

招商中证 800 指数增强型证券投资基金 2026 年中期报告

2026 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：交通银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 31 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 28 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 2026 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	5
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
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	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	16
§7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	41
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	56
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	58
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	58
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	58
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	58
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	59
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	59

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	59
7.12 投资组合报告附注	59
§8 基金份额持有人信息	60
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	60
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	60
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	61
§9 开放式基金份额变动	61
§10 重大事件揭示	61
10.1 基金份额持有人大会决议	61
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	61
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	62
10.4 基金投资策略的改变	62
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	62
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	62
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	62
10.8 其他重大事件	63
§11 备查文件目录	64
11.1 备查文件目录	64
11.2 存放地点	64
11.3 查阅方式	64

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	招商中证 800 指数增强型证券投资基金	
基金简称	招商中证 800 指数增强	
基金主代码	016276	
交易代码	016276	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 8 月 23 日	
基金管理人	招商基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	349,138,204.29 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 800 指数增强 A	招商中证 800 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	016276	016277
报告期末下属分级基金的份额总额	209,291,124.64 份	139,847,079.65 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过数量化的投资方法与严格的投资纪律约束，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。同时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%。
投资策略	本基金作为增强指数型基金，以跟踪标的指数为主，一般情况下保持各类资产配置的基本稳定，与此同时，在综合考量系统性风险、各类资产收益风险比值、股票资产估值、流动性要求、申购赎回以及分红等因素后，在有效控制基金跟踪误差的前提下，对基金资产进行合理配置。 本基金其他主要投资策略包括：股票投资策略、港股投资策略、债券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、股票期权投资策略、资产支持证券投资策略、存托凭证投资策略、参与融资及转融通证券出借业务投资策略。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率*95%+中国人民银行人民币活期存款利率（税后）*5%
风险收益特征	本基金是股票型基金，其预期风险收益水平高于债券型基金及货币市场基金。 本基金资产投资于港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有投资风险，包括港股市场股价波动较大的风险（港股市场实行 T+0 回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动可能对基金的投资收益造成损失）、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险（在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交

	易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险）等。
--	----------------------------

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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	潘西里
	联系电话	0755—83196666
	电子邮箱	cmf@cmfchina.com
客户服务电话	400-887-9555	95559
传真	0755—83196475	021-62701216
注册地址	深圳市福田区深南大道 7088 号	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号
办公地址	深圳市福田区深南大道 7088 号	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码	518040	200336
法定代表人	王颖	任德奇

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.cmfchina.com
基金中期报告置备地点	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 800 指数增强 A

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	23,813,636.09
本期利润	32,535,720.15
加权平均基金份额本期利润	0.1974
本期加权平均净值利润率	14.02%
本期基金份额净值增长率	14.82%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)

期末可供分配利润	79,329,075.75
期末可供分配基金份额利润	0.3790
期末基金资产净值	318,502,455.93
期末基金份额净值	1.5218
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	52.18%

2、招商中证 800 指数增强 C

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	16,537,501.74
本期利润	23,152,204.94
加权平均基金份额本期利润	0.1822
本期加权平均净值利润率	13.23%
本期基金份额净值增长率	14.53%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	49,312,479.87
期末可供分配基金份额利润	0.3526
期末基金资产净值	208,754,966.23
期末基金份额净值	1.4927
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	49.27%

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 800 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
过去三个月	16.79%	1.35%	13.02%	1.27%	3.77%	0.08%
过去六个月	14.82%	1.26%	10.59%	1.18%	4.23%	0.08%
过去一年	42.37%	1.10%	31.40%	1.04%	10.97%	0.06%
过去三年	56.45%	1.14%	33.44%	1.12%	23.01%	0.02%
自基金合同	52.18%	1.09%	23.47%	1.08%	28.71%	0.01%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

招商中证 800 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
过去三个月	16.64%	1.35%	13.02%	1.27%	3.62%	0.08%
过去六个月	14.53%	1.26%	10.59%	1.18%	3.94%	0.08%
过去一年	41.65%	1.09%	31.40%	1.04%	10.25%	0.05%
过去三年	54.12%	1.14%	33.44%	1.12%	20.68%	0.02%
自基金合同 生效起至今	49.27%	1.09%	23.47%	1.08%	25.80%	0.01%

3.2.2 自基金合同生效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800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800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		
王平	本基金基金经理	2022 年 8 月 23 日	-	20	男，管理学硕士，FRM。2006 年加入招商基金管理有限公司，曾任投资风险管理部助理数量分析师、风险管理部数量分析师、高级风控经理，主要负责公司投资风险管理、金融工程研究等工作，曾任招商深证 100 指数证券投资基金、上证消费 80 交易型开放式指数证券投资基金、招商上证消费 80 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、深证电子信息传媒产业(TMT)50 交易型开放式指数证券投资基金、招商深证电子信息传媒产业(TMT)50 交易型开放式指

					数证券投资基金联接基金、招商中证大宗商品股票指数证券投资基金（LOF）、招商央视财经 50 指数证券投资基金、招商中证煤炭等权指数分级证券投资基金、招商中证银行指数分级证券投资基金、招商国证生物医药指数分级证券投资基金、招商中证白酒指数分级证券投资基金、招商稳荣定期开放灵活配置混合型证券投资基金、招商财经大数据策略股票型证券投资基金、招商中证 1000 指数增强型证券投资基金、招商盛合灵活配置混合型证券投资基金、招商中证 500 指数增强型证券投资基金、招商中证 500 等权重指数增强型证券投资基金、招商沪深 300 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、招商中证银行 AH 价格优选交易型开放式指数证券投资基金、招商中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、招商中证银行 AH 价格优选交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，现任量化投资部总监兼招商量化精选股票型发起式证券投资基金、招商沪深 300 指数增强型证券投资基金、招商中证红利交易型开放式指数证券投资基金、招商中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金、招商中证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金、招商中证 800 指数增强型证券投资基金、招商中证 2000 指数增强型证券投资基金、招商成长量化选股股票型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

基金管理人已建立较完善的研究方法和投资决策流程，确保各投资组合享有公平的投资决策机会。基金管理人建立了所有组合适用的投资对象备选库，制定明确的备选库建立、维护程序。基金管理人拥有健全的投资授权制度，明确投资决策委员会、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限划分，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的

操作需要经过严格的审批程序。基金管理人的相关研究成果向内部所有投资组合开放，在投资研究层面不存在各投资组合间不公平的问题。

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，本基金各项交易均严格按照相关法律法规、基金合同的有关要求执行，公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 15 次，为旗下指数及量化等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，A 股市场呈现一季度震荡走平、二季度分化上行的趋势。其中，沪深 300 指数上涨 7.55%，中证 500 指数上涨 20.97%，中证 800 指数上涨 11.12%，中证 1000 指数上涨 15.99%，表征小盘风格的中证 2000 指数上涨 9.10%，以科技成长板块为主的创业板指数和科创 50 指数分别上涨 35.58% 和 64.25%。从中信一级行业来看，仅 9 个行业收益为正，在人工智能产业趋势带动下，电子、通信行业涨幅超 70%；其余 21 个行业收益为负，其中消费者服务、综合金融、综合等行业跌幅居前。从因子角度来看，市场风格明显偏向高贝塔、高动量，低估值与盈利因子表现不佳。

本基金 A 份额、C 份额在报告期内净值分别增长 14.82% 和 14.53%，相对业绩基准的超额收益分别为 4.23% 和 3.94%。对产品整体的业绩归因分析如下：

1. 对产品整体的绝对收益率进行拆解，新股打新贡献了 1.58%，其他股票贡献了 12.68%，股指期货多头贡献了 1.07%。

2. Brinson 归因：使用 Brinson 模型对股票部分相对中证 800 指数的超额收益率进行拆解，市场配置（A 股和港股两个市场）贡献了 -0.19%，行业配置贡献了 -0.31%，剔除新股后的个股选择贡献了 3.52%。行业配置和个股选择合计贡献前五大的行业依次为：医药生物、国防军工、电力设备、建筑材料、银行。

3. Barra 归因：使用 BarraCNLT 模型对剔除新股后 A 股部分的超额收益率进行拆解，得到行业因子贡献了-0.06%，风格因子贡献了 4.34%，个股选择贡献了-0.79%。风格因子中正贡献前三的因子依次为动量（Momentum）、贝塔（Beta）和成长（Growth）。

产品运作上，我们将通过精细化的投资管理、多元化的策略搭配，努力在争取更优超额收益的同时，尽量降低超额收益的最大回撤，为投资者创造更加稳定、可持续的超额收益率。

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 14.82%，同期业绩基准增长率为 10.59%，C 类份额净值增长率为 14.53%，同期业绩基准增长率为 10.59%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2026 年上半年中国经济运行总体平稳，实际 GDP 同比增长 4.7%，财政前置发力，货币政策适度宽松但边际审慎。生产端，得益于出口需求的结构性韧性与制造业持续转型升级，工业增加值增速总体稳中有进。需求端，外需提供较强支撑，居民消费尚未全面回暖，呈现商品弱、服务强的格局。经济的 K 型分化体现在生产、需求、投资、消费、价格等多个维度。

