

招商国证 2000 指数增强型证券投资基金 2024 年中期报告

2024 年 06 月 30 日

基金管理人：招商基金管理有限公司

基金托管人：财通证券股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现	6
§4 管理人报告.....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作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	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	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	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）	12
6.1 资产负债表.....	12
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	36
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	37
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	56
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	57
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.....	57
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.....	57
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	57
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	57

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	57
7.12 投资组合报告附注.....	58
§8 基金份额持有人信息.....	59
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	59
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	59
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.....	59
§9 开放式基金份额变动.....	60
§10 重大事件揭示.....	60
10.1 基金份额持有人大会决议.....	60
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.....	60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	60
10.4 基金投资策略的改变.....	60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	60
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	60
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	61
10.8 其他重大事件.....	61
§11 备查文件目录.....	62
11.1 备查文件目录.....	62
11.2 存放地点.....	62
11.3 查阅方式.....	63

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	招商国证 2000 指数增强型证券投资基金	
基金简称	招商国证 2000 指数增强	
基金主代码	018786	
交易代码	018786	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 8 月 1 日	
基金管理人	招商基金管理有限公司	
基金托管人	财通证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	237,235,204.97 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	招商国证 2000 指数增强 A	招商国证 2000 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	018786	018787
报告期末下属分级基金的份额总额	64,139,511.52 份	173,095,693.45 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过数量化的投资方法与严格的投资纪律约束，力求实现超越标的指数的业绩表现，谋求基金资产的长期增值。同时力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%。
投资策略	本基金作为增强指类型基金，以跟踪标的指数为主，一般情况下保持各类资产配置的基本稳定，与此同时，在综合考量系统性风险、各类资产收益风险比值、股票资产估值、流动性要求、申购赎回以及分红等因素后，在有效控制基金跟踪误差的前提下，对基金资产进行合理配置。 本基金其他主要投资策略包括：股票投资策略、债券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、股票期权投资策略、资产支持证券投资策略、存托凭证投资策略、参与融资及转融通证券出借业务投资策略。
业绩比较基准	国证 2000 指数收益率 \times 95% + 中国人民银行人民币活期存款利率（税后） \times 5%
风险收益特征	本基金是股票型基金，其预期风险收益水平高于债券型基金及货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	招商基金管理有限公司	财通证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名 潘西里	马坚岗

	联系电话	0755-83196666	0571-85080360
	电子邮箱	cmf@cmfchina.com	cttg@ctsec.com
客户服务电话		400-887-9555	95336
传真		0755-83196475	0571-87830199
注册地址		深圳市福田区深南大道 7088 号	浙江省杭州市西湖区天目山路 198 号财通双冠大厦西楼
办公地址		深圳市福田区深南大道 7088 号	浙江省杭州市西湖区天目山路 198 号财通双冠大厦西楼
邮政编码		518040	310007
法定代表人		王小青	章启诚

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

1、招商国证 2000 指数增强 A

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024 年 1 月 1 日 - 2024 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-8,261,004.64
本期利润	-5,110,319.90
加权平均基金份额本期利润	-0.0624
本期加权平均净值利润率	-6.66%
本期基金份额净值增长率	-9.92%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-6,597,093.99
期末可供分配基金份额利润	-0.1029
期末基金资产净值	57,542,417.53
期末基金份额净值	0.8971
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-10.29%

2、招商国证 2000 指数增强 C

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024 年 1 月 1 日 - 2024 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-20,053,091.05
本期利润	-29,939,112.34
加权平均基金份额本期利润	-0.1470
本期加权平均净值利润率	-15.71%
本期基金份额净值增长率	-10.10%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-18,368,968.47
期末可供分配基金份额利润	-0.1061
期末基金资产净值	154,726,724.98
期末基金份额净值	0.8939
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-10.61%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

招商国证 2000 指数增强 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-6.92%	1.29%	-8.54%	1.50%	1.62%	-0.21%
过去三个月	-7.36%	1.47%	-11.29%	1.60%	3.93%	-0.13%
过去六个月	-9.92%	1.95%	-18.67%	2.02%	8.75%	-0.07%
自基金合同生效起至今	-10.29%	1.49%	-23.34%	1.63%	13.05%	-0.14%

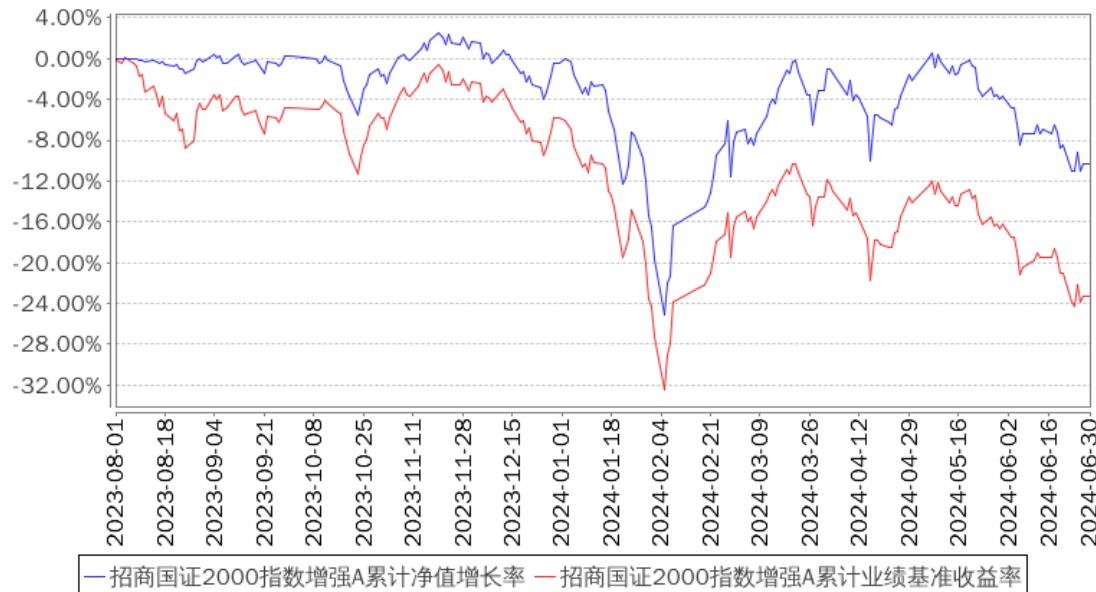
招商国证 2000 指数增强 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-6.94%	1.29%	-8.54%	1.50%	1.60%	-0.21%
过去三个月	-7.44%	1.47%	-11.29%	1.60%	3.85%	-0.13%

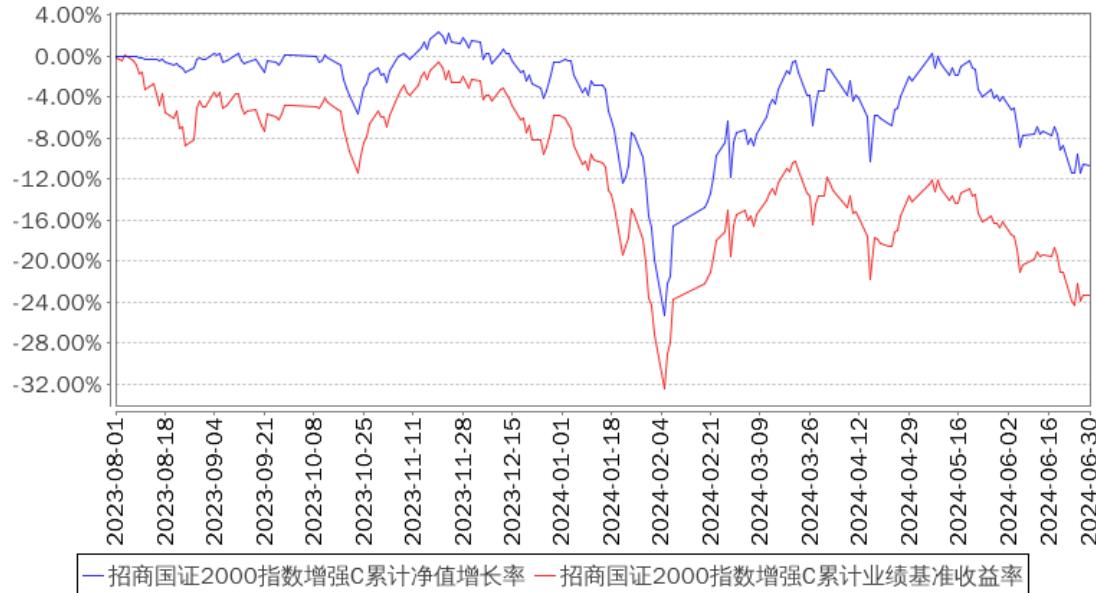
过去六个月	-10.10%	1.95%	-18.67%	2.02%	8.57%	-0.07%
自基金合同生效起至今	-10.61%	1.49%	-23.34%	1.63%	12.73%	-0.14%

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

招商国证2000指数增强A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



招商国证2000指数增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金合同于 2023 年 8 月 1 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		
邓童	本基金 基金经理	2023 年 8 月 1 日	-	11	男，硕士。2012 年 7 月加入招商基金管理有限公司量化投资部，曾任研究员。现任招商中证 500 指数增强型证券投资基金、招商中证大宗商品股票指数证券投资基金（LOF）、招商中证煤炭等权指数证券投资基金、招商北证 50 成份指数型发起式证券投资基金、招商中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、招商中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金、招商国证 2000 指数增强型证券投资基金、招商安和债券型证券投资基金、招商安康债券型证券投资基金、招商中证红利低波动 100 指数型发起式证券投资基金、招商上证科创板 50 成份增强策略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
邓童	公募基金	11	10,444,447,022.27	2021 年 11 月 23 日
	私募资产管理计划	1	950,516,933.52	2013 年 11 月 26 日
	其他组合	-	-	-
	合计	12	11,394,963,955.79	-

