04	8,940.40	-
601112	振石股份	2026 年 1 月 21 日	6 个月	新股流通 受限	11.18	17.59	176	1,967.68	3,095.84	-
603284	林平发展	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股流通 受限	37.88	34.87	37	1,401.56	1,290.19	-
603293	埃泰克	2026 年 4 月 9 日	6 个月	新股流通 受限	33.49	33.93	30	1,004.70	1,017.90	-
603352	至信股份	2026 年 1 月 8 日	6 个月	新股流通 受限	21.88	25.52	61	1,334.68	1,556.72	-
603407	长裕集团	2026 年 4 月 29 日	6 个月	新股流通 受限	13.86	73.46	115	1,593.90	8,447.90	-
603435	嘉德利	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通 受限	15.76	46.71	79	1,245.04	3,690.09	-
603459	红板科技	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通 受限	17.70	84.32	107	1,893.90	9,022.24	-
688635	长进光子	2026 年 5 月 20 日	6 个月	新股流通 受限	40.98	308.19	73	2,991.54	22,497.87	-
688781	视涯科技	2026 年 3 月 18 日	6 个月	新股流通 受限	22.68	47.61	52	1,179.36	2,475.72	-
688797	臻宝科技	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通 受限	44.56	468.67	54	2,406.24	25,308.18	-
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	42	3,438.96	66,541.86	-
688811	有研复材	2026 年 4 月 1	6 个月	新股流通 受限	6.41	24.13	523	3,352.43	12,619.99	-

		日								
688813	泰金新能	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股流通 受限	26.28	172.09	126	3,311.28	21,683.34	-
688820	盛合晶微	2026 年 4 月 13 日	6 个月	新股流通 受限	19.68	141.49	243	4,782.24	34,382.07	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代 码	证券名称	成功认 购日	受限期	流通受限 类型	认购价 格	期末估 值单价	数量（单 位：张）	期末成本总 额	期末估值总 额	备 注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金流动性风险来源于基金约定开放日兑付赎回资金的流动性风险，以及因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险以及因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。本基金所持有的金融资产分别在证券交易所和银行间同业市场交易，除附注 6.4.12 所披露的流通受限不能自由转让的基金资产外，本基金未持有其他

有重大流动性风险的投资品种。除卖出回购金融资产外，本基金所持有的金融负债的合约约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

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

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

本基金按合同约定申购赎回可采用一篮子证券的形式或现金替代方式，流动性风险相对较低。

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	473,272.18	-	-	-	473,272.18
结算备付金	189,264.57	-	-	-	189,264.57
存出保证金	107,947.00	-	-	-	107,947.00
交易性金融资产	-	-	-	115,688,947.14	115,688,947.14
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	-	-	-	-	-

应收清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	770,483.75	-	-	115,688,947.14	116,459,430.89
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	51,408.10	51,408.10
应付托管费	-	-	-	10,281.61	10,281.61
应付清算款	-	-	-	146,836.33	146,836.33
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	110,706.64	110,706.64
负债总计	-	-	-	319,232.68	319,232.68
利率敏感度缺口	770,483.75	-	-	115,369,714.46	116,140,198.21
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	617,096.50	-	-	-	617,096.50
结算备付金	102,856.63	-	-	-	102,856.63
存出保证金	189,413.86	-	-	-	189,413.86
交易性金融资产	-	-	-	177,176,602.46	177,176,602.46
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	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	2,160,673.96	2,160,673.96
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	909,366.99	-	-	179,337,276.42	180,246,643.41
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	71,327.00	71,327.00
应付托管费	-	-	-	14,265.40	14,265.40
应付清算款	-	-	-	2,031,697.41	2,031,697.41
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-

应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	65,184.40	65,184.40
负债总计	-	-	-	2,182,474.21	2,182,474.21
利率敏感度缺口	909,366.99	-	-	177,154,802.21	178,064,169.20

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末无利率风险的敏感性分析。

6.4.13.4.2 其他价格风险

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

本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的债券和股票，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金在构建资产配置和基金资产投资组合的基础上，通过建立事前和事后跟踪误差的方式，对基金资产的市场价格风险进行管理。

