

招商沪深 300 指数增强型证券投资基金 2023 年中期报告

2023 年 06 月 30 日

基金管理人：招商基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 30 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 29 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 2023 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.....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	13
§5 托管人报告.....	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	15
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
§7 投资组合报告.....	42
7.1 期末基金资产组合情况.....	42
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	42
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.....	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	54
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.....	54
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.....	54
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.....	54
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.....	55
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	55

7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	55
7.12	投资组合报告附注.....	55
§8	基金份额持有人信息.....	56
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	56
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	57
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.....	57
§9	开放式基金份额变动.....	57
§10	重大事件揭示.....	58
10.1	基金份额持有人大会决议.....	58
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.....	58
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	58
10.4	基金投资策略的改变.....	58
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	58
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.....	58
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	58
10.8	其他重大事件.....	62
§11	备查文件目录.....	63
11.1	备查文件目录.....	63
11.2	存放地点.....	63
11.3	查阅方式.....	63

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	招商沪深 300 指数增强型证券投资基金	
基金简称	招商沪深 300 指数增强	
基金主代码	004190	
交易代码	004190	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 2 月 10 日	
基金管理人	招商基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	361,872,048.79 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	招商沪深 300 指数增强 A	招商沪深 300 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	004190	004191
报告期末下属分级基金的份 额总额	196,953,764.34 份	164,918,284.45 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型股票指数基金，通过数量化的投资方法与严格的投资纪律约束，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%，同时力求实现超越标的指数的业绩表现，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金为增强型指数产品，在标的指数成份股权重的基础上根据量化模型对行业配置及个股权重等进行主动调整，力争在控制跟踪误差的基础上获取超越标的指数的投资收益。具体包括： 1、股票投资策略； 2、债券投资策略； 3、股指期货投资策略； 4、国债期货投资策略； 5、权证投资策略； 6、资产支持证券投资策略； 7、融资及转融通证券出借业务投资策略； 8、存托凭证投资策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，属于较高风险、较高预期收益的基金品种，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	招商基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	潘西里
	联系电话	0755-83196666
	电子邮箱	cmf@cmfchina.com
客户服务电话	400-887-9555	95566
传真	0755-83196475	010-66594942
注册地址	深圳市福田区深南大道 7088 号	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址	深圳市福田区深南大道 7088 号	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	518040	100818
法定代表人	王小青	葛海蛟

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
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	招商基金管理有限公司	深圳市福田区深南大道 7088 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

1、招商沪深 300 指数增强 A

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日 - 2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	2,650,967.27
本期利润	1,783,329.69
加权平均基金份额本期利润	0.0092
本期加权平均净值利润率	0.62%
本期基金份额净值增长率	0.92%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	89,527,654.26
期末可供分配基金份额利润	0.4546
期末基金资产净值	286,481,418.60
期末基金份额净值	1.4546

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	45.46%

2、招商沪深 300 指数增强 C

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日 - 2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	3,084,255.76
本期利润	3,786,922.98
加权平均基金份额本期利润	0.0192
本期加权平均净值利润率	1.32%
本期基金份额净值增长率	0.72%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	69,560,832.48
期末可供分配基金份额利润	0.4218
期末基金资产净值	234,479,116.93
期末基金份额净值	1.4218
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	42.18%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

招商沪深 300 指数增强 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.31%	0.82%	1.10%	0.83%	1.21%	-0.01%
过去三个月	-2.85%	0.76%	-4.88%	0.79%	2.03%	-0.03%
过去六个月	0.92%	0.77%	-0.69%	0.80%	1.61%	-0.03%
过去一年	-12.71%	0.92%	-13.60%	0.94%	0.89%	-0.02%
过去三年	5.22%	1.15%	-7.07%	1.14%	12.29%	0.01%
自基金合同生效起至今	45.46%	1.15%	13.17%	1.14%	32.29%	0.01%

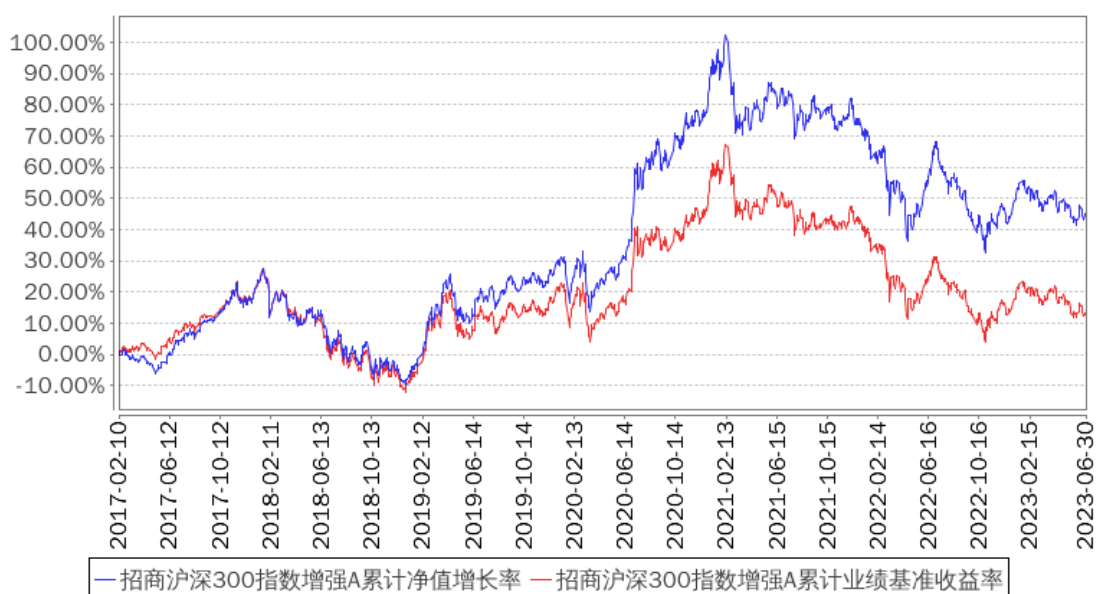
招商沪深 300 指数增强 C

阶段	份额净值	份额净值	业绩比较	业绩比较基	①-③	②-④
----	------	------	------	-------	-----	-----

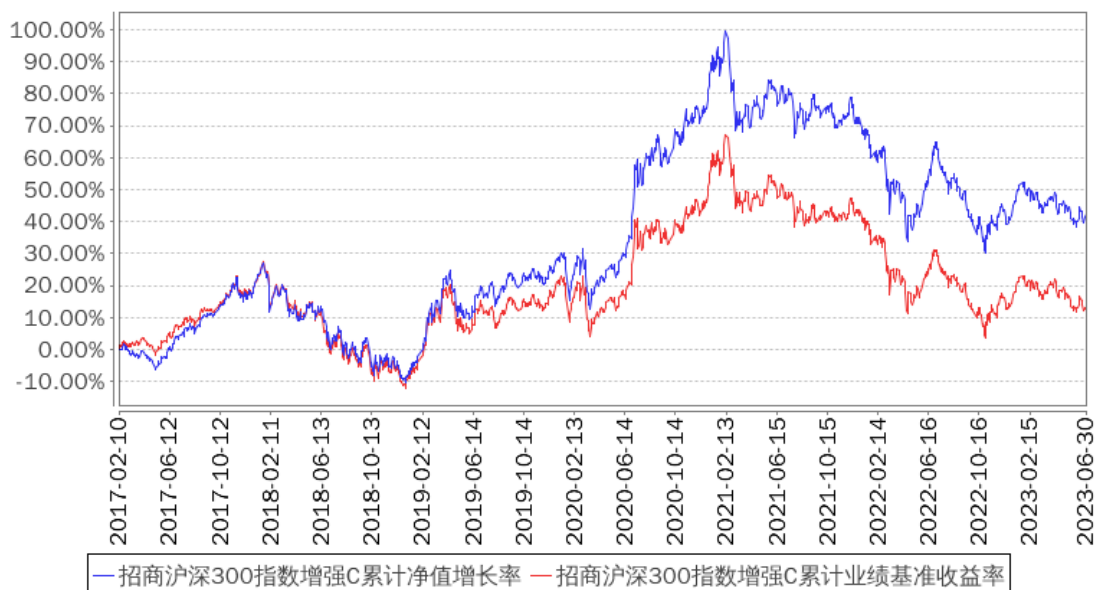
	增长率①	增长率标准 差②	基准收益 率③	准收益率标 准差④		
过去一个月	2.28%	0.82%	1.10%	0.83%	1.18%	-0.01%
过去三个月	-2.95%	0.76%	-4.88%	0.79%	1.93%	-0.03%
过去六个月	0.72%	0.77%	-0.69%	0.80%	1.41%	-0.03%
过去一年	-13.06%	0.92%	-13.60%	0.94%	0.54%	-0.02%
过去三年	3.96%	1.15%	-7.07%	1.14%	11.03%	0.01%
自基金合同 生效起至今	42.18%	1.15%	13.17%	1.14%	29.01%	0.01%