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 6 次，为旗下指数及量化组合因投资策略需要而发生反向交易。报告期内未发现有可能导致不公平交易和利益输送的重大异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，国证 2000 指数持续下跌，在经历了年初的流动性冲击后，市场的流动性有所恢复但依然未恢复至前期高位，国证 2000 在经历了一季度末的反弹后，二季度难以持续，自 5 月起持续下跌。小盘股在 2024 年上半年显著弱于大盘股，虽然短期内的流动性担忧缓解，但市场对小盘股尤其是微盘股的长期展望偏向悲观。从风格上看，价值风格在本报告期内依然阶段性占优，成长风格一度有弱反弹态势，但在指数整体下跌背景下依然难有大的起色。本基金相对基准有一定的超额收益，不过由于基准下跌幅度较大，本报告期净值依然下跌。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金 A 类份额净值增长率为 -9.92%，同期业绩基准增长率为 -18.67%，C 类份额净值增长率为 -10.10%，同期业绩基准增长率为 -18.67%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望市场，流动性是否能够恢复成为中小盘个股反弹的关键，这需要有增量资金进入或前期退出资金的信心恢复，核心还是需要经济基本面的企稳以及对非市场因素担忧的消退。指数整体涨跌难以预测，相对基准的超额收益就显得更加重要，在策略方面，本产品会继续采用多模型配置的框架，力争在较低的跟踪误差下创造出持续的超额收益。我们也将持续加强新因子及新方法的研究，尽力保持策略超额收益的持续性和多元性。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

投资和研究部门以及基金核算部共同负责关注相关投资品种的动态，评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投

资品种；投资和研究部门定期审核公允价值的确认和计量；研究部提出合理的数量分析模型对需要进行估值测算或者调整的投资品种进行公允价值定价与计量并定期对估值政策和程序进行评价，以保证其持续适用；基金核算部定期审核估值政策和程序的一致性，并负责与托管行沟通估值调整事项；风险管理部负责估值委员会工作流程中的风险控制；法律合规部负责日常的基金估值调整结果的事后复核监督工作；法律合规部与基金核算部共同负责估值调整事项的信息披露工作。

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，本托管人严格遵守法律法规、基金合同，认真履行了应尽的义务，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

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，本托管人严格按照相关法律法规和基金合同的规定对基金管理人的投资运作进行监督。在基金资产净值的计算、利润分配等方面，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

本托管人对本中期报告中主要财务指标、投资组合报告、财务会计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：招商国证 2000 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	13,582,796.25	19,890,966.60
结算备付金		1,548,155.33	7,202,847.31
存出保证金		466,368.00	2,397,336.00
交易性金融资产	6.4.7.2	197,015,735.88	331,946,093.78
其中：股票投资		196,924,943.90	331,928,092.72
基金投资		-	-
债券投资		90,791.98	18,001.06
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		478,862.79	12,746,839.03
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		213,091,918.25	374,184,082.72
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-

交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		499,161.29	927,798.10
应付管理人报酬		177,992.85	280,681.58
应付托管费		17,799.27	28,068.16
应付销售服务费		51,674.15	84,126.30
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.34	2.27
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	76,147.84	11,000.00
负债合计		822,775.74	1,331,676.41
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	237,235,204.97	374,856,163.43
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-24,966,062.46	-2,003,757.12
净资产合计		212,269,142.51	372,852,406.31
负债和净资产总计		213,091,918.25	374,184,082.72

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，招商国证 2000 指数增强 A 份额净值 0.8971 元，基金份额总额 64,139,511.52 份；招商国证 2000 指数增强 C 份额净值 0.8939 元，基金份额总额 173,095,693.45 份；总份额合计 237,235,204.97 份。

6.2 利润表

会计主体：招商国证 2000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-33,135,081.52
1.利息收入		90,507.00
其中：存款利息收入	6.4.7.9	90,507.00
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)		-26,534,306.65
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-30,922,038.88

基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	71.47
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	1,147,511.49
股利收益	6.4.7.15	3,240,149.27
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	-6,735,336.55
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	44,054.68
减: 二、营业总支出		1,914,350.72
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	1,328,617.38
其中: 暂估管理人报酬		-
2.托管费	6.4.10.2.2	132,861.73
3.销售服务费	6.4.10.2.3	378,026.07
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		5,173.20
8.其他费用	6.4.7.19	69,672.34
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-35,049,432.24
减: 所得税费用		-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-35,049,432.24
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-35,049,432.24

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

6.3 净资产变动表

会计主体: 招商国证 2000 指数增强型证券投资基金

本报告期: 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	374,856,163.43	-	-2,003,757.12	372,852,406.31
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	374,856,163.43	-	-2,003,757.12	372,852,406.31
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-137,620,958.46	-	-22,962,305.34	-160,583,263.80
(一)、综合收益总额	-	-	-35,049,432.24	-35,049,432.24
(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）	-137,620,958.46	-	12,087,126.90	-125,533,831.56
其中：1.基金申购款	176,972,081.08	-	-11,443,073.09	165,529,007.99
2.基金赎回款	-314,593,039.54	-	23,530,199.99	-291,062,839.55
(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	237,235,204.97	-	-24,966,062.46	212,269,142.51

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

徐勇欧志明何剑萍

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

招商国证 2000 指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人招商基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《招商国证 2000 指数增强型证

券投资基金基金合同》及其他有关法律法规的规定，经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2023]1312 号文准予公开募集注册。本基金为契约型开放式基金，存续期限为不定期。本基金根据是否收取认购费、申购费、销售服务费的不同，将基金份额分为 A 类基金份额和 C 类基金份额。本基金首次设立募集基金份额为 627,649,377.84 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(23)第 00199 号验资报告。《招商国证 2000 指数增强型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)于 2023 年 8 月 1 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，基金托管人为财通证券股份有限公司(以下简称“财通证券”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及截至报告期末最新公告的招募说明书的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票和存托凭证(包括主板、创业板及其他中国证监会允许投资的股票和存托凭证)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券、可分离交易可转债、可交换债券及其他中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款、通知存款及其他银行存款)、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。本基金可根据相关法律法规的规定，参与融资业务和转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金投资于股票、存托凭证资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于标的指数成份券(含存托凭证，下同)及其备选成份券(含存托凭证，下同)的资产不低于非现金基金资产的 80%;每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。股指期货、国债期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照国家相关法律法规或监管机构的规定执行。如果法律法规对基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，待履行相应程序后，以变更后的规定为准。

本基金的业绩比较基准为：国证 2000 指数收益率×95%+中国人民银行人民币活期存款利率(税后)×5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)、中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在

具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策，会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期间未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

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

(1) 证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税；2018 年 1 月 1 日起，公开募集证券投资基金管理人运营公开募集证

券投资基金过程中发生的资管产品运营业务，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	2,361,448.86
等于： 本金	2,360,918.08
加： 应计利息	530.78
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	11,221,347.39
等于： 本金	11,220,152.58
加： 应计利息	1,194.81
减： 坏账准备	-
合计	13,582,796.25

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

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

		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		209,244,854.22	-	196,924,943.90	-12,319,910.32
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	75,499.52	74.51	90,791.98	15,217.95
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	75,499.52	74.51	90,791.98	15,217.95
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		209,320,353.74	74.51	197,015,735.88	-12,304,692.37

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日				备注	
	合同/名义金额	公允价值		资产		
		负债	资产			
利率衍生工具	-	-	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	-	-	
权益衍生工具	4,046,050.00	-	-	-	-	
其中：股指期货投资	4,046,050.00	-	-	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	-	-	
合计	4,046,050.00	-	-	-	-	

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IM2407	IM2407	4.00	3,886,400.00	-159,650.00
合计				-159,650.00
减：可抵销期货暂收款				-159,650.00
净额				-

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	69,672.34
其他	6,475.50
合计	76,147.84

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

招商国证 2000 指数增强 A		
项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	83,563,012.88	83,563,012.88
本期申购	52,680,980.46	52,680,980.46
本期赎回（以“-”号填列）	-72,104,481.82	-72,104,481.82
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期末	64,139,511.52	64,139,511.52

招商国证 2000 指数增强 C		
项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	291,293,150.55	291,293,150.55
本期申购	124,291,100.62	124,291,100.62
本期赎回（以“-”号填列）	-242,488,557.72	-242,488,557.72
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期末	173,095,693.45	173,095,693.45

注：本期申购含红利再投、转换入份（金）额，本期赎回含转换出份（金）额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

招商国证 2000 指数增强 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计

上年度末	1,104,994.87	-1,444,515.94	-339,521.07
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	1,104,994.87	-1,444,515.94	-339,521.07
本期利润	-8,261,004.64	3,150,684.74	-5,110,319.90
本期基金份额交易产生的变动数	1,732,350.51	-2,879,603.53	-1,147,253.02
其中：基金申购款	-392,332.95	-4,214,452.63	-4,606,785.58
基金赎回款	2,124,683.46	1,334,849.10	3,459,532.56
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-5,423,659.26	-1,173,434.73	-6,597,093.99

招商国证 2000 指数增强 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,366,702.06	-5,030,938.11	-1,664,236.05
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	3,366,702.06	-5,030,938.11	-1,664,236.05
本期利润	-20,053,091.05	-9,886,021.29	-29,939,112.34
本期基金份额交易产生的变动数	1,485,380.53	11,748,999.39	13,234,379.92
其中：基金申购款	-4,197,456.81	-2,638,830.70	-6,836,287.51
基金赎回款	5,682,837.34	14,387,830.09	20,070,667.43
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-15,201,008.46	-3,167,960.01	-18,368,968.47

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	30,258.56
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	39,320.19
其他	20,928.25
合计	90,507.00