6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	115,688,947.14	99.61	177,176,602.46	99.50
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	115,688,947.14	99.61	177,176,602.46	99.50

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%	5,784,447.36	8,858,830.12
2. 权益性投资的市场价格下降 5%	-5,784,447.36	-8,858,830.12

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	115,175,770.50	177,064,383.04
第二层次	62,914.53	39,405.00
第三层次	450,262.11	72,814.42
合计	115,688,947.14	177,176,602.46

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	115,688,947.14	99.34
	其中：股票	115,688,947.14	99.34
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	662,536.75	0.57
8	其他各项资产	107,947.00	0.09
9	合计	116,459,430.89	100.00

注：此处的股票投资项含可退替代款估值增值。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	1,084.00	0.00
B	采矿业	5,821,396.00	5.01
C	制造业	69,602,707.90	59.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,502,084.00	1.29
E	建筑业	931,734.00	0.80
F	批发和零售业	2,309,361.71	1.99
G	交通运输、仓储和邮政业	876,672.00	0.75
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,932,524.25	8.55
J	金融业	2,936,568.00	2.53
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	741,910.00	0.64

M	科学研究和技术服务业	1,558,870.00	1.34
N	水利、环境和公共设施管理业	780,758.00	0.67
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	96,995,669.86	83.52

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	283,766.26	0.24
C	制造业	14,230,686.63	12.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	62,914.53	0.05
E	建筑业	74,970.00	0.06
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,361.22	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,361,565.66	2.89
J	金融业	165,078.00	0.14
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	512,934.98	0.44
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	18,693,277.28	16.10

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	300458	全志科技	40,560	1,600,497.60	1.38
2	002414	高德红外	120,300	1,595,178.00	1.37
3	002624	完美世界	116,900	1,451,898.00	1.25
4	002841	视源股份	38,700	1,336,311.00	1.15
5	000034	神州数码	47,560	1,319,790.00	1.14
6	002185	华天科技	58,100	1,296,211.00	1.12
7	000050	深天马 A	130,600	1,294,246.00	1.11
8	600166	福田汽车	440,700	1,282,437.00	1.10
9	000932	华菱钢铁	357,600	1,240,872.00	1.07
10	001309	德明利	1,300	1,225,770.00	1.06
11	000783	长江证券	118,300	1,153,425.00	0.99
12	301536	星宸科技	8,500	1,094,035.00	0.94
13	600699	均胜电子	49,200	1,063,212.00	0.92
14	300073	当升科技	22,000	1,056,880.00	0.91
15	002402	和而泰	40,400	1,043,532.00	0.90
16	600885	宏发股份	30,020	1,035,389.80	0.89
17	600141	兴发集团	21,900	1,028,643.00	0.89
18	601212	白银有色	200,000	1,016,000.00	0.87
19	603290	斯达半导	6,600	1,009,404.00	0.87
20	300003	乐普医疗	84,700	1,003,695.00	0.86
21	002410	广联达	120,600	984,096.00	0.85
22	300620	光库科技	2,600	983,320.00	0.85
23	002025	航天电器	12,800	975,616.00	0.84
24	600988	赤峰黄金	36,100	950,152.00	0.82
25	000951	中国重汽	48,500	946,235.00	0.81
26	300136	信维通信	7,900	942,075.00	0.81
27	603308	应流股份	15,400	930,160.00	0.80
28	601869	长飞光纤	1,700	928,030.00	0.80
29	600348	华阳股份	121,300	927,945.00	0.80
30	300857	协创数据	2,700	917,730.00	0.79
31	603444	吉比特	2,500	896,050.00	0.77
32	002335	科华数据	20,060	851,547.00	0.73
33	600536	中国软件	30,200	849,224.00	0.73
34	603256	宏和科技	3,200	849,056.00	0.73
35	300207	欣旺达	43,500	826,065.00	0.71
36	600497	驰宏锌锗	67,100	812,581.00	0.70
37	002008	大族激光	5,400	810,594.00	0.70
38	300496	中科创达	12,900	797,091.00	0.69
39	300474	景嘉微	13,000	786,240.00	0.68
40	002266	浙富控股	154,300	780,758.00	0.67

