

# 招商中证 500 等权重指数增强型证券 投资基金 2024 年中期报告

2024 年 06 月 30 日

基金管理人：招商基金管理有限公司

基金托管人：中信证券股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中信证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介.....	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
§4 管理人报告.....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	13
§5 托管人报告.....	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 净资产变动表.....	16
6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告.....	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.....	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	51
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	51
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	52
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.....	52
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	52
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	52

7.12 投资组合报告附注.....	52
§8 基金份额持有人信息.....	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	54
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	54
§9 开放式基金份额变动.....	55
§10 重大事件揭示.....	55
10.1 基金份额持有人大会决议.....	55
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	55
10.4 基金投资策略的改变.....	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	56
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.....	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	56
10.8 其他重大事件.....	56
§11 备查文件目录.....	58
11.1 备查文件目录.....	58
11.2 存放地点.....	58
11.3 查阅方式.....	58

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	招商中证 500 等权重指数增强型证券投资基金	
基金简称	招商中证 500 等权重指数增强	
基金主代码	009726	
交易代码	009726	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 12 月 23 日	
基金管理人	招商基金管理有限公司	
基金托管人	中信证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	972,774,285.99 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 等权重指数增强 A	招商中证 500 等权重指数增强 C
下属分级基金的交易代码	009726	009727
报告期末下属分级基金的份额总额	543,381,261.21 份	429,393,024.78 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	<p>大类资产配置策略：本基金作为增强指数型基金，以跟踪中证 500 等权重指数为主，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。</p> <p>其他投资策略包括：（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）资产支持证券投资策略；（6）参与融资及转融通证券出借业务策略；（7）存托凭证投资策略。</p>
业绩比较基准	中证 500 等权重指数收益率*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。

### 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	中信证券股份有限公司

信息披露负责人	姓名	潘西里	杨军智
	联系电话	0755—83196666	010-60834299
	电子邮箱	cmf@cmfchina.com	yjz@citics.com
客户服务电话	400-887-9555	010-60836588	
传真	0755—83196475	010-60834004	
注册地址	深圳市福田区深南大道 7088 号	广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座	
办公地址	深圳市福田区深南大道 7088 号	北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦 5 层	
邮政编码	518040	100125	
法定代表人	王小青	张佑君	

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.cmfchina.com">http://www.cmfchina.com</a>
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	招商基金管理有限公司	深圳市福田区深南大道 7088 号

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

#### 1、招商中证 500 等权重指数增强 A

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024 年 1 月 1 日 - 2024 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	4,956,589.15
本期利润	-19,719,796.53
加权平均基金份额本期利润	-0.0369
本期加权平均净值利润率	-3.18%
本期基金份额净值增长率	-2.40%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	73,911,727.27
期末可供分配基金份额利润	0.1360
期末基金资产净值	617,292,988.48
期末基金份额净值	1.1360
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	13.60%

## 2、招商中证 500 等权重指数增强 C

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024 年 1 月 1 日 - 2024 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	4,213,045.44
本期利润	-14,496,125.12
加权平均基金份额本期利润	-0.0385
本期加权平均净值利润率	-3.39%
本期基金份额净值增长率	-2.78%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	44,935,735.42
期末可供分配基金份额利润	0.1046
期末基金资产净值	474,328,760.20
期末基金份额净值	1.1046
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	10.46%

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 等权重指数增强 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	-5.21%	0.92%	-7.54%	0.94%	2.33%	-0.02%
过去三个月	-3.04%	1.04%	-7.03%	1.08%	3.99%	-0.04%
过去六个月	-2.40%	1.54%	-9.94%	1.52%	7.54%	0.02%
过去一年	-10.45%	1.20%	-17.16%	1.20%	6.71%	0.00%
过去三年	-2.30%	1.16%	-20.83%	1.11%	18.53%	0.05%
自基金合同生效起至今	13.60%	1.12%	-15.17%	1.08%	28.77%	0.04%

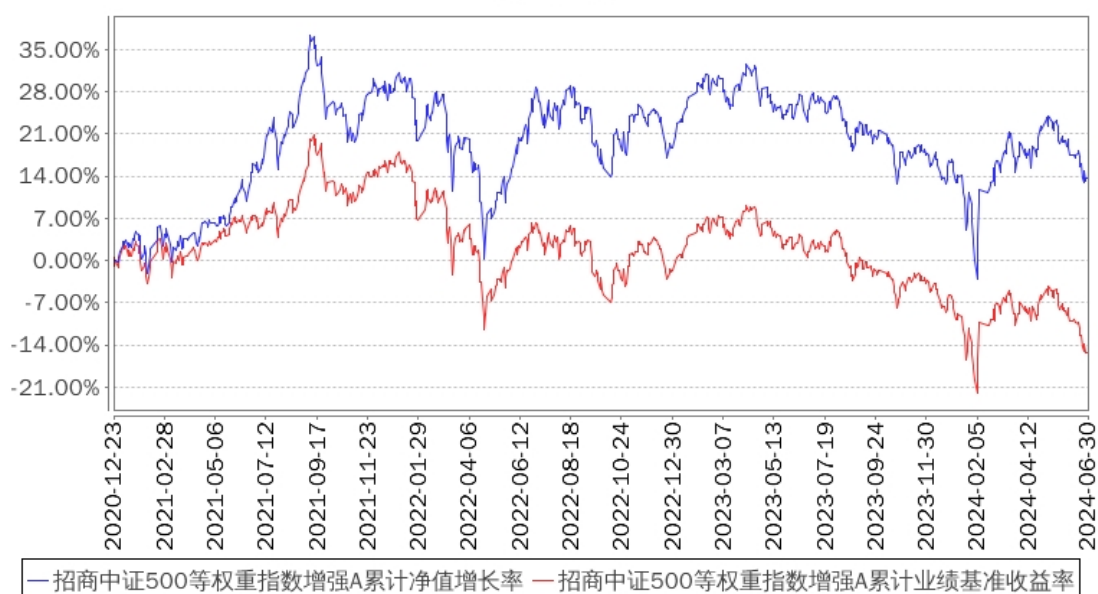
## 招商中证 500 等权重指数增强 C

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
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

		准差②	率③	率标准差 ④		
过去一个月	-5.27%	0.92%	-7.54%	0.94%	2.27%	-0.02%
过去三个月	-3.23%	1.04%	-7.03%	1.08%	3.80%	-0.04%
过去六个月	-2.78%	1.54%	-9.94%	1.52%	7.16%	0.02%
过去一年	-11.17%	1.20%	-17.16%	1.20%	5.99%	0.00%
过去三年	-4.60%	1.16%	-20.83%	1.11%	16.23%	0.05%
自基金合同 生效起至今	10.46%	1.12%	-15.17%	1.08%	25.63%	0.04%

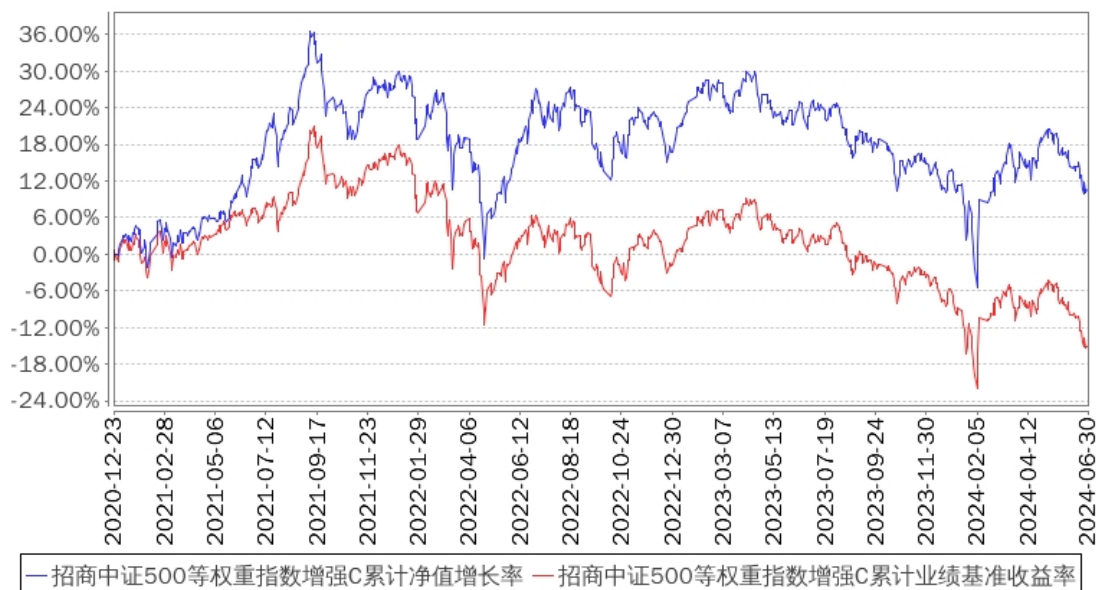
### 3.2.2 自基金合同生效/自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