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-30,922,038.88

股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-30,922,038.88

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	669,892,486.38
减：卖出股票成本总额	699,653,752.48
减：交易费用	1,160,772.78
买卖股票差价收入	-30,922,038.88

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无股票赎回差价收入。

6.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无股票申购差价收入。

6.4.7.10.5 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内无证券出借差价收入。

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	71.47
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	71.47

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

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	1,147,511.49

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	3,240,149.27

其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	3,240,149.27

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-6,454,736.55
——股票投资	-6,469,954.50
——债券投资	15,217.95
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-280,600.00
——权证投资	-
——期货投资	-280,600.00
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-6,735,336.55

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	44,054.68
合计	44,054.68

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	10,000.00
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
合计	69,672.34

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报告批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

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

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
财通证券	532,079,507.28	42.92%

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	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
财通证券	319,977.00	42.87%	-	-

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、本报告期内，基金对该类交易的佣金的计算方式是按合同约定的佣金率计算。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供研究成果和市场信息等证券综合服务，并不收取额外对价。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,328,617.38
其中：应支付销售机构的客户维护费	357,412.14
应支付基金管理人的净管理费	971,205.24
应支付投资顾问的投资顾问费	-

注：支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值×1.00%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日基金管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.00\% \div \text{当年天数}$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	132,861.73

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

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

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	招商国证 2000 指数增强 A	招商国证 2000 指数增强 C	合计
财通证券	-	187,294.99	187,294.99
招商基金管理有限公司	-	428.61	428.61
招商银行	-	1,651.92	1,651.92
招商证券	-	130.52	130.52
合计	-	189,506.04	189,506.04

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

其计算公式为：

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期内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

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
财通证券-活期	2,361,448.86	30,258.56

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

单位：人民币元

本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
财通证券	301539	宏鑫科技	新股获配	3,607	38,378.48
招商证券	688692	达梦数据	新股获配	872	75,829.12

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001359	平安电工	2024 年 3 月 19 日	6 个月	新股流通受限	17.39	20.60	184	3,199.76	3,790.40	-
001379	腾达科技	2024 年 1 月 11 日	6 个月	新股流通受限	16.98	13.48	213	3,616.74	2,871.24	-
001387	雪祺电气	2024 年 1 月 4 日	6 个月	新股流通受限	15.38	15.25	173	2,045.54	2,638.25	-
001389	广合科技	2024 年 3 月 26 日	6 个月	新股流通受限	17.43	34.56	222	3,869.46	7,672.32	-
301392	汇成真空	2024 年 5 月 28 日	6 个月	新股流通受限	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-
301502	华阳智能	2024 年 1 月 26 日	6 个月	新股流通受限	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-
301536	星宸科技	2024 年 3 月 20 日	6 个月	新股流通受限	16.16	32.27	481	7,772.96	15,521.87	-
301538	骏鼎达	2024 年 3 月 13 日	6 个月	新股流通受限	55.82	91.24	149	5,972.74	13,594.76	-
301539	宏鑫科技	2024 年 4 月 3 日	6 个月	新股流通受限	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-
301565	中仑新材	2024 年 6 月 13 日	6 个月	新股流通受限	11.88	18.98	538	6,391.44	10,211.24	-
301566	达利凯普	2023 年 12 月 22 日	6 个月	新股流通受限	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	-
301580	爱迪特	2024 年 6 月 19	6 个月	新股流通受限	44.95	65.93	141	6,337.95	9,296.13	-

		日								
301587	中瑞股份	2024 年 3 月 27 日	6 个月	新股流通受限	21.73	25.26	306	6,649.38	7,729.56	-
301588	美新科技	2024 年 3 月 6 日	6 个月	新股流通受限	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-
301589	诺瓦星云	2024 年 2 月 1 日	6 个月	新股流通受限	126.89	188.01	675	47,583.75	126,906.75	-
301591	肯特股份	2024 年 2 月 20 日	6 个月	新股流通受限	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	-
603082	北自科技	2024 年 1 月 23 日	6 个月	新股流通受限	21.28	29.49	107	2,276.96	3,155.43	-
603285	键邦股份	2024 年 6 月 28 日	1 个月内(含)	新股流通受限	18.65	18.65	1,052	19,619.80	19,619.80	-
603285	键邦股份	2024 年 6 月 28 日	6 个月	新股流通受限	18.65	18.65	117	2,182.05	2,182.05	-
603312	西典新能	2024 年 1 月 4 日	6 个月	新股流通受限	29.02	25.36	120	3,482.40	3,043.20	-
603325	博隆技术	2024 年 1 月 3 日	6 个月	新股流通受限	72.46	68.06	49	3,550.54	3,334.94	-
603341	龙旗科技	2024 年 2 月 23 日	6 个月	新股流通受限	26.00	37.49	149	3,874.00	5,586.01	-
603344	星德胜	2024 年 3 月 13 日	6 个月	新股流通受限	19.18	22.66	167	3,203.06	3,784.22	-
603350	安乃达	2024 年 6 月 26 日	1 个月内(含)	新股流通受限	20.56	20.56	945	19,429.20	19,429.20	-
603350	安乃达	2024 年 6 月 26 日	6 个月	新股流通受限	20.56	20.56	106	2,179.36	2,179.36	-
603375	盛景微	2024 年 1 月 17 日	6 个月	新股流通受限	38.18	38.90	72	2,748.96	2,800.80	-
603381	永臻股份	2024 年	6 个月	新股流通	23.35	25.13	98	2,288.30	2,462.74	-

		6月19日		受限						
688530	欧莱新材	2024年4月29日	6个月	新股流通受限	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-
688584	上海合晶	2024年2月1日	6个月	新股流通受限	22.66	15.89	504	11,420.64	8,008.56	-
688691	灿芯股份	2024年4月2日	6个月	新股流通受限	19.86	42.51	247	4,905.42	10,499.97	-
688692	达梦数据	2024年6月4日	6个月	新股流通受限	86.96	174.93	88	7,652.48	15,393.84	-
688695	中创股份	2024年3月6日	6个月	新股流通受限	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-
688709	成都华微	2024年1月31日	6个月	新股流通受限	15.69	18.79	627	9,837.63	11,781.33	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

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

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	90,791.98	18,001.06
未评级	-	-
合计	90,791.98	18,001.06

注：上述评级均由经中国证监会核准从事证券市场资信评级业务的评级机构做出。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	13,582,796.25	-	-	-	13,582,796.25
结算备付金	1,548,155.33	-	-	-	1,548,155.33
存出保证金	-	-	-	466,368.00	466,368.00
交易性金融资产	-	22,702.61	68,089.37	196,924,943.90	197,015,735.88
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	-	-	-	478,862.79	478,862.79
应收清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	15,130,951.58	22,702.61	68,089.37	197,870,174.69	213,091,918.25
负债					
应付赎回款	-	-	-	499,161.29	499,161.29
应付管理人报酬	-	-	-	177,992.85	177,992.85
应付托管费	-	-	-	17,799.27	17,799.27
应付清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	51,674.15	51,674.15
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	0.34	0.34
其他负债	-	-	-	76,147.84	76,147.84
负债总计	-	-	-	822,775.74	822,775.74
利率敏感度缺口	15,130,951.58	22,702.61	68,089.37	197,047,398.95	212,269,142.51
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

资产					
货币资金	19,890,966.60	-	-	-	19,890,966.60
结算备付金	7,202,847.31	-	-	-	7,202,847.31
存出保证金	-	-	-	2,397,336.00	2,397,336.00
交易性金融资产	-	18,001.06	-	331,928,092.72	331,946,093.78
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	-	-	-	12,746,839.03	12,746,839.03
应收清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	27,093,813.91	18,001.06	-	347,072,267.75	374,184,082.72
负债					
应付赎回款	-	-	-	927,798.10	927,798.10
应付管理人报酬	-	-	-	280,681.58	280,681.58
应付托管费	-	-	-	28,068.16	28,068.16
应付清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	84,126.30	84,126.30
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	2.27	2.27
其他负债	-	-	-	11,000.00	11,000.00
负债总计	-	-	-	1,331,676.41	1,331,676.41
利率敏感度缺口	27,093,813.91	18,001.06	-	345,740,591.34	372,852,406.31

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1.若市场利率平行上升或下降 50 个基点		
	2.其他市场变量保持不变		
	3.仅存在公允价值变动对基金资产净值的影响		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	1. 市场利率平行上升 50 个基点	-2,368.34	-427.39
	2. 市场利率平行下降 50 个基点	2,445.23	440.01

6.4.13.4.2 其他价格风险

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

6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	196,924,943.90	92.77	331,928,092.72	89.02
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	196,924,943.90	92.77	331,928,092.72	89.02

6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 若对市场价格敏感的权益性投资的市场价格上升或下降 5%		
	2. 其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	1. 权益性投资的市场价格上升 5%	9,846,247.20	16,596,404.64
	2. 权益性投资的市场价格下降 5%	-9,846,247.20	-16,596,404.64

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：

除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	196,646,001.52	331,398,788.52
第二层次	43,410.41	254,899.06
第三层次	326,323.95	292,406.20
合计	197,015,735.88	331,946,093.78

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无需要说明有助于理解和分析会计报表的其他事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	196,924,943.90	92.41

	其中：股票	196,924,943.90	92.41
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	90,791.98	0.04
	其中：债券	90,791.98	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	15,130,951.58	7.10
8	其他各项资产	945,230.79	0.44
9	合计	213,091,918.25	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	472,833.00	0.22
B	采矿业	3,930,790.00	1.85
C	制造业	120,041,366.33	56.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,828,606.70	4.16
E	建筑业	3,081,501.00	1.45
F	批发和零售业	6,447,110.60	3.04
G	交通运输、仓储和邮政业	5,558,218.60	2.62
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,255,426.59	3.42
J	金融业	2,844,907.20	1.34
K	房地产业	2,145,667.00	1.01
L	租赁和商务服务业	504,793.00	0.24
M	科学研究和技术服务业	1,379,323.00	0.65
N	水利、环境和公共设施管理业	712,181.00	0.34
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	659,882.00	0.31
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,080,239.00	0.51
S	综合	470,844.00	0.22
	合计	165,413,689.02	77.93

