

招商中证 500 增强策略交易型开放式 指数证券投资基金 2025 年中期报告

2025 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：2025 年 8 月 28 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，并由董事长签发。

基金托管人国投证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 8 月 27 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 2025 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.....	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.....	9
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 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	10
§5 托管人报告.....	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	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.....	15
§7 投资组合报告.....	32
7.1 期末基金资产组合情况.....	32
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	33
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	34
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.....	44
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.....	44
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	45
7.12 投资组合报告附注	45
§8 基金份额持有人信息	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	46
8.2 期末上市基金前十名持有人	47
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	47
8.4 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、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	49
10.8 其他重大事件	49
§11 备查文件目录	51
11.1 备查文件目录	51
11.2 存放地点	52
11.3 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：500 指数增强 ETF）
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	72,156,000.00 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
		郭刚
		0755-81682162
		tgfw@sdiesc.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	518038
法定代表人	王小青	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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.cmfchina.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
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(2025 年 1 月 1 日 - 2025 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	5,043,908.57
本期利润	6,160,201.82
加权平均基金份额本期利润	0.0871
本期加权平均净值利润率	8.21%
本期基金份额净值增长率	7.85%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	8,234,680.73
期末可供分配基金份额利润	0.1141
期末基金资产净值	80,390,680.73
期末基金份额净值	1.1141
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	11.41%

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。

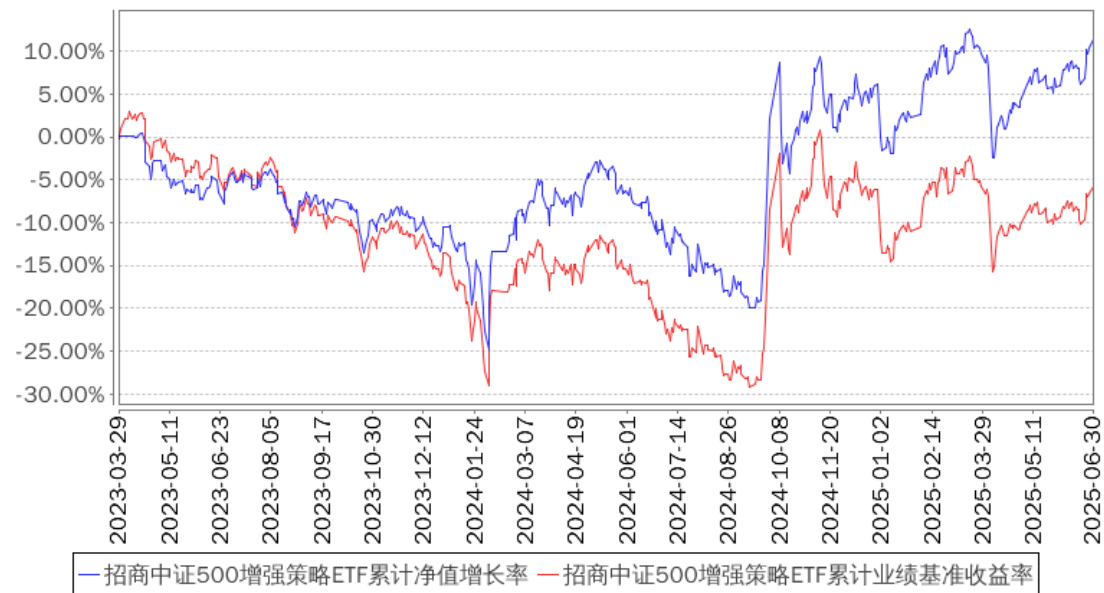
3.2 基金净值表现

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
过去一个月	5.28%	0.78%	4.31%	0.79%	0.97%	-0.01%
过去三个月	2.54%	1.54%	0.98%	1.50%	1.56%	0.04%
过去六个月	7.85%	1.33%	3.31%	1.36%	4.54%	-0.03%
过去一年	24.97%	1.65%	19.68%	1.72%	5.29%	-0.07%
自基金合同生效起至今	11.41%	1.38%	-5.80%	1.45%	17.21%	-0.07%

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

招商中证500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	-	12	男，硕士。2012 年 7 月加入招商基金管理有限公司量化投资部，曾任研究员，现任招商中证 500 指数增强型证券投资基金、招商中证大宗商品股票指数证券投资基金（LOF）、招商中证煤炭等权指数证券投资基金、招商北证 50 成份指数型发起式证券投资基金、招商中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、招商中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金、招商国证 2000 指数增强型证券投资基金、招商安和债券型证券投资基金、招商安康债券型证券投资基金、招商中证红利低波动 100 指数型发起式证券投资基金、招商上证科创板 50 成份增强策略交易型开放式指数证券投资基金、招商上证综合指数增强型发起式证券投资基金、招商中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、招商中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金基金经理，兼任投资经理。
王岩	本基金基金经理（已离任）	2023 年 3 月 29 日	2025 年 4 月 23 日	10	男，硕士。曾任杭州师范大学国际服务工程学院讲师，2010 年 9 月加入中信期货有限公司工作，任研究部研究员；2011 年 11 月加入招商证券股份有限公司工作，任资产管理部风险管理经理；2012 年 3 月加入中信期货有限公司工作，任研究部研究员；2014 年 11 月加入招商基金管理有限公司，曾任量化投资部研究员、投资经理、招商沪深 300 指数增强型证券投资基金、招商中证全指证券公司指数证券投资基金、招商沪深 300 地产等权重指数证券投资基金、招商沪深 300 高贝塔指数证券投资基金、招商中证 500 等权重指数增强型证券投资基金、招商创业板指数增强型证券投资基金、招商中证 800 指数增强型证券投资基金、招商中证 500 增强策略交易型

					开放式指数证券投资基金、招商沪深 300 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、招商中证 2000 指数增强型证券投资基金、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基金经理。
--	--	--	--	--	--

