

招商中证 500 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.....	7
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.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	11
§5 托管人报告.....	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	11
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 净资产变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告.....	38
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	38
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.....	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	55
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.....	55
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.....	56
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.....	56
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.....	56
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	56

7.12 投资组合报告附注.....	56
§8 基金份额持有人信息.....	58
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	58
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	58
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.....	59
§9 开放式基金份额变动.....	59
§10 重大事件揭示.....	59
10.1 基金份额持有人大会决议.....	59
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.....	59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	60
10.4 基金投资策略的改变.....	60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	60
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.....	60
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	60
10.8 其他重大事件.....	64
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	65
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	65
§12 备查文件目录.....	66
12.1 备查文件目录.....	66
12.2 存放地点.....	66
12.3 查阅方式.....	66

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	招商中证 500 指数增强型证券投资基金	
基金简称	招商中证 500 指数增强	
基金主代码	004192	
交易代码	004192	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 5 月 17 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	134,173,948.46 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	招商中证 500 指数增强 A	招商中证 500 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	004192	004193
报告期末下属分级基金的份 额总额	64,787,136.60 份	69,386,811.86 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：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	中证 500 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
		许俊
		010-66596688
		fxjd_hq@bank-of-china.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	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.cmfcchina.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、招商中证 500 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	-301,038.06
本期利润	-2,481,743.92
加权平均基金份额本期利润	-0.0397
本期加权平均净值利润率	-3.24%
本期基金份额净值增长率	-3.25%
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	12,829,626.22
期末可供分配基金份额利润	0.1980
期末基金资产净值	77,616,762.82
期末基金份额净值	1.1980
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	19.80%

2、招商中证 500 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	-303,777.70

本期利润	1,474,445.37
加权平均基金份额本期利润	0.0194
本期加权平均净值利润率	1.61%
本期基金份额净值增长率	-3.45%
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	12,085,170.92
期末可供分配基金份额利润	0.1742
期末基金资产净值	81,471,982.78
期末基金份额净值	1.1742
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	17.42%

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

招商中证 500 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	-4.40%	0.89%	-6.55%	0.91%	2.15%	-0.02%
过去三个月	-2.66%	1.07%	-6.16%	1.09%	3.50%	-0.02%
过去六个月	-3.25%	1.50%	-8.46%	1.53%	5.21%	-0.03%
过去一年	-8.77%	1.17%	-16.71%	1.21%	7.94%	-0.04%
过去三年	-13.16%	1.12%	-26.01%	1.14%	12.85%	-0.02%
自基金合同生效起至今	19.80%	1.22%	-16.30%	1.25%	36.10%	-0.03%

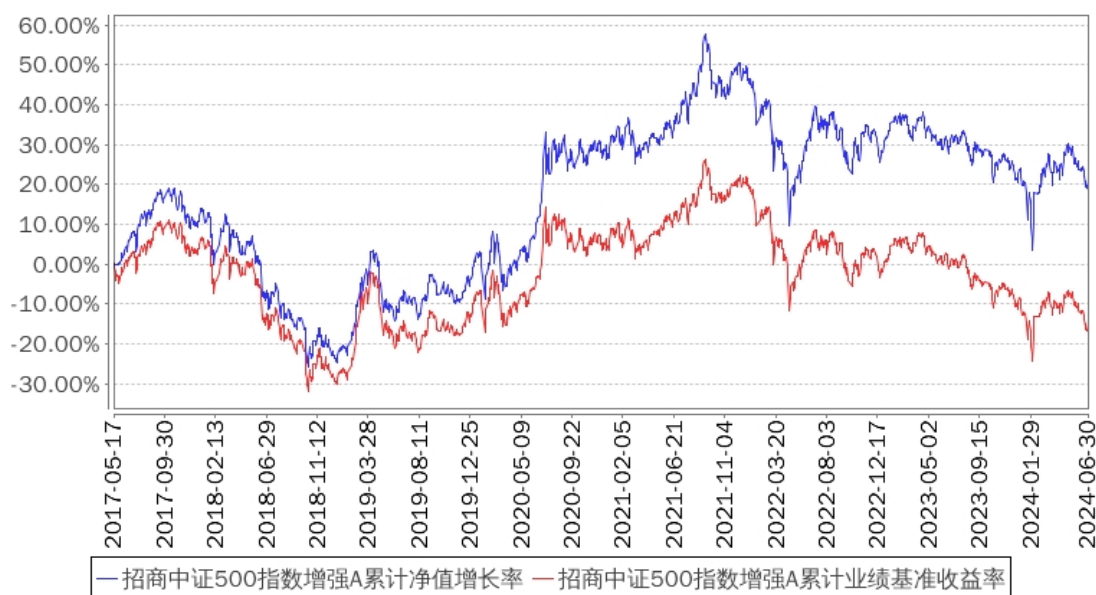
招商中证 500 指数增强 C

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	-4.42%	0.89%	-6.55%	0.91%	2.13%	-0.02%
过去三个月	-2.76%	1.07%	-6.16%	1.09%	3.40%	-0.02%

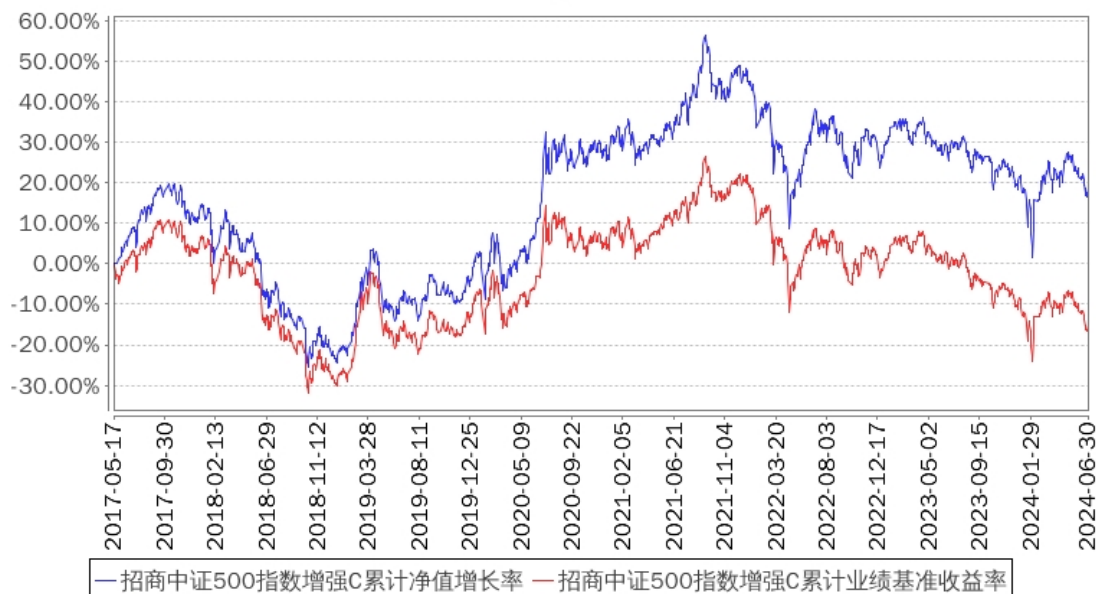
过去六个月	-3.45%	1.50%	-8.46%	1.53%	5.01%	-0.03%
过去一年	-9.13%	1.17%	-16.71%	1.21%	7.58%	-0.04%
过去三年	-14.20%	1.12%	-26.01%	1.14%	11.81%	-0.02%
自基金合同生效起至今	17.42%	1.22%	-16.30%	1.25%	33.72%	-0.03%

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

招商中证500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



招商中证500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		
邓童	本基金基金经理	2021 年 11 月 23 日	-	11	男，硕士。2012 年 7 月加入招商基金管理有限公司量化投资部，曾任研究员。现任招商中证 500 指数增强型证券投资基金、招商中证大宗商品股票指数证券投资基金（LOF）、招商中证煤炭等权指数证券投资基金、招商北证 50 成份指数型发起式证券投资基金、招商中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、招商中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金、招商国证 2000 指数增强型证券投资基金、招商安和债券型证券投资基金、招商安康债券型证券投资基金、招商中证红利低波动 100 指数型发起式证券投资基金、招商上证科创板 50 成份增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理，兼任投资经理。

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

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
邓童	公募基金	11	10,444,447,022.27	2021 年 11 月 23 日
	私募资产管理计划	1	950,516,933.52	2013 年 11 月 26 日

