# 招商深证100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：交通银行股份有限公司

送出日期：2026年8月31日

# §1 重要提示及目录

## 1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录 ..... 1
1.1 重要提示 ..... 1
1.2 目录 ..... 2
§2 基金简介 ..... 4
2.1 基金基本情况 ..... 4
2.2 基金产品说明 ..... 4
2.3 基金管理人和基金托管人 ..... 5
2.4 信息披露方式 ..... 6
2.5 其他相关资料 ..... 6
§3 主要财务指标和基金净值表现 ..... 6
3.1 主要会计数据和财务指标 ..... 6
3.2 基金净值表现 ..... 7
§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 ..... 10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 ..... 10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 ..... 11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 ..... 11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 ..... 11
§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 ..... 12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 ..... 12
§6 半年度财务会计报告（未经审计） ..... 12
6.1 资产负债表 ..... 12
6.2 利润表 ..... 13
6.3 净资产变动表 ..... 15
6.4 报表附注 ..... 16
§7 投资组合报告 ..... 34
7.1 期末基金资产组合情况 ..... 34
7.2 期末按行业分类的股票投资组合 ..... 34
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 ..... 35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 ..... 38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 ..... 40
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 ..... 40
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 ..... 40
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 ..... 40
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 ..... 40
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 ..... 40

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 ..... 41
7.12 投资组合报告附注 ..... 41
§8 基金份额持有人信息 ..... 42
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 ..... 42
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 ..... 42
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 ..... 42
§9 开放式基金份额变动 ..... 43
§10 重大事件揭示 ..... 43
10.1 基金份额持有人大会决议 ..... 43
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 ..... 43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 ..... 43
10.4 基金投资策略的改变 ..... 43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 ..... 43
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 ..... 43
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 ..... 44
10.8 其他重大事件 ..... 45
§11 备查文件目录 ..... 45
11.1 备查文件目录 ..... 45
11.2 存放地点 ..... 46
11.3 查阅方式 ..... 46

# §2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金名称 | 招商深证 100 交易型开放式指数证券投资基金 |
| 基金简称 | 招商深证 100ETF |
| 场内简称 | 深 100ETF 招商 |
| 基金主代码 | 159975 |
| 交易代码 | 159975 |
| 基金运作方式 | 交易型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2019 年 11 月 7 日 |
| 基金管理人 | 招商基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 交通银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 54,437,760.00 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 | 2020 年 1 月 2 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。 |
| 投资策略 | 1、股票投资策略：<br>本基金主要采用完全复制法，即按照标的指数成份券的构成及其权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份券及其权重的变化进行相应调整。如遇特殊情况，例如因成份券发生调整、成份券长期停牌、成份券发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因市场流动性不足时，以及因其他原因导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。<br>基金管理人每日跟踪基金组合与标的指数表现的偏离度，定期分析基金的实际组合与标的指数表现的累计偏离度、跟踪误差变化情况及其原因，并优化跟踪偏离度管理方案。 在正常情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人将采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。<br>2、债券投资策略：<br>本基金管理人将基于对国内外宏观经济形势的深入分析、国内财政政策与货币市场政策等因素对债券市场的影响，进行合理的利率预期，判断债券市场的基本走势，制定久期控制下的资产类属配置策略。在债券投资组合构建和管理过程中，本基金管理人将具体采用期限结构配置、市场转换、信用利差和相对价值判断、信用风险评估、现金管理等管理手段进行个券选择。本基金债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基 |

| | |
|---|---|
| | 础上，降低跟踪误差。<br>3、资产支持证券投资策略：<br>本基金将在宏观经济和基本面分析的基础上，对资产支持证券标的资产的质量和构成、利率风险、信用风险、流动性风险和提前偿付风险等进行分析，评估其相对投资价值并作出相应的投资决策。<br>4、股指期货投资策略：<br>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。<br>5、国债期货投资策略：<br>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。<br>6、融资及转融通投资策略：<br>本基金将在充分考虑风险和收益特征的基础上，审慎参与融资及转融通交易。本基金将基于对市场行情和组合风险收益的分析，确定投资时机、标的证券以及投资比例。若相关融资及转融通业务法律法规发生变化，本基金将从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。<br>7、存托凭证投资策略：<br>在控制风险的前提下，本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。 |
| 业绩比较基准 | 深证 100 指数（价格）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。<br>本基金为被动式投资的股票型指数基金，主要采用完全复制策略，跟踪深证 100 指数（价格），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 | 交通银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 潘西里 | 方圆 |
| | 联系电话 | 0755－83196666 | 95559 |
| | 电子邮箱 | cmf@cmfchina.com | fangy_20@bankcomm.com |
| 客户服务电话 | | 400-887-9555 | 95559 |
| 传真 | | 0755－83196475 | 021-62701216 |

| | | |
|---|---|---|
| 注册地址 | 深圳市福田区深南大道 7088 号 | 中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号 |
| 办公地址 | 深圳市福田区深南大道 7088 号 | 中国（上海）长宁区仙霞路 18 号 |
| 邮政编码 | 518040 | 200336 |
| 法定代表人 | 王颖 | 任德奇 |