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

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

金额单位：人民币元

姓名	产品类型	产品数量 (只)	资产净值(元)	任职时间
邓童	公募基金	14	10,902,181,141.69	2021 年 11 月 23 日
	私募资产管理计划	1	49,690,786.21	2013 年 11 月 26 日
	其他组合	1	3,772,902,061.10	2024 年 8 月 19 日
	合计	16	14,724,773,989.00	-

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

基金管理人按照法规要求，对连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合间的同向交易的交易价差进行分析，相关投资组合经理也

对分析中发现的价格差异次数占比超过正常范围的情况进行了合理性解释。报告期内，公司旗下投资组合向交易价差分析中未发现异常情形。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，本基金各项交易均严格按照相关法律法规、基金合同的有关要求执行，公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 12 次，为旗下指数及量化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 指数小幅上涨，4 月初在外部环境因素干扰下快速回调，但随后市场情绪企稳后逐步反弹。从市场风格上看，一季度成长风格快速拉升，价值风格则在二季度有所反弹，扭转了一季度相对弱势的局面，同时小市值风格持续强于大市值风格。量化模型在价值风格上普遍有一定的暴露，同时传统量价因子在一季度高波动高流动性环境下表现较弱，二季度市场逐步恢复正常，超额收益也逐步企稳反弹。当前外部环境的不确定性依然较高，市场信心可能有一定反复，同时由于小市值风格上半年持续强势，市值风格的风险加大，博弈情绪较重的背景下需要密切观察市场波动率同时做好风险应对。指数整体表现难以预测，相对基准的超额收益就显得更加重要，在策略方面，本产品会继续采用多模型配置的框架，力争在较低的跟踪误差下创造出持续的超额收益。我们也将持续加强新因子及新方法的研究，尽力保持策略超额收益的持续性和多元性。

4.4.2 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 7.85%，同期业绩基准增长率为 3.31%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2025 年上半年国内经济呈“生产稳、需求弱、价格低”特征，政策端以“宽货币+稳财政+促消费”为主线，央行 5 月降准、降息及调降存款利率，财政端加快专项债与超长期特别国债发行，地产供需两端政策持续加码，但传导至信用扩张与实物工作量仍需时间。展望下半年，盈利预测仍有下修压力，但 A 股整体估值仍处于相对低位，叠加美元上行空

间受限、国内稳增长政策落地预期升温，市场或呈现“震荡上行、结构再平衡”特征。风格层面，当前小市值风格正处于相对高位，需警惕其回调风险。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金的估值业务严格按照相关的法律法规、基金合同以及《招商基金管理有限公司基金估值委员会管理办法》进行。基金核算部负责日常的基金资产的估值业务，执行基金估值政策。另外，公司设立由投资和研究部门、风险管理部、基金核算部、法律合规部负责人和基金经理代表组成的估值委员会。公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历。公司估值委员会主要负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，定期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。

投资和研究部门以及基金核算部共同负责关注相关投资品种的动态，评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种；投资和研究部门定期审核公允价值的确认和计量；研究部提出合理的数量分析模型对需要进行估值测算或者调整的投资品种进行公允价值定价与计量并定期对估值政策和程序进行评价，以保证其持续适用；基金核算部定期审核估值政策和程序的一致性，并负责与托管行沟通估值调整事项；风险管理部负责估值委员会工作流程中的风险控制；法律合规部负责日常的基金估值调整结果的事后复核监督工作；法律合规部与基金核算部共同负责估值调整事项的信息披露工作。

基金经理代表向估值委员会提供估值参考信息，参与估值政策讨论；对需采用特别估值程序的证券，基金及时启动特别估值程序，由公司估值委员会集体讨论议定特别估值方案，咨询会计师事务所的专业意见，并与托管行沟通后由基金核算部具体执行。

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。截至报告期末本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供相关债券品种、流通受限股票的估值参考数据。

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 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	1,805,105.07	905,395.90
结算备付金		6,684.66	292,453.92
存出保证金		63,353.84	74,243.18
交易性金融资产	6.4.7.2	78,809,890.70	68,670,461.06
其中：股票投资		78,809,890.70	68,670,461.06
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		-	852,996.06
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		80,685,034.27	70,795,550.12
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		155,923.96	790,700.70
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		32,315.51	32,232.11
应付托管费		6,463.11	6,446.41
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	99,650.96	75,292.80
负债合计		294,353.54	904,672.02
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	72,156,000.00	67,656,000.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	8,234,680.73	2,234,878.10
净资产合计		80,390,680.73	69,890,878.10
负债和净资产总计		80,685,034.27	70,795,550.12

注：报告截止日 2025 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.1141 元，基金份额总额 72,156,000.00 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：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		6,434,810.14	894,278.35
1.利息收入		4,297.16	8,426.44
其中：存款利息收入	6.4.7.9	4,297.16	8,426.44
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		5,270,600.72	515,470.36
其中：股票投资收益	6.4.7.10	4,343,624.84	-645,076.38
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	1,135.47	5,082.93
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	925,840.41	1,155,463.81
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	1,116,293.25	327,811.96
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	43,619.01	42,569.59
减：二、营业总支出		274,608.32	390,127.96
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	185,966.78	258,758.26
其中：暂估管理人报酬		-	-
2.托管费	6.4.10.2.2	37,193.40	51,751.63
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	51,448.14	79,618.07
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		6,160,201.82	504,150.39

减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		6,160,201.82	504,150.39
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		6,160,201.82	504,150.39

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：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	138,156,000.00	-	-14,548,777.91	123,607,222.09
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	138,156,000.00	-	-14,548,777.91	123,607,222.09
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-34,500,000.00	-	3,303,224.03	-31,196,775.97

(一)、综合收益总额	-	-	504,150.39	504,150.39
(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)	-34,500,000.00	-	2,799,073.64	-31,700,926.36
其中: 1.基金申购款	25,500,000.00	-	-3,882,911.93	21,617,088.07
2.基金赎回款	-60,000,000.00	-	6,681,985.57	-53,318,014.43
(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	103,656,000.00	-	-11,245,553.88	92,410,446.12