展望下半年，经济有望实现温和修复。一方面，政策储备、出口韧性、新兴高技术制造业延续高景气等因素将为经济增长提供结构性支撑；另一方面，内需特别是居民消费与房地产相关领域的恢复仍需时间，预计经济 K 型分化态势大概率将持续。对应到证券市场，市场或会进入高波动、高震荡阶段，宏观环境的复杂性、内部的结构分化以及外部不确定性，均可能加剧市场情绪的波动与资金博弈的难度，亦使得短期市场主线的持续性及切换节奏难以精准预判，对超额收益的稳定性带来挑战。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。本基金管理人设有估值委员会，估值委员会成员均具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备相应的专业胜任能力和相关工作经历。估值委员会负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，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。

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。

本基金管理人已与第三方定价服务机构签署服务协议，由其按合同约定提供相关投资品种的估值数据。

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 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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，基金托管人在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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，基金管理人在本基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

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

本托管人依法对管理人编制和披露的本报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、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 800 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	58,743,941.49	28,385,259.58
结算备付金		3,972,141.93	6,335,271.55

存出保证金		4,636,992.00	1,866,873.60
交易性金融资产	6.4.7.2	462,180,840.95	286,094,684.79
其中：股票投资		462,130,839.92	286,046,684.16
基金投资		-	-
债券投资		50,001.03	48,000.63
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		9,514.64	-
应收申购款		2,218,781.24	1,047,807.41
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		531,762,212.25	323,729,896.93
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		1,137,179.45	2,853,518.87
应付赎回款		2,936,923.96	3,013,739.19
应付管理人报酬		213,907.39	162,870.85
应付托管费		35,651.19	27,145.16
应付销售服务费		69,332.37	77,240.60
应付投资顾问费		-	-
应交税费		40,040.06	5,267.85
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	71,755.67	20,000.00
负债合计		4,504,790.09	6,159,782.52
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	349,138,204.29	241,889,079.03
其他综合收益		-	-

未分配利润	6.4.7.8	178,119,217.87	75,681,035.38
净资产合计		527,257,422.16	317,570,114.41
负债和净资产总计		531,762,212.25	323,729,896.93

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，招商中证 800 指数增强 A 份额净值 1.5218 元，基金份额总额 209,291,124.64 份；招商中证 800 指数增强 C 份额净值 1.4927 元，基金份额总额 139,847,079.65 份；总份额合计 349,138,204.29 份。

6.2 利润表

会计主体：招商中证 800 指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		57,623,009.43	14,022,787.96
1.利息收入		75,431.97	29,381.58
其中：存款利息收入	6.4.7.9	75,431.97	19,408.71
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		-	9,972.87
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		42,119,078.83	11,910,251.40
其中：股票投资收益	6.4.7.10	35,053,385.09	9,259,226.50
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	67,746.89	19,056.64
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	3,731,172.10	408,268.43
股利收益	6.4.7.15	3,266,774.75	2,223,699.83
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	15,336,787.26	2,059,469.85
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	91,711.37	23,685.13
减：二、营业总支出		1,935,084.34	1,108,975.91
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	1,210,659.32	599,349.35
其中：暂估管理人报酬		-	-
2.托管费	6.4.10.2.2	201,776.50	99,891.58
3.销售服务费	6.4.10.2.3	435,854.56	341,118.60
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		13,468.66	1,475.52
8.其他费用	6.4.7.19	73,325.30	67,140.86
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		55,687,925.09	12,913,812.05
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		55,687,925.09	12,913,812.05
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		55,687,925.09	12,913,812.05

6.3 净资产变动表

会计主体：招商中证 800 指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 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	241,889,079.03	-	75,681,035.38	317,570,114.41
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	241,889,079.03	-	75,681,035.38	317,570,114.41
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	107,249,125.26	-	102,438,182.49	209,687,307.75
（一）、综合收益总额	-	-	55,687,925.09	55,687,925.09
（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）	107,249,125.26	-	46,750,257.40	153,999,382.66
其中：1.基金申购款	331,771,398.99	-	135,128,870.31	466,900,269.30
2.基金赎回款	-224,522,273.73	-	-88,378,612.91	-312,900,886.64
（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	349,138,204.29	-	178,119,217.87	527,257,422.16
项目	上年度可比期间 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	220,579,809.77	-	-1,001,762.31	219,578,047.46
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	220,579,809.77	-	-1,001,762.31	219,578,047.46
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-33,898,694.54	-	11,793,777.69	-22,104,916.85
（一）、综合收益总额	-	-	12,913,812.05	12,913,812.05
（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）	-33,898,694.54	-	-1,120,034.36	-35,018,728.90
其中：1.基金申购款	113,153,426.74	-	1,767,686.65	114,921,113.39
2.基金赎回款	-147,052,121.28	-	-2,887,721.01	-149,939,842.29
（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	186,681,115.23	-	10,792,015.38	197,473,130.61

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 800 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 800 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[2022]1425 号文准予公开募集注册。本基金为契约型开放式基金，存续期限为不定期。本基金首次设立募集基金份额为 240,393,821.32 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(22)第 00417 号验资报告。《招商中证 800 指数增强型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)于 2022 年 8 月 23 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，基金托管人为交通银行股份有限公司(以下简称“交通银行”)。

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、创业板及其他中国证监会允许投资的股票和存托凭证)、港股通标的股票、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券、可分离交易可转债、可交换债券及其他中国证监会允许投资的债券)、资产支持证

券、债券回购、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款、通知存款及其他银行存款)、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权,以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。本基金投资于股票、存托凭证资产的比例不低于基金资产的 80%,其中港股通标的股票投资比例不超过本基金股票资产的 50%;投资于标的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股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后,基金保留的现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。股指期货、国债期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照国家相关法律法规或监管机构的规定执行。资产投资于港股通标的股票或选择不将基金资产投资于港股通标的股票,基金资产并非必然投资港股通标的股票。如果法律法规对基金合同约定投资组合比例限制进行变更的,待履行相应程序后,以变更后的规定为准。本基金可根据相关法律法规和基金合同的约定,参与融资业务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。

本基金的业绩比较基准为:中证 800 指数收益率 $\times$ 95%+中国人民银行人民币活期存款利率(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 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2026 年 1 月 1 日至 2026 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

本基金本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内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》、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[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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[2021]33号《关于北京证券交易所税收政策适用问题的公告》、财税[2024]8号《关于延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]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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》、财税[2025]4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令 第826号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》、财税[2026]12号《关于明确增值税应税交易销售额计算口径的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，公开募集证券投资基金管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，以基金管理人为增值税纳税人，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对公募证券投资基金(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、债券取得的收入以及金融同业往来利息收入免征增值税。

(2) 对证券投资基金取得的自 2025 年 8 月 8 日之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税；取得的在 2025 年 8 月 8 日之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

(3) 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，暂不征收企业所得税。

(4) 对证券投资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。其中，对基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所挂牌交易的上市公司限售股，解禁后取得的股息红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。对基金通过港股通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过港股通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(5) 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，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。对于基金通过港股通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(6) 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 2026 年 6 月 30 日
活期存款	6,420,055.95
等于：本金	6,420,028.68
加：应计利息	27.27
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	52,323,885.54
等于：本金	52,320,883.07
加：应计利息	3,002.47
减：坏账准备	-
合计	58,743,941.49

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
----	---------------------

		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		420,662,311.02	-	462,130,839.92	41,468,528.90
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	49,999.82	1.21	50,001.03	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	49,999.82	1.21	50,001.03	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		420,712,310.84	1.21	462,180,840.95	41,468,528.90

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 2026 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	37,897,940.00	-	-	-
其中：股指期货投资	37,897,940.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	37,897,940.00	-	-	-

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
IC2607	中证 500 期货 2607	3.00	5,356,920.00	81,160.00
IC2609	中证 500 期货 2609	4.00	7,009,120.00	409,360.00
IF2607	沪深 300 期货 2607	4.00	5,906,400.00	-31,380.00
IF2609	沪深 300 期货 2609	14.00	20,369,160.00	284,520.00
合计				743,660.00
减：可抵销期货暂收款				743,660.00
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 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	69,596.22
其他	2,159.45
合计	71,755.67

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

招商中证 800 指数增强 A		
项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	104,987,237.83	104,987,237.83
本期申购	195,078,803.76	195,078,803.76
本期赎回（以“-”号填列）	-90,774,916.95	-90,774,916.95
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	209,291,124.64	209,291,124.64

招商中证 800 指数增强 C	
项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	136,901,841.20	136,901,841.20
本期申购	136,692,595.23	136,692,595.23
本期赎回（以“-”号填列）	-133,747,356.78	-133,747,356.78
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	139,847,079.65	139,847,079.65

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 800 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	24,976,211.26	9,184,789.78	34,161,001.04
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	24,976,211.26	9,184,789.78	34,161,001.04
本期利润	23,813,636.09	8,722,084.06	32,535,720.15
本期基金份额交易产生的变动数	30,539,228.40	11,975,381.70	42,514,610.10
其中：基金申购款	57,974,689.69	22,216,043.06	80,190,732.75
基金赎回款	-27,435,461.29	-10,240,661.36	-37,676,122.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	79,329,075.75	29,882,255.54	109,211,331.29

