

招商国证 2000 指数增强型证券投资基金 2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 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 3 月 29 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。本年度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 3 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。

本报告财务资料已经审计，德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了 2023 年度无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2023 年 8 月 1 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况.....	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	8
§4 管理人报告.....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.9 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.....	14
§5 托管人报告.....	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	14
§6 审计报告.....	14
6.1 审计报告的基本内容.....	14
§7 年度财务报表.....	16
7.1 资产负债表.....	16
7.2 利润表.....	18
7.3 净资产变动表.....	19
7.4 报表附注.....	20
§8 投资组合报告.....	48
8.1 期末基金资产组合情况.....	48
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	48
8.3 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.....	50
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	67
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	69
8.6 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.....	70

8.7	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	70
8.8	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	70
8.9	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	70
8.10	本基金投资股指期货的投资政策	70
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	70
8.12	投资组合报告附注	70
§9	基金份额持有人信息	72
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	72
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	72
9.3	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	73
9.4	期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	73
§10	开放式基金份额变动	73
§11	重大事件揭示	73
11.1	基金份额持有人大会决议	74
11.2	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	74
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	74
11.4	基金投资策略的改变	74
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	74
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	74
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	75
11.8	其他重大事件	75
§12	备查文件目录	77
12.1	备查文件目录	77
12.2	存放地点	77
12.3	查阅方式	77

§ 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	374,856,163.43 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	83,563,012.88 份	291,293,150.55 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	本基金作为增强指数型基金，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×95%+中国人民银行人民币活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金是股票型基金，其预期风险收益水平高于债券型基金及货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	招商基金管理有限公司	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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.cmfchina.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）	中国上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

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	2023 年 8 月 1 日-2023 年 12 月 31 日
本期已实现收益	1,395,645.36
本期利润	-273,599.18
加权平均基金份额本期利润	-0.0021
本期加权平均净值利润率	-0.21%
本期基金份额净值增长率	-0.41%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末
期末可供分配利润	-339,521.07
期末可供分配基金份额利润	-0.0041
期末基金资产净值	83,223,491.81
期末基金份额净值	0.9959
3.1.3 累计期末指标	2023 年末

基金份额累计净值增长率	-0.41%
-------------	--------

2、招商国证 2000 指数增强 C

3.1.1 期间数据和指标	2023 年 8 月 1 日-2023 年 12 月 31 日
本期已实现收益	2,963,083.68
本期利润	-1,096,677.60
加权平均基金份额本期利润	-0.0028
本期加权平均净值利润率	-0.28%
本期基金份额净值增长率	-0.57%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末
期末可供分配利润	-1,664,236.05
期末可供分配基金份额利润	-0.0057
期末基金资产净值	289,628,914.50
期末基金份额净值	0.9943
3.1.3 累计期末指标	2023 年末
基金份额累计净值增长率	-0.57%

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；

4、本基金合同于 2023 年 8 月 1 日生效，截至本报告期末成立未满 1 年，本报告期为非完整会计年度。

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
过去三个月	-0.66%	0.81%	-1.03%	1.02%	0.37%	-0.21%
自基金合同生效起至今	-0.41%	0.66%	-5.73%	1.02%	5.32%	-0.36%

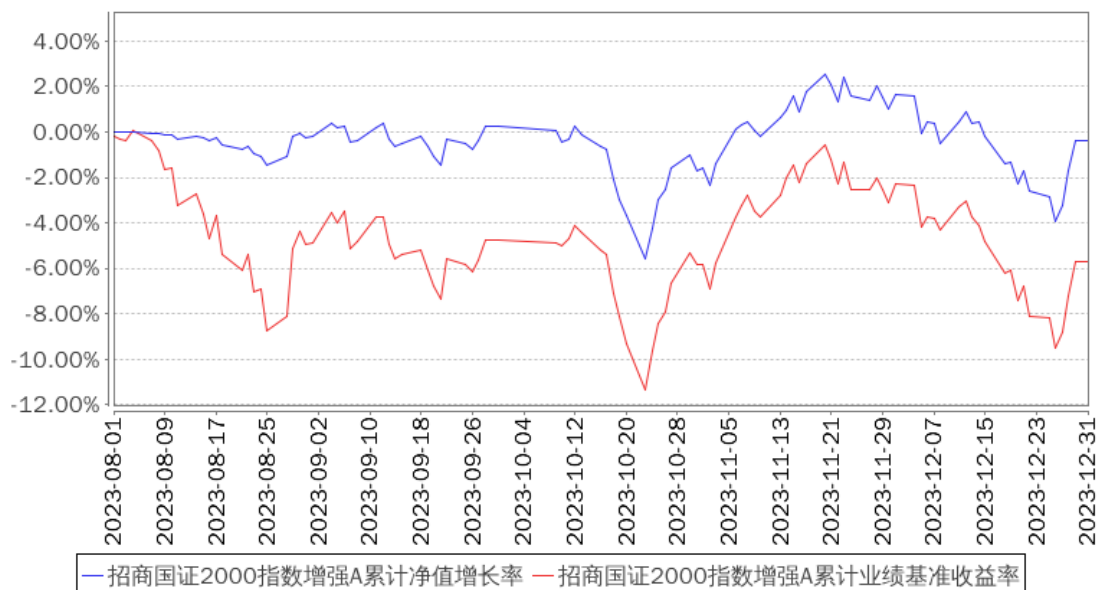
招商国证 2000 指数增强 C

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
过去三个月	-0.66%	0.81%	-1.03%	1.02%	0.37%	-0.21%
自基金合同生效起至今	-0.41%	0.66%	-5.73%	1.02%	5.32%	-0.36%

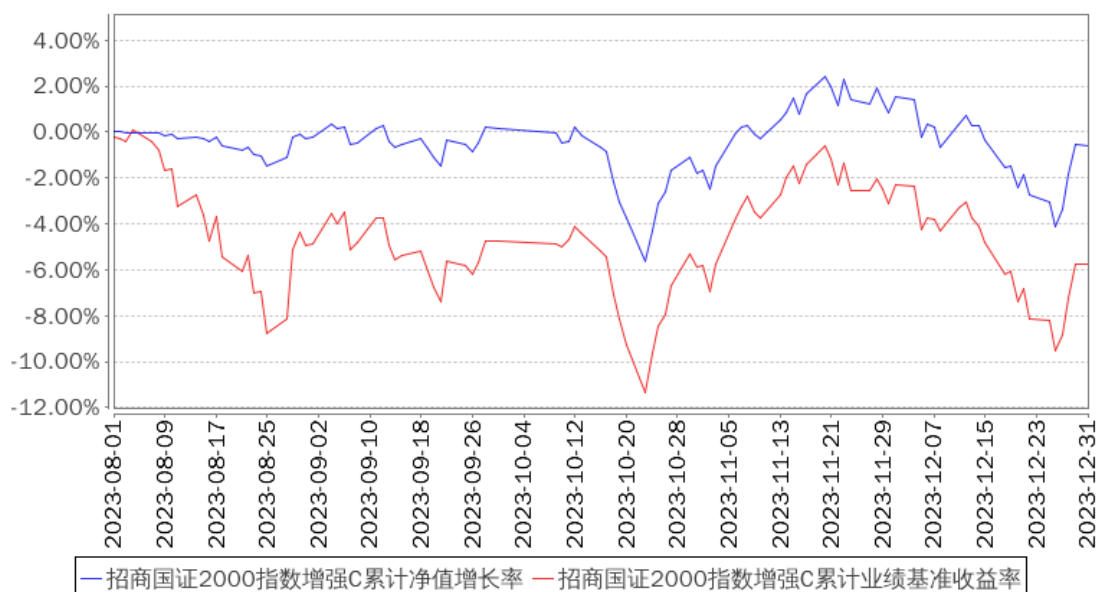
				④		
过去三个月	-0.75%	0.81%	-1.03%	1.02%	0.28%	-0.21%
自基金合同生效起至今	-0.57%	0.67%	-5.73%	1.02%	5.16%	-0.35%

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



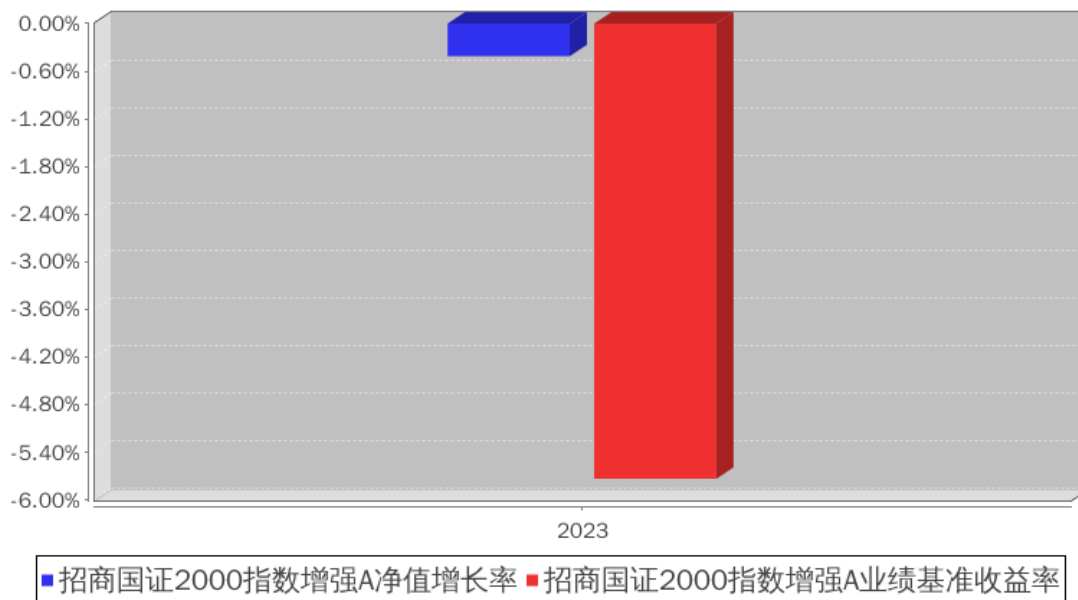
招商国证2000指数增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



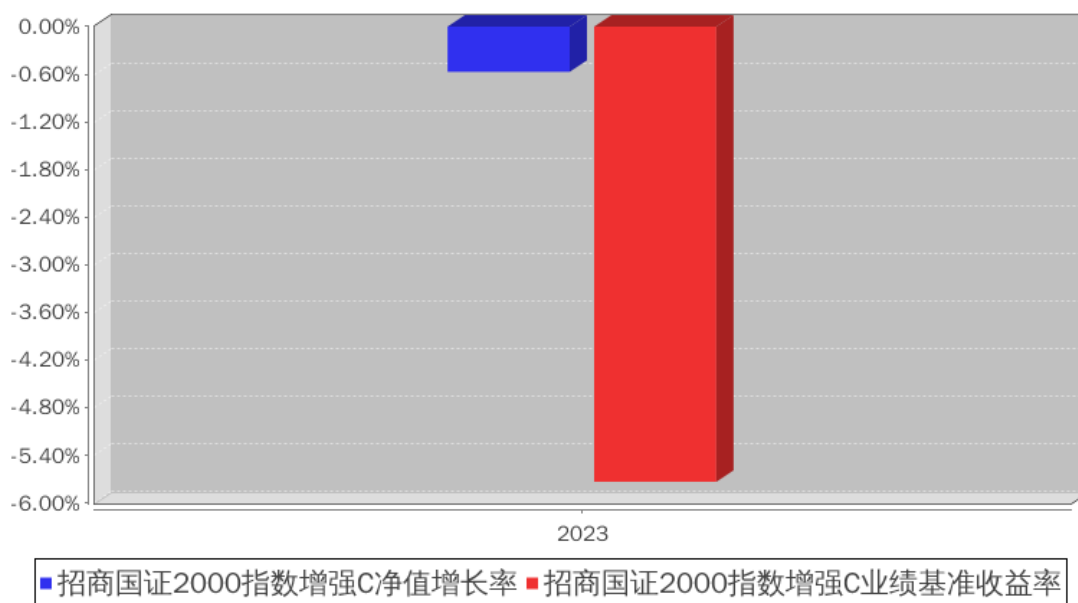
注：本基金合同于 2023 年 8 月 1 日生效，截至本报告期末基金成立未满一年；自基金成立日起 6 个月内为建仓期，截至报告期末基金建仓期尚未结束。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年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基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