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 2025 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2025 年 1 月 1 日至 2025 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

本基金在本报告期间未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期间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》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、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》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税；2018 年 1 月 1 日起，公开募集证券投资基金管理人运营公开募集证券投资基金过程中发生的资管产品运营业务，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。

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

(3) 对基金取得的股票股息红利所得，由上市公司代扣代缴个人所得税；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

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

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

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 2025 年 6 月 30 日
活期存款	1,805,105.07
等于：本金	1,804,543.62
加：应计利息	561.45
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	1,805,105.07

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		76,475,126.25	-	78,809,890.70	2,334,764.45
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		76,475,126.25	-	78,809,890.70	2,334,764.45

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 2025 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	14,394.60
其中：交易所市场	14,394.60
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	85,256.36
合计	99,650.96

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	67,656,000.00	67,656,000.00
本期申购	25,500,000.00	25,500,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-21,000,000.00	-21,000,000.00
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	72,156,000.00	72,156,000.00

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	3,363,266.87	-1,128,388.77	2,234,878.10
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	3,363,266.87	-1,128,388.77	2,234,878.10
本期利润	5,043,908.57	1,116,293.25	6,160,201.82
本期基金份额交易产生的变动数	533,796.86	-694,196.05	-160,399.19
其中：基金申购款	2,689,791.97	-1,150,617.14	1,539,174.83
基金赎回款	-2,155,995.11	456,421.09	-1,699,574.02

本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,940,972.30	-706,291.57	8,234,680.73

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	3,802.34
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	352.72
其他	142.10
合计	4,297.16

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	4,299,547.33
股票投资收益——赎回差价收入	44,077.51
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	4,343,624.84

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	146,661,739.90
减：卖出股票成本总额	142,240,155.98
减：交易费用	122,036.59
买卖股票差价收入	4,299,547.33

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	22,699,574.02
减：现金支付赎回款总额	12,670,653.02
减：赎回股票成本总额	9,984,843.49
减：交易费用	-
赎回差价收入	44,077.51

6.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无股票申购差价收入。

6.4.7.10.5 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内无证券出借差价收入。

6.4.7.11 债券投资收益**6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	0.79
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,134.68
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	1,135.47

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	6,135.72
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	4,999.98
减：应计利息总额	0.81
减：交易费用	0.25
买卖债券差价收入	1,134.68

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	925,840.41
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	925,840.41

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	1,116,293.25
——股票投资	1,116,293.25
——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	1,116,293.25

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	43,619.01
合计	43,619.01

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	1,859.57
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
其他	9,916.99
合计	51,448.14

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，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	296,920,809.26	100.00%	502,424,034.36	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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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%	13,076.31	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 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%
关联方名称	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	123,550.56	100.00%	70,657.84	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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	185,966.78	258,758.26
其中：应支付销售机构的客户维护费	41,394.18	61,030.77
应支付基金管理人的净管理费	144,572.60	197,727.49

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	37,193.40	51,751.63

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

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	1,805,105.07	3,802.34	710,267.64	5,006.14

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

本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

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（2025 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

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

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

本基金为股票型基金，本基金的运作涉及的金融工具主要包括股票投资、债券投资等。与这些金融工具有关的风险，以及本基金的基金管理人管理这些风险所采取的风险管理政策如下所述。

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，监事会、董事会及下设风险控制委员会、督察长、风险管理委员会、法律合规部和风险管理部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主要在证券交易市场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同约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)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。

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约定巨额赎回条款，设计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股票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交易形成负债的公允价值，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 2025 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	1,805,105.07	-	-	-	1,805,105.07
结算备付金	6,684.66	-	-	-	6,684.66
存出保证金	63,353.84	-	-	-	63,353.84
交易性金融资产	-	-	-	78,809,890.70	78,809,890.70
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	1,875,143.57	-	-	78,809,890.70	80,685,034.27
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	32,315.51	32,315.51
应付托管费	-	-	-	6,463.11	6,463.11
应付清算款	-	-	-	155,923.96	155,923.96
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	-	-	-	99,650.96	99,650.96
负债总计	-	-	-	294,353.54	294,353.54
利率敏感度缺口	1,875,143.57	-	-	78,515,537.16	80,390,680.73
上年度末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	905,395.90	-	-	-	905,395.90
结算备付金	292,453.92	-	-	-	292,453.92
存出保证金	74,243.18	-	-	-	74,243.18
交易性金融资产	-	-	-	68,670,461.06	68,670,461.06
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	-	-	-	852,996.06	852,996.06
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,272,093.00	-	-	69,523,457.12	70,795,550.12
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	32,232.11	32,232.11
应付托管费	-	-	-	6,446.41	6,446.41
应付清算款	-	-	-	790,700.70	790,700.70
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	-	-	-	75,292.80	75,292.80
负债总计	-	-	-	904,672.02	904,672.02
利率敏感度缺口	1,272,093.00	-	-	68,618,785.10	69,890,878.10

注：上表按金融资产或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 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	78,809,890.70	98.03	68,670,461.06	98.25
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	78,809,890.70	98.03	68,670,461.06	98.25

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（ 2025 年 6 月 30 日 ）	上年度末（ 2024 年 12 月 31 日 ）
	1. 权益性投资的市场价格上升 5%	3,940,494.54	3,433,523.05
	2. 权益性投资的市场价格下降 5%	-3,940,494.54	-3,433,523.05

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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	78,809,890.70	68,670,461.06
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	78,809,890.70	68,670,461.06