招商中证 800 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	29,768,728.85	11,751,305.49	41,520,034.34
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	29,768,728.85	11,751,305.49	41,520,034.34
本期利润	16,537,501.74	6,614,703.20	23,152,204.94
本期基金份额交易产生的变动数	3,006,249.28	1,229,398.02	4,235,647.30
其中：基金申购款	38,755,378.96	16,182,758.60	54,938,137.56
基金赎回款	-35,749,129.68	-14,953,360.58	-50,702,490.26
本期已分配利润	-	-	-
本期末	49,312,479.87	19,595,406.71	68,907,886.58

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
----	------------------------------------

活期存款利息收入	1,605.97
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	41,674.35
结算备付金利息收入	31,613.10
其他	538.55
合计	75,431.97

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	35,053,385.09
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	35,053,385.09

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	620,864,556.63
减：卖出股票成本总额	585,174,818.91
减：交易费用	636,352.63
买卖股票差价收入	35,053,385.09

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	6.37
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	67,740.52
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	67,746.89

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	161,149.98
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	93,399.73
减：应计利息总额	6.24
减：交易费用	3.49
买卖债券差价收入	67,740.52

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	3,731,172.10

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	3,266,774.75
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	3,266,774.75

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	15,104,822.56
——股票投资	15,104,822.56
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	231,964.70
——权证投资	-
——期货投资	231,964.70
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	15,336,787.26

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
----	------------------------------------

基金赎回费收入	91,711.37
合计	91,711.37

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	10,088.85
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
其他	3,729.08
合计	73,325.30

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，本基金无需要说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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
交通银行股份有限公司	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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,210,659.32	599,349.35
其中：应支付销售机构的客户维护费	473,481.85	276,994.59
应支付基金管理人的净管理费	737,177.47	322,354.76

注：支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值×0.60%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日基金管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	201,776.50	99,891.58

注：支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值×0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

6.4.10.2.3 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 2026 年 1 月 1 日至 2026 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 800 指数增强 A	招商中证 800 指数增强 C	合计
交通银行	-	2,691.82	2,691.82

招商基金管理有限公司	-	36,599.99	36,599.99
招商银行	-	56,739.63	56,739.63
招商证券	-	255.78	255.78
合计	-	96,287.22	96,287.22
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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 800 指数增强 A	招商中证 800 指数增强 C	合计
交通银行	-	4,324.64	4,324.64
招商基金管理有限公司	-	312.47	312.47
招商银行	-	49,306.54	49,306.54
招商证券	-	3.36	3.36
合计	-	53,947.01	53,947.01

注：本基金的 C 类基金份额的年销售服务费率为 0.50%，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$C \text{ 类份额日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金资产净值} \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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
交通银行-活期	6,420,055.95	1,605.97	3,090,475.91	1,262.17

注：本基金的银行存款由基金托管人交通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 2026 年 1 月 1 日至 2026 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	603459	红板科技	网下申购	2,785	49,294.50
招商证券	001365	天海电子	网下申购	1,469	39,942.11

上年度可比期间 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

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（2026 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
001220	世盟股份	2026 年 1 月 27 日	6 个月	新股流通受限	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-
001237	惠康科技	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	53.26	58.74	181	9,640.06	10,631.94	-
001248	华润新能	2026 年	6 个月	新股流通	10.11	10.11	14,679	148,404.69	148,404.69	-

	源	6 月 24 日		受限						
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	1 个月内 (含)	新股流通受限	10.11	10.11	6,290	63,591.90	63,591.90	-
001257	盛龙股份	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股流通受限	7.82	20.74	1,743	13,630.26	36,149.82	-
001312	福恩股份	2026 年 4 月 14 日	6 个月	新股流通受限	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-
001365	天海电子	2026 年 5 月 11 日	6 个月	新股流通受限	27.19	31.31	441	11,990.79	13,807.71	-
001393	维通利	2026 年 5 月 8 日	6 个月	新股流通受限	30.38	38.99	312	9,478.56	12,164.88	-
001399	惠科股份	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通受限	10.12	27.73	2,251	22,780.12	62,420.23	-
301513	尚水智能	2026 年 4 月 10 日	6 个月	新股流通受限	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-
301531	春光集团	2026 年 4 月 28 日	6 个月	新股流通受限	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-
301599	理奇智能	2026 年 4 月 22 日	6 个月	新股流通受限	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-
301666	大普微	2026 年 4 月 8 日	6 个月	新股流通受限	46.08	463.33	645	29,721.60	298,847.85	-
301669	高特电子	2026 年 6 月 2 日	6 个月	新股流通受限	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-
301680	固德电材	2026 年 2 月 27 日	6 个月	新股流通受限	58.00	112.16	117	6,786.00	13,122.72	-
301682	宏明电子	2026 年 3 月 18 日	6 个月	新股流通受限	69.66	160.06	417	29,048.22	66,745.02	-
301683	慧谷新材	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股流通受限	78.38	121.77	96	7,524.48	11,689.92	-

301687	新广益	2025 年 12 月 24 日	6 个月	新股流通 受限	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-
301696	三瑞智能	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通 受限	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-
601112	振石股份	2026 年 1 月 21 日	6 个月	新股流通 受限	11.18	17.59	325	3,633.50	5,716.75	-
603284	林平发展	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股流通 受限	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-
603293	埃泰克	2026 年 4 月 9 日	6 个月	新股流通 受限	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-
603352	至信股份	2026 年 1 月 8 日	6 个月	新股流通 受限	21.88	25.52	111	2,428.68	2,832.72	-
603407	长裕集团	2026 年 4 月 29 日	6 个月	新股流通 受限	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	-
603435	嘉德利	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通 受限	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603459	红板科技	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通 受限	17.70	84.32	279	4,938.30	23,525.28	-
688635	长进光子	2026 年 5 月 20 日	6 个月	新股流通 受限	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-
688712	北芯生命	2026 年 1 月 28 日	6 个月	新股流通 受限	17.52	35.92	1,450	25,404.00	52,084.00	-
688759	必贝特	2025 年 10 月 21 日	9 个月	新股流通 受限	17.78	30.65	7,061	125,544.58	216,419.65	-
688765	禾元生物	2025 年 10 月 16 日	9 个月	新股流通 受限	29.06	48.56	5,282	153,494.92	256,493.92	-
688781	视涯科技	2026 年 3 月 18 日	6 个月	新股流通 受限	22.68	47.61	144	3,265.92	6,855.84	-
688785	恒运昌	2026 年 1 月 20	6 个月	新股流通 受限	92.18	463.15	85	7,835.30	39,367.75	-

		日								
688790	昂瑞微	2025 年 12 月 9 日	9 个月	新股流通 受限	83.06	126.45	927	76,996.62	117,219.15	-
688795	摩尔线程	2025 年 11 月 26 日	9 个月	新股流通 受限	114.28	676.94	1,181	134,964.68	799,466.14	-
688797	臻宝科技	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通 受限	44.56	468.67	168	7,486.08	78,736.56	-
688802	沐曦股份	2025 年 12 月 9 日	9 个月	新股流通 受限	104.66	768.89	832	87,077.12	639,716.48	-
688808	联讯仪器	2026 年 4 月 16 日	6 个月	新股流通 受限	81.88	1,584.33	105	8,597.40	166,354.65	-
688811	有研复材	2026 年 4 月 1 日	6 个月	新股流通 受限	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-
688813	泰金新能	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股流通 受限	26.28	172.09	234	6,149.52	40,269.06	-
688816	易思维	2026 年 2 月 4 日	6 个月	新股流通 受限	55.95	57.10	139	7,777.05	7,936.90	-
688818	电科蓝天	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股流通 受限	9.47	70.14	1,034	9,791.98	72,524.76	-
688820	盛合晶微	2026 年 4 月 13 日	6 个月	新股流通 受限	19.68	141.49	612	12,044.16	86,591.88	-
920136	永励精密	2026 年 6 月 25 日	1 个月 内（含）	新股流通 受限	19.28	19.28	300	5,784.00	5,784.00	-
920193	吉和昌	2026 年 6 月 18 日	1 个月 内（含）	新股流通 受限	8.52	8.52	300	2,556.00	2,556.00	-

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
111025	圣泉转债	2026 年 6 月 25 日	1 个月 内（含）	新债未上 市	100.00	100.00	130	12,999.97	13,000.14	-
118071	华峰转债	2026 年	1 个月	新债未上	100.00	100.00	70	6,999.98	7,000.10	-

		6 月 23 日	内（含）市							
118072	鼎通转债	2026 年 6 月 24 日	1 个月 内（含）市	新债未上市	100.00	100.00	300	29,999.87	30,000.79	-

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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026 年 6 月 29 日	重大事项停牌	879.53	2026 年 7 月 13 日	890.99	1,118	423,794.74	983,314.54	-

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

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，董事会及下设审计委员会、风险控制委员会、督察长、风险管理委员会、监察稽核部门和风险管理部门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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	50,001.03	48,000.63
未评级	-	-
合计	50,001.03	48,000.63

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分别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约约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值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。

此外，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中约定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负债的账面价值，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 2026 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	58,743,941.49	-	-	-	58,743,941.49
结算备付金	3,972,141.93	-	-	-	3,972,141.93
存出保证金	-	-	-	4,636,992.00	4,636,992.00
交易性金融资产	-	-	50,001.03	462,130,839.92	462,180,840.95
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资	-	-	-	-	-

