

# 招商沪深 300 指数增强型证券投资基金 2024 年中期报告

2024 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：2024 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 2024 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 2024 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.....	13
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 净资产变动表.....	16
6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告.....	39
7.1 期末基金资产组合情况.....	39
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	40
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.....	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	51
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	51
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	51
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.....	51
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	52
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	52

7.12 投资组合报告附注.....	52
§8 基金份额持有人信息.....	53
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	54
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	54
§9 开放式基金份额变动.....	54
§10 重大事件揭示.....	55
10.1 基金份额持有人大会决议.....	55
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	55
10.4 基金投资策略的改变.....	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	55
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	55
10.8 其他重大事件.....	59
§11 备查文件目录.....	60
11.1 备查文件目录.....	61
11.2 存放地点.....	61
11.3 查阅方式.....	61

## § 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	750,174,361.46 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	320,847,254.97 份	429,327,106.49 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	<p>本基金为增强型指数产品，在标的指数成份券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：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、股票投资策略；</li> <li>2、债券投资策略；</li> <li>3、股指期货投资策略；</li> <li>4、国债期货投资策略；</li> <li>5、权证投资策略；</li> <li>6、资产支持证券投资策略；</li> <li>7、融资及转融通证券出借业务投资策略；</li> <li>8、存托凭证投资策略。</li> </ol>
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	<a href="http://www.cmfchina.com">http://www.cmfchina.com</a>
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(2024 年 1 月 1 日 - 2024 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	9,982,936.40
本期利润	14,056,394.23
加权平均基金份额本期利润	0.0452
本期加权平均净值利润率	3.30%
本期基金份额净值增长率	3.42%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	119,704,892.79
期末可供分配基金份额利润	0.3731
期末基金资产净值	440,552,147.76
期末基金份额净值	1.3731

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	37.31%

## 2、招商沪深 300 指数增强 C

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024 年 1 月 1 日 - 2024 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	9,204,271.97
本期利润	13,904,188.45
加权平均基金份额本期利润	0.0502
本期加权平均净值利润率	3.74%
本期基金份额净值增长率	3.21%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	144,614,868.80
期末可供分配基金份额利润	0.3368
期末基金资产净值	573,941,975.29
期末基金份额净值	1.3368
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	33.68%

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	-2.84%	0.51%	-3.14%	0.46%	0.30%	0.05%
过去三个月	-1.38%	0.72%	-2.03%	0.72%	0.65%	0.00%
过去六个月	3.42%	0.87%	0.88%	0.85%	2.54%	0.02%
过去一年	-5.60%	0.82%	-9.38%	0.83%	3.78%	-0.01%
过去三年	-25.65%	1.00%	-32.19%	0.99%	6.54%	0.01%
自基金合同生效起至今	37.31%	1.11%	2.55%	1.10%	34.76%	0.01%

## 招商沪深 300 指数增强 C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	-2.87%	0.51%	-3.14%	0.46%	0.27%	0.05%
过去三个月	-1.48%	0.72%	-2.03%	0.72%	0.55%	0.00%
过去六个月	3.21%	0.87%	0.88%	0.85%	2.33%	0.02%
过去一年	-5.98%	0.82%	-9.38%	0.83%	3.40%	-0.01%
过去三年	-26.54%	1.00%	-32.19%	0.99%	5.65%	0.01%
自基金合同 生效起至今	33.68%	1.11%	2.55%	1.10%	31.13%	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拥有公开募集证券投资基金管理、基金销售、全国社会保障基金境内委托管理、企业年金和职业年金基金投资管理、合格境内机构投资者、特定客户资产管理、保险资金投资管理、基本养老保险基金投资管理、公募基金投资顾问业务试点资格。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王平	本基金基金经理	2017 年 2 月 10 日	-	18	男，管理学硕士，FRM。2006 年加入招商基金管理有限公司，曾任投资风险管理部助理数量分析师、风险管理部数量分析师、高级风控经理，主要负责公司投资风险管理、金融工程研究等工作，曾任招商深证 100 指数证券投资基金、上证消费 80 交易型开放式指数证券投资

				<p>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、招商中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、招商中证 500 指数增强型证券投资基金、招商沪深 300 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、招商中证银行 AH 价格优选交易型开放式指数证券投资基金、招商中证银行 AH 价格优选交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，现任量化投资部总监兼招商量化精选股票型发起式证券投资基金、招商沪深 300 指数增强型证券投资基金、招商中证 1000 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 2000 指数增强型证券投资基金、招商成长量化选股股票型证券投资基金基金经理。</p>	
王岩	本基金基金经理	2021 年 3 月 26 日	-	9	<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、</p>

				投资经理、招商沪深 300 高贝塔指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、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 6 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

2024 上半年，沪深 300 指数走势呈现区间波动的形态，1 月份随着流动性压力显现，指数也出现过一段快速调整，但随后指数随着流动性恢复逐步回暖，在二季度后半期小幅走弱。就宏观数据而言，上半年的整体表现呈现了前高后低的形态，一季度的经济表现整体看依然处于弱增长的阶段。虽然规上企业利润同比增速尚可，但按月观察增速在逐步放缓；GDP 增速也表现为一季度快于二季度。总体上，国内有效需求仍然不足，内生动力有待加强，工业企业效益恢复基础仍不牢固。

就上市公司的情况来看，以万得数据口径统计，截止本年度 7 月下旬，大约 6 成业绩预告的公司盈利增速为正，但总体盈利同比增速并不高。市场在二季度的明显调整之后，对于半年报业绩的关注度会有所增加，若上市公司公告披露后依然缺乏亮点，整体的趋势性行情可能会缺乏财务基础。

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产品争取更优的超额收益。下半年投资策略会基本维持当前的逻辑，细节上会择机通过在现金流和估值水平合适的投资标的方向增加关注争取达成更优的投资目标。

### 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 3.42%，同期业绩基准增长率为 0.88%，C 类份额净值增长率为 3.21%，同期业绩基准增长率为 0.88%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

回顾 2024 年上半年，公用事业与银行板块表现较强，一定程度上和红利风格的市场偏好有所重叠，也反映了市场对于风险厌恶程度的加深。具体风格上，大盘和价值风格从性价比和防御属性角度成为了市场上半年资金的关注方向，该趋势可能依然会在下半年有所表现。沪深 300 指数与大盘价值相关性相对较高，上半年的收益结构亦受益于此。