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

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

§ 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	78,809,890.70	97.68
	其中：股票	78,809,890.70	97.68
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	1,811,789.73	2.25
8	其他各项资产	63,353.84	0.08
9	合计	80,685,034.27	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	255,630.00	0.32
B	采矿业	1,448,717.50	1.80
C	制造业	47,645,521.86	59.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,466,374.00	1.82
E	建筑业	342,569.00	0.43
F	批发和零售业	3,924,205.26	4.88
G	交通运输、仓储和邮政业	729,838.00	0.91
H	住宿和餐饮业	69,564.00	0.09
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,673,404.88	4.57
J	金融业	4,250,999.64	5.29
K	房地产业	256,235.00	0.32
L	租赁和商务服务业	652,273.00	0.81
M	科学研究和技术服务业	344,577.56	0.43
N	水利、环境和公共设施管理业	725,956.00	0.90
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	784,623.00	0.98
S	综合	-	-
	合计	66,570,488.70	82.81

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	-	-

C	制造业	8,029,361.00	9.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	401,903.00	0.50
E	建筑业	63,802.00	0.08
F	批发和零售业	178,700.00	0.22
G	交通运输、仓储和邮政业	165,356.00	0.21
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,279,047.00	2.83
J	金融业	561,466.00	0.70
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	365,559.00	0.45
N	水利、环境和公共设施管理业	23,232.00	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	170,976.00	0.21
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	12,239,402.00	15.22

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所有股票投资明细

7.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	600685	中船防务	42,500	1,155,575.00	1.44
2	603529	爱玛科技	32,900	1,131,760.00	1.41
3	002185	华天科技	106,600	1,076,660.00	1.34
4	002841	视源股份	30,800	1,065,680.00	1.33
5	600143	金发科技	102,800	1,059,868.00	1.32
6	300496	中科创达	17,900	1,024,238.00	1.27
7	300207	欣旺达	49,900	1,000,994.00	1.25
8	600739	辽宁成大	90,050	990,550.00	1.23
9	600498	烽火通信	44,200	929,526.00	1.16
10	600699	均胜电子	51,000	889,440.00	1.11
11	603233	大参林	53,520	872,376.00	1.09
12	600299	安迪苏	88,700	855,955.00	1.06

13	300919	中伟股份	25,000	822,000.00	1.02
14	600487	亨通光电	52,200	798,660.00	0.99
15	603939	益丰药房	29,900	731,653.00	0.91
16	002266	浙富控股	235,700	725,956.00	0.90
17	600885	宏发股份	31,820	709,904.20	0.88
18	600062	华润双鹤	37,700	703,482.00	0.88
19	000050	深天马 A	81,600	695,232.00	0.86
20	002025	航天电器	13,200	678,612.00	0.84
21	002065	东华软件	69,400	666,240.00	0.83
22	000733	振华科技	13,300	665,665.00	0.83
23	600038	中直股份	16,900	655,889.00	0.82
24	300751	迈为股份	9,400	653,864.00	0.81
25	603290	斯达半导	8,000	650,160.00	0.81
26	603160	汇顶科技	9,100	646,373.00	0.80
27	000887	中鼎股份	36,100	634,999.00	0.79
28	002340	格林美	99,500	631,825.00	0.79
29	002299	圣农发展	44,000	628,760.00	0.78
30	601019	山东出版	66,200	626,914.00	0.78
31	600060	海信视像	27,100	623,842.00	0.78
32	601231	环旭电子	42,200	617,386.00	0.77
33	002831	裕同科技	26,000	608,920.00	0.76
34	002008	大族激光	24,500	597,065.00	0.74
35	600704	物产中大	107,200	564,944.00	0.70
36	600380	健康元	48,224	531,910.72	0.66
37	300573	兴齐眼药	9,700	502,363.00	0.62
38	600312	平高电气	31,400	483,246.00	0.60
39	600582	天地科技	79,000	473,210.00	0.59
40	300803	指南针	5,565	448,872.90	0.56
41	600141	兴发集团	21,500	441,395.00	0.55
42	603379	三美股份	8,700	418,644.00	0.52
43	603129	春风动力	1,900	411,350.00	0.51
44	002056	横店东磁	29,000	410,350.00	0.51
45	600528	中铁工业	55,300	408,114.00	0.51
46	000709	河钢股份	187,300	404,568.00	0.50
47	600549	厦门钨业	19,150	400,618.00	0.50
48	688819	天能股份	14,421	400,326.96	0.50
49	603087	甘李药业	7,300	399,894.00	0.50
50	000729	燕京啤酒	30,700	396,951.00	0.49
51	000039	中集集团	50,300	395,358.00	0.49
52	000825	太钢不锈	109,100	391,669.00	0.49
53	002595	豪迈科技	6,500	384,930.00	0.48
54	000060	中金岭南	83,900	384,262.00	0.48
55	002673	西部证券	47,200	371,936.00	0.46

56	000830	鲁西化工	35,500	365,650.00	0.45
57	000785	居然智家	115,600	352,580.00	0.44
58	000960	锡业股份	23,000	351,900.00	0.44
59	688582	芯动联科	5,200	349,440.00	0.43
60	603893	瑞芯微	2,300	349,278.00	0.43
61	688608	恒玄科技	1,000	347,980.00	0.43
62	002138	顺络电子	12,000	337,440.00	0.42
63	000623	吉林敖东	19,600	332,220.00	0.41
64	600098	广州发展	49,000	306,250.00	0.38
65	002064	华峰化学	45,800	302,738.00	0.38
66	600153	建发股份	28,900	299,693.00	0.37
67	002500	山西证券	51,300	299,592.00	0.37
68	002281	光迅科技	6,000	295,920.00	0.37
69	600298	安琪酵母	8,400	295,428.00	0.37
70	601168	西部矿业	17,500	291,025.00	0.36
71	002429	兆驰股份	63,400	277,692.00	0.35
72	601717	中创智领	16,500	274,230.00	0.34
73	002414	高德红外	26,300	269,575.00	0.34
74	300476	胜宏科技	2,000	268,760.00	0.33
75	002517	恺英网络	13,800	266,478.00	0.33
76	601139	深圳燃气	40,800	259,488.00	0.32
77	600862	中航高科	9,800	255,584.00	0.32
78	688122	西部超导	4,825	250,321.00	0.31
79	002444	巨星科技	9,700	247,447.00	0.31
80	000988	华工科技	5,200	244,452.00	0.30
81	600109	国金证券	27,700	242,929.00	0.30
82	003022	联泓新科	15,300	242,199.00	0.30
83	605589	圣泉集团	8,700	241,425.00	0.30
84	002683	广东宏大	7,100	240,974.00	0.30
85	600517	国网英大	47,200	240,720.00	0.30
86	000021	深科技	12,800	239,872.00	0.30
87	000728	国元证券	30,350	239,461.50	0.30
88	000987	越秀资本	34,900	239,414.00	0.30
89	002821	凯莱英	2,700	238,275.00	0.30
90	002432	九安医疗	6,500	236,795.00	0.29
91	002624	完美世界	15,600	236,652.00	0.29
92	000898	鞍钢股份	102,000	236,640.00	0.29
93	600998	九州通	45,959	236,229.26	0.29
94	603858	步长制药	14,500	235,480.00	0.29
95	002007	华兰生物	14,900	233,483.00	0.29
96	688099	晶晨股份	3,288	233,480.88	0.29
97	600499	科达制造	23,800	233,240.00	0.29
98	600352	浙江龙盛	22,900	232,664.00	0.29