41	688002	睿创微纳	5,011	775,151.59	0.67
42	300454	深信服	7,900	759,980.00	0.65
43	601717	中创智领	54,500	758,095.00	0.65
44	300012	华测检测	53,700	744,282.00	0.64
45	603160	汇顶科技	12,000	740,520.00	0.64
46	002465	海格通信	57,900	739,383.00	0.64
47	601233	桐昆股份	33,500	725,275.00	0.62
48	688188	柏楚电子	6,686	713,396.20	0.61
49	688475	萤石网络	25,676	702,238.60	0.60
50	000629	钒钛股份	208,800	697,392.00	0.60
51	688568	中科星图	16,700	692,549.00	0.60
52	603379	三美股份	9,100	690,599.00	0.59
53	601608	中信重工	144,500	689,265.00	0.59
54	600170	上海建工	308,200	684,204.00	0.59
55	600985	淮北矿业	47,600	668,780.00	0.58
56	688728	格科微	31,344	659,477.76	0.57
57	002436	兴森科技	12,700	647,065.00	0.56
58	603298	杭叉集团	26,900	641,834.00	0.55
59	601699	潞安环能	44,700	638,316.00	0.55
60	002271	东方雨虹	53,600	636,232.00	0.55
61	002131	利欧股份	132,200	627,950.00	0.54
62	600601	方正科技	44,600	617,264.00	0.53
63	601666	平煤股份	86,300	617,045.00	0.53
64	300888	稳健医疗	21,800	610,182.00	0.53
65	603728	鸣志电器	9,900	603,108.00	0.52
66	600143	金发科技	39,000	602,550.00	0.52
67	002487	大金重工	10,100	585,497.00	0.50
68	600299	安迪苏	74,000	580,900.00	0.50
69	002926	华西证券	71,000	580,070.00	0.50
70	600879	航天电子	27,200	579,088.00	0.50
71	688778	厦钨新能	10,555	574,192.00	0.49
72	600704	物产中大	121,100	571,592.00	0.49
73	000528	柳工	75,500	570,025.00	0.49
74	301358	湖南裕能	7,400	561,438.00	0.48
75	688301	奕瑞科技	4,493	557,132.00	0.48
76	688099	晶晨股份	5,302	545,575.80	0.47
77	301200	大族数控	1,500	540,975.00	0.47
78	600595	中孚实业	95,300	535,586.00	0.46
79	688213	思特威	5,000	535,350.00	0.46
80	301377	鼎泰高科	900	495,810.00	0.43
81	603486	科沃斯	9,700	492,275.00	0.42
82	002152	广电运通	52,400	491,512.00	0.42
83	000739	普洛药业	29,400	489,804.00	0.42