## 2.4 信息披露方式

| | |
|---|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 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 | 6,378,448.58 |
| 本期利润 | 8,206,446.02 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.1343 |
| 本期加权平均净值利润率 | 17.41% |
| 本期基金份额净值增长率 | 19.66% |
| 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 | 21,791,700.69 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.4003 |
| 期末基金资产净值 | 47,378,246.57 |
| 期末基金份额净值 | 0.8703 |
| 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 | 98.86% |

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；

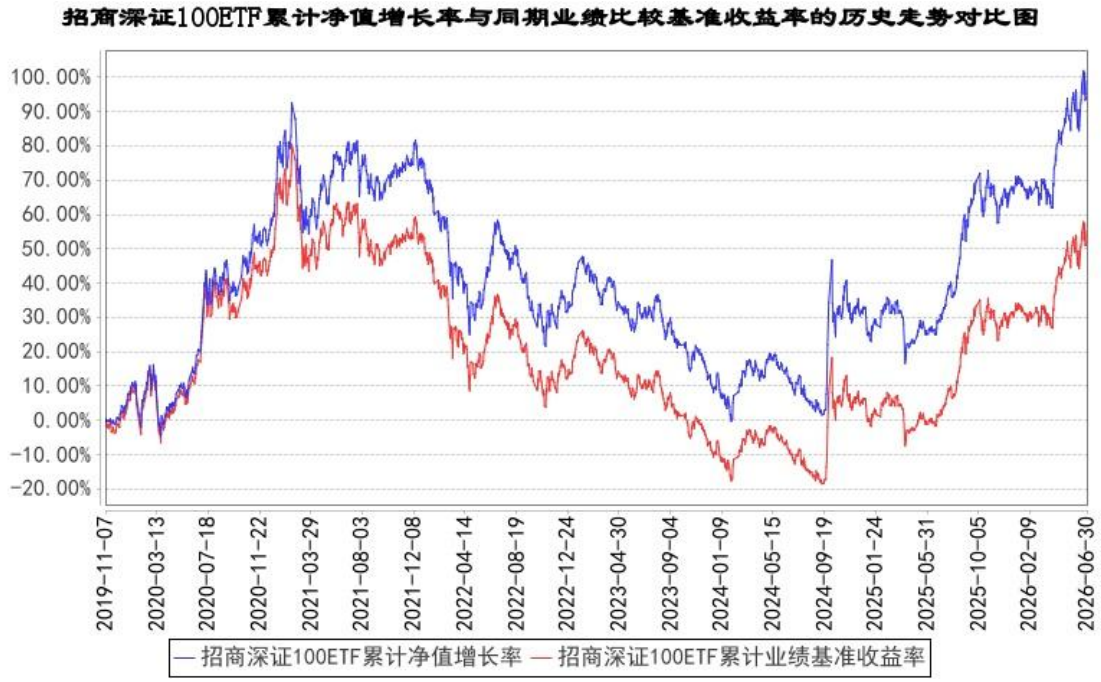
3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

## 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 | 21.86% | 1.69% | 21.31% | 1.71% | 0.55% | -0.02% |
| 过去六个月 | 19.66% | 1.44% | 19.19% | 1.46% | 0.47% | -0.02% |
| 过去一年 | 53.76% | 1.36% | 52.60% | 1.37% | 1.16% | -0.01% |
| 过去三年 | 51.59% | 1.43% | 40.51% | 1.45% | 11.08% | -0.02% |
| 过去五年 | 9.80% | 1.39% | -5.16% | 1.40% | 14.96% | -0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 98.86% | 1.43% | 55.14% | 1.46% | 43.72% | -0.03% |

### 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




# §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 | | |
| 刘重杰 | 本基金基金经理 | 2019 年 11 月 7 日 | - | 15 | 男，学士。曾任职于成都商报社、西南财经大学金融数据中心、南京大学金陵学院；2010 年 7 月加入华西期货有限责任公司，历任金融工程部高级研究员、部门负责人；2014 年 3 月加入西南证券股份有限公司，历任衍生品业务岗、平仓处置岗、策略研究岗、投资者教育及培训岗；2017 年 9 月加入招商基金管理有限公司，曾任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、招商深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、招商中证浙江 100 交易型开放式指数证券投资基金、招商中证生物科技主题交易型开放式指数证券投资基金、招商中证云计算与大数据主题交易型开放式指数证券投资基金、招商沪深 300ESG 基准交易型开放式指数证券投资基金、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、招商中证香港科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）、招商中证 A100 交易型开放式指数证券投资基金、招商中证国新央企股东回报交易型开放式指数证券投资基金、招商中证国新央企股东回报交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，现任招商深证 100 交易型开放式指数证券投资基金、招商中证红利交易型开放式指数证券投资 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | | | 基金、招商国证食品饮料行业交易型开放式指数证券投资基金、招商中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金、招商中证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金、招商中证银行 AH 价格优选交易型开放式指数证券投资基金、招商中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金联接基金、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、招商纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）、招商纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）、招商中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金、招商中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、招商利安新兴亚洲精选交易型开放式指数证券投资基金（QDII）、招商中证全指红利质量交易型开放式指数证券投资基金、招商中证香港科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）、招商中证香港科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）、招商中证全指红利质量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。 |

