招商沪深 300 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：广发证券股份有限公司

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。

基金托管人广发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 5
2.4 信息披露方式 5
2.5 其他相关资料 5
§3 主要财务指标和基金净值表现 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遵规守信情况的说明 9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 10
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 10
§5 托管人报告 11
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 11
§6 半年度财务会计报告（未经审计） 11
6.1 资产负债表 11
6.2 利润表 13
6.3 净资产变动表 14
6.4 报表附注 16
§7 投资组合报告 36
7.1 期末基金资产组合情况 37
7.2 期末按行业分类的股票投资组合 37
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 38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 48
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 48
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 49
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 49
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 49
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 49

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 49
7.12 投资组合报告附注 49
§8 基金份额持有人信息 50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 50
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 51
§9 开放式基金份额变动 51
§10 重大事件揭示 51
10.1 基金份额持有人大会决议 51
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 51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 51
10.4 基金投资策略的改变 51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 51
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 52
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 52
10.8 其他重大事件 53
§11 影响投资者决策的其他重要信息 54
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 54
§12 备查文件目录 54
12.1 备查文件目录 54
12.2 存放地点 55
12.3 查阅方式 55

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	招商沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	招商沪深 300ETF
场内简称	招商 300（扩位证券简称：沪深 300ETF 招商）
基金主代码	561930
交易代码	561930
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2024 年 9 月 6 日
基金管理人	招商基金管理有限公司
基金托管人	广发证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	118,260,624.00 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	2024 年 9 月 20 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2%以内，年化跟踪误差控制在 2%以内。
投资策略	本基金采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份券组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份券及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情形导致基金无法完全投资于标的指数成份券时，基金管理人可采取包括成份券替代策略在内的其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到紧密跟踪标的指数的目的。特殊情形包括但不限于：（1）法律法规的限制；（2）标的指数成份券流动性严重不足；（3）标的指数的成份券长期停牌；（4）标的指数成份券进行配股或增发；（5）标的指数成份券派发现金股息；（6）标的指数编制方法发生变化；（7）其他可能严重限制本基金跟踪标的指数的合理原因等。 本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2%以内，年化跟踪误差控制在 2%以内。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。 对于出现市场流动性不足、因法律法规原因个别成份券被限制投资等情况，导致本基金无法获得足够数量的成份券时，基金管理人将通过投资成份券、备选成份券、非成份券、成份券衍生品等进行替代，运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近标的指数的表现。 本基金其他主要投资策略包括：债券投资策略、可转换债券和可交换债券投资策略、资产支持证券投资策略、衍生品投资策略、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	沪深 300 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。 本基金为被动式投资的股票型指数基金，采用完全复制策略跟踪标的指数的表现，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

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	广发证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	潘西里	罗琦
	联系电话	0755－83196666	020-66338888
	电子邮箱	cmf@cmfchina.com	gzluoqi@gf.com.cn
客户服务电话		400-887-9555	95575
传真		0755－83196475	020-87553363-6847
注册地址		深圳市福田区深南大道 7088 号	广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街 2 号 618 室
办公地址		深圳市福田区深南大道 7088 号	广州市天河区马场路 26 号广发证券大厦 34 楼
邮政编码		518040	510627
法定代表人		王颖	林传辉

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.cmfchina.com
基金中期报告置备地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	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	44,178,032.60
本期利润	22,420,755.92
加权平均基金份额本期利润	0.1683

本期加权平均净值利润率	10.74%
本期基金份额净值增长率	10.20%
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	79,697,864.90
期末可供分配基金份额利润	0.6739
期末基金资产净值	197,958,488.90
期末基金份额净值	1.6739
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	67.39%

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	14.00%	1.25%	11.90%	1.26%	2.10%	-0.01%
过去六个月	10.20%	1.12%	7.55%	1.13%	2.65%	-0.01%
过去一年	32.54%	1.01%	26.51%	1.02%	6.03%	-0.01%
自基金合同生效起至今	67.39%	1.25%	52.85%	1.25%	14.54%	0.00%

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



§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		
房俊一	本基金基金经理	2024 年 10 月 26 日	-	6	男，硕士。2019 年 7 月至 2021 年 4 月在中证指数有限公司工作，任研究开发部研究员；2021 年 4 月至 2024 年 8 月在华宝基金管理有限公司工作，历任高级分析师、基金经理助理等职位。2024 年 8 月加入招商基金管理有限公司指数产品管理事业部，曾任招商中证生物科技主

					题交易型开放式指数证券投资基金、招商创业板大盘交易型开放式指数证券投资基金、招商沪深 300ESG 基准交易型开放式指数证券投资基金、招商中证全指软件交易型开放式指数证券投资基金、招商中证全指软件交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、招商中证全指医疗器械交易型开放式指数证券投资基金、招商中证全指医疗器械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，现任招商沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、招商上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金、招商沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、招商中证半导体产业交易型开放式指数证券投资基金、招商中证半导体产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、招商中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金、招商中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、招商中证云计算与大数据主题交易型开放式指数证券投资基金、招商中证国新央企股东回报交易型开放式指数证券投资基金、招商中证国新央企股东回报交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、招商中证云计算与大数据主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、招商上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金联接基金、招商国证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金、招商深证 100 指数证券投资基金、招商上证科创板芯片设计主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、招商国证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、招商上证科创板芯片设计主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，财政政策与货币政策协同巩固复苏底盘，国内经济整体保持一定韧性，但内生增长动力仍待补强。资本市场流动性整体充裕，板块结构性分化进一步放大，资金向硬科技主线集中，传统板块持续承压。聚焦市场各行业表现，可以看到行业表现分化较大。其中，电子、通信、建筑材料、机械设备行业涨幅居前。而商贸零售、农林牧渔、美容护理、食品饮料行业表现较为疲软。本基金跟踪的标的指数沪深 300 指数报告期内上涨 7.55%。关于本基金的运作，报告期内仓位相对较高，紧跟指数表现。

