招商中证800自由现金流交易型开放式指数证券投资基金2026年中期报告

2026年06月30日

基金管理人：招商基金管理有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

送出日期：2026年8月31日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 1
1.1 重要提示 1
1.2 目录 2
§2 基金简介 4
2.1 基金基本情况 4
2.2 基金产品说明 4
2.3 基金管理人和基金托管人 5
2.4 信息披露方式 5
2.5 其他相关资料 5
§3 主要财务指标和基金净值表现 5
3.1 主要会计数据和财务指标 5
3.2 基金净值表现 6
§4 管理人报告 7
4.1 基金管理人及基金经理情况 7
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 10
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 10
§5 托管人报告 11
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 11
§6 半年度财务会计报告（未经审计） 11
6.1 资产负债表 11
6.2 利润表 13
6.3 净资产变动表 14
6.4 报表附注 15
§7 投资组合报告 40
7.1 期末基金资产组合情况 40
7.2 期末按行业分类的股票投资组合 41
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细 42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 46
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 46
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 46
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 47
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 47
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 47

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 47
7.12 投资组合报告附注 47
§8 基金份额持有人信息 48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 48
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 48
§9 开放式基金份额变动 49
§10 重大事件揭示 49
10.1 基金份额持有人大会决议 49
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 49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 49
10.4 基金投资策略的改变 49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 49
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 49
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况 50
10.8 其他重大事件 51
§11 备查文件目录 52
11.1 备查文件目录 52
11.2 存放地点 52
11.3 查阅方式 52

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	招商中证 800 自由现金流交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	招商中证 800 自由现金流 ETF
场内简称	800 现金流 ETF 招商
基金主代码	159119
交易代码	159119
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2025 年 11 月 3 日
基金管理人	招商基金管理有限公司
基金托管人	平安银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	162,054,229.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2025 年 11 月 13 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2%以内，年化跟踪误差控制在 2%以内。
投资策略	本基金采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份券组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份券及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情形导致基金无法完全投资于标的指数成份券时，基金管理人可采取包括成份券替代策略在内的其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到紧密跟踪标的指数的目的。特殊情形包括但不限于：（1）法律法规的限制；（2）标的指数成份券流动性严重不足；（3）标的指数的成份券长期停牌；（4）标的指数成份券进行配股或增发；（5）标的指数成份券派发现金股息；（6）标的指数编制方法发生变化；（7）其他可能严重限制本基金跟踪标的指数的合理原因等。 本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2%以内，年化跟踪误差控制在 2%以内。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。 对于出现市场流动性不足、或因法律法规原因使个别成份券被限制投资等情况，导致本基金无法获得足够数量的成份券时，基金管理人将通过投资成份券、备选成份券、非成份券、成份券衍生品等进行替代，运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近标的指数的表现。 本基金其他主要投资策略包括：债券投资策略、可转换债券和可交换债券投资策略、资产支持证券投资策略、衍生品投资策略、参与融资及转

	融通证券出借业务策略、存托凭证投资策略。
业绩比较基准	中证 800 自由现金流指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金。 本基金为被动式投资的股票型指数基金，采用完全复制策略跟踪标的指数的表现，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

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	平安银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	潘西里	潘琦
	联系电话	0755－83196666	0755-22168257
	电子邮箱	cmf@cmfchina.com	PANQI003@pingan.com.cn
客户服务电话		400-887-9555	95511-3
传真		0755－83196475	0755-82080387
注册地址		深圳市福田区深南大道 7088 号	广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号
办公地址		深圳市福田区深南大道 7088 号	广东省深圳市福田区益田路 5023 号平安金融中心 B 座
邮政编码		518040	518001
法定代表人		王颖	谢永林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.cmfchina.com
基金中期报告置备地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 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

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-3,034,455.34
本期利润	-23,792,513.04

加权平均基金份额本期利润	-0.1348
本期加权平均净值利润率	-12.68%
本期基金份额净值增长率	-10.39%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-15,622,802.55
期末可供分配基金份额利润	-0.0964
期末基金资产净值	146,431,426.45
期末基金份额净值	0.9036
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-8.36%