招商中证500等权重指数增强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等权重指数增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



## § 4 管理人报告

## 4.1 基金管理人及基金经理情况

## 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

招商基金管理有限公司于 2002 年 12 月 27 日经中国证监会【2002】100 号文批准设立。目前，公司注册资本为人民币 13.1 亿元，招商银行股份有限公司持有公司全部股权的 55%，招商证券股份有限公司持有公司全部股权的 45%。

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

## 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王平	本基金基金经理	2020年12月23日	-	18	男，管理学硕士，FRM。2006年加入招商基金管理有限公司，曾任投资风险管理部助理数量分析师、风险管理部数量分析师、高级风控经理，主要负责公司投资风险管理、金融工程研究等工作，曾任招商深证 100 指数证券投资基金、上证消费 80 交易型开放式指数证券投资

				基金、招商上证消费 80 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、深证电子信息传媒产业(TMT)50 交易型开放式指数证券投资基金、招商深证电子信息传媒产业(TMT)50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、招商中证大宗商品股票指数证券投资基金 (LOF)、招商央视财经 50 指数证券投资基金、招商中证煤炭等权指数分级证券投资基金、招商中证银行指数分级证券投资基金、招商中证生物医药指数分级证券投资基金、招商中证白酒指数分级证券投资基金、招商稳荣定期开放灵活配置混合型证券投资基金、招商财经大数据策略股票型证券投资基金、招商盛合灵活配置混合型证券投资基金、招商中证 500 指数增强型证券投资基金、招商沪深 300 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、招商中证银行 AH 价格优选交易型开放式指数证券投资基金、招商中证银行 AH 价格优选交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，现任量化投资部总监兼招商量化精选股票型发起式证券投资基金、招商沪深 300 指数增强型证券投资基金、招商中证 1000 指数增强型证券投资基金、招商中证红利交易型开放式指数证券投资基金、招商中证 500 等权重指数增强型证券投资基金、招商中证光伏产业指数型证券投资基金、招商中证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金、招商中证 800 指数增强型证券投资基金、招商中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、招商中证 2000 指数增强型证券投资基金、招商成长量化选股股票型证券投资基金基金经理。
王岩	本基金基金经理	2021 年 9 月 16 日	-	9 男，硕士。曾任杭州师范大学国际服务工程学院讲师，2010 年 9 月加入中信期货有限公司工作，任研究部研究员；2011 年 11 月加入招商证券股份有限公司工作，任资产管理部风险管理经理；2012 年 3 月加入中信期货有限公司工作，任研究部研究员；2014 年 11 月加入招商基金管理有限公司，曾任量化投资部研究员、

				投资经理、招商沪深 300 高贝塔指数证券投资基金基金经理, 现任招商沪深 300 指数增强型证券投资基金、招商中证全指证券公司指数证券投资基金、招商沪深 300 地产等权重指数证券投资基金、招商中证 500 等权重指数增强型证券投资基金、招商创业板指数增强型证券投资基金、招商中证 800 指数增强型证券投资基金、招商中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、招商沪深 300 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、招商中证 2000 指数增强型证券投资基金、招商中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	---

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

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

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

基金管理人按照法规要求，对连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合间的同向交易的交易价差进行分析，相关投资组合经理也

对分析中发现的价格差异次数占比超过正常范围的情况进行了合理性解释。报告期内，公司旗下投资组合向交易价差分析中未发现异常情形。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，本基金各项交易均严格按照相关法律法规、基金合同的有关要求执行，公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 6 次，为旗下指数及量化组合因投资策略需要而发生反向交易。报告期内未发现有可能导致不公平交易和利益输送的重大异常交易行为。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024 上半年，中证 500 等权指数走势呈现倒 U 型形态走势，1 月份随着流动性压力显现，指数出现了快速调整，但随后指数随着流动性恢复逐步回暖，在二季度后半期小幅走弱。就宏观数据而言，上半年的整体表现呈现了前高后低的形态，一季度的经济表现整体看依然处于弱增长的阶段。虽然规上企业利润同比增速尚可，但按月观察增速在逐步放缓；GDP 增速也表现为一季度快于二季度。总体上，国内有效需求仍然不足，内生动力有待加强，工业企业效益恢复基础仍不牢固。

就上市公司的情况来看，以万得数据口径统计，截止本年度 7 月下旬，大约六成业绩预告的公司盈利增速为正，但总体盈利同比增速并不高。市场在二季度的明显调整之后，对于半年报业绩的关注度会有所增加，若上市公司公告披露后依然缺乏亮点，整体的趋势性行情可能会缺乏财务基础。

策略端方面，产品在紧跟中证 500 等权重指数的背景下选择稳健均衡的风格搭配，主要以平衡风格为主，不进行风格暴露以期对产品争取更优的超额收益。下半年投资策略会基本维持当前的逻辑，细节上会择机通过在现金流和估值水平合适的投资标的方向增加关注争取达成更优的投资目标。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金 A 类份额净值增长率为-2.40%，同期业绩基准增长率为-9.94%，C 类份额净值增长率为-2.78%，同期业绩基准增长率为-9.94%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

回顾 2024 年上半年，公用事业与银行板块表现较强，一定程度上和红利风格的市场偏好有所重叠，也反映了市场对于风险厌恶程度的加深。具体风格上，大盘和价值风格从性价比和防御属性角度成为了市场上半年资金的关注方向，该趋势可能依然会在下半年有所表现。中证 500 等权重指数的成分股在风格属性上相对接近中大盘均衡，弹性大于沪深 300 等大盘指数，但价值成色相对要低。

当前货币政策的边际变化较为友好，依然呈现良性温和的状态，考虑到近期二十届三中全会的闭幕，市场对下半年政策的再发力及政府债务规模的扩张可能会有所期待，但反映在权益市场价格上还需要具体观察其表现。

展望下半年，权益市场当前的估值水平很低，但是经济增速的压力与全球贸易格局的变化以及美国政经环境的影响可能会令市场观察估值的角度更呈现多元化，也意味着强趋势的一致预期较难形成。强确定性及财报数据可以验证业绩的行业及个股可能会继续为市场所关注。待半年报披露完全后，ROE 稳定且现金流向好的行业及个股也可能具有超额收益的基础。主题投资若没有财报得以验证继续趋势走强的概率在下降。较为拥挤的红利风格也可能在下半年有所反复。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金的估值业务严格按照相关的法律法规、基金合同以及《招商基金管理有限公司基金估值委员会管理办法》进行。基金核算部负责日常的基金资产的估值业务，执行基金估值政策。另外，公司设立由投资和研究部门、风险管理部、基金核算部、法律合规部负责人和基金经理代表组成的估值委员会。公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历。公司估值委员会主要负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，定期评价现有估值政策和程序的适用性及对估值程序执行情况进行监督。

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

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

#### 4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中信证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在对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，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、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的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

### 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

本报告期，由基金管理人编制并经托管人复核审查的有关本基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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 等权重指数增强型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	58,310,657.01	53,692,515.50
结算备付金		959,175.58	653,451.32
存出保证金		944,179.20	326,208.00
交易性金融资产	6.4.7.2	1,025,729,757.04	994,466,328.50
其中：股票投资		1,025,307,942.60	994,045,338.19
基金投资		-	-
债券投资		421,814.44	420,990.31
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		8,140,867.69	10,452,837.92
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		1,094,084,636.52	1,059,591,341.24
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		702,226.08	1,821,053.54
应付管理人报酬		1,079,661.54	1,052,650.29
应付托管费		179,943.56	175,441.69
应付销售服务费		315,194.65	261,770.45