	其他组合	-	-	-
	合计	12	11,394,963,955.79	-

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 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

报告期内，中证 500 指数持续下跌，在年初的流动性冲击中中证 500 回调幅度较大，后随着流动性的恢复快速反弹，但市场的流动性依然不足，指数未恢复至前期高位，中证 500 在经历了一季度末的反弹后，二季度难以持续，自 5 月起持续下跌。小盘股在二季度弱于大盘股。虽然短期内的流动性担忧缓解，但市场对小盘股尤其是微盘股的长期展望偏向悲观，中证 500 虽然属于中盘，但也受到一定拖累，不如大盘指数抗跌。从风格上看，价值风格在上半年持续占优，成长风格在二季度初有弱反弹态势，但在指数整体下跌背景下依然难有大的起色。本基金在上半年相对基准有一定的超额收益，不过由于基准下跌幅度较大，本报告期内净值依然下跌。

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-3.25%，同期业绩基准增长率为-8.46%，C 类份额净值增长率为-3.45%，同期业绩基准增长率为-8.46%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望市场，流动性是否能够恢复成为中小盘个股反弹的关键，这需要有增量资金进入或前期退出资金的信心恢复，核心还是需要经济基本面的企稳以及对非市场因素担忧的消退。指数整体涨跌难以预测，相对基准的超额收益就显得更加重要，在策略方面，本产品会继续采用多模型配置的框架，力争在较低的跟踪误差下创造出持续的超额收益。我们也将持续加强新因子及新方法的研究，尽力保持策略超额收益的持续性和多元性。

4.6 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：招商中证 500 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	12,576,723.39	14,343,141.25
结算备付金		807,694.32	1,977,024.75
存出保证金		610,684.89	788,801.55
交易性金融资产	6.4.7.2	145,519,781.62	134,391,325.38
其中：股票投资		145,118,087.15	134,008,238.98
基金投资		-	-
债券投资		401,694.47	383,086.40
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		155,021.99	198,486.63
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		159,669,906.21	151,698,779.56
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		0.16	2,553,759.88
应付赎回款		156,677.29	136,570.79
应付管理人报酬		160,410.13	141,142.77
应付托管费		20,051.27	17,642.84
应付销售服务费		27,403.39	21,279.01
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1.69	1.74
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	216,616.68	115,363.94
负债合计		581,160.61	2,985,760.97
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	134,173,948.46	121,171,725.87
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	24,914,797.14	27,541,292.72
净资产合计		159,088,745.60	148,713,018.59
负债和净资产总计		159,669,906.21	151,698,779.56

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，招商中证 500 指数增强 A 份额净值 1.1980 元，基金份额总额 64,787,136.60 份；招商中证 500 指数增强 C 份额净值 1.1742 元，基金份额总额 69,386,811.86 份；总份额合计 134,173,948.46 份。

6.2 利润表

会计主体：招商中证 500 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		483,446.86	5,967,273.40
1.利息收入		35,015.31	30,937.68
其中：存款利息收入	6.4.7.9	35,015.31	30,937.68
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息 收入		-	-
买入返售金融资产 收入		-	-
其他利息收入		-	-

2.投资收益（损失以“-”填列）		816,061.61	4,579,515.69
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-1,552,248.46	2,577,795.25
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	1,605.64	12,108.62
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	374,868.71	239,995.22
股利收益	6.4.7.15	1,991,835.72	1,749,616.60
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	-402,482.79	1,316,224.38
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	34,852.73	40,595.65
减：二、营业总支出		1,490,745.41	1,361,621.22
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	1,007,316.07	923,478.49
其中：暂估管理人报酬		-	-
2.托管费	6.4.10.2.2	125,914.45	115,434.88
3.销售服务费	6.4.10.2.3	183,485.97	149,216.75
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		2,008.02	1,337.11
8.其他费用	6.4.7.19	172,020.90	172,153.99
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,007,298.55	4,605,652.18
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,007,298.55	4,605,652.18
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-1,007,298.55	4,605,652.18

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：招商中证 500 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	121,171,725.87	-	27,541,292.72	148,713,018.59
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	121,171,725.87	-	27,541,292.72	148,713,018.59
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	13,002,222.59	-	-2,626,495.58	10,375,727.01
（一）、综合收益总额	-	-	-1,007,298.55	-1,007,298.55
（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）	13,002,222.59	-	-1,619,197.03	11,383,025.56
其中：1.基金申购款	55,968,605.86	-	7,773,110.14	63,741,716.00
2.基金赎回款	-42,966,383.27	-	-9,392,307.17	-52,358,690.44
（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	134,173,948.46	-	24,914,797.14	159,088,745.60
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	98,782,679.47	-	26,890,207.12	125,672,886.59
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	98,782,679.47	-	26,890,207.12	125,672,886.59
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	15,008,678.75	-	7,644,952.62	22,653,631.37
（一）、综合收益总额	-	-	4,605,652.18	4,605,652.18
（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）	15,008,678.75	-	3,039,300.44	18,047,979.19
其中：1.基金申购款	68,960,441.53	-	21,763,040.81	90,723,482.34
2.基金赎回款	-53,951,762.78	-	-18,723,740.37	-72,675,503.15
（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	113,791,358.22	-	34,535,159.74	148,326,517.96

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

招商中证 500 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》《招商中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规的规定，经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]3114 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。根据销售服务费收取方式的不同，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 332,908,992.33 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 00144 号验资报告。《招商中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)于 2017 年 5 月 17 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%，投资于中证 500 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：中证 500 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”）、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	12,576,723.39
等于：本金	12,575,620.28
加：应计利息	1,103.11
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	12,576,723.39

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	149,080,063.63	-	145,118,087.15	-3,961,976.48	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	329,298.29	594.48	401,694.47	71,801.70
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	329,298.29	594.48	401,694.47	71,801.70
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	149,409,361.92	594.48	145,519,781.62	-3,890,174.78	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	5,181,960.00	-	-	-
其中：股指期货投资	5,181,960.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	5,181,960.00	-	-	-

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
IC2407	IC2407	5.00	4,917,600.00	-264,360.00
合计				-264,360.00
减：可抵销期货暂收款				-264,360.00
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

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	91.94
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	46,852.40
其中：交易所市场	46,852.40
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	69,672.34

应付指数使用费	100,000.00
合计	216,616.68

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

招商中证 500 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	61,244,378.55	61,244,378.55
本期申购	13,013,027.32	13,013,027.32
本期赎回（以“-”号填列）	-9,470,269.27	-9,470,269.27
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期末	64,787,136.60	64,787,136.60

招商中证 500 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	59,927,347.32	59,927,347.32
本期申购	42,955,578.54	42,955,578.54
本期赎回（以“-”号填列）	-33,496,114.00	-33,496,114.00
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期末	69,386,811.86	69,386,811.86

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

招商中证 500 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	14,566,858.52	26,839.10	14,593,697.62
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	14,566,858.52	26,839.10	14,593,697.62
本期利润	-301,038.06	-2,180,705.86	-2,481,743.92
本期基金份额交易产生的变动数	820,428.45	-102,755.93	717,672.52
其中：基金申购款	2,972,097.87	-230,791.29	2,741,306.58
基金赎回款	-2,151,669.42	128,035.36	-2,023,634.06
本期已分配利润	-	-	-
本期末	15,086,248.91	-2,256,622.69	12,829,626.22

招商中证 500 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	12,826,010.46	121,584.64	12,947,595.10
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	12,826,010.46	121,584.64	12,947,595.10
本期利润	-303,777.70	1,778,223.07	1,474,445.37
本期基金份额交易产生的变动数	1,821,376.98	-4,158,246.53	-2,336,869.55
其中：基金申购款	8,631,060.19	-3,599,256.63	5,031,803.56
基金赎回款	-6,809,683.21	-558,989.90	-7,368,673.11
本期已分配利润	-	-	-
本期末	14,343,609.74	-2,258,438.82	12,085,170.92

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	21,811.95
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	13,063.94
其他	139.42
合计	35,015.31

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	-1,552,248.46
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	-1,552,248.46

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	301,068,708.97
减：卖出股票成本总额	302,341,040.35
减：交易费用	279,917.08
买卖股票差价收入	-1,552,248.46

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	1,890.64
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-285.00
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	1,605.64

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	510,250.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	500,285.00
减：应计利息总额	10,250.00
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-285.00