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

招商沪深300指数增强A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



招商沪深300指数增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

招商基金管理有限公司于 2002 年 12 月 27 日经中国证监会【2002】100 号文批准设立。目前，公司注册资本为人民币 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首批获得企业年金基金投资管理人资格、基本养老保险基金投资管理人资格；2004 年获得全国社保基金投资管理人资格；同时拥有合格境内机构投资者（QDII）业务资格、专户理财（特定客户资产管理业务）资格、公募基金投顾业务资格，在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、海外投资、FOF 投资等领域全面布局。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王平	本基金基金经理	2017 年 2 月 10 日	-	17	男，管理学硕士，FRM。2006 年加入招商基金管理有限公司，曾任投资风险管理部助理数量分析师、风险管理部数量分析师、高级风控经理，主要负责公司投资风险管理、金融工程研究等工作，曾任招商深证 100 指数证券投资基金、

				<p>上证消费 80 交易型开放式指数证券投资基金、招商上证消费 80 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、深证电子信息传媒产业(TMT)50 交易型开放式指数证券投资基金、招商深证电子信息传媒产业(TMT)50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、招商中证大宗商品股票指数证券投资基金 (LOF)、招商央视财经 50 指数证券投资基金、招商中证煤炭等权指数分级证券投资基金、招商中证银行指数分级证券投资基金、招商国证生物医药指数分级证券投资基金、招商中证白酒指数分级证券投资基金、招商稳荣定期开放灵活配置混合型证券投资基金、招商财经大数据策略股票型证券投资基金、招商盛合灵活配置混合型证券投资基金、招商沪深 300 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、招商中证银行 AH 价格优选交易型开放式指数证券投资基金基金经理，现任量化投资部副总监兼招商量化精选股票型发起式证券投资基金、招商沪深 300 指数增强型证券投资基金、招商中证 1000 指数增强型证券投资基金、招商中证 500 指数增强型证券投资基金、招商中证红利交易型开放式指数证券投资基金、招商中证 500 等权重指数增强型证券投资基金、招商中证光伏产业指数型证券投资基金、招商中证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金、招商中证 800 指数增强型证券投资基金、招商中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、招商中证银行 AH 价格优选交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理。</p>	
王岩	本基金基金经理	2021 年 3 月 26 日	-	8	<p>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 高贝塔指</p>

					数证券投资基金基金经理，现任招商沪深 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基金经理。
--	--	--	--	--	---

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，本基金各项交易均严格按照相关法律法规、基金合同的有关要求执行，公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 18 次，其中 14 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，4 次为不同基金经理管理的基金因投资策略不同而发生的反向交易。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，沪深 300 指数波动区间并不宽，年初上行趋势并未延续，高位走势回落，整体表现弱势走低，基本反映了目前中国整体宏观经济变化的节奏。就宏观数据而言，2 季度的整体表现并不理想，规模以上企业利润依然承压，出口压力也依然存在。

尽管年初市场对于 2023 年政策的持续和盈利复苏改善的预期较强，但情况并不及预期。就市场细分行业而言，汽车、通信整体环境良性变化的格局在资本市场已经有所反应。前期市场关注的中特估及人工智能在 2 季度走势开始分化，也逐步进入逻辑去伪存真与个股业绩观察的阶段，预期未来同涨同跌的局面会更少。风格方面，小盘、微盘股依然相对强势，但是差别已经明显弱化且考虑到能观察到的企业盈利和弹性方面小盘股优势不在，下半年小盘股再出现明显强势走势的概率有所降低，沪深 300 为代表的大盘股性价比进一步凸显。

当前货币政策的边际变化依然较为良性温和，市场对下半年政策的再发力及政府债务规模的扩张依然有所期待，考虑到当前市场调整的幅度，目前沪深 300 指数的配置价值明显提升。

上半年 GDP 的增速并不算理想，且低于大部分机构预期，在当前的弱增长格局下半年虽然政策发力依然有所期待，但具体效果以及全球经济变化的节奏都可能对企业盈利的增长构成扰动，当前权益市场的状态可以从估值维度考虑选择合适的投资方向与标的。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金 A 类份额净值增长率为 0.92%，同期业绩基准增长率为-0.69%，C 类份额净值增长率为 0.72%，同期业绩基准增长率为-0.69%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，权益市场当前的低点可能演化为走势筑底后阶段性反弹的格局，主题投资可能会有所淡化，对财报数据可以验证业绩的行业及个股可能有所表现。

策略端方面，产品在紧跟沪深 300 指数的背景下选择稳健均衡的风格搭配，主要以平衡风格为主，不进行风格暴露以期对产品争取更优的超额收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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制度》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。截止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

根据相关法律法规的规定和基金合同的约定，以及本基金的实际运作情况，本基金报告期末未进行利润分配。在符合分红条件的前提下，本基金已实现尚未分配的可供分配收益部分，将严格按照基金合同的约定适时向投资者予以分配。

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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在招商沪深 300 指数增强型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责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地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、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 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	14,691,073.04	25,855,657.30

结算备付金		1,445,563.21	2,692,497.29
存出保证金		188,231.11	315,863.24
交易性金融资产	6.4.7.2	506,568,566.79	540,704,914.78
其中：股票投资		491,205,344.29	523,049,023.96
基金投资		-	-
债券投资		15,363,222.50	17,655,890.82
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		319,707.00	666,118.24
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	332.94	71.42
资产总计		523,213,474.09	570,235,122.27
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 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		1,214,585.83	11,346,043.02
应付赎回款		127,337.70	154,877.09
应付管理人报酬		509,709.73	548,903.92
应付托管费		63,713.74	68,612.99
应付销售服务费		76,712.50	90,230.72
应付投资顾问费		-	-
应交税费		117.15	29.51
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	260,761.91	374,082.03
负债合计		2,252,938.56	12,582,779.28
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	361,872,048.79	391,017,259.04
其他综合收益		-	-

未分配利润	6.4.7.8	159,088,486.74	166,635,083.95
净资产合计		520,960,535.53	557,652,342.99
负债和净资产总计		523,213,474.09	570,235,122.27

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，招商沪深 300 指数增强 A 份额净值 1.4546 元，基金份额总额 196,953,764.34 份；招商沪深 300 指数增强 C 份额净值 1.4218 元，基金份额总额 164,918,284.45 份；总份额合计 361,872,048.79 份。

6.2 利润表

会计主体：招商沪深 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		10,170,238.19	-11,463,793.78
1.利息收入		43,701.72	53,219.59
其中：存款利息收入	6.4.7.9	38,148.50	51,047.80
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		-	-
证券出借利息收入		5,553.22	2,171.79
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		10,094,853.69	-39,780,459.19
其中：股票投资收益	6.4.7.10	4,044,080.54	-44,194,354.64
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	244,560.95	348,628.94
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	45,032.10	161,657.31
股利收益	6.4.7.15	5,761,180.10	3,903,609.20
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	-164,970.36	28,158,383.87
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	196,653.14	105,061.95
减：二、营业总支出		4,599,985.52	3,529,154.44
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	3,415,615.61	2,684,551.63
2.托管费	6.4.10.2.2	426,951.99	335,568.93
3.销售服务费	6.4.10.2.3	568,896.76	312,220.98
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		523.24	592.80
8.其他费用	6.4.7.19	187,997.92	196,220.10
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		5,570,252.67	-14,992,948.22
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		5,570,252.67	-14,992,948.22
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		5,570,252.67	-14,992,948.22

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：招商沪深 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 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（基金净值）	391,017,259.04	-	166,635,083.95	557,652,342.99
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	391,017,259.04	-	166,635,083.95	557,652,342.99
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-29,145,210.25	-	-7,546,597.21	-36,691,807.46
（一）、综合收益总额	-	-	5,570,252.67	5,570,252.67
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-29,145,210.25	-	-13,116,849.88	-42,262,060.13
其中：1.基金申购款	125,144,426.28	-	60,456,210.13	185,600,636.41
2.基金赎回款	-154,289,636.53	-	-73,573,060.01	-227,862,696.54
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	361,872,048.79	-	159,088,486.74	520,960,535.53