84	600332	白云山	24,200	484,968.00	0.42
85	000800	一汽解放	80,700	480,165.00	0.41
86	600535	天士力	35,800	473,634.00	0.41
87	002756	永兴材料	8,300	470,112.00	0.40
88	002064	华峰化学	47,900	454,571.00	0.39
89	000878	云南铜业	28,000	444,640.00	0.38
90	300432	富临精工	22,100	443,989.00	0.38
91	000983	山西焦煤	76,000	440,800.00	0.38
92	600546	山煤国际	40,300	440,479.00	0.38
93	688561	奇安信	18,304	438,929.92	0.38
94	600098	广州发展	72,800	430,248.00	0.37
95	001389	广合科技	1,700	403,325.00	0.35
96	300223	北京君正	1,600	398,240.00	0.34
97	000997	新大陆	24,200	394,460.00	0.34
98	003022	联泓新科	15,000	388,500.00	0.33
99	600060	海信视像	13,600	379,032.00	0.33
100	688498	源杰科技	200	377,200.00	0.32
101	300604	长川科技	1,100	375,562.00	0.32
102	300373	扬杰科技	2,300	361,629.00	0.31
103	600801	华新建材	23,100	360,360.00	0.31
104	688114	华大智造	6,875	351,175.00	0.30
105	000967	盈峰环境	33,200	349,596.00	0.30
106	000709	河钢股份	179,900	349,006.00	0.30
107	600380	健康元	36,324	342,172.08	0.29
108	300475	香农芯创	1,100	330,000.00	0.28
109	688385	复旦微电	4,600	327,934.00	0.28
110	688248	南网科技	4,600	318,228.00	0.27
111	300757	罗博特科	500	309,500.00	0.27
112	002850	科达利	1,600	302,880.00	0.26
113	688187	时代电气	4,400	302,104.00	0.26
114	688582	芯动联科	4,600	299,000.00	0.26
115	300054	鼎龙股份	2,800	296,716.00	0.26
116	688122	西部超导	4,600	288,926.00	0.25
117	003031	中瓷电子	1,600	288,480.00	0.25
118	600171	上海贝岭	9,000	287,460.00	0.25
119	002223	鱼跃医疗	11,100	284,826.00	0.25
120	002281	光迅科技	1,100	282,634.00	0.24
121	000960	锡业股份	6,600	281,754.00	0.24
122	688018	乐鑫科技	2,200	281,424.00	0.24
123	300953	震裕科技	2,100	280,770.00	0.24
124	601108	财通证券	32,300	279,395.00	0.24
125	601958	金钼股份	9,900	278,289.00	0.24
126	688052	纳芯微	943	271,876.33	0.23

127	002603	以岭药业	18,100	271,500.00	0.23
128	300676	华大基因	7,700	269,962.00	0.23
129	000519	中兵红箭	12,800	269,696.00	0.23
130	301606	绿联科技	4,400	268,488.00	0.23
131	688819	天能股份	11,901	264,202.20	0.23
132	600369	西南证券	64,800	260,496.00	0.22
133	000060	中金岭南	34,300	259,651.00	0.22
134	002273	水晶光电	7,300	259,004.00	0.22
135	688313	仕佳光子	1,400	258,510.00	0.22
136	000155	川能动力	21,500	257,570.00	0.22
137	688676	金盘科技	3,000	253,920.00	0.22
138	300919	中伟新材	5,800	253,750.00	0.22
139	600486	扬农化工	5,000	253,500.00	0.22
140	002340	格林美	38,200	252,502.00	0.22
141	688709	成都华微	6,500	247,585.00	0.21
142	601611	中国核建	22,200	247,530.00	0.21
143	603806	福斯特	14,700	246,813.00	0.21
144	300677	英科医疗	6,300	246,771.00	0.21
145	300699	光威复材	8,600	246,390.00	0.21
146	002821	凯莱英	1,500	243,000.00	0.21
147	000429	粤高速 A	17,700	241,605.00	0.21
148	300724	捷佳伟创	3,400	240,040.00	0.21
149	600339	中油工程	76,900	236,083.00	0.20
150	000893	亚钾国际	5,700	233,073.00	0.20
151	603087	甘李药业	4,100	232,716.00	0.20
152	601106	中国一重	69,600	229,680.00	0.20
153	002195	岩山科技	35,100	229,554.00	0.20
154	600312	平高电气	12,900	227,814.00	0.20
155	600871	石化油服	111,900	227,157.00	0.20
156	003035	南网能源	38,900	226,398.00	0.19
157	600642	申能股份	25,800	225,234.00	0.19
158	603565	中谷物流	22,900	224,649.00	0.19
159	601179	中国西电	14,900	222,308.00	0.19
160	603699	纽威股份	4,400	221,320.00	0.19
161	600816	建元信托	89,300	217,892.00	0.19
162	603345	安井食品	2,700	216,513.00	0.19
163	603920	世运电路	4,500	216,180.00	0.19
164	600578	京能电力	33,500	216,075.00	0.19
165	601228	广州港	74,900	211,218.00	0.18
166	600483	福能股份	19,900	202,781.00	0.17
167	601000	唐山港	48,000	199,200.00	0.17
168	300570	太辰光	800	197,368.00	0.17
169	603979	金诚信	3,100	182,993.00	0.16

