

招商中证 500 指数增强型证券投资基金 2023 年中期报告

2023 年 06 月 30 日

基金管理人：招商基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 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 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介.....	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
§4 管理人报告.....	7
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	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.....	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.....	12
4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	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.....	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
§7 投资组合报告.....	41
7.1 期末基金资产组合情况.....	41
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.....	54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	56
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	56
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	56
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	56
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	57
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	57
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	57

7.12 投资组合报告附注.....	57
§8 基金份额持有人信息.....	59
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	59
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.....	60
§9 开放式基金份额变动.....	60
§10 重大事件揭示.....	60
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.....	61
10.4 基金投资策略的改变.....	61
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	61
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	61
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	61
10.8 其他重大事件.....	65
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	66
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	66
§12 备查文件目录.....	67
12.1 备查文件目录.....	67
12.2 存放地点.....	67
12.3 查阅方式.....	67

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	招商中证 500 指数增强型证券投资基金	
基金简称	招商中证 500 指数增强	
基金主代码	004192	
交易代码	004192	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 5 月 17 日	
基金管理人	招商基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	113,791,358.22 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	招商中证 500 指数增强 A	招商中证 500 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	004192	004193
报告期末下属分级基金的份 额总额	61,536,472.35 份	52,254,885.87 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型股票指数基金，通过数量化的投资方法与严格的投资纪律约束，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%，同时力求实现超越标的指数的业绩表现，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金为增强型指数产品，在标的指数成份券权重的基础上根据量化模型对行业配置及个股权重等进行主动调整，力争在控制跟踪误差的基础上获取超越标的指数的投资收益。 具体包括：1、股票投资策略；2、债券投资策略；3、股指期货投资策略；4、国债期货投资策略；5、权证投资策略；6、资产支持证券投资策略；7、融资及转融通证券出借业务投资策略；8、存托凭证投资策略。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，属于较高风险、较高预期收益的基金品种，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	招商基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	潘西里
	联系电话	0755-83196666
	电子邮箱	cmf@cmfchina.com
		许俊
		010-66596688
		fxjd_hq@bank-of-china.com

客户服务电话	400-887-9555	95566
传真	0755—83196475	010—66594942
注册地址	深圳市福田区深南大道 7088 号	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址	深圳市福田区深南大道 7088 号	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	518040	100818
法定代表人	王小青	葛海蛟

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.cmfcchina.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

1、招商中证 500 指数增强 A

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日 - 2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	1,580,562.17
本期利润	1,641,106.24
加权平均基金份额本期利润	0.0274
本期加权平均净值利润率	2.05%
本期基金份额净值增长率	2.56%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	18,127,987.25
期末可供分配基金份额利润	0.2946
期末基金资产净值	80,804,992.61
期末基金份额净值	1.3131
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	31.31%

2、招商中证 500 指数增强 C

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日 - 2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	1,708,865.63

本期利润	2,964,545.94
加权平均基金份额本期利润	0.0525
本期加权平均净值利润率	3.98%
本期基金份额净值增长率	2.36%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	14,230,001.54
期末可供分配基金份额利润	0.2723
期末基金资产净值	67,521,525.35
期末基金份额净值	1.2922
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	29.22%

注：1、基金业绩指标不包括持有人认（申）购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

招商中证 500 指数增强 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.98%	0.82%	-0.77%	0.89%	1.75%	-0.07%
过去三个月	-3.15%	0.71%	-5.10%	0.78%	1.95%	-0.07%
过去六个月	2.56%	0.69%	2.20%	0.75%	0.36%	-0.06%
过去一年	-4.66%	0.89%	-6.65%	0.91%	1.99%	-0.02%
过去三年	14.81%	1.11%	2.48%	1.13%	12.33%	-0.02%
自基金合同生效起至今	31.31%	1.23%	0.49%	1.26%	30.82%	-0.03%

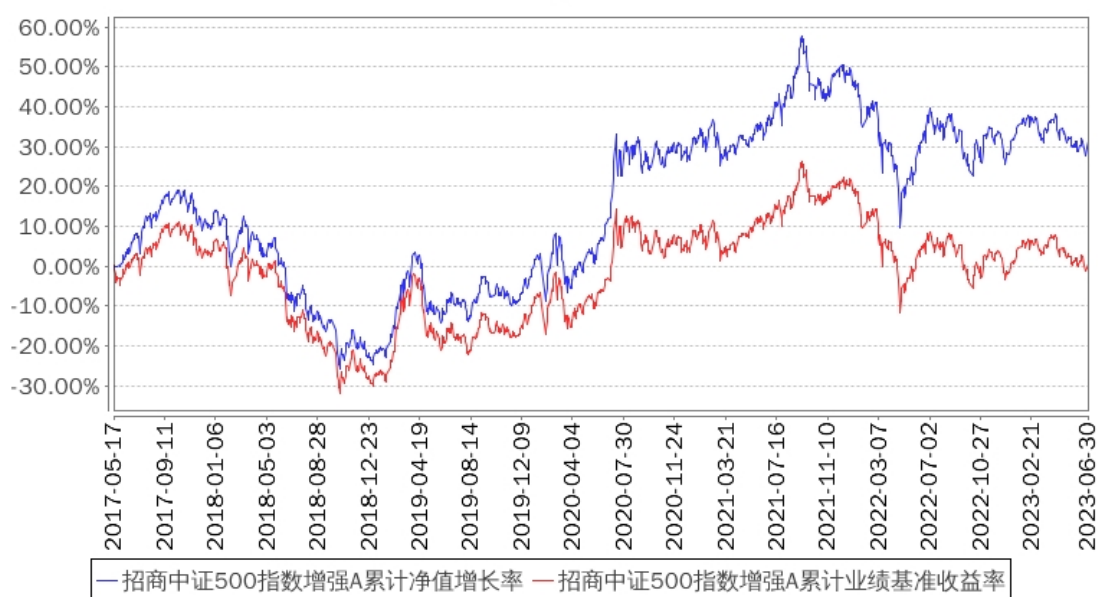
招商中证 500 指数增强 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.95%	0.82%	-0.77%	0.89%	1.72%	-0.07%
过去三个月	-3.23%	0.71%	-5.10%	0.78%	1.87%	-0.07%

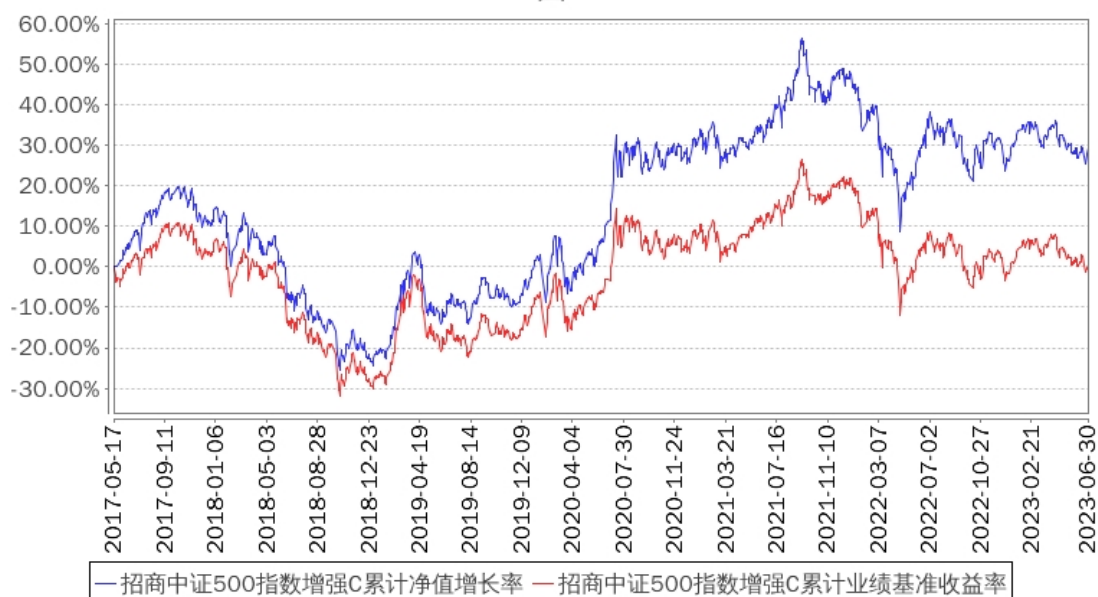
过去六个月	2.36%	0.69%	2.20%	0.75%	0.16%	-0.06%
过去一年	-5.04%	0.89%	-6.65%	0.91%	1.61%	-0.02%
过去三年	13.44%	1.11%	2.48%	1.13%	10.96%	-0.02%
自基金合同生效起至今	29.22%	1.23%	0.49%	1.26%	28.73%	-0.03%

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

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



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



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

招商基金管理有限公司首批获得企业年金基金投资管理人资格、基本养老保险基金投资管理人资格；2004 年获得全国社保基金投资管理人资格；同时拥有合格境内机构投资者（QDII）业务资格、专户理财（特定客户资产管理业务）资格、公募基金投顾业务资格，在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、海外投资、FOF 投资等领域全面布局。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王平	本基金基金经理	2017 年 5 月 17 日	-	17	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、招商盛合灵活配置混合型证券投资基金、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基金经理，现任量化投资部副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 500 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。
邓童	本基金基金经理	2021 年 11 月 23 日	-	10	男，硕士。2012 年 7 月加入招商基金管理有限公司量化投资部，曾任研究员。现任招商中证 500 指数增强型证券投资基金、招商中证大宗商品股票指数证券投资基金（LOF）、招商中证煤炭等权指数证券投资基金、招商北证 50 成份指数型发起式证券投资基金、招商中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、招商中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，兼任投资经理。