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	2,443,620.00	1.15
C	制造业	22,554,021.05	10.63
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	994,434.00	0.47
E	建筑业	794,903.00	0.37
F	批发和零售业	234,319.00	0.11
G	交通运输、仓储和邮政业	611,547.00	0.29
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,355,822.71	0.64
J	金融业	742,933.00	0.35
K	房地产业	478,696.00	0.23
L	租赁和商务服务业	696,043.12	0.33
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	61,050.00	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	543,866.00	0.26
S	综合	-	-
	合计	31,511,254.88	14.84

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600420	国药现代	129,800	1,386,264.00	0.65
2	002106	莱宝高科	117,000	1,275,300.00	0.60
3	002635	安洁科技	80,300	1,239,832.00	0.58
4	002533	金杯电工	121,800	1,211,910.00	0.57
5	002543	万和电气	119,500	1,190,220.00	0.56
6	002048	宁波华翔	91,900	1,189,186.00	0.56
7	002139	拓邦股份	103,500	1,099,170.00	0.52

8	603337	杰克股份	41,600	1,094,912.00	0.52
9	000600	建投能源	169,600	1,068,480.00	0.50
10	603897	长城科技	60,700	1,065,285.00	0.50
11	603995	甬金股份	59,600	1,044,192.00	0.49
12	000551	创元科技	116,700	1,018,791.00	0.48
13	000030	富奥股份	202,900	996,239.00	0.47
14	300492	华图山鼎	10,500	989,100.00	0.47
15	603408	建霖家居	74,400	981,336.00	0.46
16	601609	金田股份	171,900	972,954.00	0.46
17	002020	京新药业	92,200	965,334.00	0.45
18	600114	东睦股份	66,600	958,374.00	0.45
19	002479	富春环保	269,200	947,584.00	0.45
20	002376	新北洋	175,200	944,328.00	0.44
21	002540	亚太科技	178,300	943,207.00	0.44
22	002267	陕天然气	122,800	928,368.00	0.44
23	002004	华邦健康	242,900	923,020.00	0.43
24	601566	九牧王	107,700	906,834.00	0.43
25	603051	鹿山新材	41,500	905,945.00	0.43
26	002393	力生制药	57,280	905,596.80	0.43
27	603727	博迈科	67,200	884,352.00	0.42
28	300409	道氏技术	102,900	880,824.00	0.41
29	603368	柳药集团	49,900	873,250.00	0.41
30	300870	欧陆通	20,100	871,938.00	0.41
31	002073	软控股份	116,200	858,718.00	0.40
32	000550	江铃汽车	38,500	835,835.00	0.39
33	002043	兔宝宝	80,400	833,748.00	0.39
34	002322	理工能科	51,700	828,234.00	0.39
35	000544	中原环保	103,600	815,332.00	0.38
36	300532	今天国际	66,200	813,598.00	0.38
37	002204	大连重工	189,600	809,592.00	0.38
38	603112	华翔股份	77,013	809,406.63	0.38
39	603612	索通发展	62,900	802,604.00	0.38
40	300233	金城医药	53,500	798,220.00	0.38
41	002026	山东威达	94,500	784,350.00	0.37
42	600997	开滦股份	111,400	764,204.00	0.36
43	300396	迪瑞医疗	37,400	759,594.00	0.36
44	002215	诺普信	101,300	754,685.00	0.36
45	600261	阳光照明	271,800	733,860.00	0.35
46	002440	闰土股份	134,900	732,507.00	0.35
47	603618	杭电股份	167,100	731,898.00	0.34
48	605338	巴比食品	54,800	726,100.00	0.34
49	000727	冠捷科技	349,500	719,970.00	0.34
50	000900	现代投资	190,700	697,962.00	0.33

51	002788	鹭燕医药	87,800	691,864.00	0.33
52	002441	众业达	90,400	685,232.00	0.32
53	301219	腾远钴业	17,400	665,724.00	0.31
54	600835	上海机电	56,100	645,711.00	0.30
55	605007	五洲特纸	51,000	644,130.00	0.30
56	603113	金能科技	116,400	636,708.00	0.30
57	002583	海能达	154,800	630,036.00	0.30
58	300679	电连技术	15,400	619,542.00	0.29
59	603699	纽威股份	35,800	612,896.00	0.29
60	603558	健盛集团	61,400	610,930.00	0.29
61	300857	协创数据	10,700	609,900.00	0.29
62	603355	莱克电气	28,200	609,120.00	0.29
63	603515	欧普照明	35,100	608,634.00	0.29
64	601886	江河集团	124,300	606,584.00	0.29
65	300791	仙乐健康	24,070	606,564.00	0.29
66	300428	立中集团	32,600	606,034.00	0.29
67	300378	鼎捷软件	37,000	601,990.00	0.28
68	000913	钱江摩托	38,100	600,456.00	0.28
69	605018	长华集团	65,900	597,054.00	0.28
70	002534	西子洁能	59,300	593,593.00	0.28
71	600510	黑牡丹	159,400	592,968.00	0.28
72	603301	振德医疗	28,400	592,424.00	0.28
73	002455	百川股份	64,300	590,274.00	0.28
74	600761	安徽合力	27,100	586,444.00	0.28
75	002035	华帝股份	94,100	586,243.00	0.28
76	600894	广日股份	50,800	584,200.00	0.28
77	600433	冠豪高新	214,500	568,425.00	0.27
78	603516	淳中科技	18,000	568,260.00	0.27
79	000828	东莞控股	62,800	565,828.00	0.27
80	600269	赣粤高速	109,000	563,530.00	0.27
81	002462	嘉事堂	51,200	560,128.00	0.26
82	600987	航民股份	79,200	559,152.00	0.26
83	002225	濮耐股份	136,600	558,694.00	0.26
84	605305	中际联合	21,500	554,485.00	0.26
85	600618	氯碱化工	63,100	554,018.00	0.26
86	600480	凌云股份	55,900	549,497.00	0.26
87	000567	海德股份	97,520	547,087.20	0.26
88	000019	深粮控股	95,000	545,300.00	0.26
89	000680	山推股份	55,000	509,850.00	0.24
90	600742	一汽富维	68,300	508,835.00	0.24
91	002897	意华股份	13,500	508,410.00	0.24
92	002948	青岛银行	150,700	507,859.00	0.24
93	002884	凌霄泵业	26,200	503,040.00	0.24

94	603323	苏农银行	104,200	501,202.00	0.24
95	605368	蓝天燃气	36,500	497,860.00	0.23
96	003006	百亚股份	20,900	495,330.00	0.23
97	002327	富安娜	49,200	494,460.00	0.23
98	000612	焦作万方	76,000	494,000.00	0.23
99	002833	弘亚数控	27,000	492,480.00	0.23
100	600971	恒源煤电	41,200	491,928.00	0.23
101	600285	羚锐制药	20,300	491,463.00	0.23
102	300893	松原股份	17,200	491,404.00	0.23
103	000899	赣能股份	50,800	491,236.00	0.23
104	300181	佐力药业	32,400	489,888.00	0.23
105	603277	银都股份	16,300	489,652.00	0.23
106	603871	嘉友国际	27,600	488,244.00	0.23
107	688076	诺泰生物	6,226	487,371.28	0.23
108	300415	伊之密	23,400	486,252.00	0.23
109	000923	河钢资源	28,200	485,604.00	0.23
110	601500	通用股份	90,900	485,406.00	0.23
111	600750	江中药业	21,000	485,310.00	0.23
112	605333	沪光股份	17,400	484,590.00	0.23
113	601038	一拖股份	30,600	483,786.00	0.23
114	002315	焦点科技	17,900	482,584.00	0.23
115	601101	昊华能源	52,500	482,475.00	0.23
116	300705	九典制药	18,020	481,854.80	0.23
117	002022	科华生物	85,200	481,380.00	0.23
118	300783	三只松鼠	22,000	481,140.00	0.23
119	002752	昇兴股份	94,900	480,194.00	0.23
120	301061	匠心家居	10,170	477,583.20	0.22
121	000521	长虹美菱	62,982	477,403.56	0.22
122	002036	联创电子	70,600	476,550.00	0.22
123	002416	爱施德	53,000	469,050.00	0.22
124	688408	中信博	5,060	465,924.80	0.22
125	601369	陕鼓动力	56,900	456,338.00	0.21
126	601107	四川成渝	86,200	452,550.00	0.21
127	300381	溢多利	72,700	446,378.00	0.21
128	603711	香飘飘	32,200	445,970.00	0.21
129	600502	安徽建工	103,700	445,910.00	0.21
130	002768	国恩股份	23,800	445,060.00	0.21
131	000028	国药一致	13,800	444,774.00	0.21
132	300953	震裕科技	8,200	444,440.00	0.21
133	600866	星湖科技	80,200	442,704.00	0.21
134	603983	丸美股份	16,000	440,480.00	0.21
135	000682	东方电子	39,600	437,184.00	0.21
136	600694	大商股份	25,860	434,706.60	0.20

