

招商中证 500 指数增强型证券投资基金 2025 年中期报告

2025 年 06 月 30 日

基金管理人：招商基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2025 年 8 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2025 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	4
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
§4 管理人报告	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	12
§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	39
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	54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	56
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	56
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	57
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	57
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	57

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	57
7.12 投资组合报告附注	57
§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	59
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	60
10.1 基金份额持有人大会决议	60
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	60
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	61
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	61
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	61
10.8 其他重大事件	65
§11 备查文件目录	67
11.1 备查文件目录	67
11.2 存放地点	68
11.3 查阅方式	68

§ 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	149,438,627.73 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	77,207,729.89 份	72,230,897.84 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(2025 年 1 月 1 日 - 2025 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	5,665,083.19
本期利润	7,998,234.69
加权平均基金份额本期利润	0.1060
本期加权平均净值利润率	7.55%
本期基金份额净值增长率	7.46%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	34,003,503.99
期末可供分配基金份额利润	0.4404
期末基金资产净值	114,175,587.66
期末基金份额净值	1.4788
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	47.88%

2、招商中证 500 指数增强 C

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2025 年 1 月 1 日 - 2025 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	5,106,371.13

本期利润	6,845,596.53
加权平均基金份额本期利润	0.0947
本期加权平均净值利润率	6.91%
本期基金份额净值增长率	7.24%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	29,219,132.74
期末可供分配基金份额利润	0.4045
期末基金资产净值	104,275,112.60
期末基金份额净值	1.4436
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	44.36%

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	4.78%	0.65%	4.09%	0.75%	0.69%	-0.10%
过去三个月	3.80%	1.38%	0.97%	1.43%	2.83%	-0.05%
过去六个月	7.46%	1.20%	3.21%	1.29%	4.25%	-0.09%
过去一年	23.44%	1.53%	18.83%	1.64%	4.61%	-0.11%
过去三年	7.37%	1.23%	-7.61%	1.29%	14.98%	-0.06%
自基金合同 生效起至今	47.88%	1.26%	-0.54%	1.31%	48.42%	-0.05%

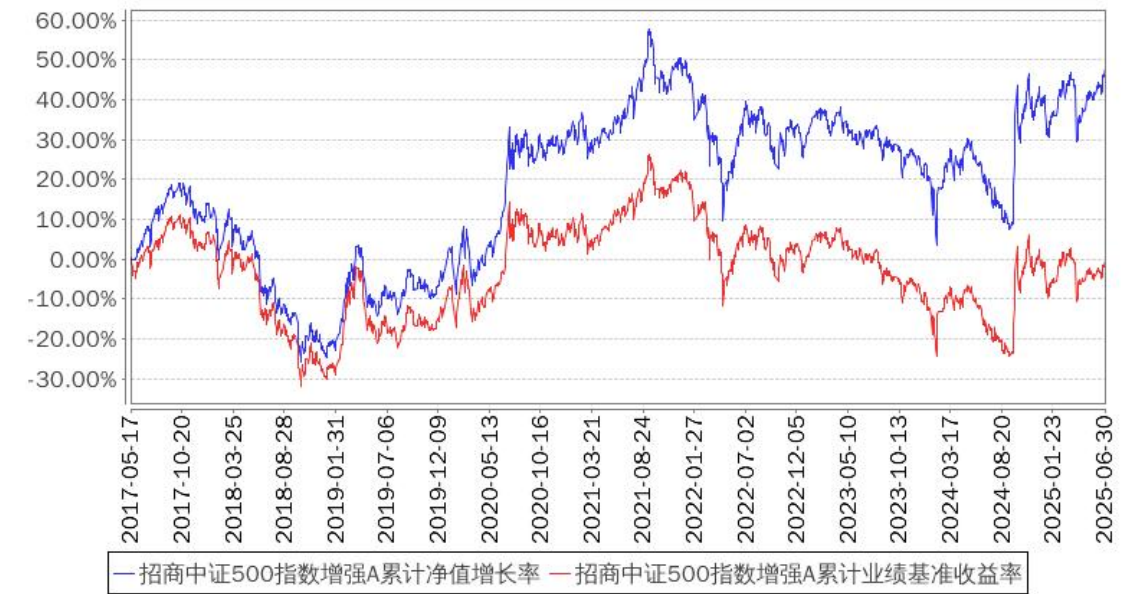
招商中证 500 指数增强 C

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	4.75%	0.64%	4.09%	0.75%	0.66%	-0.11%
过去三个月	3.69%	1.38%	0.97%	1.43%	2.72%	-0.05%

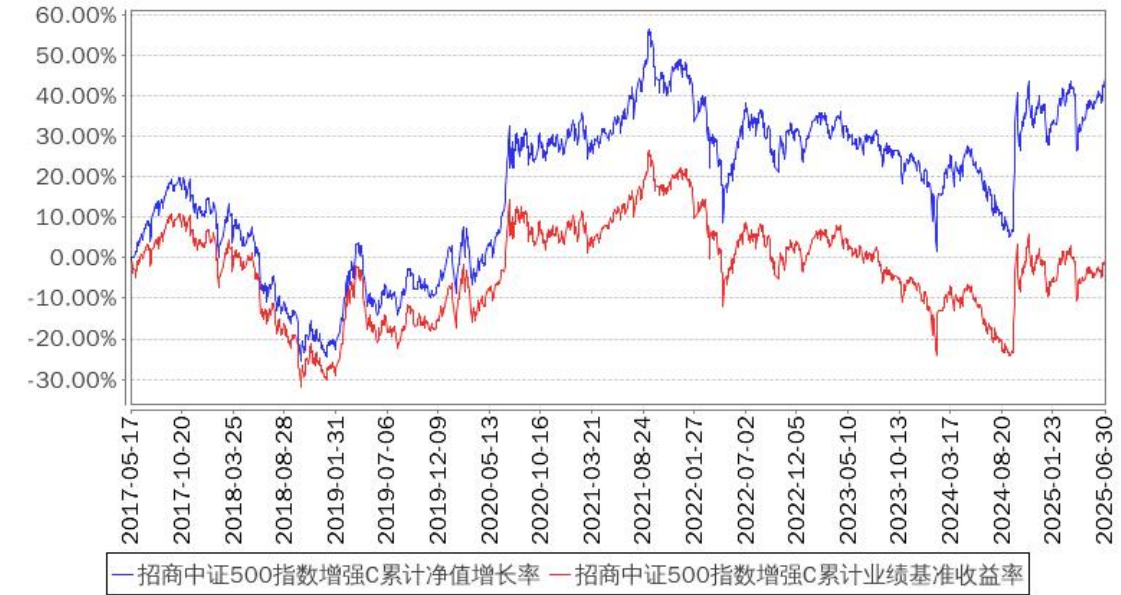
过去六个月	7.24%	1.20%	3.21%	1.29%	4.03%	-0.09%
过去一年	22.94%	1.53%	18.83%	1.64%	4.11%	-0.11%
过去三年	6.08%	1.23%	-7.61%	1.29%	13.69%	-0.06%
自基金合同生效起至今	44.36%	1.26%	-0.54%	1.31%	44.90%	-0.05%

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,公司注册资本金为人民币 13.1 亿元,招商银行股份有限公司持有公司全部股权的 55%,招商证券股份有限公司持有公司全部股权的 45%。

招商基金管理有限公司拥有公开募集证券投资基金管理、基金销售、全国社会保障基金境内委托管理、企业年金和职业年金基金投资管理、合格境内机构投资者、特定客户资产管理、保险资金投资管理、基本养老保险基金投资管理、公募基金投资顾问业务试点资格。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 （助理）期限		证券 从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
邓童	本基金基金经理	2021 年 11 月 23 日	-	12	男，硕士。2012 年 7 月加入招商基金管理有限公司量化投资部，曾任研究员，现任招商中证 500 指数增强型证券投资基金、招商中证大宗商品股票指数证券投资基金（LOF）、招商中证煤炭等权指数证券投资基金、招商北证 50 成份指数型发起式证券投资基金、招商中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、招商中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金、招商国证 2000 指数增强型证券投资基金、招商安和债券型证券投资基金、招商安康债券型证券投资基金、招商中证红利低波动 100 指数型发起式证券投资基金、招商上证科创板 50 成份增强策略交易型开放式指数证券投资基金、招商上证综合指数增强型发起式证券投资基金、招商中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、招商中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金基金经理，兼任投资经理。