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	374,868.71

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	1,991,835.72
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,991,835.72

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	17,557.21

——股票投资	8,298.35
——债券投资	9,258.86
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-420,040.00
——权证投资	-
——期货投资	-420,040.00
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	-402,482.79

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	34,852.73
合计	34,852.73

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	10,000.00
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
其他	102,348.56
合计	172,020.90

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	1,007,316.07	923,478.49
其中：应支付销售机构的客户维护费	345,005.29	385,806.66
应支付基金管理人的净管理费	662,310.78	537,671.83
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：

日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×1.20%÷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	125,914.45	115,434.88

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 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		
	招商中证 500 指数增强 A	招商中证 500 指数增强 C	合计
招商基金管理有限公司	-	66,674.05	66,674.05
招商银行	-	61,110.06	61,110.06
招商证券	-	37.18	37.18
合计	-	127,821.29	127,821.29
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		
	招商中证 500 指数增强 A	招商中证 500 指数增强 C	合计
招商基金管理有限公司	-	8,294.61	8,294.61
招商银行	-	85,225.51	85,225.51
招商证券	-	-	-
合计	-	93,520.12	93,520.12

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自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自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	12,576,723.39	21,811.95	12,677,560.31	19,702.09

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	628	54,610.88

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	2,298	58,024.50
招商证券	301428	世纪恒通	新股获配	1,430	37,680.50

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	125	2,173.75	2,575.00	-
001379	腾达科技	2024年1月11日	6个月	新股流通受限	16.98	13.48	111	1,884.78	1,496.28	-
001387	雪祺电气	2024年1月4日	6个月	新股流通受限	15.38	15.25	134	1,584.14	2,043.50	-
001389	广合科技	2024年3月26日	6个月	新股流通受限	17.43	34.56	154	2,684.22	5,322.24	-
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26日	6个月	新股流通受限	28.01	37.83	127	3,557.27	4,804.41	-
301536	星辰科技	2024年3月20日	6个月	新股流通受限	16.16	32.27	333	5,381.28	10,745.91	-
301538	骏鼎达	2024年3月13日	6个月	新股流通受限	55.82	91.24	123	4,912.16	11,222.52	-
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	396	4,704.48	7,516.08	-
301566	达利凯普	2023年12	6个月	新股流通受限	8.90	16.97	400	3,560.00	6,788.00	-

		月 22 日								
301580	爱迪特	2024 年 6 月 19 日	6 个月	新股流通受限	44.95	65.93	106	4,764.70	6,988.58	-
301587	中瑞股份	2024 年 3 月 27 日	6 个月	新股流通受限	21.73	25.26	230	4,997.90	5,809.80	-
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	284	20,048.62	53,394.84	-
301591	肯特股份	2024 年 2 月 20 日	6 个月	新股流通受限	19.43	36.98	178	3,458.54	6,582.44	-
603082	北自科技	2024 年 1 月 23 日	6 个月	新股流通受限	21.28	29.49	69	1,468.32	2,034.81	-
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	791	14,752.15	14,752.15	-
603285	键邦股份	2024 年 6 月 28 日	6 个月	新股流通受限	18.65	18.65	88	1,641.20	1,641.20	-
603312	西典新能	2024 年 1 月 4 日	6 个月	新股流通受限	29.02	25.36	55	1,596.10	1,394.80	-
603325	博隆技术	2024 年 1 月 3 日	6 个月	新股流通受限	72.46	68.06	23	1,666.58	1,565.38	-
603341	龙旗科技	2024 年 2 月 23 日	6 个月	新股流通受限	26.00	37.49	81	2,106.00	3,036.69	-
603344	星德胜	2024 年 3 月 13 日	6 个月	新股流通受限	19.18	22.66	103	1,975.54	2,333.98	-
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	804	16,530.24	16,530.24	-
603350	安乃达	2024 年 6 月 26 日	6 个月	新股流通受限	20.56	20.56	90	1,850.40	1,850.40	-
603375	盛景微	2024	6 个月	新股流通	38.18	38.90	43	1,641.74	1,672.70	-

		年 1 月 17 日		受限						
603381	永臻股份	2024 年 6 月 19 日	6 个月	新股流通受限	23.35	25.13	74	1,727.90	1,859.62	-
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	233	5,279.78	3,702.37	-
688691	灿芯股份	2024 年 4 月 2 日	6 个月	新股流通受限	19.86	42.51	208	4,130.88	8,842.08	-
688692	达梦数据	2024 年 6 月 4 日	6 个月	新股流通受限	86.96	174.93	63	5,478.48	11,020.59	-
688695	中创股份	2024 年 3 月 6 日	6 个月	新股流通受限	22.43	31.55	158	3,543.94	4,984.90	-
688709	成都华微	2024 年 1 月 31 日	6 个月	新股流通受限	15.69	18.79	289	4,534.41	5,430.31	-
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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
AAA	231,091.99	221,257.02
AAA 以下	170,602.48	161,829.38
未评级	-	-
合计	401,694.47	383,086.40

注：上述评级均由经中国证监会核准从事证券市场资信评级业务的评级机构做出。

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	12,576,723.39	-	-	-	12,576,723.39
结算备付金	807,694.32	-	-	-	807,694.32
存出保证金	20,572.89	-	-	590,112.00	610,684.89
交易性金融资产	-	89,476.29	312,218.18	145,118,087.15	145,519,781.62
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	-	-	-	155,021.99	155,021.99
应收清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	13,404,990.60	89,476.29	312,218.18	145,863,221.14	159,669,906.21
负债					
应付赎回款	-	-	-	156,677.29	156,677.29
应付管理人报酬	-	-	-	160,410.13	160,410.13
应付托管费	-	-	-	20,051.27	20,051.27
应付清算款	-	-	-	0.16	0.16
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	27,403.39	27,403.39
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	1.69	1.69
其他负债	-	-	-	216,616.68	216,616.68
负债总计	-	-	-	581,160.61	581,160.61
利率敏感度缺口	13,404,990.60	89,476.29	312,218.18	145,282,060.53	159,088,745.60
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	14,343,141.25	-	-	-	14,343,141.25
结算备付金	1,977,024.75	-	-	-	1,977,024.75
存出保证金	8,566.35	-	-	780,235.20	788,801.55
交易性金融资产	-	93,346.15	289,740.25	134,008,238.98	134,391,325.38
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	-	-	-	198,486.63	198,486.63
应收清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	16,328,732.35	93,346.15	289,740.25	134,986,960.81	151,698,779.56
负债					
应付赎回款	-	-	-	136,570.79	136,570.79
应付管理人报酬	-	-	-	141,142.77	141,142.77
应付托管费	-	-	-	17,642.84	17,642.84
应付清算款	-	-	-	2,553,759.88	2,553,759.88
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	21,279.01	21,279.01
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	1.74	1.74
其他负债	-	-	-	115,363.94	115,363.94
负债总计	-	-	-	2,985,760.97	2,985,760.97
利率敏感度缺口	16,328,732.35	93,346.15	289,740.25	132,001,199.84	148,713,018.59

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	-9,794.04
	2. 市场利率平行下降 50 个基点	10,095.13	10,451.11

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	145,118,087.15	91.22	134,008,238.98	90.11
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	145,118,087.15	91.22	134,008,238.98	90.11

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%	7,255,904.36	6,700,411.95
	2. 权益性投资的市场价格下降 5%	-7,255,904.36	-6,700,411.95

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	145,283,608.59	133,952,032.56
第二层次	35,726.99	15,953.89
第三层次	200,446.04	423,338.93
合计	145,519,781.62	134,391,325.38

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	145,118,087.15	90.89
	其中：股票	145,118,087.15	90.89
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	401,694.47	0.25
	其中：债券	401,694.47	0.25

	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	13,384,417.71	8.38
8	其他各项资产	765,706.88	0.48
9	合计	159,669,906.21	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	543,626.00	0.34
B	采矿业	5,582,269.00	3.51
C	制造业	80,784,523.26	50.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,534,824.00	4.11
E	建筑业	3,340,205.00	2.10
F	批发和零售业	3,020,774.32	1.90
G	交通运输、仓储和邮政业	3,386,811.00	2.13
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,676,749.20	4.20
J	金融业	5,820,861.30	3.66
K	房地产业	787,356.00	0.49
L	租赁和商务服务业	1,092,265.00	0.69
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	588,712.00	0.37
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	2,156,396.00	1.36
S	综合	326,656.00	0.21
	合计	120,642,028.08	75.83