产					
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	9,514.64	9,514.64
应收申购款	-	-	-	2,218,781.24	2,218,781.24
应收清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	62,716,083.42	-	50,001.03	468,996,127.80	531,762,212.25
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,936,923.96	2,936,923.96
应付管理人报酬	-	-	-	213,907.39	213,907.39
应付托管费	-	-	-	35,651.19	35,651.19
应付清算款	-	-	-	1,137,179.45	1,137,179.45
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	69,332.37	69,332.37
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	40,040.06	40,040.06
其他负债	-	-	-	71,755.67	71,755.67
负债总计	-	-	-	4,504,790.09	4,504,790.09
利率敏感度缺口	62,716,083.42	-	50,001.03	464,491,337.71	527,257,422.16
上年度末 2025 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	28,385,259.58	-	-	-	28,385,259.58
结算备付金	6,335,271.55	-	-	-	6,335,271.55
存出保证金	-	-	-	1,866,873.60	1,866,873.60
交易性金融资产	-	-	48,000.63	286,046,684.16	286,094,684.79
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	1,047,807.41	1,047,807.41
应收清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	34,720,531.13	-	48,000.63	288,961,365.17	323,729,896.93
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,013,739.19	3,013,739.19
应付管理人报酬	-	-	-	162,870.85	162,870.85
应付托管费	-	-	-	27,145.16	27,145.16
应付清算款	-	-	-	2,853,518.87	2,853,518.87
卖出回购金融资	-	-	-	-	-

产款					
应付销售服务费	-	-	-	77,240.60	77,240.60
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	5,267.85	5,267.85
其他负债	-	-	-	20,000.00	20,000.00
负债总计	-	-	-	6,159,782.52	6,159,782.52
利率敏感度缺口	34,720,531.13	-	48,000.63	282,801,582.65	317,570,114.41

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（ 2026 年 6 月 30 日 ）	上年度末（ 2025 年 12 月 31 日 ）
	1. 市场利率平行上升 50 个基点	-1,416.93	-1,371.25
	2. 市场利率平行下降 50 个基点	1,465.76	1,418.83

6.4.13.4.2 外汇风险

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
货币资金	-	-	-	-
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	-	6,742,166.29	-	6,742,166.29
衍生金融资产	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-
应收股利	1,788.41	1,555.35	-	3,343.76
应收申购款	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	1,788.41	6,743,721.64	-	6,745,510.05
以外币计价的负债				
应付清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-

应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	1,788.41	6,743,721.64	-	6,745,510.05

项目	上年度末 2025 年 12 月 31 日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
货币资金	-	-	-	-
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	-	16,226,982.27	-	16,226,982.27
衍生金融资产	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	16,226,982.27	-	16,226,982.27
以外币计价的负债				
应付清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	16,226,982.27	-	16,226,982.27

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的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（ 2026 年 6 月 30 日 ）	上年度末（ 2025 年 12 月 31 日 ）
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	337,275.50	811,349.11

	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-337,275.50	-811,349.11
--	-------------------	-------------	-------------

6.4.13.4.3 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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 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	462,130,839.92	87.65	286,046,684.16	90.07
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	462,130,839.92	87.65	286,046,684.16	90.07

6.4.13.4.3.2 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（ 2026 年 6 月 30 日 ）	上年度末（ 2025 年 12 月 31 日 ）
	1. 权益性投资的市场价格上升 5%	23,106,542.00	14,302,334.21
	2. 权益性投资的市场价格下降 5%	-23,106,542.00	-14,302,334.21

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	457,621,656.96	283,410,903.89
第二层次	1,253,652.16	604,400.63
第三层次	3,305,531.83	2,079,380.27
合计	462,180,840.95	286,094,684.79

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末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	462,130,839.92	86.91
	其中：股票	462,130,839.92	86.91
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	50,001.03	0.01

	其中：债券	50,001.03	0.01
	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	62,716,083.42	11.79
8	其他各项资产	6,865,287.88	1.29
9	合计	531,762,212.25	100.00

注：上表权益投资中通过港股通交易机制投资的港股金额人民币 6,742,166.29 元，占基金净值比例 1.28%。

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	963,041.00	0.18
B	采矿业	19,922,104.00	3.78
C	制造业	266,463,628.27	50.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,431,871.00	1.41
E	建筑业	2,137,064.00	0.41
F	批发和零售业	3,953,045.00	0.75
G	交通运输、仓储和邮政业	10,119,691.56	1.92
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,129,031.94	2.87
J	金融业	48,226,437.00	9.15
K	房地产业	972,172.00	0.18
L	租赁和商务服务业	1,998,230.00	0.38
M	科学研究和技术服务业	3,310,689.00	0.63
N	水利、环境和公共设施管理业	2,709,126.00	0.51
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	288,219.00	0.05
R	文化、体育和娱乐业	147,288.00	0.03
S	综合	-	-
	合计	383,771,637.77	72.79

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	37,743.00	0.01
B	采矿业	3,054,293.82	0.58
C	制造业	57,718,496.93	10.95
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	816,156.59	0.15
E	建筑业	673,494.00	0.13
F	批发和零售业	2,416,204.20	0.46
G	交通运输、仓储和邮政业	549,556.90	0.10
H	住宿和餐饮业	37,128.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	521,502.00	0.10
J	金融业	348,480.00	0.07
K	房地产业	175,384.00	0.03
L	租赁和商务服务业	2,187,004.00	0.41
M	科学研究和技术服务业	1,273,607.42	0.24
N	水利、环境和公共设施管理业	824,724.00	0.16
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	775,920.00	0.15
Q	卫生和社会工作	61,842.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	145,499.00	0.03
S	综合	-	-
	合计	71,617,035.86	13.58

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
通信服务	1,306,559.77	0.25
非日常生活消费品	324,373.03	0.06
日常消费品	385,426.88	0.07
能源	-	-
金融	-	-
医疗保健	43,974.69	0.01
工业	715,476.75	0.14
信息技术	3,966,355.17	0.75
原材料	-	-
房地产	-	-
公用事业	-	-
合计	6,742,166.29	1.28

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

7.3.1 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	300308	中际旭创	17,776	22,575,520.00	4.28
2	603986	兆易创新	20,100	16,381,500.00	3.11
3	300750	宁德时代	34,070	13,389,850.70	2.54
4	601688	华泰证券	434,000	8,949,080.00	1.70
5	600519	贵州茅台	7,000	8,298,430.00	1.57
6	601166	兴业银行	439,900	7,284,744.00	1.38
7	002463	沪电股份	44,900	6,860,720.00	1.30
8	002384	东山精密	25,600	6,716,160.00	1.27
9	002475	立讯精密	78,700	5,540,480.00	1.05
10	601899	紫金矿业	195,700	4,919,898.00	0.93
11	600176	中国巨石	65,400	4,766,352.00	0.90
12	002142	宁波银行	158,200	4,696,958.00	0.89
13	601288	农业银行	762,600	4,628,982.00	0.88
14	301308	江波龙	6,400	4,504,320.00	0.85
15	688008	澜起科技	14,237	4,412,046.30	0.84
16	605117	德业股份	39,100	4,151,638.00	0.79
17	000333	美的集团	48,400	3,655,652.00	0.69
18	300502	新易盛	5,740	3,484,180.00	0.66
19	688041	海光信息	9,131	3,381,209.30	0.64
20	300857	协创数据	9,740	3,310,626.00	0.63
21	300373	扬杰科技	20,900	3,286,107.00	0.62
22	300458	全志科技	77,060	3,040,787.60	0.58
23	300604	长川科技	8,900	3,038,638.00	0.58
24	601318	中国平安	63,100	3,012,394.00	0.57
25	002466	天齐锂业	44,700	2,741,004.00	0.52
26	688629	华丰科技	14,595	2,736,708.45	0.52
27	601601	中国太保	95,800	2,732,216.00	0.52
28	688256	寒武纪	1,698	2,709,243.90	0.51
29	601225	陕西煤业	131,800	2,682,130.00	0.51
30	002266	浙富控股	528,500	2,674,210.00	0.51
31	002008	大族激光	17,500	2,626,925.00	0.50
32	603993	洛阳钼业	149,100	2,616,705.00	0.50
33	000725	京东方 A	295,400	2,564,072.00	0.49
34	000408	藏格矿业	36,400	2,523,248.00	0.48
35	603259	药明康德	20,100	2,502,651.00	0.47
36	300059	东方财富	118,000	2,404,840.00	0.46