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

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

金额单位：人民币元

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作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 12 次，为旗下指数及量化组合因投资策略需要而发生反向交易。报告期内未发现有可能导致不公平交易和利益输送的重大异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内中证 500 指数小幅上涨，4 月初在外部环境因素干扰下快速回调，但随后市场情绪企稳后逐步反弹。从市场风格上看，一季度成长风格快速拉升，价值风格则在二季度有所反弹，扭转了一季度相对弱势的局面，同时小市值风格持续强于大市值风格。量化模型在价值风格上普遍有一定的暴露，同时传统量价因子在一季度高波动高流动性环境下表现较弱，二季度市场逐步恢复正常，超额收益也逐步企稳反弹。当前外部环境的不确定性依然较高，市场信心可能有一定反复，同时由于小市值风格上半年持续强势，市值风格的风险加大，博弈情绪较重的背景下需要密切观察市场波动率同时做好风险应对。指数整体表现难以预测，相对基准的超额收益就显得更加重要，在策略方面，本产品会继续采用多模型配置的框架，力争在较低的跟踪误差下创造出持续的超额收益。我们也将持续加强新因子及新方法的研究，尽力保持策略超额收益的持续性和多元性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金 A 类份额净值增长率为 7.46%，同期业绩基准增长率为 3.21%，C 类份额净值增长率为 7.24%，同期业绩基准增长率为 3.21%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2025 年上半年国内经济呈“生产稳、需求弱、价格低”特征，政策端以“宽货币+稳财政+促消费”为主线，央行 5 月降准、降息及调降存款利率，财政端加快专项债与超长期特别国债发行，地产供需两端政策持续加码，但传导至信用扩张与实物工作量仍需时间。展望下半年，盈利预测仍有下修压力，但 A 股整体估值仍处于相对低位，叠加美元上行空间受限、国内稳增长政策落地预期升温，市场或呈现“震荡上行、结构再平衡”特征。风格层面，当前小市值风格正处于相对高位，需警惕其回调风险。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

胜任能力和相关工作经历。公司估值委员会主要负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，定期评价现有估值政策和程序的适用性及对估值程序执行情况进行监督。

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

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

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。截至报告期末本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供相关债券品种、流通受限股票的估值参考数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配，符合相关法规及基金合同的约定。

4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本托管人在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职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：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	19,012,764.44	11,782,236.05
结算备付金		3,971,245.35	2,358,311.62
存出保证金		1,281,226.87	177,006.52
交易性金融资产	6.4.7.2	196,193,460.12	183,214,300.45
其中：股票投资		196,092,229.83	183,109,809.56
基金投资		-	-
债券投资		101,230.29	104,490.89
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		-	2,489,688.31

应收股利		-	-
应收申购款		314,556.66	171,979.91
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		220,773,253.44	200,193,522.86
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		0.20	-
应付赎回款		1,950,401.01	4,755,494.38
应付管理人报酬		209,605.32	208,874.25
应付托管费		26,200.67	26,109.28
应付销售服务费		33,415.63	34,590.21
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1.34	2.30
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	102,929.01	108,249.54
负债合计		2,322,553.18	5,133,319.96
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	149,438,627.73	143,284,442.58
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	69,012,072.53	51,775,760.32
净资产合计		218,450,700.26	195,060,202.90
负债和净资产总计		220,773,253.44	200,193,522.86

注：报告截止日 2025 年 6 月 30 日，招商中证 500 指数增强 A 份额净值 1.4788 元，基金份额总额 77,207,729.89 份；招商中证 500 指数增强 C 份额净值 1.4436 元，基金份额总额 72,230,897.84 份；总份额合计 149,438,627.73 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：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		16,484,152.03	483,446.86

1.利息收入		42,432.39	35,015.31
其中：存款利息收入	6.4.7.9	42,432.39	35,015.31
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）		12,251,948.65	816,061.61
其中：股票投资收益	6.4.7.10	9,810,034.48	-1,552,248.46
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	10,408.60	1,605.64
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	252,991.65	374,868.71
股利收益	6.4.7.15	2,178,513.92	1,991,835.72
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	4,072,376.90	-402,482.79
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	117,394.09	34,852.73
减：二、营业总支出		1,640,320.81	1,490,745.41
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	1,217,289.57	1,007,316.07
其中：暂估管理人报酬		-	-
2.托管费	6.4.10.2.2	152,161.12	125,914.45
3.销售服务费	6.4.10.2.3	196,154.17	183,485.97
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		1,177.51	2,008.02
8.其他费用	6.4.7.19	73,538.44	172,020.90
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		14,843,831.22	-1,007,298.55
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		14,843,831.22	-1,007,298.55
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		14,843,831.22	-1,007,298.55

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：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	143,284,442.58	-	51,775,760.32	195,060,202.90
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	143,284,442.58	-	51,775,760.32	195,060,202.90
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	6,154,185.15	-	17,236,312.21	23,390,497.36
（一）、综合收益总额	-	-	14,843,831.22	14,843,831.22
（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）	6,154,185.15	-	2,392,480.99	8,546,666.14
其中：1.基金申购款	62,733,479.12	-	24,471,073.28	87,204,552.40
2.基金赎回款	-56,579,293.97	-	-22,078,592.29	-78,657,886.26
（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	149,438,627.73	-	69,012,072.53	218,450,700.26
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			

	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	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

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

____钟文岳____ ____欧志明____ ____何剑萍____

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

招商中证 500 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 2025 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策，会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期间未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008年9月18日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
活期存款	19,012,764.44
等于：本金	19,011,044.21
加：应计利息	1,720.23
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	19,012,764.44

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		187,751,399.75	-	196,092,229.83	8,340,830.08
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	84,899.48	413.90	101,230.29	15,916.91
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	84,899.48	413.90	101,230.29	15,916.91
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-

其他	-	-	-	-
合计	187,836,299.23	413.90	196,193,460.12	8,356,746.99

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 2025 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	10,172,952.00	-	-	-
其中：股指期货投资	10,172,952.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	10,172,952.00	-	-	-

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
IC2507	IC2507	9.00	10,561,320.00	388,368.00
合计				388,368.00
减：可抵销期货暂收款				388,368.00
净额				-

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-

应付赎回费	1,932.87
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	36,416.77
其中：交易所市场	36,416.77
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	64,579.37
合计	102,929.01

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	72,585,963.28	72,585,963.28
本期申购	30,603,990.55	30,603,990.55
本期赎回（以“-”号填列）	-25,982,223.94	-25,982,223.94
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	77,207,729.89	77,207,729.89

招商中证 500 指数增强 C		
项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	70,698,479.30	70,698,479.30
本期申购	32,129,488.57	32,129,488.57
本期赎回（以“-”号填列）	-30,597,070.03	-30,597,070.03
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	72,230,897.84	72,230,897.84

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	26,459,522.71	846,091.95	27,305,614.66
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	26,459,522.71	846,091.95	27,305,614.66
本期利润	5,665,083.19	2,333,151.50	7,998,234.69
本期基金份额交易产生的变动数	1,878,898.09	-214,889.67	1,664,008.42
其中：基金申购款	12,355,167.10	-94,036.48	12,261,130.62

基金赎回款	-10,476,269.01	-120,853.19	-10,597,122.20
本期已分配利润	-	-	-
本期末	34,003,503.99	2,964,353.78	36,967,857.77

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	23,548,437.43	921,708.23	24,470,145.66
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	23,548,437.43	921,708.23	24,470,145.66
本期利润	5,106,371.13	1,739,225.40	6,845,596.53
本期基金份额交易产生的变动数	564,324.18	164,148.39	728,472.57
其中：基金申购款	11,774,986.99	434,955.67	12,209,942.66
基金赎回款	-11,210,662.81	-270,807.28	-11,481,470.09
本期已分配利润	-	-	-
本期末	29,219,132.74	2,825,082.02	32,044,214.76

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	31,282.29
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	10,940.68
其他	209.42
合计	42,432.39

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	9,810,034.48
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	9,810,034.48

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	306,784,607.90

减：卖出股票成本总额	296,720,844.00
减：交易费用	253,729.42
买卖股票差价收入	9,810,034.48

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	274.33
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	10,134.27
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	10,408.60

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	72,467.06
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	62,299.72
减：应计利息总额	30.17
减：交易费用	2.90
买卖债券差价收入	10,134.27

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	252,991.65

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	2,178,513.92
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	2,178,513.92
----	--------------

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	3,657,342.24
——股票投资	3,656,848.56
——债券投资	493.68
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	415,034.66
——权证投资	-
——期货投资	415,034.66
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	4,072,376.90

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	117,394.09
合计	117,394.09

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	5,072.00
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
其他	8,959.07
合计	73,538.44

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,217,289.57	1,007,316.07
其中：应支付销售机构的客	519,137.99	345,005.29

户维护费		
应支付基金管理人的 净管理费	698,151.58	662,310.78

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托 管费	152,161.12	125,914.45

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	-	3,125.66	3,125.66
招商银行	-	81,068.36	81,068.36
招商证券	-	354.05	354.05
合计	-	84,548.07	84,548.07
获得销售服务费的 各关联方名称	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期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

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：

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

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行-活期	19,012,764.44	31,282.29	12,576,723.39	21,811.95

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
招商证券	001388	信通电子	网下申购	937	15,385.54
中银国际证券	603409	汇通控股	网下申购	776	18,763.68

上年度可比期间 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	网下申购	628	54,610.88

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（2025 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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
001335	信凯科技	2025 年 4 月 2 日	6 个月	新股流通受限	12.80	28.05	80	1,024.00	2,244.00	-
001356	富岭股份	2025 年 1 月 16 日	6 个月	新股流通受限	5.30	14.44	547	2,899.10	7,898.68	-
001382	新亚电缆	2025 年 3 月 13 日	6 个月	新股流通受限	7.40	20.21	366	2,708.40	7,396.86	-
001388	信通电子	2025 年 6 月 24 日	1 个月内（含）	新股流通受限	16.42	16.42	843	13,842.06	13,842.06	-
001388	信通电子	2025 年 6 月 24 日	6 个月	新股流通受限	16.42	16.42	94	1,543.48	1,543.48	-
001390	古麒绒材	2025 年 5 月 21 日	6 个月	新股流通受限	12.08	18.12	178	2,150.24	3,225.36	-
001395	亚联机械	2025 年 1 月 20 日	6 个月	新股流通受限	19.08	47.25	80	1,526.40	3,780.00	-
301173	毓恬冠佳	2025 年 2 月 24 日	6 个月	新股流通受限	28.33	44.98	173	4,901.09	7,781.54	-
301275	汉朔科技	2025 年	6 个月	新股流通	27.50	56.19	191	5,252.50	10,732.29	-