项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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（基金净值）	249,950,110.88	-	185,665,851.72	435,615,962.60
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	249,950,110.88	-	185,665,851.72	435,615,962.60
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	68,812,885.26	-	23,550,961.33	92,363,846.59
（一）、综合收益总额	-	-	-14,992,948.22	-14,992,948.22
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	68,812,885.26	-	38,543,909.55	107,356,794.81
其中：1.基金申购款	117,225,506.28	-	64,494,595.32	181,720,101.60
2.基金赎回款	-48,412,621.02	-	-25,950,685.77	-74,363,306.79
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	318,762,996.14	-	209,216,813.05	527,979,809.19

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：

_____ 徐勇 _____ 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 指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人招商基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《招商沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关法律法规的规定,经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]3125 号文准予公开募集注册。本基金为契约型开放式基金,存续期限为不定期。本基金根据是否收取销售服务费,将基金份额分为 A 类基金份额和 C 类基金份额。本基金首次设立募集基金份额为 200,058,189.86 份,经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了编号为德师报(验)字(17)第

00013 号验资报告。基金合同于 2017 年 2 月 10 日正式生效。本基金的基金管理人为招商基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及截至报告期末最新公告的《招商沪深 300 指数增强型证券投资基金更新的招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票和存托凭证(包括主板、中小板、创业板和其他经中国证监会核准上市的股票和存托凭证)、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转债(含可分离交易可转换债)、可交换债、次级债、短期融资券、中期票据等)、债券回购、同业存单、银行存款、货币市场工具、资产支持证券、权证、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。本基金的投资组合为：投资于股票、存托凭证资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于沪深 300 指数成份股及其备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；本基金每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数收益率 $\times 95\%$ +同期银行活期存款利率(税后) $\times 5\%$ 。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)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 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

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[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[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》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运营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、红利收入，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。

(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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	14,691,073.04
等于：本金	14,689,876.10
加：应计利息	1,196.94
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	14,691,073.04

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	517,533,136.33	-	491,205,344.29	-26,327,792.04	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	15,109,504.00	262,332.50	15,363,222.50	-8,614.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	15,109,504.00	262,332.50	15,363,222.50	-8,614.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	532,642,640.33	262,332.50	506,568,566.79	-26,336,406.04	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			备注
	合同/名义金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-

货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	1,141,800.00	-	-	-
其中：股指期货投资	1,141,800.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	1,141,800.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IF2307	IF2307	1.00	1,149,120.00	7,320.00
合计				7,320.00
减：可抵销期货暂收款				7,320.00
净额				-

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

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	332.94
待摊费用	-
合计	332.94

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	28.86
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	136,993.97
其中：交易所市场	136,993.97
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	73,739.08
应付指数使用费	50,000.00
合计	260,761.91

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

招商沪深 300 指数增强 A		
项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	190,031,898.46	190,031,898.46
本期申购	65,416,509.60	65,416,509.60
本期赎回（以“-”号填列）	-58,494,643.72	-58,494,643.72
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	196,953,764.34	196,953,764.34

招商沪深 300 指数增强 C		
项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	200,985,360.58	200,985,360.58
本期申购	59,727,916.68	59,727,916.68
本期赎回（以“-”号填列）	-95,794,992.81	-95,794,992.81
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	164,918,284.45	164,918,284.45

注：本期申购含红利再投、转换入份（金）额，本期赎回含转换出份（金）额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

招商沪深 300 指数增强 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	107,196,703.04	-23,313,756.84	83,882,946.20
本期利润	2,650,967.27	-867,637.58	1,783,329.69
本期基金份额交易产生的变动数	4,006,717.91	-145,339.54	3,861,378.37
其中：基金申购款	37,433,321.28	-3,957,001.62	33,476,319.66
基金赎回款	-33,426,603.37	3,811,662.08	-29,614,941.29
本期已分配利润	-	-	-
本期末	113,854,388.22	-24,326,733.96	89,527,654.26

招商沪深 300 指数增强 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	106,992,462.27	-24,240,324.52	82,752,137.75
本期利润	3,084,255.76	702,667.22	3,786,922.98
本期基金份额交易产生的变动数	-20,502,371.09	3,524,142.84	-16,978,228.25
其中：基金申购款	32,305,528.68	-5,325,638.21	26,979,890.47
基金赎回款	-52,807,899.77	8,849,781.05	-43,958,118.72

本期已分配利润	-	-	-
本期末	89,574,346.94	-20,013,514.46	69,560,832.48

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
活期存款利息收入			21,599.09
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			15,989.06
其他			560.35
合计			38,148.50

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
股票投资收益——买卖股票差价收入		4,044,080.54
股票投资收益——赎回差价收入		-
股票投资收益——申购差价收入		-
股票投资收益——证券出借差价收入		-
合计		4,044,080.54

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
卖出股票成交总额		1,012,235,436.69
减：卖出股票成本总额		1,006,761,144.38
减：交易费用		1,430,211.77
买卖股票差价收入		4,044,080.54

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无股票赎回差价收入。

6.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无股票申购差价收入。

6.4.7.10.5 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内无证券出借差价收入。

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	182,170.40
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	62,390.55
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	244,560.95

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	15,699,322.53
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	15,341,167.48
减：应计利息总额	295,752.29
减：交易费用	12.21
买卖债券差价收入	62,390.55

6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券申购差价收入。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益**6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成**

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内无买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.12.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券赎回差价收入。

6.4.7.12.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券申购差价收入。

6.4.7.13 贵金属投资收益**6.4.7.13.1 贵金属投资收益项目构成**

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.13.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

6.4.7.13.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无贵金属赎回差价收入。

6.4.7.13.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无贵金属申购差价收入。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具买卖权证差价收入。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	45,032.10

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	5,761,180.10
其中：证券出借权益补偿收入	11,200.00
基金投资产生的股利收益	-
合计	5,761,180.10

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-220,010.36
——股票投资	-257,896.36
——债券投资	37,886.00
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	55,040.00
——权证投资	-
——期货投资	55,040.00
3.其他	-

减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-164,970.36

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	196,653.14
合计	196,653.14

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	14,231.71
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	5,258.84
指数使用费	100,000.00
其他	9,000.00
合计	187,997.92

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

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

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,415,615.61	2,684,551.63
其中：支付销售机构的客户维护费	1,050,175.52	852,257.49
支付投资顾问的投资顾问费	-	-

注：支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值×1.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	426,951.99	335,568.93

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

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.15%÷当年天数

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	招商沪深 300 指数增强 A	招商沪深 300 指数增强 C	合计
招商基金管理有限公司	-	131,116.25	131,116.25
招商银行	-	181,159.44	181,159.44
招商证券	-	4.43	4.43
中国银行	-	8,509.30	8,509.30
合计	-	320,789.42	320,789.42
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	招商沪深 300 指数增强 A	招商沪深 300 指数增强 C	合计
招商基金管理有限公司	-	38,347.41	38,347.41
招商银行	-	165,743.82	165,743.82
招商证券	-	-	-
中国银行	-	7,234.98	7,234.98
合计	-	211,326.21	211,326.21

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

其计算公式为：

C 类份额日销售服务费=前一日 C 类基金资产净值×0.40%÷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

本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
招商证券	-	-	-	-

上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额

招商证券	1,084,200.00	716.78	1,366,790.00	-
------	--------------	--------	--------------	---

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行-活期	14,691,073.04	21,599.09	31,879,382.92	39,159.70

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

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
招商证券	301305	朗坤环境	新股获配	7,523	189,955.75
招商证券	301428	世纪恒通	新股获配	2,289	60,315.15

上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
招商证券	001323	慕思股份	网下申购	573	22,306.89
招商证券	301123	奕东电子	网下申购	4,003	149,031.69
招商证券	700030	中信配股	配股	47,547	686,103.21
中银国际证券	764838	成银配债	可转债配售	80	7,999.96

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 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有招商银行(600036)(2022 年 6 月 30 日：持有 395,600 股，市值为人民币 16,694,320.00 元，占本基金资产净值的比例为 3.16%)。