99	601555	东吴证券	26,300	230,125.00	0.29
100	300724	捷佳伟创	4,200	228,060.00	0.28
101	601568	北元集团	54,700	227,005.00	0.28
102	600928	西安银行	57,900	226,968.00	0.28
103	688249	晶合集成	11,000	222,970.00	0.28
104	600079	人福医药	10,600	222,388.00	0.28
105	601598	中国外运	45,100	222,343.00	0.28
106	600008	首创环保	72,500	218,950.00	0.27
107	000921	海信家电	8,500	218,450.00	0.27
108	601233	桐昆股份	20,500	217,300.00	0.27
109	600435	北方导航	13,700	213,583.00	0.27
110	601162	天风证券	41,300	203,609.00	0.25
111	600583	海油工程	37,200	203,112.00	0.25
112	301165	锐捷网络	3,180	195,442.80	0.24
113	603338	浙江鼎力	4,000	189,600.00	0.24
114	601118	海南橡胶	39,800	187,856.00	0.23
115	600325	华发股份	38,000	185,060.00	0.23
116	000062	深圳华强	6,700	179,962.00	0.22
117	300454	深信服	1,900	178,942.00	0.22
118	300623	捷捷微电	6,000	178,800.00	0.22
119	688002	睿创微纳	2,556	178,204.32	0.22
120	300763	锦浪科技	3,100	177,909.00	0.22
121	600764	中国海防	5,200	176,800.00	0.22
122	300604	长川科技	3,900	175,149.00	0.22
123	688052	纳芯微	1,000	174,490.00	0.22
124	300748	金力永磁	7,300	174,032.00	0.22
125	688153	唯捷创芯	5,600	173,656.00	0.22
126	000831	中国稀土	4,800	173,376.00	0.22
127	300115	长盈精密	8,100	173,340.00	0.22
128	000783	长江证券	25,000	173,250.00	0.22
129	601216	君正集团	31,200	172,224.00	0.21
130	002156	通富微电	6,700	171,654.00	0.21
131	002130	沃尔核材	7,200	171,504.00	0.21
132	600839	四川长虹	17,600	171,072.00	0.21
133	603816	顾家家居	6,700	170,984.00	0.21
134	300458	全志科技	4,300	170,667.00	0.21
135	600884	杉杉股份	18,000	170,280.00	0.21
136	000066	中国长城	11,500	170,200.00	0.21
137	688114	华大智造	2,621	169,919.43	0.21
138	601456	国联民生	16,400	169,740.00	0.21
139	300567	精测电子	2,800	169,708.00	0.21
140	600909	华安证券	29,100	169,653.00	0.21
141	002939	长城证券	20,200	169,276.00	0.21

142	603658	安图生物	4,500	168,750.00	0.21
143	601179	中国西电	27,400	168,236.00	0.21
144	002202	金风科技	16,400	168,100.00	0.21
145	601156	东航物流	12,700	166,243.00	0.21
146	300677	英科医疗	7,000	165,760.00	0.21
147	300037	新宙邦	4,700	165,440.00	0.21
148	600378	昊华科技	6,100	165,127.00	0.21
149	002385	大北农	40,800	164,832.00	0.21
150	300601	康泰生物	10,800	164,052.00	0.20
151	600271	航天信息	17,400	160,776.00	0.20
152	600348	华阳股份	24,000	159,840.00	0.20
153	600959	江苏有线	46,000	158,240.00	0.20
154	300017	网宿科技	14,500	155,440.00	0.19
155	300073	当升科技	3,400	149,158.00	0.19
156	600968	海油发展	36,400	148,512.00	0.18
157	002945	华林证券	10,200	146,574.00	0.18
158	300002	神州泰岳	12,400	146,320.00	0.18
159	600132	重庆啤酒	2,600	143,260.00	0.18
160	688213	思特威	1,400	143,108.00	0.18
161	300474	景嘉微	1,800	131,400.00	0.16
162	000032	深桑达 A	5,600	113,288.00	0.14
163	002080	中材科技	5,300	103,350.00	0.13
164	601997	贵阳银行	15,200	94,848.00	0.12
165	603228	景旺电子	2,200	92,048.00	0.11
166	600606	绿地控股	55,900	91,117.00	0.11
167	000519	中兵红箭	3,700	80,993.00	0.10
168	002958	青农商行	22,300	80,503.00	0.10
169	601966	玲珑轮胎	5,400	79,218.00	0.10
170	002472	双环传动	2,300	77,027.00	0.10
171	601198	东兴证券	6,900	76,935.00	0.10
172	600879	航天电子	7,300	76,431.00	0.10
173	600563	法拉电子	700	76,363.00	0.09
174	603486	科沃斯	1,300	75,699.00	0.09
175	002558	巨人网络	3,200	75,360.00	0.09
176	002465	海格通信	5,400	75,276.00	0.09
177	000738	航发控制	3,600	74,700.00	0.09
178	300001	特锐德	3,100	74,307.00	0.09
179	000878	云南铜业	5,800	73,776.00	0.09
180	300627	华测导航	2,100	73,500.00	0.09
181	002085	万丰奥威	4,600	73,094.00	0.09
182	688475	萤石网络	2,312	72,874.24	0.09
183	300285	国瓷材料	4,200	72,870.00	0.09
184	300699	光威复材	2,284	72,334.28	0.09