		3 月 4 日		受限						
301458	钧崑电子	2025 年 1 月 2 日	6 个月	新股流通受限	10.40	34.11	648	6,739.20	22,103.28	-
301479	弘景光电	2025 年 3 月 6 日	6 个月	新股流通受限	41.90	77.87	171	5,111.80	13,315.77	-
301501	恒鑫生活	2025 年 3 月 11 日	6 个月	新股流通受限	39.92	45.22	186	5,109.76	8,410.92	-
301535	浙江华远	2025 年 3 月 18 日	6 个月	新股流通受限	4.92	18.99	734	3,611.28	13,938.66	-
301560	众捷汽车	2025 年 4 月 17 日	6 个月	新股流通受限	16.50	27.45	190	3,135.00	5,215.50	-
301590	优优绿能	2025 年 5 月 28 日	6 个月	新股流通受限	89.60	139.48	54	4,838.40	7,531.92	-
301595	太力科技	2025 年 5 月 12 日	6 个月	新股流通受限	17.05	29.10	196	3,341.80	5,703.60	-
301601	惠通科技	2025 年 1 月 8 日	6 个月	新股流通受限	11.80	33.85	342	4,035.60	11,576.70	-
301602	超研股份	2025 年 1 月 15 日	6 个月	新股流通受限	6.70	24.80	658	4,408.60	16,318.40	-
301636	泽润新能	2025 年 4 月 30 日	6 个月	新股流通受限	33.06	47.46	128	4,231.68	6,074.88	-
301658	首航新能	2025 年 3 月 26 日	6 个月	新股流通受限	11.80	22.98	437	5,156.60	10,042.26	-
301662	宏工科技	2025 年 4 月 10 日	6 个月	新股流通受限	26.60	82.50	143	3,803.80	11,797.50	-
301665	泰禾股份	2025 年 4 月 2 日	6 个月	新股流通受限	10.27	22.39	393	4,036.11	8,799.27	-
301678	新恒汇	2025 年 6 月 13 日	6 个月	新股流通受限	12.80	44.54	344	4,403.20	15,321.76	-

603014	威高血净	2025 年 5 月 12 日	6 个月	新股流通 受限	26.50	32.68	115	3,047.50	3,758.20	-
603049	中策橡胶	2025 年 5 月 27 日	6 个月	新股流通 受限	46.50	42.85	104	4,836.00	4,456.40	-
603072	天和磁材	2024 年 12 月 24 日	6 个月	新股流通 受限	12.30	54.45	179	2,201.70	9,746.55	-
603120	肯特催化	2025 年 4 月 9 日	6 个月	新股流通 受限	15.00	33.43	65	975.00	2,172.95	-
603124	江南新材	2025 年 3 月 12 日	6 个月	新股流通 受限	10.54	46.31	88	927.52	4,075.28	-
603202	天有为	2025 年 4 月 16 日	6 个月	新股流通 受限	93.50	90.66	35	3,272.50	3,173.10	-
603210	泰鸿万立	2025 年 4 月 1 日	6 个月	新股流通 受限	8.60	15.61	286	2,459.60	4,464.46	-
603257	中国瑞林	2025 年 3 月 28 日	6 个月	新股流通 受限	20.52	37.47	78	1,600.56	2,922.66	-
603271	永杰新材	2025 年 3 月 4 日	6 个月	新股流通 受限	20.60	35.08	94	1,936.40	3,297.52	-
603382	海阳科技	2025 年 6 月 5 日	6 个月	新股流通 受限	11.50	22.39	105	1,207.50	2,350.95	-
603400	华之杰	2025 年 6 月 12 日	6 个月	新股流通 受限	19.88	43.81	57	1,133.16	2,497.17	-
603409	汇通控股	2025 年 2 月 25 日	6 个月	新股流通 受限	24.18	33.32	78	1,886.04	2,598.96	-
688583	思看科技	2025 年 1 月 8 日	6 个月	新股流通 受限	33.46	79.68	227	5,855.50	18,087.36	-
688755	汉邦科技	2025 年 5 月 9 日	6 个月	新股流通 受限	22.77	39.33	203	4,622.31	7,983.99	-
688757	胜科纳米	2025 年 3 月 18	6 个月	新股流通 受限	9.08	25.94	536	4,866.88	13,903.84	-

		日								
688758	赛分科技	2025 年 1 月 2 日	6 个月	新股流通受限	4.32	16.97	777	3,356.64	13,185.69	-
688775	影石创新	2025 年 6 月 4 日	6 个月	新股流通受限	47.27	124.16	185	8,744.95	22,969.60	-
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
123257	安克转债	2025 年 6 月 16 日	1 个月内（含）	新债未上市	100.00	100.01	90	8,999.96	9,000.55	-

注：基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，则此新增股票的流通受限期和估值价格与相应原股票一致。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	101,230.29	104,490.89
未评级	-	-
合计	101,230.29	104,490.89

注：债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

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 2025 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	19,012,764.44	-	-	-	19,012,764.44

结算备付金	3,971,245.35	-	-	-	3,971,245.35
存出保证金	13,868.47	-	-	1,267,358.40	1,281,226.87
交易性金融资产	-	91,259.63	9,970.66	196,092,229.83	196,193,460.12
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	-	-	-	314,556.66	314,556.66
应收清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	22,997,878.26	91,259.63	9,970.66	197,674,144.89	220,773,253.44
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,950,401.01	1,950,401.01
应付管理人报酬	-	-	-	209,605.32	209,605.32
应付托管费	-	-	-	26,200.67	26,200.67
应付清算款	-	-	-	0.20	0.20
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	33,415.63	33,415.63
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	1.34	1.34
其他负债	-	-	-	102,929.01	102,929.01
负债总计	-	-	-	2,322,553.18	2,322,553.18
利率敏感度缺口	22,997,878.26	91,259.63	9,970.66	195,351,591.71	218,450,700.26
上年度末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	11,782,236.05	-	-	-	11,782,236.05
结算备付金	2,358,311.62	-	-	-	2,358,311.62
存出保证金	39,736.12	-	-	137,270.40	177,006.52
交易性金融资产	-	98,084.69	6,406.20	183,109,809.56	183,214,300.45
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	-	-	-	171,979.91	171,979.91
应收清算款	-	-	-	2,489,688.31	2,489,688.31
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	14,180,283.79	98,084.69	6,406.20	185,908,748.18	200,193,522.86
负债					
应付赎回款	-	-	-	4,755,494.38	4,755,494.38
应付管理人报酬	-	-	-	208,874.25	208,874.25
应付托管费	-	-	-	26,109.28	26,109.28
应付清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	34,590.21	34,590.21
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	2.30	2.30
其他负债	-	-	-	108,249.54	108,249.54
负债总计	-	-	-	5,133,319.96	5,133,319.96
利率敏感度缺口	14,180,283.79	98,084.69	6,406.20	180,775,428.22	195,060,202.90

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（ 2025 年 6 月 30 日 ）	上年度末（ 2024 年 12 月 31 日 ）
	1. 市场利率平行上升 50 个基点	-1,822.95	-2,060.52
	2. 市场利率平行下降 50 个基点	1,867.86	2,113.69

6.4.13.4.2 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险，该风险可能与特定投资品种相关，也有可能与整体投资品种相关。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的债券和股票，所有市场价格因素

引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金在构建资产配置和基金资产投资组合的基础上，通过建立事前和事后跟踪误差的方式，对基金资产的市场价格风险进行管理。

6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产- 股票投资	196,092,229.83	89.76	183,109,809.56	93.87
交易性金融资产- 基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产- 贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权 证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	196,092,229.83	89.76	183,109,809.56	93.87

6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1.若对市场价格敏感的权益性投资的市场价格上升或下降 5%		
	2.其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（ 2025 年 6 月 30 日 ）	上年度末（ 2024 年 12 月 31 日 ）
	1. 权益性投资的市场价格上升 5%	9,804,611.49	9,155,490.48
	2. 权益性投资的市场价格下降 5%	-9,804,611.49	-9,155,490.48

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	195,847,267.20	182,842,383.04
第二层次	25,339.09	22,859.30
第三层次	320,853.83	349,058.11
合计	196,193,460.12	183,214,300.45

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括应收款项、卖出回购金融资产和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	196,092,229.83	88.82
	其中：股票	196,092,229.83	88.82
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	101,230.29	0.05