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（2023 年 06 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
001282	三联锻造	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	-
001286	陕西能源	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
001287	中电港	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股流通受限	11.88	21.02	900	10,692.00	18,918.00	-
001324	长青科技	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股流通受限	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-
001328	登康口腔	2023 年 3 月 29 日	6 个月	新股流通受限	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-
001360	南矿集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	-
001367	海森药业	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股流通受限	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
001380	华纬科技	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新股流通受限	28.84	30.78	170	4,902.80	5,232.60	-
300804	广康生化	2023 年 6 月 15 日	6 个月	新股流通受限	42.45	32.97	226	9,593.70	7,451.22	-

301141	中科磁业	2023 年 3 月 27 日	6 个月	新股流通 受限	41.20	42.69	262	10,794.40	11,184.78	-
301157	华塑科技	2023 年 3 月 1 日	6 个月	新股流通 受限	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-
301170	锡南科技	2023 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通 受限	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	-
301202	朗威股份	2023 年 6 月 28 日	6 个月	新股流通 受限	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	-
301202	朗威股份	2023 年 6 月 28 日	1 个月 内(含)	新股流通 受限	25.82	25.82	2,754	71,108.28	71,108.28	-
301203	国泰环保	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股流通 受限	46.13	34.40	225	10,379.25	7,740.00	-
301232	飞沃科技	2023 年 6 月 8 日	6 个月	新股流通 受限	72.50	58.42	165	11,962.50	9,639.30	-
301246	宏源药业	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新股流通 受限	50.00	30.71	745	37,250.00	22,878.95	-
301261	恒工精密	2023 年 6 月 29 日	6 个月	新股流通 受限	36.90	36.90	198	7,306.20	7,306.20	-
301261	恒工精密	2023 年 6 月 29 日	1 个月 内(含)	新股流通 受限	36.90	36.90	1,775	65,497.50	65,497.50	-
301292	海科新源	2023 年 6 月 29 日	6 个月	新股流通 受限	19.99	19.99	583	11,654.17	11,654.17	-
301292	海科新源	2023 年 6 月 29 日	1 个月 内(含)	新股流通 受限	19.99	19.99	5,241	104,767.59	104,767.59	-
301293	三博脑科	2023 年 4 月 25 日	6 个月	新股流通 受限	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-
301295	美硕科技	2023 年 6 月 19 日	6 个月	新股流通 受限	37.40	36.07	215	8,041.00	7,755.05	-
301301	川宁生物	2022 年 12 月 20	6 个月	新股流通 受限	5.00	8.96	3,574	17,870.00	32,023.04	-

		日								
301305	朗坤环境	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通 受限	25.25	19.69	753	19,013.25	14,826.57	-
301315	威士顿	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新股流通 受限	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-
301320	豪江智能	2023 年 6 月 1 日	6 个月	新股流通 受限	13.06	20.62	642	8,384.52	13,238.04	-
301322	绿通科技	2023 年 2 月 27 日	6 个月	新股流通 受限	131.11	53.24	303	26,484.22	16,131.72	-
301323	新莱福	2023 年 5 月 29 日	6 个月	新股流通 受限	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08	-
301325	曼恩斯特	2023 年 5 月 4 日	6 个月	新股流通 受限	76.80	107.95	264	20,275.20	28,498.80	-
301332	德尔玛	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新股流通 受限	14.81	13.73	1,122	16,616.82	15,405.06	-
301337	亚华电子	2023 年 5 月 16 日	6 个月	新股流通 受限	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-
301345	涛涛车业	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新股流通 受限	73.45	46.64	249	18,289.05	11,613.36	-
301355	南王科技	2023 年 6 月 2 日	6 个月	新股流通 受限	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	-
301357	北方长龙	2023 年 4 月 11 日	6 个月	新股流通 受限	50.00	48.39	190	9,500.00	9,194.10	-
301358	湖南裕能	2023 年 2 月 1 日	6 个月	新股流通 受限	23.77	42.89	737	17,518.49	31,609.93	-
301360	荣旗科技	2023 年 4 月 17 日	6 个月	新股流通 受限	71.88	92.60	134	9,631.92	12,408.40	-
301373	凌玮科技	2023 年 1 月 20 日	6 个月	新股流通 受限	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45	-
301376	致欧科技	2023 年	6 个月	新股流通	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	-

		6月14日		受限							
301386	未来电器	2023年3月21日	6个月	新股流通受限	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62	-	
301408	华人健康	2023年2月22日	6个月	新股流通受限	16.24	16.95	879	14,274.96	14,899.05	-	
301419	阿莱德	2023年2月2日	6个月	新股流通受限	24.80	43.85	330	8,184.00	14,470.50	-	
301428	世纪恒通	2023年5月10日	6个月	新股流通受限	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-	
301439	泓淋电力	2023年3月10日	6个月	新股流通受限	19.99	16.90	902	18,030.98	15,243.80	-	
301486	致尚科技	2023年6月30日	6个月	新股流通受限	57.66	57.66	377	21,737.82	21,737.82	-	
301486	致尚科技	2023年6月30日	1个月内(含)	新股流通受限	57.66	57.66	3,392	195,582.72	195,582.72	-	
301488	豪恩汽电	2023年6月26日	6个月	新股流通受限	39.78	39.78	262	10,422.36	10,422.36	-	
301488	豪恩汽电	2023年6月26日	1个月内(含)	新股流通受限	39.78	39.78	2,356	93,721.68	93,721.68	-	
601061	中信金属	2023年3月30日	6个月	新股流通受限	6.58	7.58	1,962	12,909.96	14,871.96	-	
601065	江盐集团	2023年3月31日	6个月	新股流通受限	10.36	11.84	748	7,749.28	8,856.32	-	
601133	柏诚股份	2023年3月31日	6个月	新股流通受限	11.66	12.26	664	7,742.24	8,140.64	-	
603125	常青科技	2023年3月30日	6个月	新股流通受限	25.98	24.53	160	4,156.80	3,924.80	-	
603137	恒尚节能	2023年4月10日	6个月	新股流通受限	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51	-	

603172	万丰股份	2023 年 4 月 28 日	6 个月	新股流通 受限	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-
688146	中船特气	2023 年 4 月 13 日	6 个月	新股流通 受限	36.15	38.13	593	21,436.95	22,611.09	-
688249	晶合集成	2023 年 4 月 24 日	6 个月	新股流通 受限	19.86	18.06	3,419	67,901.34	61,747.14	-
688334	西高院	2023 年 6 月 9 日	6 个月	新股流通 受限	14.16	16.21	888	12,574.08	14,394.48	-
688352	颀中科技	2023 年 4 月 11 日	6 个月	新股流通 受限	12.10	12.07	1,759	21,283.90	21,231.13	-
688361	中科飞测	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股流通 受限	23.60	64.67	512	12,083.20	33,111.04	-
688429	时创能源	2023 年 6 月 20 日	6 个月	新股流通 受限	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-
688433	华曙高科	2023 年 4 月 7 日	6 个月	新股流通 受限	26.66	31.50	418	11,143.88	13,167.00	-
688458	美芯晟	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通 受限	75.00	90.76	214	16,050.00	19,422.64	-
688469	中芯集成	2023 年 4 月 28 日	6 个月	新股流通 受限	5.69	5.41	5,693	32,393.17	30,799.13	-
688472	阿特斯	2023 年 6 月 2 日	6 个月	新股流通 受限	11.10	17.04	2,226	24,708.60	37,931.04	-
688478	晶升股份	2023 年 4 月 13 日	6 个月	新股流通 受限	32.52	42.37	402	13,073.04	17,032.74	-
688479	友车科技	2023 年 5 月 4 日	6 个月	新股流通 受限	33.99	29.49	332	11,284.68	9,790.68	-
688507	索辰科技	2023 年 4 月 10 日	6 个月	新股流通 受限	245.56	122.11	164	27,257.16	20,026.04	-
688512	慧智微	2023 年 5 月 8 日	6 个月	新股流通 受限	20.92	19.16	721	15,083.32	13,814.36	-