招商国证2000指数增强C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金于 2023 年 8 月 1 日成立，截至本报告期末成立未满 1 年，故本报告期净值增长率按当年实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金于 2023 年 8 月 1 日成立，自基金合同生效日以来未进行利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
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	8	3,206,778,955.10	2021 年 11 月 23 日
	私募资产管理计划	1	931,689,560.20	2013 年 11 月 26 日

	其他组合	-	-	-
	合计	9	4,138,468,515.30	-

4.1.4 基金经理薪酬机制

公司基金经理薪酬由固定薪酬及变动奖金等组成。对于基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的，其薪酬激励结合其管理产品长期投资业绩、综合贡献及合规风控情况等因素综合评定。

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 公平交易制度和控制方法

基金管理人根据《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》和《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》（2011 年修订）的规定，制定了《招商基金管理有限公司公平交易管理办法》，对投资决策的内部控制、交易执行的内部控制、公平交易实施情况的监控与检查稽核、异常交易的监控等进行了规定。为保证各投资组合在投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会，基金管理人合理设置了各类资产管理业务之间以及各类资产管理业务内部的组织结构，建立了科学的投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 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。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

根据相关法律法规及监管规定要求，针对基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情形，公司严格执行公平交易管理相关的内部控制措施，并加强事后监测分析工作，包括：对相关投资组合收益率进行分析、扩大同向交易价差分析时间窗口等。报告期内，上述内部控制措施正常运作，未发现同一基金经理管理的公募基金、私募资产管理计划之间存在不公平交易或可能导致利益输送的异常交易。

4.3.3 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 28 次，其中 21 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，7 次为不同基金经理管理的基金因投资策略不同而发生的反向交易。报告期内未发现有可能导致不公平交易和利益输送的重大异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2023 年，国证 2000 指数小幅下跌，作为典型的小盘风格指数，表现略好于大盘宽基指数。本基金自三季度成立以来逐步建仓，随后在四季度保持稳定运作，策略端使用多策略组合的方式，以基本面因子为核心，辅助以其他卫星策略。由于各因子在三四季度表现较为符合预期，本基金跑赢基准。2023 年经济增速的恢复其实并没有如年初市场乐观预期的状态兑现，多次出现预期差，较强预期对应较弱现实数据在 2023 年下半年开始困扰资本市场的情绪。除此之外，国际市场方面以及地缘政治的复杂化也加剧了市场的阶段性担忧。对于产业链安全、出口格局变化、贸易争端、对外依存度较高行业的竞争格局恶化等窗口性问题权益市场都阶段性的给出了负面的反馈。

市场风格方面，在基本面恢复逊于预期且外部环境复杂化的背景下，资产安全边际继续是权益市场关注点，价值风格明显强势，极致价值的红利风格受到资金高度关注且表现

出延续的态势。行业方面，价值属性与分红能力阶段性成为重点关注且是市场的一条核心主线。

策略端方面，产品维持在紧跟国证 2000 指数的背景下使用多种策略组合，积极纳入新因子和新策略，2023 年取得了一定的超额收益，在后续运作中也将保持原有运作框架，力争提升超额收益。

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-0.41%，同期业绩基准增长率为-5.73%，C 类份额净值增长率为-0.57%，同期业绩基准增长率为-5.73%。

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 2024 年，经济增速应该大概率依然处于合理区间，达成政府工作目标的难度不高，但政策是否加大力度的可能性依然有待观察，而市场情绪弱化的转变需要有明晰信号作为引线。当前中国的货币环境依然较为复杂，中美息差，汇率压力，通胀水平是否能恢复到合理区间等都是市场的重点关注。考虑到 2024 年美联储降息的确定性较高，但幅度尚不好评估，其对我国货币政策的影响也需要时间观察。

企业盈利端，对于未来的展望依然可以稍显乐观，2024 年初市场波动及流动性压力带来的情绪上的影响可能在 2-3 季度后有所消散，届时配合经济数据的逐步披露，市场信心有逐步恢复的基础。考虑到 2023 年 12 月的工业企业利润相对 1-11 月有明显改善，若趋势得以延续在 2024 年的一季报披露时可能会被权益市场给与更高的正面反馈。行业上，石油、煤炭及其他燃料加工业利润增速提升最为明显，2024 年可能格局会有所延续。

策略端方面，产品维持在紧跟国证 2000 指数的背景下使用多种策略组合，积极纳入新因子和新策略，力争提升超额收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人本着诚实信用、勤勉尽责、合法经营和保障基金持有人利益的原则，经营管理和业务运作稳健、合规，基金的投资、交易、后台等运作规范有序。基金管理人的风险管理及合规控制部门依据独立、客观、公正的原则，主要从以下几个方面进一步加强了公司内部控制和基金投资风险管理工作：

- 1、公司实施了员工全面培训和形式多样的专题培训，包括不定期推送监管动态和风险案例，持续整理风险点录入系统定期推送，定期或不定期组织法规考试，不定期开展各类合规主题培训等，丰富培训形式，不断提升员工合规与风控意识；

- 2、公司合规风控部门通过事中合规控制系统、事后投资风险管理系统、风险管理模型等对基金投资合规情况及风险情况进行严格的内部监控和管理；

3、定期稽核方面，除了每季度会对各业务领域进行一次全面的稽核，公司合规审计部门还根据监察稽核计划，对公司的关键业务部门及业务流程进行了专项稽核和检查；

4、根据法律法规的更新及业务的发展变化情况，公司各业务部门对相关内部控制制度提出修改意见和建议，并关注内部控制制度的健全性和有效性，进一步完善了公司内控制度体系，更好的防范法律风险和合规风险。

报告期内，本基金的投资运作符合国家相关法律法规、监管部门的有关规定以及公司相关制度的规定。本基金的投资目标、投资决策依据和投资管理程序均符合相关基金合同和招募说明书的约定，未发现重大异常交易、利益输送、内幕交易及其他有损基金投资者利益的情形。报告期内，本基金若曾因市场波动、申购赎回等原因出现了相关投资比例限制被动突破的情形，均在法规规定的时间内完成了调整，符合法律法规和基金合同的规定和要求。报告期内，本基金未出现因权证未行权、可转债未及时卖出或转股等有损基金份额持有人利益的投资失误行为。本基金管理人承诺将一如既往本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产，在规范经营、控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

基金经理代表向估值委员会提供估值参考信息，参与估值政策讨论；对需采用特别估值程序的证券，基金及时启动特别估值程序，由公司估值委员会集体讨论议定特别估值方案，咨询会计师事务所的专业意见，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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，财通证券股份有限公司（以下称“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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人基金本年年度报告中的财务数据均核对无误。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	招商国证 2000 指数增强型证券投资基金全体持有人

审计意见	<p>我们审计了招商国证 2000 指数增强型证券投资基金的财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年 8 月 1 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日止期间的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了招商国证 2000 指数增强型证券投资基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年 8 月 1 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于招商国证 2000 指数增强型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>招商基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括招商国证 2000 指数增强型证券投资基金年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估招商国证 2000 指数增强型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算招商国证 2000 指数增强型证券投资基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督招商国证 2000 指数增强型证券投资基金的财务报告过程。</p>

注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(1)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险,设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2)了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3)评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4)对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能对招商国证 2000 指数增强型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致招商国证 2000 指数增强型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5)评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容,并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	江丽雅 林婷婷
会计师事务所的地址	中国上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼
审计报告日期	2024 年 3 月 28 日

§ 7 年度财务报表

7.1 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：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日
资产：		
货币资金	7.4.7.1	19,890,966.60
结算备付金		7,202,847.31
存出保证金		2,397,336.00
交易性金融资产	7.4.7.2	331,946,093.78
其中：股票投资		331,928,092.72
基金投资		-
债券投资		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	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
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		12,746,839.03
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.5	-
资产总计		374,184,082.72
负债和净资产	附注号	本期末 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	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		-
应付赎回款		927,798.10
应付管理人报酬		280,681.58
应付托管费		28,068.16
应付销售服务费		84,126.30
应付投资顾问费		-
应交税费		2.27

应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.6	11,000.00
负债合计		1,331,676.41
净资产：		
实收基金	7.4.7.7	374,856,163.43
其他综合收益		-
未分配利润	7.4.7.8	-2,003,757.12
净资产合计		372,852,406.31
负债和净资产总计		374,184,082.72

注：1. 报告截止日 2023 年 12 月 31 日，招商国证 2000 指数增强 A 份额净值 0.9959 元，基金份额总额 83,563,012.88 份；招商国证 2000 指数增强 C 份额净值 0.9943 元，基金份额总额 291,293,150.55 份；总份额合计 374,856,163.43 份；

2. 本财务报表的实际编制期间为 2023 年 8 月 1 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日止期间。

7.2 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：2023 年 8 月 1 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 8 月 1 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		1,669,164.13
1.利息收入		1,174,186.21
其中：存款利息收入	7.4.7.9	863,432.47
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		310,753.74
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		6,212,050.73
其中：股票投资收益	7.4.7.10	5,461,636.27
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.11	111,349.87
资产支持证券投资	7.4.7.12	-
收益		-
贵金属投资收益	7.4.7.13	-

衍生工具收益	7.4.7.14	90,579.98
股利收益	7.4.7.15	548,484.61
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）	7.4.7.16	-5,729,005.82
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	11,933.01
减：二、营业总支出		3,039,440.91
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	2,163,797.80
其中：暂估管理人报酬		-
2.托管费	7.4.10.2.2	216,379.79
3.销售服务费	7.4.10.2.3	646,362.27
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	7.4.7.18	-
7.税金及附加		701.05
8.其他费用	7.4.7.19	12,200.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,370,276.78
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,370,276.78
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-1,370,276.78

7.3 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：2023 年 8 月 1 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 8 月 1 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 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	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

二、本期期初净资产	627,649,377.84	-	-	627,649,377.84
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-252,793,214.41	-	-2,003,757.12	-254,796,971.53
(一)、综合收益总额	-	-	-1,370,276.78	-1,370,276.78
(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)	-252,793,214.41	-	-633,480.34	-253,426,694.75
其中: 1.基金申购款	148,376,025.44	-	-694,460.21	147,681,565.23
2.基金赎回款	-401,169,239.85	-	60,979.87	-401,108,259.98
(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	374,856,163.43	-	-2,003,757.12	372,852,406.31

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 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 \times 95%+中国人民银行人民币活期存款利率(税后) \times 5%。

7.4.2 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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2023 年 8 月 1 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为自 2023 年 8 月 1 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日止期间。

7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1) 金融资产的分类

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

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

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

2) 金融负债的分类

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

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

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

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

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

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，将其公允价值划分为三个层次。第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市

场上未经调整的报价；第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值原则如下：

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

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

(3)经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整，确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分