应付投资顾问费		-	-
应交税费		2.35	2.09
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	185,859.66	216,190.55
负债合计		2,462,887.84	3,527,108.61
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	972,774,285.99	915,544,158.46
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	118,847,462.69	140,520,074.17
净资产合计		1,091,621,748.68	1,056,064,232.63
负债和净资产总计		1,094,084,636.52	1,059,591,341.24

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，招商中证 500 等权重指数增强 A 份额净值 1.1360 元，基金份额总额 543,381,261.21 份；招商中证 500 等权重指数增强 C 份额净值 1.1046 元，基金份额总额 429,393,024.78 份；总份额合计 972,774,285.99 份。

## 6.2 利润表

会计主体：招商中证 500 等权重指数增强型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-25,047,081.18	33,675,306.16
1.利息收入		193,766.06	217,652.12
其中：存款利息收入	6.4.7.9	193,766.06	217,652.12
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）		17,236,503.38	20,468,753.44
其中：股票投资收益	6.4.7.10	5,427,561.30	12,483,443.55
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	10,274.53	85,557.38
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	-386,202.50	-13,133.24



股利收益	6.4.7.15	12,184,870.05	7,912,885.75
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	-43,385,556.24	10,609,501.25
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	908,205.62	2,379,399.35
减：二、营业总支出		9,168,840.47	6,179,954.81
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	6,245,306.41	4,134,497.31
其中：暂估管理人报酬		-	-
2.托管费	6.4.10.2.2	1,040,884.44	861,353.59
3.销售服务费	6.4.10.2.3	1,696,553.58	1,007,076.00
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		1.53	293.46
8.其他费用	6.4.7.19	186,094.51	176,734.45
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-34,215,921.65	27,495,351.35
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-34,215,921.65	27,495,351.35
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-34,215,921.65	27,495,351.35

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

### 6.3 净资产变动表

会计主体：招商中证 500 等权重指数增强型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综	未分配利润	净资产合计

		合收益		
一、上期期末净资产	915,544,158.46	-	140,520,074.17	1,056,064,232.63
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	915,544,158.46	-	140,520,074.17	1,056,064,232.63
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	57,230,127.53	-	-21,672,611.48	35,557,516.05
（一）、综合收益总额	-	-	-34,215,921.65	-34,215,921.65
（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）	57,230,127.53	-	12,543,310.17	69,773,437.70
其中：1.基金申购款	435,199,811.27	-	65,052,865.18	500,252,676.45
2.基金赎回款	-377,969,683.74	-	-52,509,555.01	-430,479,238.75
（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	972,774,285.99	-	118,847,462.69	1,091,621,748.68
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	425,908,632.39	-	76,573,566.51	502,482,198.90
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	425,908,632.39	-	76,573,566.51	502,482,198.90
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	232,603,573.55	-	95,237,819.08	327,841,392.63
（一）、综合收益总	-	-	27,495,351.35	27,495,351.35

额				
(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)	232,603,573.55	-	67,742,467.73	300,346,041.28
其中: 1.基金申购款	774,738,163.06	-	206,657,563.54	981,395,726.60
2.基金赎回款	-542,134,589.51	-	-138,915,095.81	-681,049,685.32
(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	658,512,205.94	-	171,811,385.59	830,323,591.53

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

\_\_\_\_\_ 徐勇 \_\_\_\_\_ 欧志明 \_\_\_\_\_ 何剑萍 \_\_\_\_\_  
 基金管理人负责人      主管会计工作负责人      会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

招商中证 500 等权重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 等权重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[2020]1060 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 252,827,541.95 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(20)第 00722 号验资报告。

《招商中证 500 等权重指数增强型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)于 2020 年 12 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,基金托管人为中信证券股份有限公司(以下简称“中信证券”)。

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、创业板及其他中国证监会允许投资的股票和存托凭证)、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、可交换债券及其他经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、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、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的相关规定。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的其他品种,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。股指期货、国债期货的投资比例遵循国家相关法律法规。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。

本基金的业绩比较基准为:中证 500 等权重指数收益率 $\times$ 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 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策,会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间未发生重大会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期间未发生重大会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

### 6.4.6 税项

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

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

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

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

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

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

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	7,089,541.20
等于：本金	7,087,030.35
加：应计利息	2,510.85
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	51,221,115.81
等于：本金	51,216,422.00
加：应计利息	4,693.81
减：坏账准备	-
合计	58,310,657.01

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	1,091,484,610.35	-	1,025,307,942.60	-66,176,667.75	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	340,997.76	721.14	421,814.44	80,095.54
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	340,997.76	721.14	421,814.44	80,095.54
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	1,091,825,608.11	721.14	1,025,729,757.04	-66,096,572.21	

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
----	---------------------

	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	8,257,074.29	-	-	-
其中：股指期货投资	8,257,074.29	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	8,257,074.29	-	-	-

#### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2407	IC2407	8.00	7,868,160.00	-388,914.29
合计				-388,914.29
减：可抵销期货暂收款				-388,914.29
净额				-

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	109.65
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	85,694.51
应付指数使用费	100,000.00
其他	55.50
合计	185,859.66

## 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

招商中证 500 等权重指数增强 A		
项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	571,300,011.99	571,300,011.99
本期申购	176,988,384.09	176,988,384.09
本期赎回（以“-”号填列）	-204,907,134.87	-204,907,134.87
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期末	543,381,261.21	543,381,261.21

招商中证 500 等权重指数增强 C		
项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	344,244,146.47	344,244,146.47
本期申购	258,211,427.18	258,211,427.18
本期赎回（以“-”号填列）	-173,062,548.87	-173,062,548.87
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期末	429,393,024.78	429,393,024.78

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 等权重指数增强 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	156,816,398.11	-63,190,179.48	93,626,218.63
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	156,816,398.11	-63,190,179.48	93,626,218.63
本期利润	4,956,589.15	-24,676,385.68	-19,719,796.53
本期基金份额交易产生的变动数	-6,013,092.02	6,018,397.19	5,305.17
其中：基金申购款	47,166,554.96	-18,036,022.61	29,130,532.35
基金赎回款	-53,179,646.98	24,054,419.80	-29,125,227.18
本期已分配利润	-	-	-
本期末	155,759,895.24	-81,848,167.97	73,911,727.27

招商中证 500 等权重指数增强 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	84,482,135.32	-37,588,279.78	46,893,855.54
加：会计政策变更	-	-	-



前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	84,482,135.32	-37,588,279.78	46,893,855.54
本期利润	4,213,045.44	-18,709,170.56	-14,496,125.12
本期基金份额交易产生的变动数	19,825,130.90	-7,287,125.90	12,538,005.00
其中：基金申购款	60,916,193.85	-24,993,861.02	35,922,332.83
基金赎回款	-41,091,062.95	17,706,735.12	-23,384,327.83
本期已分配利润	-	-	-
本期末	108,520,311.66	-63,584,576.24	44,935,735.42

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	101,379.20
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	9,721.50
其他	82,665.36
合计	193,766.06

#### 6.4.7.10 股票投资收益

##### 6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	5,427,561.30
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	5,427,561.30

##### 6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	2,565,918,737.18
减：卖出股票成本总额	2,556,602,142.97
减：交易费用	3,889,032.91
买卖股票差价收入	5,427,561.30

##### 6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无股票赎回差价收入。

##### 6.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无股票申购差价收入。

#### 6.4.7.10.5 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内无证券出借差价收入。

#### 6.4.7.11 债券投资收益

##### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	450.04
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	9,824.49
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	10,274.53

##### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	21,829.22
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	11,999.95
减：应计利息总额	1.78
减：交易费用	3.00
买卖债券差价收入	9,824.49