		日								
688523	航天环宇	2023 年 5 月 26 日	6 个月	新股流通 受限	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20	-
688531	日联科技	2023 年 3 月 24 日	6 个月	新股流通 受限	152.38	135.97	208	31,695.04	28,281.76	-
688535	华海诚科	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股流通 受限	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-
688543	国科军工	2023 年 6 月 14 日	6 个月	新股流通 受限	43.67	53.05	369	16,114.23	19,575.45	-
688562	航天软件	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通 受限	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06	-
688570	天玛智控	2023 年 5 月 29 日	6 个月	新股流通 受限	30.26	25.33	627	18,973.02	15,881.91	-
688581	安杰思	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股流通 受限	125.80	118.03	139	17,486.20	16,406.17	-
688582	芯动联科	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新股流通 受限	26.74	40.68	573	15,322.02	23,309.64	-
688593	新相微	2023 年 5 月 25 日	6 个月	新股流通 受限	11.18	14.59	959	10,721.62	13,991.81	-
688603	天承科技	2023 年 6 月 30 日	6 个月	新股流通 受限	55.00	55.00	140	7,700.00	7,700.00	-
688603	天承科技	2023 年 6 月 30 日	1 个月 内(含)	新股流通 受限	55.00	55.00	1,251	68,805.00	68,805.00	-
688620	安凯微	2023 年 6 月 15 日	6 个月	新股流通 受限	10.68	12.34	1,016	10,850.88	12,537.44	-
688623	双元科技	2023 年 5 月 31 日	6 个月	新股流通 受限	125.88	86.79	143	18,000.84	12,410.97	-
688629	华丰科技	2023 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通 受限	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	-
688631	莱斯信息	2023 年	6 个月	新股流通	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	-

		6 月 19 日		受限						
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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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
000691	亚太实业	2023 年 6 月 27 日	重大事项停牌	4.36	2023 年 7 月 4 日	4.80	372,500	1,510,711.00	1,624,100.00	-

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

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值单价	数量（单位：股）	期末估值总额
1	000063	中兴通讯	2023 年 7 月 4 日	45.54	30,000.00	1,366,200.00
合计	-	-	-	-	30,000.00	1,366,200.00

出借证券中如有其他流通受限的情况详见本报告“本基金持有的流通受限证券”部分内容。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金是股票型基金，本基金的运作涉及的金融工具主要包括股票投资（主要是指成份股、备选成份股）、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。

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，并按照合同约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 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	14,691,073.04	-	-	-	14,691,073.04
结算备付金	1,445,563.21	-	-	-	1,445,563.21

存出保证金	50,336.71	-	-	137,894.40	188,231.11
交易性金融资产	15,363,222.50	-	-	491,205,344.29	506,568,566.79
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	-	-	-	319,707.00	319,707.00
应收清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	332.94	332.94
资产总计	31,550,195.46	-	-	491,663,278.63	523,213,474.09
负债					
应付赎回款	-	-	-	127,337.70	127,337.70
应付管理人报酬	-	-	-	509,709.73	509,709.73
应付托管费	-	-	-	63,713.74	63,713.74
应付清算款	-	-	-	1,214,585.83	1,214,585.83
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	76,712.50	76,712.50
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	117.15	117.15
其他负债	-	-	-	260,761.91	260,761.91
负债总计	-	-	-	2,252,938.56	2,252,938.56
利率敏感度缺口	31,550,195.46	-	-	489,410,340.07	520,960,535.53
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	25,855,657.30	-	-	-	25,855,657.30
结算备付金	2,692,497.29	-	-	-	2,692,497.29
存出保证金	36,071.24	-	-	279,792.00	315,863.24
交易性金融资产	17,655,890.82	-	-	523,049,023.96	540,704,914.78
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	-	-	-	666,118.24	666,118.24
应收清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	71.42	71.42
资产总计	46,240,116.65	-	-	523,995,005.62	570,235,122.27
负债					
应付赎回款	-	-	-	154,877.09	154,877.09

应付管理人报酬	-	-	-	548,903.92	548,903.92
应付托管费	-	-	-	68,612.99	68,612.99
应付清算款	-	-	-	11,346,043.02	11,346,043.02
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	90,230.72	90,230.72
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	29.51	29.51
其他负债	-	-	-	374,082.03	374,082.03
负债总计	-	-	-	12,582,779.28	12,582,779.28
利率敏感度缺口	46,240,116.65	-	-	511,412,226.34	557,652,342.99

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1.若市场利率平行上升或下降 50 个基点		
	2.其他市场变量保持不变		
	3.仅存在公允价值变动对基金资产净值的影响		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	1. 市场利率平行上升 50 个基点	-6,095.51	-39,963.06
	2. 市场利率平行下降 50 个基点	6,115.13	40,108.75

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，也有可能与其他投资品种相关。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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	491,205,344.29	94.29	523,049,023.96	93.79

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	491,205,344.29	94.29	523,049,023.96	93.79

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（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	1. 权益性投资的市场价格上升 5%	24,560,267.21	26,152,451.20
	2. 权益性投资的市场价格下降 5%	-24,560,267.21	-26,152,451.20

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 2023 年 6 月 30 日
第一层次	487,899,972.08
第二层次	17,653,526.74
第三层次	1,015,067.97
合计	506,568,566.79

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（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	491,205,344.29	93.88
	其中：股票	491,205,344.29	93.88
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	15,363,222.50	2.94
	其中：债券	15,363,222.50	2.94
	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	16,136,636.25	3.08
8	其他资产	508,271.05	0.10
9	合计	523,213,474.09	100.00

注：本基金本报告期末融出证券市值为 1,366,200.00 元，占净值比例 0.26%。

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	783,653.60	0.15
B	采矿业	11,287,312.24	2.17
C	制造业	251,173,258.63	48.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,715,119.00	3.21
E	建筑业	16,896,500.35	3.24
F	批发和零售业	6,779.69	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	10,079,848.30	1.93
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,303,911.30	2.94
J	金融业	90,269,951.88	17.33
K	房地产业	246,195.19	0.05
L	租赁和商务服务业	5,301,166.76	1.02
M	科学研究和技术服务业	9,582,231.48	1.84
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	1,104,281.50	0.21
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	428,750,209.92	82.30

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	119,780.00	0.02
B	采矿业	6,824,506.00	1.31
C	制造业	41,426,539.38	7.95
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,982,906.47	0.38
E	建筑业	832,857.15	0.16
F	批发和零售业	2,071,359.21	0.40
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,704,552.61	0.71
J	金融业	2,108,891.94	0.40
K	房地产业	3,232,702.00	0.62
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	14,394.48	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	24,355.57	0.00

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	756.70	0.00
Q	卫生和社会工作	23,782.86	0.00
R	文化、体育和娱乐业	87,750.00	0.02
S	综合	-	-
	合计	62,455,134.37	11.99

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	600519	贵州茅台	19,605	33,152,055.00	6.36
2	300750	宁德时代	96,920	22,174,326.80	4.26
3	601318	中国平安	326,519	15,150,481.60	2.91
4	000858	五粮液	84,623	13,841,784.11	2.66
5	600276	恒瑞医药	257,026	12,311,545.40	2.36
6	000063	中兴通讯	205,400	9,353,916.00	1.80
7	601668	中国建筑	1,628,580	9,348,049.20	1.79
8	601012	隆基绿能	308,392	8,841,598.64	1.70
9	300760	迈瑞医疗	29,200	8,754,160.00	1.68
10	601328	交通银行	1,325,900	7,690,220.00	1.48
11	300274	阳光电源	64,100	7,475,983.00	1.44
12	600016	民生银行	1,970,391	7,388,966.25	1.42
13	603259	药明康德	116,308	7,247,151.48	1.39
14	000333	美的集团	115,460	6,802,903.20	1.31
15	600050	中国联通	1,362,700	6,540,960.00	1.26
16	600760	中航沈飞	144,220	6,489,900.00	1.25
17	600926	杭州银行	545,500	6,409,625.00	1.23
18	002594	比亚迪	24,400	6,301,788.00	1.21
19	601688	华泰证券	423,000	5,824,710.00	1.12
20	000596	古井贡酒	23,400	5,788,692.00	1.11
21	600196	复星医药	172,985	5,345,236.50	1.03
22	600438	通威股份	154,900	5,314,619.00	1.02
23	601838	成都银行	432,800	5,284,488.00	1.01
24	002179	中航光电	106,736	4,840,477.60	0.93
25	600104	上汽集团	335,011	4,747,105.87	0.91