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。

## 4.2 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

报告期内 A 股整体上呈现出上涨行情，其中沪深 300 指数上涨 7.55%，中证 500 指数上涨 20.97%，中证 1000 指数上涨 15.99%；31 个申万一级行业中，涨幅前三的行业为电子、通信、建筑材料，涨幅分别为 86.29%、73.59%、46.26%；而跌幅前三的行业为商贸零售、农林牧渔、美容护理，下跌幅度分别为 29.42%、25.26%、24.86%。本基金的基准指数深证 100 指数报告期内上涨 19.19%。关于本基金的运作，仓位维持在 99%左右的水平，基本上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 19.66%，同期业绩基准增长率为 19.19%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

报告期内，市场波动向上，A 股风格极致分化。AI 相关的科技成长板块交易拥挤，消费和周期行业表现落后。指数表现上，主要宽基指数涨多跌少，科创 50、科创 100 和创业板指涨幅居前，万得微盘股指数和北证 50 相对落后；行业表现上，电子和通信行业涨幅大幅领先，农林牧渔、石油石化和美容护理等行业表现落后。当前全 A 估值水平市盈率与市净率历史分位数位于相对较高的水平;市场的传统产业的低估值板块与新兴科技成长风格板块的估值持续分化。市场指数维持高位震荡，但风格内部轮动加剧，宏观层面，外部加息交易反复与地缘缓和并存，国内流动性均衡偏松，上半年股票市场资金呈现有进有出的结构，基本面上中长期价格上行与出口韧性将推动盈利结构性修复。进入三季度和下半年的业绩披露期，风格择时重要性可能会有所下降，业绩兑现有望成为主导因子。

## 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

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

## 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配，符合相关法规及基金合同的约定。

## 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，相关解决方案已经上报证监会。

# §5 托管人报告

## 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

## §6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：招商深证 100 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 | 541,333.06 | 645,338.88 |
| 结算备付金 | | 2,046.68 | 676.29 |
| 存出保证金 | | 223.00 | 416.51 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 46,872,812.92 | 51,786,403.17 |
| 其中：股票投资 | | 46,872,812.92 | 51,786,403.17 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | - | - |
| 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 | | 47,416,415.66 | 52,432,834.85 |
| 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 | | - | - |
| 应付赎回款 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | | 7,820.11 | 8,859.95 |
| 应付托管费 | | 3,910.07 | 4,430.00 |
| 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 | 26,438.91 | 100,728.14 |
| 负债合计 | | 38,169.09 | 114,018.09 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.7 | 23,824,389.66 | 31,483,169.50 |
| 其他综合收益 | | - | - |
| 未分配利润 | 6.4.7.8 | 23,553,856.91 | 20,835,647.26 |
| 净资产合计 | | 47,378,246.57 | 52,318,816.76 |
| 负债和净资产总计 | | 47,416,415.66 | 52,432,834.85 |

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.8703 元，基金份额总额 54,437,760.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：招商深证 100 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 | 上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|---|---|---|---|
| 一、营业总收入 | | 8,302,250.72 | -435,455.93 |
| 1.利息收入 | | 798.97 | 956.31 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.9 | 798.97 | 956.31 |
| 债券利息收入 | | - | - |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 6,474,118.79 | -564,362.04 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.10 | 6,072,914.79 | -1,241,420.71 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.11 | - | 3,833.46 |
| 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 | 401,204.00 | 673,225.21 |
| 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 | 1,827,997.44 | 127,731.64 |
| 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 | -664.48 | 218.16 |
| 减：二、营业总支出 | | 95,804.70 | 126,624.90 |
| 1.管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 46,793.59 | 54,295.07 |
| 其中：暂估管理人报酬 | | - | - |
| 2.托管费 | 6.4.10.2.2 | 23,396.86 | 27,147.52 |
| 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 | 25,614.25 | 45,182.31 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 8,206,446.02 | -562,080.83 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 8,206,446.02 | -562,080.83 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | 8,206,446.02 | -562,080.83 |

## 6.3 净资产变动表

会计主体：招商深证 100 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 | 31,483,169.50 | - | 20,835,647.26 | 52,318,816.76 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产 | 31,483,169.50 | - | 20,835,647.26 | 52,318,816.76 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -7,658,779.84 | - | 2,718,209.65 | -4,940,570.19 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | 8,206,446.02 | 8,206,446.02 |
| （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） | -7,658,779.84 | - | -5,488,236.37 | -13,147,016.21 |
| 其中：1.基金申购款 | 6,564,668.44 | - | 5,767,728.40 | 12,332,396.84 |
| 2.基金赎回款 | -14,223,448.28 | - | -11,255,964.77 | -25,479,413.05 |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列） | - | - | - | - |
| （四）、其他综合收 | - | - | - | - |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 益结转留存收益 | | | | |
| 四、本期期末净资产 | 23,824,389.66 | - | 23,553,856.91 | 47,378,246.57 |
| 项目 | 上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 | | | |
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产 | 50,083,063.41 | - | 15,275,487.84 | 65,358,551.25 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产 | 50,083,063.41 | - | 15,275,487.84 | 65,358,551.25 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -12,035,225.46 | - | -4,118,762.49 | -16,153,987.95 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | -562,080.83 | -562,080.83 |
| （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） | -12,035,225.46 | - | -3,556,681.66 | -15,591,907.12 |
| 其中：1.基金申购款 | 5,470,557.05 | - | 1,513,298.12 | 6,983,855.17 |
| 2.基金赎回款 | -17,505,782.51 | - | -5,069,979.78 | -22,575,762.29 |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列） | - | - | - | - |
| （四）、其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产 | 38,047,837.95 | - | 11,156,725.35 | 49,204,563.30 |