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	1,059,235.00	0.67

C	制造业	20,349,423.80	12.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	173,013.00	0.11
F	批发和零售业	260,512.70	0.16
G	交通运输、仓储和邮政业	17,623.08	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,398,133.97	0.88
J	金融业	603,437.00	0.38
K	房地产业	141,253.00	0.09
L	租赁和商务服务业	1,759.36	0.00
M	科学研究和技术服务业	282,066.91	0.18
N	水利、环境和公共设施管理业	100,961.25	0.06
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	86,240.00	0.05
Q	卫生和社会工作	2,400.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	24,476,059.07	15.39

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	600521	华海药业	91,600	1,561,780.00	0.98
2	000830	鲁西化工	133,600	1,548,424.00	0.97
3	600066	宇通客车	56,500	1,457,700.00	0.92
4	000703	恒逸石化	200,200	1,419,418.00	0.89
5	300529	健帆生物	50,900	1,384,989.00	0.87
6	000887	中鼎股份	110,500	1,352,520.00	0.85
7	601717	郑煤机	89,600	1,326,080.00	0.83
8	601231	环旭电子	81,600	1,309,680.00	0.82
9	600839	四川长虹	290,700	1,305,243.00	0.82
10	300207	欣旺达	85,600	1,298,552.00	0.82
11	601636	旗滨集团	201,000	1,296,450.00	0.81

12	600038	中直股份	30,900	1,270,299.00	0.80
13	002273	水晶光电	74,400	1,263,312.00	0.79
14	000039	中集集团	132,700	1,228,802.00	0.77
15	603658	安图生物	26,500	1,220,855.00	0.77
16	600704	物产中大	279,700	1,213,898.00	0.76
17	603160	汇顶科技	17,500	1,203,125.00	0.76
18	600582	天地科技	167,500	1,154,075.00	0.73
19	002008	大族激光	55,200	1,148,160.00	0.72
20	000709	河钢股份	579,600	1,124,424.00	0.71
21	002064	华峰化学	156,500	1,122,105.00	0.71
22	600282	南钢股份	217,100	1,081,158.00	0.68
23	002078	太阳纸业	76,100	1,061,595.00	0.67
24	603228	景旺电子	33,200	1,055,760.00	0.66
25	000630	铜陵有色	290,600	1,049,066.00	0.66
26	002152	广电运通	99,700	1,042,862.00	0.66
27	002465	海格通信	100,300	1,039,108.00	0.65
28	300394	天孚通信	11,600	1,025,672.00	0.64
29	300001	特锐德	48,000	965,760.00	0.61
30	600820	隧道股份	143,000	933,790.00	0.59
31	000400	许继电气	26,400	908,424.00	0.57
32	601233	桐昆股份	56,800	906,528.00	0.57
33	600699	均胜电子	60,800	901,056.00	0.57
34	600299	安迪苏	90,100	873,970.00	0.55
35	002156	通富微电	37,300	835,147.00	0.52
36	002563	森马服饰	142,800	829,668.00	0.52
37	601139	深圳燃气	121,300	810,284.00	0.51
38	300017	网宿科技	100,200	791,580.00	0.50
39	600928	西安银行	241,000	788,070.00	0.50
40	002558	巨人网络	83,200	785,408.00	0.49
41	002517	恺英网络	80,400	767,820.00	0.48
42	002138	顺络电子	27,200	746,912.00	0.47
43	603786	科博达	11,200	718,480.00	0.45
44	002155	湖南黄金	39,300	711,330.00	0.45
45	601611	中国核建	87,900	711,111.00	0.45
46	002128	电投能源	33,000	696,300.00	0.44
47	600143	金发科技	105,200	695,372.00	0.44
48	600707	彩虹股份	102,000	694,620.00	0.44
49	601216	君正集团	188,200	694,458.00	0.44
50	600498	烽火通信	42,900	682,110.00	0.43
51	601058	赛轮轮胎	47,700	667,800.00	0.42
52	002340	格林美	103,100	656,747.00	0.41
53	000066	中国长城	74,600	652,750.00	0.41
54	002444	巨星科技	26,400	652,080.00	0.41

55	002028	思源电气	9,300	622,170.00	0.39
56	300253	卫宁健康	103,200	608,880.00	0.38
57	002608	江苏国信	77,600	601,400.00	0.38
58	600170	上海建工	274,800	590,820.00	0.37
59	601168	西部矿业	32,800	588,760.00	0.37
60	600737	中粮糖业	60,800	583,072.00	0.37
61	000883	湖北能源	96,100	577,561.00	0.36
62	000050	深天马 A	78,801	573,671.28	0.36
63	000921	海信家电	17,700	570,648.00	0.36
64	600177	雅戈尔	79,900	568,888.00	0.36
65	300724	捷佳伟创	10,400	561,704.00	0.35
66	000027	深圳能源	76,700	559,910.00	0.35
67	002385	大北农	143,900	554,015.00	0.35
68	000513	丽珠集团	14,800	550,708.00	0.35
69	002572	索菲亚	35,200	539,616.00	0.34
70	601666	平煤股份	48,100	538,720.00	0.34
71	000967	盈峰环境	126,700	535,941.00	0.34
72	603568	伟明环保	26,000	535,080.00	0.34
73	002831	裕同科技	20,900	534,831.00	0.34
74	000032	深桑达 A	35,200	527,296.00	0.33
75	002065	东华软件	115,200	520,704.00	0.33
76	603927	中科软	28,480	515,203.20	0.32
77	300677	英科医疗	19,200	514,752.00	0.32
78	600096	云天化	26,300	510,746.00	0.32
79	002019	亿帆医药	39,800	491,928.00	0.31
80	002557	洽洽食品	17,300	487,687.00	0.31
81	300502	新易盛	4,600	485,530.00	0.31
82	600166	福田汽车	213,300	479,925.00	0.30
83	600377	宁沪高速	38,000	478,800.00	0.30
84	601608	中信重工	124,100	472,821.00	0.30
85	601077	渝农商行	92,600	464,852.00	0.29
86	601997	贵阳银行	87,400	460,598.00	0.29
87	600901	江苏金租	90,960	459,348.00	0.29
88	688475	萤石网络	13,200	450,252.00	0.28
89	300251	光线传媒	53,500	449,935.00	0.28
90	600008	首创环保	166,800	447,024.00	0.28
91	300002	神州泰岳	54,800	444,976.00	0.28
92	600511	国药股份	14,300	440,297.00	0.28
93	000958	电投产融	119,200	436,272.00	0.27
94	603939	益丰药房	17,560	431,098.00	0.27
95	600985	淮北矿业	25,500	426,870.00	0.27
96	601000	唐山港	88,500	415,950.00	0.26
97	600885	宏发股份	14,700	406,896.00	0.26

98	001203	大中矿业	42,200	405,542.00	0.25
99	600126	杭钢股份	98,200	403,602.00	0.25
100	600873	梅花生物	39,900	399,798.00	0.25
101	600956	新天绿能	48,400	395,428.00	0.25
102	002739	万达电影	32,200	389,298.00	0.24
103	000937	冀中能源	57,900	387,930.00	0.24
104	688188	柏楚电子	2,080	383,864.00	0.24
105	600848	上海临港	42,000	382,620.00	0.24
106	600380	健康元	34,100	380,897.00	0.24
107	600352	浙江龙盛	43,900	377,101.00	0.24
108	000729	燕京啤酒	42,600	376,158.00	0.24
109	600755	厦门国贸	52,400	375,708.00	0.24
110	603379	三美股份	9,500	371,830.00	0.23
111	600536	中国软件	12,400	371,008.00	0.23
112	000423	东阿阿胶	5,800	363,080.00	0.23
113	603225	新凤鸣	22,800	355,452.00	0.22
114	002532	天山铝业	43,600	353,596.00	0.22
115	600339	中油工程	113,100	352,872.00	0.22
116	600398	海澜之家	37,500	346,500.00	0.22
117	002120	韵达股份	44,300	342,882.00	0.22
118	600098	广州发展	53,300	341,120.00	0.21
119	603606	东方电缆	6,800	331,908.00	0.21
120	600350	山东高速	37,300	330,105.00	0.21
121	600157	永泰能源	278,900	329,102.00	0.21
122	600062	华润双鹤	16,800	328,944.00	0.21
123	601228	广州港	107,300	327,265.00	0.21
124	600673	东阳光	46,400	326,656.00	0.21
125	600566	济川药业	10,200	323,442.00	0.20
126	601992	金隅集团	233,700	320,169.00	0.20
127	002653	海思科	10,400	319,280.00	0.20
128	601198	东兴证券	39,900	317,604.00	0.20
129	601990	南京证券	41,300	317,184.00	0.20
130	603298	杭叉集团	16,100	316,204.00	0.20
131	600871	石化油服	180,800	314,592.00	0.20
132	002945	华林证券	31,500	314,370.00	0.20
133	300054	鼎龙股份	13,800	312,984.00	0.20
134	600153	建发股份	34,700	309,871.00	0.19
135	688516	奥特维	7,397	309,268.57	0.19
136	603893	瑞芯微	5,200	307,684.00	0.19
137	000818	航锦科技	13,900	306,912.00	0.19
138	601928	凤凰传媒	27,900	305,784.00	0.19
139	603156	养元饮品	14,300	304,161.00	0.19
140	600872	中炬高新	13,000	294,970.00	0.19