185	600867	通化东宝	8,800	72,160.00	0.09
186	600166	福田汽车	26,600	72,086.00	0.09
187	600155	华创云信	10,300	71,688.00	0.09
188	000034	神州数码	1,900	71,516.00	0.09
189	000636	风华高科	5,200	71,448.00	0.09
190	601212	白银有色	22,800	71,364.00	0.09
191	002203	海亮股份	6,900	71,208.00	0.09
192	002244	滨江集团	7,300	71,175.00	0.09
193	002409	雅克科技	1,300	71,097.00	0.09
194	600497	驰宏锌锗	13,400	70,886.00	0.09
195	601608	中信重工	16,200	70,794.00	0.09
196	002508	老板电器	3,700	70,337.00	0.09
197	601921	浙版传媒	8,700	70,122.00	0.09
198	600329	达仁堂	2,100	70,056.00	0.09
199	002572	索菲亚	5,000	70,050.00	0.09
200	603885	吉祥航空	5,200	70,044.00	0.09
201	601958	金钼股份	6,400	70,016.00	0.09
202	002078	太阳纸业	5,200	69,992.00	0.09
203	600511	国药股份	2,400	69,984.00	0.09
204	600655	豫园股份	12,600	69,930.00	0.09
205	601611	中国核建	7,600	69,844.00	0.09
206	688425	铁建重工	17,100	69,768.00	0.09
207	600282	南钢股份	16,600	69,720.00	0.09
208	000959	首钢股份	20,500	69,700.00	0.09
209	300676	华大基因	1,400	69,678.00	0.09
210	600486	扬农化工	1,200	69,600.00	0.09
211	000513	丽珠集团	1,931	69,593.24	0.09
212	600754	锦江酒店	3,100	69,564.00	0.09
213	000426	兴业银锡	4,400	69,520.00	0.09
214	000893	亚钾国际	2,300	69,322.00	0.09
215	601965	中国汽研	3,900	69,225.00	0.09
216	600516	方大炭素	14,900	69,136.00	0.09
217	603298	杭叉集团	3,300	69,135.00	0.09
218	603341	龙旗科技	1,700	69,071.00	0.09
219	002120	韵达股份	10,300	69,010.00	0.09
220	002532	天山铝业	8,300	68,973.00	0.09
221	300012	华测检测	5,900	68,971.00	0.09
222	002507	涪陵榨菜	5,390	68,938.10	0.09
223	000027	深圳能源	10,800	68,904.00	0.09
224	002608	江苏国信	9,400	68,902.00	0.09
225	002461	珠江啤酒	6,100	68,869.00	0.09
226	600535	天士力	4,400	68,860.00	0.09
227	601061	中信金属	8,700	68,817.00	0.09

228	601016	节能风电	23,800	68,782.00	0.09
229	688248	南网科技	2,186	68,771.56	0.09
230	601158	重庆水务	14,800	68,672.00	0.09
231	301301	川宁生物	5,700	68,628.00	0.09
232	600177	雅戈尔	9,400	68,620.00	0.09
233	600021	上海电力	7,800	68,562.00	0.09
234	600925	苏能股份	13,100	68,513.00	0.09
235	603596	伯特利	1,300	68,497.00	0.09
236	000598	兴蓉环境	9,500	68,495.00	0.09
237	002966	苏州银行	7,800	68,484.00	0.09
238	000937	冀中能源	11,900	68,425.00	0.09
239	600820	隧道股份	11,200	68,320.00	0.08
240	600056	中国医药	6,600	68,244.00	0.08
241	001213	中铁特货	16,800	68,208.00	0.08
242	601928	凤凰传媒	6,100	68,137.00	0.08
243	600096	云天化	3,100	68,107.00	0.08
244	000539	粤电力 A	15,000	68,100.00	0.08
245	003035	南网能源	14,800	67,932.00	0.08
246	002850	科达利	600	67,902.00	0.08
247	002318	久立特材	2,900	67,831.00	0.08
248	600598	北大荒	4,700	67,774.00	0.08
249	603156	养元饮品	3,200	67,712.00	0.08
250	002223	鱼跃医疗	1,900	67,640.00	0.08
251	600873	梅花生物	6,300	67,347.00	0.08
252	600004	白云机场	7,400	67,340.00	0.08
253	601991	大唐发电	21,200	67,204.00	0.08
254	300765	新诺威	1,300	67,197.00	0.08
255	600956	新天绿能	8,700	67,164.00	0.08
256	600578	京能电力	14,900	66,901.00	0.08
257	000429	粤高速 A	5,000	66,650.00	0.08
258	601577	长沙银行	6,700	66,598.00	0.08
259	002155	湖南黄金	3,730	66,580.50	0.08
260	002353	杰瑞股份	1,900	66,500.00	0.08
261	601128	常熟银行	8,852	65,239.24	0.08
262	601665	齐鲁银行	10,300	65,096.00	0.08
263	601990	南京证券	7,900	63,832.00	0.08
264	600988	赤峰黄金	2,500	62,200.00	0.08
265	605358	立昂微	2,600	60,580.00	0.08
266	688617	惠泰医疗	200	59,400.00	0.07
267	688578	艾力斯	600	55,824.00	0.07
268	002410	广联达	4,000	53,640.00	0.07
269	688772	珠海冠宇	1,933	27,622.57	0.03
270	601696	中银证券	2,400	25,656.00	0.03