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

招商深证 100 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》、《招商深证 100 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[2019]1335 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 981,171,871.00 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(19)第 00324 号验资报告。《招商深证 100 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 2019 年 11 月 7 日正式生效。本基金的基金管理人为招商基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司(以下简称“交通银行”)。

根据《招商基金管理有限公司关于招商深证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金份额拆分结果的公告》,本基金的基金管理人于 2021 年 1 月 28 日对本基金进行基金份额拆分。根据拆分前基金份额净值和公告的基金份额拆分比例计算公式,基金份额拆分比例为 1:10,拆分后基金份额净值为人民币 0.7628 元。本基金注册登记机构于 2021 年 1 月 28 日对各基金份额持有人经重新计算的基金份额进行了变更登记。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及截至报告期末最新公告的招募说明书的有关规定,本基金主要投资于标的指数成份券和备选成份券。为更好地实现基金的投资目标,本基金可能会少量投资于国内依法发行上市的非成份券(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票和存托凭证)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、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)。本基金将根据法律法规的规定参与融资及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%;本基金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,应当保持不低于交易保证金一倍的现金。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金的业绩比较基准为:深证 100 指数(价格)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

本报告期所采用的会计政策，会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内未发生重大会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内未发生重大会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

### 6.4.6 税项

根据财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[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 | 541,333.06 |
| 等于：本金 | 540,704.09 |
| 加：应计利息 | 628.97 |
| 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 | 541,333.06 |

### 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 | | 35,464,887.69 | - | 46,872,812.92 | 11,407,925.23 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | | - | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | - | - | - | - |
| | 银行间市场 | - | - | - | - |
| | 合计 | - | - | - | - |
| 资产支持证券 | | - | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - | - |
| 合计 | | 35,464,887.69 | - | 46,872,812.92 | 11,407,925.23 |

### 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 | 934.66 |
| 其中：交易所市场 | 934.66 |
| 银行间市场 | - |
| 应付利息 | - |
| 预提费用 | 25,504.25 |
| 合计 | 26,438.91 |

### 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 | 71,937,760.00 | 31,483,169.50 |
| 本期申购 | 15,000,000.00 | 6,564,668.44 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -32,500,000.00 | -14,223,448.28 |
| 基金份额折算变动份额 | - | - |
| 本期末 | 54,437,760.00 | 23,824,389.66 |

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

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|---|---|---|---|
| 上年度末 | 20,810,316.86 | 25,330.40 | 20,835,647.26 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 本期期初 | 20,810,316.86 | 25,330.40 | 20,835,647.26 |
| 本期利润 | 6,378,448.58 | 1,827,997.44 | 8,206,446.02 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -5,397,064.75 | -91,171.62 | -5,488,236.37 |
| 其中：基金申购款 | 5,311,109.39 | 456,619.01 | 5,767,728.40 |
| 基金赎回款 | -10,708,174.14 | -547,790.63 | -11,255,964.77 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 21,791,700.69 | 1,762,156.22 | 23,553,856.91 |

### 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 | 789.94 |
| 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 | 8.55 |
| 其他 | 0.48 |

| | |
|---|---|
| 合计 | 798.97 |

### 6.4.7.10 股票投资收益

#### 6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | 121,769.30 |
| 股票投资收益——赎回差价收入 | 5,951,145.49 |
| 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 | 6,072,914.79 |

#### 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 | 4,541,034.74 |
| 减：卖出股票成本总额 | 4,415,375.18 |
| 减：交易费用 | 3,890.26 |
| 买卖股票差价收入 | 121,769.30 |

#### 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 | 25,479,413.05 |
| 减：现金支付赎回款总额 | 105,966.05 |
| 减：赎回股票成本总额 | 19,422,301.51 |
| 减：交易费用 | - |
| 赎回差价收入 | 5,951,145.49 |

#### 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

本基金本报告期内无债券投资收益。

#### 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 | 401,204.00 |
| 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 | 401,204.00 |

### 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 | 1,827,997.44 |
| ——股票投资 | 1,827,997.44 |
| ——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 | 1,827,997.44 |

### 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 | -664.48 |
| 合计 | -664.48 |

### 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 | 736.91 |
| 信息披露费 | 24,767.34 |
| 证券出借违约金 | - |
| 其他 | 110.00 |
| 合计 | 25,614.25 |

注：本报告期内，基金管理人自主承担了本基金迷你期间的相关固定费用。

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报告批准报出日，本基金无需要说明的资产负债表日后事项。

### 6.4.9 关联方、关联关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

#### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
| --- | --- |
| 招商基金管理有限公司 | 基金管理人 |
| 交通银行股份有限公司 | 基金托管人 |
| 招商证券股份有限公司(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