当前货币政策的边际变化较为友好，依然呈现良性温和的状态，考虑到近期二十届三中全会的闭幕，市场对下半年政策的再发力及政府债务规模的扩张可能会有所期待，但权益市场的表现还有待观察。

展望下半年，权益市场当前的估值水平很低，但是经济增速的压力与全球贸易格局的变化以及美国政经环境的影响可能会令市场观察估值的角度更呈现多元化，也意味着强趋势的一致预期较难形成。强确定性及财报数据可以验证业绩的行业及个股可能会继续为市场所关注。沪深 300 指数的价值属性在当前的估值水平其性价比依然处于具有吸引力的状态。

#### 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

本基金本报告期内未实施利润分配。

#### 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,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:2024 年 6 月 30 日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	43,122,709.03	49,809,641.66
结算备付金		3,798,253.24	1,329,870.38
存出保证金		254,624.31	186,527.63
交易性金融资产	6.4.7.2	968,197,196.09	585,044,255.43
其中：股票投资		957,569,870.74	575,567,750.77
基金投资		-	-
债券投资		10,627,325.35	9,476,504.66
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		857,567.89	601,720.51
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		1,016,230,350.56	636,972,015.61
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 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		-	25,802,813.65
应付赎回款		68,311.31	147,023.80
应付管理人报酬		936,609.63	518,262.91
应付托管费		117,076.20	64,782.87
应付销售服务费		166,741.62	70,325.06
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	31.17
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-

其他负债	6.4.7.6	447,488.75	332,894.67
负债合计		1,736,227.51	26,936,134.13
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	750,174,361.46	463,481,879.34
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	264,319,761.59	146,554,002.14
净资产合计		1,014,494,123.05	610,035,881.48
负债和净资产总计		1,016,230,350.56	636,972,015.61

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，招商沪深 300 指数增强 A 份额净值 1.3731 元，基金份额总额 320,847,254.97 份；招商沪深 300 指数增强 C 份额净值 1.3368 元，基金份额总额 429,327,106.49 份；总份额合计 750,174,361.46 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		34,266,685.09	10,170,238.19
1.利息收入		86,056.92	43,701.72
其中：存款利息收入	6.4.7.9	86,056.92	38,148.50
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		-	5,553.22
2.投资收益（损失以“-” 填列）		24,655,259.76	10,094,853.69
其中：股票投资收益	6.4.7.10	15,311,046.79	4,044,080.54
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	75,448.12	244,560.95
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	391,425.16	45,032.10
股利收益	6.4.7.15	8,877,339.69	5,761,180.10
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	8,773,374.31	-164,970.36
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	751,994.10	196,653.14
减：二、营业总支出		6,306,102.41	4,599,985.52
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	4,775,225.67	3,415,615.61
其中：暂估管理人报酬		-	-
2.托管费	6.4.10.2.2	596,903.22	426,951.99
3.销售服务费	6.4.10.2.3	745,366.74	568,896.76
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		1,410.92	523.24
8.其他费用	6.4.7.19	187,195.86	187,997.92
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		27,960,582.68	5,570,252.67
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		27,960,582.68	5,570,252.67
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		27,960,582.68	5,570,252.67

注：根据最新《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》中的利润表格式的要求：上年度可比期间“证券出借利息收入”项目的“本期”金额列示于本期“其他利息收入”项目的“上年度可比期间”金额中。

### 6.3 净资产变动表

会计主体：招商沪深 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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	463,481,879.34	-	146,554,002.14	610,035,881.48
加：会计政策变更	-	-	-	-

前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	463,481,879.34	-	146,554,002.14	610,035,881.48
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	286,692,482.12	-	117,765,759.45	404,458,241.57
（一）、综合收益总额	-	-	27,960,582.68	27,960,582.68
（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）	286,692,482.12	-	89,805,176.77	376,497,658.89
其中：1.基金申购款	482,383,528.97	-	157,013,303.23	639,396,832.20
2.基金赎回款	-195,691,046.85	-	-67,208,126.46	-262,899,173.31
（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	750,174,361.46	-	264,319,761.59	1,014,494,123.05
项目	上年度可比期间 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	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	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净资产变动数（净资产减少以“-”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	361,872,048.79	-	159,088,486.74	520,960,535.53

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)。本基金可以参与融资和转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为:本基金投资于股票、存托凭证资产

的比例不低于基金资产的 80%，投资于沪深 300 指数成份券及其备选成份券的资产不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，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×95%+同期银行活期存款利率(税后)×5%。

## 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)、中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

## 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2024 年 1 月 1 日至 2024 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 2024 年 6 月 30 日
活期存款	43,122,709.03
等于：本金	43,118,780.65
加：应计利息	3,928.38
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	43,122,709.03

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	984,482,884.05	-	957,569,870.74	-26,913,013.31	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	10,513,803.00	109,475.35	10,627,325.35	4,047.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	10,513,803.00	109,475.35	10,627,325.35	4,047.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	994,996,687.05	109,475.35	968,197,196.09	-26,908,966.31	

#### 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 2024 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	20.71
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	267,898.91
其中：交易所市场	267,898.91
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	79,569.13
应付指数使用费	100,000.00
合计	447,488.75

## 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	299,725,495.44	299,725,495.44
本期申购	58,577,977.99	58,577,977.99
本期赎回（以“-”号填列）	-37,456,218.46	-37,456,218.46
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期末	320,847,254.97	320,847,254.97

招商沪深 300 指数增强 C		
项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	163,756,383.90	163,756,383.90
本期申购	423,805,550.98	423,805,550.98
本期赎回（以“-”号填列）	-158,234,828.39	-158,234,828.39
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期末	429,327,106.49	429,327,106.49

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	145,763,593.13	-47,546,461.65	98,217,131.48
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-