##### 6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

##### 6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券申购差价收入。

#### 6.4.7.12 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

##### 6.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内无买卖资产支持证券差价收入。

##### 6.4.7.12.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券赎回差价收入。

#### 6.4.7.12.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券申购差价收入。

#### 6.4.7.13 贵金属投资收益

##### 6.4.7.13.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

##### 6.4.7.13.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

##### 6.4.7.13.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无贵金属赎回差价收入。

##### 6.4.7.13.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无贵金属申购差价收入。

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

##### 6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具买卖权证差价收入。

##### 6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	-386,202.50

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	12,184,870.05
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	12,184,870.05

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-43,007,461.95
——股票投资	-43,007,993.05
——债券投资	531.10

——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-378,094.29
——权证投资	-
——期货投资	-378,094.29
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	-43,385,556.24

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	908,205.62
合计	908,205.62

#### 6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	26,022.17
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
其他	100,400.00
合计	186,094.51

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

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

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

###### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	6,245,306.41	4,134,497.31
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,207,612.96	1,367,756.96
应支付基金管理人的净管理费	4,037,693.45	2,766,740.35
应支付投资顾问的投资顾问费	-	-

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

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

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,040,884.44	861,353.59

注：支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值×0.20%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：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

**6.4.10.2.3 销售服务费**

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	招商中证 500 等权重指数增强 A	招商中证 500 等权重指数增强 C	合计
招商基金管理有限公司	-	182,274.91	182,274.91
招商银行	-	78,483.00	78,483.00
招商证券	-	280.41	280.41
中信证券	-	72,329.22	72,329.22
合计	-	333,367.54	333,367.54
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	招商中证 500 等权重指数增强 A	招商中证 500 等权重指数增强 C	合计
招商基金管理有限公司	-	406,312.07	406,312.07
招商银行	-	103,211.17	103,211.17
招商证券	-	-	-
中信证券	-	40,161.60	40,161.60
合计	-	549,684.84	549,684.84

注：本基金的 C 类基金份额的年销售服务费率为 0.80%，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{C 类份额日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金资产净值} \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

**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自有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间基金管理人无运用自有资金投资本基金的情况。

##### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信证券-活期	7,089,541.20	101,379.20	35,393,148.34	159,555.88

注：本基金的托管人为中信证券股份有限公司，银行存款存放在具有基金托管资格的银行，按银行约定利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

单位：人民币元

本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
招商证券	688692	达梦数据	新股获配	1,745	151,745.20
中信建投证券	301580	爱迪特	新股获配	2,018	90,709.10
中信证券	001387	雪祺电气	新股获配	1,330	20,455.40
中信证券	688584	上海合晶	新股获配	8,659	196,212.94
中信证券	001359	平安电工	新股获配	1,833	31,875.87

上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
招商证券	301305	朗坤环境	新股获配	7,523	189,955.75
招商证券	301428	世纪恒通	新股获配	2,289	60,315.15
中信证券	301261	恒工精密	新股获配	1,973	72,803.70
中信证券	688631	莱斯信息	新股获配	3,357	84,864.96
中信证券	301170	锡南科技	新股获配	2,496	84,864.00
中信证券	301323	新莱福	新股获配	2,277	88,939.62
中信证券	688523	航天环宇	新股获配	4,717	103,113.62
中信证券	001324	长青科技	新股获配	1,131	21,353.28
中信证券	688581	安杰思	新股获配	1,629	204,928.20
中信证券	301293	三博脑科	新股获配	3,324	98,390.40
中信证券	688146	中船特气	新股获配	5,209	188,305.35
中信证券	001286	陕西能源	新股获配	37,667	361,603.20
中信证券	601133	柏诚股份	新股获配	5,940	69,260.40
中信证券	001367	海森药业	新股获配	549	24,419.52
中信证券	601061	中信金属	新股获配	17,254	113,531.32
中信证券	603162	海通发展	新股获配	523	19,481.75
中信证券	301439	泓淋电力	新股获配	7,905	158,020.95
中信证券	301157	华塑科技	新股获配	1,498	84,637.00

注：本表已包含托管人的关联方承销期内承销的证券。

## 6.4.11 利润分配情况

### 6.4.11.1 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

## 6.4.12 期末（2024 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001359	平安电工	2024年3月19日	6个月	新股流通受限	17.39	20.60	184	3,199.76	3,790.40	-
001379	腾达科技	2024年1月11日	6个月	新股流通受限	16.98	13.48	213	3,616.74	2,871.24	-
001387	雪祺电气	2024年1月4日	6个月	新股流通受限	15.38	15.25	173	2,045.54	2,638.25	-



001389	广合科技	2024年3月26日	6个月	新股流通受限	17.43	34.56	222	3,869.46	7,672.32	-
301392	汇成真空	2024年5月28日	6个月	新股流通受限	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-
301502	华阳智能	2024年1月26日	6个月	新股流通受限	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-
301536	星辰科技	2024年3月20日	6个月	新股流通受限	16.16	32.27	481	7,772.96	15,521.87	-
301538	骏鼎达	2024年3月13日	6个月	新股流通受限	55.82	91.24	150	5,972.74	13,686.00	-
301539	宏鑫科技	2024年4月3日	6个月	新股流通受限	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-
301565	中仑新材	2024年6月13日	6个月	新股流通受限	11.88	18.98	711	8,446.68	13,494.78	-
301566	达利凯普	2023年12月22日	6个月	新股流通受限	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	-
301580	爱迪特	2024年6月19日	6个月	新股流通受限	44.95	65.93	202	9,079.90	13,317.86	-
301587	中瑞股份	2024年3月27日	6个月	新股流通受限	21.73	25.26	306	6,649.38	7,729.56	-
301588	美新科技	2024年3月6日	6个月	新股流通受限	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-
301589	诺瓦星云	2024年2月1日	6个月	新股流通受限	126.89	188.01	1,244	87,680.99	233,884.44	-
301591	肯特股份	2024年2月20日	6个月	新股流通受限	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	-
603082	北自科技	2024年1月23日	6个月	新股流通受限	21.28	29.49	107	2,276.96	3,155.43	-
603285	键邦股份	2024年6月	1个月内(含)	新股流通受限	18.65	18.65	1,158	21,596.70	21,596.70	-

		28 日								
603285	键邦股份	2024 年 6 月 28 日	6 个月	新股流通受限	18.65	18.65	129	2,405.85	2,405.85	-
603312	西典新能	2024 年 1 月 4 日	6 个月	新股流通受限	29.02	25.36	130	3,772.60	3,296.80	-
603325	博隆技术	2024 年 1 月 3 日	6 个月	新股流通受限	72.46	68.06	66	4,782.36	4,491.96	-
603341	龙旗科技	2024 年 2 月 23 日	6 个月	新股流通受限	26.00	37.49	298	7,748.00	11,172.02	-
603344	星德胜	2024 年 3 月 13 日	6 个月	新股流通受限	19.18	22.66	182	3,490.76	4,124.12	-
603350	安乃达	2024 年 6 月 26 日	1 个月内(含)	新股流通受限	20.56	20.56	945	19,429.20	19,429.20	-
603350	安乃达	2024 年 6 月 26 日	6 个月	新股流通受限	20.56	20.56	106	2,179.36	2,179.36	-
603375	盛景微	2024 年 1 月 17 日	6 个月	新股流通受限	38.18	38.90	72	2,748.96	2,800.80	-
603381	永臻股份	2024 年 6 月 19 日	6 个月	新股流通受限	23.35	25.13	178	4,156.30	4,473.14	-
688530	欧莱新材	2024 年 4 月 29 日	6 个月	新股流通受限	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-
688584	上海合晶	2024 年 2 月 1 日	6 个月	新股流通受限	22.66	15.89	866	19,623.56	13,760.74	-
688691	灿芯股份	2024 年 4 月 2 日	6 个月	新股流通受限	19.86	42.51	247	4,905.42	10,499.97	-
688692	达梦数据	2024 年 6 月 4 日	6 个月	新股流通受限	86.96	174.93	175	15,218.00	30,612.75	-
688695	中创股份	2024 年 3 月 6 日	6 个月	新股流通受限	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-
688709	成都华微	2024	6 个月	新股流通	15.69	18.79	1,045	16,396.05	19,635.55	-

		年 1 月 31 日		受限						
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代 码	证券名称	成功认 购日	受限期	流通受限 类型	认购价 格	期末估 值单价	数量（单 位：张）	期末成本总 额	期末估值总 额	备 注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