各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

1) 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

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

转融通证券出借业务利息收入在转融通证券实际出借期间内，按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时计入转融通证券出借业务利息收入。

2) 投资收益

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

债券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖债券价差收入。除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。买卖债券价差收入为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

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

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

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

出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益。

3) 公允价值变动收益

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

4) 信用减值损失

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

1) 在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3) 基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4) A 类基金份额和 C 类基金份额之间由于 A 类基金份额不收取而 C 类基金份额收取销售服务费将导致在可供分配利润上有所不同；本基金同一类别的每份基金份额享有同等分配权；

5) 投资者的现金红利和红利再投资形成的基金份额均保留到小数点后第 2 位，小数点后第 3 位开始舍去，舍去部分归基金资产；

6) 法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

在不影响基金份额持有人利益的情况下，基金管理人可在不违反法律法规的前提下酌情调整以上基金收益分配原则，此项调整不需要召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在规定媒介公告。

7.4.4.12 外币交易

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

7.4.4.13 分部报告

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

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》（中基协发[2017]6 号），在估值日按照该通知规定的流通受限股票公允价值计算模型进行估值。

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

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

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	6,195,733.42
等于：本金	6,193,315.91
加：应计利息	2,417.51
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	13,695,233.18
等于：本金	13,693,339.84
加：应计利息	1,893.34
减：坏账准备	-
合计	19,890,966.60

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	337,778,048.54	-	331,928,092.72	-5,849,955.82	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	17,999.88	1.18	18,001.06	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	17,999.88	1.18	18,001.06	-
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	337,796,048.42	1.18	331,946,093.78	-5,849,955.82	

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	19,856,850.00	-	-	-
其中：股指期货投资	19,856,850.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	19,856,850.00	-	-	-

7.4.7.3.2 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
IM2401	IM2401	12.00	14,131,200.00	-22,890.00
IM2403	IM2403	5.00	5,846,600.00	143,840.00
合计				120,950.00
减：可抵销期货暂收款				120,950.00
净额				-

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 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。

7.4.7.4.2 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。

7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 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	11,000.00
合计	11,000.00

7.4.7.7 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 2023 年 8 月 1 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额

基金合同生效日	156,315,135.62	156,315,135.62
本期申购	7,591,841.81	7,591,841.81
本期赎回（以“-”号填列）	-80,343,964.55	-80,343,964.55
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	83,563,012.88	83,563,012.88

招商国证 2000 指数增强 C		
项目	本期 2023 年 8 月 1 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	471,334,242.22	471,334,242.22
本期申购	140,784,183.63	140,784,183.63
本期赎回（以“-”号填列）	-320,825,275.30	-320,825,275.30
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	291,293,150.55	291,293,150.55

注：1、本期申购含红利再投、转换入份（金）额，本期赎回含转换出份（金）额。

2、本基金自 2023 年 7 月 17 日至 2023 年 7 月 28 日止期间公开发售，有效净认购金额人民币 627,508,625.96 元，折算为 627,508,625.96 份基金份额。根据《招商国证 2000 指数增强型证券投资基金基金合同》的规定，经本基金注册登记人计算并确认，本基金认购资金在募集期内产生的利息人民币 140,751.88 元，折算为 140,751.88 份基金份额，划入基金持有人账户，两者合计 627,649,377.84 份基金份额。

7.4.7.8 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
基金合同生效日	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	1,395,645.36	-1,669,244.54	-273,599.18
本期基金份额交易产生的变动数	-290,650.49	224,728.60	-65,921.89
其中：基金申购款	57,917.61	-56,117.47	1,800.14
基金赎回款	-348,568.10	280,846.07	-67,722.03
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,104,994.87	-1,444,515.94	-339,521.07

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
基金合同生效日	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	2,963,083.68	-4,059,761.28	-1,096,677.60
本期基金份额交易产生的变动数	403,618.38	-971,176.83	-567,558.45
其中：基金申购款	1,358,048.03	-2,054,308.38	-696,260.35
基金赎回款	-954,429.65	1,083,131.55	128,701.90
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,366,702.06	-5,030,938.11	-1,664,236.05

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 8 月 1 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	195,495.53
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	582,816.44
其他	85,120.50
合计	863,432.47

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 8 月 1 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	5,461,636.27
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	5,461,636.27

7.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 8 月 1 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	620,617,984.40
减：卖出股票成本总额	613,724,342.50

减：交易费用	1,432,005.63
买卖股票差价收入	5,461,636.27

7.4.7.10.3 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。

7.4.7.10.4 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。

7.4.7.10.5 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。

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 8 月 1 日（基金合同生效日） 至 2023 年 12 月 31 日
债券投资收益——利息收入	165.38
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	111,184.49
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	111,349.87

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 8 月 1 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	615,584.89
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	504,197.73
减：应计利息总额	171.92
减：交易费用	30.75
买卖债券差价收入	111,184.49

7.4.7.11.3 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。

7.4.7.11.4 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。

7.4.7.12 资产支持证券投资收益**7.4.7.12.1 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。

7.4.7.12.2 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。

7.4.7.12.3 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。

7.4.7.12.4 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。

7.4.7.13 贵金属投资收益**7.4.7.13.1 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。

7.4.7.13.2 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。

7.4.7.13.3 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。

7.4.7.13.4 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。

7.4.7.14 衍生工具收益**7.4.7.14.1 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。

7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2023 年 8 月 1 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
股指期货投资收益	90,579.98

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 8 月 1 日（基金合同生效日）
----	----------------------------

	至 2023 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	548,484.61
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	548,484.61

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 8 月 1 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	-5,849,955.82
——股票投资	-5,849,955.82
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	120,950.00
——权证投资	-
——期货投资	120,950.00
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	-5,729,005.82

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 8 月 1 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	11,933.01
合计	11,933.01

7.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 8 月 1 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
审计费用	11,000.00
信息披露费	-
证券出借违约金	-
其他	1,200.00
合计	12,200.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

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
招商财富资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司
博时基金(国际)有限公司	基金管理人的参股经营机构

注：1、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。

2、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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 8 月 1 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
财通证券	751,553,519.92	47.88%

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 8 月 1 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
财通证券	238,588.56	38.76%

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 8 月 1 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例

财通证券	2,327,390,000.00	59.82%
------	------------------	--------

7.4.10.1.4 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。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 8 月 1 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 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	492,294.29	48.35%	-	-

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 8 月 1 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,163,797.80
其中：应支付销售机构的客户维护费	548,958.67
应支付基金管理人的净管理费	1,614,839.13
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：

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

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 8 月 1 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	216,379.79

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：

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

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2023 年 8 月 1 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 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	-	311,504.01	311,504.01

招商基金管理有限 公司	-	57.86	57.86
招商银行	-	111.35	111.35
招商证券	-	58.18	58.18
合计	-	311,731.40	311,731.40

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

其计算公式为：

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

7.4.10.3 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。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 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。

7.4.10.5.2 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

本报告期末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 8 月 1 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
财通证券-活期	6,195,733.42	195,495.53
财通证券-其他存款	4,970,893.15	40,417.20

注：本基金的托管人为财通证券股份有限公司，活期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。其他存款为本基金存放在证券公司的证券交易结算资金，按协议约定利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

单位：人民币元

本期 2023 年 8 月 1 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 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	603373	安邦护卫	网下申购	876	16,731.60
招商证券	001378	德冠新材	网下申购	2,044	64,753.92
招商证券	688653	康希通信	网下申购	6,478	68,019.00

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2023 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
001239	永达股份	2023 年 12 月 4 日	6 个月	新股流通受限	12.05	19.92	189	2,277.45	3,764.88	-
001326	联域股份	2023 年 11 月 1 日	6 个月	新股流通受限	41.18	48.64	99	4,076.82	4,815.36	-
001358	兴欣新材	2023 年 12 月 14 日	6 个月	新股流通受限	41.00	44.16	87	3,567.00	3,841.92	-
001378	德冠新材	2023 年 10 月 23 日	6 个月	新股流通受限	31.68	31.27	205	6,494.40	6,410.35	-
301413	安培龙	2023 年 12 月 11 日	6 个月	新股流通受限	33.25	58.19	164	5,453.00	9,543.16	-
301459	丰茂股份	2023 年 12 月 6 日	6 个月	新股流通受限	31.90	39.84	208	6,635.20	8,286.72	-

		日								
301489	思泉新材	2023 年 10 月 16 日	6 个月	新股流通 受限	41.66	64.11	128	5,332.48	8,206.08	-
301508	中机认检	2023 年 11 月 23 日	6 个月	新股流通 受限	16.82	26.68	419	7,047.58	11,178.92	-
301516	中远通	2023 年 12 月 1 日	6 个月	新股流通 受限	6.87	15.51	604	4,149.48	9,368.04	-
301517	陕西华达	2023 年 10 月 9 日	6 个月	新股流通 受限	26.87	43.69	185	4,970.95	8,082.65	-
301520	万邦医药	2023 年 9 月 18 日	6 个月	新股流通 受限	67.88	52.74	160	10,860.80	8,438.40	-
301526	国际复材	2023 年 12 月 19 日	6 个月	新股流通 受限	2.66	4.45	5,312	14,129.92	23,638.40	-
301555	惠柏新材	2023 年 10 月 24 日	6 个月	新股流通 受限	22.88	32.44	224	5,125.12	7,266.56	-
301558	三态股份	2023 年 9 月 21 日	6 个月	新股流通 受限	7.33	13.40	1,458	10,687.14	19,537.20	-
301559	中集环科	2023 年 9 月 26 日	6 个月	新股流通 受限	24.22	18.24	767	18,576.74	13,990.08	-
301566	达利凯普	2023 年 12 月 22 日	6 个月	新股流通 受限	8.90	22.14	576	5,126.40	12,752.64	-
301568	思泰克	2023 年 11 月 21 日	6 个月	新股流通 受限	23.23	35.58	246	5,714.58	8,752.68	-
301578	辰奕智能	2023 年 12 月 21 日	6 个月	新股流通 受限	48.94	68.32	118	5,774.92	8,061.76	-
601083	锦江航运	2023 年 11 月 28 日	6 个月	新股流通 受限	11.25	11.07	581	6,536.25	6,431.67	-
601096	宏盛华源	2023 年 12 月 15 日	6 个月	新股流通 受限	1.70	4.06	2,428	4,127.60	9,857.68	-
603004	鼎龙科技	2023 年	6 个月	新股流通	16.80	31.19	171	2,872.80	5,333.49	-

		12月20日		受限						
603107	上海汽配	2023年10月25日	6个月	新股流通受限	14.23	18.19	292	4,155.16	5,311.48	-
603193	润本股份	2023年10月9日	6个月	新股流通受限	17.38	16.66	303	5,266.14	5,047.98	-
603231	索宝蛋白	2023年12月6日	6个月	新股流通受限	21.29	21.53	145	3,087.05	3,121.85	-
603273	天元智能	2023年10月16日	6个月	新股流通受限	9.50	18.97	178	1,691.00	3,376.66	-
603276	恒兴新材	2023年9月18日	6个月	新股流通受限	25.73	24.88	134	3,447.82	3,333.92	-
603373	安邦护卫	2023年12月13日	6个月	新股流通受限	19.10	34.75	88	1,680.80	3,058.00	-
688648	中邮科技	2023年11月6日	6个月	新股流通受限	15.18	21.43	303	4,599.54	6,493.29	-
688652	京仪装备	2023年11月22日	6个月	新股流通受限	31.95	52.25	330	10,543.50	17,242.50	-
688653	康希通信	2023年11月10日	6个月	新股流通受限	10.50	15.99	648	6,804.00	10,361.52	-
688657	浩辰软件	2023年9月25日	6个月	新股流通受限	103.40	78.23	101	10,443.40	7,901.23	-
688716	中研股份	2023年9月13日	6个月	新股流通受限	29.66	36.39	267	7,919.22	9,716.13	-
688719	爱科赛博	2023年9月20日	6个月	新股流通受限	69.98	60.10	194	13,576.12	11,659.40	-
688720	艾森股份	2023年11月29日	6个月	新股流通受限	28.03	49.84	165	4,624.95	8,223.60	-