其他	-	-	-
本期期初	145,763,593.13	-47,546,461.65	98,217,131.48
本期利润	9,982,936.40	4,073,457.83	14,056,394.23
本期基金份额交易产生的变动数	10,776,658.93	-3,345,291.85	7,431,367.08
其中：基金申购款	28,924,777.45	-7,139,280.48	21,785,496.97
基金赎回款	-18,148,118.52	3,793,988.63	-14,354,129.89
本期已分配利润	-	-	-
本期末	166,523,188.46	-46,818,295.67	119,704,892.79

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	73,821,900.73	-25,485,030.07	48,336,870.66
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	73,821,900.73	-25,485,030.07	48,336,870.66
本期利润	9,204,271.97	4,699,916.48	13,904,188.45
本期基金份额交易产生的变动数	123,058,742.27	-40,684,932.58	82,373,809.69
其中：基金申购款	192,609,039.94	-57,381,233.68	135,227,806.26
基金赎回款	-69,550,297.67	16,696,301.10	-52,853,996.57
本期已分配利润	-	-	-
本期末	206,084,914.97	-61,470,046.17	144,614,868.80

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	65,387.36
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	19,343.79
其他	1,325.77
合计	86,056.92

#### 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	15,311,046.79
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	15,311,046.79
----	---------------

#### 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,342,715,608.87
减：卖出股票成本总额	1,326,094,723.44
减：交易费用	1,309,838.64
买卖股票差价收入	15,311,046.79

#### 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	76,038.12
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-590.00
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	75,448.12

##### 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	19,386,100.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	19,000,590.00
减：应计利息总额	386,100.00
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-590.00

##### 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	391,425.16

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	8,877,339.69
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	8,877,339.69

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	8,804,934.31
——股票投资	8,804,715.31
——债券投资	219.00
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-31,560.00
——权证投资	-
——期货投资	-31,560.00
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	8,773,374.31

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	751,994.10
合计	751,994.10

#### 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	19,896.79
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
其他	107,626.73
合计	187,195.86

## 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	4,775,225.67	3,415,615.61
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,445,812.67	1,050,175.52
应支付基金管理人的净管理费	3,329,413.00	2,365,440.09
应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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	596,903.22	426,951.99

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：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	-	202,102.02	202,102.02
招商银行	-	193,413.31	193,413.31
招商证券	-	3,590.89	3,590.89
中国银行	-	10,412.01	10,412.01
合计	-	409,518.23	409,518.23
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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	-	131,116.25	131,116.25

公司			
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

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：

$$C \text{ 类份额日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金资产净值} \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

#### 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	43,122,709.03	65,387.36	14,691,073.04	21,599.09

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	688692	达梦数据	新股获配	1,745	151,745.20

上年度可比期间 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

注：本表已包含托管人的关联方承销期内承销的证券。

#### 6.4.11 利润分配情况

##### 6.4.11.1 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2024 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
001359	平安电工	2024 年 3 月 19 日	6 个月	新股流通受限	17.39	20.60	184	3,199.76	3,790.40	-
001379	腾达科技	2024 年 1 月 11 日	6 个月	新股流通受限	16.98	13.48	213	3,616.74	2,871.24	-
001387	雪祺电气	2024 年 1 月 4 日	6 个月	新股流通受限	15.38	15.25	173	2,045.54	2,638.25	-
001389	广合科技	2024 年 3 月 26 日	6 个月	新股流通受限	17.43	34.56	222	3,869.46	7,672.32	-
301392	汇成真空	2024 年 5 月 28 日	6 个月	新股流通受限	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-
301502	华阳智能	2024 年 1 月	6 个月	新股流通受限	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-

		26 日								
301536	星辰科技	2024 年 3 月 20 日	6 个月	新股流通受限	16.16	32.27	481	7,772.96	15,521.87	-
301538	骏鼎达	2024 年 3 月 13 日	6 个月	新股流通受限	55.82	91.24	150	5,972.74	13,686.00	-
301539	宏鑫科技	2024 年 4 月 3 日	6 个月	新股流通受限	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-
301565	中仑新材	2024 年 6 月 13 日	6 个月	新股流通受限	11.88	18.98	711	8,446.68	13,494.78	-
301566	达利凯普	2023 年 12 月 22 日	6 个月	新股流通受限	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	-
301580	爱迪特	2024 年 6 月 19 日	6 个月	新股流通受限	44.95	65.93	202	9,079.90	13,317.86	-
301587	中瑞股份	2024 年 3 月 27 日	6 个月	新股流通受限	21.73	25.26	306	6,649.38	7,729.56	-
301588	美新科技	2024 年 3 月 6 日	6 个月	新股流通受限	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-
301589	诺瓦星云	2024 年 2 月 1 日	6 个月	新股流通受限	126.89	188.01	1,244	87,680.99	233,884.44	-
301591	肯特股份	2024 年 2 月 20 日	6 个月	新股流通受限	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	-
603082	北自科技	2024 年 1 月 23 日	6 个月	新股流通受限	21.28	29.49	107	2,276.96	3,155.43	-
603285	键邦股份	2024 年 6 月 28 日	1 个月内(含)	新股流通受限	18.65	18.65	1,158	21,596.70	21,596.70	-
603285	键邦股份	2024 年 6 月 28 日	6 个月	新股流通受限	18.65	18.65	129	2,405.85	2,405.85	-
603312	西典新能	2024 年 1 月 4 日	6 个月	新股流通受限	29.02	25.36	130	3,772.60	3,296.80	-
603325	博隆技术	2024	6 个月	新股流通	72.46	68.06	66	4,782.36	4,491.96	-



		年 1 月 3 日		受限						
603341	龙旗科技	2024 年 2 月 23 日	6 个月	新股流通受限	26.00	37.49	298	7,748.00	11,172.02	-
603344	星德胜	2024 年 3 月 13 日	6 个月	新股流通受限	19.18	22.66	182	3,490.76	4,124.12	-
603350	安乃达	2024 年 6 月 26 日	1 个月内(含)	新股流通受限	20.56	20.56	945	19,429.20	19,429.20	-
603350	安乃达	2024 年 6 月 26 日	6 个月	新股流通受限	20.56	20.56	106	2,179.36	2,179.36	-
603375	盛景微	2024 年 1 月 17 日	6 个月	新股流通受限	38.18	38.90	72	2,748.96	2,800.80	-
603381	永臻股份	2024 年 6 月 19 日	6 个月	新股流通受限	23.35	25.13	178	4,156.30	4,473.14	-
688530	欧莱新材	2024 年 4 月 29 日	6 个月	新股流通受限	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-
688584	上海合晶	2024 年 2 月 1 日	6 个月	新股流通受限	22.66	15.89	866	19,623.56	13,760.74	-
688691	灿芯股份	2024 年 4 月 2 日	6 个月	新股流通受限	19.86	42.51	247	4,905.42	10,499.97	-
688692	达梦数据	2024 年 6 月 4 日	6 个月	新股流通受限	86.96	174.93	175	15,218.00	30,612.75	-
688695	中创股份	2024 年 3 月 6 日	6 个月	新股流通受限	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-
688709	成都华微	2024 年 1 月 31 日	6 个月	新股流通受限	15.69	18.79	1,045	16,396.05	19,635.55	-