137	603008	喜临门	24,800	429,784.00	0.20
138	600172	黄河旋风	228,100	428,828.00	0.20
139	002567	唐人神	79,800	427,728.00	0.20
140	603055	台华新材	42,200	427,486.00	0.20
141	300547	川环科技	26,100	426,735.00	0.20
142	605183	确成股份	27,500	425,150.00	0.20
143	603661	恒林股份	10,000	422,100.00	0.20
144	002034	旺能环境	32,400	421,524.00	0.20
145	603258	电魂网络	26,100	421,515.00	0.20
146	002404	嘉欣丝绸	79,600	421,084.00	0.20
147	600284	浦东建设	78,200	417,588.00	0.20
148	002911	佛燃能源	45,455	415,458.70	0.20
149	603393	新天然气	11,900	413,406.00	0.19
150	600966	博汇纸业	85,500	408,690.00	0.19
151	600605	汇通能源	16,400	408,032.00	0.19
152	002544	普天科技	21,700	405,573.00	0.19
153	603611	诺力股份	23,800	405,552.00	0.19
154	002100	天康生物	58,400	404,712.00	0.19
155	002955	鸿合科技	17,300	404,474.00	0.19
156	600993	马应龙	15,100	402,717.00	0.19
157	603178	圣龙股份	18,500	396,455.00	0.19
158	600551	时代出版	55,900	395,772.00	0.19
159	002969	嘉美包装	138,000	393,300.00	0.19
160	605377	华旺科技	29,540	391,405.00	0.18
161	002947	恒铭达	11,100	390,720.00	0.18
162	688399	硕世生物	5,718	386,651.16	0.18
163	000543	皖能电力	43,600	385,860.00	0.18
164	603878	武进不锈	58,900	385,206.00	0.18
165	300360	炬华科技	22,600	384,200.00	0.18
166	601339	百隆东方	73,700	383,977.00	0.18
167	300638	广和通	22,400	383,040.00	0.18
168	002270	华明装备	17,100	380,304.00	0.18
169	601963	重庆银行	48,900	378,975.00	0.18
170	600320	振华重工	110,300	377,226.00	0.18
171	600368	五洲交通	105,280	375,849.60	0.18
172	600012	皖通高速	26,900	375,793.00	0.18
173	603713	密尔克卫	7,000	374,640.00	0.18
174	300194	福安药业	100,100	374,374.00	0.18
175	002140	东华科技	48,100	372,775.00	0.18
176	601975	招商南油	103,800	372,642.00	0.18
177	002171	楚江新材	56,500	372,335.00	0.18
178	000429	粤高速 A	35,600	370,596.00	0.17
179	603619	中曼石油	15,800	370,036.00	0.17

180	603977	国泰集团	36,300	369,171.00	0.17
181	601020	华钰矿业	28,800	368,640.00	0.17
182	603530	神马电力	13,900	368,211.00	0.17
183	603507	振江股份	11,200	367,584.00	0.17
184	000801	四川九洲	36,700	367,000.00	0.17
185	603283	赛腾股份	4,800	366,720.00	0.17
186	002521	齐峰新材	31,200	366,600.00	0.17
187	688676	金盘科技	7,000	365,050.00	0.17
188	601918	新集能源	37,400	364,650.00	0.17
189	000990	诚志股份	49,000	364,560.00	0.17
190	301004	嘉益股份	4,000	364,000.00	0.17
191	603358	华达科技	12,600	363,510.00	0.17
192	300304	云意电气	55,700	362,607.00	0.17
193	605090	九丰能源	12,500	362,500.00	0.17
194	600133	东湖高新	34,700	362,268.00	0.17
195	601702	华峰铝业	19,800	361,548.00	0.17
196	000922	佳电股份	30,300	361,479.00	0.17
197	603556	海兴电力	7,700	360,591.00	0.17
198	000099	中信海直	22,200	360,528.00	0.17
199	002839	张家港行	89,600	360,192.00	0.17
200	688575	亚辉龙	15,422	359,641.04	0.17
201	000603	盛达资源	30,400	359,632.00	0.17
202	002379	宏创控股	61,300	359,218.00	0.17
203	002840	华统股份	21,600	358,344.00	0.17
204	600818	中路股份	25,600	357,888.00	0.17
205	000526	学大教育	5,800	357,280.00	0.17
206	002922	伊戈尔	16,300	356,318.00	0.17
207	002749	国光股份	23,600	354,944.00	0.17
208	605016	百龙创园	17,320	352,808.40	0.17
209	301345	涛涛车业	6,400	352,640.00	0.17
210	600331	宏达股份	60,800	352,032.00	0.17
211	603009	北特科技	19,500	349,635.00	0.16
212	300908	仲景食品	12,522	347,861.16	0.16
213	300049	福瑞股份	6,900	347,346.00	0.16
214	600461	洪城环境	29,800	345,084.00	0.16
215	300779	惠城环保	7,100	343,640.00	0.16
216	603367	辰欣药业	24,400	340,136.00	0.16
217	301030	仕净科技	13,780	339,263.60	0.16
218	300708	聚灿光电	37,400	336,600.00	0.16
219	000532	华金资本	27,400	330,444.00	0.16
220	600162	香江控股	247,000	328,510.00	0.15
221	002845	同兴达	24,800	327,856.00	0.15
222	603039	泛微网络	10,300	327,128.00	0.15

223	600300	维维股份	136,000	326,400.00	0.15
224	000090	天健集团	80,500	323,610.00	0.15
225	002590	万安科技	24,500	322,910.00	0.15
226	603966	法兰泰克	46,500	319,455.00	0.15
227	603399	吉翔股份	51,600	319,404.00	0.15
228	300463	迈克生物	28,000	318,640.00	0.15
229	603610	麒盛科技	32,000	316,160.00	0.15
230	603050	科林电气	13,020	315,865.20	0.15
231	688018	乐鑫科技	3,200	315,776.00	0.15
232	301015	百洋医药	13,300	312,949.00	0.15
233	002296	辉煌科技	30,000	309,300.00	0.15
234	002469	三维化学	54,100	308,370.00	0.15
235	605196	华通线缆	29,200	307,184.00	0.14
236	002827	高争民爆	14,000	306,460.00	0.14
237	002003	伟星股份	24,300	304,965.00	0.14
238	002438	江苏神通	28,000	302,680.00	0.14
239	605098	行动教育	7,100	302,602.00	0.14
240	000906	浙商中拓	44,500	299,930.00	0.14
241	605296	神农集团	8,500	298,775.00	0.14
242	000657	中钨高新	32,600	297,964.00	0.14
243	002807	江阴银行	79,000	297,830.00	0.14
244	688183	生益电子	15,364	297,754.32	0.14
245	603319	湘油泵	18,600	297,414.00	0.14
246	002130	沃尔核材	21,000	296,520.00	0.14
247	300842	帝科股份	7,600	294,880.00	0.14
248	002449	国星光电	41,200	293,344.00	0.14
249	002645	华宏科技	45,800	291,288.00	0.14
250	688484	南芯科技	7,400	274,540.00	0.13
251	002483	润邦股份	59,800	269,698.00	0.13
252	300187	永清环保	64,300	269,417.00	0.13
253	002250	联化科技	56,100	269,280.00	0.13
254	603992	松霖科技	14,500	266,655.00	0.13
255	600979	广安爱众	78,800	264,768.00	0.12
256	002688	金河生物	72,500	263,175.00	0.12
257	600169	太原重工	143,300	262,239.00	0.12
258	000541	佛山照明	53,700	261,519.00	0.12
259	605198	安德利	9,900	261,360.00	0.12
260	300320	海达股份	31,500	257,040.00	0.12
261	688208	道通科技	10,613	256,197.82	0.12
262	002757	南兴股份	21,100	254,255.00	0.12
263	605266	健之佳	9,700	251,715.00	0.12
264	600167	联美控股	48,000	250,080.00	0.12
265	600210	紫江企业	46,700	248,444.00	0.12

266	601700	风范股份	56,300	247,157.00	0.12
267	300349	金卡智能	20,700	246,744.00	0.12
268	000589	贵州轮胎	48,100	243,867.00	0.11
269	600125	铁龙物流	40,400	241,188.00	0.11
270	688553	汇宇制药	19,400	240,948.00	0.11
271	600572	康恩贝	53,900	240,933.00	0.11
272	688219	会通股份	31,000	240,870.00	0.11
273	603987	康德莱	39,400	240,734.00	0.11
274	600458	时代新材	23,800	240,380.00	0.11
275	000821	京山轻机	21,200	240,196.00	0.11
276	300133	华策影视	38,900	238,846.00	0.11
277	300259	新天科技	94,200	238,326.00	0.11
278	002053	云南能投	19,600	236,964.00	0.11
279	688590	新致软件	18,253	235,463.70	0.11
280	002668	TCL 智家	25,500	231,030.00	0.11
281	603583	捷昌驱动	11,200	228,256.00	0.11
282	603489	八方股份	8,400	226,632.00	0.11
283	002014	永新股份	23,800	225,624.00	0.11
284	300533	冰川网络	16,250	225,550.00	0.11
285	601595	上海电影	11,400	225,492.00	0.11
286	603929	亚翔集成	9,400	224,660.00	0.11
287	000555	神州信息	24,100	224,612.00	0.11
288	600187	国中水务	161,500	221,255.00	0.10
289	601002	晋亿实业	75,600	219,240.00	0.10
290	600283	钱江水利	17,200	217,408.00	0.10
291	002588	史丹利	28,700	216,111.00	0.10
292	300120	经纬辉开	40,600	210,714.00	0.10
293	301091	深城交	7,750	210,335.00	0.10
294	603165	荣晟环保	19,800	210,276.00	0.10
295	601311	骆驼股份	26,100	209,322.00	0.10
296	600479	千金药业	20,500	208,485.00	0.10
297	600094	大名城	53,800	208,206.00	0.10
298	603809	豪能股份	25,604	206,880.32	0.10
299	603508	思维列控	11,000	206,250.00	0.10
300	000777	中核科技	13,400	204,752.00	0.10
301	603730	岱美股份	20,380	202,577.20	0.10
302	600067	冠城大通	115,400	201,950.00	0.10
303	301291	明阳电气	6,700	201,335.00	0.09
304	603663	三祥新材	13,900	200,021.00	0.09
305	002550	千红制药	37,000	199,430.00	0.09
306	002737	葵花药业	8,500	198,730.00	0.09
307	600171	上海贝岭	11,800	196,824.00	0.09
308	603035	常熟汽饰	15,500	196,540.00	0.09