170	601997	贵阳银行	34,600	177,498.00	0.15
171	000009	中国宝安	28,400	176,932.00	0.15
172	002312	川发龙蟒	19,100	175,147.00	0.15
173	002683	广东宏大	5,800	169,882.00	0.15
174	603659	璞泰来	5,600	162,008.00	0.14
175	300285	国瓷材料	1,500	154,770.00	0.13
176	603049	中策橡胶	2,903	130,083.43	0.11
177	300146	汤臣倍健	13,400	121,136.00	0.10
178	000027	深圳能源	19,100	118,420.00	0.10
179	000415	渤海租赁	28,000	113,960.00	0.10
180	600378	昊华科技	1,500	113,070.00	0.10
181	300395	菲利华	800	106,984.00	0.09
182	601399	国机重装	29,700	103,950.00	0.09
183	300017	网宿科技	7,000	91,070.00	0.08
184	002673	西部证券	14,000	90,860.00	0.08
185	600998	九州通	18,759	87,979.71	0.08
186	600498	烽火通信	1,000	73,600.00	0.06
187	000825	太钢不锈	19,400	66,154.00	0.06
188	300735	光弘科技	2,600	59,124.00	0.05
189	000021	深科技	900	57,843.00	0.05
190	000539	粤电力 A	7,600	51,756.00	0.04
191	603129	春风动力	200	51,160.00	0.04
192	601001	晋控煤业	2,500	43,475.00	0.04
193	601112	振石股份	176	3,095.84	0.00
194	600598	北大荒	100	1,084.00	0.00

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产 净值比例 （%）
1	002558	巨人网络	41,000	1,129,960.00	0.97
2	300450	先导智能	24,500	997,640.00	0.86
3	002080	中材科技	10,500	945,000.00	0.81
4	688525	佰维存储	1,700	841,041.00	0.72
5	603799	华友钴业	15,900	767,334.00	0.66
6	688183	生益电子	5,333	706,089.20	0.61
7	601231	环旭电子	21,700	703,080.00	0.61
8	002294	信立泰	19,200	612,288.00	0.53
9	000938	紫光股份	19,000	548,340.00	0.47
10	600549	厦门钨业	6,250	532,500.00	0.46
11	603259	药明康德	4,100	510,491.00	0.44

12	688391	钜泉科技	13,167	472,300.29	0.41
13	600686	金龙汽车	40,400	456,116.00	0.39
14	000725	京东方 A	52,500	455,700.00	0.39
15	688060	云涌科技	12,949	425,892.61	0.37
16	688296	和达科技	34,529	395,011.76	0.34
17	002600	领益智造	22,000	381,480.00	0.33
18	688797	臻宝科技	532	355,180.76	0.31
19	600309	万华化学	5,000	342,050.00	0.29
20	603019	中科曙光	3,000	321,690.00	0.28
21	002202	金风科技	12,900	308,310.00	0.27
22	002156	通富微电	3,900	295,893.00	0.25
23	000066	中国长城	15,500	295,275.00	0.25
24	002049	紫光国微	3,200	284,000.00	0.24
25	600198	大唐电信	29,200	281,780.00	0.24
26	300438	鹏辉能源	3,400	281,690.00	0.24
27	605117	德业股份	2,600	276,068.00	0.24
28	002475	立讯精密	3,900	274,560.00	0.24
29	301511	德福科技	1,900	273,315.00	0.24
30	002415	海康威视	7,700	263,340.00	0.23
31	600050	中国联通	63,900	255,600.00	0.22
32	300959	线上线下	1,700	251,277.00	0.22
33	301217	铜冠铜箔	1,500	247,605.00	0.21
34	688329	艾隆科技	12,045	243,429.45	0.21
35	688130	晶华微	8,600	241,832.00	0.21
36	600201	生物股份	20,300	236,495.00	0.20
37	300478	杭州高新	6,200	227,478.00	0.20
38	600989	宝丰能源	11,100	225,663.00	0.19
39	300164	通源石油	27,600	220,800.00	0.19
40	002532	天山铝业	20,100	215,673.00	0.19
41	601600	中国铝业	26,200	215,364.00	0.19
42	300418	昆仑万维	4,700	189,692.00	0.16
43	300059	东方财富	8,100	165,078.00	0.14
44	301669	高特电子	3,025	120,561.06	0.10
45	301666	大普微	253	117,222.49	0.10
46	603538	美诺华	2,500	81,375.00	0.07
47	601186	中国铁建	12,600	74,970.00	0.06
48	688808	联讯仪器	42	66,541.86	0.06
49	300102	乾照光电	2,500	65,100.00	0.06
50	001248	华润新能源	6,223	62,914.53	0.05
51	001399	惠科股份	1,800	61,200.00	0.05
52	001280	中国铀业	736	49,091.20	0.04
53	300119	瑞普生物	3,000	43,290.00	0.04
54	688820	盛合晶微	243	34,382.07	0.03