## 6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

注：对于在流通受限期内发生送股的股票，上表列示的数量为原受限股票数量与送股数量的加总。

#### 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（主要是指数成份股、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 2024 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	43,122,709.03	-	-	-	43,122,709.03
结算备付金	3,798,253.24	-	-	-	3,798,253.24
存出保证金	254,624.31	-	-	-	254,624.31
交易性金融资产	10,627,325.35	-	-	957,569,870.74	968,197,196.09
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	-	-	-	857,567.89	857,567.89
应收清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	57,802,911.93	-	-	958,427,438.63	1,016,230,350.56
负债					
应付赎回款	-	-	-	68,311.31	68,311.31
应付管理人报酬	-	-	-	936,609.63	936,609.63
应付托管费	-	-	-	117,076.20	117,076.20
应付清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资	-	-	-	-	-

产款					
应付销售服务费	-	-	-	166,741.62	166,741.62
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	447,488.75	447,488.75
负债总计	-	-	-	1,736,227.51	1,736,227.51
利率敏感度缺口	57,802,911.93	-	-	956,691,211.12	1,014,494,123.05
上年度末 2023 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	49,809,641.66	-	-	-	49,809,641.66
结算备付金	1,329,870.38	-	-	-	1,329,870.38
存出保证金	62,478.83	-	-	124,048.80	186,527.63
交易性金融资产	9,476,504.66	-	-	575,567,750.77	585,044,255.43
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	-	-	-	601,720.51	601,720.51
应收清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	60,678,495.53	-	-	576,293,520.08	636,972,015.61
负债					
应付赎回款	-	-	-	147,023.80	147,023.80
应付管理人报酬	-	-	-	518,262.91	518,262.91
应付托管费	-	-	-	64,782.87	64,782.87
应付清算款	-	-	-	25,802,813.65	25,802,813.65
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	70,325.06	70,325.06
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	31.17	31.17
其他负债	-	-	-	332,894.67	332,894.67
负债总计	-	-	-	26,936,134.13	26,936,134.13
利率敏感度缺口	60,678,495.53	-	-	549,357,385.95	610,035,881.48

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（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	1. 市场利率平行上升 50 个基点	-22,650.32	-3,254.75
2. 市场利率平行下降 50 个基点	22,737.13	3,263.99	

#### 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 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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	957,569,870.74	94.39	575,567,750.77	94.35
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	957,569,870.74	94.39	575,567,750.77	94.35

##### 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（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	1. 权益性投资的市场价格上升 5%	47,878,493.54	28,778,387.54
2. 权益性投资的市场价格下降 5%	-47,878,493.54	-28,778,387.54	

## 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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	957,045,389.24	574,568,878.15
第二层次	10,672,936.46	9,476,504.66
第三层次	478,870.39	998,872.62
合计	968,197,196.09	585,044,255.43

#### 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	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	957,569,870.74	94.23
	其中：股票	957,569,870.74	94.23
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	10,627,325.35	1.05
	其中：债券	10,627,325.35	1.05
	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	46,920,962.27	4.62
8	其他各项资产	1,112,192.20	0.11
9	合计	1,016,230,350.56	100.00

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

## 7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	2,806,922.40	0.28
B	采矿业	34,680,958.19	3.42
C	制造业	461,362,996.60	45.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	39,480,444.00	3.89
E	建筑业	19,100,133.13	1.88
F	批发和零售业	2,952.99	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	24,297,764.30	2.40
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	29,637,540.55	2.92
J	金融业	188,755,687.51	18.61
K	房地产业	421,517.25	0.04
L	租赁和商务服务业	1,342,299.00	0.13
M	科学研究和技术服务业	14,860,730.43	1.46
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	223,840.80	0.02
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	816,973,787.15	80.53

### 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	1,260,709.00	0.12
C	制造业	105,544,292.56	10.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,030,384.00	1.28
E	建筑业	4,667,497.10	0.46
F	批发和零售业	12,710.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	3,345,815.00	0.33
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,037,630.38	0.30
J	金融业	1,768,608.55	0.17
K	房地产业	602,898.00	0.06
L	租赁和商务服务业	828,920.00	0.08
M	科学研究和技术服务业	2,317,320.00	0.23
N	水利、环境和公共设施管理业	951.00	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,080,326.00	0.11
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	3,098,022.00	0.31
S	综合	-	-
	合计	140,596,083.59	13.86