26	600886	国投电力	370,700	4,689,355.00	0.90
27	601166	兴业银行	290,950	4,553,367.50	0.87
28	601766	中国中车	698,600	4,540,900.00	0.87
29	600900	长江电力	197,900	4,365,674.00	0.84
30	300059	东方财富	301,386	4,279,681.20	0.82
31	000568	泸州老窖	19,875	4,165,203.75	0.80
32	601888	中国中免	37,592	4,155,043.76	0.80
33	000725	京东方 A	1,011,600	4,137,444.00	0.79
34	600745	闻泰科技	83,900	4,102,710.00	0.79
35	300014	亿纬锂能	67,400	4,077,700.00	0.78
36	600741	华域汽车	215,012	3,969,121.52	0.76
37	600011	华能国际	410,900	3,804,934.00	0.73
38	601899	紫金矿业	334,100	3,798,717.00	0.73
39	002415	海康威视	113,500	3,757,985.00	0.72
40	600089	特变电工	161,200	3,593,148.00	0.69
41	600029	南方航空	590,800	3,562,524.00	0.68
42	002236	大华股份	179,900	3,553,025.00	0.68
43	600030	中信证券	178,370	3,528,158.60	0.68
44	000776	广发证券	221,805	3,262,751.55	0.63
45	601186	中国铁建	318,969	3,141,844.65	0.60
46	600028	中国石化	490,400	3,118,944.00	0.60
47	002049	紫光国微	31,360	2,924,320.00	0.56
48	000651	格力电器	78,126	2,852,380.26	0.55
49	601336	新华保险	73,800	2,713,626.00	0.52
50	002410	广联达	82,760	2,688,872.40	0.52
51	002371	北方华创	8,300	2,636,495.00	0.51
52	601985	中国核电	344,000	2,425,200.00	0.47
53	300450	先导智能	65,800	2,379,986.00	0.46
54	600887	伊利股份	83,900	2,376,048.00	0.46
55	601398	工商银行	485,000	2,337,700.00	0.45
56	300759	康龙化成	61,000	2,335,080.00	0.45
57	000100	TCL 科技	534,810	2,107,151.40	0.40
58	601225	陕西煤业	115,700	2,104,583.00	0.40
59	600570	恒生电子	47,400	2,099,346.00	0.40
60	600309	万华化学	22,900	2,011,536.00	0.39
61	600837	海通证券	217,400	2,004,428.00	0.38
62	300433	蓝思科技	170,246	2,002,092.96	0.38
63	601601	中国太保	75,465	1,960,580.70	0.38
64	601006	大秦铁路	252,900	1,879,047.00	0.36
65	600362	江西铜业	95,500	1,812,590.00	0.35
66	601669	中国电建	312,500	1,793,750.00	0.34
67	601818	光大银行	571,400	1,754,198.00	0.34
68	002352	顺丰控股	36,770	1,657,959.30	0.32

69	600690	海尔智家	69,999	1,643,576.52	0.32
70	000001	平安银行	145,099	1,629,461.77	0.31
71	601390	中国中铁	214,900	1,628,942.00	0.31
72	601169	北京银行	341,500	1,581,145.00	0.30
73	601288	农业银行	445,700	1,573,321.00	0.30
74	000338	潍柴动力	125,800	1,567,468.00	0.30
75	002180	纳思达	45,000	1,541,250.00	0.30
76	002475	立讯精密	43,812	1,421,699.40	0.27
77	601138	工业富联	51,400	1,295,280.00	0.25
78	688981	中芯国际	25,569	1,291,745.88	0.25
79	300033	同花顺	7,200	1,262,016.00	0.24
80	605499	东鹏饮料	7,200	1,244,880.00	0.24
81	601728	中国电信	218,200	1,228,466.00	0.24
82	000625	长安汽车	91,200	1,179,216.00	0.23
83	002304	洋河股份	8,800	1,155,880.00	0.22
84	002027	分众传媒	168,300	1,146,123.00	0.22
85	600031	三一重工	68,500	1,139,155.00	0.22
86	601877	正泰电器	41,100	1,136,415.00	0.22
87	300454	深信服	10,000	1,132,500.00	0.22
88	002459	晶澳科技	26,604	1,109,386.80	0.21
89	300015	爱尔眼科	59,530	1,104,281.50	0.21
90	002142	宁波银行	43,243	1,094,047.90	0.21
91	600000	浦发银行	150,822	1,091,951.28	0.21
92	300316	晶盛机电	14,800	1,049,320.00	0.20
93	601816	京沪高铁	198,100	1,042,006.00	0.20
94	601021	春秋航空	17,600	1,011,472.00	0.19
95	601939	建设银行	161,500	1,010,990.00	0.19
96	600660	福耀玻璃	27,700	993,045.00	0.19
97	601211	国泰君安	70,100	980,699.00	0.19
98	600019	宝钢股份	172,600	970,012.00	0.19
99	600958	东方证券	98,400	954,480.00	0.18
100	601618	中国中冶	240,000	952,800.00	0.18
101	600061	国投资本	132,500	943,400.00	0.18
102	601658	邮储银行	191,400	935,946.00	0.18
103	300896	爱美客	2,100	934,395.00	0.18
104	601919	中远海控	98,600	926,840.00	0.18
105	600919	江苏银行	123,500	907,725.00	0.17
106	603993	洛阳钼业	170,300	907,699.00	0.17
107	688599	天合光能	21,200	903,332.00	0.17
108	300751	迈为股份	5,320	901,101.60	0.17
109	300142	沃森生物	33,700	891,365.00	0.17
110	605117	德业股份	5,840	873,372.00	0.17
111	002230	科大讯飞	12,800	869,888.00	0.17

112	600025	华能水电	113,900	812,107.00	0.16
113	601100	恒立液压	11,400	733,362.00	0.14
114	600918	中泰证券	105,100	726,241.00	0.14
115	002736	国信证券	80,600	703,638.00	0.14
116	601088	中国神华	22,500	691,875.00	0.13
117	002241	歌尔股份	38,700	686,925.00	0.13
118	000876	新希望	56,600	661,088.00	0.13
119	603288	海天味业	13,843	648,544.55	0.12
120	688012	中微公司	4,000	625,800.00	0.12
121	002601	龙佰集团	37,900	625,350.00	0.12
122	300124	汇川技术	9,645	619,305.45	0.12
123	300957	贝泰妮	6,900	613,272.00	0.12
124	601998	中信银行	101,200	605,176.00	0.12
125	600085	同仁堂	10,500	604,380.00	0.12
126	000425	徐工机械	86,600	586,282.00	0.11
127	600941	中国移动	6,200	578,460.00	0.11
128	601699	潞安环能	30,700	501,024.00	0.10
129	601633	长城汽车	19,800	498,366.00	0.10
130	002714	牧原股份	11,104	468,033.60	0.09
131	000157	中联重科	69,100	466,425.00	0.09
132	601989	中国重工	88,800	428,016.00	0.08
133	600803	新奥股份	19,100	362,518.00	0.07
134	600809	山西汾酒	1,924	356,074.68	0.07
135	000792	盐湖股份	16,500	316,305.00	0.06
136	300498	温氏股份	17,200	315,620.00	0.06
137	003816	中国广核	82,100	255,331.00	0.05
138	000538	云南白药	4,700	246,656.00	0.05
139	300207	欣旺达	12,400	202,368.00	0.04
140	603290	斯达半导	800	172,160.00	0.03
141	600188	兖矿能源	5,497	164,470.24	0.03
142	601360	三六零	11,800	147,972.00	0.03
143	000002	万科 A	9,825	137,746.50	0.03
144	002129	TCL 中环	3,825	126,990.00	0.02
145	601319	中国人保	21,300	124,392.00	0.02
146	600048	保利发展	8,178	106,559.34	0.02
147	601600	中国铝业	14,400	79,056.00	0.02
148	601800	中国交建	2,800	30,548.00	0.01
149	002821	凯莱英	200	23,572.00	0.00
150	600585	海螺水泥	948	22,505.52	0.00
151	603392	万泰生物	194	12,953.38	0.00
152	600845	宝信软件	240	12,194.40	0.00
153	603986	兆易创新	84	8,925.00	0.00
154	300661	圣邦股份	92	7,555.96	0.00