141	000932	华菱钢铁	66,300	293,709.00	0.18
142	600549	厦门钨业	17,000	293,250.00	0.18
143	300558	贝达药业	9,000	292,950.00	0.18
144	603486	科沃斯	6,200	292,516.00	0.18
145	688169	石头科技	743	291,701.80	0.18
146	002958	青农商行	104,300	279,524.00	0.18
147	300144	宋城演艺	34,300	275,429.00	0.17
148	601966	玲珑轮胎	14,800	271,876.00	0.17
149	601019	山东出版	22,500	265,950.00	0.17
150	600739	辽宁成大	31,000	259,470.00	0.16
151	601577	长沙银行	31,600	258,488.00	0.16
152	601665	齐鲁银行	51,800	254,338.00	0.16
153	600271	航天信息	34,100	250,976.00	0.16
154	601098	中南传媒	19,800	245,916.00	0.15
155	601298	青岛港	24,900	238,044.00	0.15
156	002966	苏州银行	31,600	237,000.00	0.15
157	601128	常熟银行	31,190	236,108.30	0.15
158	601156	东航物流	11,500	234,025.00	0.15
159	600968	海油发展	56,800	234,016.00	0.15
160	600483	福能股份	19,900	232,034.00	0.15
161	002281	光迅科技	6,200	231,694.00	0.15
162	600863	内蒙华电	49,900	231,536.00	0.15
163	000960	锡业股份	14,800	229,252.00	0.14
164	601991	大唐发电	76,100	229,061.00	0.14
165	000598	兴蓉环境	30,400	228,608.00	0.14
166	601567	三星医疗	6,500	227,500.00	0.14
167	603979	金诚信	4,500	227,385.00	0.14
168	601598	中国外运	40,300	226,889.00	0.14
169	300373	扬杰科技	5,800	225,620.00	0.14
170	002595	豪迈科技	5,900	225,203.00	0.14
171	002203	海亮股份	28,200	225,036.00	0.14
172	600970	中材国际	18,600	224,316.00	0.14
173	600373	中文传媒	15,100	224,084.00	0.14
174	001872	招商港口	11,600	223,300.00	0.14
175	600528	中铁工业	30,500	223,260.00	0.14
176	600801	华新水泥	16,200	222,750.00	0.14
177	002414	高德红外	37,800	222,642.00	0.14
178	600598	北大荒	17,800	222,322.00	0.14
179	002223	鱼跃医疗	5,900	221,840.00	0.14
180	600642	申能股份	25,100	221,633.00	0.14
181	300866	安克创新	3,100	220,751.00	0.14
182	000878	云南铜业	17,700	220,542.00	0.14
183	600998	九州通	45,172	220,439.36	0.14

184	000683	远兴能源	31,900	220,429.00	0.14
185	002625	光启技术	12,700	220,345.00	0.14
186	000156	华数传媒	34,900	219,172.00	0.14
187	001286	陕西能源	19,000	219,070.00	0.14
188	600988	赤峰黄金	13,400	218,956.00	0.14
189	002508	老板电器	9,900	218,790.00	0.14
190	603056	德邦股份	16,700	218,770.00	0.14
191	600348	华阳股份	21,900	218,124.00	0.14
192	603338	浙江鼎力	3,600	217,512.00	0.14
193	600580	卧龙电驱	17,900	217,485.00	0.14
194	002372	伟星新材	14,100	217,422.00	0.14
195	600995	南网储能	22,500	217,350.00	0.14
196	600329	达仁堂	6,700	217,013.00	0.14
197	600517	国网英大	50,100	216,933.00	0.14
198	601108	财通证券	32,700	216,147.00	0.14
199	603345	安井食品	2,900	215,499.00	0.14
200	600967	内蒙一机	29,900	215,280.00	0.14
201	000785	居然之家	88,300	214,569.00	0.13
202	601568	北元集团	57,800	214,438.00	0.13
203	600663	陆家嘴	24,300	214,326.00	0.13
204	000987	越秀资本	43,200	214,272.00	0.13
205	600141	兴发集团	11,200	213,696.00	0.13
206	689009	九号公司	5,800	213,498.00	0.13
207	601555	东吴证券	36,100	212,990.00	0.13
208	000933	神火股份	10,500	212,415.00	0.13
209	002353	杰瑞股份	6,000	210,480.00	0.13
210	002185	华天科技	25,500	207,825.00	0.13
211	600060	海信视像	8,400	207,816.00	0.13
212	600131	国网信通	12,100	204,127.00	0.13
213	603529	爱玛科技	7,400	202,242.00	0.13
214	600315	上海家化	11,300	200,914.00	0.13
215	600418	江淮汽车	12,600	199,584.00	0.13
216	002262	恩华药业	8,300	197,042.00	0.12
217	000623	吉林敖东	14,200	190,280.00	0.12
218	603883	老百姓	10,361	190,227.96	0.12
219	300009	安科生物	21,900	187,026.00	0.12
220	600021	上海电力	18,900	186,921.00	0.12
221	000998	隆平高科	18,800	184,804.00	0.12
222	300024	机器人	18,900	184,086.00	0.12
223	300357	我武生物	9,100	184,002.00	0.12
224	300383	光环新网	21,700	183,365.00	0.12
225	002439	启明星辰	10,600	182,956.00	0.12
226	688617	惠泰医疗	400	182,440.00	0.11

227	601212	白银有色	64,300	178,754.00	0.11
228	600079	人福医药	10,400	178,568.00	0.11
229	300474	景嘉微	2,800	177,044.00	0.11
230	603456	九洲药业	12,900	176,988.00	0.11
231	600500	中化国际	50,400	175,896.00	0.11
232	002506	协鑫集成	90,200	174,988.00	0.11
233	300776	帝尔激光	3,800	174,648.00	0.11
234	002056	横店东磁	13,900	173,333.00	0.11
235	300604	长川科技	6,100	165,737.00	0.10
236	002373	千方科技	18,200	165,074.00	0.10
237	688153	唯捷创芯	4,426	163,762.00	0.10
238	002865	钧达股份	4,200	161,196.00	0.10
239	001227	兰州银行	67,300	160,174.00	0.10
240	603087	甘李药业	3,400	157,488.00	0.10
241	600535	天士力	12,300	154,734.00	0.10
242	600022	山东钢铁	125,500	153,110.00	0.10
243	688029	南微医学	2,438	150,083.28	0.09
244	600390	五矿资本	36,200	146,610.00	0.09
245	600879	航天电子	18,400	142,968.00	0.09
246	600578	京能电力	42,900	138,996.00	0.09
247	600497	驰宏锌锗	26,000	138,840.00	0.09
248	601399	国机重装	53,800	138,804.00	0.09
249	002409	雅克科技	2,200	138,402.00	0.09
250	600499	科达制造	16,300	137,409.00	0.09
251	601118	海南橡胶	30,000	136,500.00	0.09
252	000825	太钢不锈	40,300	136,214.00	0.09
253	600435	北方导航	15,800	136,196.00	0.09
254	600481	双良节能	29,100	135,897.00	0.09
255	300088	长信科技	28,900	135,830.00	0.09
256	601958	金钼股份	13,000	135,330.00	0.09
257	002984	森麒麟	5,600	134,904.00	0.08
258	000739	普洛药业	9,900	134,343.00	0.08
259	688349	三一重能	5,400	134,136.00	0.08
260	000563	陕国投 A	48,700	133,925.00	0.08
261	600612	老凤祥	2,300	133,837.00	0.08
262	002867	周大生	10,200	133,212.00	0.08
263	600546	山煤国际	9,100	133,042.00	0.08
264	688002	睿创微纳	4,750	132,857.50	0.08
265	601162	天风证券	60,700	132,326.00	0.08
266	603233	大参林	9,240	132,132.00	0.08
267	600004	白云机场	13,900	131,772.00	0.08
268	603185	弘元绿能	7,700	131,593.00	0.08
269	000537	中绿电	13,800	131,514.00	0.08