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 10.20%，同期业绩基准增长率为 7.55%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，经济预计仍将保持韧性增长。展望政策层面，财政政策依然保持积极，货币政策适度宽松，政策重心向提振内需、科技创新倾斜。 就投资机会而言，除了关注科技自主可控板块的景气度外，建议关注低估值板块。在做相关投资决策时，建议综合把握政策支持、产业趋势和业绩兑现这三个维度，在科技成长、顺周期修复、高股息防御中寻求结构性机会，同时保持对市场波动抬升的警惕。

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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金托管业务管理办法》等相关法律法规的规定和基金合同、托管协议的约定勤勉履行基金托管人职责，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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本基金管理人在本基金各重要方面的运作符合基金合同、托管协议的约定，本基金托管人未发现本基金在投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支及利润分配等方面存在任何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

本托管人依法对管理人编制和披露的本报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：招商沪深 300 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	1,177,595.57	4,154,578.12
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	196,974,259.06	296,498,147.39
其中：股票投资		196,974,259.06	296,498,147.39
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-

其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		198,151,854.63	300,652,725.51
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		-	2,169,191.11
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		23,834.58	43,114.19
应付托管费		7,944.86	14,371.39
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	161,586.29	316,572.00
负债合计		193,365.73	2,543,248.69
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	118,260,624.00	196,260,624.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	79,697,864.90	101,848,852.82
净资产合计		197,958,488.90	298,109,476.82
负债和净资产总计		198,151,854.63	300,652,725.51

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.6739 元，基金份额总额 118,260,624.00 份。

6.2 利润表

会计主体：招商沪深 300 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		22,761,989.47	642,392.76
1.利息收入		9,561.35	13,563.24
其中：存款利息收入	6.4.7.9	9,561.35	13,563.24
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）		44,061,942.39	36,811,538.80
其中：股票投资收益	6.4.7.10	42,395,578.60	30,386,286.85
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	15,981.14
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	1,666,363.79	6,409,270.81
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	-21,757,276.68	-36,668,298.27
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	447,762.41	485,588.99
减：二、营业总支出		341,233.55	820,453.61
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	155,342.79	494,813.73
其中：暂估管理人报酬		-	-
2.托管费	6.4.10.2.2	51,780.97	164,937.92
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		-	0.01
8.其他费用	6.4.7.19	134,109.79	160,701.95
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		22,420,755.92	-178,060.85
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		22,420,755.92	-178,060.85
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		22,420,755.92	-178,060.85

6.3 净资产变动表

会计主体：招商沪深 300 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	196,260,624.00	-	101,848,852.82	298,109,476.82
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	196,260,624.00	-	101,848,852.82	298,109,476.82
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-78,000,000.00	-	-22,150,987.92	-100,150,987.92
（一）、综合收益总额	-	-	22,420,755.92	22,420,755.92
（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）	-78,000,000.00	-	-44,571,743.84	-122,571,743.84
其中：1.基金申购款	171,000,000.00	-	95,421,351.68	266,421,351.68
2.基金赎回款	-249,000,000.00	-	-139,993,095.52	-388,993,095.52
（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	118,260,624.00	-	79,697,864.90	197,958,488.90
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	730,260,624.00	-	176,077,815.49	906,338,439.49
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	730,260,624.00	-	176,077,815.49	906,338,439.49
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-414,000,000.00	-	-92,943,799.26	-506,943,799.26
（一）、综合收益总额	-	-	-178,060.85	-178,060.85
（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）	-414,000,000.00	-	-92,765,738.41	-506,765,738.41
其中：1.基金申购款	141,000,000.00	-	29,576,594.93	170,576,594.93
2.基金赎回款	-555,000,000.00	-	-122,342,333.34	-677,342,333.34
（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	316,260,624.00	-	83,134,016.23	399,394,640.23

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

____钟文岳___ ____欧志明_____ ____何剑萍____

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

招商沪深 300 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》、《招商沪深 300 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[2024]1043 号文准予公开募集注册。本基金为交易型开放式,存续期限为不定期。本基金首次设立募集基金份额为 586,260,624.00 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(24)第 00168 号验资报告。《招商沪深 300 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 2024 年 9 月 6 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,基金托管人为广发证券股份有限公司(以下简称“广发证券”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及截至报告期末最新公告的《招商沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》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、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、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)。本基金可根据相关法律法规和基金合同的约定,参与融资业务和转融通证券出借业务。基金的投资组合比例为:本基金投资于标的指数成份券和备选成份券的资产比例不低于基金资产净值的 90%,且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合约、国债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、国债期货和股票期权的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如法律法规或中国证监会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为:沪深 300 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》、国务院令第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》、财税[2026]12 号《关于明确增值税应税交易销售额计算口径的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，公开募集证券投资基金管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，以基金管理人为增值税纳税人，可以选择适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对公募证券投资基金(封闭式证券投资基金，开

放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入以及金融同业往来利息收入免征增值税。

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

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

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

(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	612,691.62
等于：本金	612,377.28
加：应计利息	314.34
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	564,903.95

等于：本金	564,843.67
加：应计利息	60.28
减：坏账准备	-
合计	1,177,595.57

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		178,420,165.28	-	196,974,259.06	18,554,093.78
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		178,420,165.28	-	196,974,259.06	18,554,093.78

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	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	154,109.79
其他	7,476.50
合计	161,586.29

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	196,260,624.00	196,260,624.00
本期申购	171,000,000.00	171,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-249,000,000.00	-249,000,000.00
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	118,260,624.00	118,260,624.00

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	74,883,596.91	26,965,255.91	101,848,852.82
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	74,883,596.91	26,965,255.91	101,848,852.82
本期利润	44,178,032.60	-21,757,276.68	22,420,755.92
本期基金份额交易产生的变动数	-35,388,901.58	-9,182,842.26	-44,571,743.84
其中：基金申购款	101,568,661.63	-6,147,309.95	95,421,351.68
基金赎回款	-136,957,563.21	-3,035,532.31	-139,993,095.52
本期已分配利润	-	-	-
本期末	83,672,727.93	-3,974,863.03	79,697,864.90