7.4.12.1.2 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)	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	------	-------	-----	--------	------	--------	-------	--------	--------	----

							位： 张)			
113069	博 23 转债	2023 年 12 月 22 日	1 个月 内 (含)	新债未上市	100.00	100.01	180	17,999.88	18,001.06	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值 单价	复牌 日期	复牌开 盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688337	普源精电	2023 年 12 月 25 日	重大事项 停牌	43.87	2024 年 1 月 9 日	41.72	5,400	256,102.00	236,898.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 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。

7.4.12.3.2 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。

7.4.12.4 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。

7.4.13 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。

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 信用风险

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

本基金的银行存款存放在本基金的基金托管人开立的托管账户中，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。本基金所持有的债券投资的信用评级情况参见附注 7.4.13.2.1 至 7.4.13.2.6，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。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的债券投资。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023 年 12 月 31 日
AAA	-
AAA 以下	18,001.06
未评级	-
合计	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。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.3 流动性风险

7.4.13.3.1 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 7.4.12 所披露的流通受限不能自由转让的基金资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。除卖出回购金融资产外，本基金所持有的金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值或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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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：上表按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	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	331,928,092.72	89.02

7.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

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

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	331,398,788.52
第二层次	254,899.06

第三层次	292,406.20
合计	331,946,093.78

7.4.14.2.2 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。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 8 月 1 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	217,375.33	217,375.33
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	75,030.87	75,030.87
其中：计入损益的利得或损失	-	75,030.87	75,030.87
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	292,406.20	292,406.20
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	75,030.87	75,030.87

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

金额单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价

					值之间的 关系
股票投资	292,406.20	平均价格亚式 期权模型	流通受限股票 预期波动率	0.2716-2.1988	负相关

7.4.14.3 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。

7.4.14.4 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。

7.4.15 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。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例 （%）
1	权益投资	331,928,092.72	88.71
	其中：股票	331,928,092.72	88.71
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	18,001.06	0.00
	其中：债券	18,001.06	0.00
	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	27,093,813.91	7.24
8	其他资产	15,144,175.03	4.05
9	合计	374,184,082.72	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	500,825.00	0.13
B	采矿业	1,292,873.00	0.35
C	制造业	171,473,686.67	45.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,365,786.00	1.44
E	建筑业	5,182,423.00	1.39
F	批发和零售业	17,313,065.00	4.64
G	交通运输、仓储和邮政业	4,702,906.00	1.26
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	25,011,984.06	6.71
J	金融业	2,564,741.00	0.69
K	房地产业	5,380,442.00	1.44
L	租赁和商务服务业	2,803,382.00	0.75
M	科学研究和技术服务业	3,764,945.52	1.01
N	水利、环境和公共设施管理业	4,288,483.00	1.15
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	527,040.00	0.14
Q	卫生和社会工作	283,800.00	0.08
R	文化、体育和娱乐业	4,546,227.00	1.22
S	综合	335,040.00	0.09
	合计	255,337,649.25	68.48

8.2.2 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	979,392.00	0.26
C	制造业	53,256,251.08	14.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,458,350.00	0.93
E	建筑业	2,435,042.00	0.65
F	批发和零售业	3,747,164.65	1.00
G	交通运输、仓储和邮政业	455,338.67	0.12
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,968,432.75	2.14
J	金融业	502,370.00	0.13
K	房地产业	200,376.00	0.05
L	租赁和商务服务业	450,086.00	0.12
M	科学研究和技术服务业	463,425.32	0.12
N	水利、环境和公共设施管理业	611,776.00	0.16
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	619,876.00	0.17
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,442,563.00	0.39
S	综合	-	-
	合计	76,590,443.47	20.54

8.2.3 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。

8.3 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

8.3.1 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

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	002533	金杯电工	271,800	2,196,144.00	0.59
2	603611	诺力股份	115,800	2,192,094.00	0.59
3	600210	紫江企业	449,600	2,113,120.00	0.57
4	603639	海利尔	132,800	2,084,960.00	0.56
5	002212	天融信	212,700	2,080,206.00	0.56
6	601609	金田股份	306,900	2,077,713.00	0.56
7	002171	楚江新材	277,200	2,073,456.00	0.56
8	603897	长城科技	100,100	2,050,048.00	0.55
9	600502	安徽建工	400,600	1,862,790.00	0.50
10	603367	辰欣药业	124,100	1,816,824.00	0.49
11	002004	华邦健康	386,500	1,801,090.00	0.48
12	002160	常铝股份	421,500	1,766,085.00	0.47
13	603071	物产环能	115,500	1,755,600.00	0.47
14	002293	罗莱生活	187,500	1,741,875.00	0.47
15	688368	晶丰明源	15,639	1,688,073.66	0.45
16	001696	宗申动力	252,000	1,670,760.00	0.45
17	601369	陕鼓动力	208,500	1,663,830.00	0.45
18	002462	嘉事堂	110,800	1,574,468.00	0.42
19	603012	创力集团	265,700	1,570,287.00	0.42
20	000900	现代投资	395,000	1,548,400.00	0.42
21	600475	华光环能	147,000	1,528,800.00	0.41
22	600835	上海机电	128,600	1,526,482.00	0.41
23	300708	聚灿光电	135,100	1,523,928.00	0.41
24	300532	今天国际	91,400	1,500,788.00	0.40
25	002204	大连重工	327,200	1,495,304.00	0.40
26	000881	中广核技	205,900	1,492,775.00	0.40
27	002111	威海广泰	162,500	1,472,250.00	0.39

28	002540	亚太科技	221,900	1,466,759.00	0.39
29	603508	思维列控	92,740	1,456,018.00	0.39
30	603989	艾华集团	67,300	1,448,296.00	0.39
31	000906	浙商中拓	196,800	1,438,608.00	0.39
32	002376	新北洋	187,500	1,428,750.00	0.38
33	000727	冠捷科技	523,900	1,404,052.00	0.38
34	002327	富安娜	156,200	1,397,990.00	0.37
35	002543	万和电气	156,200	1,393,304.00	0.37
36	600577	精达股份	331,400	1,371,996.00	0.37
37	000910	大亚圣象	170,600	1,364,800.00	0.37
38	002441	众业达	143,900	1,362,733.00	0.37
39	603301	振德医疗	55,000	1,347,500.00	0.36
40	600169	太原重工	569,800	1,344,728.00	0.36
41	601019	山东出版	141,500	1,327,270.00	0.36
42	600461	洪城环境	145,200	1,327,128.00	0.36
43	002614	奥佳华	175,600	1,317,000.00	0.35
44	002367	康力电梯	171,600	1,290,432.00	0.35
45	300409	道氏技术	114,100	1,271,074.00	0.34
46	603368	柳药集团	66,700	1,261,964.00	0.34
47	002479	富春环保	256,200	1,222,074.00	0.33
48	600757	长江传媒	163,400	1,217,330.00	0.33
49	603165	荣晟环保	101,000	1,209,980.00	0.32
50	000680	山推股份	239,200	1,181,648.00	0.32
51	000949	新乡化纤	365,000	1,178,950.00	0.32
52	000789	万年青	171,200	1,174,432.00	0.31
53	600966	博汇纸业	188,000	1,167,480.00	0.31
54	300132	青松股份	223,300	1,165,626.00	0.31
55	600828	茂业商业	305,500	1,115,075.00	0.30
56	688095	福昕软件	15,714	1,097,622.90	0.29
57	300286	安科瑞	42,100	1,091,653.00	0.29
58	002469	三维化学	176,500	1,069,590.00	0.29
59	600694	大商股份	62,900	1,062,381.00	0.28
60	600510	黑牡丹	185,800	1,049,770.00	0.28
61	600459	贵研铂业	73,000	1,048,280.00	0.28
62	300771	智莱科技	96,400	1,047,868.00	0.28
63	603208	江山欧派	34,800	1,033,212.00	0.28
64	603855	华荣股份	50,946	1,016,882.16	0.27
65	000717	中南股份	398,000	1,010,920.00	0.27
66	002757	南兴股份	63,500	993,140.00	0.27
67	603699	纽威股份	71,500	990,990.00	0.27
68	003012	东鹏控股	119,500	985,875.00	0.26
69	002803	吉宏股份	47,600	978,656.00	0.26
70	002688	金河生物	203,000	976,430.00	0.26

71	603283	赛腾股份	13,400	972,304.00	0.26
72	600997	开滦股份	127,100	969,773.00	0.26
73	601003	柳钢股份	305,700	969,069.00	0.26
74	301109	军信股份	59,600	941,680.00	0.25
75	002932	明德生物	40,200	923,394.00	0.25
76	300469	信息发展	62,500	920,000.00	0.25
77	601886	江河集团	135,100	899,766.00	0.24
78	600908	无锡银行	176,900	893,345.00	0.24
79	002534	西子洁能	71,100	888,039.00	0.24
80	300718	长盛轴承	47,500	881,125.00	0.24
81	002788	鹭燕医药	97,100	872,929.00	0.23
82	603533	掌阅科技	43,500	864,780.00	0.23
83	002632	道明光学	87,500	864,500.00	0.23
84	301015	百洋医药	24,000	860,640.00	0.23
85	000823	超声电子	89,700	858,429.00	0.23
86	002582	好想你	111,400	854,438.00	0.23
87	600987	航民股份	97,400	853,224.00	0.23
88	688020	方邦股份	17,522	849,466.56	0.23
89	600162	香江控股	487,600	848,424.00	0.23
90	000639	西王食品	188,600	833,612.00	0.22
91	002022	科华生物	71,800	817,084.00	0.22
92	002303	美盈森	232,400	815,724.00	0.22
93	300533	冰川网络	29,300	811,610.00	0.22
94	002432	九安医疗	21,400	806,138.00	0.22
95	002545	东方铁塔	112,000	800,800.00	0.21
96	002296	辉煌科技	96,600	796,950.00	0.21
97	002158	汉钟精机	35,500	790,230.00	0.21
98	002440	闰土股份	129,200	788,120.00	0.21
99	000521	长虹美菱	139,700	786,511.00	0.21
100	002641	公元股份	156,200	785,686.00	0.21
101	000589	贵州轮胎	128,300	785,196.00	0.21
102	002588	史丹利	122,900	784,102.00	0.21
103	300687	赛意信息	35,900	781,902.00	0.21
104	002391	长青股份	122,900	774,270.00	0.21
105	002035	华帝股份	124,400	772,524.00	0.21
106	002048	宁波华翔	58,500	761,085.00	0.20
107	300228	富瑞特装	106,600	756,860.00	0.20
108	600710	苏美达	106,100	752,249.00	0.20
109	300389	艾比森	42,400	735,216.00	0.20
110	002645	华宏科技	64,900	733,370.00	0.20
111	000650	仁和药业	109,600	726,648.00	0.19
112	002833	弘亚数控	40,600	720,244.00	0.19
113	001208	华菱线缆	77,400	719,046.00	0.19