270	688017	绿的谐波	1,600	131,360.00	0.08
271	300003	乐普医疗	8,800	130,592.00	0.08
272	601880	辽港股份	105,900	130,257.00	0.08
273	002850	科达利	1,700	129,846.00	0.08
274	300765	新诺威	5,100	128,673.00	0.08
275	603317	天味食品	11,200	127,792.00	0.08
276	688276	百克生物	4,398	124,771.26	0.08
277	600583	海油工程	20,300	119,973.00	0.08
278	002408	齐翔腾达	21,300	119,280.00	0.07
279	688099	晶晨股份	2,000	118,640.00	0.07
280	603712	七一二	6,300	114,597.00	0.07
281	002487	大金重工	5,000	114,400.00	0.07
282	688777	中控技术	3,000	113,100.00	0.07
283	300058	蓝色光标	19,800	107,712.00	0.07
284	688375	国博电子	1,338	94,516.32	0.06
285	601179	中国西电	11,700	94,068.00	0.06
286	600486	扬农化工	1,600	90,320.00	0.06
287	603589	口子窖	2,300	90,137.00	0.06
288	000559	万向钱潮	20,000	89,200.00	0.06
289	002432	九安医疗	2,200	89,188.00	0.06
290	601866	中远海发	34,400	88,752.00	0.06
291	600529	山东药玻	3,500	88,690.00	0.06
292	603816	顾家家居	2,700	87,183.00	0.05
293	002507	涪陵榨菜	7,100	86,975.00	0.05
294	000988	华工科技	2,900	86,797.00	0.05
295	002683	广东宏大	4,300	86,559.00	0.05
296	601828	美凯龙	33,100	84,405.00	0.05
297	002244	滨江集团	11,500	83,490.00	0.05
298	601155	新城控股	9,400	83,378.00	0.05
299	688120	华海清科	400	75,832.00	0.05
300	002791	坚朗五金	2,800	72,436.00	0.05
301	000778	新兴铸管	17,400	60,552.00	0.04
302	300070	碧水源	12,800	53,632.00	0.03
303	600959	江苏有线	18,900	49,896.00	0.03
304	688065	凯赛生物	800	36,312.00	0.02
305	688301	奕瑞科技	253	29,153.19	0.02
306	600208	新潮中宝	14,900	23,542.00	0.01
307	000738	航发控制	1,000	20,070.00	0.01
308	688107	安路科技	317	8,058.14	0.01
309	688331	荣昌生物	78	3,369.60	0.00
310	688220	翱捷科技	70	2,622.20	0.00
311	688819	天能股份	90	2,147.40	0.00
312	002384	东山精密	100	2,070.00	0.00

313	603737	三棵树	36	1,305.72	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	300428	立中集团	55,200	1,026,168.00	0.65
2	002463	沪电股份	19,100	697,150.00	0.44
3	002139	拓邦股份	62,100	659,502.00	0.41
4	300102	乾照光电	80,500	516,810.00	0.32
5	600114	东睦股份	35,700	513,723.00	0.32
6	300378	鼎捷软件	30,800	501,116.00	0.31
7	002035	华帝股份	49,500	308,385.00	0.19
8	000521	长虹美菱	40,300	305,474.00	0.19
9	300308	中际旭创	2,080	286,790.40	0.18
10	688076	诺泰生物	3,356	262,707.68	0.17
11	603408	建霖家居	19,800	261,162.00	0.16
12	002835	同为股份	15,100	255,039.00	0.16
13	600028	中国石化	37,900	239,528.00	0.15
14	601607	上海医药	12,400	236,964.00	0.15
15	002020	京新药业	22,600	236,622.00	0.15
16	301004	嘉益股份	2,600	236,600.00	0.15
17	002270	华明装备	10,400	231,296.00	0.15
18	601318	中国平安	5,500	227,480.00	0.14
19	600273	嘉化能源	31,600	225,624.00	0.14
20	600894	广日股份	19,500	224,250.00	0.14
21	300218	安利股份	14,800	223,184.00	0.14
22	002540	亚太科技	42,100	222,709.00	0.14
23	002422	科伦药业	7,300	221,409.00	0.14
24	000725	京东方 A	54,100	221,269.00	0.14
25	002521	齐峰新材	18,800	220,900.00	0.14
26	003006	百亚股份	9,300	220,410.00	0.14
27	600623	华谊集团	37,900	219,062.00	0.14
28	688109	品茗科技	8,000	218,800.00	0.14
29	601918	新集能源	22,400	218,400.00	0.14
30	603516	淳中科技	6,900	217,833.00	0.14
31	605333	沪光股份	7,800	217,230.00	0.14
32	002600	领益智造	30,400	216,448.00	0.14
33	603009	北特科技	12,000	215,160.00	0.14
34	600160	巨化股份	8,900	214,757.00	0.13
35	002236	大华股份	13,800	213,348.00	0.13

36	300573	兴齐眼药	1,300	213,200.00	0.13
37	000930	中粮科技	42,000	211,260.00	0.13
38	002534	西子洁能	21,100	211,211.00	0.13
39	002749	国光股份	14,000	210,560.00	0.13
40	600150	中国船舶	5,100	207,621.00	0.13
41	002925	盈趣科技	15,800	200,186.00	0.13
42	002493	荣盛石化	20,700	199,962.00	0.13
43	605376	博迁新材	8,800	198,616.00	0.12
44	002241	歌尔股份	9,900	193,149.00	0.12
45	600372	中航机载	15,866	189,916.02	0.12
46	000550	江铃汽车	8,700	188,877.00	0.12
47	300045	华力创通	10,600	187,090.00	0.12
48	002180	纳思达	6,900	182,298.00	0.11
49	003038	鑫铂股份	12,320	181,966.40	0.11
50	000700	模塑科技	34,500	181,125.00	0.11
51	300124	汇川技术	3,500	179,550.00	0.11
52	000821	京山轻机	15,600	176,748.00	0.11
53	000333	美的集团	2,700	174,150.00	0.11
54	600667	太极实业	30,300	173,013.00	0.11
55	300145	中金环境	68,600	171,500.00	0.11
56	300059	东方财富	16,000	168,960.00	0.11
57	600567	山鹰国际	109,300	163,950.00	0.10
58	002824	和胜股份	12,200	155,672.00	0.10
59	002001	新 和 成	7,400	142,080.00	0.09
59	601020	华钰矿业	11,100	142,080.00	0.09
60	300476	胜宏科技	4,400	141,944.00	0.09
61	603615	茶花股份	13,400	141,102.00	0.09
62	300328	宜安科技	32,400	138,672.00	0.09
63	000570	苏常柴 A	30,900	138,123.00	0.09
64	688692	达梦数据	628	137,795.29	0.09
65	300181	佐力药业	9,100	137,592.00	0.09
66	688510	航亚科技	7,441	136,988.81	0.09
67	603699	纽威股份	8,000	136,960.00	0.09
68	000975	山金国际	8,400	136,836.00	0.09
69	605196	华通线缆	13,000	136,760.00	0.09
70	688226	威腾电气	7,800	136,344.00	0.09
71	000999	华润三九	3,200	136,256.00	0.09
72	000922	佳电股份	11,400	136,002.00	0.09
73	603909	建发合诚	16,200	134,784.00	0.08
74	002840	华统股份	8,100	134,379.00	0.08
75	603337	杰克股份	5,100	134,232.00	0.08
76	000551	创元科技	15,300	133,569.00	0.08
77	002692	远程股份	39,800	133,330.00	0.08