	其中：债券	101,230.29	0.05
	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	22,984,009.79	10.41
8	其他各项资产	1,595,783.53	0.72
9	合计	220,773,253.44	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	430,112.00	0.20
B	采矿业	7,816,905.00	3.58
C	制造业	115,612,671.87	52.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,470,152.00	2.50
E	建筑业	1,023,161.00	0.47
F	批发和零售业	3,555,881.28	1.63
G	交通运输、仓储和邮政业	1,778,158.00	0.81
H	住宿和餐饮业	137,061.00	0.06
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,015,750.86	4.58
J	金融业	9,844,402.10	4.51
K	房地产业	1,360,980.00	0.62
L	租赁和商务服务业	626,348.00	0.29
M	科学研究和技术服务业	2,005,818.68	0.92
N	水利、环境和公共设施管理业	1,488,296.00	0.68
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	1,351,061.00	0.62
S	综合	417,517.00	0.19
	合计	162,934,275.79	74.59

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	237,074.00	0.11
C	制造业	22,261,439.89	10.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	909,888.53	0.42
E	建筑业	1,195,870.00	0.55
F	批发和零售业	162,849.27	0.07
G	交通运输、仓储和邮政业	1,120,194.56	0.51
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,363,964.64	1.54
J	金融业	1,902,467.00	0.87
K	房地产业	953.00	0.00
L	租赁和商务服务业	684,087.92	0.31
M	科学研究和技术服务业	1,034,626.63	0.47
N	水利、环境和公共设施管理业	284,538.60	0.13
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	33,157,954.04	15.18

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	000050	深天马 A	299,701	2,553,452.52	1.17
2	600685	中船防务	93,100	2,531,389.00	1.16
3	002185	华天科技	231,600	2,339,160.00	1.07
4	600435	北方导航	133,200	2,076,588.00	0.95
5	300476	胜宏科技	14,100	1,894,758.00	0.87
6	002202	金风科技	180,700	1,852,175.00	0.85
7	002624	完美世界	117,900	1,788,543.00	0.82
8	600487	亨通光电	114,200	1,747,260.00	0.80
9	301165	锐捷网络	28,320	1,740,547.20	0.80
10	002056	横店东磁	122,100	1,727,715.00	0.79

11	002353	杰瑞股份	49,300	1,725,500.00	0.79
12	600060	海信视像	73,000	1,680,460.00	0.77
13	002683	广东宏大	49,200	1,669,848.00	0.76
14	300573	兴齐眼药	32,200	1,667,638.00	0.76
15	601717	中创智领	99,900	1,660,338.00	0.76
16	600380	健康元	150,200	1,656,706.00	0.76
17	600873	梅花生物	154,600	1,652,674.00	0.76
18	000988	华工科技	34,500	1,621,845.00	0.74
19	600298	安琪酵母	45,100	1,586,167.00	0.73
20	300373	扬杰科技	30,300	1,572,570.00	0.72
21	002080	中材科技	80,400	1,567,800.00	0.72
22	601231	环旭电子	107,000	1,565,410.00	0.72
23	002318	久立特材	66,300	1,550,757.00	0.71
24	300496	中科创达	26,900	1,539,218.00	0.70
25	600166	福田汽车	564,200	1,528,982.00	0.70
26	600582	天地科技	248,000	1,485,520.00	0.68
27	000921	海信家电	57,300	1,472,610.00	0.67
28	002414	高德红外	142,500	1,460,625.00	0.67
29	603737	三棵树	38,380	1,414,303.00	0.65
30	002821	凯莱英	15,900	1,403,175.00	0.64
31	002281	光迅科技	28,100	1,385,892.00	0.63
32	600498	烽火通信	65,600	1,379,568.00	0.63
33	300012	华测检测	117,800	1,377,082.00	0.63
34	600282	南钢股份	327,500	1,375,500.00	0.63
35	002595	豪迈科技	23,000	1,362,060.00	0.62
36	000513	丽珠集团	37,600	1,355,104.00	0.62
37	002008	大族激光	53,300	1,298,921.00	0.59
38	000709	河钢股份	576,500	1,245,240.00	0.57
39	002266	浙富控股	403,300	1,242,164.00	0.57
40	600499	科达制造	121,300	1,188,740.00	0.54
41	002517	恺英网络	59,700	1,152,807.00	0.53
42	600348	华阳股份	173,000	1,152,180.00	0.53
43	603129	春风动力	5,200	1,125,800.00	0.52
44	000519	中兵红箭	50,500	1,105,445.00	0.51
45	600885	宏发股份	48,860	1,090,066.60	0.50
46	000932	华菱钢铁	244,200	1,074,480.00	0.49
47	300207	欣旺达	53,000	1,063,180.00	0.49
48	600352	浙江龙盛	104,600	1,062,736.00	0.49
49	300017	网宿科技	98,900	1,060,208.00	0.49
50	600583	海油工程	192,600	1,051,596.00	0.48
51	000060	中金岭南	220,600	1,010,348.00	0.46
52	603816	顾家家居	39,100	997,832.00	0.46
53	002155	湖南黄金	55,380	988,533.00	0.45

54	600704	物产中大	184,200	970,734.00	0.44
55	600079	人福医药	45,500	954,590.00	0.44
56	002138	顺络电子	33,900	953,268.00	0.44
57	603379	三美股份	19,100	919,092.00	0.42
58	001696	宗申动力	40,400	906,980.00	0.42
59	300454	深信服	9,500	894,710.00	0.41
60	000636	风华高科	62,200	854,628.00	0.39
61	000039	中集集团	106,800	839,448.00	0.38
62	002831	裕同科技	35,100	822,042.00	0.38
63	000959	首钢股份	238,700	811,580.00	0.37
64	600271	航天信息	86,000	794,640.00	0.36
65	688213	思特威	7,293	745,490.46	0.34
66	603486	科沃斯	12,700	739,521.00	0.34
67	600143	金发科技	71,600	738,196.00	0.34
68	000960	锡业股份	47,800	731,340.00	0.33
69	002340	格林美	114,600	727,710.00	0.33
70	600862	中航高科	27,700	722,416.00	0.33
71	600764	中国海防	20,900	710,600.00	0.33
72	603087	甘李药业	12,900	706,662.00	0.32
73	603893	瑞芯微	4,600	698,556.00	0.32
74	300677	英科医疗	29,200	691,456.00	0.32
75	600096	云天化	30,900	678,873.00	0.31
76	688002	睿创微纳	9,587	668,405.64	0.31
77	600909	华安证券	113,500	661,705.00	0.30
78	000783	长江证券	92,200	638,946.00	0.29
79	000825	太钢不锈	176,900	635,071.00	0.29
80	600517	国网英大	123,900	631,890.00	0.29
81	600820	隧道股份	103,100	628,910.00	0.29
82	600153	建发股份	60,400	626,348.00	0.29
83	601568	北元集团	150,100	622,915.00	0.29
84	000728	国元证券	76,900	606,741.00	0.28
85	601139	深圳燃气	95,300	606,108.00	0.28
86	601179	中国西电	98,100	602,334.00	0.28
87	600098	广州发展	96,200	601,250.00	0.28
88	600739	辽宁成大	53,300	586,300.00	0.27
89	300803	指南针	7,260	585,591.60	0.27
90	300724	捷佳伟创	10,600	575,580.00	0.26
91	002532	天山铝业	68,700	570,897.00	0.26
92	601555	东吴证券	65,000	568,750.00	0.26
93	603858	步长制药	35,000	568,400.00	0.26
94	000887	中鼎股份	32,200	566,398.00	0.26
95	600578	京能电力	125,800	564,842.00	0.26
96	603596	伯特利	10,700	563,783.00	0.26

97	600299	安迪苏	58,400	563,560.00	0.26
98	600062	华润双鹤	30,200	563,532.00	0.26
99	002500	山西证券	96,200	561,808.00	0.26
100	300037	新宙邦	15,900	559,680.00	0.26
101	600132	重庆啤酒	10,102	556,620.20	0.25
102	003031	中瓷电子	10,156	540,400.76	0.25
103	600699	均胜电子	30,300	528,432.00	0.24
104	600549	厦门钨业	24,300	508,356.00	0.23
105	600959	江苏有线	145,200	499,488.00	0.23
106	600884	杉杉股份	52,200	493,812.00	0.23
107	002939	长城证券	58,900	493,582.00	0.23
108	000739	普洛药业	35,200	492,800.00	0.23
109	601456	国联民生	47,600	492,660.00	0.23
110	600528	中铁工业	66,200	488,556.00	0.22
111	000830	鲁西化工	47,000	484,100.00	0.22
112	601212	白银有色	154,600	483,898.00	0.22
113	603529	爱玛科技	14,000	481,600.00	0.22
114	600998	九州通	93,472	480,446.08	0.22
115	601577	长沙银行	47,000	467,180.00	0.21
116	002078	太阳纸业	34,600	465,716.00	0.21
117	000027	深圳能源	72,900	465,102.00	0.21
118	600021	上海电力	52,800	464,112.00	0.21
119	601168	西部矿业	27,200	452,336.00	0.21
120	600109	国金证券	50,600	443,762.00	0.20
121	600985	淮北矿业	38,500	436,590.00	0.20
122	600339	中油工程	132,000	431,640.00	0.20
123	688188	柏楚电子	3,271	430,659.86	0.20
124	600839	四川长虹	43,800	425,736.00	0.19
125	000893	亚钾国际	14,100	424,974.00	0.19
126	300919	中伟股份	12,900	424,152.00	0.19
127	600928	西安银行	107,700	422,184.00	0.19
128	603233	大参林	25,900	422,170.00	0.19
129	600673	东阳光	35,900	417,517.00	0.19
130	300627	华测导航	11,900	416,500.00	0.19
131	601928	凤凰传媒	36,800	411,056.00	0.19
132	003022	联泓新科	25,600	405,248.00	0.19
133	300604	长川科技	8,800	395,208.00	0.18
134	601958	金钼股份	36,100	394,934.00	0.18
135	300140	节能环保	64,000	394,880.00	0.18
136	601611	中国核建	42,900	394,251.00	0.18
137	688425	铁建重工	96,539	393,879.12	0.18
138	000937	冀中能源	67,800	389,850.00	0.18
139	002223	鱼跃医疗	10,900	388,040.00	0.18