114	300441	鲍斯股份	104,300	718,627.00	0.19
115	000059	华锦股份	129,500	710,955.00	0.19
116	002225	濮耐股份	186,600	705,348.00	0.19
117	600180	瑞茂通	113,500	691,215.00	0.19
118	603556	海兴电力	23,700	688,011.00	0.18
119	000030	富奥股份	126,300	674,442.00	0.18
120	002724	海洋王	81,300	668,286.00	0.18
121	603113	金能科技	82,400	664,968.00	0.18
122	300698	万马科技	18,200	664,300.00	0.18
123	300364	中文在线	25,700	661,261.00	0.18
124	600320	振华重工	197,400	655,368.00	0.18
125	603920	世运电路	35,800	654,424.00	0.18
126	000973	佛塑科技	132,800	649,392.00	0.17
127	000928	中钢国际	111,100	647,713.00	0.17
128	002851	麦格米特	26,200	644,520.00	0.17
129	002661	克明食品	67,600	644,228.00	0.17
130	002416	爱施德	69,300	643,797.00	0.17
131	002839	张家港行	165,300	641,364.00	0.17
132	000631	顺发恒业	192,300	638,436.00	0.17
133	600526	菲达环保	128,800	636,272.00	0.17
134	002215	诺普信	76,800	634,368.00	0.17
135	601326	秦港股份	222,400	633,840.00	0.17
136	300451	创业慧康	96,700	633,385.00	0.17
137	002611	东方精工	127,500	632,400.00	0.17
138	002393	力生制药	24,200	631,620.00	0.17
139	603588	高能环境	96,300	629,802.00	0.17
140	603018	华设集团	82,600	627,760.00	0.17
141	002206	海利得	124,700	625,994.00	0.17
142	002181	粤传媒	136,000	625,600.00	0.17
143	002404	嘉欣丝绸	103,000	622,120.00	0.17
144	301051	信濠光电	9,700	617,599.00	0.17
145	300042	朗科科技	17,600	616,000.00	0.17
146	688197	首药控股	11,127	614,099.13	0.16
147	300161	华中数控	17,000	610,300.00	0.16
148	600971	恒源煤电	54,700	609,905.00	0.16
149	002270	华明装备	43,000	607,160.00	0.16
150	300705	九典制药	18,100	601,463.00	0.16
151	000090	天健集团	129,800	597,080.00	0.16
152	300709	精研科技	19,100	595,729.00	0.16
153	603277	银都股份	22,100	592,722.00	0.16
154	300319	麦捷科技	61,200	589,968.00	0.16
155	300102	乾照光电	80,100	588,735.00	0.16
156	000019	深粮控股	78,000	588,120.00	0.16

157	600986	浙文互联	107,000	584,220.00	0.16
158	000543	皖能电力	92,200	577,172.00	0.15
159	002277	友阿股份	141,800	571,454.00	0.15
160	600639	浦东金桥	55,900	565,149.00	0.15
161	600312	平高电气	44,300	562,167.00	0.15
162	300627	华测导航	18,100	561,462.00	0.15
163	600496	精工钢构	183,700	560,285.00	0.15
164	601339	百隆东方	114,500	557,615.00	0.15
165	600033	福建高速	179,500	556,450.00	0.15
166	603916	苏博特	54,600	556,374.00	0.15
167	300349	金卡智能	44,200	548,964.00	0.15
168	002283	天润工业	93,100	544,635.00	0.15
169	603901	永创智能	44,900	534,310.00	0.14
170	300573	兴齐眼药	2,900	528,728.00	0.14
171	003032	传智教育	36,600	527,040.00	0.14
172	000600	建投能源	103,800	520,038.00	0.14
173	002677	浙江美大	51,400	519,654.00	0.14
174	002515	金字火腿	90,400	509,856.00	0.14
175	600633	浙数文化	45,600	504,336.00	0.14
176	600285	羚锐制药	29,400	503,034.00	0.13
177	603636	南威软件	39,200	502,544.00	0.13
178	300291	百纳千成	78,000	502,320.00	0.13
179	002768	国恩股份	23,400	501,228.00	0.13
180	600790	轻纺城	126,000	500,220.00	0.13
181	300856	科思股份	8,000	497,840.00	0.13
182	300288	朗玛信息	30,200	496,790.00	0.13
183	603255	鼎际得	13,300	496,090.00	0.13
184	688768	容知日新	13,448	495,020.88	0.13
185	300123	亚光科技	67,300	493,309.00	0.13
186	600200	江苏吴中	59,800	491,556.00	0.13
187	300327	中颖电子	21,500	490,200.00	0.13
188	600449	宁夏建材	27,300	489,489.00	0.13
189	301215	中汽股份	79,200	488,664.00	0.13
190	603421	鼎信通讯	51,600	485,040.00	0.13
191	002390	信邦制药	109,000	483,960.00	0.13
192	603366	日出东方	77,400	482,202.00	0.13
193	600658	电子城	107,100	478,737.00	0.13
194	000989	九芝堂	46,600	471,592.00	0.13
195	603258	电魂网络	20,500	471,090.00	0.13
196	002232	启明信息	27,500	466,125.00	0.13
197	002214	大立科技	39,500	453,065.00	0.12
198	688083	中望软件	4,491	447,034.14	0.12
199	600007	中国国贸	23,000	445,740.00	0.12

200	300857	协创数据	8,300	439,817.00	0.12
201	688700	东威科技	7,200	439,344.00	0.12
202	688150	莱特光电	19,899	429,619.41	0.12
203	000503	国新健康	32,500	428,350.00	0.11
204	002075	沙钢股份	110,800	423,256.00	0.11
205	603686	福龙马	41,200	421,476.00	0.11
206	002364	中恒电气	54,600	420,420.00	0.11
207	603859	能科科技	11,000	415,030.00	0.11
208	000811	冰轮环境	30,300	411,171.00	0.11
209	000969	安泰科技	45,600	409,944.00	0.11
210	300358	楚天科技	38,200	408,740.00	0.11
211	600756	浪潮软件	29,400	407,778.00	0.11
212	002987	京北方	21,700	403,186.00	0.11
213	300702	天宇股份	18,500	401,635.00	0.11
214	000852	石化机械	65,000	399,750.00	0.11
215	300168	万达信息	47,100	399,408.00	0.11
216	605299	舒华体育	39,900	395,010.00	0.11
217	300492	华图山鼎	4,500	381,015.00	0.10
218	688128	中国电研	18,462	378,840.24	0.10
219	300894	火星人	23,000	373,520.00	0.10
220	000612	焦作万方	64,700	372,025.00	0.10
221	603067	振华股份	36,500	371,935.00	0.10
222	002088	鲁阳节能	26,100	371,925.00	0.10
223	300232	洲明科技	42,200	371,360.00	0.10
224	600531	豫光金铅	60,900	368,445.00	0.10
225	300732	设研院	41,600	367,328.00	0.10
226	000990	诚志股份	44,600	366,166.00	0.10
227	300259	新天科技	100,800	365,904.00	0.10
228	002361	神剑股份	92,800	364,704.00	0.10
229	002818	富森美	29,200	363,832.00	0.10
230	002274	华昌化工	48,000	362,400.00	0.10
231	002948	青岛银行	118,800	362,340.00	0.10
232	000517	荣安地产	147,500	361,375.00	0.10
233	300925	法本信息	30,700	360,725.00	0.10
234	000913	钱江摩托	28,900	360,383.00	0.10
235	601827	三峰环境	47,800	358,978.00	0.10
236	601579	会稽山	33,400	358,716.00	0.10
237	601512	中新集团	46,200	356,202.00	0.10
238	600548	深高速	39,500	355,105.00	0.10
239	300505	川金诺	21,200	355,100.00	0.10
240	300870	欧陆通	8,000	354,160.00	0.09
241	600458	时代新材	38,300	352,743.00	0.09
242	002658	雪迪龙	43,900	352,517.00	0.09

243	688121	卓然股份	17,400	352,002.00	0.09
244	000026	飞亚达	32,100	351,816.00	0.09
245	000061	农产品	53,900	348,733.00	0.09
246	002467	二六三	74,900	347,536.00	0.09
247	688626	翔宇医疗	6,504	346,598.16	0.09
248	300985	致远新能	9,100	343,161.00	0.09
249	002178	延华智能	66,500	343,140.00	0.09
250	000601	韶能股份	80,100	342,828.00	0.09
251	000681	视觉中国	23,200	341,040.00	0.09
252	688277	天智航	25,800	340,044.00	0.09
253	300035	中科电气	32,000	337,280.00	0.09
254	600618	氯碱化工	37,000	336,700.00	0.09
255	000925	众合科技	38,700	335,142.00	0.09
256	000551	创元科技	32,000	335,040.00	0.09
257	688062	迈威生物	10,205	333,601.45	0.09
258	603100	川仪股份	12,000	332,640.00	0.09
259	600433	冠豪高新	93,500	323,510.00	0.09
260	603558	健盛集团	32,700	316,863.00	0.08
261	300596	利安隆	10,500	310,380.00	0.08
262	300036	超图软件	14,700	307,230.00	0.08
263	688568	中科星图	6,032	295,929.92	0.08
264	688315	诺禾致源	12,670	295,717.80	0.08
265	002090	金智科技	29,600	295,408.00	0.08
266	002334	英威腾	33,600	293,328.00	0.08
267	605376	博迁新材	10,400	293,280.00	0.08
268	688378	奥来德	6,192	293,129.28	0.08
269	603076	乐惠国际	10,900	292,120.00	0.08
270	605369	拱东医疗	5,200	290,264.00	0.08
271	600731	湖南海利	44,130	289,934.10	0.08
272	002649	博彦科技	23,600	289,572.00	0.08
273	688371	菲沃泰	16,442	289,543.62	0.08
274	688267	中触媒	15,059	289,433.98	0.08
275	002635	安洁科技	17,700	289,041.00	0.08
276	688499	利元亨	7,586	288,874.88	0.08
277	300138	晨光生物	21,500	288,745.00	0.08
278	300378	鼎捷软件	13,500	287,685.00	0.08
279	600729	重庆百货	10,200	287,640.00	0.08
280	000922	佳电股份	28,000	287,560.00	0.08
281	000055	方大集团	63,600	287,472.00	0.08
282	603881	数据港	14,500	287,390.00	0.08
283	300193	佳士科技	36,900	286,713.00	0.08
284	002318	久立特材	14,400	286,272.00	0.08
285	002421	达实智能	88,700	285,614.00	0.08

286	002483	润邦股份	54,700	285,534.00	0.08
287	002912	中新赛克	10,200	285,498.00	0.08
288	300740	水羊股份	17,100	285,057.00	0.08
289	601089	福元医药	16,500	284,460.00	0.08
290	002412	汉森制药	41,900	284,082.00	0.08
291	301239	普瑞眼科	3,300	283,800.00	0.08
292	300439	美康生物	24,400	283,284.00	0.08
293	002062	宏润建设	63,800	282,634.00	0.08
294	600572	康恩贝	55,900	282,295.00	0.08
295	600512	腾达建设	113,700	281,976.00	0.08
296	300075	数字政通	16,000	281,600.00	0.08
297	002448	中原内配	42,400	281,536.00	0.08
298	300430	诚益通	19,700	281,513.00	0.08
299	000028	国药一致	9,700	281,203.00	0.08
300	688661	和林微纳	6,128	280,784.96	0.08
301	600429	三元股份	62,700	279,642.00	0.08
302	600880	博瑞传播	55,500	278,055.00	0.07
303	002434	万里扬	37,100	276,395.00	0.07
304	300229	拓尔思	16,300	274,818.00	0.07
305	002980	华盛昌	9,600	263,040.00	0.07
306	002573	清新环境	53,000	262,350.00	0.07
307	300066	三川智慧	51,800	261,590.00	0.07
308	002443	金洲管道	38,100	260,985.00	0.07
309	000531	穗恒运 A	38,100	254,889.00	0.07
310	300188	国投智能	15,800	253,116.00	0.07
311	300344	立方数科	43,500	247,515.00	0.07
312	301122	采纳股份	7,300	247,178.00	0.07
313	600750	江中药业	11,700	244,296.00	0.07
314	002578	闽发铝业	54,200	242,816.00	0.07
315	601126	四方股份	17,100	242,136.00	0.06
316	300420	五洋停车	79,600	241,984.00	0.06
317	002051	中工国际	29,800	241,976.00	0.06
318	300638	广和通	12,700	241,681.00	0.06
319	000049	德赛电池	8,870	240,554.40	0.06
320	688337	普源精电	5,400	236,898.00	0.06
321	605009	豪悦护理	6,200	236,654.00	0.06
322	688699	明微电子	5,804	234,191.40	0.06
323	600713	南京医药	48,200	233,288.00	0.06
324	002546	新联电子	46,400	232,000.00	0.06
325	301087	可孚医疗	6,100	231,190.00	0.06
326	600223	福瑞达	23,900	230,157.00	0.06
327	002815	崇达技术	24,000	229,920.00	0.06
328	002847	盐津铺子	3,300	229,284.00	0.06