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

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量 (只)	资产净值(元)	任职时间
邓童	公募基金	6	2,490,548,301.57	2021 年 11 月 23 日
	私募资产管理计划	2	1,673,379,023.18	2013 年 11 月 26 日
	其他组合	-	-	-
	合计	8	4,163,927,324.75	-

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 18 次，其中 14 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，4 次为不同基金经理管理的基金因投资策略不同而发生的反向交易。报告期内未发现有可能导致不公平交易和利益输送的重大异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，中证 500 指数小幅上涨，但市场波动率较以往明显降低的情况下，整体走势呈现窄区间波动特征，市场关注的上市企业业绩改善其实并未兑现。就宏观数据而言，上半年的整体表现并不理想，规模以上企业利润依然承压，出口压力也依然存在。尽管年初市场

对于 2023 年政策的持续和盈利复苏改善的预期较强，指数一季度表现较好，但二季度不及预期后出现了持续下跌。

市场风格方面，2023 年中小价值的风格依然有所延续，成长风格依然被压制。行业方面，汽车、通信整体环境良性变化的格局在资本市场已经有所反应，业绩较好的行业股价出现有明显的支撑。前期市场关注的中特估及人工智能在 2 季度走势开始分化，也逐步进入逻辑去伪存真与个股业绩观察的阶段，预期未来同涨同跌的局面会更少。

当前货币政策的边际变化依然较为良性温和，市场对下半年政策的再发力及政府债务规模的扩张依然有所期待。上市企业 2 季报披露的财务数据依然有压力，但现金流稳定，ROE 尚可的领域可能具备超额收益的基础。

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 2.56%，同期业绩基准增长率为 2.20%，C 类份额净值增长率为 2.36%，同期业绩基准增长率为 2.20%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，权益市场当前的低点可能演化为走势筑底后阶段性反弹的格局，主题投资可能会有所淡化。

策略端方面，产品维持在紧跟中证 500 指数的背景下重点关注财务数据边际有明显改善的行业和个股。整体策略相对基准偏好中盘均衡风格，在控制风险的基础上力争为产品争取更优的超额收益。

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制度》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

根据相关法律法规的规定和基金合同的约定，以及本基金的实际运作情况，本基金报告期末未进行利润分配。在符合分红条件的前提下，本基金已实现尚未分配的可供分配收益部分，将严格按照基金合同的约定适时向投资者予以分配。

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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在招商中证 500 指数增强型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：招商中证 500 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	12,677,560.31	7,683,160.93
结算备付金		860,465.93	753,169.53
存出保证金		755,488.78	14,420.51
交易性金融资产	6.4.7.2	134,375,597.66	117,596,883.29
其中：股票投资		133,634,354.22	116,953,222.40
基金投资		-	-
债券投资		741,243.44	643,660.89
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		90,684.39	84,172.42
应收股利		-	-
应收申购款		103,221.07	414,823.54
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		148,863,018.14	126,546,630.22
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月

		日	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		187,446.58	408,136.75
应付管理人报酬		144,424.71	128,735.67
应付托管费		18,053.09	16,091.97
应付销售服务费		21,913.67	19,768.46
应付投资顾问费		-	-
应交税费		4.39	3.62
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	164,657.74	301,007.16
负债合计		536,500.18	873,743.63
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	113,791,358.22	98,782,679.47
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	34,535,159.74	26,890,207.12
净资产合计		148,326,517.96	125,672,886.59
负债和净资产总计		148,863,018.14	126,546,630.22

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，招商中证 500 指数增强 A 份额净值 1.3131 元，基金份额总额 61,536,472.35 份；招商中证 500 指数增强 C 份额净值 1.2922 元，基金份额总额 52,254,885.87 份；总份额合计 113,791,358.22 份。

6.2 利润表

会计主体：招商中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		5,967,273.40	-6,903,238.73
1.利息收入		30,937.68	18,706.47
其中：存款利息收入	6.4.7.9	30,937.68	18,706.47
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			
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		4,579,515.69	-8,168,210.12
其中：股票投资收益	6.4.7.10	2,577,795.25	-9,583,254.23
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	12,108.62	22,828.24
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	239,995.22	394,084.96
股利收益	6.4.7.15	1,749,616.60	998,130.91
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	1,316,224.38	1,190,542.77
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	40,595.65	55,722.15
减：二、营业总支出		1,361,621.22	923,270.46
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	923,478.49	587,143.88
2.托管费	6.4.10.2.2	115,434.88	73,393.05
3.销售服务费	6.4.10.2.3	149,216.75	85,939.23
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		1,337.11	1,424.48
8.其他费用	6.4.7.19	172,153.99	175,369.82
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,605,652.18	-7,826,509.19
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,605,652.18	-7,826,509.19
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		4,605,652.18	-7,826,509.19

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：招商中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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（基金净值）	98,782,679.47	-	26,890,207.12	125,672,886.59
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	98,782,679.47	-	26,890,207.12	125,672,886.59
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	15,008,678.75	-	7,644,952.62	22,653,631.37
（一）、综合收益总额	-	-	4,605,652.18	4,605,652.18
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	15,008,678.75	-	3,039,300.44	18,047,979.19
其中：1.基金申购款	68,960,441.53	-	21,763,040.81	90,723,482.34
2.基金赎回款	-53,951,762.78	-	-18,723,740.37	-72,675,503.15
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	113,791,358.22	-	34,535,159.74	148,326,517.96
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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（基金净值）	71,655,893.26	-	35,141,938.40	106,797,831.66
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	71,655,893.26	-	35,141,938.40	106,797,831.66
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	8,189,270.15	-	-5,580,111.88	2,609,158.27

(一)、综合收益总额	-	-	-7,826,509.19	-7,826,509.19
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	8,189,270.15	-	2,246,397.31	10,435,667.46
其中: 1.基金申购款	28,678,951.03	-	8,973,023.11	37,651,974.14
2.基金赎回款	-20,489,680.88	-	-6,726,625.80	-27,216,306.68
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	79,845,163.41	-	29,561,826.52	109,406,989.93

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

招商中证 500 指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人招商基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《招商中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规的规定,经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]3114 号文准予公开募集注册。本基金为契约型开放式基金,存续期限为不定期。根据销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为 A 类基金份额和 C 类基金份额。本基金首次设立募集基金份额为 332,908,992.33 份,经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了编号为德师报(验)字(17)第 00144 号验资报告。《招商中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)于 2017 年 5 月 17 日正式生效。本基金的基金管理人为招商基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”)。根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及截至报告期末最新公告的《招商中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票和存托凭证(包括主板、中小板、创业板和其他经中国证监会核准上市的股票和存托凭证)、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转债(含可分离交易可转换债)、可交换债、次级债、短期融资券、中期票据等)、债券回购、同业存单、银行存款、货币市场工具、资产支持证券、权证、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但

须符合中国证监会相关规定)。本基金可以参与融资和转融通证券出借业务。基金的投资组合比例为:本基金投资于股票、存托凭证资产的比例不低于基金资产的 80%,投资于中证 500 指数成份券及其备选成份券的资产不低于非现金基金资产的 80%;每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%,其中,现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为中证 500 指数收益率 \times 95%+同期银行活期存款利率(税后) \times 5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)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 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

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

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、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[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[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]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》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运营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,暂不缴纳企业所得税。

3) 对基金取得的股票股息、红利收入,由上市公司在收到相关扣收税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳。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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	12,677,560.31
等于：本金	12,676,493.00
加：应计利息	1,067.31
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-

其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	12,677,560.31

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	135,808,387.83	-	133,634,354.22	-2,174,033.61
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	998.86	741,243.44	174,647.75
	银行间市场	-	-	-
	合计	998.86	741,243.44	174,647.75
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	136,373,984.66	998.86	134,375,597.66	-1,999,385.86

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 2023 年 6 月 30 日			备注
	合同/名义金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	6,005,160.00	-	-	-
其中：股指期货投资	6,005,160.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	6,005,160.00	-	-	-

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
IC2307	IC2307	4.00	4,792,640.00	-28,520.00
IC2308	IC2308	1.00	1,196,080.00	12,080.00
合计				-16,440.00
减：可抵销期货暂收款				-16,440.00

净额	-
----	---

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	14.86
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	45,135.51
其中：交易所市场	45,135.51
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	69,507.37
应付指数使用费	50,000.00
合计	164,657.74

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

招商中证 500 指数增强 A		
项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	54,224,175.06	54,224,175.06
本期申购	19,428,823.99	19,428,823.99
本期赎回（以“-”号填列）	-12,116,526.70	-12,116,526.70
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	61,536,472.35	61,536,472.35

招商中证 500 指数增强 C		
项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	44,558,504.41	44,558,504.41
本期申购	49,531,617.54	49,531,617.54

本期赎回（以“-”号填列）	-41,835,236.08	-41,835,236.08
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	52,254,885.87	52,254,885.87

注：本期申购含红利再投、转换入份（金）额，本期赎回含转换出份（金）额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

招商中证 500 指数增强 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	14,547,441.94	651,466.64	15,198,908.58
本期利润	1,580,562.17	60,544.07	1,641,106.24
本期基金份额交易产生的变动数	1,999,983.14	428,522.30	2,428,505.44
其中：基金申购款	5,623,725.87	993,021.30	6,616,747.17
基金赎回款	-3,623,742.73	-564,499.00	-4,188,241.73
本期已分配利润	-	-	-
本期末	18,127,987.25	1,140,533.01	19,268,520.26