140	603298	杭叉集团	18,500	387,575.00	0.18
141	600535	天士力	24,700	386,555.00	0.18
142	000623	吉林敖东	22,800	386,460.00	0.18
143	000729	燕京啤酒	29,500	381,435.00	0.17
144	600956	新天绿能	49,000	378,280.00	0.17
145	600895	张江高科	14,700	377,790.00	0.17
146	000987	越秀资本	54,900	376,614.00	0.17
147	688100	威胜信息	10,157	376,316.85	0.17
148	601216	君正集团	67,800	374,256.00	0.17
149	000423	东阿阿胶	7,000	366,100.00	0.17
150	601399	国机重装	121,300	363,900.00	0.17
151	688172	燕东微	18,400	361,744.00	0.17
152	600801	华新水泥	30,100	356,384.00	0.16
153	600141	兴发集团	17,200	353,116.00	0.16
154	603341	龙旗科技	8,600	349,418.00	0.16
155	600707	彩虹股份	53,700	346,902.00	0.16
156	688475	萤石网络	11,000	346,720.00	0.16
157	603927	中科软	17,900	346,186.00	0.16
158	688772	珠海冠宇	24,188	345,646.52	0.16
159	601598	中国外运	69,200	341,156.00	0.16
160	600007	中国国贸	16,000	329,280.00	0.15
161	300748	金力永磁	13,500	321,840.00	0.15
162	000831	中国稀土	8,300	299,796.00	0.14
163	600361	创新新材	72,900	290,871.00	0.13
164	002958	青农商行	77,600	280,136.00	0.13
165	000703	恒逸石化	46,100	271,068.00	0.12
166	688819	天能股份	9,721	269,854.96	0.12
167	300001	特锐德	10,900	261,273.00	0.12
168	601997	贵阳银行	41,800	260,832.00	0.12
169	600867	通化东宝	31,400	257,480.00	0.12
170	002926	华西证券	28,800	257,472.00	0.12
171	603939	益丰药房	10,360	253,509.20	0.12
172	605589	圣泉集团	9,100	252,525.00	0.12
173	600906	财达证券	37,000	252,340.00	0.12
174	688248	南网科技	8,008	251,931.68	0.12
175	000426	兴业银锡	15,900	251,220.00	0.12
176	002603	以岭药业	17,800	250,980.00	0.11
177	600497	驰宏锌锗	47,300	250,217.00	0.11
178	600329	达仁堂	7,500	250,200.00	0.11
179	002203	海亮股份	24,200	249,744.00	0.11
180	601636	旗滨集团	49,800	249,498.00	0.11
181	601990	南京证券	30,800	248,864.00	0.11
182	603885	吉祥航空	18,400	247,848.00	0.11

183	600637	东方明珠	33,000	246,510.00	0.11
184	300146	汤臣倍健	21,900	246,156.00	0.11
185	000898	鞍钢股份	106,100	246,152.00	0.11
186	603568	伟明环保	12,900	246,132.00	0.11
187	688578	艾力斯	2,645	246,090.80	0.11
188	002156	通富微电	9,600	245,952.00	0.11
189	600848	上海临港	27,100	245,797.00	0.11
190	600511	国药股份	8,400	244,944.00	0.11
191	002653	海思科	5,800	244,876.00	0.11
192	601061	中信金属	30,900	244,419.00	0.11
193	002608	江苏国信	33,300	244,089.00	0.11
194	002966	苏州银行	27,800	244,084.00	0.11
195	600056	中国医药	23,600	244,024.00	0.11
196	601016	节能风电	84,300	243,627.00	0.11
197	600995	南网储能	24,900	243,522.00	0.11
198	601158	重庆水务	52,400	243,136.00	0.11
199	600008	首创环保	80,500	243,110.00	0.11
200	600177	雅戈尔	33,300	243,090.00	0.11
201	600737	中粮糖业	25,700	242,865.00	0.11
202	001213	中铁特货	59,700	242,382.00	0.11
203	600598	北大荒	16,800	242,256.00	0.11
204	600483	福能股份	25,100	241,964.00	0.11
205	600925	苏能股份	46,200	241,626.00	0.11
206	002461	珠江啤酒	21,400	241,606.00	0.11
207	000598	兴蓉环境	33,500	241,535.00	0.11
208	601965	中国汽研	13,600	241,400.00	0.11
209	002294	信立泰	5,100	241,383.00	0.11
210	603156	养元饮品	11,400	241,224.00	0.11
211	600901	江苏金租	39,600	239,976.00	0.11
212	600004	白云机场	26,200	238,420.00	0.11
213	002064	华峰化学	36,000	237,960.00	0.11
214	600486	扬农化工	4,100	237,800.00	0.11
215	300765	新诺威	4,600	237,774.00	0.11
216	601991	大唐发电	74,900	237,433.00	0.11
217	601098	中南传媒	17,900	234,848.00	0.11
218	000429	粤高速 A	17,600	234,608.00	0.11
219	600295	鄂尔多斯	26,900	234,299.00	0.11
220	601128	常熟银行	31,550	232,523.50	0.11
221	600968	海油发展	56,900	232,152.00	0.11
222	601665	齐鲁银行	36,700	231,944.00	0.11
223	600566	济川药业	8,800	231,704.00	0.11
224	002444	巨星科技	9,000	229,590.00	0.11
225	601162	天风证券	46,500	229,245.00	0.10

226	002739	万达电影	19,200	219,456.00	0.10
227	688617	惠泰医疗	718	213,246.00	0.10
228	300251	光线传媒	10,300	208,781.00	0.10
229	600378	昊华科技	7,600	205,732.00	0.09
230	301358	湖南裕能	6,500	202,735.00	0.09
231	603606	东方电缆	3,900	201,669.00	0.09
232	300763	锦浪科技	3,500	200,865.00	0.09
233	688122	西部超导	3,871	200,827.48	0.09
234	000021	深科技	10,600	198,644.00	0.09
235	600563	法拉电子	1,800	196,362.00	0.09
236	002244	滨江集团	20,100	195,975.00	0.09
237	600038	中直股份	5,000	194,050.00	0.09
238	300567	精测电子	3,200	193,952.00	0.09
239	002409	雅克科技	3,500	191,415.00	0.09
240	300601	康泰生物	12,600	191,394.00	0.09
241	601118	海南橡胶	39,800	187,856.00	0.09
242	002841	视源股份	5,400	186,840.00	0.09
243	600312	平高电气	12,000	184,680.00	0.08
244	688249	晶合集成	9,000	182,430.00	0.08
245	000537	中绿电	21,400	178,904.00	0.08
246	600398	海澜之家	24,600	171,216.00	0.08
247	000009	中国宝安	17,900	158,952.00	0.07
248	002385	大北农	38,900	157,156.00	0.07
249	600879	航天电子	14,600	152,862.00	0.07
250	300558	贝达药业	2,600	150,670.00	0.07
251	002465	海格通信	10,800	150,552.00	0.07
252	603160	汇顶科技	2,100	149,163.00	0.07
253	601608	中信重工	34,100	149,017.00	0.07
254	002410	广联达	10,800	144,828.00	0.07
255	601233	桐昆股份	13,600	144,160.00	0.07
256	000528	柳 工	15,000	144,150.00	0.07
257	002430	杭氧股份	7,400	143,708.00	0.07
258	600521	华海药业	7,700	143,451.00	0.07
259	601108	财通证券	18,000	142,380.00	0.07
260	689009	九号公司	2,400	142,008.00	0.07
261	002508	老板电器	7,300	138,773.00	0.06
262	601921	浙版传媒	17,200	138,632.00	0.06
263	600977	中国电影	12,900	138,288.00	0.06
264	000591	太阳能	31,400	137,846.00	0.06
265	600516	方大炭素	29,600	137,344.00	0.06
266	600258	首旅酒店	9,700	137,061.00	0.06
267	301498	乖宝宠物	1,253	137,040.61	0.06
268	002007	华兰生物	8,700	136,329.00	0.06