329	002759	天际股份	21,600	229,176.00	0.06
330	300099	尤洛卡	36,700	227,173.00	0.06
331	002398	垒知集团	47,500	226,575.00	0.06
332	605507	国邦医药	12,900	226,524.00	0.06
333	601678	滨化股份	53,600	225,656.00	0.06
334	601963	重庆银行	32,000	222,720.00	0.06
335	002807	江阴银行	62,700	222,585.00	0.06
336	601860	紫金银行	87,900	222,387.00	0.06
337	600308	华泰股份	64,100	221,786.00	0.06
338	605168	三人行	3,500	221,760.00	0.06
339	300133	华策影视	37,300	218,951.00	0.06
340	603918	金桥信息	11,700	218,790.00	0.06
341	301311	昆船智能	9,000	218,700.00	0.06
342	002777	久远银海	8,700	218,457.00	0.06
343	002267	陕天然气	29,800	218,434.00	0.06
344	300580	贝斯特	7,200	218,016.00	0.06
345	002919	名臣健康	8,500	217,940.00	0.06
346	603108	润达医疗	10,700	217,745.00	0.06
347	300085	银之杰	15,200	217,664.00	0.06
348	688029	南微医学	2,246	217,412.80	0.06
349	603477	巨星农牧	5,800	217,326.00	0.06
350	688233	神工股份	6,157	217,280.53	0.06
351	600035	楚天高速	56,800	216,976.00	0.06
352	603383	顶点软件	4,400	216,920.00	0.06
353	002728	特一药业	12,100	216,832.00	0.06
354	301095	广立微	2,900	216,717.00	0.06
355	688578	艾力斯	5,200	216,632.00	0.06
356	002115	三维通信	30,000	216,600.00	0.06
357	300215	电科院	40,900	216,361.00	0.06
358	300429	强力新材	16,800	216,048.00	0.06
359	002400	省广集团	38,900	215,895.00	0.06
360	300969	恒帅股份	2,400	215,688.00	0.06
361	301297	富乐德	8,000	215,680.00	0.06
362	002401	中远海科	11,900	215,628.00	0.06
363	600976	健民集团	3,300	215,325.00	0.06
364	300047	天源迪科	24,600	215,250.00	0.06
365	300657	弘信电子	11,100	215,229.00	0.06
366	000888	峨眉山 A	24,100	215,213.00	0.06
367	300396	迪瑞医疗	7,300	214,985.00	0.06
368	002627	三峡旅游	40,200	214,668.00	0.06
369	000829	天音控股	22,500	214,650.00	0.06
370	002342	巨力索具	49,700	214,207.00	0.06
371	600780	通宝能源	26,100	214,020.00	0.06

372	002038	双鹭药业	21,000	213,990.00	0.06
373	002003	伟星股份	19,700	213,745.00	0.06
374	600184	光电股份	18,700	213,741.00	0.06
375	300311	任子行	34,900	213,239.00	0.06
376	000025	特力 A	13,400	213,194.00	0.06
377	300098	高新兴	52,500	213,150.00	0.06
378	300125	聆达股份	16,900	213,109.00	0.06
379	300391	长药控股	27,500	212,850.00	0.06
380	600012	皖通高速	19,300	212,686.00	0.06
381	002832	比音勒芬	6,700	212,390.00	0.06
382	600279	重庆港	47,700	212,265.00	0.06
383	300507	苏奥传感	31,400	212,264.00	0.06
384	600084	中葡股份	27,000	212,220.00	0.06
385	300379	东方通	11,600	212,048.00	0.06
386	603181	皇马科技	19,400	212,042.00	0.06
387	603949	雪龙集团	11,300	211,649.00	0.06
388	688066	航天宏图	5,000	211,200.00	0.06
389	600300	维维股份	67,900	211,169.00	0.06
390	002379	宏创控股	46,500	211,110.00	0.06
391	600594	益佰制药	37,100	211,099.00	0.06
392	002187	广百股份	33,400	210,754.00	0.06
393	000552	甘肃能化	69,000	210,450.00	0.06
393	002034	旺能环境	13,800	210,450.00	0.06
394	000088	盐田港	43,100	210,328.00	0.06
395	000036	华联控股	54,000	210,060.00	0.06
396	603069	海汽集团	11,400	209,760.00	0.06
397	600252	中恒集团	83,500	209,585.00	0.06
398	600508	上海能源	15,100	209,286.00	0.06
399	603313	梦百合	19,900	208,950.00	0.06
400	000507	珠海港	39,700	208,822.00	0.06
401	001301	尚太科技	5,700	208,734.00	0.06
402	603300	华铁应急	32,600	208,640.00	0.06
403	605266	健之佳	3,500	207,900.00	0.06
404	000791	甘肃能源	37,200	207,204.00	0.06
405	603708	家家悦	15,600	203,892.00	0.05
406	603393	新天然气	6,600	201,762.00	0.05
407	605222	起帆电缆	10,300	198,584.00	0.05
408	000029	深深房 A	16,700	196,392.00	0.05
409	603979	金诚信	5,200	196,352.00	0.05
410	002783	凯龙股份	14,300	165,737.00	0.04
411	603396	金辰股份	3,000	163,950.00	0.04
412	603212	赛伍技术	8,700	151,119.00	0.04
413	002130	沃尔核材	19,400	146,470.00	0.04

414	688680	海优新材	2,212	145,217.80	0.04
415	603333	尚纬股份	25,300	144,463.00	0.04
416	002967	广电计量	9,600	144,096.00	0.04
417	600537	亿晶光电	26,000	143,260.00	0.04
418	300053	航宇微	11,700	143,091.00	0.04
419	002737	葵花药业	5,500	142,890.00	0.04
420	600371	万向德农	13,300	142,709.00	0.04
421	688382	益方生物	9,400	142,316.00	0.04
422	603112	华翔股份	11,700	142,155.00	0.04
423	600761	安徽合力	7,800	142,038.00	0.04
424	600894	广日股份	19,300	141,855.00	0.04
425	301080	百普赛斯	2,400	141,456.00	0.04
426	002662	京威股份	40,300	141,453.00	0.04
427	300266	兴源环境	52,300	141,210.00	0.04
428	002911	佛燃能源	12,300	140,958.00	0.04
429	603590	康辰药业	3,700	140,896.00	0.04
430	600359	新农开发	19,000	140,790.00	0.04
431	000597	东北制药	26,300	140,705.00	0.04
432	002039	黔源电力	10,100	139,279.00	0.04
433	603889	新澳股份	19,500	138,840.00	0.04
434	603013	亚普股份	8,000	138,240.00	0.04
435	300566	激智科技	7,400	138,232.00	0.04
436	600206	有研新材	11,100	137,529.00	0.04
437	600480	凌云股份	14,700	133,917.00	0.04
438	688319	欧林生物	8,463	133,715.40	0.04
439	002011	盾安环境	9,700	133,375.00	0.04
440	601038	一拖股份	9,000	131,130.00	0.04
441	002126	银轮股份	7,000	130,690.00	0.04
442	003038	鑫铂股份	3,800	130,530.00	0.04
443	002182	宝武镁业	6,600	129,756.00	0.03
444	688179	阿拉丁	6,717	128,697.72	0.03
445	300791	仙乐健康	3,700	128,242.00	0.03
446	688003	天准科技	3,400	127,568.00	0.03
447	601137	博威合金	8,200	127,346.00	0.03
448	002335	科华数据	4,600	127,328.00	0.03
449	300415	伊之密	7,200	126,936.00	0.03
450	002276	万马股份	12,400	126,728.00	0.03
451	002988	豪美新材	5,300	126,511.00	0.03
452	300320	海达股份	16,200	126,036.00	0.03
453	300237	美晨生态	58,700	125,618.00	0.03
454	002838	道恩股份	9,800	125,538.00	0.03
455	603618	杭电股份	19,600	125,440.00	0.03
456	600477	杭萧钢构	38,100	125,349.00	0.03

457	300456	赛微电子	5,200	125,008.00	0.03
458	002419	天虹股份	22,500	124,425.00	0.03
459	603197	保隆科技	2,200	124,080.00	0.03
460	603055	台华新材	10,300	124,012.00	0.03
461	603997	继峰股份	9,200	123,924.00	0.03
462	000885	城发环境	10,900	123,606.00	0.03
463	603515	欧普照明	7,100	123,398.00	0.03
464	300436	广生堂	4,800	123,024.00	0.03
465	002639	雪人股份	16,400	123,000.00	0.03
466	600668	尖峰集团	11,100	122,655.00	0.03
467	300206	理邦仪器	12,000	122,520.00	0.03
468	002061	浙江交科	33,400	121,910.00	0.03
469	300119	瑞普生物	7,400	121,286.00	0.03
470	600284	浦东建设	19,200	120,960.00	0.03
471	600728	佳都科技	21,100	120,692.00	0.03
472	300203	聚光科技	7,600	120,460.00	0.03
473	600810	神马股份	16,100	119,784.00	0.03
474	688575	亚辉龙	5,200	118,924.00	0.03
475	300077	国民技术	10,500	118,545.00	0.03
476	300552	万集科技	4,000	118,400.00	0.03
477	301302	华如科技	4,700	118,017.00	0.03
478	603138	海量数据	6,600	117,480.00	0.03
479	603118	共进股份	13,100	117,376.00	0.03
480	688221	前沿生物	11,800	117,056.00	0.03
481	000901	航天科技	12,500	116,500.00	0.03
482	000555	神州信息	10,300	116,287.00	0.03
483	003029	吉大正元	5,800	114,318.00	0.03
484	002279	久其软件	17,500	113,925.00	0.03
485	300624	万兴科技	1,200	113,520.00	0.03
486	600686	金龙汽车	14,500	109,765.00	0.03
487	300752	隆利科技	6,000	109,020.00	0.03
488	688023	安恒信息	970	107,563.30	0.03
489	002707	众信旅游	14,300	102,102.00	0.03
490	605007	五洲特纸	6,900	101,499.00	0.03
491	600230	沧州大化	7,500	101,025.00	0.03
492	600420	国药现代	8,900	87,131.00	0.02
493	300729	乐歌股份	4,600	82,386.00	0.02
494	002332	仙琚制药	5,900	75,343.00	0.02
495	600742	一汽富维	7,600	72,580.00	0.02
496	002275	桂林三金	5,000	72,450.00	0.02
497	000550	江铃汽车	3,800	72,314.00	0.02
498	603319	湘油泵	4,100	71,914.00	0.02
499	603609	禾丰股份	8,400	71,904.00	0.02