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

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

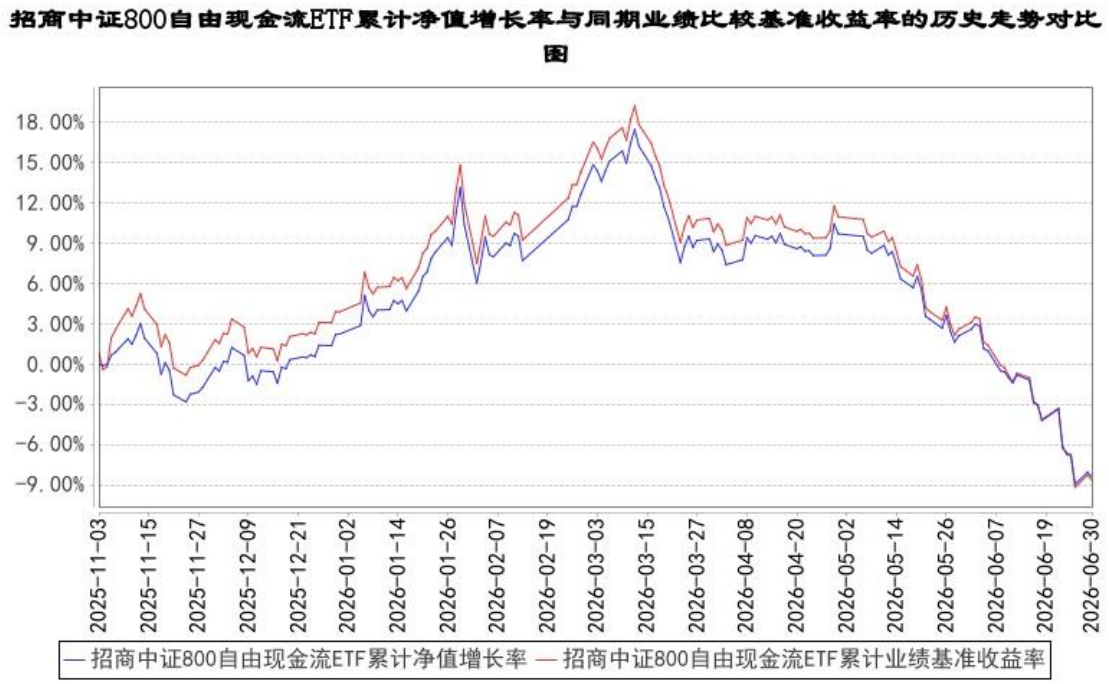
3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-15.44%	0.86%	-16.80%	0.88%	1.36%	-0.02%
过去六个月	-10.39%	1.09%	-12.04%	1.11%	1.65%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-8.36%	1.02%	-8.60%	1.06%	0.24%	-0.04%

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



注：本基金合同于 2025 年 11 月 3 日生效，截至本报告期末基金成立未满一年；自基金成立日起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
侯昊	本基金基金经理	2025 年 11 月 3 日	-	16	男，硕士。2009 年 7 月加入招商基金管理有限公司，曾任风险管理部风控经理，量化投资部助理投资经理、投资经理，招商深证 100 指数证券投资基金、招商央视财经 50 指数证券投资基金、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、招商中证新能源汽车指数型证券投资基金、招商中证物联网主题交易型开放式指数证券投资基金、招商国证食品饮料行业交易型开放式指数证券投资基金、招商上证港股通交易型开放式指数证券投资基金、招商中证疫苗与生物技术交易型开放式指数证券投资基金、招商中证沪港深消费龙头交易型开放式指数证券投资基金基金经理，现任指数产品管理事业部总经理兼招商中证白酒指数证券投资基金、招商国证生物医药指数证券投资基金、招商中证银行指数证券投资基金、招商中证消费龙头指数增强型证券投资基金、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、招商中证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金、招商中证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金、招商中证上海环交所碳中和交易型开放式指数证券投资基金、招商中证上海环交所碳中和交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、招商上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金联接基金、招商国证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金、招商中证 800 自由现金流交易型开放式指数证券投资基金、招商创业板人工智能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
侯昊	公募基金	14	44,338,623,751.18	2017 年 8 月 22 日
	私募资产管理计划	1	29,388,750.50	2012 年 3 月 5 日

	其他组合	3	21,326,066,463.46	2018年8月2日
	合计	18	65,694,078,965.14	-

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，本基金各项交易均严格按照相关法律法规、基金合同的有关要求执行，公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易共有15次，为旗下指数及量化等组合因投资策略需要而发生反向交易。报告期内未发现有可能导致不公平交易和利益输送的重大异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年中国经济呈现弱复苏、强结构的 K 型分化格局，经济增长动能主要来自出口和高端制造，消费及房地产投资依然疲弱；报告期内 A 股市场主要宽基指数普遍上涨，成交额显著提升，市场活跃度相对较高，同时风格及行业走势分化显著，申万一级行业中电子、通信、建筑材料大幅领涨，商贸零售、农林牧渔、美容护理等行业回调幅度较大。800 现金流 2026 年上半年下跌 12.04%，关于本基金的运作，仓位维持在 99%左右的水平，基本完成了对基准的跟踪。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金份额净值增长率为-10.39%，同期业绩基准增长率为-12.04%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年宏观经济有望延续温和修复态势，出口仍有支撑，内需方面关注增量政策落地及消费低位修复情况。A 股整体盈利改善趋势延续，市场总体有望呈现宽幅震荡，同时波动明显加大，在聚焦科技景气主线的同时需警惕阶段性拥挤度过高，关注风格再平衡下低位板块修复机会。800 现金流指数目前具有较高配置价值，长期看来是稳健配置的重要选择，过去一段时间由于成长板块极致行情演绎，在重新再平衡过程中，800 现金流指数有可能受益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内实施的利润分配金额为 2,745,806.48 元，符合相关法规及基金合同的约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，托管人在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

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

本托管人依法对管理人编制和披露的本报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：招商中证 800 自由现金流交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	3,584,511.66	3,874,731.98
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	144,685,205.35	165,954,808.96
其中：股票投资		144,627,202.81	165,954,808.96
基金投资		-	-