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 | | 上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 | |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 |
| 招商证券 | 9,879,144.74 | 100.00% | 5,878,213.57 | 100.00% |

##### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 | | 上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 | |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 |
| 招商证券 | - | - | 29,634.65 | 100.00% |

##### 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

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 当期佣金 | 占当期佣金总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例 |
| 招商证券 | 986.77 | 100.00% | 934.66 | 100.00% |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 | | | |
| | 当期佣金 | 占当期佣金总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例 |
| 招商证券 | 587.26 | 100.00% | 361.18 | 100.00% |

注：1、本报告期内，本基金与关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2、根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

3、本报告期内，基金对该类交易的佣金的计算方式是按相关协议约定的佣金费率计算。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为基金提供研究服务 （被动股票型基金自 2024 年 7 月 1 日起不适用）。

### 6.4.10.2 关联方报酬

### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 46,793.59 | 54,295.07 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 7,464.05 | 9,498.72 |
| 应支付基金管理人的净管理费 | 39,329.54 | 44,796.35 |

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×0.20%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：

日基金管理人报酬＝前一日基金资产净值×0.20%÷当年天数

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 23,396.86 | 27,147.52 |

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

日基金托管费＝前一日基金资产净值×0.10%÷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

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 | 2,587,200.00 | 4.75% | 5,686,200.00 | 7.90% |

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 | 上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|---|---|---|

| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
|---|---|---|---|---|
| 交通银行-活期 | 541,333.06 | 789.94 | 612,740.05 | 942.52 |

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

### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

### 6.4.11 利润分配情况

### 6.4.11.1 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

### 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、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

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的债券投资。

##### 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 | 541,333.06 | - | - | - | 541,333.06 |
| 结算备付金 | 2,046.68 | - | - | - | 2,046.68 |
| 存出保证金 | 223.00 | - | - | - | 223.00 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 46,872,812.92 | 46,872,812.92 |
| 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 | 543,602.74 | - | - | 46,872,812.92 | 47,416,415.66 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 7,820.11 | 7,820.11 |
| 应付托管费 | - | - | - | 3,910.07 | 3,910.07 |
| 应付清算款 | - | - | - | - | - |
| 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 | - | - | - | 26,438.91 | 26,438.91 |
| 负债总计 | - | - | - | 38,169.09 | 38,169.09 |
| 利率敏感度缺口 | 543,602.74 | - | - | 46,834,643.83 | 47,378,246.57 |
| 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 | 645,338.88 | - | - | - | 645,338.88 |
| 结算备付金 | 676.29 | - | - | - | 676.29 |
| 存出保证金 | 416.51 | - | - | - | 416.51 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 51,786,403.17 | 51,786,403.17 |
| 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 | 646,431.68 | - | - | 51,786,403.17 | 52,432,834.85 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 8,859.95 | 8,859.95 |
| 应付托管费 | - | - | - | 4,430.00 | 4,430.00 |
| 应付清算款 | - | - | - | - | - |
| 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 | - | - | - | 100,728.14 | 100,728.14 |
| 负债总计 | - | - | - | 114,018.09 | 114,018.09 |
| 利率敏感度缺口 | 646,431.68 | - | - | 51,672,385.08 | 52,318,816.76 |

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

本基金本报告期末及上年度末无利率风险的敏感性分析。

### 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 | 46,872,812.92 | 98.93 | 51,786,403.17 | 98.98 |
| 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 | 46,872,812.92 | 98.93 | 51,786,403.17 | 98.98 |

### 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 | 上年度末（ 2025 年 12 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | | 30 日 ） | 月 31 日 ） |
| | 1. 权益性投资的市场价格上升 5% | 2,343,640.65 | 2,589,320.16 |
| | 2. 权益性投资的市场价格下降 5% | -2,343,640.65 | -2,589,320.16 |

### 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 | 46,872,812.92 | 51,477,467.97 |
| 第二层次 | - | 308,935.20 |
| 第三层次 | - | - |
| 合计 | 46,872,812.92 | 51,786,403.17 |

##### 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 | 46,872,812.92 | 98.85 |
| | 其中：股票 | 46,872,812.92 | 98.85 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 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 | 543,379.74 | 1.15 |
| 8 | 其他各项资产 | 223.00 | 0.00 |
| 9 | 合计 | 47,416,415.66 | 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 | 662,357.56 | 1.40 |
| B | 采矿业 | 169,090.00 | 0.36 |
| C | 制造业 | 40,799,086.26 | 86.11 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 125,896.00 | 0.27 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 88,971.68 | 0.19 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 433,192.26 | 0.91 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 1,186,358.00 | 2.50 |
| J | 金融业 | 2,855,390.88 | 6.03 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| K | 房地产业 | 177,556.86 | 0.37 |
| L | 租赁和商务服务业 | 208,604.00 | 0.44 |
| 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 | 157,584.28 | 0.33 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 46,864,087.78 | 98.91 |

### 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 | - | - |
| C | 制造业 | 8,725.14 | 0.02 |
| 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 | - | - |
| 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 | 8,725.14 | 0.02 |