招商中证 500 指数增强 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	11,095,496.88	595,801.66	11,691,298.54
本期利润	1,708,865.63	1,255,680.31	2,964,545.94
本期基金份额交易产生的变动数	1,425,639.03	-814,844.03	610,795.00
其中：基金申购款	12,761,306.40	2,384,987.24	15,146,293.64
基金赎回款	-11,335,667.37	-3,199,831.27	-14,535,498.64
本期已分配利润	-	-	-
本期末	14,230,001.54	1,036,637.94	15,266,639.48

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	19,702.09
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	10,986.32
其他	249.27
合计	30,937.68

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	2,577,795.25
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	2,577,795.25

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	357,960,519.79
减：卖出股票成本总额	354,872,269.28
减：交易费用	510,455.26
买卖股票差价收入	2,577,795.25

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	12,308.62
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-200.00
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	12,108.62

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	2,038,800.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	2,000,200.00

减：应计利息总额	38,800.00
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-200.00

6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券申购差价收入。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内无买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.12.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券赎回差价收入。

6.4.7.12.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券申购差价收入。

6.4.7.13 贵金属投资收益

6.4.7.13.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.13.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

6.4.7.13.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无贵金属赎回差价收入。

6.4.7.13.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无贵金属申购差价收入。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具买卖权证差价收入。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	239,995.22

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,749,616.60
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,749,616.60

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	1,332,664.38
——股票投资	1,276,578.63
——债券投资	56,085.75
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-16,440.00
——权证投资	-
——期货投资	-16,440.00
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	1,316,224.38

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	40,595.65
合计	40,595.65

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	10,000.00
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	2,645.74
指数使用费	100,000.00
其他	0.88
合计	172,153.99

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报告批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
招商基金管理有限公司	基金管理人
中国银行股份有限公司	基金托管人
招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)	基金管理人的股东
招商证券股份有限公司(以下简称“招商证券”)	基金管理人的股东

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

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	923,478.49	587,143.88
其中：支付销售机构的客户维护费	385,806.66	231,745.67
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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	115,434.88	73,393.05

注：支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值×0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	招商中证 500 指数增强 A	招商中证 500 指数增强 C	合计
当期发生的基金应支付的销售服务费			
招商基金管理有限公司	-	8,294.61	8,294.61
招商银行	-	85,225.51	85,225.51
合计	-	93,520.12	93,520.12
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		

	招商中证 500 指数增强 A	招商中证 500 指数增强 C	合计
招商基金管理有限 公司	-	7,195.19	7,195.19
招商银行	-	40,768.79	40,768.79
合计	-	47,963.98	47,963.98

注：本基金的 C 类基金份额的年销售服务费率为 0.40%，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行-活期	12,677,560.31	19,702.09	10,331,939.40	12,218.21

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行股份有限公司保管，按银行约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

单位：人民币元

本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
招商证券	301305	朗坤环境	新股获配	2,298	58,024.50
招商证券	301428	世纪恒通	新股获配	1,430	37,680.50

上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	001323	慕思股份	网下申购	573	22,306.89
招商证券	301123	奕东电子	网下申购	946	35,219.58

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（2023 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
001282	三联锻造	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	27.93	33.03	55	1,536.15	1,816.65	-
001286	陕西能源	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
001287	中电港	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股流通受限	11.88	21.02	207	2,459.16	4,351.14	-
001324	长青科技	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股流通受限	18.88	19.60	75	1,416.00	1,470.00	-
001328	登康口腔	2023 年 3 月	6 个月	新股流通受限	20.68	25.49	69	1,426.92	1,758.81	-

		29 日								
001360	南矿集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	15.38	14.87	89	1,368.82	1,323.43	-
001367	海森药业	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股流通受限	44.48	39.48	30	1,334.40	1,184.40	-
001380	华纬科技	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新股流通受限	28.84	30.78	91	2,624.44	2,800.98	-
300804	广康生化	2023 年 6 月 15 日	6 个月	新股流通受限	42.45	32.97	132	5,603.40	4,352.04	-
301141	中科磁业	2023 年 3 月 27 日	6 个月	新股流通受限	41.20	42.69	125	5,150.00	5,336.25	-
301157	华塑科技	2023 年 3 月 1 日	6 个月	新股流通受限	56.50	52.93	87	4,915.50	4,604.91	-
301170	锡南科技	2023 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通受限	34.00	34.93	131	4,454.00	4,575.83	-
301202	朗威股份	2023 年 6 月 28 日	6 个月	新股流通受限	25.82	25.82	133	3,434.06	3,434.06	-
301202	朗威股份	2023 年 6 月 28 日	1 个月内(含)	新股流通受限	25.82	25.82	1,197	30,906.54	30,906.54	-
301203	国泰环保	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股流通受限	46.13	34.40	101	4,659.13	3,474.40	-
301232	飞沃科技	2023 年 6 月 8 日	6 个月	新股流通受限	72.50	58.42	70	5,075.00	4,089.40	-
301246	宏源药业	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新股流通受限	50.00	30.71	180	9,000.00	5,527.80	-
301261	恒工精密	2023 年 6 月 29 日	6 个月	新股流通受限	36.90	36.90	99	3,653.10	3,653.10	-
301261	恒工精密	2023 年 6 月 29 日	1 个月内(含)	新股流通受限	36.90	36.90	887	32,730.30	32,730.30	-
301292	海科新源	2023	6 个月	新股流通	19.99	19.99	261	5,217.39	5,217.39	-

		年 6 月 29 日		受限						
301292	海科新源	2023 年 6 月 29 日	1 个月内(含)	新股流通受限	19.99	19.99	2,340	46,776.60	46,776.60	-
301293	三博脑科	2023 年 4 月 25 日	6 个月	新股流通受限	29.60	71.42	157	4,647.20	11,212.94	-
301295	美硕科技	2023 年 6 月 19 日	6 个月	新股流通受限	37.40	36.07	155	5,797.00	5,590.85	-
301301	川宁生物	2022 年 12 月 20 日	6 个月	新股流通受限	5.00	8.96	1,055	5,275.00	9,452.80	-
301305	朗坤环境	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	25.25	19.69	230	5,807.50	4,528.70	-
301315	威士顿	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新股流通受限	32.29	51.12	130	4,197.70	6,645.60	-
301320	豪江智能	2023 年 6 月 1 日	6 个月	新股流通受限	13.06	20.62	467	6,099.02	9,629.54	-
301322	绿通科技	2023 年 2 月 27 日	6 个月	新股流通受限	131.11	53.24	89	7,735.49	4,738.36	-
301323	新莱福	2023 年 5 月 29 日	6 个月	新股流通受限	39.06	39.36	100	3,906.00	3,936.00	-
301325	曼恩斯特	2023 年 5 月 4 日	6 个月	新股流通受限	76.80	107.95	78	5,990.40	8,420.10	-
301332	德尔玛	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新股流通受限	14.81	13.73	344	5,094.64	4,723.12	-
301337	亚华电子	2023 年 5 月 16 日	6 个月	新股流通受限	32.60	30.37	116	3,781.60	3,522.92	-
301345	涛涛车业	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新股流通受限	73.45	46.64	57	4,186.65	2,658.48	-
301355	南王科技	2023 年 6 月 2 日	6 个月	新股流通受限	17.55	16.75	264	4,633.20	4,422.00	-

301357	北方长龙	2023 年 4 月 11 日	6 个月	新股流通 受限	50.00	48.39	89	4,450.00	4,306.71	-
301358	湖南裕能	2023 年 2 月 1 日	6 个月	新股流通 受限	23.77	42.89	210	4,991.70	9,006.90	-
301360	荣旗科技	2023 年 4 月 17 日	6 个月	新股流通 受限	71.88	92.60	64	4,600.32	5,926.40	-
301373	凌玮科技	2023 年 1 月 20 日	6 个月	新股流通 受限	33.73	31.85	118	3,980.14	3,758.30	-
301376	致欧科技	2023 年 6 月 14 日	6 个月	新股流通 受限	24.66	22.51	200	4,932.00	4,502.00	-
301386	未来电器	2023 年 3 月 21 日	6 个月	新股流通 受限	29.99	23.79	152	4,558.48	3,616.08	-
301408	华人健康	2023 年 2 月 22 日	6 个月	新股流通 受限	16.24	16.95	390	6,333.60	6,610.50	-
301419	阿莱德	2023 年 2 月 2 日	6 个月	新股流通 受限	24.80	43.85	254	6,299.20	11,137.90	-
301428	世纪恒通	2023 年 5 月 10 日	6 个月	新股流通 受限	26.35	30.60	143	3,768.05	4,375.80	-
301439	泓淋电力	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新股流通 受限	19.99	16.90	219	4,377.81	3,701.10	-
301486	致尚科技	2023 年 6 月 30 日	6 个月	新股流通 受限	57.66	57.66	106	6,111.96	6,111.96	-
301486	致尚科技	2023 年 6 月 30 日	1 个月 内(含)	新股流通 受限	57.66	57.66	945	54,488.70	54,488.70	-
301488	豪恩汽电	2023 年 6 月 26 日	6 个月	新股流通 受限	39.78	39.78	135	5,370.30	5,370.30	-
301488	豪恩汽电	2023 年 6 月 26 日	1 个月 内(含)	新股流通 受限	39.78	39.78	1,211	48,173.58	48,173.58	-
603172	万丰股份	2023 年 4 月	6 个月	新股流通 受限	14.58	16.13	105	1,530.90	1,693.65	-