债券投资		58,002.54	-
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		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		148,269,717.01	169,829,540.94
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		1,674,197.70	2,012,718.44
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		20,761.03	23,502.51
应付托管费		6,920.34	7,834.18
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	136,411.49	27,684.93
负债合计		1,838,290.56	2,071,740.06
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	162,054,229.00	164,054,229.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-15,622,802.55	3,703,571.88
净资产合计		146,431,426.45	167,757,800.88
负债和净资产总计		148,269,717.01	169,829,540.94

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.9036 元，基金份额总额 162,054,229.00 份。

6.2 利润表

会计主体：招商中证 800 自由现金流交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-23,471,636.31
1.利息收入		1,515.90
其中：存款利息收入	6.4.7.9	1,515.90
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）		-3,004,328.45
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-4,986,264.83
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	2.54
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	-
股利收益	6.4.7.15	1,981,933.84
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	-20,758,057.70
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	289,233.94
减：二、营业总支出		320,876.73
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	140,079.07
其中：暂估管理人报酬		-
2.托管费	6.4.10.2.2	46,693.03

3.销售服务费		-
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		-
8.其他费用	6.4.7.19	134,104.63
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-23,792,513.04
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-23,792,513.04
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-23,792,513.04

6.3 净资产变动表

会计主体：招商中证 800 自由现金流交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	164,054,229.00	-	3,703,571.88	167,757,800.88
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	164,054,229.00	-	3,703,571.88	167,757,800.88
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-2,000,000.00	-	-19,326,374.43	-21,326,374.43
（一）、综合收益总额	-	-	-23,792,513.04	-23,792,513.04
（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）	-2,000,000.00	-	7,211,945.09	5,211,945.09
其中：1.基金申购款	130,000,000.00	-	11,493,219.86	141,493,219.86
2.基金赎回	-132,000,000.00	-	-4,281,274.77	-136,281,274.77

款				
（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）	-	-	-2,745,806.48	-2,745,806.48
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	162,054,229.00	-	-15,622,802.55	146,431,426.45

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

____钟文岳___ ____欧志明_____ ____何剑萍____

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

招商中证 800 自由现金流交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人招商基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《招商中证 800 自由现金流交易型开放式指数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[2025]564 号文准予公开募集注册。本基金为交易型开放式基金，存续期限为不定期。本基金首次设立募集基金份额为 266,054,229.00 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(25)第 00364 号验资报告。《招商中证 800 自由现金流交易型开放式指数证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)于 2025 年 11 月 3 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，基金托管人为平安银行股份有限公司(以下简称“平安银行”)。

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 800 自由现金流交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份券(含存托凭证，下同)和备选成份券(含存托凭证，下同)。为更好地实现基金的投资目标，本基金可少量投资于非成份券(包括主板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票和存托凭证)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券(含可分离交易可转债)、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、货币市场工具、同业存单、债券回购、资产支持证券、银行存款、股指期货、国债期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金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。基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份券和备选成份券的资产比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。股指期货、国债期货和股票期权的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如法律法规或中国证监会以后允许基金投资其他品种或变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围或调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为：中证 800 自由现金流指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)、中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本基金上年度可比期间为自 2025 年 11 月 3 日(基金合同生效日)至 2025 年 12 月 31 日止期间。

6.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1)金融资产的分类

根据本基金的金融资产业务模式和金融资产的合同现金流量特征，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产，暂无金融资产划分为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

金融资产的合同条款规定在特定日期产生的现金流量仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付，且本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标，则本基金将该金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产。此类金融资产主要包括货币资金、各类应收款项、买入返售金融资产等。

不符合分类为以摊余成本计量的金融资产以及公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产条件的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产计入“衍生金融资产”外，其他以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产计入“交易性金融资产”。

2)金融负债的分类

本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。对于以常规方式购买或出售金融资产的，在交易日确认将收到的资产和为此将承担的负债，或者在交易日终止确认已出售的资产。金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券或资产支持证券已到付息期但尚未领取的利息，单独确认为应收项目。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失以及与该金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，发生减值或终止确认产生的利得或损失，计入当期损益。

本基金对分类为以摊余成本计量的金融资产以预期信用损失为基础确认损失准备。除购买或源生的已发生信用减值的金融资产外，本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后的变动情况。若该金融工具的信用风险自初始确认后已显著增加，本基金按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备；若该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加，本基金按照相当于该金融工具未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备。信用损失准备的增加或转回金额，作为减值损失或利得计入当期损益。

本基金在前一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形的，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

本基金利用可获得的合理且有依据的前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止、该金融资产已转移且其所有权上几乎所有的风险和报酬已转移或虽然既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是未保留对该金融资产的控制，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。若本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有风险和报酬，且保留了对该金融资产控制的，则按照其继续涉入被转移金融资产的程度继续确认该被转移金融资产，并相应确认相关负债。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价(包括转出的非现金资产或承担的新金融负债)之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，将其公允价值划分为三个层次。第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值是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；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值原则如下：

(1)对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市价不能真实反映公允价值的，应对市价进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2)当投资品种不存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

(3)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或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整，确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