本基金为股票型基金，本基金的运作涉及的金融工具主要包括股票投资、债券投资等。与这些金融工具有关的风险，以及本基金的基金管理人管理这些风险所采取的风险管理政策如下所述。

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人从事风险管理的目标是提升本基金风险调整后收益水平，保证本基金的基金资产安全，维护基金份额持有人利益。基于该风险管理目标，本基金的基金管理人风险管理的基本策略是识别和分析本基金运作时本基金面临各种类型的风险，确定适当的风险容忍度，并及时可靠地对各种风险进行监督，将风险控制在限定的范围之内。本基金目前面临的主要风险包括：市场风险、信用风险和流动性风险。

本基金的基金管理人建立了以全面、独立、互相制约以及定性和定量相结合为原则的，监事会、董事会及下设风险控制委员会、督察长、风险管理委员会、法律合规部和风险管理部等多层次的风险管理组织架构体系。

##### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指金融工具的一方到期无法履行约定义务致使本基金遭受损失的风险。本基金的信用风险主要存在于银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资、资产支持证券投资及其他。

本基金的银行存款存放于本基金的基金托管人，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在证券交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并采用券款对付交割方式，以控制相应的信用风险。

对于与债券投资、资产支持证券投资等投资品种相关的信用风险，本基金的基金管理人通过对投资品种的信用等级评估来选择适当的投资对象，并限制单个投资品种的持有比例来管理信用风险。附注 6.4.13.2.1 至 6.4.13.2.6 列示了本基金所持有的债券投资及资产支持证券投资的信用评级，该信用评级不包括本基金所持有的国债、央行票据、政策性金融债。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	421,814.44	420,990.31
未评级	-	-
合计	421,814.44	420,990.31

注：上述评级均由经中国证监会核准从事证券市场资信评级业务的评级机构做出。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

### 6.4.13.3 流动性风险

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金流动性风险来源于基金约定开放日兑付赎回资金的流动性风险，以及因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险以及因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。本基金所持有的金融资产主要在证券交易所和银行间同业市场交易。除附注 6.4.12 所披露的流通受限不能自由转让的基金资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。除卖出回购金融资产外，本基金所持有的金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人在基金合同约定巨额赎回条款，设计了非常情况下赎回资金的处理模式，控制因开放模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

日常流动性风险管理中，本基金的基金管理人每日监控和预测本基金的流动性指标，通过对投资品种的流动性指标来持续地评估、选择、跟踪和控制基金投资的流动性风险。同时，本基金通过预留一定的现金头寸，并且在需要时可通过卖出回购金融资产方式融入短期资金，以缓解流动性风险。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的基金管理人日常通过对利率水平的预测、分析收益率曲线及优化利率重新定价日组合等方法对上述利率风险进行管理。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	58,310,657.01	-	-	-	58,310,657.01
结算备付金	959,175.58	-	-	-	959,175.58
存出保证金	-	-	-	944,179.20	944,179.20
交易性金融资产	-	74,102.81	347,711.63	1,025,307,942.60	1,025,729,757.04
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	-	-	-	8,140,867.69	8,140,867.69
应收清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	59,269,832.59	74,102.81	347,711.63	1,034,392,989.49	1,094,084,636.52
负债					
应付赎回款	-	-	-	702,226.08	702,226.08
应付管理人报酬	-	-	-	1,079,661.54	1,079,661.54
应付托管费	-	-	-	179,943.56	179,943.56
应付清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	315,194.65	315,194.65
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	2.35	2.35
其他负债	-	-	-	185,859.66	185,859.66
负债总计	-	-	-	2,462,887.84	2,462,887.84
利率敏感度缺口	59,269,832.59	74,102.81	347,711.63	1,031,930,101.65	1,091,621,748.68
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	53,692,515.50	-	-	-	53,692,515.50
结算备付金	653,451.32	-	-	-	653,451.32
存出保证金	-	-	-	326,208.00	326,208.00
交易性金融资产	-	-	420,990.31	994,045,338.19	994,466,328.50
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	-	-	-	10,452,837.92	10,452,837.92
应收清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	54,345,966.82	-	420,990.31	1,004,824,384.11	1,059,591,341.24
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,821,053.54	1,821,053.54
应付管理人报酬	-	-	-	1,052,650.29	1,052,650.29
应付托管费	-	-	-	175,441.69	175,441.69
应付清算款	-	-	-	-	-

卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	261,770.45	261,770.45
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	2.09	2.09
其他负债	-	-	-	216,190.55	216,190.55
负债总计	-	-	-	3,527,108.61	3,527,108.61
利率敏感度缺口	54,345,966.82	-	420,990.31	1,001,297,275.50	1,056,064,232.63

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1.若市场利率平行上升或下降 50 个基点		
	2.其他市场变量保持不变		
	3.仅存在公允价值变动对基金资产净值的影响		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	1. 市场利率平行上升 50 个基点	-10,330.68	-11,327.37
2. 市场利率平行下降 50 个基点	10,647.54	11,703.67	

#### 6.4.13.4.2 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险，该风险可能与特定投资品种相关，也有可能与整体投资品种相关。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的债券和股票，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金在构建资产配置和基金资产投资组合的基础上，通过建立事前和事后跟踪误差的方式，对基金资产的市场价格风险进行管理。

##### 6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产-股票投资	1,025,307,942.60	93.93	994,045,338.19	94.13
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	1,025,307,942.60	93.93	994,045,338.19	94.13

#### 6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1.若对市场价格敏感的权益性投资的市场价格上升或下降 5%		
	2.其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	1. 权益性投资的市场价格上升 5%	51,265,397.13	49,702,266.91
	2. 权益性投资的市场价格下降 5%	-51,265,397.13	-49,702,266.91

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	1,025,205,275.54	993,378,627.04
第二层次	45,611.11	-
第三层次	478,870.39	1,087,701.46
合计	1,025,729,757.04	994,466,328.50

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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



### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无需要说明有助于理解和分析会计报表的其他事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,025,307,942.60	93.71
	其中：股票	1,025,307,942.60	93.71
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	421,814.44	0.04
	其中：债券	421,814.44	0.04
	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	59,269,832.59	5.42
8	其他各项资产	9,085,046.89	0.83
9	合计	1,094,084,636.52	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	-	-
B	采矿业	28,875,353.60	2.65
C	制造业	560,254,761.64	51.32
D	电力、热力、燃气及水生产和	32,076,536.51	2.94

	供应业		
E	建筑业	38,617,260.00	3.54
F	批发和零售业	14,669,853.00	1.34
G	交通运输、仓储和邮政业	12,087,946.48	1.11
H	住宿和餐饮业	7,365,540.00	0.67
I	信息传输、软件和信息技术服务业	48,917,369.32	4.48
J	金融业	32,923,016.30	3.02
K	房地产业	12,569,644.00	1.15
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	11,915,843.00	1.09
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	58,905.00	0.01
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	25,398,549.00	2.33
S	综合	4,830,848.00	0.44
	合计	830,561,425.85	76.09

### 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	5,290,350.00	0.48
C	制造业	135,793,698.45	12.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	696,780.00	0.06
E	建筑业	8,338.86	0.00
F	批发和零售业	7,994,599.36	0.73
G	交通运输、仓储和邮政业	2,646,099.00	0.24
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,338,626.29	1.41
J	金融业	9,209,650.00	0.84
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,787,204.00	0.16
M	科学研究和技术服务业	6,447,077.45	0.59
N	水利、环境和公共设施管理业	4,950,500.88	0.45
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	2,196,588.00	0.20
Q	卫生和社会工作	2,387,004.46	0.22
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-