		28 日								
688334	西高院	2023 年 6 月 9 日	6 个月	新股流通受限	14.16	16.21	304	4,304.64	4,927.84	-
688361	中科飞测	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股流通受限	23.60	64.67	143	3,374.80	9,247.81	-
688429	时创能源	2023 年 6 月 20 日	6 个月	新股流通受限	19.20	25.53	170	3,264.00	4,340.10	-
688458	美芯晟	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	75.00	90.76	61	4,575.00	5,536.36	-
688469	中芯集成	2023 年 4 月 28 日	6 个月	新股流通受限	5.69	5.41	1,691	9,621.79	9,148.31	-
688472	阿特斯	2023 年 6 月 2 日	6 个月	新股流通受限	11.10	17.04	626	6,948.60	10,667.04	-
688479	友车科技	2023 年 5 月 4 日	6 个月	新股流通受限	33.99	29.49	108	3,670.92	3,184.92	-
688502	茂莱光学	2023 年 2 月 28 日	6 个月	新股流通受限	69.72	178.59	823	57,379.56	146,979.57	-
688512	慧智微	2023 年 5 月 8 日	6 个月	新股流通受限	20.92	19.16	227	4,748.84	4,349.32	-
688523	航天环宇	2023 年 5 月 26 日	6 个月	新股流通受限	21.86	23.85	221	4,831.06	5,270.85	-
688543	国科军工	2023 年 6 月 14 日	6 个月	新股流通受限	43.67	53.05	103	4,498.01	5,464.15	-
688562	航天软件	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	12.68	22.31	305	3,867.40	6,804.55	-
688570	天玛智控	2023 年 5 月 29 日	6 个月	新股流通受限	30.26	25.33	177	5,356.02	4,483.41	-
688581	安杰思	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股流通受限	125.80	118.03	39	4,906.20	4,603.17	-
688582	芯动联科	2023	6 个月	新股流通	26.74	40.68	164	4,385.36	6,671.52	-

		年 6 月 21 日		受限						
688593	新相微	2023 年 5 月 25 日	6 个月	新股流通受限	11.18	14.59	379	4,237.22	5,529.61	-
688603	天承科技	2023 年 6 月 30 日	6 个月	新股流通受限	55.00	55.00	77	4,235.00	4,235.00	-
688603	天承科技	2023 年 6 月 30 日	1 个月内(含)	新股流通受限	55.00	55.00	688	37,840.00	37,840.00	-
688620	安凯微	2023 年 6 月 15 日	6 个月	新股流通受限	10.68	12.34	449	4,795.32	5,540.66	-
688623	双元科技	2023 年 5 月 31 日	6 个月	新股流通受限	125.88	86.79	40	5,035.20	3,471.60	-
688629	华丰科技	2023 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通受限	9.26	18.59	413	3,824.38	7,677.67	-
688631	莱斯信息	2023 年 6 月 19 日	6 个月	新股流通受限	25.28	29.87	119	3,008.32	3,554.53	-

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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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
601298	青岛港	2023 年 6 月 28 日	重大事项停牌	6.97	2023 年 7 月 3 日	7.40	11,200	71,092.75	78,064.00	-
000540	*ST 中天	2023 年 5 月 19 日	重大事项停牌	0.01	已摘牌	-	95,300	72,428.00	953.00	-

注：“*ST 中天”已于 2023 年 6 月 30 日摘牌并终止上市。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

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

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	68,132.11	67,909.27
AAA 以下	673,111.33	575,751.62
未评级	-	-
合计	741,243.44	643,660.89

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 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	12,677,560.31	-	-	-	12,677,560.31
结算备付金	860,465.93	-	-	-	860,465.93
存出保证金	36,842.38	-	-	718,646.40	755,488.78
交易性金融资产	-	246,144.53	495,098.91	133,634,354.22	134,375,597.66
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	-	-	-	103,221.07	103,221.07
应收清算款	-	-	-	90,684.39	90,684.39
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	13,574,868.62	246,144.53	495,098.91	134,546,906.08	148,863,018.14
负债					
应付赎回款	-	-	-	187,446.58	187,446.58
应付管理人报酬	-	-	-	144,424.71	144,424.71
应付托管费	-	-	-	18,053.09	18,053.09
应付清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资	-	-	-	-	-

产款					
应付销售服务费	-	-	-	21,913.67	21,913.67
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	4.39	4.39
其他负债	-	-	-	164,657.74	164,657.74
负债总计	-	-	-	536,500.18	536,500.18
利率敏感度缺口	13,574,868.62	246,144.53	495,098.91	134,010,405.90	148,326,517.96
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	7,683,160.93	-	-	-	7,683,160.93
结算备付金	753,169.53	-	-	-	753,169.53
存出保证金	14,420.51	-	-	-	14,420.51
交易性金融资产	-	132,493.62	511,167.27	116,953,222.40	117,596,883.29
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	-	-	-	414,823.54	414,823.54
应收清算款	-	-	-	84,172.42	84,172.42
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	8,450,750.97	132,493.62	511,167.27	117,452,218.36	126,546,630.22
负债					
应付赎回款	-	-	-	408,136.75	408,136.75
应付管理人报酬	-	-	-	128,735.67	128,735.67
应付托管费	-	-	-	16,091.97	16,091.97
应付清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	19,768.46	19,768.46
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	3.62	3.62
其他负债	-	-	-	301,007.16	301,007.16
负债总计	-	-	-	873,743.63	873,743.63
利率敏感度缺口	8,450,750.97	132,493.62	511,167.27	116,578,474.73	125,672,886.59

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1.若市场利率平行上升或下降 50 个基点
	2.其他市场变量保持不变

3.仅存在公允价值变动对基金资产净值的影响			
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	1. 市场利率平行上升 50 个基点	-18,306.35	-16,975.21
2. 市场利率平行下降 50 个基点	18,882.73	17,537.00	

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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	133,634,354.22	90.09	116,953,222.40	93.06
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	133,634,354.22	90.09	116,953,222.40	93.06

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（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	1. 权益性投资的市场价格上升 5%	6,681,717.71	5,847,661.12
2. 权益性投资的市场价格下降 5%	-6,681,717.71	-5,847,661.12	

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 2023 年 6 月 30 日
第一层次	133,549,412.68
第二层次	357,001.53
第三层次	469,183.45
合计	134,375,597.66

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（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	133,634,354.22	89.77
	其中：股票	133,634,354.22	89.77
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	741,243.44	0.50
	其中：债券	741,243.44	0.50
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	13,538,026.24	9.09
8	其他资产	949,394.24	0.64
9	合计	148,863,018.14	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	1,011,951.00	0.68
B	采矿业	4,529,117.00	3.05
C	制造业	76,960,274.09	51.89
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,889,626.60	1.95
E	建筑业	3,315,895.00	2.24
F	批发和零售业	3,563,604.26	2.40
G	交通运输、仓储和邮政业	2,074,930.00	1.40
H	住宿和餐饮业	236,875.00	0.16
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,553,777.30	3.74
J	金融业	4,831,195.80	3.26
K	房地产业	1,746,563.00	1.18
L	租赁和商务服务业	114,885.00	0.08
M	科学研究和技术服务业	454,252.00	0.31
N	水利、环境和公共设施管理业	1,531,023.00	1.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	597,179.00	0.40
R	文化、体育和娱乐业	1,387,998.00	0.94

S	综合	725,751.00	0.49
	合计	111,524,897.05	75.19

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	72,640.00	0.05
B	采矿业	183,492.00	0.12
C	制造业	12,547,362.56	8.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	417,038.47	0.28
E	建筑业	71,820.00	0.05
F	批发和零售业	2,599,227.04	1.75
G	交通运输、仓储和邮政业	155,008.00	0.10
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,081,971.97	2.08
J	金融业	1,040,334.00	0.70
K	房地产业	1,165,695.00	0.79
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	370,271.84	0.25
N	水利、环境和公共设施管理业	17,194.35	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	11,212.94	0.01
R	文化、体育和娱乐业	376,189.00	0.25
S	综合	-	-
	合计	22,109,457.17	14.91

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	000729	燕京啤酒	133,300	1,662,251.00	1.12
2	600582	天地科技	276,500	1,611,995.00	1.09
3	600580	卧龙电驱	103,400	1,510,674.00	1.02

4	002444	巨星科技	68,600	1,500,968.00	1.01
5	600718	东软集团	132,800	1,415,648.00	0.95
6	601717	郑煤机	112,100	1,395,645.00	0.94
7	002056	横店东磁	73,295	1,334,701.95	0.90
8	002422	科伦药业	42,900	1,273,272.00	0.86
9	000739	普洛药业	71,200	1,263,088.00	0.85
10	601139	深圳燃气	172,400	1,256,796.00	0.85
11	300866	安克创新	13,001	1,137,587.50	0.77
12	600820	隧道股份	185,000	1,111,850.00	0.75
13	600143	金发科技	123,700	1,079,901.00	0.73
14	600060	海信视像	43,200	1,069,200.00	0.72
15	600623	华谊集团	171,500	1,068,445.00	0.72
16	002353	杰瑞股份	42,100	1,057,973.00	0.71
17	000997	新大陆	52,800	997,920.00	0.67
18	002600	领益智造	141,200	975,692.00	0.66
19	600066	宇通客车	65,800	969,892.00	0.65
20	300003	乐普医疗	42,300	956,403.00	0.64
21	600038	中直股份	23,800	947,716.00	0.64
22	600879	航天电子	109,000	925,410.00	0.62
23	600170	上海建工	342,200	920,518.00	0.62
24	600699	均胜电子	50,900	897,876.00	0.61
25	600998	九州通	82,397	855,280.86	0.58
26	603883	老百姓	28,600	853,710.00	0.58
27	601231	环旭电子	56,500	845,240.00	0.57
28	002249	大洋电机	148,100	844,170.00	0.57
29	600535	天士力	58,100	843,031.00	0.57
30	002244	滨江集团	94,500	833,490.00	0.56
31	600166	福田汽车	238,600	811,240.00	0.55
32	000709	河钢股份	356,300	805,238.00	0.54
33	000039	中集集团	116,400	801,996.00	0.54
34	688819	天能股份	21,121	778,097.64	0.52
35	002518	科士达	19,000	760,190.00	0.51
36	600517	国网英大	133,300	759,810.00	0.51
37	600500	中化国际	134,550	748,098.00	0.50
38	000878	云南铜业	67,500	745,875.00	0.50
39	600871	石化油服	376,300	745,074.00	0.50
40	002595	豪迈科技	21,200	744,756.00	0.50
41	603688	石英股份	6,400	728,576.00	0.49
42	300115	长盈精密	61,140	728,177.40	0.49
43	600985	淮北矿业	62,800	723,456.00	0.49
44	002429	兆驰股份	131,400	722,700.00	0.49
45	000967	盈峰环境	142,600	720,130.00	0.49
46	002025	航天电器	11,000	701,800.00	0.47