1)利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

2)投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本与相关交易费用的差额确认。

债券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖债券价差收入。除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发

行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。买卖债券价差收入为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

资产支持证券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖资产支持证券价差收入。资产支持证券利息收入在持有期内，按资产支持证券的票面价值和预计收益率计算的利息逐日确认资产支持证券利息收入。在收到资产支持证券支付的款项时，其中属于证券投资收益的部分冲减应计利息(若有)后的差额，确认资产支持证券利息收入。买卖资产支持证券价差收入为卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本、相关交易费用与税费后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额确认，由上市公司代扣代缴的个人所得税于卖出交易日按实际代扣代缴金额确认。

转融通证券出借业务利息收入在转融通证券实际出借期间内，按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时计入当期损益。出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为当期损益。

3)公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

4)信用减值损失

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认信用损失准备。本基金所计提的信用减值损失计入当期损益。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬、基金托管费和销售服务费(如适用)按基金合同及相关公告约定的费率和计算方法逐日计提。

卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率逐日计提。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

1)每一基金份额享有同等分配权；

2)本基金的收益分配方式为现金分红；

3)基金管理人可每月对基金相对业绩比较基准的超额收益率以及基金的可供分配利润进行评价，收益评价日核定的基金净值增长率超过业绩比较基准同期增长率或者基金可供分配利润金额大于零时，基金管理人可进行收益分配；

4)当基金收益分配根据基金相对业绩比较基准的超额收益率决定时，基于本基金的特点，本基金收益分配无需以弥补亏损为前提，收益分配后基金份额净值有可能低于面值；当基金收益分配根据基金可供分配利润金额决定时，本基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

5)在符合上述基金分红条件的前提下，本基金可每月进行收益分配。评价时间、分配时间、分配方案及每次基金收益分配数额等内容，基金管理人可以根据实际情况确定并按照有关规定公告；

6)若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；

7)法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。证券交易所或基金登记机构对收益分配另有规定的，从其规定。

在对基金份额持有人利益无实质不利影响的情况下，基金管理人可在不违反法律法规规定的前提下酌情调整以上基金收益分配原则，此项调整不需要召开基金份额持有人大会，但应在规定媒介公告。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，与所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策与计量基础一致。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据《关于发布<证券投资基金投资

流通受限股票估值指引(试行)>的通知》(中基协发[2017]6号)，在估值日按照该通知规定的流通受限股票公允价值计算模型进行估值。

(2)对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，根据《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》(中国证监会公告[2017]13号)及《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》(中基协发[2013]13号)相关规定，本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(3)对于中国证券投资基金业协会《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》(中基协字[2022]566号)所规定的固定收益品种，本基金按照相关规定，对以公允价值计量的固定收益品种选取第三方估值基准服务机构提供估值全价进行估值;对以摊余成本计量的固定收益品种用第三方估值基准服务机构提供的预期信用损失减值计量结果。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2021]33号《关于北京证券交易所税收政策适用问题的公告》、财税[2024]8号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财税[2025]4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令第826号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》、财税[2026]12号《关于明确增值税应税交易销售额计算口径的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)自2026年1月1日至2027年12月31日，公开募集证券投资基金管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，以基金管理人为增值税纳税人，可以选择适用简

易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对公募证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入以及金融同业往来利息收入免征增值税。

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

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

(4)对证券投资基金取得的股票股息红利所得，由上市公司代扣代缴个人所得税；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。其中，对基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所挂牌交易的上市公司限售股，解禁后取得的股息红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	622,098.61
等于：本金	622,045.49
加：应计利息	53.12
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	2,962,413.05
等于：本金	2,962,381.34
加：应计利息	31.71
减：坏账准备	-
合计	3,584,511.66

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		162,105,266.16	-	144,627,202.81	-17,478,063.35
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	57,999.87	2.67	58,002.54	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	57,999.87	2.67	58,002.54	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		162,163,266.03	2.67	144,685,205.35	-17,478,063.35

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

本基金本报告期末无衍生金融工具。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-

应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	136,285.94
其他	125.55
合计	136,411.49

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	164,054,229.00	164,054,229.00
本期申购	130,000,000.00	130,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-132,000,000.00	-132,000,000.00
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	162,054,229.00	162,054,229.00

注：1、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；

2、本基金合同于 2025 年 11 月 3 日生效，基金合同生效日的基金份额总额为 266,054,229.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 17,229.00 份基金份额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,904,575.81	798,996.07	3,703,571.88
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	2,904,575.81	798,996.07	3,703,571.88
本期利润	-3,034,455.34	-20,758,057.70	-23,792,513.04
本期基金份额交易产生的变动数	864,813.68	6,347,131.41	7,211,945.09
其中：基金申购款	6,616,822.20	4,876,397.66	11,493,219.86
基金赎回款	-5,752,008.52	1,470,733.75	-4,281,274.77
本期已分配利润	-2,745,806.48	-	-2,745,806.48
本期末	-2,010,872.33	-13,611,930.22	-15,622,802.55

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

活期存款利息收入	1,056.70
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	459.20
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	1,515.90

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-5,133,543.66
股票投资收益——赎回差价收入	147,278.83
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	-4,986,264.83