271	601858	中国科传	1,000	19,450.00	0.02
272	000723	美锦能源	3,700	15,984.00	0.02
273	300888	稳健医疗	300	12,330.00	0.02

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	688187	时代电气	18,900	806,085.00	1.00
2	002373	千方科技	75,700	704,010.00	0.88
3	002236	大华股份	40,500	643,140.00	0.80
4	000534	万泽股份	30,000	447,600.00	0.56
5	002230	科大讯飞	7,500	359,100.00	0.45
6	002139	拓邦股份	20,400	281,724.00	0.35
7	002824	和胜股份	16,300	280,360.00	0.35
8	002380	科远智慧	11,400	278,730.00	0.35
9	600219	南山铝业	67,700	259,291.00	0.32
10	300866	安克创新	2,200	249,920.00	0.31
11	002001	新 和 成	11,700	248,859.00	0.31
12	601319	中国人保	27,300	237,783.00	0.30
13	000725	京东方 A	57,100	227,829.00	0.28
14	002479	富春环保	45,100	225,951.00	0.28
15	600584	长电科技	6,700	225,723.00	0.28
16	000938	紫光股份	9,400	225,506.00	0.28
17	688225	亚信安全	11,000	224,290.00	0.28
18	601992	金隅集团	146,100	222,072.00	0.28
19	002649	博彦科技	13,900	201,967.00	0.25
20	300033	同花顺	700	191,107.00	0.24
21	603595	东尼电子	9,500	186,865.00	0.23
22	300232	洲明科技	25,800	186,792.00	0.23
23	603259	药明康德	2,500	173,875.00	0.22
24	002376	新北洋	22,200	172,494.00	0.21
25	300418	昆仑万维	5,100	171,513.00	0.21
26	300015	爱尔眼科	13,700	170,976.00	0.21
27	300206	理邦仪器	14,200	170,684.00	0.21
28	000156	华数传媒	21,400	169,916.00	0.21
29	002788	鹭燕医药	19,600	167,972.00	0.21
30	300124	汇川技术	2,600	167,882.00	0.21
31	000401	冀东水泥	38,000	166,440.00	0.21
32	603876	鼎胜新材	18,300	166,347.00	0.21
33	603833	欧派家居	2,900	163,705.00	0.20
34	601877	正泰电器	6,800	154,156.00	0.19

35	600030	中信证券	4,800	132,576.00	0.16
36	002179	中航光电	3,100	125,116.00	0.16
37	300762	上海瀚讯	5,300	119,939.00	0.15
38	300363	博腾股份	6,500	111,020.00	0.14
39	000685	中山公用	12,400	108,872.00	0.14
40	603296	华勤技术	1,300	104,884.00	0.13
41	601919	中远海控	6,600	99,264.00	0.12
42	603799	华友钴业	2,600	96,252.00	0.12
43	301080	百普赛斯	1,300	92,989.00	0.12
44	600500	中化国际	21,700	83,111.00	0.10
45	002408	齐翔腾达	18,000	80,640.00	0.10
46	301061	匠心家居	1,000	77,540.00	0.10
47	600186	莲花控股	12,800	76,800.00	0.10
48	301459	丰茂股份	1,760	74,624.00	0.09
49	603286	日盈电子	2,500	74,450.00	0.09
50	000778	新兴铸管	19,800	73,656.00	0.09
51	002487	大金重工	2,200	72,380.00	0.09
52	003008	开普检测	3,400	72,250.00	0.09
53	002988	豪美新材	1,900	72,200.00	0.09
54	002295	精艺股份	8,500	72,080.00	0.09
55	603150	万朗磁塑	2,200	71,830.00	0.09
56	603898	好莱客	6,500	71,435.00	0.09
57	300808	久量股份	2,400	71,160.00	0.09
58	301456	盘古智能	2,900	70,934.00	0.09
59	001238	浙江正特	1,800	70,560.00	0.09
60	000952	广济药业	11,400	70,452.00	0.09
61	002399	海普瑞	5,900	70,269.00	0.09
62	000030	富奥股份	11,800	69,502.00	0.09
63	603665	康隆达	2,800	69,384.00	0.09
64	002174	游族网络	5,700	69,141.00	0.09
65	300009	安科生物	8,200	68,634.00	0.09
66	600642	申能股份	7,800	67,080.00	0.08
67	600350	山东高速	6,200	66,092.00	0.08
68	603699	纽威股份	2,100	65,457.00	0.08
69	002847	盐津铺子	800	64,320.00	0.08
70	002989	中天精装	1,900	63,802.00	0.08
71	605499	东鹏饮料	200	62,810.00	0.08
72	603444	吉比特	200	60,390.00	0.08
73	000913	钱江摩托	3,500	52,500.00	0.07
74	300685	艾德生物	2,200	47,366.00	0.06
75	300770	新媒股份	1,000	39,990.00	0.05
76	603153	上海建科	1,500	26,445.00	0.03
77	300929	华骐环保	2,200	23,232.00	0.03

78	603508	思维列控	700	18,536.00	0.02
79	600066	宇通客车	700	17,402.00	0.02
80	688089	嘉必优	600	15,090.00	0.02
81	300274	阳光电源	200	13,554.00	0.02
82	601607	上海医药	600	10,728.00	0.01

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	002065	东华软件	1,404,162.00	2.01
2	300476	胜宏科技	1,306,880.00	1.87
3	002299	圣农发展	1,271,538.00	1.82
4	000050	深天马 A	1,208,861.00	1.73
5	000683	博源化工	1,131,257.00	1.62
6	301236	软通动力	1,129,318.00	1.62
7	603529	爱玛科技	1,118,582.00	1.60
8	600685	中船防务	1,084,005.00	1.55
9	002841	视源股份	1,066,264.00	1.53
10	300496	中科创达	1,006,726.00	1.44
11	300919	中伟股份	975,723.00	1.40
12	600143	金发科技	959,156.00	1.37
13	002008	大族激光	910,970.00	1.30
14	002185	华天科技	909,617.25	1.30
15	600312	平高电气	904,653.00	1.29
16	002340	格林美	896,100.00	1.28
17	600739	辽宁成大	892,764.00	1.28
18	601168	西部矿业	882,366.00	1.26
19	002281	光迅科技	881,781.00	1.26
20	000887	中鼎股份	875,457.00	1.25