269	002299	圣农发展	9,500	135,755.00	0.06
270	003035	南网能源	29,500	135,405.00	0.06
271	000539	粤电力 A	29,800	135,292.00	0.06
272	603565	中谷物流	13,900	132,745.00	0.06
273	600131	国网信通	7,400	130,980.00	0.06
274	601866	中远海发	52,300	129,181.00	0.06
275	300395	菲利华	2,500	127,750.00	0.06
276	600988	赤峰黄金	5,000	124,400.00	0.06
277	000733	振华科技	2,400	120,120.00	0.05
278	688563	航材股份	2,111	119,545.93	0.05
279	002558	巨人网络	5,000	117,750.00	0.05
280	000563	陕国投 A	32,000	114,240.00	0.05
281	300699	光威复材	3,600	114,012.00	0.05
282	603345	安井食品	1,400	112,588.00	0.05
283	603000	人民网	5,500	111,155.00	0.05
284	300487	蓝晓科技	2,200	110,660.00	0.05
285	600655	豫园股份	19,700	109,335.00	0.05
286	601228	广州港	33,400	107,882.00	0.05
287	002507	涪陵榨菜	8,400	107,436.00	0.05
288	601155	新城控股	7,800	106,704.00	0.05
289	600663	陆家嘴	11,900	105,434.00	0.05
290	603899	晨光股份	3,600	104,364.00	0.05
291	601000	唐山港	25,600	103,936.00	0.05
292	300054	鼎龙股份	2,200	63,096.00	0.03
293	603589	口子窖	1,200	41,760.00	0.02
294	688278	特宝生物	192	13,845.12	0.01
295	688582	芯动联科	164	11,020.80	0.01
296	688017	绿的谐波	66	8,242.74	0.00
297	688702	盛科通信	103	6,291.24	0.00
298	688561	奇安信	185	6,286.30	0.00
299	688153	唯捷创芯	101	3,132.01	0.00
300	688114	华大智造	47	3,047.01	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	601126	四方股份	62,500	1,016,875.00	0.47
2	002230	科大讯飞	19,500	933,660.00	0.43
3	600482	中国动力	39,600	913,572.00	0.42
4	000425	徐工机械	110,600	859,362.00	0.39

5	601117	中国化学	109,600	840,632.00	0.38
6	688502	茂莱光学	2,823	812,064.18	0.37
7	603444	吉比特	1,900	573,705.00	0.26
8	300866	安克创新	4,400	499,840.00	0.23
9	301080	百普赛斯	6,900	493,557.00	0.23
10	002376	新北洋	60,000	466,200.00	0.21
11	600755	厦门国贸	75,600	457,380.00	0.21
12	603799	华友钴业	12,200	451,644.00	0.21
13	600320	振华重工	86,000	375,820.00	0.17
14	688450	光格科技	13,667	361,082.14	0.17
15	002001	新 和 成	16,700	355,209.00	0.16
16	688479	友车科技	18,600	351,540.00	0.16
17	688060	云涌科技	9,519	348,300.21	0.16
18	600642	申能股份	39,300	337,980.00	0.15
19	002487	大金重工	10,200	335,580.00	0.15
20	600219	南山铝业	86,700	332,061.00	0.15
21	601288	农业银行	54,900	322,812.00	0.15
22	601992	金隅集团	205,000	311,600.00	0.14
23	688005	容百科技	13,255	295,851.60	0.14
24	002268	电科网安	15,200	278,008.00	0.13
25	301305	朗坤科技	15,000	269,250.00	0.12
26	601919	中远海控	17,600	264,704.00	0.12
27	002972	科安达	21,500	264,235.00	0.12
28	002871	伟隆股份	23,200	258,216.00	0.12
29	002668	TCL 智家	26,300	256,951.00	0.12
30	001210	金房能源	18,737	256,509.53	0.12
31	601628	中国人寿	6,200	255,378.00	0.12
32	000725	京东方 A	63,200	252,168.00	0.12
33	603259	药明康德	3,600	250,380.00	0.11
34	002399	海普瑞	20,900	248,919.00	0.11
35	600066	宇通客车	10,000	248,600.00	0.11
36	002543	万和电气	22,100	245,531.00	0.11
37	001283	豪鹏科技	4,500	245,025.00	0.11
38	002534	西子洁能	21,500	241,660.00	0.11
39	002881	美格智能	5,200	241,280.00	0.11
40	002384	东山精密	6,300	237,951.00	0.11
41	600420	国药现代	22,300	237,495.00	0.11
42	688089	嘉必优	9,400	236,410.00	0.11
43	603699	纽威股份	7,500	233,775.00	0.11
44	688516	奥特维	7,000	232,680.00	0.11
45	600350	山东高速	21,800	232,388.00	0.11
46	002011	盾安环境	19,900	230,840.00	0.11
47	600500	中化国际	59,600	228,268.00	0.10

48	688296	和达科技	17,157	225,271.41	0.10
49	600057	厦门象屿	31,800	223,554.00	0.10
50	000726	鲁 泰 A	34,800	220,632.00	0.10
51	603313	梦百合	25,700	218,450.00	0.10
52	000498	山东路桥	37,000	217,560.00	0.10
53	000521	长虹美菱	31,300	217,222.00	0.10
54	300729	乐歌股份	15,000	214,800.00	0.10
55	603759	海天股份	23,400	198,666.00	0.09
56	301678	新恒汇	3,435	198,308.96	0.09
57	002209	达 意 隆	15,400	193,270.00	0.09
58	300777	中简科技	5,300	192,125.00	0.09
59	600584	长电科技	5,700	192,033.00	0.09
60	301031	中熔电气	2,400	191,160.00	0.09
61	600460	士兰微	7,700	191,114.00	0.09
62	301503	智迪科技	4,900	186,445.00	0.09
63	603989	艾华集团	12,100	186,340.00	0.09
64	301236	软通动力	3,400	185,776.00	0.09
65	603456	九洲药业	12,200	185,562.00	0.08
66	301367	瑞迈特	2,200	185,020.00	0.08
67	000938	紫光股份	7,600	182,324.00	0.08
68	300418	昆仑万维	5,400	181,602.00	0.08
69	000401	冀东水泥	41,000	179,580.00	0.08
70	688187	时代电气	4,200	179,130.00	0.08
71	603600	永艺股份	16,400	174,496.00	0.08
72	002901	大博医疗	4,800	173,952.00	0.08
73	002920	德赛西威	1,700	173,621.00	0.08
74	300033	同花顺	600	163,806.00	0.07
75	000877	天山股份	35,200	163,328.00	0.07
76	301265	华新环保	16,000	163,200.00	0.07
77	603173	福斯达	4,400	156,420.00	0.07
78	603808	歌力思	18,800	156,040.00	0.07
79	301061	匠心家居	2,000	155,080.00	0.07
80	002705	新宝股份	10,500	154,350.00	0.07
81	601311	骆驼股份	17,000	153,510.00	0.07
82	002032	苏 泊 尔	2,900	151,931.00	0.07
83	688128	中国电研	6,200	151,900.00	0.07
84	002284	亚太股份	13,700	151,385.00	0.07
85	603916	苏博特	16,400	148,584.00	0.07
86	301002	崧盛股份	6,700	148,137.00	0.07
87	301362	民爆光电	3,600	146,916.00	0.07
88	001872	招商港口	7,300	144,978.00	0.07
89	301273	瑞晨环保	5,900	143,960.00	0.07
90	603898	好莱客	13,000	142,870.00	0.07

91	603665	康隆达	5,700	141,246.00	0.06
92	600741	华域汽车	8,000	141,200.00	0.06
93	001238	浙江正特	3,600	141,120.00	0.06
94	688517	金冠电气	9,800	140,924.00	0.06
95	002988	豪美新材	3,700	140,600.00	0.06
96	603515	欧普照明	7,800	140,322.00	0.06
97	000705	浙江震元	16,400	138,580.00	0.06
98	600268	国电南自	17,700	138,414.00	0.06
99	002989	中天精装	4,100	137,678.00	0.06
100	002102	能特科技	43,500	137,460.00	0.06
101	002174	游族网络	11,300	137,069.00	0.06
102	002847	盐津铺子	1,700	136,680.00	0.06
103	688131	皓元医药	2,800	135,380.00	0.06
104	600016	民生银行	28,100	133,475.00	0.06
105	601166	兴业银行	5,700	133,038.00	0.06
106	600908	无锡银行	21,000	132,510.00	0.06
107	601169	北京银行	19,400	132,502.00	0.06
108	001203	大中矿业	13,900	131,355.00	0.06
109	002839	张家港行	28,800	129,600.00	0.06
110	600012	皖通高速	7,400	125,652.00	0.06
111	605499	东鹏饮料	400	125,620.00	0.06
112	002028	思源电气	1,700	123,947.00	0.06
113	600201	生物股份	14,700	117,894.00	0.05
114	002479	富春环保	23,300	116,733.00	0.05
115	301469	恒达新材	4,345	115,229.40	0.05
116	600305	恒顺醋业	14,900	115,177.00	0.05
117	302132	中航成飞	1,300	114,322.00	0.05
118	002454	松芝股份	14,800	114,256.00	0.05
119	000952	广济药业	18,300	113,094.00	0.05
120	301115	联检科技	7,300	113,077.00	0.05
121	600531	豫光金铅	14,500	112,230.00	0.05
122	000977	浪潮信息	2,200	111,936.00	0.05
122	603309	维力医疗	8,800	111,936.00	0.05
123	603187	海容冷链	9,300	109,368.00	0.05
124	000900	现代投资	25,700	108,711.00	0.05
125	600351	亚宝药业	17,900	108,653.00	0.05
126	601939	建设银行	11,500	108,560.00	0.05
127	002606	大连电瓷	12,100	107,932.00	0.05
128	600919	江苏银行	9,000	107,460.00	0.05
129	600222	太龙药业	19,200	107,328.00	0.05
130	300779	惠城环保	600	107,094.00	0.05
131	001227	兰州银行	42,600	106,500.00	0.05
132	000603	盛达资源	7,100	105,719.00	0.05