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	225,440,026.46
减：卖出股票成本总额	230,390,936.46
减：交易费用	182,633.66
买卖股票差价收入	-5,133,543.66

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	136,281,274.77
减：现金支付赎回款总额	86,209,461.77
减：赎回股票成本总额	49,924,534.17
减：交易费用	-
赎回差价收入	147,278.83

6.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无股票申购差价收入。

6.4.7.10.5 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内无证券出借差价收入。

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	2.54
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
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	2.54

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期内无买卖债券差价收入。

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

本基金本报告期内无衍生工具其他投资收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,981,933.84
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	1,981,933.84

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-20,758,057.70
——股票投资	-20,758,057.70
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
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	-20,758,057.70

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	289,233.76
其他	0.18
合计	289,233.94

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	4,669.28
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
其他	69,927.98
合计	134,104.63

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

2026 年 7 月 13 日，本基金管理人发布《招商中证 800 自由现金流交易型开放式指数证券投资基金 2026 年度第六次分红公告》，收益分配基准日为 2026 年 6 月 30 日，权益登记日为 2026 年 7 月 15 日，除息日为 2026 年 7 月 16 日，现金红利发放日为 2026 年 7 月 20 日，收益分配方案为招商中证 800 自由现金流 ETF 每 10 份基金份额派发红利人民币 0.030 元。

2026 年 8 月 12 日，本基金管理人发布《招商中证 800 自由现金流交易型开放式指数证券投资基金 2026 年度第七次分红公告》，收益分配基准日为 2026 年 7 月 31 日，权益登记日为 2026 年 8 月 14 日，除息日为 2026 年 8 月 17 日，现金红利发放日为 2026 年 8 月 19 日，收益分配方案为招商中证 800 自由现金流 ETF 每 10 份基金份额派发红利人民币 0.030 元。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
招商基金管理有限公司	基金管理人
平安银行股份有限公司	基金托管人
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

本基金本报告期内无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	140,079.07
其中：应支付销售机构的客户维护费	13,513.02
应支付基金管理人的净管理费	126,566.05

注：支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值×0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金管理人报酬＝前一日基金资产净值×0.15%÷当年天数

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	46,693.03

注：支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值×0.05%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金托管费＝前一日基金资产净值×0.05%÷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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
招商证券股份有限公司	4,043,978.00	2.50%	2,925,340.00	1.78%

注：表格中的比例为四舍五入的结果。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
平安银行-活期	622,098.61	1,056.70

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

单位：人民币元

本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
招商证券	603459	红板科技	网下申购	1,412	24,992.40
招商证券	001365	天海电子	网下申购	838	22,785.22

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

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	场内除息日	场外除息日	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
1	2026 年 2 月 13 日	2026 年 2 月 24 日	-	0.0300	516,160.88	-	516,160.88	-
2	2026 年 3 月 13 日	2026 年 3 月 16 日	-	0.0300	561,161.12	-	561,161.12	-
3	2026 年 4 月 15 日	2026 年 4 月 16 日	-	0.0300	603,161.33	-	603,161.33	-
4	2026 年 5 月 19 日	2026 年 5 月 20 日	-	0.0300	537,161.52	-	537,161.52	-
5	2026 年 6 月 12 日	2026 年 6 月 15 日	-	0.0300	528,161.63	-	528,161.63	-
合计	-	-	-	0.1500	2,745,806.48	-	2,745,806.48	-

6.4.12 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001237	惠康科技	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	53.26	58.74	101	5,379.26	5,932.74	-
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	6 个月	新股流通受限	10.11	10.11	6,083	61,499.13	61,499.13	-
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	1 个月内（含）	新股流通受限	10.11	10.11	2,607	26,356.77	26,356.77	-
001257	盛龙股份	2026 年 3 月 24	6 个月	新股流通受限	7.82	20.74	837	6,545.34	17,359.38	-

		日								
001312	福恩股份	2026 年 4 月 14 日	6 个月	新股流通受限	18.38	16.78	78	1,433.64	1,308.84	-
001365	天海电子	2026 年 5 月 11 日	6 个月	新股流通受限	27.19	31.31	252	6,851.88	7,890.12	-
001393	维通利	2026 年 5 月 8 日	6 个月	新股流通受限	30.38	38.99	175	5,316.50	6,823.25	-
001399	惠科股份	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通受限	10.12	27.73	999	10,109.88	27,702.27	-
301513	尚水智能	2026 年 4 月 10 日	6 个月	新股流通受限	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-
301531	春光集团	2026 年 4 月 28 日	6 个月	新股流通受限	13.30	51.56	281	3,737.30	14,488.36	-
301599	理奇智能	2026 年 4 月 22 日	6 个月	新股流通受限	13.91	32.47	297	4,131.27	9,643.59	-
301666	大普微	2026 年 4 月 8 日	6 个月	新股流通受限	46.08	463.33	314	14,469.12	145,485.62	-
301669	高特电子	2026 年 6 月 2 日	6 个月	新股流通受限	7.08	28.40	397	2,810.76	11,274.80	-
301682	宏明电子	2026 年 3 月 18 日	6 个月	新股流通受限	69.66	160.06	191	13,305.06	30,571.46	-
301683	慧谷新材	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股流通受限	78.38	121.77	44	3,448.72	5,357.88	-
301687	新广益	2025 年 12 月 24 日	6 个月	新股流通受限	21.93	77.78	160	3,508.80	12,444.80	-
301696	三瑞智能	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	24.68	86.80	135	3,331.80	11,718.00	-
601112	振石股份	2026 年 1 月 21 日	6 个月	新股流通受限	11.18	17.59	129	1,442.22	2,269.11	-
603284	林平发展	2026 年	6 个月	新股流通	37.88	34.87	32	1,212.16	1,115.84	-