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	300476	胜宏科技	1,802,394.00	2.58

2	301236	软通动力	1,394,779.00	2.00
3	000683	博源化工	1,342,140.00	1.92
4	300866	安克创新	1,287,324.00	1.84
5	603129	春风动力	1,254,472.00	1.79
6	601168	西部矿业	1,231,220.00	1.76
7	002065	东华软件	1,226,733.00	1.76
8	002384	东山精密	1,204,015.00	1.72
9	300699	光威复材	1,191,093.00	1.70
10	000034	神州数码	1,135,538.00	1.62
11	600339	中油工程	1,102,609.00	1.58
12	000783	长江证券	1,054,185.00	1.51
13	300054	鼎龙股份	1,009,447.00	1.44
14	301022	海泰科	999,676.00	1.43
15	600862	中航高科	962,156.00	1.38
16	002128	电投能源	945,416.00	1.35
17	300203	聚光科技	931,644.00	1.33
18	002273	水晶光电	928,619.00	1.33
19	600378	昊华科技	928,487.00	1.33
20	002429	兆驰股份	894,878.00	1.28

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	150,259,069.36
卖出股票收入（成交）总额	146,661,739.90

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

报告期内基金投资的前十名证券除均胜电子（证券代码 600699）外其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

根据 2024 年 8 月 13 日发布的相关公告，该证券发行人因违规使用募集资金、未及时披露公司重大事件、信息披露虚假或严重误导性陈述、重大事项未履行审议程序被上海证券交易所通报批评。

对上述证券的投资决策程序的说明：本基金为指数型基金，因复制指数被动持有，上述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。

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	63,353.84
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	63,353.84

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	
		持有份额	占总份额比 例	持有份额	占总份额比 例
712	101,342.70	50,416,000.00	69.87%	21,740,000.00	30.13%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	平安资管-工商银行-平安资产鑫享 32 号资产管理产品	5,590,900.00	7.75%
2	中国印钞造币集团有限公司企业年金计划-中国光大银行股份有限公司	3,292,200.00	4.56%
3	重庆市叁号职业年金计划-建设银行	3,222,700.00	4.47%
4	上海市肆号职业年金计划-浦发银行	3,180,500.00	4.41%
5	中央国家机关及所属事业单位(壹号)职业年金计划-建设银行	3,024,800.00	4.19%
6	吉林省壹号职业年金计划-工商银行	3,005,700.00	4.17%
7	中国铁路南昌局集团有限公司企业年金计划-中国建设银行股份有限公司	2,893,300.00	4.01%
8	东方证券股份有限公司企业年金计划-中国工商银行股份有限公司	2,840,000.00	3.94%
9	江苏省伍号职业年金计划-浦发银行	2,728,500.00	3.78%
10	方正证券股份有限公司	2,535,400.00	3.51%

注：以上数据由中国证券登记结算公司提供，前十名持有人均为场内持有人。

8.3 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	-	-

8.4 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	67,656,000.00
本报告期基金总申购份额	25,500,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	21,000,000.00
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-

本报告期末基金份额总额	72,156,000.00
-------------	---------------

§ 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

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

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

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

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

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、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人没有受到监管部门的稽查或处罚，亦未收到关于基金管理人的高级管理人员受到监管部门的稽查或处罚的书面通知或文件。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国投证券	4	296,920,809.26	100.00%	29,666.04	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	6,135.72	100.00%	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	招商基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-01-02
2	关于警惕冒用招商基金管理有限公司名义进行诈骗活动的特别提示公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会	2025-01-14

		会基金电子披露网站	
3	招商基金管理有限公司旗下部分基金增加爱建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	2025-01-21
4	招商基金管理有限公司旗下基金 2024 年第 4 季度报告提示性公告	上海证券报及基金管理人网站	2025-01-21
5	招商中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金 2024 年第 4 季度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-01-21
6	关于招商中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金增加国盛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	2025-02-14
7	招商基金管理有限公司关于招融资本私募股权基金管理（深圳）有限责任公司股东变更的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-08
8	招商基金管理有限公司旗下部分基金增加东方证券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	2025-03-13
9	招商基金管理有限公司旗下基金 2024 年年度报告提示性公告	上海证券报及基金管理人网站	2025-03-28
10	招商中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金 2024 年年度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-28
11	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（二零二五年第一号）	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-28
12	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	2025-03-28
13	招商基金管理有限公司关于运用固有资金投资旗下公募基金的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-04-08
14	招商中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金溢价风险提示公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-04-08
15	招商基金管理有限公司旗下基金 2025 年第 1 季度报告提示性公告	上海证券报及基金管理人网站	2025-04-21
16	招商中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-04-21
17	关于招商中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理变更的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-04-23
18	招商基金管理有限公司旗下部分基金增加湘财	上海证券报、基金管	2025-04-25

	证券股份有限公司为场内申购赎回代办券商的公告	理人网站及中国证监会基金电子披露网站	
19	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（二零二五年第二号）	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-04-28
20	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	2025-04-28
21	招商基金管理有限公司关于提醒投资者持续完善身份信息资料的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-05-09
22	招商基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-05-20
23	招商基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-05-30
24	招商基金管理有限公司旗下部分基金增加东吴证券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	2025-06-16
25	招商基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-06-19
26	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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-06-26
27	招商基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-06-27

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准设立招商基金管理有限公司的文件；
- 2、中国证券监督管理委员会批准招商中证 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。

11.2 存放地点

招商基金管理有限公司

地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

11.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人招商基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-887-9555

网址：<http://www.cmfcchina.com>

招商基金管理有限公司

2025 年 8 月 28 日