合计	194,746,516.75	17.84
----	----------------	-------

### 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	600299	安迪苏	1,483,850	14,393,345.00	1.32
2	600582	天地科技	2,086,173	14,373,731.97	1.32
3	600282	南钢股份	2,880,400	14,344,392.00	1.31
4	601991	大唐发电	4,727,500	14,229,775.00	1.30
5	002340	格林美	2,217,500	14,125,475.00	1.29
6	300207	欣旺达	925,600	14,041,352.00	1.29
7	600521	华海药业	820,700	13,992,935.00	1.28
8	600339	中油工程	4,481,400	13,981,968.00	1.28
9	002128	电投能源	658,666	13,897,852.60	1.27
10	002028	思源电气	205,600	13,754,640.00	1.26
11	600820	隧道股份	2,076,300	13,558,239.00	1.24
12	000887	中鼎股份	1,082,900	13,254,696.00	1.21
13	600315	上海家化	732,400	13,022,072.00	1.19
14	002432	九安医疗	320,800	13,005,232.00	1.19
15	002065	东华软件	2,877,100	13,004,492.00	1.19
16	600528	中铁工业	1,763,800	12,911,016.00	1.18
17	002557	洽洽食品	456,500	12,868,735.00	1.18
18	601717	郑煤机	867,139	12,833,657.20	1.18
19	600380	健康元	1,145,159	12,791,426.03	1.17
20	603658	安图生物	272,515	12,554,766.05	1.15
21	300677	英科医疗	465,280	12,474,156.80	1.14
22	001203	大中矿业	1,278,100	12,282,541.00	1.13
23	601636	旗滨集团	1,903,200	12,275,640.00	1.12
24	300724	捷佳伟创	225,110	12,158,191.10	1.11
25	300144	宋城演艺	1,512,600	12,146,178.00	1.11
26	600699	均胜电子	819,500	12,144,990.00	1.11
27	600535	天士力	951,040	11,964,083.20	1.10
28	300070	碧水源	2,824,300	11,833,817.00	1.08
29	000513	丽珠集团	296,300	11,025,323.00	1.01
30	600170	上海建工	5,113,100	10,993,165.00	1.01

31	603228	景旺电子	332,700	10,579,860.00	0.97
32	600143	金发科技	1,569,500	10,374,395.00	0.95
33	600066	宇通客车	378,700	9,770,460.00	0.90
34	002138	顺络电子	334,900	9,196,354.00	0.84
35	002563	森马服饰	1,545,100	8,977,031.00	0.82
36	300136	信维通信	456,600	8,940,228.00	0.82
37	603160	汇顶科技	129,400	8,896,250.00	0.81
38	000703	恒逸石化	1,232,400	8,737,716.00	0.80
39	300394	天孚通信	98,560	8,714,675.20	0.80
40	601058	赛轮轮胎	620,900	8,692,600.00	0.80
41	002831	裕同科技	337,200	8,628,948.00	0.79
42	601567	三星医疗	243,900	8,536,500.00	0.78
43	600707	彩虹股份	1,252,800	8,531,568.00	0.78
44	000830	鲁西化工	736,100	8,531,399.00	0.78
45	002444	巨星科技	343,700	8,489,390.00	0.78
46	000039	中集集团	903,700	8,368,262.00	0.77
47	601990	南京证券	1,076,900	8,270,592.00	0.76
48	600885	宏发股份	298,500	8,262,480.00	0.76
49	002152	广电运通	787,800	8,240,388.00	0.75
50	300383	光环新网	974,200	8,231,990.00	0.75
51	300251	光线传媒	967,500	8,136,675.00	0.75
52	601198	东兴证券	1,020,200	8,120,792.00	0.74
53	600004	白云机场	856,251	8,117,259.48	0.74
54	601966	玲珑轮胎	431,300	7,922,981.00	0.73
55	002056	横店东磁	632,800	7,891,016.00	0.72
56	603345	安井食品	104,300	7,750,533.00	0.71
57	002517	恺英网络	805,900	7,696,345.00	0.71
58	600848	上海临港	831,200	7,572,232.00	0.69
59	600258	首旅酒店	596,400	7,365,540.00	0.67
60	300253	卫宁健康	1,212,800	7,155,520.00	0.66
61	002384	东山精密	344,200	7,124,940.00	0.65
62	002273	水晶光电	408,600	6,938,028.00	0.64
63	688772	珠海冠宇	416,364	6,203,823.60	0.57
64	000563	陕国投 A	2,195,500	6,037,625.00	0.55
65	601128	常熟银行	796,590	6,030,186.30	0.55
66	000598	兴蓉环境	760,700	5,720,464.00	0.52
67	603379	三美股份	142,400	5,573,536.00	0.51
68	000401	冀东水泥	1,333,100	5,412,386.00	0.50
69	000050	深天马 A	726,700	5,290,376.00	0.48
70	002595	豪迈科技	134,900	5,149,133.00	0.47
71	601019	山东出版	432,800	5,115,696.00	0.47
72	688153	唯捷创芯	137,762	5,097,194.00	0.47
73	688561	奇安信	213,926	5,052,932.12	0.46

74	600827	百联股份	678,100	5,004,378.00	0.46
75	600663	陆家嘴	566,600	4,997,412.00	0.46
76	600673	东阳光	686,200	4,830,848.00	0.44
77	600177	雅戈尔	657,600	4,682,112.00	0.43
78	688516	奥特维	110,290	4,611,224.90	0.42
79	601139	深圳燃气	682,200	4,557,096.00	0.42
80	600157	永泰能源	3,827,100	4,515,978.00	0.41
81	000709	河钢股份	2,320,700	4,502,158.00	0.41
82	002078	太阳纸业	319,523	4,457,345.85	0.41
83	600499	科达制造	493,400	4,159,362.00	0.38
84	600038	中直股份	100,900	4,147,999.00	0.38
85	601108	财通证券	613,100	4,052,591.00	0.37
86	300474	景嘉微	63,500	4,015,105.00	0.37
87	603885	吉祥航空	361,300	3,970,687.00	0.36
88	600739	辽宁成大	466,100	3,901,257.00	0.36
89	688220	翱捷科技	93,797	3,513,635.62	0.32
90	603883	老百姓	168,350	3,090,906.00	0.28
91	000027	深圳能源	412,300	3,009,790.00	0.28
92	000636	风华高科	226,900	2,963,314.00	0.27
93	600583	海油工程	456,000	2,694,960.00	0.25
94	000967	盈峰环境	630,400	2,666,592.00	0.24
95	600166	福田汽车	1,172,900	2,639,025.00	0.24
96	300002	神州泰岳	324,000	2,630,880.00	0.24
97	300001	特锐德	130,300	2,621,636.00	0.24
98	600998	九州通	531,400	2,593,232.00	0.24
99	002153	石基信息	443,000	2,538,390.00	0.23
100	002409	雅克科技	39,900	2,510,109.00	0.23
101	603317	天味食品	218,700	2,495,367.00	0.23
102	002373	千方科技	227,900	2,067,053.00	0.19
103	600872	中炬高新	87,500	1,985,375.00	0.18
104	002203	海亮股份	122,700	979,146.00	0.09
105	688475	萤石网络	15,900	542,349.00	0.05
106	603444	吉比特	2,800	498,428.00	0.05
107	601555	东吴证券	69,700	411,230.00	0.04
108	601615	明阳智能	42,000	396,480.00	0.04
109	688120	华海清科	1,546	293,090.68	0.03
110	000032	深桑达 A	5,600	83,888.00	0.01
111	600765	中航重机	4,100	83,640.00	0.01
112	002429	兆驰股份	17,300	83,213.00	0.01
113	300776	帝尔激光	1,800	82,728.00	0.01
114	600566	济川药业	2,600	82,446.00	0.01
115	600079	人福医药	4,800	82,416.00	0.01
116	603218	日月股份	8,000	82,160.00	0.01