309	002869	金溢科技	6,100	196,481.00	0.09
310	600035	楚天高速	45,000	193,050.00	0.09
311	603890	春秋电子	20,900	189,354.00	0.09
312	300228	富瑞特装	33,900	185,094.00	0.09
313	603766	隆鑫通用	26,800	181,704.00	0.09
314	300441	鲍斯股份	30,500	180,865.00	0.09
315	000888	峨眉山 A	15,800	172,062.00	0.08
316	603960	克来机电	8,100	170,910.00	0.08
317	002083	孚日股份	40,200	170,046.00	0.08
318	300850	新强联	11,200	168,224.00	0.08
319	300421	力星股份	18,300	167,811.00	0.08
320	300403	汉宇集团	24,500	167,335.00	0.08
321	605186	健麾信息	7,300	163,958.00	0.08
322	600982	宁波能源	45,900	163,863.00	0.08
323	000950	重药控股	33,300	162,171.00	0.08
324	000957	中通客车	15,400	162,008.00	0.08
325	601811	新华文轩	11,500	161,115.00	0.08
326	688100	威胜信息	4,200	160,230.00	0.08
327	002332	仙琚制药	13,900	158,599.00	0.07
328	300596	利安隆	5,600	151,928.00	0.07
329	002375	亚厦股份	46,200	150,150.00	0.07
330	605365	立达信	9,400	149,178.00	0.07
331	002782	可立克	13,400	148,472.00	0.07
332	002573	清新环境	37,700	145,899.00	0.07
333	000411	英特集团	14,900	143,487.00	0.07
334	603855	华荣股份	6,400	141,504.00	0.07
335	600976	健民集团	2,800	141,400.00	0.07
336	000833	粤桂股份	30,000	140,400.00	0.07
337	301391	卡莱特	3,200	140,096.00	0.07
338	603985	恒润股份	11,700	139,230.00	0.07
339	002895	川恒股份	7,600	139,156.00	0.07
340	688556	高测股份	11,600	137,924.00	0.06
341	600216	浙江医药	12,300	135,054.00	0.06
342	600595	中孚实业	54,100	134,709.00	0.06
343	688190	云路股份	1,800	134,478.00	0.06
344	688519	南亚新材	5,139	131,404.23	0.06
345	688502	茂莱光学	1,400	130,214.00	0.06
346	301051	信濠光电	4,960	130,100.80	0.06
347	600525	长园集团	30,500	129,930.00	0.06
348	000925	众合科技	19,600	128,968.00	0.06
349	002090	金智科技	14,900	128,736.00	0.06
350	000690	宝新能源	24,900	126,990.00	0.06
351	601126	四方股份	6,600	126,852.00	0.06

352	002993	奥海科技	3,400	126,480.00	0.06
353	603167	渤海轮渡	15,400	125,818.00	0.06
354	002067	景兴纸业	46,200	125,664.00	0.06
355	688663	新风光	5,400	125,658.00	0.06
356	002979	雷赛智能	6,900	125,580.00	0.06
357	603889	新澳股份	16,200	125,388.00	0.06
358	300627	华测导航	4,200	125,370.00	0.06
359	000910	大亚圣象	20,400	125,256.00	0.06
360	300102	乾照光电	19,500	125,190.00	0.06
361	600531	豫光金铅	19,400	124,936.00	0.06
362	002741	光华科技	13,900	124,822.00	0.06
363	601827	三峰环境	14,700	124,803.00	0.06
364	605599	菜百股份	9,800	124,754.00	0.06
365	002212	天融信	25,600	124,672.00	0.06
366	002160	常铝股份	46,000	124,660.00	0.06
367	300193	佳士科技	16,800	124,656.00	0.06
368	300490	华自科技	17,400	124,584.00	0.06
369	688798	艾为电子	2,200	124,564.00	0.06
370	002279	久其软件	28,900	124,559.00	0.06
371	603299	苏盐井神	13,100	124,450.00	0.06
372	002669	康达新材	15,100	124,273.00	0.06
373	600268	国电南自	21,740	124,135.40	0.06
374	002615	哈尔斯	20,000	124,000.00	0.06
375	603111	康尼机电	21,300	123,966.00	0.06
376	300687	赛意信息	8,900	123,888.00	0.06
377	000517	荣安地产	46,200	123,816.00	0.06
378	603053	成都燃气	12,800	123,648.00	0.06
379	300080	易成新能	42,900	123,552.00	0.06
380	002554	惠博普	56,900	123,473.00	0.06
381	603333	尚纬股份	39,700	123,467.00	0.06
382	300377	赢时胜	24,300	123,444.00	0.06
383	300384	三联虹普	9,400	123,328.00	0.06
384	600775	南京熊猫	15,400	123,200.00	0.06
385	603693	江苏新能	10,600	123,172.00	0.06
386	300369	绿盟科技	24,100	123,151.00	0.06
387	002063	远光软件	23,500	123,140.00	0.06
388	600691	阳煤化工	72,000	123,120.00	0.06
389	600874	创业环保	22,000	122,980.00	0.06
390	605555	德昌股份	6,600	122,826.00	0.06
391	300379	东方通	15,200	122,816.00	0.06
392	601512	中新集团	16,100	122,682.00	0.06
393	002818	富森美	10,000	122,600.00	0.06
394	300035	中科电气	14,400	122,544.00	0.06

395	002838	道恩股份	13,500	122,310.00	0.06
396	603906	龙蟠科技	15,700	122,303.00	0.06
397	002302	西部建设	23,500	122,200.00	0.06
398	600512	腾达建设	64,600	122,094.00	0.06
399	603239	浙江仙通	8,900	122,019.00	0.06
400	002126	银轮股份	7,000	121,870.00	0.06
401	601199	江南水务	25,000	121,750.00	0.06
402	002242	九阳股份	11,600	121,568.00	0.06
403	300841	康华生物	2,400	121,536.00	0.06
404	600810	神马股份	19,600	121,520.00	0.06
405	300681	英搏尔	9,300	121,272.00	0.06
406	600587	新华医疗	7,700	121,198.00	0.06
407	603520	司太立	12,700	121,158.00	0.06
408	600609	金杯汽车	34,900	121,103.00	0.06
409	000901	航天科技	13,800	120,888.00	0.06
410	300453	三鑫医疗	18,900	120,771.00	0.06
411	300598	诚迈科技	4,300	120,744.00	0.06
412	300145	中金环境	47,700	119,250.00	0.06
413	603803	瑞斯康达	16,000	113,600.00	0.05
414	002790	瑞尔特	12,100	109,263.00	0.05
415	002988	豪美新材	6,800	104,380.00	0.05
416	603949	雪龙集团	8,600	96,836.00	0.05
417	600501	航天晨光	7,100	91,377.00	0.04
418	001201	东瑞股份	4,900	90,846.00	0.04
419	603171	税友股份	3,300	89,232.00	0.04
420	688766	普冉股份	904	87,841.68	0.04
421	600710	苏美达	10,500	85,575.00	0.04
422	601528	瑞丰银行	17,900	84,488.00	0.04
423	301155	海力风电	2,100	84,483.00	0.04
424	002662	京威股份	27,600	83,904.00	0.04
425	601860	紫金银行	33,500	83,750.00	0.04
426	000404	长虹华意	15,700	83,681.00	0.04
427	600908	无锡银行	15,700	83,524.00	0.04
428	300109	新开源	7,200	83,376.00	0.04
429	002233	塔牌集团	11,400	83,334.00	0.04
430	600467	好当家	58,600	83,212.00	0.04
431	603421	鼎信通讯	18,600	82,956.00	0.04
432	605009	豪悦护理	2,100	82,824.00	0.04
433	002724	海洋王	18,600	82,770.00	0.04
434	601279	英利汽车	22,100	82,433.00	0.04
435	603915	国茂股份	8,000	82,320.00	0.04
436	300662	科锐国际	5,100	82,263.00	0.04
437	301260	格力博	6,000	81,720.00	0.04

438	688138	清溢光电	3,800	81,700.00	0.04
439	600571	信雅达	7,300	76,212.00	0.04
440	002837	英维克	3,530	75,506.70	0.04
441	300047	天源迪科	11,000	71,940.00	0.03
442	002851	麦格米特	2,700	69,768.00	0.03
443	603916	苏博特	10,000	67,100.00	0.03
444	300903	科翔股份	8,100	66,744.00	0.03
445	002075	沙钢股份	17,400	65,598.00	0.03
446	603067	振华股份	5,400	62,964.00	0.03
447	002238	天威视讯	7,700	60,445.00	0.03
448	000897	津滨发展	29,300	60,065.00	0.03
449	300272	开能健康	12,200	59,780.00	0.03
450	688351	微电生理	2,700	59,508.00	0.03
451	600789	鲁抗医药	8,500	59,500.00	0.03
452	300758	七彩化学	5,500	59,125.00	0.03
453	605577	龙版传媒	3,800	59,014.00	0.03
454	300917	特发服务	1,700	58,769.00	0.03
455	000766	通化金马	3,600	58,284.00	0.03
456	002970	锐明技术	1,600	57,648.00	0.03
457	000737	北方铜业	6,200	57,536.00	0.03
458	603416	信捷电气	2,000	57,160.00	0.03
459	688336	三生国健	2,800	56,980.00	0.03
460	300284	苏交科	7,000	56,560.00	0.03
461	300881	盛德鑫泰	2,200	56,518.00	0.03
462	605208	永茂泰	9,000	56,070.00	0.03
463	300648	星云股份	3,300	56,034.00	0.03
464	001267	汇绿生态	10,600	55,862.00	0.03
465	688550	瑞联新材	2,400	55,656.00	0.03
466	002135	东南网架	14,000	55,440.00	0.03
467	002110	三钢闽光	18,700	55,165.00	0.03
468	600308	华泰股份	17,300	54,322.00	0.03
469	688321	微芯生物	3,000	52,800.00	0.02
470	601579	会稽山	4,700	48,128.00	0.02
471	688596	正帆科技	1,400	46,200.00	0.02
472	000919	金陵药业	6,800	42,568.00	0.02
473	002677	浙江美大	5,200	42,172.00	0.02
474	600064	南京高科	6,700	40,669.00	0.02
475	603360	百傲化学	3,440	40,420.00	0.02
476	001323	慕思股份	1,400	40,278.00	0.02
477	300307	慈星股份	6,700	39,865.00	0.02
478	600186	莲花健康	11,600	39,788.00	0.02
479	603309	维力医疗	3,600	39,636.00	0.02
480	002556	辉隆股份	9,500	39,615.00	0.02