133	000089	深圳机场	15,300	105,570.00	0.05
134	600269	赣粤高速	20,700	104,742.00	0.05
135	601600	中国铝业	13,700	96,448.00	0.04
136	000657	中钨高新	7,300	86,578.00	0.04
137	301589	诺瓦星云	567	82,402.11	0.04
138	601319	中国人保	9,100	79,261.00	0.04
139	688573	信宇人	2,234	77,296.40	0.04
140	301511	德福科技	3,270	67,689.00	0.03
141	000534	万泽股份	4,500	67,140.00	0.03
142	688508	芯朋微	1,200	66,984.00	0.03
143	300770	新媒股份	1,400	55,986.00	0.03
144	301533	威马农机	1,442	54,161.52	0.02
145	300363	博腾股份	3,100	52,948.00	0.02
146	603296	华勤技术	600	48,408.00	0.02
147	002936	郑州银行	22,200	45,732.00	0.02
148	603400	华之杰	569	31,875.73	0.01
149	688693	锆威特	857	28,289.57	0.01
150	601818	光大银行	6,500	26,975.00	0.01
151	688169	石头科技	168	26,300.40	0.01
152	600030	中信证券	900	24,858.00	0.01
153	688775	影石创新	185	22,969.60	0.01
154	301458	钧崴电子	648	22,103.28	0.01
155	603235	天新药业	800	21,832.00	0.01
156	688225	亚信安全	1,000	20,390.00	0.01
157	603325	博隆技术	224	20,224.96	0.01
158	603312	西典新能	544	19,948.48	0.01
159	300952	恒辉安防	700	19,936.00	0.01
160	002352	顺丰控股	400	19,504.00	0.01
161	301487	盟固利	867	18,926.61	0.01
162	001387	雪祺电气	1,331	18,287.94	0.01
163	688583	思看科技	227	18,087.36	0.01
164	603969	银龙股份	2,400	17,592.00	0.01
165	000800	一汽解放	2,500	17,150.00	0.01
166	301018	申菱环境	451	17,110.94	0.01
167	301602	超研股份	658	16,318.40	0.01
168	688603	天承科技	361	15,956.20	0.01
169	001388	信通电子	937	15,385.54	0.01
170	301535	浙江华远	734	13,938.66	0.01
171	600022	山东钢铁	10,700	13,910.00	0.01
172	688757	胜科纳米	536	13,903.84	0.01
173	301479	弘景光电	171	13,315.77	0.01
174	688758	赛分科技	777	13,185.69	0.01
175	301421	波长光电	158	12,638.42	0.01

176	301550	斯菱股份	135	12,054.15	0.01
177	301662	宏工科技	143	11,797.50	0.01
178	300308	中际旭创	80	11,668.80	0.01
179	301601	惠通科技	342	11,576.70	0.01
180	301413	安培龙	151	11,543.95	0.01
181	001391	国货航	1,671	11,245.83	0.01
182	300394	天孚通信	140	11,177.60	0.01
183	688648	中邮科技	232	10,943.44	0.01
184	301275	汉朔科技	191	10,732.29	0.00
185	301658	首航新能	437	10,042.26	0.00
186	688591	泰凌微	208	9,963.20	0.00
187	603072	天和磁材	179	9,746.55	0.00
188	300904	威力传动	178	9,665.40	0.00
189	301488	豪恩汽电	135	9,558.00	0.00
190	301585	蓝宇股份	273	9,363.90	0.00
191	001230	劲旅环境	450	9,211.50	0.00
192	301665	泰禾股份	393	8,799.27	0.00
193	301526	国际复材	2,395	8,717.80	0.00
194	301501	恒鑫生活	186	8,410.92	0.00
195	688755	汉邦科技	203	7,983.99	0.00
196	001356	富岭股份	547	7,898.68	0.00
197	301173	毓恬冠佳	173	7,781.54	0.00
198	603194	中力股份	168	7,625.52	0.00
199	301590	优优绿能	54	7,531.92	0.00
200	301516	中远通	449	7,498.30	0.00
201	301566	达利凯普	400	7,420.00	0.00
202	001382	新亚电缆	366	7,396.86	0.00
203	301486	致尚科技	106	7,321.42	0.00
204	301261	恒工精密	99	7,216.11	0.00
205	301508	中机认检	213	7,199.40	0.00
206	688652	京仪装备	121	6,935.72	0.00
207	688549	中巨芯	855	6,617.70	0.00
208	301459	丰茂股份	155	6,572.00	0.00
209	301348	蓝箭电子	270	6,353.10	0.00
210	301636	泽润新能	128	6,074.88	0.00
211	301381	赛维时代	303	6,044.85	0.00
212	301489	思泉新材	105	6,036.45	0.00
213	301292	海科新源	261	5,898.60	0.00
214	301517	陕西华达	143	5,818.67	0.00
215	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
216	301015	百洋医药	275	5,516.50	0.00
217	301558	三态股份	607	5,469.07	0.00
218	301202	朗威股份	133	5,466.30	0.00

219	688720	艾森股份	124	5,305.96	0.00
220	301560	众捷汽车	190	5,215.50	0.00
221	301370	国科恒泰	469	4,994.85	0.00
222	301568	思泰克	130	4,946.50	0.00
223	301507	民生健康	338	4,904.38	0.00
224	301555	惠柏新材	176	4,845.28	0.00
225	603119	浙江荣泰	101	4,670.24	0.00
226	301509	金凯生科	123	4,648.17	0.00
227	301578	辰奕智能	129	4,616.91	0.00
228	601096	宏盛华源	1,099	4,549.86	0.00
229	603210	泰鸿万立	286	4,464.46	0.00
230	603049	中策橡胶	104	4,456.40	0.00
231	688653	康希通信	354	4,336.50	0.00
232	301505	苏州规划	189	4,129.65	0.00
233	603124	江南新材	88	4,075.28	0.00
234	301518	长华化学	186	4,023.18	0.00
235	688716	中研股份	107	3,809.20	0.00
236	301393	昊帆生物	71	3,802.76	0.00
237	001395	亚联机械	80	3,780.00	0.00
238	603014	威高血净	115	3,758.20	0.00
239	688651	盛邦安全	104	3,549.52	0.00
240	688719	爱科赛博	83	3,527.50	0.00
241	301500	飞南资源	164	3,512.88	0.00
242	301525	儒竞科技	45	3,475.35	0.00
243	301548	崇德科技	68	3,314.32	0.00
244	603271	永杰新材	94	3,297.52	0.00
245	301372	科净源	143	3,260.40	0.00
246	301528	多浦乐	60	3,229.20	0.00
247	001390	古麒绒材	178	3,225.36	0.00
248	603193	润本股份	102	3,203.82	0.00
249	603202	天有为	35	3,173.10	0.00
250	688671	碧兴物联	148	3,159.80	0.00
251	603373	安邦护卫	64	3,153.92	0.00
252	301296	新巨丰	305	2,931.05	0.00
253	603257	中国瑞林	78	2,922.66	0.00
254	301418	协昌科技	79	2,886.66	0.00
255	301559	中集环科	177	2,835.54	0.00
256	301519	舜禹股份	205	2,816.70	0.00
257	688602	康鹏科技	332	2,782.16	0.00
258	301529	福赛科技	87	2,725.71	0.00
259	601083	锦江航运	243	2,699.73	0.00
260	301371	敷尔佳	103	2,613.11	0.00
261	688646	ST 逸飞	91	2,608.06	0.00

262	603409	汇通控股	78	2,598.96	0.00
263	301520	万邦医药	58	2,500.38	0.00
264	603273	天元智能	142	2,459.44	0.00
265	301515	港通医疗	119	2,419.27	0.00
266	603382	海阳科技	105	2,350.95	0.00
267	001335	信凯科技	80	2,244.00	0.00
268	001378	德冠新材	100	2,217.00	0.00
269	001306	夏厦精密	29	2,202.26	0.00
270	603120	肯特催化	65	2,172.95	0.00
271	688657	浩辰软件	50	2,123.50	0.00
272	001239	永达股份	142	2,121.48	0.00
273	688612	威迈斯	79	2,112.46	0.00
274	603270	金帝股份	82	2,106.58	0.00
275	001326	联域股份	59	2,008.36	0.00
276	603004	鼎龙科技	77	1,685.53	0.00
277	603107	上海汽配	104	1,619.28	0.00
278	603276	恒兴新材	86	1,412.12	0.00
279	001358	兴欣新材	59	1,411.87	0.00
280	603075	热威股份	59	1,179.41	0.00
281	603231	索宝蛋白	68	1,113.84	0.00
282	300787	海能实业	80	1,108.00	0.00
283	400174	中天 3	95,300	953.00	0.00
284	600372	中航机载	66	795.96	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	600685	中船防务	3,042,383.00	1.56
2	002624	完美世界	2,771,295.00	1.42
3	002185	华天科技	2,547,191.00	1.31
4	000825	太钢不锈	2,080,648.00	1.07
5	300207	欣旺达	2,065,938.00	1.06
6	300017	网宿科技	2,065,002.00	1.06
7	600282	南钢股份	2,063,497.00	1.06
8	600582	天地科技	2,026,253.00	1.04
9	601231	环旭电子	1,892,568.00	0.97
10	002683	广东宏大	1,828,290.00	0.94
11	002202	金风科技	1,804,837.00	0.93
12	002281	光迅科技	1,764,987.00	0.90
13	600271	航天信息	1,741,136.00	0.89