### 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 | 300308 | 中际旭创 | 3,700 | 4,699,000.00 | 9.92 |
| 2 | 300750 | 宁德时代 | 11,280 | 4,433,152.80 | 9.36 |
| 3 | 300502 | 新易盛 | 5,412 | 3,285,084.00 | 6.93 |
| 4 | 000333 | 美的集团 | 20,803 | 1,571,250.59 | 3.32 |
| 5 | 002371 | 北方华创 | 1,735 | 1,534,711.60 | 3.24 |
| 6 | 002475 | 立讯精密 | 20,187 | 1,421,164.80 | 3.00 |
| 7 | 002384 | 东山精密 | 5,300 | 1,390,455.00 | 2.93 |
| 8 | 000725 | 京东方 A | 139,900 | 1,214,332.00 | 2.56 |
| 9 | 300059 | 东方财富 | 55,081 | 1,122,550.78 | 2.37 |
| 10 | 300274 | 阳光电源 | 6,300 | 1,001,826.00 | 2.11 |
| 11 | 300408 | 三环集团 | 5,400 | 901,260.00 | 1.90 |
| 12 | 300476 | 胜宏科技 | 2,600 | 900,718.00 | 1.90 |
| 13 | 002463 | 沪电股份 | 5,800 | 886,240.00 | 1.87 |
| 14 | 002594 | 比亚迪 | 10,806 | 861,238.20 | 1.82 |
| 15 | 300394 | 天孚通信 | 2,728 | 825,711.04 | 1.74 |
| 16 | 301308 | 江波龙 | 1,100 | 774,180.00 | 1.63 |
| 17 | 000651 | 格力电器 | 18,400 | 690,000.00 | 1.46 |
| 18 | 000988 | 华工科技 | 3,600 | 664,596.00 | 1.40 |
| 19 | 000338 | 潍柴动力 | 21,700 | 591,325.00 | 1.25 |
| 20 | 300124 | 汇川技术 | 8,699 | 577,004.67 | 1.22 |
| 21 | 000858 | 五粮液 | 7,629 | 564,546.00 | 1.19 |
| 22 | 002415 | 海康威视 | 15,800 | 540,360.00 | 1.14 |
| 23 | 002916 | 深南电路 | 1,146 | 524,753.40 | 1.11 |
| 24 | 000063 | 中兴通讯 | 13,532 | 489,723.08 | 1.03 |
| 25 | 000100 | TCL 科技 | 82,160 | 478,171.20 | 1.01 |
| 26 | 300433 | 蓝思科技 | 8,300 | 445,378.00 | 0.94 |
| 27 | 002142 | 宁波银行 | 14,670 | 435,552.30 | 0.92 |
| 28 | 002028 | 思源电气 | 2,500 | 432,500.00 | 0.91 |
| 29 | 000792 | 盐湖股份 | 14,100 | 425,679.00 | 0.90 |
| 30 | 002050 | 三花智控 | 9,200 | 403,236.00 | 0.85 |
| 31 | 300014 | 亿纬锂能 | 6,100 | 396,683.00 | 0.84 |
| 32 | 002353 | 杰瑞股份 | 2,600 | 396,500.00 | 0.84 |
| 33 | 000657 | 中钨高新 | 3,900 | 373,308.00 | 0.79 |
| 34 | 002714 | 牧原股份 | 10,564 | 369,634.36 | 0.78 |
| 35 | 000001 | 平安银行 | 36,100 | 362,805.00 | 0.77 |
| 36 | 300760 | 迈瑞医疗 | 2,600 | 353,158.00 | 0.75 |
| 37 | 002602 | 世纪华通 | 24,500 | 345,450.00 | 0.73 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 38 | 002230 | 科大讯飞 | 8,200 | 334,888.00 | 0.71 |
| 39 | 002352 | 顺丰控股 | 10,101 | 315,757.26 | 0.67 |
| 40 | 002460 | 赣锋锂业 | 4,720 | 308,688.00 | 0.65 |
| 41 | 000776 | 广发证券 | 12,900 | 301,860.00 | 0.64 |
| 42 | 000977 | 浪潮信息 | 4,300 | 301,000.00 | 0.64 |
| 43 | 002709 | 天赐材料 | 5,800 | 298,294.00 | 0.63 |
| 44 | 002938 | 鹏鼎控股 | 2,800 | 295,064.00 | 0.62 |
| 45 | 300498 | 温氏股份 | 23,760 | 292,723.20 | 0.62 |
| 46 | 000425 | 徐工机械 | 36,000 | 291,240.00 | 0.61 |
| 47 | 300033 | 同花顺 | 1,180 | 284,380.00 | 0.60 |
| 48 | 002466 | 天齐锂业 | 4,400 | 269,808.00 | 0.57 |
| 49 | 000938 | 紫光股份 | 9,080 | 262,048.80 | 0.55 |
| 50 | 002837 | 英维克 | 3,200 | 254,592.00 | 0.54 |
| 51 | 000568 | 泸州老窖 | 3,252 | 252,095.04 | 0.53 |
| 52 | 002049 | 紫光国微 | 2,820 | 250,275.00 | 0.53 |
| 53 | 300442 | 润泽科技 | 3,000 | 249,210.00 | 0.53 |
| 54 | 002241 | 歌尔股份 | 10,700 | 241,071.00 | 0.51 |
| 55 | 002600 | 领益智造 | 13,500 | 234,090.00 | 0.49 |
| 56 | 002179 | 中航光电 | 4,814 | 222,406.80 | 0.47 |
| 57 | 000408 | 藏格矿业 | 3,100 | 214,892.00 | 0.45 |
| 58 | 002027 | 分众传媒 | 43,100 | 208,604.00 | 0.44 |
| 59 | 002625 | 光启技术 | 6,800 | 206,176.00 | 0.44 |
| 60 | 000630 | 铜陵有色 | 32,300 | 205,428.00 | 0.43 |
| 61 | 000807 | 云铝股份 | 8,900 | 197,046.00 | 0.42 |
| 62 | 002422 | 科伦药业 | 4,900 | 188,748.00 | 0.40 |
| 63 | 002001 | 新和成 | 6,568 | 186,662.56 | 0.39 |
| 64 | 002648 | 卫星化学 | 7,400 | 173,826.00 | 0.37 |
| 65 | 300015 | 爱尔眼科 | 19,078 | 157,584.28 | 0.33 |
| 66 | 000166 | 申万宏源 | 35,700 | 157,080.00 | 0.33 |
| 67 | 000538 | 云南白药 | 3,220 | 152,531.40 | 0.32 |
| 68 | 300418 | 昆仑万维 | 3,700 | 149,332.00 | 0.32 |
| 69 | 000625 | 长安汽车 | 20,428 | 146,468.76 | 0.31 |
| 70 | 000157 | 中联重科 | 20,740 | 144,557.80 | 0.31 |
| 71 | 002311 | 海大集团 | 3,102 | 138,380.22 | 0.29 |
| 72 | 002236 | 大华股份 | 8,000 | 131,920.00 | 0.28 |
| 73 | 000975 | 山金国际 | 7,200 | 122,400.00 | 0.26 |
| 74 | 002493 | 荣盛石化 | 11,100 | 119,325.00 | 0.25 |
| 75 | 002736 | 国信证券 | 11,800 | 117,882.00 | 0.25 |
| 76 | 003816 | 中国广核 | 29,800 | 116,518.00 | 0.25 |
| 77 | 000768 | 中航西飞 | 5,500 | 112,640.00 | 0.24 |
| 78 | 002601 | 龙佰集团 | 6,700 | 110,416.00 | 0.23 |
| 79 | 301269 | 华大九天 | 900 | 107,478.00 | 0.23 |
| 80 | 000301 | 东方盛虹 | 9,300 | 106,485.00 | 0.22 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 81 | 300866 | 安克创新 | 1,000 | 104,500.00 | 0.22 |
| 82 | 000895 | 双汇发展 | 4,500 | 100,800.00 | 0.21 |
| 83 | 002920 | 德赛西威 | 1,200 | 97,800.00 | 0.21 |
| 84 | 002304 | 洋河股份 | 2,500 | 95,375.00 | 0.20 |
| 85 | 001979 | 招商蛇口 | 14,402 | 92,604.86 | 0.20 |
| 86 | 000963 | 华东医药 | 3,164 | 88,971.68 | 0.19 |
| 87 | 000002 | 万科 A | 28,700 | 84,952.00 | 0.18 |
| 88 | 000617 | 中油资本 | 11,120 | 73,280.80 | 0.15 |
| 89 | 001965 | 招商公路 | 7,900 | 72,364.00 | 0.15 |
| 90 | 302132 | 中航成飞 | 1,100 | 64,152.00 | 0.14 |
| 91 | 000999 | 华润三九 | 2,632 | 59,193.68 | 0.12 |
| 92 | 300999 | 金龙鱼 | 2,457 | 57,149.82 | 0.12 |
| 93 | 000596 | 古井贡酒 | 600 | 47,880.00 | 0.10 |
| 94 | 001280 | 中国铀业 | 700 | 46,690.00 | 0.10 |
| 95 | 000708 | 中信特钢 | 3,500 | 44,170.00 | 0.09 |
| 96 | 300765 | 石药创新 | 1,500 | 40,845.00 | 0.09 |
| 97 | 001391 | 国货航 | 6,300 | 25,641.00 | 0.05 |
| 98 | 300979 | 华利集团 | 800 | 23,800.00 | 0.05 |
| 99 | 001872 | 招商港口 | 1,000 | 19,430.00 | 0.04 |
| 100 | 001289 | 龙源电力 | 600 | 9,378.00 | 0.02 |