481	300942	易瑞生物	6,600	39,534.00	0.02
482	603158	腾龙股份	5,600	39,424.00	0.02
483	002642	荣联科技	7,600	39,216.00	0.02
484	600459	贵研铂业	2,900	39,179.00	0.02
485	002154	报喜鸟	7,100	38,624.00	0.02
486	002303	美盈森	15,800	38,078.00	0.02
487	601137	博威合金	2,200	33,528.00	0.02
488	002614	奥佳华	5,600	30,968.00	0.01
489	300119	瑞普生物	1,400	19,068.00	0.01
490	600251	冠农股份	2,600	18,824.00	0.01
491	688095	福昕软件	402	18,415.62	0.01
492	688368	晶丰明源	188	10,415.20	0.00
493	688606	奥泰生物	131	6,174.03	0.00
494	688150	莱特光电	166	3,220.40	0.00
495	688699	明微电子	91	2,889.25	0.00
496	688369	致远互联	134	2,107.82	0.00
497	300787	海能实业	80	992.80	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	603681	永冠新材	84,200	1,073,550.00	0.51
2	601717	郑煤机	57,400	849,520.00	0.40
3	600623	华谊集团	138,500	800,530.00	0.38
4	603228	景旺电子	20,800	661,440.00	0.31
5	000930	中粮科技	126,100	634,283.00	0.30
6	000032	深桑达 A	42,200	632,156.00	0.30
7	603680	今创集团	93,000	613,800.00	0.29
8	002835	同为股份	34,100	575,949.00	0.27
9	600967	内蒙一机	78,100	562,320.00	0.26
10	002236	大华股份	35,800	553,468.00	0.26
11	002228	合兴包装	223,400	522,756.00	0.25
12	600066	宇通客车	19,400	500,520.00	0.24
13	601019	山东出版	41,100	485,802.00	0.23
14	000921	海信家电	14,100	454,584.00	0.21
15	600790	轻纺城	140,400	452,088.00	0.21
16	002661	克明食品	59,700	445,959.00	0.21
17	000830	鲁西化工	35,400	410,286.00	0.19
18	002249	大洋电机	85,800	405,834.00	0.19
19	300743	天地数码	28,100	380,474.00	0.18

20	002155	湖南黄金	20,700	374,670.00	0.18
21	300573	兴齐眼药	2,280	373,920.00	0.18
22	301032	新柴股份	54,700	367,037.00	0.17
23	600101	明星电力	29,400	361,620.00	0.17
24	300308	中际旭创	2,600	358,488.00	0.17
25	688226	威腾电气	20,482	358,025.36	0.17
26	603499	翔港科技	26,500	357,220.00	0.17
27	300502	新易盛	3,300	348,315.00	0.16
28	000688	国城矿业	36,200	344,624.00	0.16
29	601231	环旭电子	21,200	340,260.00	0.16
30	600050	中国联通	71,400	335,580.00	0.16
31	688109	品茗科技	12,056	329,731.60	0.16
32	600027	华电国际	46,200	320,628.00	0.15
33	600370	三房巷	239,700	314,007.00	0.15
34	002555	三七互娱	24,000	313,200.00	0.15
35	601919	中远海控	19,800	306,702.00	0.14
36	300218	安利股份	20,300	306,124.00	0.14
37	601001	晋控煤业	17,100	282,492.00	0.13
38	603551	奥普家居	28,500	279,300.00	0.13
39	002128	电投能源	12,600	265,860.00	0.13
40	002016	世荣兆业	41,300	254,408.00	0.12
41	688578	艾力斯	3,978	253,557.72	0.12
42	002010	传化智联	62,900	241,536.00	0.11
43	002463	沪电股份	6,600	240,900.00	0.11
44	600098	广州发展	37,300	238,720.00	0.11
45	301285	鸿日达	9,100	237,419.00	0.11
46	601567	三星医疗	6,700	234,500.00	0.11
47	603615	茶花股份	22,000	231,660.00	0.11
48	002318	久立特材	9,800	228,634.00	0.11
49	603979	金诚信	4,500	227,385.00	0.11
50	000426	兴业银锡	16,600	225,428.00	0.11
51	000620	新华联	130,400	224,288.00	0.11
52	301105	鸿铭股份	8,800	219,912.00	0.10
53	600150	中国船舶	5,100	207,621.00	0.10
54	300905	宝丽迪	7,200	204,552.00	0.10
55	601229	上海银行	27,600	200,376.00	0.09
56	300577	开润股份	9,600	199,968.00	0.09
57	300207	欣旺达	12,500	189,625.00	0.09
58	600282	南钢股份	37,400	186,252.00	0.09
59	605099	共创草坪	9,600	181,536.00	0.09
60	301012	扬电科技	7,300	180,748.00	0.09
61	601168	西部矿业	9,600	172,320.00	0.08
62	601225	陕西煤业	6,600	170,082.00	0.08

63	000338	潍柴动力	10,300	167,272.00	0.08
64	601872	招商轮船	19,700	166,465.00	0.08
65	002989	中天精装	10,700	162,747.00	0.08
66	000933	神火股份	7,900	159,817.00	0.08
67	688456	有研粉材	5,800	154,686.00	0.07
68	600386	北巴传媒	52,600	146,754.00	0.07
69	300751	迈为股份	1,200	143,376.00	0.07
70	688267	中触媒	7,200	142,992.00	0.07
71	688685	迈信林	5,789	141,541.05	0.07
72	002653	海思科	4,600	141,220.00	0.07
73	300290	荣科科技	15,000	139,650.00	0.07
74	002629	仁智股份	89,600	138,880.00	0.07
75	601156	东航物流	6,800	138,380.00	0.07
76	000786	北新建材	4,600	136,436.00	0.06
77	001288	运机集团	4,900	135,632.00	0.06
78	300394	天孚通信	1,520	134,398.40	0.06
79	600482	中国动力	6,600	128,568.00	0.06
80	603579	荣泰健康	8,300	128,318.00	0.06
81	301589	诺瓦星云	675	126,906.75	0.06
82	601288	农业银行	29,100	126,876.00	0.06
83	601169	北京银行	21,700	126,728.00	0.06
84	002456	欧菲光	16,200	126,522.00	0.06
84	300562	乐心医疗	14,200	126,522.00	0.06
85	001207	联科科技	8,600	124,872.00	0.06
86	600398	海澜之家	13,500	124,740.00	0.06
87	603725	天安新材	20,020	124,324.20	0.06
88	600000	浦发银行	15,100	124,273.00	0.06
89	600177	雅戈尔	17,400	123,888.00	0.06
90	603160	汇顶科技	1,800	123,750.00	0.06
91	300877	金春股份	11,400	123,576.00	0.06
92	601058	赛轮轮胎	8,800	123,200.00	0.06
93	603225	新凤鸣	7,900	123,161.00	0.06
94	600686	金龙汽车	16,700	122,912.00	0.06
95	000887	中鼎股份	10,000	122,400.00	0.06
96	000717	中南股份	72,300	122,187.00	0.06
97	000157	中联重科	15,900	122,112.00	0.06
98	601666	平煤股份	10,900	122,080.00	0.06
99	000881	中广核技	18,900	121,716.00	0.06
100	002078	太阳纸业	8,700	121,365.00	0.06
101	601233	桐昆股份	7,600	121,296.00	0.06
102	000726	鲁泰 A	18,300	121,146.00	0.06
103	002705	新宝股份	8,600	121,002.00	0.06
104	000528	柳工	10,800	120,852.00	0.06