14	300573	兴齐眼药	1,736,960.20	0.89
15	300496	中科创达	1,721,897.00	0.88
16	000830	鲁西化工	1,704,369.00	0.87
17	600583	海油工程	1,703,536.00	0.87
18	600079	人福医药	1,690,210.00	0.87
19	600060	海信视像	1,685,341.00	0.86
20	603816	顾家家居	1,673,279.00	0.86

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	300054	鼎龙股份	2,666,150.00	1.37
2	002831	裕同科技	2,629,141.00	1.35
3	600143	金发科技	2,181,249.00	1.12
4	002273	水晶光电	2,152,181.00	1.10
5	000825	太钢不锈	2,044,379.00	1.05
6	300476	胜宏科技	1,997,499.00	1.02
7	300207	欣旺达	1,916,431.00	0.98
8	600486	扬农化工	1,905,117.00	0.98
9	002384	东山精密	1,853,017.08	0.95
10	000528	柳 工	1,835,205.00	0.94
11	002019	亿帆医药	1,827,389.00	0.94
12	000988	华工科技	1,816,439.00	0.93
13	000539	粤电力 A	1,765,275.00	0.90
14	000060	中金岭南	1,743,179.00	0.89
15	600141	兴发集团	1,738,121.00	0.89
16	600498	烽火通信	1,726,620.00	0.89
17	002368	太极股份	1,706,945.00	0.88
18	002250	联化科技	1,658,504.00	0.85
19	600583	海油工程	1,651,673.00	0.85
20	000039	中集集团	1,606,076.00	0.82

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	306,046,415.71
卖出股票收入（成交）总额	306,784,607.90

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

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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）	101,230.29	0.05
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	101,230.29	0.05

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	123158	宙邦转债	605	73,749.09	0.03
2	123257	安克转债	90	9,000.55	0.00
3	127090	兴瑞转债	76	8,979.39	0.00
4	113683	伟 24 转债	30	3,980.20	0.00
5	118040	宏微转债	30	3,424.60	0.00

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

本报告期内，本基金投资国债期货符合既定的投资政策和投资目的。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

报告期内基金投资的前十名证券除胜宏科技（证券代码 300476）外其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

根据 2025 年 1 月 16 日发布的相关公告，该证券发行人因违反海关监管规定被中华人民共和国西永海关处以罚款。

根据 2025 年 4 月 16 日发布的相关公告，该证券发行人因违反海关监管规定被中华人民共和国梅沙海关处以罚款。

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	1,281,226.87
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	314,556.66
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,595,783.53

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	123158	宙邦转债	73,749.09	0.03
2	127090	兴瑞转债	8,979.39	0.00
3	113683	伟 24 转债	3,980.20	0.00
4	118040	宏微转债	3,424.60	0.00
5	118042	奥维转债	1,126.35	0.00
6	123250	嘉益转债	970.11	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 500 指数增强 A	7,535	10,246.55	-	-	77,207,729.89	100.00%
招商中证 500 指数增强 C	4,880	14,801.41	11,416,078.79	15.80%	60,814,819.05	84.20%
合计	12,415	12,036.94	11,416,078.79	7.64%	138,022,548.94	92.36%

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	43,458.96	0.0563%
	招商中证 500 指数增强 C	1.00	0.0000%
	合计	43,459.96	0.0291%

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	招商中证 500 指数增强 A	0~10
	招商中证 500 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	72,585,963.28	70,698,479.30
本报告期基金总申购份额	30,603,990.55	32,129,488.57
减：本报告期基金总赎回份额	25,982,223.94	30,597,070.03
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	77,207,729.89	72,230,897.84

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

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

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

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

本报告期内，经中国银行股份有限公司研究决定，聘任边济东先生为资产托管部总经理。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	
华泰证券	4	219,341,619.69	35.87%	21,920.10	35.88%	-
中信证券	8	104,637,772.19	17.11%	10,448.46	17.10%	本报告期减少 3 个
中信建投证券	2	64,075,457.40	10.48%	6,401.46	10.48%	本报告期减少 3 个
国泰海通证券	7	63,655,772.52	10.41%	6,359.53	10.41%	-
方正证券	4	59,165,464.93	9.68%	5,910.35	9.67%	本报告期减少 3 个
平安证券	3	47,955,829.81	7.84%	4,790.46	7.84%	-
广发证券	6	42,062,831.30	6.88%	4,201.91	6.88%	本报告期减少 2 个
银河证券	1	8,589,141.49	1.40%	858.12	1.40%	-
申万宏源	2	2,003,555.94	0.33%	200.16	0.33%	-
北京证券	2	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
第一创业	3	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
光大证券	3	-	-	-	-	-
国海证券	3	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国联民生	4	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国投证券	4	-	-	-	-	-
国新证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	3	-	-	-	-	-
国元证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	本报告 期减少 3 个
华宝证券	4	-	-	-	-	-
华创证券	4	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	4	-	-	-	-	-
华西证券	3	-	-	-	-	-
华源证券	2	-	-	-	-	-
华鑫证券	2	-	-	-	-	-
汇丰前海 证券	2	-	-	-	-	本报告 期新增
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	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	本报告 期新增
山西证券	6	-	-	-	-	-
上海证券	2	-	-	-	-	-
申港证券	1	-	-	-	-	-

世纪证券	1	-	-	-	-	-
首创证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	本报告 期减少 1 个
天府证券	2	-	-	-	-	-
万和证券	1	-	-	-	-	-
五矿证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	2	-	-	-	-	本报告 期减少 1 个
信达证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
粤开证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	5	-	-	-	-	本报告 期减少 1 个
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	2	-	-	-	-	-
中银国际 证券	3	-	-	-	-	-
中邮证券	2	-	-	-	-	-
甬兴证券	2	-	-	-	-	-

注：（一）选择标准

1、证券公司应财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强，并通过基金管理人的尽职调查。

2、被动股票型基金选择佣金费率相对较低，能够提供优质证券交易服务的证券公司。

3、被动股票型基金以外类型基金选择能够提供优质研究服务的证券公司。

（二）选择程序

1、基金管理人根据上述标准进行评估并确定选用的证券公司。

2、基金管理人与被选择的证券公司签订交易单元租用协议/证券经纪服务协议。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通证券	30,384.63	41.93%	-	-	-	-
方正证券	42,082.43	58.07%	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
北京证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
诚通证券	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国联民生	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
国新证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-

华福证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
华源证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
汇丰前海 证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证 券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
天府证券	-	-	-	-	-	-
万和证券	-	-	-	-	-	-
五矿证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
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	关于警惕冒用招商基金管理有限公司名义进行诈骗活动的特别提示公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-01-14
2	招商基金管理有限公司旗下基金 2024 年第 4 季度报告提示性公告	上海证券报及基金管理人网站	2025-01-21
3	招商中证 500 指数增强型证券投资基金 2024 年第 4 季度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-01-21
4	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	2025-02-26
5	招商基金管理有限公司关于招融资本私募股权基金管理（深圳）有限责任公司股东变更的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-08
6	关于招商基金管理有限公司旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-19
7	招商中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同（2025 年 3 月 21 日修订）	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-19
8	招商中证 500 指数增强型证券投资基金托管协议（2025 年 3 月 21 日修订）	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-19
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	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-21
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	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-21
11	招商中证 500 指数增强型证券投资基金更新的招募说明书（二零二五年第一号）	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-21
12	招商基金管理有限公司旗下基金 2024 年年度报告提示性公告	上海证券报及基金管理人网站	2025-03-28
13	招商中证 500 指数增强型证券投资基金 2024 年年度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-28
14	招商基金管理有限公司关于运用固有资金投资旗下公募基金的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-04-08
15	招商基金管理有限公司旗下基金 2025 年第 1 季度报告提示性公告	上海证券报及基金管理人网站	2025-04-21

16	招商中证 500 指数增强型证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-04-21
17	招商基金管理有限公司关于提醒投资者持续完善身份信息资料的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-05-09
18	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	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-05-16
19	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	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-05-16
20	招商中证 500 指数增强型证券投资基金更新的招募说明书（二零二五年第二号）	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-05-16
21	招商基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-05-20
22	招商基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-05-30
23	招商基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-06-19
24	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	2025-06-25
25	招商基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-06-27

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准设立招商基金管理有限公司的文件；
- 2、中国证券监督管理委员会批准招商中证 500 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。

11.2 存放地点

招商基金管理有限公司

地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

11.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人招商基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-887-9555

网址：<http://www.cmfcchina.com>

招商基金管理有限公司

2025 年 8 月 28 日