		2 月 3 日		受限						
603293	埃泰克	2026 年 4 月 9 日	6 个月	新股流通受限	33.49	33.93	38	1,272.62	1,289.34	-
603352	至信股份	2026 年 1 月 8 日	6 个月	新股流通受限	21.88	25.52	64	1,400.32	1,633.28	-
603407	长裕集团	2026 年 4 月 29 日	6 个月	新股流通受限	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	-
603435	嘉德利	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603459	红板科技	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	17.70	84.32	142	2,513.40	11,973.44	-
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
113704	春风转债	2026 年 6 月 10 日	1 个月内（含）	新债未上市	100.00	100.00	580	57,999.87	58,002.54	-

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金的基金管理人建立了以全面、独立、互相制约以及定性和定量相结合为原则的，董事会及下设审计委员会、风险控制委员会、督察长、风险管理委员会、监察稽核部门和风险管理部门等多层次的风险管理组织架构体系。

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	58,002.54	-
未评级	-	-

合计	58,002.54	-

注：债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

本基金按合同约定申购赎回可采用一篮子证券的形式或现金替代方式，流动性风险相对较低。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	3,584,511.66	-	-	-	3,584,511.66
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	58,002.54	144,627,202.81	144,685,205.35
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	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	3,584,511.66	-	58,002.54	144,627,202.81	148,269,717.01
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	20,761.03	20,761.03
应付托管费	-	-	-	6,920.34	6,920.34
应付清算款	-	-	-	1,674,197.70	1,674,197.70
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	136,411.49	136,411.49
负债总计	-	-	-	1,838,290.56	1,838,290.56
利率敏感度缺口	3,584,511.66	-	58,002.54	142,788,912.25	146,431,426.45
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	3,874,731.98	-	-	-	3,874,731.98
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	165,954,808.96	165,954,808.96

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	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	3,874,731.98	-	-	165,954,808.96	169,829,540.94
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	23,502.51	23,502.51
应付托管费	-	-	-	7,834.18	7,834.18
应付清算款	-	-	-	2,012,718.44	2,012,718.44
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	27,684.93	27,684.93
负债总计	-	-	-	2,071,740.06	2,071,740.06
利率敏感度缺口	3,874,731.98	-	-	163,883,068.90	167,757,800.88

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1.若市场利率平行上升或下降 50 个基点		
	2.其他市场变量保持不变		
	3.仅存在公允价值变动对基金资产净值的影响		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（ 2026 年 6 月 30 日 ）	上年度末（ 2025 年 12 月 31 日 ）
	1. 市场利率平行上升 50 个基点	-1,641.66	-
	2. 市场利率平行下降 50 个基点	1,698.18	-

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 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产-股票投资	144,627,202.81	98.77	165,954,808.96	98.93
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	144,627,202.81	98.77	165,954,808.96	98.93

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（ 2026 年 6 月 30 日 ）	上年度末（ 2025 年 12 月 31 日 ）
	1. 权益性投资的市场价格上升 5%	7,231,360.14	8,297,740.45
	2. 权益性投资的市场价格下降 5%	-7,231,360.14	-8,297,740.45

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	144,191,110.45	165,929,193.56
第二层次	145,858.44	-
第三层次	348,236.46	25,615.40
合计	144,685,205.35	165,954,808.96

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无需要说明有助于理解和分析会计报表的其他事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	144,627,202.81	97.54
	其中：股票	144,627,202.81	97.54
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	58,002.54	0.04
	其中：债券	58,002.54	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	3,584,511.66	2.42
8	其他各项资产	-	-
9	合计	148,269,717.01	100.00

注：此处的股票投资项含可退替代款估值增值。

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	19,269,113.00	13.16
C	制造业	102,709,026.45	70.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	3,610,521.00	2.47
G	交通运输、仓储和邮政业	7,510,452.00	5.13
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,697,438.00	4.57
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	4,394,560.00	3.00
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	144,191,110.45	98.47

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	17,359.38	0.01
C	制造业	330,877.08	0.23

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	87,855.90	0.06
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
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	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	436,092.36	0.30

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股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000651	格力电器	381,900	14,321,250.00	9.78
2	601633	长城汽车	872,343	13,163,655.87	8.99
3	000100	TCL 科技	2,066,191	12,025,231.62	8.21
4	600938	中国海油	422,400	11,468,160.00	7.83
5	601600	中国铝业	1,060,200	8,714,844.00	5.95
6	002415	海康威视	247,214	8,454,718.80	5.77
7	601877	正泰电器	317,200	7,952,204.00	5.43
8	600031	三一重工	293,000	5,063,040.00	3.46
9	000708	中信特钢	393,700	4,968,494.00	3.39
10	688599	天合光能	219,043	3,092,887.16	2.11
11	600482	中国动力	92,900	3,047,120.00	2.08
12	601699	潞安环能	209,000	2,984,520.00	2.04