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	8,532.43
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	1,028.92
结算备付金利息收入	-

其他	-
合计	9,561.35

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	27,189,547.45
股票投资收益——赎回差价收入	15,206,031.15
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	42,395,578.60

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	183,621,011.64
减：卖出股票成本总额	156,287,262.35
减：交易费用	144,201.84
买卖股票差价收入	27,189,547.45

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	388,993,095.52
减：现金支付赎回款总额	163,437,120.52
减：赎回股票成本总额	210,349,943.85
减：交易费用	-
赎回差价收入	15,206,031.15

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	1,666,363.79
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	1,666,363.79

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	-21,757,276.68
——股票投资	-21,757,276.68
——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	-21,757,276.68

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	447,762.41
合计	447,762.41

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	5,178.06
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
其他	69,424.36
合计	134,109.79

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
广发证券股份有限公司	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
招商沪深 300 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“招商沪深 300ETF 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
广发证券	319,198,676.85	100.00%	378,140,117.31	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
广发证券	-	-	120,987.37	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
广发证券	31,922.34	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
广发证券	37,818.79	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	155,342.79	494,813.73
其中：应支付销售机构的客户维护费	10,112.00	22,951.38
应支付基金管理人的净管理费	145,230.79	471,862.35

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×0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金管理人报酬＝前一日基金资产净值×0.15%÷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	51,780.97	164,937.92

注：支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值×0.05%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金托管费＝前一日基金资产净值×0.05%÷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
广发证券股份有限公司	4,454,724.00	3.77%	1,476,844.00	0.75%
招商沪深 300ETF 发起式联接	55,445,900.00	46.88%	20,431,400.00	10.41%

招商证券股份有限公司	895,522.00	0.76%	7,414,222.00	3.78%

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
广发证券-活期	612,691.62	8,532.43	964,837.24	9,564.45
广发证券-其他存款	564,903.95	1,028.92	3,313,370.96	3,998.79

注：本基金的托管人为广发证券股份有限公司，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
广发证券	603435	嘉德利	网下申购	963	15,176.88
招商证券	603459	红板科技	网下申购	1,280	22,656.00
招商证券	001365	天海电子	网下申购	740	20,120.60

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
广发证券	001382	新亚电缆	网下申购	3,660	27,084.00
广发证券	301662	宏工科技	网下申购	1,429	38,011.40
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。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

于 2026 年 6 月 30 日，本基金因指数成份股原因被动持有招商银行（600036）85,600 股，市值为人民币 3,038,800.00 元，占本基金资产净值的比例为 1.54%（2025 年 6 月 30 日：持有 235,200 股，市值为人民币 10,807,440.00 元，占本基金资产净值的比例为 2.71%）。

于 2026 年 6 月 30 日，本基金因指数成份股原因被动持有招商证券（600999）25,600 股，市值为人民币 540,160.00 元，占本基金资产净值的比例为 0.27%（2025 年 6 月 30 日：持有 70,500 股，市值为人民币 1,240,095.00 元，占本基金资产净值的比例为 0.31%）。

于 2026 年 6 月 30 日，本基金因指数成份股原因被动持有广发证券（000776）20,400 股，市值为人民币 477,360.00 元，占本基金资产净值的比例为 0.24%（2025 年 6 月 30 日：持有 56,200 股，市值为人民币 944,722.00 元，占本基金资产净值的比例为 0.24%）。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001220	世盟股份	2026 年 1 月 27 日	6 个月	新股流通受限	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-
001237	惠康科技	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	53.26	58.74	86	4,580.36	5,051.64	-
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	6,319	63,885.09	63,885.09	-
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	2,708	27,377.88	27,377.88	-
001257	盛龙股份	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股流通受限	7.82	20.74	750	5,865.00	15,555.00	-
001312	福恩股份	2026 年 4 月 14 日	6 个月	新股流通受限	18.38	16.78	73	1,341.74	1,224.94	-
001365	天海电子	2026 年 5 月 11 日	6 个月	新股流通受限	27.19	31.31	222	6,036.18	6,950.82	-
001393	维通利	2026 年 5 月 8 日	6 个月	新股流通受限	30.38	38.99	157	4,769.66	6,121.43	-
001399	惠科股份	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通受限	10.12	27.73	1,025	10,373.00	28,423.25	-
301513	尚水智能	2026 年	6 个月	新股流通	26.66	50.96	130	3,465.80	6,624.80	-

		4 月 10 日		受限						
301531	春光集团	2026 年 4 月 28 日	6 个月	新股流通受限	13.30	51.56	240	3,192.00	12,374.40	-
301599	理奇智能	2026 年 4 月 22 日	6 个月	新股流通受限	13.91	32.47	252	3,505.32	8,182.44	-
301666	大普微	2026 年 4 月 8 日	6 个月	新股流通受限	46.08	463.33	296	13,639.68	137,145.68	-
301669	高特电子	2026 年 6 月 2 日	6 个月	新股流通受限	7.08	28.40	409	2,895.72	11,615.60	-
301680	固德电材	2026 年 2 月 27 日	6 个月	新股流通受限	58.00	112.16	84	4,872.00	9,421.44	-
301682	宏明电子	2026 年 3 月 18 日	6 个月	新股流通受限	69.66	160.06	163	11,354.58	26,089.78	-
301683	慧谷新材	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股流通受限	78.38	121.77	39	3,056.82	4,749.03	-
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	124	3,060.32	10,763.20	-
601112	振石股份	2026 年 1 月 21 日	6 个月	新股流通受限	11.18	17.59	302	3,376.36	5,312.18	-
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	36	1,205.64	1,221.48	-
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	135	1,871.10	9,917.10	-