117	002266	浙富控股	29,400	82,026.00	0.01
118	300558	贝达药业	2,500	81,375.00	0.01
119	300861	美畅股份	4,200	81,270.00	0.01
120	002568	百润股份	4,800	80,784.00	0.01
121	603233	大参林	5,600	80,080.00	0.01
122	000630	铜陵有色	19,300	69,673.00	0.01
123	002472	双环传动	2,700	59,454.00	0.01
124	002607	中公教育	38,500	58,905.00	0.01
125	002202	金风科技	6,500	43,680.00	0.00
126	001286	陕西能源	3,767	43,433.51	0.00
127	688188	柏楚电子	224	41,339.20	0.00
128	301165	锐捷网络	591	17,635.44	0.00
129	300502	新易盛	100	10,555.00	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601989	中国重工	2,599,600	12,816,028.00	1.17
2	002245	蔚蓝锂芯	1,474,800	11,429,700.00	1.05
3	603806	福斯特	720,060	10,584,882.00	0.97
4	603681	永冠新材	651,000	8,300,250.00	0.76
5	603408	建霖家居	608,600	8,027,434.00	0.74
6	300369	绿盟科技	1,441,200	7,364,532.00	0.67
7	002463	沪电股份	169,500	6,186,750.00	0.57
8	300755	华致酒行	440,500	6,017,230.00	0.55
9	603171	税友股份	215,700	5,832,528.00	0.53
10	300835	龙磁科技	196,200	5,699,610.00	0.52
11	601918	新集能源	542,600	5,290,350.00	0.48
12	600685	中船防务	177,400	4,949,460.00	0.45
13	688323	瑞华泰	488,724	4,921,450.68	0.45
14	601318	中国平安	118,500	4,901,160.00	0.45
15	300858	科拓生物	309,300	4,552,896.00	0.42
16	601319	中国人保	836,600	4,308,490.00	0.39
17	603385	惠达卫浴	773,300	4,245,417.00	0.39
18	002612	朗姿股份	300,300	4,150,146.00	0.38
19	300492	华图山鼎	43,700	4,116,540.00	0.38
20	002035	华帝股份	612,800	3,817,744.00	0.35
21	605007	五洲特纸	289,300	3,653,859.00	0.33
22	603507	振江股份	111,300	3,652,866.00	0.33
23	002897	意华股份	96,100	3,619,126.00	0.33

24	300428	立中集团	178,300	3,314,597.00	0.30
25	002237	恒邦股份	278,500	3,205,535.00	0.29
26	002519	银河电子	591,600	2,904,756.00	0.27
27	603177	德创环保	381,800	2,684,054.00	0.25
28	000089	深圳机场	414,100	2,646,099.00	0.24
29	688147	微导纳米	97,166	2,419,433.40	0.22
30	300244	迪安诊断	196,400	2,356,800.00	0.22
31	603355	莱克电气	109,000	2,354,400.00	0.22
32	300422	博世科	472,400	2,248,624.00	0.21
33	600661	昂立教育	195,600	2,196,588.00	0.20
34	300472	新元科技	489,000	2,166,270.00	0.20
35	300582	英飞特	251,700	2,154,552.00	0.20
36	603987	康德莱	352,600	2,154,386.00	0.20
37	002073	软控股份	287,700	2,126,103.00	0.19
38	301066	万事利	261,900	2,121,390.00	0.19
39	603909	建发合诚	248,300	2,065,856.00	0.19
40	600386	北巴传媒	693,400	1,934,586.00	0.18
41	605080	浙江自然	115,600	1,828,792.00	0.17
42	300662	科锐国际	110,800	1,787,204.00	0.16
43	300463	迈克生物	156,600	1,782,108.00	0.16
44	300577	开润股份	60,100	1,251,883.00	0.11
45	300204	舒泰神	216,000	1,222,560.00	0.11
46	688296	和达科技	118,550	1,152,306.00	0.11
47	688208	道通科技	47,432	1,145,008.48	0.10
48	605198	安德利	27,000	712,800.00	0.07
49	002380	科远智慧	38,300	700,890.00	0.06
50	000600	建投能源	110,600	696,780.00	0.06
51	002920	德赛西威	3,200	278,688.00	0.03
52	002054	德美化工	49,900	245,009.00	0.02
53	301589	诺瓦星云	1,244	233,884.44	0.02
54	002811	郑中设计	34,500	229,770.00	0.02
55	300482	万孚生物	8,040	196,176.00	0.02
56	300496	中科创达	3,500	159,565.00	0.01
57	600372	中航机载	12,700	152,019.00	0.01
58	688503	聚和材料	2,959	83,147.90	0.01
59	688084	晶品特装	1,875	81,937.50	0.01
60	688249	晶合集成	4,159	61,012.53	0.01
61	688143	长盈通	2,519	53,956.98	0.00
62	301301	川宁生物	3,574	45,675.72	0.00
63	688472	阿特斯	3,346	34,062.28	0.00
64	688361	中科飞测	675	31,927.50	0.00
65	688469	中芯集成	7,859	31,121.64	0.00
66	688692	达梦数据	175	30,612.75	0.00

67	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.00
68	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.00
69	688631	莱斯信息	336	20,838.72	0.00
70	301297	富乐德	1,015	20,614.65	0.00
71	688543	国科军工	492	20,206.44	0.00
72	688709	成都华微	1,045	19,635.55	0.00
73	688629	华丰科技	708	18,662.88	0.00
74	301325	曼恩斯特	437	18,537.54	0.00
75	688582	芯动联科	648	18,247.68	0.00
76	688570	天玛智控	884	18,024.76	0.00
77	688352	硕中科技	1,551	17,696.91	0.00
78	301293	三博脑科	433	16,319.77	0.00
79	301266	宇邦新材	517	15,840.88	0.00
80	688146	中船特气	521	15,551.85	0.00
81	301368	丰立智能	337	15,528.96	0.00
82	301536	星宸科技	481	15,521.87	0.00
83	301311	昆船智能	832	15,292.16	0.00
84	301285	鸿日达	565	14,740.85	0.00
85	688334	西高院	888	14,296.80	0.00
86	301239	普瑞眼科	393	13,884.69	0.00
87	688584	上海合晶	866	13,760.74	0.00
88	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.00
89	301377	鼎泰高科	770	13,513.50	0.00
90	301565	中仑新材	711	13,494.78	0.00
91	301580	爱迪特	202	13,317.86	0.00
92	001287	中电港	789	13,042.17	0.00
93	301176	逸豪新材	544	12,669.76	0.00
94	688531	日联科技	268	12,370.88	0.00
95	601061	中信金属	1,726	11,857.62	0.00
96	301141	中科磁业	367	11,835.75	0.00
97	301345	涛涛车业	213	11,736.30	0.00
98	688478	晶升股份	402	11,706.24	0.00
99	301305	朗坤环境	753	11,453.13	0.00
100	603341	龙旗科技	298	11,172.02	0.00
101	688581	安杰思	228	11,156.04	0.00
102	688562	航天软件	726	11,086.02	0.00
103	688535	华海诚科	161	11,031.72	0.00
104	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
105	301398	星源卓镁	255	10,340.25	0.00
106	301439	泓淋电力	791	10,021.97	0.00
107	688623	双元科技	178	10,008.94	0.00
108	301332	德尔玛	1,122	9,918.48	0.00
109	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00



110	688507	索辰科技	199	9,671.40	0.00
111	301320	豪江智能	642	9,642.84	0.00
112	688593	新相微	959	9,590.00	0.00
113	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
114	301408	华人健康	879	8,992.17	0.00
115	301376	致欧科技	420	8,891.40	0.00
116	301413	安培龙	213	8,807.55	0.00
117	301246	宏源药业	652	8,775.92	0.00
118	688433	华曙高科	418	8,719.48	0.00
119	301357	北方长龙	266	8,586.48	0.00
120	688458	美芯晟	309	8,281.20	0.00
121	688620	安凯微	1,016	8,270.24	0.00
122	301419	阿莱德	330	8,193.90	0.00
123	688523	航天环宇	472	8,142.00	0.00
124	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
125	301328	维峰电子	219	8,083.29	0.00
126	301386	未来电器	378	7,839.72	0.00
127	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
128	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
129	301315	威士顿	226	7,365.34	0.00
130	301220	亚香股份	285	7,273.20	0.00
131	301323	新莱福	228	7,200.24	0.00
132	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
133	301322	绿通科技	370	6,944.90	0.00
134	301428	世纪恒通	229	6,572.30	0.00
135	301170	锡南科技	250	6,512.50	0.00
136	301265	华新环保	819	6,478.29	0.00
137	301337	亚华电子	232	6,398.56	0.00
138	301203	国泰环保	225	6,369.75	0.00
139	601133	柏诚股份	594	6,349.86	0.00
140	301232	飞沃科技	231	6,287.82	0.00
141	300693	盛弘股份	300	6,282.00	0.00
142	688512	慧智微	721	6,121.29	0.00
143	301578	辰奕智能	153	6,054.21	0.00
144	301295	美硕科技	301	5,992.91	0.00
145	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
146	688429	时创能源	346	5,861.24	0.00
147	301360	荣旗科技	134	5,795.50	0.00
148	601065	江盐集团	662	5,739.54	0.00
149	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
150	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
151	301355	南王科技	563	5,399.17	0.00
152	301161	唯万密封	346	5,373.38	0.00