13	000039	中集集团	350,500	2,842,555.00	1.94
14	002602	世纪华通	197,200	2,780,520.00	1.90
15	002027	分众传媒	493,800	2,389,992.00	1.63
16	002532	天山铝业	212,300	2,277,979.00	1.56
17	002001	新和成	78,200	2,222,444.00	1.52
18	603885	吉祥航空	215,200	2,214,408.00	1.51
19	600415	小商品城	197,300	2,004,568.00	1.37
20	601156	东航物流	107,500	1,732,900.00	1.18
21	600801	华新建材	98,400	1,535,040.00	1.05
22	002558	巨人网络	54,900	1,513,044.00	1.03
23	601880	辽港股份	1,060,800	1,463,904.00	1.00
24	688819	天能股份	65,275	1,449,105.00	0.99
25	600256	广汇能源	286,500	1,415,310.00	0.97
26	000999	华润三九	61,100	1,374,139.00	0.94
27	300972	万辰集团	7,800	1,352,598.00	0.92
28	000975	山金国际	78,900	1,341,300.00	0.92
29	603233	大参林	88,500	1,330,155.00	0.91
30	603444	吉比特	3,700	1,326,154.00	0.91
31	601216	君正集团	293,200	1,307,672.00	0.89
32	600398	海澜之家	244,300	1,277,689.00	0.87
33	600546	山煤国际	113,200	1,237,276.00	0.84
34	600295	鄂尔多斯	104,900	1,124,528.00	0.77
35	600380	健康元	117,800	1,109,676.00	0.76
36	603565	中谷物流	95,000	931,950.00	0.64
37	603939	益丰药房	51,600	927,768.00	0.63
38	000513	丽珠集团	31,600	912,924.00	0.62
39	601001	晋控煤业	47,300	822,547.00	0.56
40	000423	东阿阿胶	18,000	816,480.00	0.56
41	600132	重庆啤酒	18,400	759,920.00	0.52
42	600131	国网信通	46,000	671,600.00	0.46
43	603766	隆鑫通用	55,900	666,887.00	0.46
44	600535	天士力	49,400	653,562.00	0.45
45	603816	顾家家居	27,800	621,608.00	0.42
46	600004	白云机场	83,500	606,210.00	0.41
47	601000	唐山港	135,200	561,080.00	0.38
48	001386	马可波罗	38,300	542,328.00	0.37
49	002773	康弘药业	20,100	411,045.00	0.28
50	300002	神州泰岳	52,000	406,120.00	0.28

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	301666	大普微	314	145,485.62	0.10
2	001248	华润新能源	8,690	87,855.90	0.06
3	301682	宏明电子	191	30,571.46	0.02
4	001399	惠科股份	999	27,702.27	0.02
5	001257	盛龙股份	837	17,359.38	0.01
6	301531	春光集团	281	14,488.36	0.01
7	301687	新广益	160	12,444.80	0.01
8	603459	红板科技	142	11,973.44	0.01
9	301696	三瑞智能	135	11,718.00	0.01
10	301669	高特电子	397	11,274.80	0.01
11	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.01
12	301599	理奇智能	297	9,643.59	0.01
13	001365	天海电子	252	7,890.12	0.01
14	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
15	001393	维通利	175	6,823.25	0.00
16	001237	惠康科技	101	5,932.74	0.00
17	301683	慧谷新材	44	5,357.88	0.00
18	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
19	601112	振石股份	129	2,269.11	0.00
20	603352	至信股份	64	1,633.28	0.00
21	001312	福恩股份	78	1,308.84	0.00
22	603293	埃泰克	38	1,289.34	0.00
23	603284	林平发展	32	1,115.84	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	601728	中国电信	22,232,023.58	13.25
2	601633	长城汽车	16,798,326.32	10.01
3	600938	中国海油	15,652,882.00	9.33
4	600104	上汽集团	13,318,417.00	7.94
5	601600	中国铝业	13,075,969.00	7.79
6	601877	正泰电器	10,450,649.00	6.23
7	002415	海康威视	8,811,218.02	5.25
8	601816	京沪高铁	7,326,592.00	4.37
9	600031	三一重工	6,263,859.00	3.73
10	002352	顺丰控股	6,209,600.00	3.70
11	601919	中远海控	6,169,369.00	3.68

12	600019	宝钢股份	4,610,412.00	2.75
13	601699	潞安环能	4,243,343.00	2.53
14	600482	中国动力	3,874,210.00	2.31
15	688599	天合光能	3,671,927.35	2.19
16	000100	TCL 科技	3,621,053.50	2.16
17	002027	分众传媒	3,480,389.00	2.07
18	002602	世纪华通	3,195,781.00	1.90
19	002532	天山铝业	3,178,132.00	1.89
20	600415	小商品城	3,136,360.00	1.87