603435	嘉德利	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	15.76	46.71	97	1,528.72	4,530.87	-
603459	红板科技	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	17.70	84.32	128	2,265.60	10,792.96	-
688635	长进光子	2026 年 5 月 20 日	6 个月	新股流通受限	40.98	308.19	86	3,524.28	26,504.34	-
688712	北芯生命	2026 年 1 月 28 日	6 个月	新股流通受限	17.52	35.92	1,292	22,635.84	46,408.64	-
688781	视涯科技	2026 年 3 月 18 日	6 个月	新股流通受限	22.68	47.61	59	1,338.12	2,808.99	-
688785	恒运昌	2026 年 1 月 20 日	6 个月	新股流通受限	92.18	463.15	80	7,374.40	37,052.00	-
688797	臻宝科技	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通受限	44.56	468.67	77	3,431.12	36,087.59	-
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	51	4,175.88	80,800.83	-
688811	有研复材	2026 年 4 月 1 日	6 个月	新股流通受限	6.41	24.13	627	4,019.07	15,129.51	-
688813	泰金新能	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股流通受限	26.28	172.09	134	3,521.52	23,060.06	-
688816	易思维	2026 年 2 月 4 日	6 个月	新股流通受限	55.95	57.10	116	6,490.20	6,623.60	-
688818	电科蓝天	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股流通受限	9.47	70.14	853	8,077.91	59,829.42	-
688820	盛合晶微	2026 年 4 月 13 日	6 个月	新股流通受限	19.68	141.49	291	5,726.88	41,173.59	-

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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026 年 6 月 29 日	重大事项停牌	832.00	2026 年 7 月 13 日	890.99	1,400	906,376.05	1,164,800.00	-

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	1,177,595.57	-	-	-	1,177,595.57
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	196,974,259.06	196,974,259.06
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	1,177,595.57	-	-	196,974,259.06	198,151,854.63
负债					

应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	23,834.58	23,834.58
应付托管费	-	-	-	7,944.86	7,944.86
应付清算款	-	-	-	-	-
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	-	-	-	161,586.29	161,586.29
负债总计	-	-	-	193,365.73	193,365.73
利率敏感度缺口	1,177,595.57	-	-	196,780,893.33	197,958,488.90
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	4,154,578.12	-	-	-	4,154,578.12
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	296,498,147.39	296,498,147.39
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	4,154,578.12	-	-	296,498,147.39	300,652,725.51
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	43,114.19	43,114.19
应付托管费	-	-	-	14,371.39	14,371.39
应付清算款	-	-	-	2,169,191.11	2,169,191.11
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	-	-	-	316,572.00	316,572.00
负债总计	-	-	-	2,543,248.69	2,543,248.69
利率敏感度缺口	4,154,578.12	-	-	293,954,898.70	298,109,476.82

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	196,974,259.06	99.50	296,498,147.39	99.46
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	196,974,259.06	99.50	296,498,147.39	99.46

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%	9,848,712.95	14,824,907.37
	2. 权益性投资的市场价格下降 5%	-9,848,712.95	-14,824,907.37

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	194,999,436.66	293,045,805.64
第二层次	1,256,062.97	2,339,393.20
第三层次	718,759.43	1,112,948.55
合计	196,974,259.06	296,498,147.39

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	196,974,259.06	99.41
	其中：股票	196,974,259.06	99.41
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	1,177,595.57	0.59
8	其他各项资产	-	-
9	合计	198,151,854.63	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	1,114,687.00	0.56
B	采矿业	8,178,038.00	4.13
C	制造业	125,340,858.41	63.32
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,257,941.52	2.66
E	建筑业	2,227,895.00	1.13
F	批发和零售业	290,112.00	0.15
G	交通运输、仓储和邮政业	4,751,600.02	2.40
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,614,741.67	5.36
J	金融业	34,255,071.00	17.30
K	房地产业	635,155.00	0.32
L	租赁和商务服务业	889,713.00	0.45
M	科学研究和技术服务业	2,129,121.00	1.08
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	265,972.00	0.13
R	文化、体育和娱乐业	113,118.00	0.06
S	综合	-	-
	合计	196,064,023.62	99.04

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	15,555.00	0.01
C	制造业	799,390.03	0.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	91,262.97	0.05
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	2,443.98	0.00
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	910,235.44	0.46

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	300308	中际旭创	7,750	9,842,500.00	4.97
2	300750	宁德时代	18,238	7,167,716.38	3.62
3	300502	新易盛	9,676	5,873,332.00	2.97
4	600519	贵州茅台	4,300	5,097,607.00	2.58
5	603986	兆易创新	4,600	3,749,000.00	1.89
6	688256	寒武纪	2,217	3,537,334.35	1.79
7	601318	中国平安	73,700	3,518,438.00	1.78
8	600036	招商银行	85,600	3,038,800.00	1.54
9	601899	紫金矿业	113,900	2,863,446.00	1.45
10	002371	北方华创	3,030	2,680,216.80	1.35
11	000333	美的集团	33,600	2,537,808.00	1.28
12	002475	立讯精密	35,200	2,478,080.00	1.25
13	688008	澜起科技	7,964	2,468,043.60	1.25
14	688012	中微公司	5,206	2,439,011.00	1.23
15	688041	海光信息	6,458	2,391,397.40	1.21
16	002384	东山精密	8,800	2,308,680.00	1.17
17	600900	长江电力	84,600	2,239,362.00	1.13
18	688981	中芯国际	13,870	2,202,833.40	1.11
19	000725	京东方 A	251,400	2,182,152.00	1.10
20	603259	药明康德	17,100	2,129,121.00	1.08
21	601138	工业富联	27,400	1,976,910.00	1.00
22	600030	中信证券	67,500	1,939,275.00	0.98
23	601166	兴业银行	117,100	1,939,176.00	0.98
24	300059	东方财富	87,500	1,783,250.00	0.90
25	600183	生益科技	10,100	1,751,340.00	0.88
26	600276	恒瑞医药	30,900	1,608,036.00	0.81
27	300274	阳光电源	10,000	1,590,200.00	0.80
28	601398	工商银行	223,700	1,581,559.00	0.80
29	300408	三环集团	9,200	1,535,480.00	0.78
30	002594	比亚迪	18,800	1,498,360.00	0.76
31	300476	胜宏科技	4,200	1,455,006.00	0.74
32	601211	国泰海通	78,160	1,422,512.00	0.72
33	002463	沪电股份	9,300	1,421,040.00	0.72
34	300394	天孚通信	4,536	1,372,956.48	0.69
35	000988	华工科技	7,000	1,292,270.00	0.65
36	301308	江波龙	1,800	1,266,840.00	0.64
37	600176	中国巨石	16,600	1,209,808.00	0.61
38	601288	农业银行	198,800	1,206,716.00	0.61
39	601328	交通银行	184,600	1,186,978.00	0.60
40	688072	拓荆科技	1,400	1,164,800.00	0.59
41	000651	格力电器	31,000	1,162,500.00	0.59
42	600522	中天科技	18,900	1,146,852.00	0.58
43	688521	芯原股份	2,976	1,104,512.64	0.56