### 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 | 301413 | 安培龙 | 91 | 6,450.08 | 0.01 |
| 2 | 301578 | 辰奕智能 | 74 | 1,508.86 | 0.00 |
| 3 | 001387 | 雪祺电气 | 60 | 766.20 | 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 | 000988 | 华工科技 | 576,268.00 | 1.10 |
| 2 | 301308 | 江波龙 | 564,051.00 | 1.08 |
| 3 | 300502 | 新易盛 | 454,099.00 | 0.87 |
| 4 | 002353 | 杰瑞股份 | 384,613.00 | 0.74 |
| 5 | 002602 | 世纪华通 | 371,245.00 | 0.71 |
| 6 | 000657 | 中钨高新 | 313,913.00 | 0.60 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 7 | 002709 | 天赐材料 | 293,038.00 | 0.56 |
| 8 | 000807 | 云铝股份 | 251,198.00 | 0.48 |
| 9 | 002837 | 英维克 | 228,756.00 | 0.44 |
| 10 | 000630 | 铜陵有色 | 228,447.00 | 0.44 |
| 11 | 002916 | 深南电路 | 118,217.00 | 0.23 |
| 12 | 300308 | 中际旭创 | 90,136.00 | 0.17 |
| 13 | 000776 | 广发证券 | 69,514.00 | 0.13 |
| 14 | 002384 | 东山精密 | 65,581.00 | 0.13 |
| 15 | 000063 | 中兴通讯 | 61,477.00 | 0.12 |
| 16 | 300014 | 亿纬锂能 | 60,209.00 | 0.12 |
| 17 | 002594 | 比亚迪 | 52,863.00 | 0.10 |
| 18 | 001280 | 中国铀业 | 48,877.00 | 0.09 |
| 19 | 002371 | 北方华创 | 48,002.00 | 0.09 |
| 20 | 002463 | 沪电股份 | 44,898.00 | 0.09 |