### 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	42,605	62,518,150.95	6.16

2	601318	中国平安	768,213	31,773,289.68	3.13
3	000333	美的集团	373,460	24,088,170.00	2.37
4	300750	宁德时代	126,420	22,759,392.60	2.24
5	000725	京东方 A	5,360,900	21,926,081.00	2.16
6	600030	中信证券	1,128,570	20,573,831.10	2.03
7	601766	中国中车	2,642,600	19,845,926.00	1.96
8	600000	浦发银行	2,275,822	18,730,015.06	1.85
9	600050	中国联通	3,842,600	18,060,220.00	1.78
10	000568	泸州老窖	120,375	17,272,608.75	1.70
11	300274	阳光电源	258,260	16,019,867.80	1.58
12	601601	中国太保	561,365	15,639,628.90	1.54
13	601989	中国重工	3,138,948	15,475,013.64	1.53
14	002142	宁波银行	683,643	15,081,164.58	1.49
15	603259	药明康德	379,197	14,860,730.43	1.46
16	600029	南方航空	2,419,200	14,249,088.00	1.40
17	600926	杭州银行	1,080,972	14,106,684.60	1.39
18	600900	长江电力	486,200	14,060,904.00	1.39
19	601838	成都银行	908,100	13,794,039.00	1.36
20	600028	中国石化	2,164,500	13,679,640.00	1.35
21	600196	复星医药	610,066	13,506,861.24	1.33
22	000063	中兴通讯	466,100	13,036,817.00	1.29
23	600809	山西汾酒	58,224	12,278,277.12	1.21
24	603806	福斯特	794,520	11,679,444.00	1.15
25	600011	华能国际	1,199,300	11,537,266.00	1.14
26	600104	上汽集团	816,000	11,309,760.00	1.11
27	601899	紫金矿业	634,773	11,152,961.61	1.10
28	002371	北方华创	34,200	10,940,238.00	1.08
29	000858	五粮液	80,923	10,361,380.92	1.02
30	601166	兴业银行	586,650	10,336,773.00	1.02
31	600760	中航沈飞	224,476	9,001,487.60	0.89
32	000977	浪潮信息	246,900	8,979,753.00	0.89
33	600372	中航机载	686,600	8,218,602.00	0.81
34	600795	国电电力	1,284,900	7,696,551.00	0.76
35	601668	中国建筑	1,372,980	7,290,523.80	0.72
36	002594	比亚迪	28,800	7,207,200.00	0.71
37	601398	工商银行	1,252,900	7,141,530.00	0.70
38	601728	中国电信	1,153,700	7,095,255.00	0.70
39	000100	TCL 科技	1,635,510	7,065,403.20	0.70
40	000625	长安汽车	506,500	6,802,295.00	0.67
41	002180	纳思达	252,834	6,679,874.28	0.66
42	601688	华泰证券	517,200	6,408,108.00	0.63
43	002415	海康威视	206,800	6,392,188.00	0.63
44	601328	交通银行	838,900	6,266,583.00	0.62

45	000651	格力电器	158,826	6,229,155.72	0.61
46	600150	中国船舶	149,822	6,099,253.62	0.60
47	601865	福莱特	292,900	5,887,290.00	0.58
48	601186	中国铁建	662,769	5,679,930.33	0.56
49	002241	歌尔股份	288,400	5,626,684.00	0.55
50	600741	华域汽车	334,812	5,484,220.56	0.54
51	600989	宝丰能源	315,700	5,471,081.00	0.54
52	600276	恒瑞医药	140,646	5,409,245.16	0.53
53	600362	江西铜业	224,238	5,309,955.84	0.52
54	000661	长春高新	56,700	5,203,359.00	0.51
55	300760	迈瑞医疗	17,800	5,178,198.00	0.51
56	002475	立讯精密	129,712	5,098,978.72	0.50
57	601633	长城汽车	197,600	4,999,280.00	0.49
58	600027	华电国际	679,800	4,717,812.00	0.47
59	601800	中国交建	520,400	4,652,376.00	0.46
60	601818	光大银行	1,461,800	4,633,906.00	0.46
61	000786	北新建材	154,000	4,567,640.00	0.45
62	000338	潍柴动力	273,100	4,435,144.00	0.44
63	600887	伊利股份	167,800	4,335,952.00	0.43
64	300979	华利集团	69,400	4,222,990.00	0.42
65	600309	万华化学	50,575	4,089,494.50	0.40
66	601088	中国神华	91,300	4,050,981.00	0.40
67	600018	上港集团	664,300	3,839,654.00	0.38
68	601288	农业银行	864,200	3,767,912.00	0.37
69	605499	东鹏饮料	16,900	3,646,175.00	0.36
70	600219	南山铝业	934,600	3,560,826.00	0.35
71	300059	东方财富	297,186	3,138,284.16	0.31
72	601857	中国石油	279,100	2,880,312.00	0.28
73	601138	工业富联	104,000	2,849,600.00	0.28
74	603195	公牛集团	35,820	2,762,438.40	0.27
75	601816	京沪高铁	486,600	2,613,042.00	0.26
76	601336	新华保险	86,900	2,609,607.00	0.26
77	300308	中际旭创	15,460	2,131,624.80	0.21
78	601225	陕西煤业	78,500	2,022,945.00	0.20
79	600919	江苏银行	270,600	2,010,558.00	0.20
80	600016	民生银行	528,291	2,002,222.89	0.20
81	601919	中远海控	121,700	1,885,133.00	0.19
82	002714	牧原股份	40,104	1,748,534.40	0.17
83	600690	海尔智家	56,499	1,603,441.62	0.16
84	601939	建设银行	211,200	1,562,880.00	0.15
85	600941	中国移动	14,500	1,558,750.00	0.15
86	601006	大秦铁路	197,500	1,414,100.00	0.14
87	600875	东方电气	76,200	1,405,890.00	0.14