37	688692	达梦数据	9,730	2,376,941.70	0.45
38	002493	荣盛石化	215,900	2,320,925.00	0.44
39	300394	天孚通信	7,420	2,245,885.60	0.43
40	600549	厦门钨业	26,200	2,232,240.00	0.42
41	002371	北方华创	2,500	2,211,400.00	0.42
42	002916	深南电路	4,700	2,152,130.00	0.41
43	002709	天赐材料	41,600	2,139,488.00	0.41
44	688498	源杰科技	1,126	2,123,636.00	0.40
45	300475	香农芯创	6,900	2,070,000.00	0.39
46	600026	中远海能	111,700	2,003,898.00	0.38
47	600674	川投能源	141,000	1,997,970.00	0.38
48	001309	德明利	2,100	1,980,090.00	0.38
49	688521	芯原股份	5,323	1,975,578.22	0.37
50	300054	鼎龙股份	18,000	1,907,460.00	0.36
51	600309	万华化学	27,800	1,901,798.00	0.36
52	600489	中金黄金	104,200	1,880,810.00	0.36
53	000951	中国重汽	95,000	1,853,450.00	0.35
54	603019	中科曙光	17,200	1,844,356.00	0.35
55	601816	京沪高铁	406,300	1,840,539.00	0.35
56	300223	北京君正	7,300	1,816,970.00	0.34
57	600183	生益科技	10,300	1,786,020.00	0.34
58	601699	潞安环能	120,300	1,717,884.00	0.33
59	601021	春秋航空	36,687	1,672,193.46	0.32
60	300408	三环集团	9,800	1,635,620.00	0.31
61	600499	科达制造	117,700	1,624,260.00	0.31
62	688266	泽璟制药	13,528	1,578,176.48	0.30
63	300953	震裕科技	11,600	1,550,920.00	0.29
64	688012	中微公司	3,285	1,539,022.50	0.29
65	601398	工商银行	216,100	1,527,827.00	0.29
66	603338	浙江鼎力	35,900	1,525,750.00	0.29
67	688981	中芯国际	9,282	1,474,167.24	0.28
68	600030	中信证券	51,200	1,470,976.00	0.28
69	600885	宏发股份	42,000	1,448,580.00	0.27
70	000960	锡业股份	33,800	1,442,922.00	0.27
71	601872	招商轮船	79,100	1,389,787.00	0.26
72	601211	国泰海通	75,200	1,368,640.00	0.26
73	688220	翱捷科技	11,001	1,367,644.32	0.26
74	000001	平安银行	130,600	1,312,530.00	0.25
75	002821	凯莱英	8,000	1,296,000.00	0.25
76	688235	百济神州	5,044	1,284,252.84	0.24
77	600522	中天科技	21,100	1,280,348.00	0.24
78	600941	中国移动	14,200	1,223,046.00	0.23
79	600879	航天电子	57,300	1,219,917.00	0.23

80	300661	圣邦股份	8,500	1,219,580.00	0.23
81	002407	多氟多	24,000	1,205,520.00	0.23
82	600111	北方稀土	24,900	1,196,445.00	0.23
83	000338	潍柴动力	43,500	1,185,375.00	0.22
84	600801	华新建材	75,300	1,174,680.00	0.22
85	000657	中钨高新	12,200	1,167,784.00	0.22
86	300628	亿联网络	34,500	1,166,790.00	0.22
87	600392	盛和资源	38,900	1,158,053.00	0.22
88	300432	富临精工	57,200	1,149,148.00	0.22
89	301536	星宸科技	8,800	1,132,648.00	0.21
90	300454	深信服	11,700	1,125,540.00	0.21
91	301358	湖南裕能	14,800	1,122,876.00	0.21
92	002138	顺络电子	15,200	1,111,120.00	0.21
93	688313	仕佳光子	6,000	1,107,900.00	0.21
94	688676	金盘科技	13,000	1,100,320.00	0.21
95	688002	睿创微纳	7,099	1,098,144.31	0.21
96	600039	四川路桥	140,100	1,095,582.00	0.21
97	301165	锐捷网络	13,600	1,094,120.00	0.21
98	600988	赤峰黄金	41,500	1,092,280.00	0.21
99	600150	中国船舶	32,200	1,088,038.00	0.21
100	301200	大族数控	3,000	1,081,950.00	0.21
101	600795	国电电力	231,200	1,079,704.00	0.20
102	688347	华虹宏力	3,200	1,076,160.00	0.20
103	300972	万辰集团	6,100	1,057,801.00	0.20
104	688200	华峰测控	1,994	1,047,049.40	0.20
105	000776	广发证券	44,700	1,045,980.00	0.20
106	603799	华友钴业	21,400	1,032,764.00	0.20
107	600601	方正科技	74,300	1,028,312.00	0.20
108	601229	上海银行	116,500	1,011,220.00	0.19
109	688111	金山办公	4,746	1,011,135.30	0.19
110	000807	云铝股份	45,500	1,007,370.00	0.19
111	601888	中国中免	18,600	999,006.00	0.19
112	603379	三美股份	13,000	986,570.00	0.19
113	688072	拓荆科技	1,118	983,314.54	0.19
114	603345	安井食品	12,100	970,299.00	0.18
115	002414	高德红外	70,900	940,134.00	0.18
116	000975	山金国际	55,000	935,000.00	0.18
117	600887	伊利股份	39,000	934,440.00	0.18
118	002353	杰瑞股份	6,100	930,250.00	0.18
119	002714	牧原股份	26,300	920,237.00	0.17
120	601658	邮储银行	185,600	915,008.00	0.17
121	600536	中国软件	32,000	899,840.00	0.17
122	600535	天士力	67,900	898,317.00	0.17

123	600482	中国动力	27,000	885,600.00	0.17
124	002841	视源股份	25,500	880,515.00	0.17
125	688019	安集科技	2,575	874,109.50	0.17
126	003022	联泓新科	33,700	872,830.00	0.17
127	300763	锦浪科技	9,400	849,290.00	0.16
128	600025	华能水电	94,900	843,661.00	0.16
129	601136	首创证券	60,300	841,185.00	0.16
130	003816	中国广核	215,000	840,650.00	0.16
131	600023	浙能电力	158,000	831,080.00	0.16
132	600938	中国海油	30,500	828,075.00	0.16
133	300073	当升科技	17,200	826,288.00	0.16
134	603979	金诚信	13,900	820,517.00	0.16
135	601012	隆基绿能	62,300	817,376.00	0.16
136	601997	贵阳银行	158,300	812,079.00	0.15
137	300012	华测检测	58,300	808,038.00	0.15
138	002064	华峰化学	84,900	805,701.00	0.15
139	002851	麦格米特	4,800	802,464.00	0.15
140	603156	养元饮品	16,200	794,934.00	0.15
141	002415	海康威视	22,800	779,760.00	0.15
142	600010	宝钢股份	347,900	775,817.00	0.15
143	000429	粤高速 A	56,774	774,965.10	0.15
144	000858	五粮液	10,400	769,600.00	0.15
145	600595	中孚实业	136,900	769,378.00	0.15
146	600688	上海石化	262,300	768,539.00	0.15
147	002271	东方雨虹	64,600	766,802.00	0.15
148	002049	紫光国微	8,500	754,375.00	0.14
149	603444	吉比特	2,100	752,682.00	0.14
150	600362	江西铜业	16,800	727,440.00	0.14
151	688187	时代电气	10,575	726,079.50	0.14
152	600015	华夏银行	113,100	722,709.00	0.14
153	002558	巨人网络	24,800	683,488.00	0.13
154	002028	思源电气	3,900	674,700.00	0.13
155	603256	宏和科技	2,500	663,325.00	0.13
156	002273	水晶光电	18,600	659,928.00	0.13
157	002340	格林美	98,100	648,441.00	0.12
158	601916	浙商银行	240,300	631,989.00	0.12
159	601111	中国国航	103,800	627,990.00	0.12
160	600875	东方电气	21,700	624,309.00	0.12
161	600060	海信视像	22,200	618,714.00	0.12
162	300620	光库科技	1,600	605,120.00	0.11
163	600511	国药股份	23,200	604,128.00	0.11
164	600901	江苏金租	102,900	591,675.00	0.11
165	300666	江丰电子	1,600	589,760.00	0.11

166	000623	吉林敖东	32,300	572,679.00	0.11
167	001389	广合科技	2,400	569,400.00	0.11
168	600515	海南机场	207,800	569,372.00	0.11
169	603699	纽威股份	11,200	563,360.00	0.11
170	600312	平高电气	31,800	561,588.00	0.11
171	002648	卫星化学	23,800	559,062.00	0.11
172	601077	渝农商行	90,800	554,788.00	0.11
173	002837	英维克	6,890	548,168.40	0.10
174	603885	吉祥航空	51,900	534,051.00	0.10
175	600177	雅戈尔	70,600	531,618.00	0.10
176	002594	比亚迪	6,600	526,020.00	0.10
177	688234	天岳先进	3,000	520,530.00	0.10
178	600008	首创环保	190,400	517,888.00	0.10
179	002202	金风科技	21,400	511,460.00	0.10
180	600295	鄂尔多斯	47,400	508,128.00	0.10
181	002850	科达利	2,600	492,180.00	0.09
182	000893	亚钾国际	12,000	490,680.00	0.09
183	601668	中国建筑	112,100	486,514.00	0.09
184	600900	长江电力	17,700	468,519.00	0.09
185	000792	盐湖股份	15,500	467,945.00	0.09
186	002938	鹏鼎控股	4,400	463,672.00	0.09
187	601156	东航物流	28,700	462,644.00	0.09
188	300442	润泽科技	5,500	456,885.00	0.09
189	601138	工业富联	6,300	454,545.00	0.09
190	002532	天山铝业	42,300	453,879.00	0.09
191	000559	万向钱潮	35,100	453,843.00	0.09
192	688120	华海清科	1,400	451,052.00	0.09
193	600089	特变电工	19,900	447,750.00	0.08
194	000997	新大陆	27,300	444,990.00	0.08
195	002436	兴森科技	8,700	443,265.00	0.08
196	000895	双汇发展	19,700	441,280.00	0.08
197	603288	海天味业	13,300	441,028.00	0.08
198	601088	中国神华	11,200	437,248.00	0.08
199	002032	苏泊尔	10,900	431,640.00	0.08
200	601698	中国卫通	13,700	414,425.00	0.08
201	601939	建设银行	43,000	414,090.00	0.08
202	688099	晶晨股份	4,000	411,600.00	0.08
203	002244	滨江集团	53,000	402,800.00	0.08
204	600369	西南证券	99,700	400,794.00	0.08
205	002402	和而泰	15,400	397,782.00	0.08
206	688082	盛美上海	920	397,440.00	0.08
207	601857	中国石油	44,900	389,732.00	0.07
208	000988	华工科技	2,100	387,681.00	0.07