47	600521	华海药业	37,100	683,011.00	0.46
48	002223	鱼跃医疗	18,900	680,211.00	0.46
49	002511	中顺洁柔	61,000	680,150.00	0.46
50	603338	浙江鼎力	12,100	677,721.00	0.46
51	002439	启明星辰	22,700	675,552.00	0.46
52	600598	北大荒	50,200	669,166.00	0.45
53	603355	莱克电气	26,200	665,742.00	0.45
54	603228	景旺电子	25,800	661,770.00	0.45
55	000012	南玻 A	111,000	661,560.00	0.45
56	600968	海油发展	215,200	660,664.00	0.45
57	600667	太极实业	89,200	647,592.00	0.44
58	002065	东华软件	91,500	645,990.00	0.44
59	600418	江淮汽车	50,700	638,313.00	0.43
60	603868	飞科电器	10,100	637,209.00	0.43
61	002250	联化科技	59,300	620,278.00	0.42
62	601869	长飞光纤	16,200	599,562.00	0.40
63	300244	迪安诊断	23,300	597,179.00	0.40
64	600096	云天化	34,700	592,329.00	0.40
65	300073	当升科技	11,370	572,252.10	0.39
66	000400	许继电气	24,800	571,640.00	0.39
67	601992	金隅集团	260,200	567,236.00	0.38
68	000630	铜陵有色	195,500	564,995.00	0.38
69	601555	东吴证券	79,600	552,424.00	0.37
70	002373	千方科技	40,500	552,420.00	0.37
71	000783	长江证券	94,800	549,840.00	0.37
72	002266	浙富控股	132,100	545,573.00	0.37
73	600528	中铁工业	54,900	542,412.00	0.37
74	600764	中国海防	19,900	541,678.00	0.37
75	002080	中材科技	26,200	537,624.00	0.36
76	002745	木林森	57,800	531,760.00	0.36
77	600380	健康元	40,200	510,942.00	0.34
78	600967	内蒙一机	50,100	506,010.00	0.34
79	300363	博腾股份	17,000	503,030.00	0.34
80	600271	航天信息	36,600	501,054.00	0.34
81	600153	建发股份	45,900	500,769.00	0.34
82	603056	德邦股份	32,400	499,608.00	0.34
83	000050	深天马 A	54,201	497,565.18	0.34
84	601958	金钼股份	43,300	482,795.00	0.33
85	000559	万向钱潮	85,500	465,975.00	0.31
86	002831	裕同科技	19,000	463,410.00	0.31
87	002078	太阳纸业	43,200	461,808.00	0.31
88	600315	上海家化	15,910	461,549.10	0.31
89	000060	中金岭南	96,500	458,375.00	0.31

90	603233	大参林	15,840	443,678.40	0.30
91	002966	苏州银行	67,500	442,125.00	0.30
92	002683	广东宏大	15,000	441,600.00	0.30
93	601058	赛轮轮胎	38,700	440,793.00	0.30
94	002384	东山精密	16,800	435,120.00	0.29
95	603737	三棵树	6,536	427,585.12	0.29
96	002572	索菲亚	24,300	423,306.00	0.29
97	000156	华数传媒	47,900	416,730.00	0.28
98	002563	森马服饰	66,300	412,386.00	0.28
99	600511	国药股份	10,600	411,810.00	0.28
100	600863	内蒙华电	99,100	411,265.00	0.28
101	001914	招商积余	26,700	401,835.00	0.27
102	600350	山东高速	63,000	401,310.00	0.27
103	002092	中泰化学	62,200	401,190.00	0.27
104	601966	玲珑轮胎	17,700	393,294.00	0.27
105	601128	常熟银行	57,500	392,150.00	0.26
106	600377	宁沪高速	39,800	391,234.00	0.26
107	300146	汤臣倍健	16,200	388,476.00	0.26
108	600597	光明乳业	36,300	377,520.00	0.25
109	600372	中航电子	24,866	377,465.88	0.25
110	601997	贵阳银行	73,100	377,196.00	0.25
111	603596	伯特利	4,700	372,522.00	0.25
112	002128	电投能源	28,000	370,160.00	0.25
113	000009	中国宝安	30,500	368,135.00	0.25
114	603127	昭衍新药	9,000	368,100.00	0.25
115	002465	海格通信	35,500	367,070.00	0.25
116	002705	新宝股份	20,345	366,820.35	0.25
117	600637	东方明珠	46,900	366,758.00	0.25
118	600498	烽火通信	18,000	366,660.00	0.25
119	603858	步长制药	17,800	366,502.00	0.25
120	300001	特锐德	17,500	363,650.00	0.25
121	300037	新宙邦	7,000	363,230.00	0.24
122	603712	七一二	12,000	362,520.00	0.24
123	601000	唐山港	102,400	361,472.00	0.24
124	600970	中材国际	28,300	360,825.00	0.24
125	600901	江苏金租	87,360	360,796.80	0.24
126	600329	达仁堂	8,000	359,120.00	0.24
127	688567	孚能科技	16,623	358,890.57	0.24
128	600673	东阳光	49,600	357,616.00	0.24
129	600141	兴发集团	16,000	355,520.00	0.24
130	300136	信维通信	17,700	355,416.00	0.24
131	002138	顺络电子	14,800	353,868.00	0.24
132	002739	万达电影	28,200	353,628.00	0.24

133	002203	海亮股份	29,400	353,094.00	0.24
134	603939	益丰药房	9,520	352,240.00	0.24
135	000031	大悦城	94,800	346,968.00	0.23
136	000869	张裕 A	11,300	346,458.00	0.23
137	002299	圣农发展	17,900	342,785.00	0.23
138	603026	胜华新材	5,700	337,725.00	0.23
139	000932	华菱钢铁	70,500	336,285.00	0.23
140	002532	天山铝业	54,800	328,252.00	0.22
141	603589	口子窖	6,400	315,840.00	0.21
142	601991	大唐发电	94,200	311,802.00	0.21
143	600765	中航重机	11,700	310,167.00	0.21
144	601928	凤凰传媒	27,200	310,080.00	0.21
145	002156	通富微电	13,600	307,360.00	0.21
146	601666	平煤股份	40,600	306,124.00	0.21
147	600398	海澜之家	44,200	304,096.00	0.21
148	300482	万孚生物	11,200	298,256.00	0.20
149	603225	新风鸣	26,100	288,405.00	0.19
150	600487	亨通光电	19,500	285,870.00	0.19
151	000750	国海证券	85,200	285,420.00	0.19
152	600167	联美控股	40,800	284,376.00	0.19
153	000930	中粮科技	35,092	284,245.20	0.19
154	601233	桐昆股份	21,300	282,225.00	0.19
155	002340	格林美	40,800	281,928.00	0.19
156	002326	永太科技	18,400	281,336.00	0.19
157	000553	安道麦 A	33,100	279,364.00	0.19
158	600481	双良节能	19,800	276,804.00	0.19
159	002030	达安基因	27,600	275,172.00	0.19
160	002081	金螳螂	61,000	275,110.00	0.19
161	002385	大北农	41,600	274,560.00	0.19
162	002019	亿帆医药	18,800	274,480.00	0.19
163	600282	南钢股份	81,400	274,318.00	0.18
164	000898	鞍钢股份	98,600	274,108.00	0.18
165	300438	鹏辉能源	5,600	269,024.00	0.18
166	600131	国网信通	13,300	268,527.00	0.18
167	603529	爱玛科技	8,300	267,426.00	0.18
168	002468	申通快递	24,700	267,254.00	0.18
169	300308	中际旭创	1,800	265,410.00	0.18
170	300070	碧水源	49,500	265,320.00	0.18
171	603160	汇顶科技	5,700	263,625.00	0.18
172	600801	华新水泥	21,300	263,055.00	0.18
173	301029	怡合达	5,764	257,535.52	0.17
174	601168	西部矿业	23,600	248,036.00	0.17
175	600109	国金证券	28,600	247,962.00	0.17