78	001288	运机集团	4,800	132,864.00	0.08
79	688132	邦彦技术	7,613	132,085.55	0.08
80	300492	华图山鼎	1,400	131,880.00	0.08
81	601700	风范股份	30,000	131,700.00	0.08
82	601101	昊华能源	14,300	131,417.00	0.08
83	300049	福瑞股份	2,600	130,884.00	0.08
84	301392	汇成真空	2,189	128,899.54	0.08
85	601001	晋控煤业	7,800	128,856.00	0.08
86	002961	瑞达期货	11,700	128,115.00	0.08
87	301538	骏鼎达	1,221	123,525.96	0.08
88	002498	汉缆股份	37,300	122,717.00	0.08
89	002420	毅昌科技	26,600	121,296.00	0.08
90	301345	涛涛车业	2,200	121,220.00	0.08
91	002970	锐明技术	3,300	118,899.00	0.07
92	002635	安洁科技	7,700	118,888.00	0.07
93	603385	惠达卫浴	21,300	116,937.00	0.07
94	301536	星辰科技	3,329	115,755.71	0.07
95	603039	泛微网络	3,600	114,336.00	0.07
96	600480	凌云股份	11,200	110,096.00	0.07
97	688691	灿芯股份	2,078	108,887.08	0.07
98	430718	合肥高科	11,404	108,794.16	0.07
99	301589	诺瓦星云	567	108,438.34	0.07
100	603897	长城科技	5,900	103,545.00	0.07
101	002827	高争民爆	4,600	100,694.00	0.06
102	600262	北方股份	6,100	100,223.00	0.06
103	600320	振华重工	29,100	99,522.00	0.06
104	603025	大豪科技	7,200	99,504.00	0.06
105	301565	中仑新材	3,953	97,045.77	0.06
106	002182	宝武镁业	8,600	97,008.00	0.06
107	002225	濮耐股份	23,500	96,115.00	0.06
108	600605	汇通能源	3,800	94,544.00	0.06
109	002988	豪美新材	6,100	93,635.00	0.06
110	301539	宏鑫科技	3,607	92,654.66	0.06
111	600186	莲花健康	26,000	89,180.00	0.06
112	301061	匠心家居	1,890	88,754.40	0.06
113	600050	中国联通	18,800	88,360.00	0.06
114	600346	恒力石化	6,300	87,885.00	0.06
115	301259	艾布鲁	4,300	87,505.00	0.06
116	000526	学大教育	1,400	86,240.00	0.05
117	600285	羚锐制药	3,500	84,735.00	0.05
118	688676	金盘科技	1,600	83,440.00	0.05
119	301580	爱迪特	1,057	80,405.78	0.05
120	600818	中路股份	5,600	78,288.00	0.05

121	688502	茂莱光学	823	76,547.23	0.05
122	002455	百川股份	8,000	73,440.00	0.05
123	301591	肯特股份	1,779	71,775.16	0.05
124	300140	节能环境	11,900	71,043.00	0.04
125	688530	欧莱新材	3,437	69,099.55	0.04
126	301498	乖宝宠物	1,253	67,411.40	0.04
127	001389	广合科技	1,536	67,194.38	0.04
128	301587	中瑞股份	2,292	66,948.10	0.04
129	601088	中国神华	1,400	62,118.00	0.04
130	301588	美新科技	2,568	59,238.22	0.04
131	688709	成都华微	2,890	55,681.63	0.04
132	601633	长城汽车	2,200	55,660.00	0.03
133	001234	泰慕士	3,200	54,368.00	0.03
134	688695	中创股份	1,578	53,634.10	0.03
135	301502	华阳智能	1,265	49,379.87	0.03
136	301511	德福科技	3,270	48,265.20	0.03
137	600016	民生银行	12,700	48,133.00	0.03
138	605007	五洲特纸	3,800	47,994.00	0.03
139	688573	信宇人	2,234	47,762.92	0.03
140	002230	科大讯飞	1,100	47,245.00	0.03
141	600510	黑牡丹	12,300	45,756.00	0.03
142	688584	上海合晶	2,322	38,066.42	0.02
143	301533	威马农机	1,442	37,044.98	0.02
144	603341	龙旗科技	805	31,258.21	0.02
145	688693	锆威特	857	30,783.44	0.02
146	601818	光大银行	9,700	30,749.00	0.02
147	001359	平安电工	1,241	27,428.32	0.02
148	603344	星德胜	1,026	24,273.69	0.02
149	600379	宝光股份	2,900	24,041.00	0.02
150	301487	盟固利	867	22,420.62	0.01
151	603082	北自科技	687	20,723.13	0.01
152	001387	雪祺电气	1,331	20,597.00	0.01
153	603381	永臻股份	733	20,311.62	0.01
154	688231	隆达股份	1,400	19,964.00	0.01
155	603350	安乃达	894	18,380.64	0.01
156	603375	盛景微	428	16,988.00	0.01
157	603285	键邦股份	879	16,393.35	0.01
158	603325	博隆技术	224	15,390.16	0.01
159	600221	海航控股	15,000	15,300.00	0.01
160	001379	腾达科技	1,106	15,167.58	0.01
161	600893	航发动力	400	14,620.00	0.01
162	603236	移远通信	300	14,019.00	0.01
163	603312	西典新能	544	13,962.10	0.01

164	301018	申菱环境	451	8,767.44	0.01
165	603113	金能科技	1,600	8,752.00	0.01
166	301516	中远通	449	8,364.87	0.01
167	301348	蓝箭电子	270	8,205.30	0.01
168	301526	国际复材	2,395	7,975.35	0.01
169	301508	中机认检	213	7,872.48	0.00
170	300904	威力传动	178	7,114.66	0.00
171	301381	赛维时代	303	6,887.19	0.00
172	301421	波长光电	158	6,830.34	0.00
173	301566	达利凯普	400	6,788.00	0.00
174	301488	豪恩汽电	135	6,493.50	0.00
175	301015	百洋医药	275	6,470.75	0.00
176	001230	劲旅环境	450	6,250.50	0.00
177	301413	安培龙	151	6,243.85	0.00
178	688563	航材股份	111	5,869.68	0.00
179	688549	中巨芯	855	5,771.25	0.00
180	301517	陕西华达	102	5,508.00	0.00
181	301489	思泉新材	75	5,293.50	0.00
182	301370	国科恒泰	469	5,098.03	0.00
183	301558	三态股份	607	5,092.73	0.00
184	688648	中邮科技	232	5,066.88	0.00
185	688720	艾森股份	124	5,026.96	0.00
186	301555	惠柏新材	176	4,986.08	0.00
187	688652	京仪装备	121	4,729.89	0.00
188	301459	丰茂股份	119	4,725.49	0.00
189	688582	芯动联科	164	4,618.24	0.00
190	688653	康希通信	354	4,559.52	0.00
191	601096	宏盛华源	1,099	4,494.91	0.00
192	301486	致尚科技	106	4,484.86	0.00
193	301509	金凯生科	123	4,474.74	0.00
194	301550	斯菱股份	93	4,455.63	0.00
195	301505	苏州规划	145	4,350.00	0.00
196	301507	民生健康	338	4,265.56	0.00
197	688702	盛科通信	103	4,171.50	0.00
198	301568	思泰克	130	4,136.60	0.00
199	688591	泰凌微	208	4,066.40	0.00
200	688603	天承科技	77	4,020.17	0.00
201	301578	辰奕智能	99	3,917.43	0.00
202	301372	科净源	143	3,810.95	0.00
203	301261	恒工精密	99	3,669.93	0.00
204	301548	崇德科技	68	3,609.44	0.00
205	301202	朗威股份	133	3,559.08	0.00
206	301469	恒达新材	145	3,539.45	0.00