209	601611	中国核建	34,600	385,790.00	0.07
210	600809	山西汾酒	3,500	382,795.00	0.07
211	300115	长盈精密	13,400	374,396.00	0.07
212	600660	福耀玻璃	7,400	373,256.00	0.07
213	002465	海格通信	29,200	372,884.00	0.07
214	300757	罗博特科	600	371,400.00	0.07
215	000967	盈峰环境	35,200	370,656.00	0.07
216	601179	中国西电	24,800	370,016.00	0.07
217	002195	岩山科技	55,600	363,624.00	0.07
218	603737	三棵树	14,980	361,018.00	0.07
219	002131	利欧股份	74,900	355,775.00	0.07
220	601991	大唐发电	48,900	346,212.00	0.07
221	601399	国机重装	98,900	346,150.00	0.07
222	600711	盛屯矿业	31,200	342,264.00	0.06
223	600298	安琪酵母	9,400	340,280.00	0.06
224	603920	世运电路	7,000	336,280.00	0.06
225	600893	航发动力	8,600	329,724.00	0.06
226	603298	杭叉集团	13,800	329,268.00	0.06
227	601018	宁波港	104,500	329,175.00	0.06
228	600031	三一重工	19,000	328,320.00	0.06
229	000703	恒逸石化	24,100	327,037.00	0.06
230	600871	石化油服	159,900	324,597.00	0.06
231	601212	白银有色	63,200	321,056.00	0.06
232	600219	南山铝业	80,000	319,200.00	0.06
233	603606	东方电缆	7,600	315,476.00	0.06
234	002460	赣锋锂业	4,800	313,920.00	0.06
235	688037	芯源微	700	307,335.00	0.06
236	600566	济川药业	13,700	304,003.00	0.06
237	600989	宝丰能源	14,700	298,851.00	0.06
238	600348	华阳股份	38,600	295,290.00	0.06
239	002409	雅克科技	1,300	291,850.00	0.06
240	002044	美年健康	57,300	288,219.00	0.05
241	000060	中金岭南	37,900	286,903.00	0.05
242	000708	中信特钢	22,700	286,474.00	0.05
243	605589	圣泉集团	4,500	286,065.00	0.05
244	300567	精测电子	900	285,840.00	0.05
245	688702	盛科通信	718	280,012.82	0.05
246	002223	鱼跃医疗	10,900	279,694.00	0.05
247	601608	中信重工	56,700	270,459.00	0.05
248	000977	浪潮信息	3,700	259,000.00	0.05
249	601100	恒立液压	2,400	258,144.00	0.05
250	300677	英科医疗	6,500	254,605.00	0.05
251	300751	迈为股份	900	254,214.00	0.05

252	601689	拓普集团	4,500	253,890.00	0.05
253	688396	华润微	2,600	253,630.00	0.05
254	601988	中国银行	42,300	241,956.00	0.05
255	002027	分众传媒	49,800	241,032.00	0.05
256	301611	珂玛科技	1,300	234,091.00	0.04
257	002756	永兴材料	4,000	226,560.00	0.04
258	000729	燕京啤酒	22,100	223,873.00	0.04
259	000878	云南铜业	14,000	222,320.00	0.04
260	301377	鼎泰高科	400	220,360.00	0.04
261	601869	长飞光纤	400	218,360.00	0.04
262	603369	今世缘	9,200	218,132.00	0.04
263	600153	建发股份	27,300	216,489.00	0.04
264	002423	中粮资本	26,100	214,803.00	0.04
265	601727	上海电气	30,400	212,800.00	0.04
266	000513	丽珠集团	7,000	202,230.00	0.04
267	002126	银轮股份	4,000	199,200.00	0.04
268	600483	福能股份	19,000	193,610.00	0.04
269	601877	正泰电器	7,500	188,025.00	0.04
270	600415	小商品城	18,300	185,928.00	0.04
271	603806	福斯特	10,900	183,011.00	0.03
272	600760	中航沈飞	4,400	180,840.00	0.03
273	300316	晶盛机电	2,900	175,160.00	0.03
274	600329	达仁堂	4,700	174,934.00	0.03
275	002311	海大集团	3,900	173,979.00	0.03
276	600009	上海机场	7,300	168,630.00	0.03
277	002299	圣农发展	11,100	168,276.00	0.03
278	603766	隆鑫通用	14,000	167,020.00	0.03
279	601898	中煤能源	13,600	165,648.00	0.03
280	600233	圆通速递	10,400	163,800.00	0.03
281	600066	宇通客车	6,100	163,541.00	0.03
282	300699	光威复材	5,700	163,305.00	0.03
283	600426	华鲁恒升	6,600	157,872.00	0.03
284	002281	光迅科技	600	154,164.00	0.03
285	600115	中国东航	39,900	152,019.00	0.03
286	603225	新凤鸣	7,500	147,375.00	0.03
287	600977	中国电影	11,400	147,288.00	0.03
288	600352	浙江龙盛	12,100	146,531.00	0.03
289	000598	兴蓉环境	21,800	139,956.00	0.03
290	002601	龙佰集团	8,300	136,784.00	0.03
291	002050	三花智控	3,000	131,490.00	0.02
292	600704	物产中大	27,800	131,216.00	0.02
293	688169	石头科技	1,378	130,868.66	0.02
294	601117	中国化学	17,100	125,685.00	0.02

295	601958	金钼股份	4,200	118,062.00	0.02
296	688506	百利天恒	400	117,612.00	0.02
297	002487	大金重工	2,000	115,940.00	0.02
298	300001	特锐德	3,000	113,490.00	0.02
299	300274	阳光电源	700	111,314.00	0.02
300	600517	国网英大	23,500	109,980.00	0.02
301	603650	彤程新材	1,100	107,778.00	0.02
302	002078	太阳纸业	8,600	107,414.00	0.02
303	000938	紫光股份	3,700	106,782.00	0.02
304	600919	江苏银行	9,200	99,176.00	0.02
305	600927	永安期货	7,700	95,865.00	0.02
306	600905	三峡能源	25,700	95,347.00	0.02
307	002179	中航光电	2,000	92,400.00	0.02
308	601808	中海油服	8,500	91,885.00	0.02
309	000519	中兵红箭	4,300	90,601.00	0.02
310	603939	益丰药房	5,000	89,900.00	0.02
311	002831	裕同科技	2,383	84,739.48	0.02
312	600930	华电新能	16,200	77,274.00	0.01
313	600583	海油工程	15,200	76,456.00	0.01
314	601009	南京银行	7,700	76,153.00	0.01
315	600546	山煤国际	6,600	72,138.00	0.01
316	600737	中粮糖业	5,700	70,281.00	0.01
317	603728	鸣志电器	1,100	67,012.00	0.01
318	000683	博源化工	11,500	66,240.00	0.01
319	000629	钒钛股份	19,500	65,130.00	0.01
320	600316	洪都航空	2,300	64,262.00	0.01
321	600435	北方导航	5,700	63,840.00	0.01
322	603119	浙江荣泰	910	60,369.40	0.01
323	002683	广东宏大	2,000	58,580.00	0.01
324	688297	中无人机	1,400	58,170.00	0.01
325	600926	杭州银行	4,000	57,800.00	0.01
326	001203	大中矿业	1,900	56,905.00	0.01
327	001386	马可波罗	3,800	53,808.00	0.01
328	600038	中直股份	2,100	53,109.00	0.01
329	688295	中复神鹰	800	48,432.00	0.01
330	600967	内蒙一机	4,400	47,740.00	0.01
331	003021	兆威机电	500	43,675.00	0.01
332	600970	中材国际	6,100	43,493.00	0.01
333	601118	海南橡胶	8,700	42,804.00	0.01
334	000651	格力电器	1,000	37,500.00	0.01
335	001221	悍高集团	900	36,198.00	0.01
336	600292	电投水电	2,900	34,916.00	0.01
337	002265	建设工业	1,600	27,840.00	0.01