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票；

2、基金持有的股票分类为交易性金融资产的，本项的“累计买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 300502 | 新易盛 | 624,400.00 | 1.19 |
| 2 | 300750 | 宁德时代 | 287,698.00 | 0.55 |
| 3 | 300661 | 圣邦股份 | 206,014.74 | 0.39 |
| 4 | 000333 | 美的集团 | 140,428.00 | 0.27 |
| 5 | 300476 | 胜宏科技 | 132,522.00 | 0.25 |
| 6 | 300308 | 中际旭创 | 115,900.00 | 0.22 |
| 7 | 002252 | 上海莱士 | 114,181.00 | 0.22 |
| 8 | 002594 | 比亚迪 | 100,911.00 | 0.19 |
| 9 | 000786 | 北新建材 | 97,516.00 | 0.19 |
| 10 | 000661 | 长春高新 | 91,835.00 | 0.18 |
| 11 | 002384 | 东山精密 | 88,201.00 | 0.17 |
| 12 | 002475 | 立讯精密 | 86,311.00 | 0.16 |
| 13 | 300059 | 东方财富 | 78,996.00 | 0.15 |
| 14 | 300628 | 亿联网络 | 76,846.80 | 0.15 |
| 15 | 300896 | 爱美客 | 74,939.20 | 0.14 |
| 16 | 300274 | 阳光电源 | 73,996.00 | 0.14 |
| 17 | 300760 | 迈瑞医疗 | 73,323.00 | 0.14 |
| 18 | 000876 | 新希望 | 69,664.00 | 0.13 |
| 19 | 300122 | 智飞生物 | 69,151.00 | 0.13 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 20 | 300832 | 新产业 | 68,663.00 | 0.13 |

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 | 5,338,110.00 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 4,541,034.74 |

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

本基金本报告期末未持有债券。

## 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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

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

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本报告期内，本基金投资国债期货符合既定的投资政策和投资目的。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

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

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

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

### 7.12.2

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

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

金额单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
| --- | --- | --- |
| 1 | 存出保证金 | 223.00 |
| 2 | 应收清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |

| | | |
|---|---|---|
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 223.00 |

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

## §8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 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 |
| 881 | 61,790.87 | 34,536,990.00 | 63.44% | 19,900,770.00 | 36.56% |

### 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负责人持有本开放式基金 | 0 |
| 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(2019 年 11 月 7 日)基金份额总额 | 981,171,871.00 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 71,937,760.00 |
| 本报告期基金总申购份额 | 15,000,000.00 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 32,500,000.00 |
| 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 | 54,437,760.00 |

# §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。

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

## 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、公募基金托管业务的重大诉讼事项。

## 10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

## 10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

### 10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人无受调查或处罚等情况。

### 10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

### 10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

报告期内，本基金托管人的基金托管业务部门无受调查或处罚等情况。

### 10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，本基金托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

## 10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

### 10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 招商证券 | 4 | 9,879,144.74 | 100.00% | 986.77 | 100.00% | - |
| 方正证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国联民生 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | 1 | - | - | - | - | - |

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 |
| 招商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国联民生 | - | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | - | - | - | - | - | - |

## 10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|---|---|---|---|
| 1 | 招商基金管理有限公司旗下基金 2025 年第 4 季度报告提示性公告 | 中国证券报及基金管理人网站 | 2026-01-21 |
| 2 | 招商深证 100 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第 4 季度报告 | 基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2026-01-21 |
| 3 | 招商基金管理有限公司旗下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 | 招商基金管理有限公司旗下部分基金增加中国国际金融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 | 2026-03-09 |
| 5 | 招商基金管理有限公司旗下基金 2025 年年度报告提示性公告 | 中国证券报及基金管理人网站 | 2026-03-31 |
| 6 | 招商深证 100 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年年度报告 | 基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2026-03-31 |
| 7 | 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 |
| 8 | 招商深证 100 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 |
| 9 | 招商基金管理有限公司关于提醒投资者持续完善客户身份信息的公告 | 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 |

# §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深证 100 交易型开放式指数证券投资基金设立的文件；

3、《招商深证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；

4、《招商深证 100 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；

5、《招商深证 100 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