155	002460	赣锋锂业	120	7,315.20	0.00
156	603799	华友钴业	110	5,050.10	0.00
157	002311	海大集团	94	4,402.96	0.00
158	000963	华东医药	100	4,337.00	0.00
159	002271	东方雨虹	141	3,843.66	0.00
160	600406	国电南瑞	120	2,772.00	0.00
161	600588	用友网络	121	2,480.50	0.00
162	601607	上海医药	109	2,442.69	0.00
163	001979	招商蛇口	145	1,889.35	0.00
164	600176	中国巨石	130	1,840.80	0.00
165	601788	光大证券	77	1,223.53	0.00
166	600346	恒力石化	52	745.16	0.00
167	601229	上海银行	100	575.00	0.00
168	600606	绿地控股	206	566.50	0.00
169	600015	华夏银行	100	541.00	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600582	天地科技	820,600	4,784,098.00	0.92
2	300749	顶固集创	367,100	3,373,649.00	0.65
3	600583	海油工程	548,600	3,209,310.00	0.62
4	603161	科华控股	173,200	2,523,524.00	0.48
5	603688	石英股份	17,300	1,969,432.00	0.38
6	600027	华电国际	291,100	1,947,459.00	0.37
7	600153	建发股份	176,700	1,927,797.00	0.37
8	603089	正裕工业	201,100	1,787,779.00	0.34
9	600060	海信视像	71,800	1,777,050.00	0.34
10	000691	亚太实业	372,500	1,624,100.00	0.31
11	002128	电投能源	116,500	1,540,130.00	0.30
12	600271	航天信息	110,000	1,505,900.00	0.29
13	000030	富奥股份	266,800	1,344,672.00	0.26
14	000783	长江证券	224,000	1,299,200.00	0.25
15	600325	华发股份	129,200	1,272,620.00	0.24
16	000589	贵州轮胎	226,600	1,268,960.00	0.24
17	003023	彩虹集团	58,100	1,191,631.00	0.23
18	000921	海信家电	43,500	1,172,325.00	0.23
19	002073	软控股份	175,100	1,159,162.00	0.22
20	002065	东华软件	145,500	1,027,230.00	0.20
21	000623	吉林敖东	54,100	867,764.00	0.17

22	002373	千方科技	61,400	837,496.00	0.16
23	002811	郑中设计	103,700	822,341.00	0.16
24	002966	苏州银行	123,400	808,270.00	0.16
25	002022	科华生物	74,000	784,400.00	0.15
26	002056	横店东磁	42,700	777,567.00	0.15
27	600500	中化国际	139,600	776,176.00	0.15
28	000049	德赛电池	21,800	769,104.00	0.15
29	600185	格力地产	110,900	760,774.00	0.15
30	600663	陆家嘴	76,900	759,003.00	0.15
31	600938	中国海油	41,700	755,604.00	0.15
32	002793	罗欣药业	138,300	745,437.00	0.14
33	002456	欧菲光	132,900	744,240.00	0.14
34	600487	亨通光电	50,100	734,466.00	0.14
35	600256	广汇能源	104,700	718,242.00	0.14
36	002121	科陆电子	97,900	717,607.00	0.14
37	300846	首都在线	44,500	683,075.00	0.13
38	600066	宇通客车	43,500	641,190.00	0.12
39	301032	新柴股份	69,600	622,920.00	0.12
40	300703	创源股份	64,900	617,848.00	0.12
41	600352	浙江龙盛	64,800	605,880.00	0.12
42	601958	金钼股份	53,800	599,870.00	0.12
43	600765	中航重机	22,580	598,595.80	0.11
44	301076	新潮新材	27,700	543,474.00	0.10
45	300520	科大国创	24,000	524,400.00	0.10
46	000050	深天马 A	54,100	496,638.00	0.10
47	300823	建科机械	21,000	431,550.00	0.08
48	603345	安井食品	2,900	425,720.00	0.08
49	000807	云铝股份	31,800	404,814.00	0.08
50	603605	珀莱雅	3,540	397,896.00	0.08
51	000014	沙河股份	34,500	394,680.00	0.08
52	300713	英可瑞	17,100	387,486.00	0.07
53	603825	华扬联众	25,800	342,882.00	0.07
54	000999	华润三九	5,200	315,432.00	0.06
55	000048	京基智农	15,100	294,752.00	0.06
56	300129	泰胜风能	22,900	219,611.00	0.04
57	301486	致尚科技	3,769	217,320.54	0.04
58	300379	东方通	9,900	203,643.00	0.04
59	002422	科伦药业	6,200	184,016.00	0.04
60	002152	广电运通	12,500	146,500.00	0.03
61	002772	众兴菌业	10,600	119,780.00	0.02
62	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.02
63	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.02
64	603580	艾艾精工	6,700	95,341.00	0.02

65	000719	中原传媒	7,500	87,750.00	0.02
66	601028	玉龙股份	7,900	84,925.00	0.02
67	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.02
68	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.01
69	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.01
70	688249	晶合集成	3,419	61,747.14	0.01
71	002432	九安医疗	1,400	49,294.00	0.01
72	002968	新大正	3,000	45,330.00	0.01
73	688472	阿特斯	2,226	37,931.04	0.01
74	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.01
75	688361	中科飞测	512	33,111.04	0.01
76	301301	川宁生物	3,574	32,023.04	0.01
77	301358	湖南裕能	737	31,609.93	0.01
78	688469	中芯集成	5,693	30,799.13	0.01
79	301325	曼恩斯特	264	28,498.80	0.01
80	688531	日联科技	208	28,281.76	0.01
81	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
82	688582	芯动联科	573	23,309.64	0.00
83	301246	宏源药业	745	22,878.95	0.00
84	688146	中船特气	593	22,611.09	0.00
85	002372	伟星新材	1,100	22,594.00	0.00
86	603363	傲农生物	2,400	22,008.00	0.00
87	688352	颀中科技	1,759	21,231.13	0.00
88	688507	索辰科技	164	20,026.04	0.00
89	688543	国科军工	369	19,575.45	0.00
90	688458	美芯晟	214	19,422.64	0.00
91	001287	中电港	900	18,918.00	0.00
92	688478	晶升股份	402	17,032.74	0.00
93	688581	安杰思	139	16,406.17	0.00
94	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
95	301322	绿通科技	303	16,131.72	0.00
96	688570	天玛智控	627	15,881.91	0.00
97	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
98	301439	泓淋电力	902	15,243.80	0.00
99	301408	华人健康	879	14,899.05	0.00
100	601061	中信金属	1,962	14,871.96	0.00
101	301305	朗坤环境	753	14,826.57	0.00
102	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
103	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
104	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
105	688512	慧智微	721	13,814.36	0.00
106	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
107	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00

108	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
109	688620	安凯微	1,016	12,537.44	0.00
110	688623	二元科技	143	12,410.97	0.00
111	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
112	301345	涛涛车业	249	11,613.36	0.00
113	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
114	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
115	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
116	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
117	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
118	603658	安图生物	187	9,673.51	0.00
119	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
120	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
121	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
122	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00
123	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
124	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
125	601065	江盐集团	748	8,856.32	0.00
126	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
127	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
128	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
129	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
130	601133	柏诚股份	664	8,140.64	0.00
131	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
132	301295	美硕科技	215	7,755.05	0.00
133	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
134	300804	广康生化	226	7,451.22	0.00
135	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
136	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
137	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
138	002032	苏泊尔	83	4,150.00	0.00
139	600038	中直股份	100	3,982.00	0.00
140	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
141	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
142	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
143	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
144	002008	大族激光	100	2,620.00	0.00
145	300003	乐普医疗	115	2,600.15	0.00
146	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
147	002624	完美世界	135	2,280.15	0.00
148	603518	锦泓集团	200	2,270.00	0.00
149	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
150	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00

151	002576	通达动力	100	1,999.00	0.00
152	603172	万丰股份	122	1,967.86	0.00
153	000997	新大陆	100	1,890.00	0.00
154	600706	曲江文旅	100	1,789.00	0.00
155	002080	中材科技	75	1,539.00	0.00
156	300482	万孚生物	57	1,517.91	0.00
157	603029	天鹅股份	70	1,466.50	0.00
158	002900	哈三联	100	1,337.00	0.00
159	600985	淮北矿业	100	1,152.00	0.00
160	603600	永艺股份	102	970.02	0.00
161	300218	安利股份	100	942.00	0.00
162	002755	奥赛康	100	879.00	0.00
163	002607	中公教育	161	756.70	0.00
164	603696	安记食品	76	717.44	0.00
165	000728	国元证券	110	717.20	0.00
166	600704	物产中大	100	494.00	0.00
167	000488	晨鸣纸业	100	485.00	0.00
168	600390	五矿资本	79	425.02	0.00
169	600675	中华企业	100	295.00	0.00
170	000666	经纬纺机	28	279.72	0.00
171	600871	石化油服	100	198.00	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	600519	贵州茅台	13,116,046.00	2.35
2	601668	中国建筑	12,463,510.60	2.23
3	600196	复星医药	11,844,506.08	2.12
4	600050	中国联通	11,276,294.95	2.02
5	002371	北方华创	11,192,391.00	2.01
6	300750	宁德时代	11,097,749.86	1.99
7	000063	中兴通讯	11,024,566.00	1.98
8	300760	迈瑞医疗	10,610,393.00	1.90
9	601318	中国平安	9,819,450.83	1.76
10	600276	恒瑞医药	9,637,439.20	1.73
11	601688	华泰证券	9,603,642.00	1.72
12	601766	中国中车	9,447,492.00	1.69
13	601818	光大银行	9,317,165.00	1.67
14	300014	亿纬锂能	9,264,754.00	1.66
15	000001	平安银行	9,092,292.00	1.63