338	603833	欧派家居	900	27,099.00	0.01
339	601112	振石股份	325	5,716.75	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	002653	海思科	36,800	2,441,312.00	0.46
2	688525	佰维存储	4,200	2,077,866.00	0.39
3	002080	中材科技	20,400	1,836,000.00	0.35
4	02513	智谱	1,000	1,827,429.20	0.35
5	688668	鼎通科技	4,541	1,695,155.30	0.32
6	300776	帝尔激光	6,500	1,397,240.00	0.27
7	600755	厦门国贸	252,300	1,367,466.00	0.26
8	06869	长飞光纤光 缆	6,000	1,330,966.02	0.25
9	603203	快克智能	16,050	1,232,319.00	0.23
10	002156	通富微电	14,600	1,107,702.00	0.21
11	09999	网易	6,300	1,107,505.48	0.21
12	603317	天味食品	85,100	1,107,151.00	0.21
13	301217	铜冠铜箔	6,700	1,105,969.00	0.21
14	688221	前沿生物	48,600	1,088,640.00	0.21
15	601168	西部矿业	40,100	1,088,314.00	0.21
16	002192	融捷股份	12,100	1,081,740.00	0.21
17	603876	鼎胜新材	41,100	1,069,011.00	0.20
18	920045	衡东光	1,682	1,059,845.02	0.20
19	300347	泰格医药	21,300	1,022,400.00	0.19
20	603061	金海通	2,000	1,004,440.00	0.19
21	688410	山外山	66,980	961,832.80	0.18
22	002317	众生药业	38,600	948,402.00	0.18
23	000933	神火股份	41,200	873,440.00	0.17
24	002832	比音勒芬	42,200	871,008.00	0.17
25	688663	新风光	9,790	866,023.40	0.16
26	300590	移为通信	58,300	836,605.00	0.16
27	603711	香飘飘	74,100	823,251.00	0.16
28	002956	西麦食品	39,340	816,698.40	0.15
29	06082	壁仞科技	15,200	807,959.95	0.15
30	688795	摩尔线程	1,181	799,466.14	0.15
31	001316	润贝航科	24,040	792,839.20	0.15
32	300790	宇瞳光学	27,940	729,513.40	0.14
33	603013	亚普股份	45,300	715,287.00	0.14

34	603198	迎驾贡酒	24,000	710,400.00	0.13
35	300580	贝斯特	35,300	709,883.00	0.13
36	300681	英搏尔	24,700	706,914.00	0.13
37	000404	长虹华意	86,400	679,104.00	0.13
38	600185	珠免集团	144,300	649,350.00	0.12
39	301219	腾远钴业	11,830	648,284.00	0.12
40	688802	沐曦股份	832	639,716.48	0.12
41	002668	TCL 智家	55,500	614,940.00	0.12
42	688388	嘉元科技	13,460	592,240.00	0.11
43	002946	新乳业	40,300	567,424.00	0.11
44	000962	东方钽业	6,200	561,720.00	0.11
45	600872	中炬高新	31,900	553,784.00	0.11
46	000572	海马汽车	148,200	548,340.00	0.10
47	002859	洁美科技	5,000	547,550.00	0.10
48	601038	一拖股份	50,900	539,031.00	0.10
49	603083	剑桥科技	2,100	535,227.00	0.10
50	603195	公牛集团	13,522	529,386.30	0.10
51	002716	湖南白银	62,200	503,198.00	0.10
52	09699	顺丰同城	79,200	502,160.87	0.10
53	600956	新天绿能	71,500	499,785.00	0.09
54	002484	江海股份	4,700	493,500.00	0.09
55	600323	瀚蓝环境	17,200	472,312.00	0.09
56	605599	菜百股份	34,000	465,800.00	0.09
57	605111	新洁能	4,600	456,044.00	0.09
58	002228	合兴包装	152,800	449,232.00	0.09
59	001287	中电港	14,400	448,560.00	0.09
60	601208	东材科技	6,300	445,977.00	0.08
61	000603	盛达资源	19,200	443,520.00	0.08
62	600961	株冶集团	13,600	440,504.00	0.08
63	600838	上海九百	60,500	432,575.00	0.08
64	301077	星华新材	19,100	431,278.00	0.08
65	002163	海南发展	51,400	428,676.00	0.08
66	688667	菱电电控	3,200	427,680.00	0.08
67	301371	敷尔佳	16,100	418,600.00	0.08
68	688775	影石创新	2,908	403,194.20	0.08
69	300428	立中集团	22,000	399,960.00	0.08
70	300769	德方纳米	6,000	399,000.00	0.08
71	300492	华图山鼎	11,600	398,460.00	0.08
72	002557	洽洽食品	22,000	395,120.00	0.07
73	002290	禾盛新材	4,300	395,041.00	0.07
74	002255	海陆重工	39,000	382,980.00	0.07
75	002607	中公教育	209,700	377,460.00	0.07
76	000534	万泽股份	13,600	372,096.00	0.07

77	603228	景旺电子	5,100	369,291.00	0.07
78	300322	硕贝德	14,500	365,400.00	0.07
79	002895	川恒股份	12,300	359,160.00	0.07
80	002961	瑞达期货	16,500	323,070.00	0.06
81	002979	雷赛智能	5,700	317,946.00	0.06
82	605060	联德股份	5,600	317,744.00	0.06
83	600201	生物股份	27,200	316,880.00	0.06
84	603686	福龙马	23,900	308,788.00	0.06
85	000700	模塑科技	20,700	305,532.00	0.06
86	300035	中科电气	21,000	302,820.00	0.06
87	301666	大普微	645	298,847.85	0.06
88	603162	海通发展	33,152	297,373.44	0.06
89	300823	建科智能	20,300	295,974.00	0.06
90	603009	北特科技	6,100	292,617.00	0.06
91	002129	TCL 中环	23,800	286,076.00	0.05
92	600983	惠而浦	40,700	282,051.00	0.05
93	002128	电投能源	12,100	279,752.00	0.05
94	601126	四方股份	4,400	278,080.00	0.05
95	600577	精达股份	27,900	272,862.00	0.05
96	688006	杭可科技	7,446	272,151.30	0.05
97	002768	国恩股份	5,180	269,670.80	0.05
98	603025	大豪科技	19,700	268,708.00	0.05
99	002636	金安国纪	2,200	263,934.00	0.05
100	688299	长阳科技	15,763	263,399.73	0.05
101	301171	易点天下	7,700	261,492.00	0.05
102	003010	若羽臣	10,700	260,010.00	0.05
103	603207	小方制药	11,600	259,376.00	0.05
104	002533	金杯电工	24,300	259,281.00	0.05
105	688765	禾元生物	5,282	256,493.92	0.05
106	09633	农夫山泉	7,200	247,766.05	0.05
107	603929	亚翔集成	900	244,818.00	0.05
108	300640	德艺文创	43,200	243,216.00	0.05
109	688759	必贝特	7,061	216,419.65	0.04
110	00363	上海实业控股	20,000	213,315.88	0.04
111	688503	聚和材料	1,600	212,320.00	0.04
112	002222	福晶科技	2,300	212,244.00	0.04
113	001248	华润新能源	20,969	211,996.59	0.04
114	301510	固高科技	6,500	207,545.00	0.04
115	09988	阿里巴巴-W	2,500	201,612.17	0.04
116	605588	冠石科技	3,000	201,510.00	0.04
117	605077	华康股份	18,600	201,066.00	0.04
118	300782	卓胜微	1,800	197,244.00	0.04

119	300596	利安隆	3,700	194,176.00	0.04
120	603696	安记食品	16,700	192,050.00	0.04
121	000811	冰轮环境	3,300	185,526.00	0.04
122	301345	涛涛车业	800	184,800.00	0.04
123	002880	卫光生物	9,300	181,164.00	0.03
124	002782	可立克	8,400	176,820.00	0.03
125	600641	先导基电	4,400	175,384.00	0.03
126	600057	厦门象屿	31,400	170,188.00	0.03
127	688293	奥浦迈	4,048	168,761.12	0.03
128	688808	联讯仪器	105	166,354.65	0.03
129	605376	博迁新材	600	162,780.00	0.03
130	600012	皖通高速	10,200	160,752.00	0.03
131	688059	华锐精密	800	159,768.00	0.03
132	002478	常宝股份	25,300	156,354.00	0.03
133	300737	科顺股份	23,500	154,395.00	0.03
134	300154	瑞凌股份	19,400	145,888.00	0.03
135	688389	普门科技	14,592	142,855.68	0.03
136	001339	智微智能	1,300	132,964.00	0.03
137	300483	首华燃气	7,100	124,818.00	0.02
138	601061	中信金属	11,300	121,701.00	0.02
139	600206	有研新材	1,800	119,880.00	0.02
140	300041	回天新材	7,600	118,104.00	0.02
141	603811	诚意药业	15,680	117,913.60	0.02
142	688790	昂瑞微	927	117,219.15	0.02
143	603716	塞力医疗	8,200	113,980.00	0.02
144	00700	腾讯控股	300	111,990.84	0.02
145	00288	万洲国际	15,500	111,604.33	0.02
146	605116	奥锐特	5,800	109,736.00	0.02
147	600821	金开新能	16,700	104,375.00	0.02
148	002043	兔宝宝	9,400	104,152.00	0.02
149	300969	恒帅股份	1,100	103,136.00	0.02
150	603297	永新光学	700	102,865.00	0.02
151	600757	长江传媒	13,400	97,954.00	0.02
152	600869	远东股份	2,900	97,063.00	0.02
153	02331	李宁	7,500	95,887.92	0.02
154	603871	嘉友国际	8,800	89,848.00	0.02
155	300224	正海磁材	6,700	89,311.00	0.02
156	301039	中集车辆	12,300	86,715.00	0.02
157	688820	盛合晶微	612	86,591.88	0.02
158	600315	上海家化	5,100	85,782.00	0.02
159	688334	西高院	4,545	82,446.30	0.02
160	002476	新叶股份	16,800	81,648.00	0.02
161	688797	臻宝科技	168	78,736.56	0.01