207	301519	舜禹股份	205	3,394.80	0.00
208	688208	道通科技	140	3,379.60	0.00
209	301292	海科新源	261	3,228.57	0.00
210	301518	长华化学	186	3,223.38	0.00
211	301418	协昌科技	79	3,160.00	0.00
212	688671	碧兴物联	148	3,068.04	0.00
213	688651	盛邦安全	104	3,042.00	0.00
214	301393	昊帆生物	71	3,015.37	0.00
215	301500	飞南资源	164	2,861.80	0.00
216	301529	福赛科技	87	2,854.47	0.00
217	688646	逸飞激光	91	2,840.11	0.00
218	603273	天元智能	142	2,605.70	0.00
219	301559	中集环科	177	2,578.89	0.00
220	301528	多浦乐	60	2,570.40	0.00
221	688602	康鹏科技	332	2,546.44	0.00
222	301525	儒竞科技	45	2,532.60	0.00
223	301371	敷尔佳	79	2,453.74	0.00
224	301520	万邦医药	58	2,400.04	0.00
225	300244	迪安诊断	200	2,400.00	0.00
226	001378	德冠新材	100	2,386.00	0.00
227	601083	锦江航运	243	2,323.08	0.00
228	301515	港通医疗	119	2,277.66	0.00
229	688716	中研股份	107	2,268.40	0.00
230	301296	新巨丰	305	2,199.05	0.00
231	688719	爱科赛博	83	2,163.81	0.00
232	001326	联域股份	59	2,115.74	0.00
233	688612	威迈斯	79	2,099.03	0.00
234	001239	永达股份	142	1,970.96	0.00
235	688768	容知日新	82	1,919.62	0.00
236	603193	润本股份	102	1,875.78	0.00
237	688657	浩辰软件	50	1,848.00	0.00
238	603119	浙江荣泰	101	1,789.72	0.00
239	603373	安邦护卫	64	1,759.36	0.00
240	603107	上海汽配	104	1,652.56	0.00
241	688450	光格科技	67	1,630.78	0.00
242	603270	金帝股份	82	1,626.88	0.00
243	001306	夏厦精密	29	1,565.71	0.00
244	603004	鼎龙科技	77	1,305.15	0.00
245	001358	兴欣新材	59	1,210.68	0.00
246	603276	恒兴新材	86	1,198.84	0.00
247	300363	博腾股份	100	1,195.00	0.00
248	603231	索宝蛋白	68	1,158.72	0.00
249	603075	热威股份	59	1,041.35	0.00

250	400174	中天 3	95,300	953.00	0.00
251	688105	诺唯赞	39	780.39	0.00
252	688728	格科微	49	593.39	0.00
253	688020	方邦股份	16	533.76	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	300207	欣旺达	1,959,074.00	1.32
2	600521	华海药业	1,683,992.00	1.13
3	300394	天孚通信	1,652,818.60	1.11
4	600141	兴发集团	1,641,662.00	1.10
5	600038	中直股份	1,630,891.00	1.10
6	600839	四川长虹	1,615,328.00	1.09
7	603658	安图生物	1,562,330.00	1.05
8	000630	铜陵有色	1,528,204.00	1.03
9	000830	鲁西化工	1,521,695.10	1.02
10	300529	健帆生物	1,517,050.00	1.02
11	000703	恒逸石化	1,478,959.00	0.99
12	601636	旗滨集团	1,458,821.00	0.98
13	600498	烽火通信	1,438,478.00	0.97
14	002558	巨人网络	1,411,560.00	0.95
15	002156	通富微电	1,395,905.00	0.94
16	600704	物产中大	1,372,265.00	0.92
17	002465	海格通信	1,371,779.00	0.92
18	002831	裕同科技	1,335,383.00	0.90
19	002385	大北农	1,334,509.00	0.90
20	000032	深桑达 A	1,320,433.00	0.89

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	002595	豪迈科技	1,951,175.00	1.31
2	600141	兴发集团	1,890,678.00	1.27

3	002683	广东宏大	1,776,977.00	1.19
4	000156	华数传媒	1,737,779.00	1.17
5	000729	燕京啤酒	1,717,795.00	1.16
6	300866	安克创新	1,686,035.09	1.13
7	600482	中国动力	1,614,373.00	1.09
8	000967	盈峰环境	1,603,282.00	1.08
9	002032	苏泊尔	1,585,852.00	1.07
10	002422	科伦药业	1,539,099.00	1.03
11	600637	东方明珠	1,529,849.00	1.03
12	002092	ST 中泰	1,525,717.00	1.03
13	688208	道通科技	1,515,122.02	1.02
14	600582	天地科技	1,512,578.00	1.02
15	600038	中直股份	1,507,320.00	1.01
16	600060	海信视像	1,470,031.00	0.99
17	600549	厦门钨业	1,424,522.00	0.96
18	601958	金铂股份	1,400,405.11	0.94
19	600498	烽火通信	1,370,776.00	0.92
20	600153	建发股份	1,366,277.00	0.92

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	313,442,590.17
卖出股票收入（成交）总额	301,068,708.97

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	-	-
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）	401,694.47	0.25
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	401,694.47	0.25

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	113067	燃 23 转债	1,870	231,091.99	0.15
2	123158	宙邦转债	605	68,797.37	0.04
3	127091	科数转债	327	36,952.68	0.02
4	113069	博 23 转债	150	18,918.84	0.01
5	113683	伟 24 转债	90	18,092.85	0.01

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华海药业(证券代码 600521)、鲁西化工(证券代码 000830)、中鼎股份(证券代码 000887)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、华海药业(证券代码 600521)

根据 2024 年 4 月 19 日发布的相关公告,该证券发行人因违规使用募集资金被浙江证监局给予警示。

2、鲁西化工(证券代码 000830)

根据 2023 年 8 月 25 日发布的相关公告,该证券发行人因未依法履行职责被聊城高新技术产业开发区管理委员会处以罚款。

根据 2024 年 4 月 22 日发布的相关公告,该证券发行人因重大事故被山东省人民政府处以罚款。

根据 2024 年 6 月 5 日发布的相关公告,该证券发行人因违规经营被聊城高新技术产业开发区管理委员会处以行政处罚。

3、中鼎股份(证券代码 000887)

根据 2024 年 1 月 2 日发布的相关公告,该证券发行人因未依法履行职责被宣城市应急管理局责令改正。

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	610,684.89
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	155,021.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	765,706.88

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	113067	燃 23 转债	231,091.99	0.15
2	123158	宙邦转债	68,797.37	0.04
3	127091	科数转债	36,952.68	0.02
4	113069	博 23 转债	18,918.84	0.01
5	118042	奥维转债	13,741.32	0.01
6	127090	兴瑞转债	9,377.63	0.01
7	118040	宏微转债	2,961.71	0.00
8	123195	蓝晓转 02	1,760.08	0.00

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
招商中证	5,203	12,451.88	218,968.73	0.34%	64,568,167.87	99.66%

500 指数增强 A						
招商中证 500 指数增强 C	3,165	21,923.16	24,425,813.26	35.20%	44,960,998.60	64.80%
合计	8,368	16,034.17	24,644,781.99	18.37%	109,529,166.47	81.63%

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	招商中证 500 指数增强 A	43,591.69	0.0673%
	招商中证 500 指数增强 C	1.00	0.0000%
	合计	43,592.69	0.0325%

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、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	招商中证 500 指数增强 A	0
	招商中证 500 指数增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	招商中证 500 指数增强 A	0
	招商中证 500 指数增强 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	招商中证 500 指数增强 A	招商中证 500 指数增强 C
基金合同生效日(2017 年 5 月 17 日)基金份额总额	124,892,139.37	208,016,852.96
本报告期期初基金份额总额	61,244,378.55	59,927,347.32
本报告期基金总申购份额	13,013,027.32	42,955,578.54

减：本报告期基金总赎回份额	9,470,269.27	33,496,114.00
本报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-	-
本报告期期末基金份额总额	64,787,136.60	69,386,811.86

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，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	612,892,852.98	99.89%	89,422.39	99.37%	-
中信证券	11	658,816.95	0.11%	569.94	0.63%	-
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	500,285.00	100.00%	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	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	上海证券报及基金管理人网站	2024-01-19
3	招商中证 500 指数增强型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-01-19
4	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	上海证券报及基金管理人网站	2024-03-29
5	招商中证 500 指数增强型证券投资基金 2023 年年度报告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-03-29
6	招商中证 500 指数增强型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-04-19
7	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	上海证券报及基金管理人网站	2024-04-19
8	招商中证 500 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）	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-05-16
9	招商中证 500 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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-05-16
10	招商中证 500 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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-05-16
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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-06-05

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

		达到或者超过 20% 的时间区间					
机构	1	20240206-20240206	10,911,967.36	19,003,561.79	8,250,000.00	21,665,529.15	16.15%

产品特有风险

本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况，可能会出现集中赎回甚至巨额赎回从而引发基金净值剧烈波动，甚至引发基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。

注：1、报告期末持有份额占比按照四舍五入方法保留至小数点后第 2 位；

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

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准设立招商基金管理有限公司的文件；
- 2、中国证券监督管理委员会批准招商中证 500 指数增强型证券投资基金设立的文件；
- 3、《招商中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 4、《招商中证 500 指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 5、《招商中证 500 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。

12.2 存放地点

招商基金管理有限公司

地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

12.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人招商基金管理有限公司。

客户服务中心电话：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