176	002185	华天科技	26,500	243,800.00	0.16
177	000623	吉林敖东	15,000	240,600.00	0.16
178	600489	中金黄金	23,000	237,590.00	0.16
179	600258	首旅酒店	12,500	236,875.00	0.16
180	601098	中南传媒	20,100	233,160.00	0.16
181	000591	太阳能	32,700	221,706.00	0.15
182	603786	科博达	3,100	203,670.00	0.14
183	300832	新产业	3,400	200,600.00	0.14
184	002568	百润股份	5,400	196,290.00	0.13
185	600161	天坛生物	7,100	192,765.00	0.13
186	300888	稳健医疗	4,540	189,181.80	0.13
187	002531	天顺风能	12,300	187,329.00	0.13
188	000513	丽珠集团	4,629	180,114.39	0.12
189	600299	安迪苏	22,500	179,325.00	0.12
190	600873	梅花生物	19,700	175,921.00	0.12
191	600352	浙江龙盛	18,700	174,845.00	0.12
192	600298	安琪酵母	4,800	173,808.00	0.12
193	600062	华润双鹤	9,900	172,458.00	0.12
194	000027	深圳能源	26,040	171,603.60	0.12
195	000728	国元证券	26,300	171,476.00	0.12
196	300373	扬杰科技	4,200	170,394.00	0.11
197	000933	神火股份	13,000	169,000.00	0.11
198	600808	马钢股份	64,900	166,793.00	0.11
199	688002	睿创微纳	3,723	166,790.40	0.11
200	002152	广电运通	14,000	164,080.00	0.11
201	601077	渝农商行	44,000	157,960.00	0.11
202	000703	恒逸石化	21,800	147,804.00	0.10
203	002032	苏泊尔	2,900	145,000.00	0.10
204	300724	捷佳伟创	1,200	134,820.00	0.09
205	601108	财通证券	17,800	128,872.00	0.09
206	300861	美畅股份	2,900	125,773.00	0.08
207	000830	鲁西化工	11,500	121,440.00	0.08
208	002625	光启技术	7,600	115,976.00	0.08
209	688390	固德威	680	113,464.80	0.08
210	002500	山西证券	19,800	110,484.00	0.07
211	600497	驰宏锌锗	21,700	108,934.00	0.07
212	000887	中鼎股份	8,100	106,029.00	0.07
213	300017	网宿科技	14,300	101,673.00	0.07
214	002867	周大生	5,400	96,012.00	0.06
215	300058	蓝色光标	9,900	95,733.00	0.06
216	600663	陆家嘴	9,500	93,765.00	0.06
217	002463	沪电股份	4,200	87,948.00	0.06
218	600566	济川药业	3,000	87,120.00	0.06

219	002368	太极股份	2,100	86,457.00	0.06
220	603638	艾迪精密	4,200	86,184.00	0.06
221	003035	南网能源	12,100	86,152.00	0.06
222	688099	晶晨股份	1,000	84,320.00	0.06
223	300776	帝尔激光	1,280	83,072.00	0.06
224	600435	北方导航	7,200	82,728.00	0.06
225	000021	深科技	4,100	81,959.00	0.06
226	600118	中国卫星	2,900	81,809.00	0.06
227	603816	顾家家居	2,100	80,115.00	0.05
228	300212	易华录	2,400	79,752.00	0.05
229	002850	科达利	600	79,350.00	0.05
230	600536	中国软件	1,690	79,227.20	0.05
231	603267	鸿远电子	1,200	78,360.00	0.05
232	601298	青岛港	11,200	78,064.00	0.05
233	000807	云铝股份	6,100	77,653.00	0.05
234	002791	坚朗五金	1,200	77,652.00	0.05
235	002273	水晶光电	6,500	77,610.00	0.05
236	000563	陕国投 A	25,400	77,470.00	0.05
237	002690	美亚光电	3,000	77,250.00	0.05
238	000683	远兴能源	10,700	76,933.00	0.05
239	601636	旗滨集团	8,900	76,718.00	0.05
240	600885	宏发股份	2,400	76,440.00	0.05
241	002372	伟星新材	3,700	75,998.00	0.05
242	001872	招商港口	4,400	75,988.00	0.05
243	002508	老板电器	3,000	75,870.00	0.05
244	600160	巨化股份	5,500	75,790.00	0.05
245	300568	星源材质	4,400	75,636.00	0.05
246	000581	威孚高科	4,800	75,600.00	0.05
247	300699	光威复材	2,441	75,304.85	0.05
248	600827	百联股份	5,600	74,872.00	0.05
249	002028	思源电气	1,600	74,752.00	0.05
250	300144	宋城演艺	6,000	74,400.00	0.05
250	600516	方大炭素	12,000	74,400.00	0.05
251	002797	第一创业	13,000	74,360.00	0.05
252	600409	三友化工	13,600	74,120.00	0.05
253	300285	国瓷材料	2,700	73,980.00	0.05
254	300296	利亚德	11,300	73,789.00	0.05
255	002192	融捷股份	1,100	73,513.00	0.05
256	688116	天奈科技	1,600	73,200.00	0.05
257	600369	西南证券	20,000	73,000.00	0.05
258	000959	首钢股份	20,800	72,800.00	0.05
259	002624	完美世界	4,300	72,627.00	0.05
260	601718	际华集团	24,300	72,171.00	0.05

261	000155	川能动力	5,000	72,000.00	0.05
261	600008	首创环保	25,000	72,000.00	0.05
262	000629	钒钛股份	18,300	71,553.00	0.05
263	600859	王府井	3,600	71,244.00	0.05
264	002497	雅化集团	4,000	71,120.00	0.05
265	000831	中国稀土	2,400	71,040.00	0.05
266	600848	上海临港	5,900	70,505.00	0.05
267	300677	英科医疗	3,200	70,400.00	0.05
268	600399	抚顺特钢	6,900	70,380.00	0.05
269	600486	扬农化工	800	69,936.00	0.05
270	000987	越秀资本	11,000	69,850.00	0.05
271	603866	桃李面包	6,900	69,828.00	0.05
272	600956	新天绿能	8,000	69,760.00	0.05
273	600195	中牧股份	5,900	68,912.00	0.05
274	002294	信立泰	2,200	68,618.00	0.05
275	002653	海思科	2,900	68,440.00	0.05
276	603379	三美股份	2,900	68,179.00	0.05
277	002155	湖南黄金	5,500	67,100.00	0.05
278	600867	通化东宝	6,400	66,816.00	0.05
279	603456	九洲药业	2,400	65,712.00	0.04
280	688777	中控技术	1,045	65,605.10	0.04
281	300026	红日药业	12,100	65,582.00	0.04
282	688185	康希诺	800	65,200.00	0.04
283	600348	华阳股份	8,100	64,071.00	0.04
284	603218	日月股份	3,300	62,667.00	0.04
285	688690	纳微科技	1,600	62,160.00	0.04
286	300357	我武生物	1,800	60,534.00	0.04
287	300558	贝达药业	1,100	52,833.00	0.04
288	603444	吉比特	100	49,111.00	0.03
289	600549	厦门钨业	1,900	36,157.00	0.02
290	603317	天味食品	2,100	30,681.00	0.02
291	002010	传化智联	3,600	19,152.00	0.01
292	600157	永泰能源	12,900	18,318.00	0.01
293	002131	利欧股份	5,300	12,190.00	0.01
294	002738	中矿资源	120	6,112.80	0.00
295	002507	涪陵榨菜	34	622.54	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	601607	上海医药	43,500	974,835.00	0.66
2	603613	国联股份	16,385	605,098.05	0.41
3	000961	中南建设	304,600	478,222.00	0.32
4	300532	今天国际	21,000	431,760.00	0.29
5	300226	上海钢联	12,720	412,128.00	0.28
6	002478	常宝股份	55,300	411,985.00	0.28
7	600050	中国联通	85,500	410,400.00	0.28
8	600376	首开股份	104,800	408,720.00	0.28
9	002126	银轮股份	22,300	394,710.00	0.27
10	600761	安徽合力	19,200	382,656.00	0.26
11	002048	宁波华翔	27,800	372,520.00	0.25
12	002434	万里扬	41,300	369,635.00	0.25
13	000768	中航西飞	13,800	369,150.00	0.25
14	603368	柳药集团	14,800	365,708.00	0.25
15	601226	华电重工	46,600	365,344.00	0.25
16	603298	杭叉集团	15,500	365,025.00	0.25
17	601766	中国中车	55,900	363,350.00	0.24
18	002335	科华数据	10,100	363,095.00	0.24
19	000682	东方电子	37,300	362,556.00	0.24
20	601038	一拖股份	29,900	351,026.00	0.24
21	601601	中国太保	13,400	348,132.00	0.23
22	000759	中百集团	76,900	346,819.00	0.23
23	002475	立讯精密	10,300	334,235.00	0.23
24	300463	迈克生物	22,100	334,152.00	0.23
25	000028	国药一致	7,540	328,819.40	0.22
26	600795	国电电力	81,700	312,911.00	0.21
27	603719	良品铺子	12,500	312,625.00	0.21
28	000921	海信家电	11,100	299,145.00	0.20
29	002840	华统股份	18,900	295,596.00	0.20
30	000048	京基智农	15,100	294,752.00	0.20
31	300577	开润股份	18,000	293,220.00	0.20
32	603551	奥普家居	22,400	289,632.00	0.20
33	002158	汉钟精机	11,300	282,048.00	0.19
34	300396	迪瑞医疗	8,600	279,414.00	0.19
35	600007	中国国贸	15,000	277,800.00	0.19
36	603556	海兴电力	11,000	277,640.00	0.19
37	002391	长青股份	40,400	277,548.00	0.19
38	603899	晨光股份	6,000	267,840.00	0.18
39	300377	赢时胜	33,000	267,300.00	0.18
40	601318	中国平安	5,700	264,480.00	0.18
41	603309	维力医疗	16,700	258,349.00	0.17
42	002987	京北方	11,600	254,272.00	0.17
43	600031	三一重工	14,700	244,461.00	0.16