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	600104	上汽集团	24,092,550.00	14.36
2	601728	中国电信	22,659,929.00	13.51
3	600938	中国海油	20,542,844.82	12.25
4	601919	中远海控	14,213,320.90	8.47
5	600019	宝钢股份	9,726,951.00	5.80
6	601600	中国铝业	7,878,043.00	4.70
7	601877	正泰电器	7,688,788.00	4.58
8	601816	京沪高铁	7,120,542.00	4.24
9	601212	白银有色	6,166,685.14	3.68
10	002714	牧原股份	6,128,098.00	3.65
11	601633	长城汽车	5,918,889.16	3.53
12	600352	浙江龙盛	5,775,561.00	3.44
13	600482	中国动力	5,765,443.00	3.44
14	002352	顺丰控股	5,297,822.00	3.16
15	000792	盐湖股份	5,102,560.64	3.04
16	002648	卫星化学	4,565,855.00	2.72
17	600096	云天化	4,418,671.76	2.63
18	600585	海螺水泥	4,252,686.00	2.54
19	000568	泸州老窖	3,525,189.36	2.10
20	600415	小商品城	3,135,705.00	1.87

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	229,057,085.18
卖出股票收入（成交）总额	225,440,026.46

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）	58,002.54	0.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	58,002.54	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	113704	春风转债	580	58,002.54	0.04

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

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

7.11.2 本期国债期货投资评价

本报告期内，本基金投资国债期货符合既定的投资政策和投资目的。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中，天合光能股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到上海证券交易所的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

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

7.12.2

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

本基金本报告期末未持有其他资产。

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	301666	大普微	145,485.62	0.10	新股流通受限
2	001248	华润新能源	87,855.90	0.06	新股流通受限
3	301682	宏明电子	30,571.46	0.02	新股流通受限
4	001399	惠科股份	27,702.27	0.02	新股流通受限
5	001257	盛龙股份	17,359.38	0.01	新股流通受限

§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

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
2,469	65,635.57	48,671,908.00	30.03%	113,382,321.00	69.97%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	-	-

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	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	0

负责人持有本开放式基金	
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2025 年 11 月 3 日)基金份额总额	266,054,229.00
本报告期期初基金份额总额	164,054,229.00
本报告期基金总申购份额	130,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	132,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-
本报告期期末基金份额总额	162,054,229.00

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

2026 年 6 月 23 日，根据托管人工作安排，聘任宋卓先生为平安银行股份有限公司资产托管部总经理。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、公募基金托管业务的重大诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

报告期内，本基金托管人的基金托管业务部门无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，本基金托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国投证券	6	453,884,956.00	100.00%	40,850.69	100.00%	本报告期新增

注：（一）选择标准

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

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

3、被动股票型基金以外类型基金选择能够提供优质研究服务的证券公司。

（二）选择程序

1、基金管理人根据上述标准进行评估并确定选用的证券公司。

2、基金管理人与被选择的证券公司签订交易单元租用协议/证券经纪服务协议。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国投证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	招商基金管理有限公司旗下部分基金增加华宝证券股份有限公司为场内申购赎回代办券商的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-01-16
2	招商中证 800 自由现金流交易型开放式指数证券投资基金 2026 年度第一次分红公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-02-11
3	招商基金管理有限公司旗下部分基金增加国联民生证券股份有限公司为场内申购赎回代办券商的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-02
4	招商中证 800 自由现金流交易型开放式指数证券投资基金 2026 年度第二次分红公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-11
5	招商基金管理有限公司关于旗下部分深交所 ETF 变更场内简称的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-20
6	招商中证 800 自由现金流交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-20
7	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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-04-01
8	招商中证 800 自由现金流交易型开放式指数证券投资基金 2026 年度第三次分红公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-04-13
9	招商基金管理有限公司旗下基金 2026 年第 1 季度报告提示性公告	中国证券报及基金管理人网站	2026-04-22
10	招商中证 800 自由现金流交易型开放式指数证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-04-22
11	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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-05-12
12	招商基金管理有限公司关于提醒投资者持续完善客户身份信息的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-05-14
13	招商中证 800 自由现金流交易型开放式指数证券投资基金 2026 年度第四次分红公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-05-15
14	招商中证 800 自由现金流交易型开放式指数证券投资基金 2026 年度第五次分红公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监	2026-06-10

		会基金电子披露网站	
15	招商基金管理有限公司旗下部分基金增加民生证券股份有限公司为场内申购赎回代办券商的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-06-16

§11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

1、中国证券监督管理委员会批准设立招商基金管理有限公司的文件；

2、中国证券监督管理委员会批准招商中证 800 自由现金流交易型开放式指数证券投资基金设立的文件；

3、《招商中证 800 自由现金流交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；

4、《招商中证 800 自由现金流交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；

5、《招商中证 800 自由现金流交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；

6、基金管理人业务资格批件、营业执照。

11.2 存放地点

招商基金管理有限公司

地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

11.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人招商基金管理有限公司。

客户服务电话：400-887-9555

网址：http://www.cmfchina.com

招商基金管理有限公司

2026 年 8 月 31 日