44	600919	江苏银行	101,400	1,093,092.00	0.55
45	603019	中科曙光	10,100	1,083,023.00	0.55
46	603993	洛阳钼业	60,400	1,060,020.00	0.54
47	600150	中国船舶	31,199	1,054,214.21	0.53
48	600887	伊利股份	43,700	1,047,052.00	0.53
49	600584	长电科技	9,900	1,025,145.00	0.52
50	000338	潍柴动力	37,100	1,010,975.00	0.51
51	000858	五粮液	13,400	991,600.00	0.50
52	601816	京沪高铁	202,900	919,137.00	0.46
53	600309	万华化学	12,900	882,489.00	0.45
54	300124	汇川技术	13,100	868,923.00	0.44
55	002415	海康威视	25,300	865,260.00	0.44
56	002916	深南电路	1,880	860,852.00	0.43
57	600111	北方稀土	17,500	840,875.00	0.42
58	000100	TCL 科技	144,000	838,080.00	0.42
59	601688	华泰证券	40,400	833,048.00	0.42
60	000063	中兴通讯	22,300	807,037.00	0.41
61	600000	浦发银行	92,000	792,120.00	0.40
62	600089	特变电工	34,930	785,925.00	0.40
63	601857	中国石油	89,600	777,728.00	0.39
64	002028	思源电气	4,300	743,900.00	0.38
65	601088	中国神华	19,000	741,760.00	0.37
66	300433	蓝思科技	13,800	740,508.00	0.37
67	600031	三一重工	41,100	710,208.00	0.36
68	300014	亿纬锂能	10,500	682,815.00	0.34
69	002050	三花智控	15,500	679,365.00	0.34
70	002142	宁波银行	22,800	676,932.00	0.34
71	601601	中国太保	23,700	675,924.00	0.34
72	000001	平安银行	67,000	673,350.00	0.34
73	002714	牧原股份	18,900	661,311.00	0.33
74	000792	盐湖股份	21,900	661,161.00	0.33
75	600549	厦门钨业	7,700	656,040.00	0.33
76	002353	杰瑞股份	4,200	640,500.00	0.32
77	600406	国电南瑞	27,800	635,230.00	0.32
78	601668	中国建筑	142,800	619,752.00	0.31
79	000657	中钨高新	6,300	603,036.00	0.30
80	601229	上海银行	68,700	596,316.00	0.30
81	002602	世纪华通	40,800	575,280.00	0.29
82	601919	中远海控	43,300	574,158.00	0.29
83	300760	迈瑞医疗	4,200	570,486.00	0.29
84	601988	中国银行	98,800	565,136.00	0.29
85	601939	建设银行	58,600	564,318.00	0.29
86	600660	福耀玻璃	11,100	559,884.00	0.28

87	603501	豪威集团	5,900	559,615.00	0.28
88	601728	中国电信	107,400	557,406.00	0.28
89	600016	民生银行	171,900	553,518.00	0.28
90	601012	隆基绿能	41,905	549,793.60	0.28
91	601225	陕西煤业	26,800	545,380.00	0.28
92	600941	中国移动	6,291	541,843.83	0.27
93	600999	招商证券	25,600	540,160.00	0.27
94	002230	科大讯飞	13,200	539,088.00	0.27
95	600690	海尔智家	25,900	528,619.00	0.27
96	002352	顺丰控股	16,600	518,916.00	0.26
97	600930	华电新能	107,776	514,091.52	0.26
98	601985	中国核电	56,900	513,807.00	0.26
99	002460	赣锋锂业	7,800	510,120.00	0.26
100	002709	天赐材料	9,900	509,157.00	0.26
101	600926	杭州银行	35,100	507,195.00	0.26
102	603799	华友钴业	10,500	506,730.00	0.26
103	002938	鹏鼎控股	4,800	505,824.00	0.26
104	601169	北京银行	102,500	502,250.00	0.25
105	300033	同花顺	2,080	501,280.00	0.25
106	000977	浪潮信息	7,100	497,000.00	0.25
107	600160	巨化股份	9,300	492,993.00	0.25
108	000776	广发证券	20,400	477,360.00	0.24
109	300442	润泽科技	5,700	473,499.00	0.24
110	688126	沪硅产业	11,528	459,851.92	0.23
111	000425	徐工机械	56,700	458,703.00	0.23
112	002202	金风科技	19,100	456,490.00	0.23
113	000938	紫光股份	15,800	455,988.00	0.23
114	300498	温氏股份	36,800	453,376.00	0.23
115	601600	中国铝业	54,800	450,456.00	0.23
116	600028	中国石化	100,600	448,676.00	0.23
117	600938	中国海油	16,500	447,975.00	0.23
118	002466	天齐锂业	7,200	441,504.00	0.22
119	002600	领益智造	25,300	438,702.00	0.22
120	601766	中国中车	84,200	437,840.00	0.22
121	600460	士兰微	8,000	437,280.00	0.22
122	688082	盛美上海	1,005	434,160.00	0.22
123	600050	中国联通	108,000	432,000.00	0.22
124	601009	南京银行	42,700	422,303.00	0.21
125	002837	英维克	5,300	421,668.00	0.21
126	002049	紫光国微	4,700	417,125.00	0.21
127	002179	中航光电	8,800	406,560.00	0.21
128	601628	中国人寿	11,500	406,525.00	0.21
129	300661	圣邦股份	2,810	403,178.80	0.20