153	688479	友车科技	332	5,275.48	0.00
154	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
155	301313	凡拓数创	247	5,026.45	0.00
156	301319	唯特偶	167	5,015.01	0.00
157	300804	广康生化	226	4,926.80	0.00
158	301157	华塑科技	150	4,890.00	0.00
159	001380	华纬科技	241	4,685.04	0.00
160	603325	博隆技术	66	4,491.96	0.00
161	603381	永臻股份	178	4,473.14	0.00
162	603344	星德胜	182	4,124.12	0.00
163	603125	常青科技	232	3,992.72	0.00
164	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
165	001328	登康口腔	145	3,668.50	0.00
166	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00
167	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
168	001282	三联锻造	105	2,909.55	0.00
169	001379	腾达科技	213	2,871.24	0.00
170	603375	盛景微	72	2,800.80	0.00
171	001387	雪祺电气	173	2,638.25	0.00
172	001360	南矿集团	177	2,175.33	0.00
173	603137	恒尚节能	195	1,989.00	0.00
174	603172	万丰股份	122	1,971.52	0.00
175	001367	海森药业	81	1,890.54	0.00
176	001324	长青科技	114	1,846.80	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	000636	风华高科	22,403,748.00	2.12
2	600004	白云机场	21,920,909.10	2.08
3	601966	玲珑轮胎	20,719,294.70	1.96
4	601567	三星医疗	20,529,258.00	1.94
5	601989	中国重工	20,227,502.00	1.92
6	001203	大中矿业	19,604,971.00	1.86
7	600820	隧道股份	19,432,565.00	1.84
8	600066	宇通客车	19,244,024.00	1.82
9	300428	立中集团	18,187,347.00	1.72
10	601991	大唐发电	17,958,587.00	1.70
11	603885	吉祥航空	17,907,056.20	1.70
12	600528	中铁工业	17,014,934.00	1.61

13	600079	人福医药	16,846,106.81	1.60
14	300677	英科医疗	16,662,398.20	1.58
15	002557	洽洽食品	16,491,356.82	1.56
16	600282	南钢股份	16,296,139.00	1.54
17	600707	彩虹股份	16,291,691.18	1.54
18	300394	天孚通信	16,236,936.67	1.54
19	603658	安图生物	15,962,056.75	1.51
20	002128	电投能源	15,857,738.90	1.50

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	603885	吉祥航空	26,983,486.20	2.56
2	600970	中材国际	23,641,103.50	2.24
3	600707	彩虹股份	23,185,552.30	2.20
4	002683	广东宏大	23,073,743.50	2.18
5	300776	帝尔激光	23,030,118.70	2.18
6	601233	桐昆股份	21,413,170.00	2.03
7	300001	特锐德	21,170,271.00	2.00
8	600079	人福医药	21,019,984.00	1.99
9	002739	万达电影	20,817,896.09	1.97
10	600580	卧龙电驱	19,892,458.00	1.88
11	000636	风华高科	19,530,916.00	1.85
12	603568	伟明环保	19,029,433.60	1.80
13	002558	巨人网络	19,008,128.00	1.80
14	600325	华发股份	18,163,868.50	1.72
15	002422	科伦药业	17,859,771.00	1.69
16	603225	新凤鸣	17,477,696.00	1.65
17	002432	九安医疗	17,427,510.00	1.65
18	002588	史丹利	17,210,584.62	1.63
19	600737	中粮糖业	17,197,593.00	1.63
20	600060	海信视像	17,003,704.00	1.61

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	2,630,872,740.43
卖出股票收入（成交）总额	2,565,918,737.18

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）	421,814.44	0.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	421,814.44	0.04

### 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	113671	武进转债	2,850	347,711.63	0.03
2	113669	景 23 转债	560	74,102.81	0.01

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金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

本基金本报告期末持有国债期货合约。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

报告期内基金投资的前十名证券除华海药业（证券代码 600521）、思源电气（证券代码 002028）、天地科技（证券代码 600582）外其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

#### 1、华海药业（证券代码 600521）

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

#### 2、思源电气（证券代码 002028）

根据 2023 年 11 月 10 日发布的相关公告，该证券发行人因违反交通法规被中华人民共和国洋山港海事局处以罚款。

#### 3、天地科技（证券代码 600582）

根据发布的相关公告，该证券发行人在报告期内因欠税、未依法履行职责，多次受到监管机构的处罚。

对上述证券的投资决策程序的说明：本基金为指数型基金，因复制指数被动持有，上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

### 7.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	944,179.20
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	8,140,867.69
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,085,046.89

### 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	113671	武进转债	347,711.63	0.03
2	113669	景 23 转债	74,102.81	0.01

### 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	户均持有的基	持有人结构
------	------	--------	-------

	数（户）	金份额	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 等权重指数增强 A	62,571	8,684.23	72,638,947.48	13.37%	470,742,313.73	86.63%
招商中证 500 等权重指数增强 C	28,560	15,034.77	249,423,070.63	58.09%	179,969,954.15	41.91%
合计	91,131	10,674.46	322,062,018.11	33.11%	650,712,267.88	66.89%

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 等权重指数增强 A	204,866.36	0.0377%
	招商中证 500 等权重指数增强 C	107,493.69	0.0250%
	合计	312,360.05	0.0321%

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 等权重指数增强 A	0~10
	招商中证 500 等权重指数增强 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 等权重指数增强 A	0~10
	招商中证 500 等权重指数增强 C	0
	合计	0~10

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	招商中证 500 等权重指数增强 A	招商中证 500 等权重指数增强 C
基金合同生效日(2020年12月23日)基金份额总额	173,648,823.69	79,178,718.26
本报告期期初基金份额总额	571,300,011.99	344,244,146.47
本报告期基金总申购份额	176,988,384.09	258,211,427.18
减：本报告期基金总赎回份额	204,907,134.87	173,062,548.87
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	543,381,261.21	429,393,024.78

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，本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、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，本基金托管人及其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	
东莞证券	2	3,798,984,596.96	73.13%	1,615,147.72	71.06%	-
国信证券	3	959,043,912.87	18.46%	338,921.91	14.91%	-
渤海证券	2	436,928,424.09	8.41%	318,876.59	14.03%	-

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

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东莞证券	3,666.01	16.79%	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	18,163.21	83.21%	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	招商基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-01-05
2	招商基金管理有限公司关于终止北京中期时代基金销售有限公司办理旗下基金销售业务的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-01-18

3	招商基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 4 季度报告提示性公告	证券时报及基金管理人网站	2024-01-19
4	招商中证 500 等权重指数增强型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-01-19
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	2024-02-02
6	招商基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-03-20
7	招商基金管理有限公司旗下基金 2023 年年度报告提示性公告	证券时报及基金管理人网站	2024-03-29
8	招商中证 500 等权重指数增强型证券投资基金 2023 年年度报告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-03-29
9	招商中证 500 等权重指数增强型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-04-19
10	招商基金管理有限公司旗下基金 2024 年第 1 季度报告提示性公告	证券时报及基金管理人网站	2024-04-19
11	招商基金管理有限公司关于提醒投资者持续完善身份信息资料的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-05-18
12	招商基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-06-05
13	招商基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-06-20
14	招商中证 500 等权重指数增强型证券投资基金 (A 类份额) 基金产品资料概要更新	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-06-28
15	招商中证 500 等权重指数增强型证券投资基金 (C 类份额) 基金产品资料概要更新	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-06-28

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准设立招商基金管理有限公司的文件；

2、中国证券监督管理委员会批准招商中证 500 等权重指数增强型证券投资基金设立的文件；

- 3、《招商中证 500 等权重指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 4、《招商中证 500 等权重指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 5、《招商中证 500 等权重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

2024 年 8 月 30 日