500	600403	大有能源	17,600	66,880.00	0.02
501	688660	电气风电	11,529	59,259.06	0.02
502	603966	法兰泰克	7,200	58,896.00	0.02
503	002605	姚记科技	2,600	57,772.00	0.02
504	603995	甬金股份	2,800	53,844.00	0.01
505	600307	酒钢宏兴	33,400	49,766.00	0.01
506	002891	中宠股份	1,600	42,160.00	0.01
507	603063	禾望电气	1,500	37,500.00	0.01
508	688208	道通科技	213	5,058.75	0.00
509	688369	致远互联	134	4,637.74	0.00
510	688302	海创药业	16	833.12	0.00

8.3.2 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	002382	蓝帆医疗	267,200	1,784,896.00	0.48
2	600370	三房巷	698,200	1,689,644.00	0.45
3	002637	赞宇科技	147,300	1,580,529.00	0.42
4	000100	TCL 科技	340,900	1,465,870.00	0.39
5	600098	广州发展	248,600	1,334,982.00	0.36
6	600623	华谊集团	206,500	1,329,860.00	0.36
7	002793	罗欣药业	244,800	1,312,128.00	0.35
8	688180	君实生物	29,690	1,241,932.70	0.33
9	603886	元祖股份	59,900	1,091,977.00	0.29
10	600737	中粮糖业	125,600	1,034,944.00	0.28
11	002589	瑞康医药	312,300	1,021,221.00	0.27
12	002405	四维图新	111,400	991,460.00	0.27
13	601138	工业富联	63,600	961,632.00	0.26
14	002392	北京利尔	242,700	917,406.00	0.25
15	603115	海星股份	59,000	863,760.00	0.23
16	600582	天地科技	152,000	826,880.00	0.22
17	002249	大洋电机	160,700	798,679.00	0.21
18	300866	安克创新	9,000	797,400.00	0.21
19	601607	上海医药	46,400	776,272.00	0.21
20	600707	彩虹股份	115,000	776,250.00	0.21
21	002798	帝欧家居	117,900	772,245.00	0.21
22	000921	海信家电	37,700	769,080.00	0.21
23	600841	动力新科	128,700	760,617.00	0.20
24	601717	郑煤机	58,300	737,495.00	0.20
25	603236	移远通信	13,400	720,250.00	0.19

26	600203	福日电子	97,100	719,511.00	0.19
27	603351	威尔药业	27,100	714,627.00	0.19
28	600744	华银电力	219,200	710,208.00	0.19
29	688109	品茗科技	25,127	707,827.59	0.19
30	000930	中粮科技	104,700	695,208.00	0.19
31	600332	白云山	24,200	692,120.00	0.19
32	002481	双塔食品	154,100	679,581.00	0.18
33	600487	亨通光电	56,600	675,804.00	0.18
34	603788	宁波高发	45,100	673,343.00	0.18
35	603232	格尔软件	48,800	668,072.00	0.18
36	002743	富煌钢构	111,000	663,780.00	0.18
37	002992	宝明科技	8,300	647,400.00	0.17
38	002734	利民股份	79,700	635,209.00	0.17
39	600967	内蒙一机	75,500	623,630.00	0.17
40	000895	双汇发展	23,300	622,343.00	0.17
41	000526	学大教育	12,400	619,876.00	0.17
42	603863	松炆资源	18,200	615,706.00	0.17
43	688480	赛恩斯	15,800	611,776.00	0.16
44	600271	航天信息	57,200	608,608.00	0.16
45	600881	亚泰集团	310,800	606,060.00	0.16
46	000039	中集集团	79,200	605,880.00	0.16
47	688228	开普云	9,220	603,264.60	0.16
48	603096	新经典	30,100	592,368.00	0.16
49	600153	建发股份	55,000	529,650.00	0.14
50	600605	汇通能源	18,800	522,076.00	0.14
51	301070	开勒股份	11,400	511,404.00	0.14
52	600050	中国联通	116,300	509,394.00	0.14
53	600674	川投能源	32,900	497,448.00	0.13
54	002657	中科金财	27,000	491,940.00	0.13
55	002228	合兴包装	143,400	491,862.00	0.13
56	002128	电投能源	33,800	482,326.00	0.13
57	600546	山煤国际	27,500	481,525.00	0.13
58	600066	宇通客车	36,300	480,975.00	0.13
59	600569	安阳钢铁	224,800	478,824.00	0.13
60	000572	海马汽车	97,500	478,725.00	0.13
61	600261	阳光照明	131,800	430,986.00	0.12
62	300196	长海股份	39,200	426,496.00	0.11
63	605288	凯迪股份	8,900	419,368.00	0.11
64	601158	重庆水务	72,700	412,209.00	0.11
65	002229	鸿博股份	14,800	411,440.00	0.11
66	600170	上海建工	171,600	401,544.00	0.11
67	601058	赛轮轮胎	33,500	393,625.00	0.11
68	000880	潍柴重机	34,800	369,924.00	0.10

69	002032	苏泊尔	6,900	365,769.00	0.10
70	002097	山河智能	59,500	364,735.00	0.10
71	002827	高争民爆	21,700	363,475.00	0.10
72	603217	元利科技	19,900	362,976.00	0.10
73	603758	秦安股份	31,300	358,072.00	0.10
74	603303	得邦照明	27,800	357,230.00	0.10
75	002563	森马服饰	61,700	356,009.00	0.10
76	601006	大秦铁路	49,200	354,732.00	0.10
77	688418	震有科技	18,428	347,552.08	0.09
78	002654	万润科技	27,800	345,276.00	0.09
79	603388	元成股份	38,000	343,520.00	0.09
80	688256	寒武纪	2,400	323,904.00	0.09
81	601928	凤凰传媒	35,100	309,231.00	0.08
82	688737	中自科技	9,096	301,077.60	0.08
83	002453	华软科技	26,000	293,800.00	0.08
84	600038	中直股份	7,600	292,828.00	0.08
85	600570	恒生电子	10,100	290,476.00	0.08
86	300212	易华录	9,200	289,340.00	0.08
87	688625	呈和科技	7,373	289,169.06	0.08
88	600129	太极集团	6,200	288,052.00	0.08
89	002223	鱼跃医疗	8,300	287,014.00	0.08
90	301004	嘉益股份	6,300	286,335.00	0.08
91	001896	豫能控股	65,200	284,924.00	0.08
92	002548	金新农	50,600	284,878.00	0.08
93	300979	华利集团	5,400	284,256.00	0.08
94	605188	国光连锁	33,095	281,638.45	0.08
95	002474	榕基软件	42,800	281,624.00	0.08
96	600820	隧道股份	48,700	280,512.00	0.08
97	301052	果麦文化	6,400	280,192.00	0.08
98	600640	国脉文化	24,300	278,721.00	0.07
99	002821	凯莱英	2,400	278,640.00	0.07
100	000975	银泰黄金	18,500	277,500.00	0.07
101	000625	长安汽车	16,400	276,012.00	0.07
102	601929	吉视传媒	151,600	275,912.00	0.07
103	600015	华夏银行	48,400	272,008.00	0.07
104	301200	大族数控	7,200	271,944.00	0.07
105	000157	中联重科	41,200	269,036.00	0.07
106	603179	新泉股份	5,300	268,763.00	0.07
107	603721	中广天择	9,300	260,772.00	0.07
108	688111	金山办公	800	252,960.00	0.07
109	603365	水星家纺	17,000	244,460.00	0.07
110	002687	乔治白	45,400	241,982.00	0.06
111	601800	中国交建	31,600	240,160.00	0.06

112	603929	亚翔集成	9,800	234,416.00	0.06
113	300949	奥雅股份	4,000	231,960.00	0.06
114	601336	新华保险	7,400	230,362.00	0.06
115	002014	永新股份	27,400	228,790.00	0.06
116	688167	炬光科技	2,000	228,000.00	0.06
117	688159	有方科技	6,000	225,900.00	0.06
118	601186	中国铁建	29,600	225,256.00	0.06
119	001218	丽臣实业	10,400	224,744.00	0.06
120	600527	江南高纤	113,600	221,520.00	0.06
121	002763	汇洁股份	26,300	221,183.00	0.06
122	603444	吉比特	900	220,608.00	0.06
123	600398	海澜之家	29,600	219,632.00	0.06
124	601857	中国石油	31,100	219,566.00	0.06
125	000158	常山北明	25,400	218,948.00	0.06
126	300840	酷特智能	10,900	217,019.00	0.06
127	603773	沃格光电	6,400	216,768.00	0.06
128	603528	多伦科技	23,600	214,288.00	0.06
129	002316	亚联发展	40,900	213,089.00	0.06
130	603839	安正时尚	25,600	212,480.00	0.06
131	002790	瑞尔特	20,300	211,932.00	0.06
132	300928	华安鑫创	4,200	211,848.00	0.06
133	300254	仟源医药	21,900	210,897.00	0.06
134	002555	三七互娱	11,200	210,672.00	0.06
135	300952	恒辉安防	9,500	206,910.00	0.06
136	000402	金融街	55,200	200,376.00	0.05
137	601096	宏盛华源	26,672	145,624.08	0.04
138	603898	好莱客	13,200	144,804.00	0.04
139	601360	三六零	15,900	143,259.00	0.04
140	002429	兆驰股份	25,500	142,290.00	0.04
141	300082	奥克股份	20,400	142,188.00	0.04
142	002498	汉缆股份	35,400	141,600.00	0.04
143	002325	洪涛股份	89,600	141,568.00	0.04
144	600166	福田汽车	51,800	141,414.00	0.04
145	000709	河钢股份	65,600	139,728.00	0.04
146	000404	长虹华意	23,700	139,593.00	0.04
147	300741	华宝股份	6,500	139,165.00	0.04
148	603010	万盛股份	12,800	138,112.00	0.04
149	605289	罗曼股份	2,400	138,000.00	0.04
150	300919	中伟股份	2,800	137,564.00	0.04
151	603298	杭叉集团	5,500	136,840.00	0.04
152	601600	中国铝业	24,100	135,924.00	0.04
153	000559	万向钱潮	25,500	132,345.00	0.04
154	603225	新凤鸣	9,300	132,060.00	0.04