130	601100	恒立液压	3,700	397,972.00	0.20
131	000568	泸州老窖	5,100	395,352.00	0.20
132	601872	招商轮船	22,300	391,811.00	0.20
133	002241	歌尔股份	17,200	387,516.00	0.20
134	603288	海天味业	11,500	381,340.00	0.19
135	601006	大秦铁路	82,500	380,325.00	0.19
136	605117	德业股份	3,556	377,576.08	0.19
137	601658	邮储银行	76,100	375,173.00	0.19
138	000408	藏格矿业	5,400	374,328.00	0.19
139	600809	山西汾酒	3,400	371,858.00	0.19
140	601818	光大银行	128,600	371,654.00	0.19
141	600905	三峡能源	99,000	367,290.00	0.19
142	600489	中金黄金	20,200	364,610.00	0.18
143	002625	光启技术	11,900	360,808.00	0.18
144	688396	华润微	3,696	360,544.80	0.18
145	601888	中国中免	6,700	359,857.00	0.18
146	000630	铜陵有色	55,600	353,616.00	0.18
147	600893	航发动力	9,200	352,728.00	0.18
148	600010	包钢股份	156,600	349,218.00	0.18
149	688111	金山办公	1,637	348,762.85	0.18
150	688271	联影医疗	3,428	347,016.44	0.18
151	601336	新华保险	5,800	346,028.00	0.17
152	601127	赛力斯	5,600	343,000.00	0.17
153	600958	东方证券	36,200	341,728.00	0.17
154	601689	拓普集团	6,000	338,520.00	0.17
155	002027	分众传媒	69,800	337,832.00	0.17
156	600118	中国卫星	4,100	336,405.00	0.17
157	600019	宝钢股份	60,200	326,886.00	0.17
158	600760	中航沈飞	7,900	324,690.00	0.16
159	000807	云铝股份	14,400	318,816.00	0.16
160	600362	江西铜业	7,200	311,760.00	0.16
161	688183	生益电子	2,354	311,669.60	0.16
162	601838	成都银行	17,600	311,520.00	0.16
163	600104	上汽集团	31,800	310,368.00	0.16
164	300450	先导智能	7,600	309,472.00	0.16
165	600989	宝丰能源	15,200	309,016.00	0.16
166	601727	上海电气	43,600	305,200.00	0.15
167	600875	东方电气	10,500	302,085.00	0.15
168	002001	新和成	10,600	301,252.00	0.15
169	601825	沪农商行	39,900	298,851.00	0.15
170	601390	中国中铁	70,600	294,402.00	0.15
171	603296	华勤技术	3,960	294,109.20	0.15
172	601995	中金公司	8,100	292,815.00	0.15

173	002422	科伦药业	7,600	292,752.00	0.15
174	000538	云南白药	6,160	291,799.20	0.15
175	601377	兴业证券	47,700	288,108.00	0.15
176	600795	国电电力	61,500	287,205.00	0.15
177	600547	山东黄金	12,400	286,316.00	0.14
178	603893	瑞芯微	1,500	282,540.00	0.14
179	600585	海螺水泥	16,600	281,370.00	0.14
180	600015	华夏银行	44,000	281,160.00	0.14
181	601669	中国电建	59,500	279,650.00	0.14
182	000166	申万宏源	62,500	275,000.00	0.14
183	002648	卫星化学	11,700	274,833.00	0.14
184	601916	浙商银行	104,100	273,783.00	0.14
185	300316	晶盛机电	4,500	271,800.00	0.14
186	601698	中国卫通	8,800	266,200.00	0.13
187	300015	爱尔眼科	32,200	265,972.00	0.13
188	601066	中信建投	9,000	261,630.00	0.13
189	600482	中国动力	7,900	259,120.00	0.13
190	600346	恒力石化	14,600	258,566.00	0.13
191	601868	中国能建	96,600	257,922.00	0.13
192	601998	中信银行	36,700	254,331.00	0.13
193	002311	海大集团	5,700	254,277.00	0.13
194	002558	巨人网络	9,200	253,552.00	0.13
195	300418	昆仑万维	6,200	250,232.00	0.13
196	000625	长安汽车	34,200	245,214.00	0.12
197	600426	华鲁恒升	10,200	243,984.00	0.12
198	600066	宇通客车	9,100	243,971.00	0.12
199	002532	天山铝业	22,400	240,352.00	0.12
200	600221	海航控股	177,300	239,355.00	0.12
201	000157	中联重科	34,200	238,374.00	0.12
202	688036	传音控股	3,997	235,623.15	0.12
203	600011	华能国际	30,300	229,977.00	0.12
204	600436	片仔癀	2,100	229,488.00	0.12
205	605499	东鹏饮料	1,858	229,332.94	0.12
206	600048	保利发展	49,500	229,185.00	0.12
207	300803	指南针	2,500	229,175.00	0.12
208	600438	通威股份	18,600	225,246.00	0.11
209	600115	中国东航	58,900	224,409.00	0.11
210	601077	渝农商行	36,700	224,237.00	0.11
211	002236	大华股份	13,500	222,615.00	0.11
212	002493	荣盛石化	20,700	222,525.00	0.11
213	600570	恒生电子	10,500	222,495.00	0.11
214	600886	国投电力	16,600	220,946.00	0.11
215	600188	兖矿能源	12,300	218,571.00	0.11