44	600030	中信证券	12,100	239,338.00	0.16
45	002011	盾安环境	13,200	182,556.00	0.12
46	605266	健之佳	2,100	176,043.00	0.12
47	600551	时代出版	15,500	171,275.00	0.12
48	002938	鹏鼎控股	6,959	169,034.11	0.11
49	688502	茂莱光学	823	146,979.57	0.10
50	601811	新华文轩	9,600	135,936.00	0.09
51	002149	西部材料	7,900	132,641.00	0.09
52	002130	沃尔核材	15,900	129,108.00	0.09
53	002371	北方华创	400	127,060.00	0.09
54	002976	瑞玛精密	4,400	123,068.00	0.08
55	600028	中国石化	19,100	121,476.00	0.08
56	601163	三角轮胎	7,600	120,612.00	0.08
57	002937	兴瑞科技	4,900	120,540.00	0.08
58	300697	电工合金	9,900	118,602.00	0.08
59	603630	拉芳家化	7,400	118,178.00	0.08
60	603878	武进不锈	13,900	117,455.00	0.08
61	605077	华康股份	4,400	116,512.00	0.08
62	300750	宁德时代	500	114,395.00	0.08
63	002179	中航光电	2,500	113,375.00	0.08
64	600016	民生银行	28,000	105,000.00	0.07
65	301162	国能日新	1,120	88,345.60	0.06
66	003033	征和工业	2,400	84,240.00	0.06
67	600933	爱柯迪	3,600	83,844.00	0.06
68	002869	金溢科技	3,800	83,524.00	0.06
69	300952	恒辉安防	3,700	83,472.00	0.06
70	605068	明新旭腾	3,400	83,164.00	0.06
71	603701	德宏股份	5,800	82,302.00	0.06
72	603595	东尼电子	1,900	81,358.00	0.05
73	600525	长园集团	13,800	81,144.00	0.05
74	600026	中远海能	6,400	80,896.00	0.05
75	301179	泽宇智能	2,400	80,880.00	0.05
76	002805	丰元股份	3,640	78,915.20	0.05
77	603008	喜临门	3,100	78,058.00	0.05
78	002918	蒙娜丽莎	5,000	77,200.00	0.05
79	601872	招商轮船	12,800	74,112.00	0.05
80	300996	普联软件	2,400	73,680.00	0.05
81	603992	松霖科技	4,800	73,632.00	0.05
82	002124	天邦食品	16,000	72,640.00	0.05
83	688560	明冠新材	2,600	72,254.00	0.05
84	600307	酒钢宏兴	46,600	72,230.00	0.05
85	603778	乾景园林	13,300	71,820.00	0.05
86	002242	九阳股份	4,800	71,760.00	0.05

87	300376	易事特	10,700	71,690.00	0.05
88	002727	一心堂	2,700	71,280.00	0.05
89	300777	中简科技	1,500	70,890.00	0.05
90	603998	方盛制药	5,600	70,616.00	0.05
91	300769	德方纳米	640	70,547.20	0.05
92	300035	中科电气	5,800	69,716.00	0.05
93	002343	慈文传媒	9,100	68,978.00	0.05
94	600917	重庆燃气	10,100	68,680.00	0.05
95	603681	永冠新材	4,800	68,544.00	0.05
96	600201	生物股份	7,200	68,472.00	0.05
97	301153	中科江南	900	67,464.00	0.05
98	300203	聚光科技	3,300	66,891.00	0.05
99	301360	荣旗科技	636	65,574.56	0.04
100	601398	工商银行	13,300	64,106.00	0.04
101	300767	震安科技	2,500	63,400.00	0.04
102	603605	珀莱雅	560	62,944.00	0.04
103	601699	潞安环能	3,800	62,016.00	0.04
104	301486	致尚科技	1,051	60,600.66	0.04
105	688711	宏微科技	1,000	58,340.00	0.04
106	301488	豪恩汽电	1,346	53,543.88	0.04
107	301292	海科新源	2,601	51,993.99	0.04
108	301332	德尔玛	3,438	48,936.38	0.03
109	688581	安杰思	389	47,474.67	0.03
110	000333	美的集团	800	47,136.00	0.03
111	001218	丽臣实业	2,000	45,220.00	0.03
112	688603	天承科技	765	42,075.00	0.03
113	002956	西麦食品	2,500	39,075.00	0.03
114	301261	恒工精密	986	36,383.40	0.02
115	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.02
116	301202	朗威股份	1,330	34,340.60	0.02
117	688639	华恒生物	347	31,396.56	0.02
118	002318	久立特材	1,200	20,436.00	0.01
119	601688	华泰证券	1,400	19,278.00	0.01
120	301018	申菱环境	451	16,231.49	0.01
121	001367	海森药业	296	13,308.68	0.01
122	301293	三博脑科	157	11,212.94	0.01
123	301419	阿莱德	254	11,137.90	0.01
124	688472	阿特斯	626	10,667.04	0.01
125	688398	赛特新材	283	9,664.45	0.01
126	301320	豪江智能	467	9,629.54	0.01
127	301301	川宁生物	1,055	9,452.80	0.01
128	688361	中科飞测	143	9,247.81	0.01
129	001230	劲旅环境	375	9,191.25	0.01

130	688469	中芯集成	1,691	9,148.31	0.01
131	301358	湖南裕能	210	9,006.90	0.01
132	002017	东信和平	650	8,521.50	0.01
133	301325	曼恩斯特	78	8,420.10	0.01
134	688629	华丰科技	413	7,677.67	0.01
135	301015	百洋医药	275	7,634.00	0.01
136	688562	航天软件	305	6,804.55	0.00
137	688582	芯动联科	164	6,671.52	0.00
138	301315	威士顿	130	6,645.60	0.00
139	301408	华人健康	390	6,610.50	0.00
140	301295	美硕科技	155	5,590.85	0.00
141	688620	安凯微	449	5,540.66	0.00
142	688458	美芯晟	61	5,536.36	0.00
143	688593	新相微	379	5,529.61	0.00
144	301246	宏源药业	180	5,527.80	0.00
145	688543	国科军工	103	5,464.15	0.00
146	301141	中科磁业	125	5,336.25	0.00
147	688523	航天环宇	221	5,270.85	0.00
148	301296	新巨丰	305	5,148.40	0.00
149	688334	西高院	304	4,927.84	0.00
150	301322	绿通科技	89	4,738.36	0.00
151	301157	华塑科技	87	4,604.91	0.00
152	301170	锡南科技	131	4,575.83	0.00
153	301305	朗坤环境	230	4,528.70	0.00
154	301376	致欧科技	200	4,502.00	0.00
155	688570	天玛智控	177	4,483.41	0.00
156	301355	南王科技	264	4,422.00	0.00
157	301428	世纪恒通	143	4,375.80	0.00
158	300804	广康生化	132	4,352.04	0.00
159	001287	中电港	207	4,351.14	0.00
160	688512	慧智微	227	4,349.32	0.00
161	688429	时创能源	170	4,340.10	0.00
162	301357	北方长龙	89	4,306.71	0.00
163	301232	飞沃科技	70	4,089.40	0.00
164	301323	新莱福	100	3,936.00	0.00
165	301373	凌玮科技	118	3,758.30	0.00
166	301439	泓淋电力	219	3,701.10	0.00
167	301386	未来电器	152	3,616.08	0.00
168	688631	莱斯信息	119	3,554.53	0.00
169	301337	亚华电子	116	3,522.92	0.00
170	301203	国泰环保	101	3,474.40	0.00
171	688623	双元科技	40	3,471.60	0.00
172	688479	友车科技	108	3,184.92	0.00

173	688193	仁度生物	71	3,058.68	0.00
174	001380	华纬科技	91	2,800.98	0.00
175	301345	涛涛车业	57	2,658.48	0.00
176	002603	以岭药业	100	2,569.00	0.00
177	301101	明月镜片	50	2,051.50	0.00
178	001282	三联锻造	55	1,816.65	0.00
179	001328	登康口腔	69	1,758.81	0.00
180	603172	万丰股份	105	1,693.65	0.00
181	001324	长青科技	75	1,470.00	0.00
182	001360	南矿集团	89	1,323.43	0.00
183	301193	家联科技	60	1,051.80	0.00
184	000540	*ST 中天	95,300	953.00	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	000729	燕京啤酒	2,695,322.00	2.14
2	300144	宋城演艺	2,573,248.00	2.05
3	600535	天士力	2,482,154.00	1.98
4	002078	太阳纸业	2,346,884.00	1.87
5	002250	联化科技	2,332,626.00	1.86
6	601139	深圳燃气	2,326,633.00	1.85
7	603355	莱克电气	2,264,445.60	1.80
8	601717	郑煤机	2,251,525.00	1.79
9	002353	杰瑞股份	2,220,069.00	1.77
10	002690	美亚光电	2,208,898.40	1.76
11	600038	中直股份	2,180,450.00	1.74
12	601699	潞安环能	2,147,174.74	1.71
13	601869	长飞光纤	2,043,132.00	1.63
14	600699	均胜电子	1,995,290.00	1.59
15	603737	三棵树	1,926,097.00	1.53
16	603868	飞科电器	1,915,073.00	1.52
17	600376	首开股份	1,856,225.00	1.48
18	002738	中矿资源	1,813,722.00	1.44
19	300009	安科生物	1,790,397.00	1.42
20	601128	常熟银行	1,786,808.00	1.42