88	002466	天齐锂业	46,200	1,381,842.00	0.14
89	601169	北京银行	231,900	1,354,296.00	0.13
90	600015	华夏银行	198,500	1,270,400.00	0.13
91	600089	特变电工	90,300	1,252,461.00	0.12
92	002938	鹏鼎控股	31,300	1,244,488.00	0.12
93	600585	海螺水泥	51,448	1,213,658.32	0.12
94	601319	中国人保	221,400	1,140,210.00	0.11
95	300498	温氏股份	53,400	1,058,388.00	0.10
96	600406	国电南瑞	41,400	1,033,344.00	0.10
97	000617	中油资本	176,000	971,520.00	0.10
98	000001	平安银行	94,199	956,119.85	0.09
99	300124	汇川技术	18,445	946,228.50	0.09
100	601236	红塔证券	146,800	942,456.00	0.09
101	603993	洛阳钼业	104,800	890,800.00	0.09
102	002027	分众传媒	142,100	861,126.00	0.08
103	002410	广联达	85,960	823,496.80	0.08
104	600039	四川路桥	98,000	773,220.00	0.08
105	688256	寒武纪	3,825	759,912.75	0.07
106	601117	中国化学	85,300	702,872.00	0.07
107	601229	上海银行	81,300	590,238.00	0.06
108	000166	申万宏源	134,400	579,264.00	0.06
109	601985	中国核电	49,400	526,604.00	0.05
110	600660	福耀玻璃	10,800	517,320.00	0.05
111	601012	隆基绿能	35,692	500,401.84	0.05
112	601888	中国中免	7,700	481,173.00	0.05
113	601881	中国银河	42,400	460,464.00	0.05
114	600886	国投电力	25,100	457,824.00	0.05
115	688036	传音控股	5,640	431,685.60	0.04
116	000876	新希望	46,900	428,666.00	0.04
117	000002	万科 A	60,825	421,517.25	0.04
118	000408	藏格矿业	17,300	416,411.00	0.04
119	002236	大华股份	26,900	415,874.00	0.04
120	600085	同仁堂	10,800	412,668.00	0.04
121	002129	TCL 中环	46,925	405,901.25	0.04
122	600460	士兰微	22,800	399,228.00	0.04
123	601998	中信银行	57,700	386,590.00	0.04
124	003816	中国广核	68,100	315,303.00	0.03
125	600161	天坛生物	12,480	304,512.00	0.03
126	002304	洋河股份	3,500	282,590.00	0.03
127	603501	韦尔股份	2,800	278,236.00	0.03
128	600031	三一重工	16,100	265,650.00	0.03
129	601877	正泰电器	13,600	259,216.00	0.03
130	601021	春秋航空	4,400	247,852.00	0.02

131	688111	金山办公	1,000	227,500.00	0.02
132	300015	爱尔眼科	21,690	223,840.80	0.02
133	000792	盐湖股份	12,600	219,870.00	0.02
134	000807	云铝股份	14,300	193,193.00	0.02
135	688981	中芯国际	3,390	156,279.00	0.02
136	601066	中信建投	7,800	150,072.00	0.01
137	601238	广汽集团	18,900	146,286.00	0.01
138	600010	包钢股份	98,200	137,480.00	0.01
139	601916	浙商银行	40,600	112,056.00	0.01
140	601628	中国人寿	3,600	111,780.00	0.01
141	001289	龙源电力	6,000	103,500.00	0.01
142	601788	光大证券	7,077	103,465.74	0.01
143	600025	华能水电	6,000	64,680.00	0.01
144	300122	智飞生物	2,300	64,469.00	0.01
145	601360	三六零	7,900	60,672.00	0.01
146	002352	顺丰控股	1,370	48,895.30	0.00
147	300316	晶盛机电	1,600	45,968.00	0.00
148	600958	东方证券	3,400	25,840.00	0.00
149	600837	海通证券	2,600	22,256.00	0.00
150	002230	科大讯飞	400	17,180.00	0.00
151	605117	德业股份	196	14,570.64	0.00
152	603986	兆易创新	84	8,032.08	0.00
153	300661	圣邦股份	92	7,615.76	0.00
154	603288	海天味业	203	6,997.41	0.00
155	002821	凯莱英	100	6,580.00	0.00
156	603392	万泰生物	94	6,192.72	0.00
157	002179	中航光电	136	5,174.80	0.00
158	002311	海大集团	94	4,422.70	0.00
159	002460	赣锋锂业	120	3,438.00	0.00
160	600188	兖矿能源	146	3,318.58	0.00
161	000963	华东医药	100	2,781.00	0.00
162	603799	华友钴业	110	2,434.30	0.00
163	002271	东方雨虹	141	1,739.94	0.00
164	000776	广发证券	135	1,642.95	0.00
165	600588	用友网络	121	1,210.00	0.00
166	002459	晶澳科技	84	940.80	0.00
167	300433	蓝思科技	46	839.50	0.00
168	600346	恒力石化	52	725.40	0.00
169	601390	中国中铁	100	652.00	0.00
170	601669	中国电建	100	559.00	0.00
171	601607	上海医药	9	171.99	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	601991	大唐发电	3,089,000	9,297,890.00	0.92
2	601127	赛力斯	98,900	9,011,768.00	0.89
3	002028	思源电气	132,900	8,891,010.00	0.88
4	601567	三星医疗	226,600	7,931,000.00	0.78
5	300207	欣旺达	500,500	7,592,585.00	0.75
6	601717	郑煤机	410,600	6,076,880.00	0.60
7	600066	宇通客车	217,000	5,598,600.00	0.55
8	600448	华纺股份	2,553,200	5,029,804.00	0.50
9	300955	嘉亨家化	388,800	4,926,096.00	0.49
10	002463	沪电股份	130,000	4,745,000.00	0.47
11	600667	太极实业	817,400	4,667,354.00	0.46
12	603822	嘉澳环保	229,080	4,331,902.80	0.43
13	601058	赛轮轮胎	305,113	4,271,582.00	0.42
14	002340	格林美	654,300	4,167,891.00	0.41
15	600177	雅戈尔	547,300	3,896,776.00	0.38
16	600012	皖通高速	239,500	3,345,815.00	0.33
17	000027	深圳能源	438,300	3,199,590.00	0.32
18	600282	南钢股份	636,500	3,169,770.00	0.31
19	601019	山东出版	262,100	3,098,022.00	0.31
20	600420	国药现代	286,200	3,056,616.00	0.30
21	605198	安德利	108,600	2,867,040.00	0.28
22	600380	健康元	242,600	2,709,842.00	0.27
23	603429	集友股份	652,900	2,709,535.00	0.27
24	300492	华图山鼎	24,600	2,317,320.00	0.23
25	002921	联诚精密	195,300	1,954,953.00	0.19
26	603681	永冠新材	150,700	1,921,425.00	0.19
27	002602	世纪华通	494,600	1,696,478.00	0.17
28	600985	淮北矿业	67,000	1,121,580.00	0.11
29	600661	昂立教育	96,200	1,080,326.00	0.11
30	603858	步长制药	61,545	932,406.75	0.09
31	600685	中船防务	32,900	917,910.00	0.09
32	000783	长江证券	182,800	882,924.00	0.09
33	002969	嘉美包装	307,400	876,090.00	0.09
34	002852	道道全	120,700	869,040.00	0.09
35	601990	南京证券	109,000	837,120.00	0.08
36	600057	厦门象屿	121,900	828,920.00	0.08
37	002030	达安基因	156,500	782,500.00	0.08