55	002324	普利特	2,200	26,554.00	0.02
56	301682	宏明电子	149	23,848.94	0.02
57	688635	长进光子	73	22,497.87	0.02
58	688813	泰金新能	126	21,683.34	0.02
59	001233	海安集团	425	18,997.50	0.02
60	603185	弘元绿能	1,000	16,690.00	0.01
61	001257	盛龙股份	669	13,875.06	0.01
62	688811	有研复材	523	12,619.99	0.01
63	301531	春光集团	200	10,312.00	0.01
64	603459	红板科技	107	9,022.24	0.01
65	301696	三瑞智能	103	8,940.40	0.01
66	603407	长裕集团	115	8,447.90	0.01
67	301599	理奇智能	211	6,851.17	0.01
68	301513	尚水智能	109	5,554.64	0.00
69	001365	天海电子	177	5,541.87	0.00
70	001393	维通利	126	4,912.74	0.00
71	301683	慧谷新材	37	4,505.49	0.00
72	001237	惠康科技	70	4,111.80	0.00
73	001369	双欣材料	290	3,920.80	0.00
74	603435	嘉德利	79	3,690.09	0.00
75	603248	锡华科技	165	3,479.85	0.00
76	688781	视涯科技	52	2,475.72	0.00
77	001396	誉帆科技	69	2,443.98	0.00
78	603352	至信股份	61	1,556.72	0.00
79	001220	世盟股份	49	1,361.22	0.00
80	603284	林平发展	37	1,290.19	0.00
81	001312	福恩股份	61	1,023.58	0.00
82	603293	埃泰克	30	1,017.90	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	002558	巨人网络	3,119,481.00	1.75
2	000034	神州数码	2,597,524.40	1.46
3	000528	柳工	2,592,834.00	1.46
4	300450	先导智能	2,331,731.00	1.31
5	300207	欣旺达	2,183,480.00	1.23
6	600988	赤峰黄金	2,180,640.00	1.22
7	002202	金风科技	2,058,341.00	1.16
8	002410	广联达	1,976,054.00	1.11

9	000050	深天马 A	1,951,637.27	1.10
10	000733	振华科技	1,935,016.00	1.09
11	000932	华菱钢铁	1,893,386.00	1.06
12	002128	电投能源	1,675,262.00	0.94
13	002475	立讯精密	1,637,622.00	0.92
14	300474	景嘉微	1,629,467.00	0.92
15	002138	顺络电子	1,613,401.00	0.91
16	002624	完美世界	1,598,883.00	0.90
17	600801	华新建材	1,553,242.00	0.87
18	300003	乐普医疗	1,546,344.00	0.87
19	000951	中国重汽	1,501,166.00	0.84
20	002335	科华数据	1,494,495.06	0.84

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	002436	兴森科技	3,618,144.00	2.03
2	300003	乐普医疗	3,169,714.00	1.78
3	301200	大族数控	3,142,255.00	1.76
4	002203	海亮股份	3,003,328.00	1.69
5	300496	中科创达	2,974,529.00	1.67
6	600487	亨通光电	2,909,559.00	1.63
7	300627	华测导航	2,809,811.08	1.58
8	002624	完美世界	2,679,905.00	1.51
9	002008	大族激光	2,648,541.00	1.49
10	000933	神火股份	2,561,435.00	1.44
11	002185	华天科技	2,517,015.00	1.41
12	002414	高德红外	2,465,174.65	1.38
13	300207	欣旺达	2,414,358.00	1.36
14	000733	振华科技	2,391,274.00	1.34
15	002138	顺络电子	2,292,502.64	1.29
16	300454	深信服	2,260,661.00	1.27
17	300919	中伟新材	2,222,130.00	1.25
18	000932	华菱钢铁	2,196,170.00	1.23
19	300373	扬杰科技	2,169,588.16	1.22
20	002152	广电运通	2,092,150.00	1.17