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	300308	中际旭创	4,369,814.00	3.48
2	002384	东山精密	3,113,136.00	2.48
3	601699	潞安环能	3,066,453.90	2.44
4	002705	新宝股份	3,050,041.00	2.43
5	300144	宋城演艺	3,036,969.00	2.42
6	000999	华润三九	2,768,835.90	2.20
7	300073	当升科技	2,707,958.00	2.15
8	600160	巨化股份	2,693,116.00	2.14
9	002465	海格通信	2,558,016.00	2.04
10	002273	水晶光电	2,404,738.00	1.91
11	002430	杭氧股份	2,334,681.00	1.86
12	000739	普洛药业	2,329,572.00	1.85
13	002690	美亚光电	2,159,696.70	1.72
14	603355	莱克电气	2,086,618.00	1.66
15	002444	巨星科技	2,056,715.00	1.64
16	600535	天士力	2,036,993.00	1.62
17	002831	裕同科技	2,021,566.00	1.61
18	300888	稳健医疗	1,980,420.06	1.58
19	601607	上海医药	1,980,089.42	1.58
20	600566	济川药业	1,977,016.00	1.57

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	370,276,822.47
卖出股票收入（成交）总额	357,960,519.79

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）	741,243.44	0.50
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	741,243.44	0.50

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	113063	赛轮转债	1,030	141,283.52	0.10
2	127058	科伦转债	580	109,603.79	0.07
3	113062	常银转债	900	102,687.02	0.07
4	123158	宙邦转债	605	83,993.84	0.06
5	113659	莱克转债	580	68,370.96	0.05

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，有选择地投资于流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金在进行股指期货投资时，首先将基于对证券市场总体行情的判断和组合风险收益的分析确定投资时机，并根据风险资产投资（或拟投资）的总体规模和风险系数决定股指期货的投资比例；其次，本基金将在综合考虑证券市场和期货市场运行趋势以及股指期货流动性、收益性、风险特征和估值水平的基础上进行投资品种选择，以对冲风险资产组合的系统性风险和流动性风险。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

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

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

报告期内基金投资的前十名证券除巨星科技（证券代码 002444）、深圳燃气（证券代码 601139）、天地科技（证券代码 600582）、卧龙电驱（证券代码 600580）、燕京啤酒（证券代码 000729）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、巨星科技（证券代码 002444）

根据 2022 年 9 月 21 日发布的相关公告，该证券发行人因行贿受贿被海后采购供应局列入不良行为记录名单，暂停或取消相关资格。

2、深圳燃气（证券代码 601139）

根据 2023 年 3 月 20 日发布的相关公告，该证券发行人因未依法履行职责被深圳市交通运输局处以罚款。

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。

4、卧龙电驱（证券代码 600580）

根据 2023 年 1 月 20 日发布的相关公告，该证券发行人因未依法履行职责被宁波海事局处以罚款。

5、燕京啤酒（证券代码 000729）

根据 2022 年 9 月 5 日发布的相关公告，该证券发行人因涉嫌违反法律法规被北京市顺义区住房和城乡建设委员会处以罚款，并责令改正。

根据 2023 年 2 月 17 日发布的相关公告，该证券发行人因违反交通法规被顺义区交通局处以罚款，并责令停产停业。

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	755,488.78
2	应收清算款	90,684.39
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	103,221.07
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	949,394.24

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	113063	赛轮转债	141,283.52	0.10
2	127058	科伦转债	109,603.79	0.07
3	113062	常银转债	102,687.02	0.07
4	123158	宙邦转债	83,993.84	0.06
5	113659	莱克转债	68,370.96	0.05
6	127025	冀东转债	41,452.77	0.03
7	110088	淮 22 转债	26,679.34	0.02

8	127024	盈峰转债	23,140.68	0.02
9	123114	三角转债	21,408.77	0.01
10	110082	宏发转债	17,024.94	0.01
11	110089	兴发转债	15,243.71	0.01
12	127036	三花转债	14,319.95	0.01
13	110076	华海转债	12,124.00	0.01
14	113045	环旭转债	2,339.93	0.00
15	127046	百润转债	1,966.42	0.00
16	123064	万孚转债	1,338.05	0.00
17	127020	中金转债	633.63	0.00
18	127073	天赐转债	370.48	0.00
19	127064	杭氧转债	308.60	0.00
20	128136	立讯转债	112.52	0.00

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
招商中证 500 指数增强 A	4,548	13,530.45	-	-	61,536,472.35	100.00%
招商中证 500 指数增强 C	4,102	12,738.88	8,478,276.13	16.22%	43,776,609.74	83.78%
合计	8,650	13,155.07	8,478,276.13	7.45%	105,313,082.09	92.55%

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

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	招商中证 500 指数增强 A	197,696.33	0.3213%
	招商中证 500 指数增强 C	1.00	0.0000%
	合计	197,697.33	0.1737%

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

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	招商中证 500 指数增强 A	0
	招商中证 500 指数增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	招商中证 500 指数增强 A	10~50
	招商中证 500 指数增强 C	0
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	招商中证 500 指数增强 A	招商中证 500 指数增强 C
基金合同生效日(2017 年 5 月 17 日)基金份额总额	124,892,139.37	208,016,852.96
本报告期期初基金份额总额	54,224,175.06	44,558,504.41
本报告期基金总申购份额	19,428,823.99	49,531,617.54
减：报告期基金总赎回份额	12,116,526.70	41,835,236.08
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	61,536,472.35	52,254,885.87

§ 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

根据本基金管理人 2023 年 6 月 22 日的公告，经招商基金管理有限公司第六届董事会 2023 年第四次会议审议通过，钟文岳先生离任公司常务副总经理、财务负责人职务。

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

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，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
第一创业	3	724,716,664.59	100.00%	95,162.06	100.00%	-
安信证券	6	-	-	-	-	-
财通证券	3	-	-	-	-	-
长城证券	3	-	-	-	-	-
长江证券	6	-	-	-	-	-

诚通证券	1	-	-	-	-	-
大通证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	4	-	-	-	-	-
东北证券	3	-	-	-	-	-
东方财富	3	-	-	-	-	-
东方证券	3	-	-	-	-	-
东海证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	6	-	-	-	-	-
东兴证券	3	-	-	-	-	-
方正证券	7	-	-	-	-	-
光大证券	3	-	-	-	-	-
广发证券	7	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	4	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	3	-	-	-	-	-
国信证券	3	-	-	-	-	-
国元证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	4	-	-	-	-	-
宏信证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	5	-	-	-	-	-
华宝证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	4	-	-	-	-	-
华金证券	4	-	-	-	-	-
华泰证券	4	-	-	-	-	-
华西证券	3	-	-	-	-	-
华鑫证券	2	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
九州证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	5	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	3	-	-	-	-	-
瑞信方正	2	-	-	-	-	-
山西证券	6	-	-	-	-	-
上海证券	2	-	-	-	-	-
申港证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
首创证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证	2	-	-	-	-	-

券						
天风证券	7	-	-	-	-	-
万和证券	1	-	-	-	-	-
五矿证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	5	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
粤开证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	5	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
中航证券	2	-	-	-	-	-
中金财富 证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	3	-	-	-	-	-
中泰证券	3	-	-	-	-	-
中信建投 证券	5	-	-	-	-	-
中信证券	6	-	-	-	-	-
中银国际 证券	4	-	-	-	-	-
甬兴证券	2	-	-	-	-	-

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
第一创业	2,000,200.00	100.00%	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
诚通证券	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-

德邦证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
九州证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
瑞信方正	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证 券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-

万和证券	-	-	-	-	-	-
五矿证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
中金财富 证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投 证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际 证券	-	-	-	-	-	-
甬兴证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	招商中证 500 指数增强型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-01-18
2	招商基金管理有限公司旗下基金 2022 年第 4 季度报告提示性公告	上海证券报及基金管理人网站	2023-01-18
3	招商中证 500 指数增强型证券投资基金 2022 年年度报告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-03-30
4	招商基金管理有限公司旗下基金 2022 年年度报告提示性公告	上海证券报及基金管理人网站	2023-03-30
5	招商基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 1 季度报告提示性公告	上海证券报及基金管理人网站	2023-04-21
6	招商中证 500 指数增强型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-04-21
7	招商基金管理有限公司关于旗下基金投资关联	上海证券报、基金管	2023-05-11

	方承销证券的公告	理人网站及中国证监会基金电子披露网站	
8	招商基金管理有限公司关于提醒投资者持续完善身份信息资料的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-05-12
9	招商中证 500 指数增强型证券投资基金更新的招募说明书（二零二三年第一号）	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-05-16
10	招商基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-05-16
11	招商中证 500 指数增强型证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要更新	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-05-16
12	招商中证 500 指数增强型证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要更新	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-05-16
13	招商基金管理有限公司关于旗下基金估值变更的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-06-14
14	招商基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-06-22

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
个人	1	20230106-20230221	-	29,418,595.64	29,418,595.64	-	-
产品特有风险							
本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况，可能会出现集中赎回甚至巨额赎回从而引发基金净值剧烈波动，甚至引发基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。							

注：报告期末持有份额占比按照四舍五入方法保留至小数点后第 2 位。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准设立招商基金管理有限公司的文件；
- 2、中国证券监督管理委员会批准招商中证 500 指数增强型证券投资基金设立的文件；
- 3、《招商中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 4、《招商中证 500 指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 5、《招商中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书》；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照。

12.2 存放地点

招商基金管理有限公司

地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

12.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人招商基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-887-9555

网址：<http://www.cmfcchina.com>

招商基金管理有限公司

2023 年 8 月 30 日