16	002049	紫光国微	8,906,810.60	1.60
17	600089	特变电工	8,796,907.00	1.58
18	002142	宁波银行	8,613,097.90	1.54
19	002475	立讯精密	8,598,470.00	1.54
20	600029	南方航空	8,562,724.00	1.54

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	000063	中兴通讯	14,866,393.00	2.67
2	600809	山西汾酒	14,160,063.00	2.54
3	600030	中信证券	13,990,690.80	2.51
4	601138	工业富联	13,010,622.00	2.33
5	300498	温氏股份	12,461,047.00	2.23
6	603369	今世缘	12,230,401.63	2.19
7	601766	中国中车	11,417,587.00	2.05
8	601998	中信银行	11,283,303.00	2.02
9	002371	北方华创	11,225,131.74	2.01
10	600519	贵州茅台	11,028,312.50	1.98
11	300750	宁德时代	11,006,167.40	1.97
12	601601	中国太保	10,832,417.00	1.94
13	000001	平安银行	10,423,386.00	1.87
14	601288	农业银行	10,169,567.00	1.82
15	002459	晶澳科技	10,065,663.05	1.81
16	002142	宁波银行	9,760,729.54	1.75
17	601818	光大银行	9,740,226.00	1.75
18	600276	恒瑞医药	9,549,622.40	1.71
19	601012	隆基绿能	9,424,661.08	1.69
20	002938	鹏鼎控股	9,390,466.24	1.68

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	975,175,361.07
卖出股票收入（成交）总额	1,012,235,436.69

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

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	15,363,222.50	2.95
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	15,363,222.50	2.95

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	019679	22 国债 14	139,000	14,149,906.77	2.72
2	019694	23 国债 01	12,000	1,213,315.73	0.23

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

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

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

本基金本报告期末持有国债期货合约。

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中国建筑（证券代码 601668）、中国平安（证券代码 601318）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。

1、中国建筑（证券代码 601668）

根据发布的相关公告，该证券发行人在报告期内因未依法履行职责、涉嫌违反法律法规等原因，多次受到监管机构的处罚。

2、中国平安（证券代码 601318）

根据 2022 年 8 月 22 日发布的相关公告，该证券发行人因未依法履行职责被国家外汇管理局深圳市分局处以罚款，警告，并责令改正。

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	188,231.11
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	319,707.00
6	其他应收款	332.94
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	508,271.05

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

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	000063	中兴通讯	1,366,200.00	0.26	转融通证券出借

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (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
招商沪深 300 指数增强 A	13,096	15,039.23	63,377,677.49	32.18%	133,576,086.85	67.82%
招商沪深 300 指数增强 C	9,500	17,359.82	44,098,804.28	26.74%	120,819,480.17	73.26%
合计	22,596	16,014.87	107,476,481.77	29.70%	254,395,567.02	70.30%

注：机构投资者/个人投资者持有份额占总份额比例计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	招商沪深 300 指数增强 A	594,223.52	0.3017%
	招商沪深 300 指数增强 C	5,932.26	0.0036%
	合计	600,155.78	0.1658%

注：分级基金机构投资者/个人投资者持有份额占总份额比例计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	招商沪深 300 指数增强 A	0~10
	招商沪深 300 指数增强 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	招商沪深 300 指数增强 A	0~10
	招商沪深 300 指数增强 C	0
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	招商沪深 300 指数增强 A	招商沪深 300 指数增强 C
基金合同生效日(2017年2月10日)基金份额总额	200,048,770.92	9,418.94
本报告期期初基金份额总额	190,031,898.46	200,985,360.58
本报告期基金总申购份额	65,416,509.60	59,727,916.68
减：报告期基金总赎回份额	58,494,643.72	95,794,992.81

本报告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	196,953,764.34	164,918,284.45

§ 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

根据本基金管理人 2023 年 6 月 22 日的公告，经招商基金管理有限公司第六届董事会 2023 年第四次会议审议通过，钟文岳先生离任公司常务副总经理、财务负责人职务。

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

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、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	
第一创业	3	1,976,415,539.30	100.00%	259,509.18	100.00%	-
安信证券	6	-	-	-	-	-
财通证券	3	-	-	-	-	-
长城证券	3	-	-	-	-	-
长江证券	6	-	-	-	-	-
诚通证券	1	-	-	-	-	-
大通证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	4	-	-	-	-	-
东北证券	3	-	-	-	-	-
东方财富	3	-	-	-	-	-
东方证券	3	-	-	-	-	-
东海证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	6	-	-	-	-	-
东兴证券	3	-	-	-	-	-
方正证券	7	-	-	-	-	-
光大证券	3	-	-	-	-	-
广发证券	7	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	4	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	3	-	-	-	-	-
国信证券	3	-	-	-	-	-
国元证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	4	-	-	-	-	-
宏信证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	5	-	-	-	-	-
华宝证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	4	-	-	-	-	-
华金证券	4	-	-	-	-	-
华泰证券	4	-	-	-	-	-
华西证券	3	-	-	-	-	-
华鑫证券	2	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
九州证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	5	-	-	-	-	-

南京证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	3	-	-	-	-	-
瑞信方正	2	-	-	-	-	-
山西证券	6	-	-	-	-	-
上海证券	2	-	-	-	-	-
申港证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
首创证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	7	-	-	-	-	-
万和证券	1	-	-	-	-	-
五矿证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	5	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
粤开证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	5	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
中航证券	2	-	-	-	-	-
中金财富证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	3	-	-	-	-	-
中泰证券	3	-	-	-	-	-
中信建投证券	5	-	-	-	-	-
中信证券	6	-	-	-	-	-
中银国际证券	4	-	-	-	-	-
甬兴证券	2	-	-	-	-	-

注：基金交易佣金根据券商季度综合评分结果给与分配，券商综合评分根据研究报告质量、路演质量、联合调研质量等维度进行打分，从多家服务券商中选取符合法律规范经营的综合能力靠前的券商给与佣金分配，季度评分和佣金分配分别由专人负责。

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
第一创业	13,201,649.83	100.00%	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-

财通证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
诚通证券	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
九州证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
瑞信方正	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-

世纪证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
万和证券	-	-	-	-	-	-
五矿证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
中金财富证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	-	-	-	-
甬兴证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	招商基金管理有限公司旗下基金 2022 年第 4 季度报告提示性公告	证券时报及基金管理人网站	2023-01-18
2	招商沪深 300 指数增强型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-01-18
3	招商沪深 300 指数增强型证券投资基金更新的招募说明书（二零二三年第一号）	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-02-09
4	招商沪深 300 指数增强型证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要更新	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-02-09
5	招商沪深 300 指数增强型证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要更新	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-02-09
6	招商沪深 300 指数增强型证券投资基金 2022	证券时报、基金管理	2023-03-30

	年年度报告	人网站及中国证监会基金电子披露网站	
7	招商基金管理有限公司旗下基金 2022 年年度报告提示性公告	证券时报及基金管理人网站	2023-03-30
8	招商基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 1 季度报告提示性公告	证券时报及基金管理人网站	2023-04-21
9	招商沪深 300 指数增强型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-04-21
10	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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-05-11
11	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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-05-12
12	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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-05-16
13	招商基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-06-22

§ 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沪深 300 指数增强型证券投资基金设立的文件；
- 3、《招商沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 4、《招商沪深 300 指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 5、《招商沪深 300 指数增强型证券投资基金招募说明书》；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照。

11.2 存放地点

招商基金管理有限公司
地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

11.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人招商基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-887-9555

网址：<http://www.cmfcchina.com>

招商基金管理有限公司

2023 年 8 月 30 日