216	003816	中国广核	54,300	212,313.00	0.11
217	002736	国信证券	21,200	211,788.00	0.11
218	601058	赛轮轮胎	18,200	209,846.00	0.11
219	000301	东方盛虹	18,300	209,535.00	0.11
220	601360	三六零	24,100	209,429.00	0.11
221	600026	中远海能	11,500	206,310.00	0.10
222	601901	方正证券	28,500	205,200.00	0.10
223	002074	国轩高科	7,400	203,574.00	0.10
224	688047	龙芯中科	1,303	201,535.01	0.10
225	600009	上海机场	8,600	198,660.00	0.10
226	600196	复星医药	8,800	197,736.00	0.10
227	000768	中航西飞	9,600	196,608.00	0.10
228	601788	光大证券	13,600	196,248.00	0.10
229	000975	山金国际	11,500	195,500.00	0.10
230	600029	南方航空	37,400	193,732.00	0.10
231	601111	中国国航	32,000	193,600.00	0.10
232	600415	小商品城	18,900	192,024.00	0.10
233	601456	国联民生	21,700	191,828.00	0.10
234	600674	川投能源	13,500	191,295.00	0.10
235	600219	南山铝业	47,600	189,924.00	0.10
236	601186	中国铁建	31,700	188,615.00	0.10
237	601881	中国银河	15,000	188,550.00	0.10
238	601877	正泰电器	7,500	188,025.00	0.09
239	600233	圆通速递	11,900	187,425.00	0.09
240	601117	中国化学	25,400	186,690.00	0.09
241	301236	软通动力	4,300	182,535.00	0.09
242	600372	中航机载	16,700	181,195.00	0.09
243	601878	浙商证券	18,900	179,550.00	0.09
244	301269	华大九天	1,500	179,130.00	0.09
245	000963	华东医药	6,100	171,532.00	0.09
246	002920	德赛西威	2,100	171,150.00	0.09
247	600741	华域汽车	10,900	169,168.00	0.09
248	000895	双汇发展	7,200	161,280.00	0.08
249	001979	招商蛇口	24,800	159,464.00	0.08
250	688506	百利天恒	536	157,600.08	0.08
251	300866	安克创新	1,500	156,750.00	0.08
252	002304	洋河股份	4,100	156,415.00	0.08
253	601898	中煤能源	12,700	154,686.00	0.08
254	601021	春秋航空	3,300	150,414.00	0.08
255	601319	中国人保	22,100	149,396.00	0.08
256	600023	浙能电力	27,700	145,702.00	0.07
257	600039	四川路桥	18,000	140,760.00	0.07
258	601800	中国交建	24,400	139,324.00	0.07

259	000002	万科 A	46,900	138,824.00	0.07
260	688223	晶科能源	28,460	135,185.00	0.07
261	600588	用友网络	14,200	130,356.00	0.07
262	601633	长城汽车	8,600	129,774.00	0.07
263	001965	招商公路	14,100	129,156.00	0.07
264	600600	青岛啤酒	2,400	125,352.00	0.06
265	603369	今世缘	5,200	123,292.00	0.06
266	600027	华电国际	27,400	121,930.00	0.06
267	601618	中国中冶	49,500	120,780.00	0.06
268	601607	上海医药	7,700	118,580.00	0.06
269	300628	亿联网络	3,500	118,370.00	0.06
270	600918	中泰证券	22,000	117,040.00	0.06
271	302132	中航成飞	2,000	116,640.00	0.06
272	000617	中油资本	17,600	115,984.00	0.06
273	603260	合盛硅业	2,400	115,824.00	0.06
274	600061	国投资本	17,600	115,280.00	0.06
275	300832	新产业	2,700	113,400.00	0.06
276	300251	光线传媒	10,200	113,118.00	0.06
277	600025	华能水电	12,700	112,903.00	0.06
278	600085	同仁堂	4,800	110,928.00	0.06
279	601059	信达证券	6,700	108,473.00	0.05
280	688472	阿特斯	9,954	107,702.28	0.05
281	600515	海南机场	39,300	107,682.00	0.05
282	000999	华润三九	4,530	101,879.70	0.05
283	600803	新奥股份	6,400	101,120.00	0.05
284	600845	宝信软件	6,000	99,780.00	0.05
285	600018	上港集团	20,900	98,648.00	0.05
286	300122	智飞生物	8,200	95,858.00	0.05
287	300999	金龙鱼	4,000	93,040.00	0.05
288	000596	古井贡酒	1,100	87,780.00	0.04
289	300896	爱美客	1,000	87,200.00	0.04
290	000708	中信特钢	6,900	87,078.00	0.04
291	688009	中国通号	18,099	86,151.24	0.04
292	601018	宁波港	27,100	85,365.00	0.04
293	601238	广汽集团	15,400	78,232.00	0.04
294	688303	大全能源	4,470	77,912.10	0.04
295	300413	芒果超媒	5,200	76,076.00	0.04
296	001280	中国铀业	1,100	73,370.00	0.04
297	301165	锐捷网络	900	72,405.00	0.04
298	603392	万泰生物	2,600	70,122.00	0.04
299	001391	国货航	14,786	60,179.02	0.03
300	601136	首创证券	3,800	53,010.00	0.03

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	301666	大普微	296	137,145.68	0.07
2	001248	华润新能源	9,027	91,262.97	0.05
3	688808	联讯仪器	51	80,800.83	0.04
4	688809	强一股份	101	62,923.00	0.03
5	688818	电科蓝天	853	59,829.42	0.03
6	688712	北芯生命	1,292	46,408.64	0.02
7	688820	盛合晶微	291	41,173.59	0.02
8	688785	恒运昌	80	37,052.00	0.02
9	688797	臻宝科技	77	36,087.59	0.02
10	001399	惠科股份	1,025	28,423.25	0.01
11	688583	思看科技	318	27,274.86	0.01
12	688635	长进光子	86	26,504.34	0.01
13	301682	宏明电子	163	26,089.78	0.01
14	688813	泰金新能	134	23,060.06	0.01
15	001257	盛龙股份	750	15,555.00	0.01
16	301687	新广益	195	15,167.10	0.01
17	688811	有研复材	627	15,129.51	0.01
18	301531	春光集团	240	12,374.40	0.01
19	301669	高特电子	409	11,615.60	0.01
20	603459	红板科技	128	10,792.96	0.01
21	301696	三瑞智能	124	10,763.20	0.01
22	603407	长裕集团	135	9,917.10	0.01
23	301680	固德电材	84	9,421.44	0.00
24	301599	理奇智能	252	8,182.44	0.00
25	001369	双欣材料	560	7,571.20	0.00
26	001365	天海电子	222	6,950.82	0.00
27	301513	尚水智能	130	6,624.80	0.00
28	688816	易思维	116	6,623.60	0.00
29	001393	维通利	157	6,121.43	0.00
30	601112	振石股份	302	5,312.18	0.00
31	001237	惠康科技	86	5,051.64	0.00
32	301683	慧谷新材	39	4,749.03	0.00
33	603435	嘉德利	97	4,530.87	0.00
34	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
35	688781	视涯科技	59	2,808.99	0.00
36	001396	誉帆科技	69	2,443.98	0.00