162	000922	佳电股份	5,300	73,988.00	0.01
163	688818	电科蓝天	1,034	72,524.76	0.01
164	688239	航宇科技	1,200	71,796.00	0.01
165	600618	氯碱化工	7,000	70,350.00	0.01
166	301682	宏明电子	417	66,745.02	0.01
167	301035	润丰股份	1,430	66,352.00	0.01
168	001399	惠科股份	2,251	62,420.23	0.01
169	688510	航亚科技	2,600	62,088.00	0.01
170	300244	迪安诊断	3,300	61,842.00	0.01
171	603182	嘉华股份	5,400	61,560.00	0.01
172	600740	山西焦化	17,700	56,463.00	0.01
173	301061	匠心家居	1,560	54,709.20	0.01
174	01024	快手-W	1,500	54,197.52	0.01
175	688712	北芯生命	1,450	52,084.00	0.01
176	002206	海利得	9,300	48,081.00	0.01
177	300528	幸福蓝海	3,700	47,545.00	0.01
178	00460	四环医药	61,000	43,974.69	0.01
179	603199	九华旅游	1,400	43,624.00	0.01
180	600648	外高桥	5,100	40,749.00	0.01
181	601952	苏垦农发	5,400	40,446.00	0.01
182	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.01
183	688635	长进光子	128	39,448.32	0.01
184	688785	恒运昌	85	39,367.75	0.01
185	601579	会稽山	2,600	38,194.00	0.01
186	300761	立华股份	2,300	37,743.00	0.01
187	600258	首旅酒店	3,400	37,128.00	0.01
188	300791	仙乐健康	2,300	36,846.00	0.01
189	600388	龙净环保	2,500	36,375.00	0.01
190	603612	索通发展	2,000	36,260.00	0.01
191	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.01
192	300824	北鼎股份	4,800	34,464.00	0.01
193	00772	阅文集团	2,000	32,865.93	0.01
194	09992	泡泡玛特	200	26,872.94	0.01
195	02698	乐舒适	1,200	26,056.50	0.00
196	603093	南华期货	1,400	25,410.00	0.00
197	603459	红板科技	279	23,525.28	0.00
198	002518	科士达	400	21,436.00	0.00
199	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
200	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
201	002891	中宠股份	700	18,704.00	0.00
202	603707	健友股份	2,500	17,675.00	0.00
203	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
204	301687	新广益	195	15,167.10	0.00

205	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
206	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
207	001365	天海电子	441	13,807.71	0.00
208	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
209	001393	维通利	312	12,164.88	0.00
210	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
211	001237	惠康科技	181	10,631.94	0.00
212	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
213	688816	易思维	139	7,936.90	0.00
214	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
215	688781	视涯科技	144	6,855.84	0.00
216	920136	永励精密	300	5,784.00	0.00
217	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
218	603352	至信股份	111	2,832.72	0.00
219	920193	吉和昌	300	2,556.00	0.00
220	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
221	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
222	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
223	001220	世盟股份	57	1,583.46	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	300308	中际旭创	17,102,108.40	5.39
2	603986	兆易创新	12,208,007.98	3.84
3	600519	贵州茅台	12,007,226.00	3.78
4	601166	兴业银行	9,355,658.00	2.95
5	300750	宁德时代	8,887,587.00	2.80
6	603979	金诚信	7,711,901.00	2.43
7	002371	北方华创	7,657,579.00	2.41
8	002475	立讯精密	6,550,404.00	2.06
9	601899	紫金矿业	6,540,091.00	2.06
10	002463	沪电股份	6,452,039.00	2.03
11	300502	新易盛	6,347,625.00	2.00
12	002916	深南电路	5,813,378.00	1.83
13	002384	东山精密	5,433,618.62	1.71
14	601012	隆基绿能	5,304,335.84	1.67
15	300394	天孚通信	5,000,868.00	1.57
16	603259	药明康德	4,735,908.30	1.49
17	601377	兴业证券	4,709,828.00	1.48

18	000426	兴业银锡	4,655,664.00	1.47
19	002493	荣盛石化	4,480,483.00	1.41
20	000807	云铝股份	4,375,166.00	1.38

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	300502	新易盛	10,994,209.00	3.46
2	002371	北方华创	9,882,974.00	3.11
3	600016	民生银行	9,458,492.00	2.98
4	300308	中际旭创	8,568,688.00	2.70
5	601899	紫金矿业	7,905,957.00	2.49
6	601998	中信银行	6,642,713.00	2.09
7	000858	五粮液	6,526,396.66	2.06
8	300395	菲利华	5,854,234.00	1.84
9	601211	国泰海通	5,763,850.00	1.81
10	603979	金诚信	5,608,872.00	1.77
11	002475	立讯精密	5,266,416.00	1.66
12	603986	兆易创新	5,234,870.00	1.65
13	000426	兴业银锡	5,081,455.96	1.60
14	600809	山西汾酒	4,965,159.42	1.56
15	002916	深南电路	4,689,284.00	1.48
16	000807	云铝股份	4,166,357.00	1.31
17	601377	兴业证券	4,105,929.00	1.29
18	600188	兖矿能源	4,033,967.00	1.27
19	600183	生益科技	3,955,659.00	1.25
20	688615	合合信息	3,812,083.23	1.20

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	746,154,152.11
卖出股票收入（成交）总额	620,864,556.63

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）	50,001.03	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	50,001.03	0.01

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	118072	鼎通转债	300	30,000.79	0.01
2	111025	圣泉转债	130	13,000.14	0.00
3	118071	华峰转债	70	7,000.10	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

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。通过对股指期货的投资，实现管理市场风险和改善投资组合风险收益特性的目的。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金参与国债期货投资是为了有效控制债券市场的系统性风险，本基金将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，适度运用国债期货提高投资组合运作效率。在国债期货投资过程中，基金管理人通过对宏观经济和利率市场走势的分析与判断，并充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置，谨慎进行投资，以调整债券组合的久期，降低投资组合的整体风险。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本报告期内，本基金投资国债期货符合既定的投资政策和投资目的。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中，兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。立讯精密工业股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家市场监督管理总局的处罚。

本基金对上述主体所发行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。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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	4,636,992.00
2	应收清算款	-
3	应收股利	9,514.64
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,218,781.24
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,865,287.88

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
招商中证 800 指数增强 A	47,081	4,445.34	100,396,144.18	47.97%	108,894,980.46	52.03%
招商中证 800 指数增强 C	26,368	5,303.67	45,439,103.35	32.49%	94,407,976.30	67.51%
合计	73,449	4,753.48	145,835,247.53	41.77%	203,302,956.76	58.23%

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 800 指数增强 A	506,898.22	0.2422%
	招商中证 800 指数增强 C	9,274.25	0.0066%
	合计	516,172.47	0.1478%

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 800 指数增强 A	0
	招商中证 800 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 800 指数增强 A	0
	招商中证 800 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 800 指数增强 A	招商中证 800 指数增强 C
基金合同生效日(2022 年 8 月 23 日)基金份额总额	73,255,419.23	167,138,402.09
本报告期期初基金份额总额	104,987,237.83	136,901,841.20
本报告期基金总申购份额	195,078,803.76	136,692,595.23
减：本报告期基金总赎回份额	90,774,916.95	133,747,356.78
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	209,291,124.64	139,847,079.65

§ 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

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、公募基金托管业务的重大诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

报告期内，本基金托管人的基金托管业务部门无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，本基金托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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	
中航证券	3	842,132,397.15	61.70%	83,550.32	44.83%	-
方正证券	3	402,964,113.21	29.52%	79,011.09	42.40%	-
国新证券	3	119,833,587.63	8.78%	23,790.99	12.77%	-
银河证券	3	-	-	-	-	-

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 基金租用或者通过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
中航证券	114,803.98	71.24%	-	-	-	-
方正证券	46,346.00	28.76%	-	-	-	-
国新证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	招商基金管理有限公司旗下基金 2025 年第 4 季度报告提示性公告	证券时报及基金管理人网站	2026-01-21
2	招商中证 800 指数增强型证券投资基金 2025 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	2026-01-21
3	招商基金管理有限公司旗下基金 2025 年年度报告提示性公告	证券时报及基金管理人网站	2026-03-31
4	招商中证 800 指数增强型证券投资基金 2025 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	2026-03-31
5	招商基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-04-01
6	招商基金管理有限公司旗下基金 2026 年第 1 季度报告提示性公告	证券时报及基金管理人网站	2026-04-22
7	招商中证 800 指数增强型证券投资基金 2026 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	2026-04-22

8	招商基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-05-12
9	招商基金管理有限公司关于提醒投资者持续完善客户身份信息的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-05-14

§ 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 800 指数增强型证券投资基金设立的文件；
- 3、《招商中证 800 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 4、《招商中证 800 指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 5、《招商中证 800 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。

客户服务电话：400-887-9555

网址：<http://www.cmfcchina.com>

招商基金管理有限公司

2026 年 8 月 31 日