38	000718	苏宁环球	288,500	484,680.00	0.05
39	603002	宏昌电子	97,600	457,744.00	0.05
40	603688	石英股份	15,000	444,150.00	0.04
41	600707	彩虹股份	58,400	397,704.00	0.04
42	688188	柏楚电子	2,112	389,769.60	0.04
43	300866	安克创新	5,420	385,958.20	0.04
44	603379	三美股份	9,800	383,572.00	0.04
45	002955	鸿合科技	16,030	374,781.40	0.04
46	002558	巨人网络	38,700	365,328.00	0.04
47	600737	中粮糖业	37,100	355,789.00	0.04
48	688506	百利天恒	1,870	339,218.00	0.03
49	000830	鲁西化工	29,100	337,269.00	0.03
50	688316	青云科技	11,036	330,086.76	0.03
51	600032	浙江新能	38,300	278,824.00	0.03
52	688538	和辉光电	137,200	271,656.00	0.03
53	603408	建霖家居	20,400	269,076.00	0.03
54	002494	华斯股份	78,600	245,232.00	0.02
55	600529	山东药玻	9,600	243,264.00	0.02
56	603160	汇顶科技	3,500	240,625.00	0.02
57	301589	诺瓦星云	1,244	233,884.44	0.02
58	688707	振华新材	23,564	229,513.36	0.02
59	603185	弘元绿能	9,877	168,797.93	0.02
60	300002	神州泰岳	20,500	166,460.00	0.02
61	002152	广电运通	15,800	165,268.00	0.02
62	603706	东方环宇	9,900	145,035.00	0.01
63	000933	神火股份	6,800	137,564.00	0.01
64	002128	电投能源	5,800	122,380.00	0.01
65	601155	新城控股	13,300	117,971.00	0.01
66	300034	钢研高纳	5,300	84,217.00	0.01
67	000536	华映科技	40,000	80,800.00	0.01
68	605196	华通线缆	6,500	68,380.00	0.01
69	603053	成都燃气	5,600	54,096.00	0.01
70	688789	宏华数科	400	43,120.00	0.00
71	002958	青农商行	15,300	41,004.00	0.00
72	002517	恺英网络	4,200	40,110.00	0.00
73	600236	桂冠电力	4,700	36,049.00	0.00
74	688692	达梦数据	175	30,612.75	0.00
75	002519	银河电子	5,900	28,969.00	0.00
76	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.00
77	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.00
78	300397	天和防务	2,300	21,160.00	0.00
79	688709	成都华微	1,045	19,635.55	0.00
80	300045	华力创通	1,100	19,415.00	0.00

81	000600	建投能源	3,000	18,900.00	0.00
82	601918	新集能源	1,700	16,575.00	0.00
83	301536	星辰科技	481	15,521.87	0.00
84	688584	上海合晶	866	13,760.74	0.00
85	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.00
86	301565	中仑新材	711	13,494.78	0.00
87	301580	爱迪特	202	13,317.86	0.00
88	300892	品渥食品	900	12,276.00	0.00
89	603341	龙旗科技	298	11,172.02	0.00
90	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
91	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
92	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
93	601992	金隅集团	6,500	8,905.00	0.00
94	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
95	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
96	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
97	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
98	002936	郑州银行	3,800	6,574.00	0.00
99	301578	辰奕智能	154	6,093.78	0.00
100	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
101	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
102	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
103	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
104	603325	博隆技术	66	4,491.96	0.00
105	603381	永臻股份	178	4,473.14	0.00
106	002032	苏泊尔	83	4,158.30	0.00
107	603344	星德胜	182	4,124.12	0.00
108	600038	中直股份	100	4,111.00	0.00
109	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
110	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00
111	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
112	001379	腾达科技	213	2,871.24	0.00
113	603375	盛景微	72	2,800.80	0.00
114	001387	雪祺电气	173	2,638.25	0.00
115	002008	大族激光	100	2,080.00	0.00
116	300003	乐普医疗	115	1,706.60	0.00
117	600765	中航重机	80	1,632.00	0.00
118	300218	安利股份	100	1,508.00	0.00
119	000997	新大陆	100	1,391.00	0.00
120	300482	万孚生物	57	1,390.80	0.00
121	002576	通达动力	100	1,135.00	0.00
122	603600	永艺股份	102	1,064.88	0.00
123	002624	完美世界	135	1,026.00	0.00



124	600706	曲江文旅	100	951.00	0.00
125	603518	锦泓集团	100	880.00	0.00
126	000728	国元证券	110	666.60	0.00
127	603696	安记食品	76	515.28	0.00
128	600704	物产中大	100	434.00	0.00
129	000488	晨鸣纸业	100	346.00	0.00
130	600390	五矿资本	79	319.95	0.00
131	600675	中华企业	100	247.00	0.00
132	600871	石化油服	100	174.00	0.00
133	600606	绿地控股	106	143.10	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	39,588,972.61	6.49
2	601567	三星医疗	28,605,625.00	4.69
3	601601	中国太保	25,345,298.00	4.15
4	601318	中国平安	24,766,641.43	4.06
5	000725	京东方 A	24,481,641.00	4.01
6	600809	山西汾酒	23,416,793.00	3.84
7	600050	中国联通	22,452,128.00	3.68
8	002142	宁波银行	21,256,977.00	3.48
9	000333	美的集团	19,891,099.00	3.26
10	600926	杭州银行	19,641,861.00	3.22
11	000063	中兴通讯	19,203,343.00	3.15
12	600030	中信证券	18,622,378.00	3.05
13	600795	国电电力	18,520,128.00	3.04
14	601398	工商银行	18,254,203.00	2.99
15	600029	南方航空	17,977,889.00	2.95
16	601865	福莱特	17,911,037.00	2.94
17	600760	中航沈飞	17,867,499.56	2.93
18	603259	药明康德	17,265,980.40	2.83
19	600000	浦发银行	17,183,183.00	2.82
20	601607	上海医药	16,874,353.00	2.77
21	601766	中国中车	16,798,826.00	2.75
22	600104	上汽集团	16,738,865.00	2.74
23	601600	中国铝业	16,096,135.00	2.64
24	002371	北方华创	15,947,473.00	2.61
25	601989	中国重工	15,902,013.12	2.61
26	600028	中国石化	15,284,298.00	2.51