105	688159	有方科技	3,182	120,470.52	0.06
106	002906	华阳集团	4,500	120,420.00	0.06
107	601088	中国神华	2,700	119,799.00	0.06
108	002916	深南电路	1,100	116,347.00	0.05
109	300871	回盛生物	10,100	96,354.00	0.05
110	000626	远大控股	21,100	87,565.00	0.04
111	603365	水星家纺	5,400	84,510.00	0.04
112	600183	生益科技	4,000	84,240.00	0.04
113	601988	中国银行	18,200	84,084.00	0.04
114	600566	济川药业	2,600	82,446.00	0.04
115	600545	卓郎智能	61,100	81,874.00	0.04
116	002601	龙佰集团	4,400	81,708.00	0.04
117	300840	酷特智能	8,800	81,400.00	0.04
118	300652	雷迪克	4,100	81,303.00	0.04
119	600038	中直股份	1,800	73,998.00	0.03
120	600681	百川能源	21,800	73,466.00	0.03
121	002602	世纪华通	21,200	72,716.00	0.03
122	300254	仟源医药	8,700	68,382.00	0.03
123	002074	国轩高科	3,500	67,025.00	0.03
124	603298	杭叉集团	3,400	66,776.00	0.03
125	688132	邦彦技术	3,780	65,583.00	0.03
126	301259	艾布鲁	3,000	61,050.00	0.03
127	600690	海尔智家	2,100	59,598.00	0.03
128	300719	安达维尔	3,500	59,325.00	0.03
129	600273	嘉化能源	8,300	59,262.00	0.03
130	601921	浙版传媒	7,600	58,064.00	0.03
131	002152	广电运通	5,400	56,484.00	0.03
132	688278	特宝生物	1,000	53,550.00	0.03
133	002065	东华软件	11,800	53,336.00	0.03
134	600718	东软集团	6,100	50,447.00	0.02
135	002766	索菱股份	9,300	45,012.00	0.02
136	300866	安克创新	630	44,862.30	0.02
137	601328	交通银行	5,600	41,832.00	0.02
138	002420	毅昌科技	9,100	41,496.00	0.02
139	600582	天地科技	5,900	40,651.00	0.02
140	600817	宇通重工	4,900	40,180.00	0.02
141	603819	神力股份	3,800	39,900.00	0.02
142	601216	君正集团	10,800	39,852.00	0.02
143	600737	中粮糖业	4,100	39,319.00	0.02
144	002773	康弘药业	1,800	38,970.00	0.02
145	601166	兴业银行	2,200	38,764.00	0.02
146	603115	海星股份	3,700	38,480.00	0.02
147	603235	天新药业	1,600	38,448.00	0.02

148	603201	常润股份	1,500	36,300.00	0.02
149	301299	卓创资讯	700	29,400.00	0.01
150	603381	永臻股份	977	27,074.74	0.01
151	603285	键邦股份	1,169	21,801.85	0.01
152	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.01
153	301536	星宸科技	481	15,521.87	0.01
154	688692	达梦数据	88	15,393.84	0.01
155	600819	耀皮玻璃	3,300	13,926.00	0.01
156	301538	骏鼎达	149	13,594.76	0.01
157	688709	成都华微	627	11,781.33	0.01
158	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
159	301565	中仑新材	538	10,211.24	0.00
160	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
161	301580	爱迪特	141	9,296.13	0.00
162	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
163	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
164	688584	上海合晶	504	8,008.56	0.00
165	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
166	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
167	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
168	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
169	603341	龙旗科技	149	5,586.01	0.00
170	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
171	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
172	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
173	601956	东贝集团	1,100	5,038.00	0.00
174	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
175	603344	星德胜	167	3,784.22	0.00
176	603325	博隆技术	49	3,334.94	0.00
177	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
178	603312	西典新能	120	3,043.20	0.00
179	603004	鼎龙科技	171	2,898.45	0.00
180	001379	腾达科技	213	2,871.24	0.00
181	603375	盛景微	72	2,800.80	0.00
182	001387	雪祺电气	173	2,638.25	0.00
183	603373	安邦护卫	88	2,419.12	0.00
184	301578	辰奕智能	53	2,097.21	0.00
185	603231	索宝蛋白	45	766.80	0.00
186	002687	乔治白	129	541.80	0.00
187	301413	安培龙	13	537.55	0.00
188	001358	兴欣新材	22	451.44	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	002043	兔宝宝	2,418,542.00	0.65
2	605338	巴比食品	1,894,938.00	0.51
3	603520	司太立	1,881,438.00	0.50
4	300102	乾照光电	1,815,857.00	0.49
5	002543	万和电气	1,806,784.00	0.48
6	301219	腾远钴业	1,779,516.70	0.48
7	603112	华翔股份	1,715,335.10	0.46
8	600987	航民股份	1,700,467.00	0.46
9	600180	瑞茂通	1,660,401.00	0.45
10	002022	科华生物	1,640,307.00	0.44
11	002467	二六三	1,634,973.00	0.44
12	600771	广誉远	1,624,336.52	0.44
13	301080	百普赛斯	1,614,934.50	0.43
14	002048	宁波华翔	1,589,159.00	0.43
15	002106	莱宝高科	1,586,599.00	0.43
16	300659	中孚信息	1,556,525.00	0.42
17	688095	福昕软件	1,547,982.22	0.42
18	600548	深高速	1,547,956.00	0.42
19	601566	九牧王	1,546,602.00	0.41
20	000550	江铃汽车	1,538,213.00	0.41

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	001696	宗申动力	3,180,678.00	0.85
2	300771	智莱科技	2,707,514.37	0.73
3	688095	福昕软件	2,300,546.50	0.62
4	600210	紫江企业	2,269,601.00	0.61
5	603855	华荣股份	2,177,348.71	0.58
6	603367	辰欣药业	2,102,634.00	0.56
7	600180	瑞茂通	2,093,565.00	0.56
8	300866	安克创新	2,090,456.40	0.56

9	002645	华宏科技	2,059,902.00	0.55
10	601138	工业富联	2,050,468.00	0.55
11	300102	乾照光电	2,042,951.00	0.55
12	002533	金杯电工	2,027,545.00	0.54
13	002432	九安医疗	2,027,456.00	0.54
14	002160	常铝股份	2,016,877.00	0.54
15	600548	深高速	2,010,796.00	0.54
16	002545	东方铁塔	2,003,209.00	0.54
17	002543	万和电气	1,997,234.00	0.54
18	601019	山东出版	1,981,004.00	0.53
19	002467	二六三	1,941,801.00	0.52
20	603508	思维列控	1,921,695.60	0.52

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	571,120,558.16
卖出股票收入（成交）总额	669,892,486.38

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，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）	90,791.98	0.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

10	合计	90,791.98	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	123240	楚天转债	444	51,343.84	0.02
2	113069	博 23 转债	180	22,702.61	0.01
3	113684	湘泵转债	90	11,390.39	0.01
4	127104	姚记转债	41	5,355.14	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

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

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末持有国债期货合约。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

报告期内基金投资的前十名证券除万和电气（证券代码 002543）外其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

根据 2023 年 7 月 20 日发布的相关公告，该证券发行人因涉嫌违反法律法规被广东省通信管理局责令改正。

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

7.12.2

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	466,368.00
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	478,862.79
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	945,230.79

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	113069	博 23 转债	22,702.61	0.01

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
招商国证 2000 指数 增强 A	1,294	49,566.86	3,983,994.67	6.21%	60,155,516.85	93.79%
招商国证 2000 指数 增强 C	2,227	77,725.95	6,704,918.92	3.87%	166,390,774.53	96.13%
合计	3,521	67,377.22	10,688,913.59	4.51%	226,546,291.38	95.49%

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

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	招商国证 2000 指数 增强 A	14,686.51	0.0229%
	招商国证 2000 指数 增强 C	293,241.89	0.1694%
	合计	307,928.40	0.1298%

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

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	招商国证 2000 指数增强 A	0
	招商国证 2000 指数增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	招商国证 2000 指数增强 A	0
	招商国证 2000 指数增强 C	10~50

	合计	10~50
--	----	-------

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	招商国证 2000 指数增强 A	招商国证 2000 指数增强 C
基金合同生效日(2023 年 8 月 1 日) 基金份额总额	156,315,135.62	471,334,242.22
本报告期期初基金份额总额	83,563,012.88	291,293,150.55
本报告期基金总申购份额	52,680,980.46	124,291,100.62
减：本报告期基金总赎回份额	72,104,481.82	242,488,557.72
本报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以"-"填列)	-	-
本报告期期末基金份额总额	64,139,511.52	173,095,693.45

§ 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，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的重大诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人没有受到监管部门的稽查或处罚，亦未收到关于基金管理人的高级管理人员受到监管部门的稽查或处罚的书面通知或文件。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易 单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股 票成交总 额的比例	佣金	占当期佣金 总量的比例	
财通证券	3	532,079,507.28	42.92%	319,977.00	42.87%	-
西南证券	3	480,348,466.23	38.75%	277,692.52	37.20%	-
东海证券	3	227,180,165.28	18.33%	148,731.01	19.93%	-

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债 券成交总 额的比例	成交金额	占当期债 券回购成 交总额的 比例	成交金额	占当期权 证成交总 额的比例
财通证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-

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关于终止北京中期时代基金销售有限公司办理旗下基金销售业务的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-01-18
2	招商基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 4 季度报告提示性公告	证券时报及基金管理人网站	2024-01-19
3	招商国证 2000 指数增强型证券投资基金 2023	证券时报、基金管理	2024-01-19

	年第 4 季度报告	人网站及中国证监会基金电子披露网站	
4	招商基金管理有限公司旗下基金 2023 年年度报告提示性公告	证券时报及基金管理人网站	2024-03-29
5	招商国证 2000 指数增强型证券投资基金 2023 年年度报告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-03-29
6	招商基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-04-08
7	招商基金管理有限公司旗下基金 2024 年第 1 季度报告提示性公告	证券时报及基金管理人网站	2024-04-19
8	招商国证 2000 指数增强型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-04-19
9	招商基金管理有限公司关于提醒投资者持续完善身份信息资料的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-05-18
10	招商基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-06-05
11	招商国证 2000 指数增强型证券投资基金(A 类份额)基金产品资料概要更新	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-06-28
12	招商国证 2000 指数增强型证券投资基金(C 类份额)基金产品资料概要更新	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-06-28

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准设立招商基金管理有限公司的文件；
- 2、中国证券监督管理委员会批准招商国证 2000 指数增强型证券投资基金设立的文件；
- 3、《招商国证 2000 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 4、《招商国证 2000 指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 5、《招商国证 2000 指数增强型证券投资基金招募说明书》；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照。

11.2 存放地点

招商基金管理有限公司
地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

11.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人招商基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-887-9555

网址：<http://www.cmfchina.com>

招商基金管理有限公司

2024 年 8 月 30 日