37	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
38	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00
39	001312	福恩股份	73	1,224.94	0.00
40	603293	埃泰克	36	1,221.48	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	300750	宁德时代	12,321,470.00	4.13
2	300308	中际旭创	9,326,442.00	3.13
3	300502	新易盛	6,839,524.00	2.29
4	000333	美的集团	4,156,955.96	1.39
5	002371	北方华创	3,577,524.00	1.20
6	002475	立讯精密	3,115,743.00	1.05
7	002594	比亚迪	2,905,042.24	0.97
8	300274	阳光电源	2,815,471.00	0.94
9	300059	东方财富	2,743,723.00	0.92
10	000858	五粮液	2,457,750.81	0.82
11	300394	天孚通信	2,159,584.00	0.72
12	002384	东山精密	1,796,648.00	0.60
13	000651	格力电器	1,764,683.00	0.59
14	300476	胜宏科技	1,749,609.00	0.59
15	000725	京东方 A	1,742,795.00	0.58
16	000338	潍柴动力	1,627,180.00	0.55
17	002415	海康威视	1,370,665.00	0.46
18	000063	中兴通讯	1,309,692.00	0.44
19	002714	牧原股份	1,289,929.00	0.43
20	000792	盐湖股份	1,285,151.00	0.43

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	300750	宁德时代	16,673,940.00	5.59
2	300308	中际旭创	12,399,588.00	4.16

3	300502	新易盛	8,652,878.00	2.90
4	000333	美的集团	6,023,943.70	2.02
5	002475	立讯精密	4,471,884.00	1.50
6	002371	北方华创	4,432,125.00	1.49
7	300059	东方财富	4,112,288.00	1.38
8	002594	比亚迪	4,051,059.00	1.36
9	300274	阳光电源	3,781,912.00	1.27
10	000858	五粮液	3,475,215.54	1.17
11	300394	天孚通信	2,735,037.00	0.92
12	300476	胜宏科技	2,606,905.00	0.87
13	000651	格力电器	2,592,944.00	0.87
14	000725	京东方 A	2,499,107.00	0.84
15	002384	东山精密	2,353,120.82	0.79
16	000338	潍柴动力	2,304,472.00	0.77
17	688256	寒武纪	2,237,153.98	0.75
18	300124	汇川技术	1,935,542.00	0.65
19	002415	海康威视	1,920,554.00	0.64
20	002230	科大讯飞	1,908,131.00	0.64

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	136,794,675.01
卖出股票收入（成交）总额	183,621,011.64

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，招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

7.12.3 期末其他各项资产构成

本基金本报告期末未持有其他资产。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	301666	大普微	137,145.68	0.07	新股流通受限
2	001248	华润新能源	91,262.97	0.05	新股流通受限
3	688808	联讯仪器	80,800.83	0.04	新股流通受限
4	688818	电科蓝天	59,829.42	0.03	新股流通受限

§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		招商沪深 300ETF 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
1,729	68,398.28	93,649,024.00	79.19%	24,611,600.00	20.81%	55,445,900.00	46.88%

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(2024 年 9 月 6 日)基金份额总额	586,260,624.00
本报告期期初基金份额总额	196,260,624.00
本报告期基金总申购份额	171,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	249,000,000.00
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	118,260,624.00

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、公募基金托管业务的重大诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

报告期内，本基金托管人的基金托管业务部门无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门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	
广发证券	6	319,198,676.85	100.00%	31,922.34	100.00%	-

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
广发证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	招商沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-01-21
2	招商基金管理有限公司旗下基金 2025 年第 4 季度报告提示性公告	中国证券报及基金管理人网站	2026-01-21
3	招商基金管理有限公司旗下部分基金增加国联民生证券股份有限公司为场内申购赎回代办券商的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-02
4	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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-09
5	招商基金管理有限公司旗下部分基金增加万和证券股份有限公司为场内申购赎回代办券商的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-19
6	招商沪深 300 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
7	招商基金管理有限公司旗下基金 2025 年年度报告提示性公告	中国证券报及基金管理人网站	2026-03-31
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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-04-01
9	招商沪深 300 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
10	招商基金管理有限公司旗下基金 2026 年第 1 季度报告提示性公告	中国证券报及基金管理人网站	2026-04-22
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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-05-12
12	招商基金管理有限公司关于提醒投资者持续完善客户身份信息的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-05-14
13	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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-05-16
14	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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-06-22

§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
招商沪深 300ETF 发起式联接	1	20260204-20260205, 20260210-20260630	20,431,400.00	38,573,400.00	3,558,900.00	55,445,900.00	46.88%
机构	1	20260101-20260326, 20260330-20260406, 20260409-20260630	58,072,300.00	-	31,877,700.00	26,194,600.00	22.15%
产品特有风险							
本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况，可能会出现集中赎回甚至巨额赎回从而引发基金净值剧烈波动，甚至引发基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。							

注：1、报告期末持有份额占比按照四舍五入方法保留至小数点后第 2 位；

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

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1、中国证券监督管理委员会批准设立招商基金管理有限公司的文件；

2、中国证券监督管理委员会批准招商沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金设立的文件；

3、《招商沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；

4、《招商沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；

5、《招商沪深 300 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.cmfchina.com

招商基金管理有限公司

2026 年 8 月 31 日