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	198,066,805.93
卖出股票收入（成交）总额	234,733,149.41

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

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。通过对股指期货的投资，实现管理市场风险和改善投资组合风险收益特性的目的。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金参与国债期货投资是为了有效控制债券市场的系统性风险，本基金将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，适度运用国债期货提高投资组合运作效率。在国债期货投资过程中，基金管理人通过对宏观经济和利率市场走势的分析与判断，并充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置，谨慎进行投资，以调整债券组合的久期，降低投资组合的整体风险。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本报告期内，本基金投资国债期货符合既定的投资政策和投资目的。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中，湖南华菱钢铁股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到税务部门的处罚。

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	107,947.00
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	107,947.00

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

持有人 户数 (户)	户均持有的基金份 额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		招商中证 500 增强策略 ETF 发起式联接	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
941	83,056.32	56,415,600.00	72.18%	21,740,400.00	27.82%	31,498,100.00	40.30%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	-	-

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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2023 年 3 月 29 日)基金份额总额	376,656,000.00
本报告期期初基金份额总额	129,156,000.00
本报告期基金总申购份额	31,500,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	82,500,000.00
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	78,156,000.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、公募基金托管业务的重大诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

报告期内，本基金托管人的基金托管业务部门无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，本基金托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国投证券	4	432,101,195.33	100.00%	43,169.73	100.00%	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

注：（一）选择标准

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

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

3、被动股票型基金以外类型基金选择能够提供优质研究服务的证券公司。

（二）选择程序

1、基金管理人根据上述标准进行评估并确定选用的证券公司。

2、基金管理人与被选择的证券公司签订交易单元租用协议/证券经纪服务协议。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国投证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	招商基金管理有限公司旗下基金 2025 年第 4 季度报告提示性公告	上海证券报及基金管理人网站	2026-01-21
2	招商中证 500 增强策略交易型开放式指数证券	基金管理人网站及中	2026-01-21

	投资基金 2025 年第 4 季度报告	国证监会基金电子披露网站	
3	招商基金管理有限公司关于旗下部分上交所 ETF 变更扩位证券简称的公告	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	2026-02-06
4	招商中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-02-06
5	招商基金管理有限公司旗下部分基金增加中国国际金融股份有限公司为场内申购赎回代办券商的公告	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	2026-03-09
6	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	2026-03-25
7	招商中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金更新的招募说明书（二零二六年第一号）	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-27
8	招商中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-27
9	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
10	招商中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金 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
11	招商基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	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
12	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
13	招商中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金 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
14	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
15	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
16	招商基金管理有限公司旗下部分基金增加华鑫证券有限责任公司为场内申购赎回代办券商的公告	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	2026-06-22

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
招商中证 500 增强策略 ETF 发起式联接	1	20260101-20260630	47,665,400.00	3,914,900.00	20,082,200.00	31,498,100.00	40.30%
产品特有风险							
本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况，可能会出现集中赎回甚至巨额赎回从而引发基金净值剧烈波动，甚至引发基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。							

注：1、报告期末持有份额占比按照四舍五入方法保留至小数点后第 2 位；

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

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准设立招商基金管理有限公司的文件；
- 2、中国证券监督管理委员会批准招商中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金设立的文件；
- 3、《招商中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 4、《招商中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 5、《招商中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照。

12.2 存放地点

招商基金管理有限公司

地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

12.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人招商基金管理有限公司。

客户服务电话：400-887-9555

网址：<http://www.cmfcchina.com>

招商基金管理有限公司

2026 年 8 月 31 日