27	603806	福斯特	15,126,321.20	2.48
28	000661	长春高新	14,685,121.00	2.41
29	600196	复星医药	14,638,399.92	2.40
30	002241	歌尔股份	14,251,202.66	2.34
31	002028	思源电气	14,053,582.00	2.30
32	601328	交通银行	13,961,400.00	2.29
33	000568	泸州老窖	13,547,763.00	2.22
34	300124	汇川技术	12,963,935.00	2.13
35	000858	五粮液	12,882,737.00	2.11
36	601688	华泰证券	12,830,799.00	2.10
37	601868	中国能建	12,744,228.00	2.09
38	601800	中国交建	12,279,708.00	2.01
39	601668	中国建筑	12,223,840.00	2.00

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	601567	三星医疗	26,399,771.00	4.33
2	601607	上海医药	24,396,452.00	4.00
3	000858	五粮液	19,919,309.00	3.27
4	600795	国电电力	18,244,956.00	2.99
5	601398	工商银行	17,991,503.00	2.95
6	601600	中国铝业	17,784,997.00	2.92
7	601328	交通银行	17,303,802.00	2.84
8	300124	汇川技术	16,868,731.00	2.77
9	601865	福莱特	16,858,271.05	2.76
10	600016	民生银行	16,700,167.00	2.74
11	601169	北京银行	16,615,725.08	2.72
12	601211	国泰君安	16,549,027.00	2.71
13	601390	中国中铁	16,021,211.00	2.63
14	601318	中国平安	14,829,339.18	2.43
15	601688	华泰证券	14,715,482.00	2.41
16	000661	长春高新	14,711,060.00	2.41
17	601668	中国建筑	14,422,726.00	2.36
18	000063	中兴通讯	14,133,119.14	2.32
19	600760	中航沈飞	13,683,384.00	2.24
20	002236	大华股份	13,636,692.00	2.24

21	000338	潍柴动力	13,234,156.00	2.17
22	002241	歌尔股份	13,126,798.58	2.15
23	000651	格力电器	13,005,190.41	2.13
24	601868	中国能建	12,345,653.00	2.02

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	1,699,292,128.10
卖出股票收入（成交）总额	1,342,715,608.87

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	10,627,325.35	1.05
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	10,627,325.35	1.05

### 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	019733	24 国债 02	75,000	7,580,480.14	0.75
2	019709	23 国债 16	30,000	3,046,845.21	0.30

### 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

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

### 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浦发银行（证券代码 600000）、中信证券（证券代码 600030）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、浦发银行（证券代码 600000）

根据发布的相关公告，该证券发行人在报告期内因违规经营、未依法履行职责、违反反洗钱法等原因，多次受到监管机构的处罚。

#### 2、中信证券（证券代码 600030）

根据发布的相关公告，该证券发行人在报告期内因违规经营、未依法履行职责、违反反洗钱法等原因，多次受到监管机构的处罚。

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	254,624.31
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	857,567.89
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,112,192.20

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（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	15,048	21,321.59	153,613,803.44	47.88%	167,233,451.53	52.12%
招商沪深 300 指数增强 C	31,482	13,637.22	234,649,972.63	54.66%	194,677,133.86	45.34%
合计	46,530	16,122.38	388,263,776.07	51.76%	361,910,585.39	48.24%

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	638,819.37	0.1991%
	招商沪深 300 指数增强 C	21,957.24	0.0051%
	合计	660,776.61	0.0881%

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

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	招商沪深 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	299,725,495.44	163,756,383.90
本报告期基金总申购份额	58,577,977.99	423,805,550.98
减：本报告期基金总赎回份额	37,456,218.46	158,234,828.39
本报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-	-
本报告期期末基金份额总额	320,847,254.97	429,327,106.49

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，经中国银行股份有限公司研究决定，郭德秋先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 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	3,040,173,193.28	100.00%	443,570.33	100.00%	-
财通证券	3	-	-	-	-	-
长城证券	3	-	-	-	-	-
长江证券	4	-	-	-	-	-
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	3	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	4	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	3	-	-	-	-	-
国投证券	6	-	-	-	-	-
国新证券	2	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	4	-	-	-	-	-
华泰证券	4	-	-	-	-	-
华西证券	3	-	-	-	-	-
华源证券	2	-	-	-	-	-
华鑫证券	2	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
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	5	-	-	-	-	-
万和证券	1	-	-	-	-	-
五矿证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	3	-	-	-	-	-
信达证券	7	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
粤开证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	6	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
中航证券	2	-	-	-	-	-
中金财富 证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	5	-	-	-	-	-

中泰证券	3	-	-	-	-	-
中信建投 证券	5	-	-	-	-	-
中信证券	11	-	-	-	-	-
中银国际 证券	4	-	-	-	-	-
中邮证券	2	-	-	-	-	-
甬兴证券	2	-	-	-	-	-

注：本报告期内，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	20,217,291.00	100.00%	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
国新证券	-	-	-	-	-	-

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	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
华源证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-
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关于终止北京中期时代基金销售有限公司办理旗下基金销售业务的公告	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	2024-01-18
2	招商基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 4 季度报告提示性公告	证券时报及基金管理人网站	2024-01-19
3	招商沪深 300 指数增强型证券投资基金 2023 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	2024-01-19
4	招商沪深 300 指数增强型证券投资基金更新的招募说明书（二零二四年第一号）	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	2024-02-08
5	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	2024-02-08
6	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	2024-02-08
7	招商基金管理有限公司旗下基金 2023 年年度报告提示性公告	证券时报及基金管理人网站	2024-03-29
8	招商沪深 300 指数增强型证券投资基金 2023 年年度报告	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	2024-03-29
9	招商基金管理有限公司旗下基金 2024 年第 1 季度报告提示性公告	证券时报及基金管理人网站	2024-04-19
10	招商沪深 300 指数增强型证券投资基金 2024 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	2024-04-19
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	2024-05-18

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	2024-06-05
13	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	2024-06-28
14	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	2024-06-28

## § 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.cmfchina.com>

招商基金管理有限公司

2024 年 8 月 30 日