155	601233	桐昆股份	8,600	130,118.00	0.03
156	600143	金发科技	16,200	129,438.00	0.03
157	002078	太阳纸业	10,500	127,785.00	0.03
158	600727	鲁北化工	19,400	127,652.00	0.03
159	601668	中国建筑	26,200	126,022.00	0.03
160	300818	耐普矿机	3,800	125,438.00	0.03
161	600808	马钢股份	46,000	125,120.00	0.03
162	002422	科伦药业	4,300	124,915.00	0.03
163	600104	上汽集团	9,200	124,476.00	0.03
164	000338	潍柴动力	9,100	124,215.00	0.03
165	600819	耀皮玻璃	24,400	124,196.00	0.03
166	603992	松霖科技	6,800	123,352.00	0.03
167	600566	济川药业	3,900	122,577.00	0.03
168	600482	中国动力	6,800	122,468.00	0.03
169	603068	博通集成	4,200	122,430.00	0.03
170	002236	大华股份	6,600	121,770.00	0.03
171	688561	奇安信	3,037	121,753.33	0.03
172	000698	沈阳化工	28,800	121,536.00	0.03
173	002439	启明星辰	4,500	121,500.00	0.03
174	600019	宝钢股份	20,300	120,379.00	0.03
175	000539	粤电力 A	24,300	118,827.00	0.03
176	000008	神州高铁	50,100	118,236.00	0.03
177	002065	东华软件	19,000	117,230.00	0.03
178	600718	东软集团	12,600	116,550.00	0.03
179	002819	东方中科	4,500	115,245.00	0.03
180	600637	东方明珠	14,600	109,792.00	0.03
181	300454	深信服	1,500	108,435.00	0.03
182	603866	桃李面包	13,400	102,644.00	0.03
183	600667	太极实业	14,600	102,638.00	0.03
184	002027	分众传媒	16,100	101,752.00	0.03
185	002986	宇新股份	6,500	101,400.00	0.03
186	600596	新安股份	11,100	101,232.00	0.03
187	601390	中国中铁	17,800	101,104.00	0.03
188	002822	中装建设	22,900	100,302.00	0.03
189	600578	京能电力	33,700	99,752.00	0.03
190	002394	联发股份	12,000	99,720.00	0.03
191	002172	澳洋健康	26,000	98,540.00	0.03
192	000729	燕京啤酒	10,900	94,067.00	0.03
193	601919	中远海控	9,700	92,926.00	0.02
194	600362	江西铜业	5,100	91,086.00	0.02
195	600498	烽火通信	4,200	69,888.00	0.02
196	600619	海立股份	9,700	66,057.00	0.02
197	601956	东贝集团	9,600	57,312.00	0.02

198	603228	景旺电子	2,500	56,400.00	0.02
199	601989	中国重工	10,700	44,191.00	0.01
200	301526	国际复材	5,312	23,638.40	0.01
201	301558	三态股份	1,458	19,537.20	0.01
202	688652	京仪装备	330	17,242.50	0.00
203	301559	中集环科	867	15,876.08	0.00
204	301566	达利凯普	576	12,752.64	0.00
205	688719	爱科赛博	194	11,659.40	0.00
206	301508	中机认检	419	11,178.92	0.00
207	603196	日播时尚	800	10,808.00	0.00
208	688653	康希通信	648	10,361.52	0.00
209	688716	中研股份	267	9,716.13	0.00
210	301413	安培龙	164	9,543.16	0.00
211	301516	中远通	604	9,368.04	0.00
212	301568	思泰克	246	8,752.68	0.00
213	301520	万邦医药	160	8,438.40	0.00
214	301459	丰茂股份	208	8,286.72	0.00
215	688720	艾森股份	165	8,223.60	0.00
216	301489	思泉新材	128	8,206.08	0.00
217	301517	陕西华达	185	8,082.65	0.00
218	301578	辰奕智能	118	8,061.76	0.00
219	688657	浩辰软件	101	7,901.23	0.00
220	601083	锦江航运	681	7,680.67	0.00
221	301555	惠柏新材	224	7,266.56	0.00
222	688648	中邮科技	303	6,493.29	0.00
223	001378	德冠新材	205	6,410.35	0.00
224	603004	鼎龙科技	171	5,333.49	0.00
225	603107	上海汽配	292	5,311.48	0.00
226	603193	润本股份	303	5,047.98	0.00
227	001326	联域股份	99	4,815.36	0.00
228	001358	兴欣新材	87	3,841.92	0.00
229	001239	永达股份	189	3,764.88	0.00
230	688063	派能科技	32	3,392.00	0.00
231	603273	天元智能	178	3,376.66	0.00
232	603276	恒兴新材	134	3,333.92	0.00
233	603231	索宝蛋白	145	3,121.85	0.00
234	603373	安邦护卫	88	3,058.00	0.00
235	688345	博力威	1	31.46	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	001696	宗申动力	4,709,380.00	1.26
2	600502	安徽建工	4,408,381.00	1.18
3	603639	海利尔	4,348,823.00	1.17
4	603367	辰欣药业	4,302,279.00	1.15
5	600210	紫江企业	4,299,414.00	1.15
6	002212	天融信	4,285,343.00	1.15
7	002275	桂林三金	4,198,621.00	1.13
8	002533	金杯电工	4,198,253.00	1.13
9	002757	南兴股份	4,089,289.00	1.10
10	002022	科华生物	4,067,498.00	1.09
11	002987	京北方	4,065,928.60	1.09
12	002540	亚太科技	4,026,229.00	1.08
13	601003	柳钢股份	3,946,219.00	1.06
14	603012	创力集团	3,928,155.00	1.05
15	002367	康力电梯	3,896,202.00	1.04
16	600997	开滦股份	3,747,122.00	1.00
17	002004	华邦健康	3,701,287.00	0.99
18	603071	物产环能	3,673,834.00	0.99
19	603897	长城科技	3,592,724.00	0.96
20	600757	长江传媒	3,557,172.00	0.95

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。

8.4.2 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	002275	桂林三金	4,028,223.00	1.08
2	002757	南兴股份	3,599,169.00	0.97
3	603003	龙宇股份	3,572,601.00	0.96
4	002022	科华生物	3,557,005.00	0.95
5	002987	京北方	3,424,420.00	0.92
6	600997	开滦股份	3,175,312.00	0.85
7	600742	一汽富维	2,998,753.00	0.80
8	600789	鲁抗医药	2,986,707.55	0.80
9	002540	亚太科技	2,935,247.00	0.79
10	600218	全柴动力	2,933,000.00	0.79
11	001696	宗申动力	2,920,343.00	0.78

12	000555	神州信息	2,884,643.00	0.77
13	002416	爱施德	2,775,878.00	0.74
14	603367	辰欣药业	2,697,190.00	0.72
15	000541	佛山照明	2,599,440.60	0.70
16	002042	华孚时尚	2,597,650.00	0.70
17	601003	柳钢股份	2,574,617.00	0.69
18	002967	广电计量	2,556,509.00	0.69
19	688369	致远互联	2,534,378.05	0.68
20	002664	信质集团	2,504,277.00	0.67

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。

8.4.3 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	951,502,391.04
卖出股票收入（成交）总额	620,617,984.40

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。

8.5 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）	18,001.06	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	18,001.06	0.00

8.6 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	113069	博 23 转债	180	18,001.06	0.00

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

8.12 投资组合报告附注

报告期内基金投资的前十名证券除安徽建工（证券代码 600502）、楚江新材（证券代码 002171）、金田股份（证券代码 601609）、诺力股份（证券代码 603611）外其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

1、安徽建工（证券代码 600502）

根据发布的相关公告，该证券发行人在报告期内因未依法履行职责、未按期申报税款等原因，多次受到监管机构的处罚。

2、楚江新材（证券代码 002171）

根据 2023 年 1 月 29 日发布的相关公告，该证券发行人因违反安全生产行为被芜湖经济技术开发区管理委员会处以罚款。

3、金田股份（证券代码 601609）

根据 2023 年 3 月 7 日发布的相关公告，该证券发行人因违反海关监管规定被中华人民共和国北仑海关处以罚款。

根据 2023 年 3 月 15 日发布的相关公告，该证券发行人因违反海关监管规定被中华人民共和国北仑海关处以罚款。

根据 2023 年 4 月 12 日发布的相关公告，该证券发行人因违反海关监管规定被宁波海关处以罚款。

4、诺力股份（证券代码 603611）

根据 2023 年 9 月 13 日发布的相关公告，该证券发行人因未依法履行职责被苏州工业园区市场监管局处以罚款。

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。

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。

8.12.1 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	2,397,336.00
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	12,746,839.03
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	15,144,175.03
---	----	---------------

8.12.2 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。

8.12.3 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.3.1 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。

8.12.3.2 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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	1,100	75,966.38	4,255,052.66	5.09%	79,307,960.22	94.91%
招商国证 2000 指数增强 C	2,794	104,256.68	53,422,570.21	18.34%	237,870,580.34	81.66%
合计	3,894	96,265.07	57,677,622.87	15.39%	317,178,540.56	84.61%

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）。

9.2 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	11,632.77	0.0139%
	招商国证 2000 指数增强 C	102.18	0.0000%
	合计	11,734.95	0.0031%

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）。

9.3 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	0
	合计	0

9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

基金经理姓名	产品类型	持有本人管理的产品份额总量的数量区间（万份）
邓童	公募基金	10~50
	私募资产管理计划	0
	合计	10~50

§ 10 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
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	7,591,841.81	140,784,183.63
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	80,343,964.55	320,825,275.30
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	83,563,012.88	291,293,150.55

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

根据本基金管理人 2023 年 8 月 30 日的公告，经招商基金管理有限公司第六届董事会 2023 年第五次会议审议通过，同意聘任孙明霞女士为公司副总经理。

根据本基金管理人 2023 年 9 月 28 日的公告，经招商基金管理有限公司第六届董事会 2023 年第七次会议审议通过，同意聘任董方先生为公司副总经理。

根据本基金管理人 2023 年 12 月 30 日的公告，经招商基金管理有限公司第七届董事会 2023 年第一次会议审议通过，同意聘任孙明霞女士为公司财务负责人。

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。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金的审计事务所无变化，目前德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）已为本基金提供审计服务 1 年，本报告期应支付给德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为人民币 11,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 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。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	751,553,519.92	47.88%	492,294.29	48.35%	-
西南证券	3	453,940,107.49	28.92%	312,166.53	30.66%	-
东海证券	3	364,301,098.37	23.21%	213,654.57	20.99%	-

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

11.7.2 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	238,588.56	38.76%	2,327,390,000.00	59.82%	-	-
西南证券	233,668.86	37.96%	752,000,000.00	19.33%	-	-
东海证券	143,327.47	23.28%	811,000,000.00	20.85%	-	-

11.8 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	招商国证 2000 指数增强型证券投资基金托管协议	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	2023-06-29
2	招商国证 2000 指数增强型证券投资基金招募说明书	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	2023-06-29
3	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	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	2023-06-29
4	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	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	2023-06-29
5	招商基金管理有限公司关于养老金客户通过直	证券时报、基金管理	2023-06-29

	销柜台认购旗下招商国证 2000 指数增强型证券投资基金 A 类基金份额费率优惠的公告	人网站及中国证监会基金电子披露网站	
6	招商国证 2000 指数增强型证券投资基金基金合同	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	2023-06-29
7	招商国证 2000 指数增强型证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告	证券时报及基金管理人网站	2023-06-29
8	招商国证 2000 指数增强型证券投资基金基金份额发售公告	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	2023-06-29
9	招商国证 2000 指数增强型证券投资基金基金合同生效公告	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	2023-08-02
10	招商基金管理有限公司关于运用自有资金投资旗下公募基金的公告	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	2023-08-21
11	招商基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	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	2023-08-30
12	关于开放招商国证 2000 指数增强型证券投资基金日常申购赎回及转换和定期定额投资业务的公告	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	2023-09-02
13	招商基金管理有限公司关于终止南京途牛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	2023-09-05
14	招商基金管理有限公司关于终止凤凰金信（海口）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	2023-09-07
15	招商基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	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	2023-09-28
16	招商国证 2000 指数增强型证券投资基金 2023 年第 3 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	2023-10-24
17	招商基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 3 季度报告提示性公告	证券时报及基金管理人网站	2023-10-24
18	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	2023-10-24
19	招商基金管理有限公司关于运用自有资金投资旗下公募基金的公告	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	2023-10-30
20	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	2023-11-11

		基金电子披露网站	
21	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	2023-12-14
22	招商基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	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	2023-12-30

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准设立招商基金管理有限公司的文件；
- 2、中国证券监督管理委员会批准招商国证 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。

12.2 存放地点

招商基金管理有限公司
地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

12.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人招商基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-887-9555

网址：<http://www.cmfcchina.com>

招商基金管理有限公司

2024 年 3 月 29 日