

招商国证 2000 指数增强型证券投资基金 2024 年年度报告

2024 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：2025 年 3 月 28 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 2025 年 3 月 27 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 2024 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 2024 年 1 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	9
§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	11
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	12
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	15
6.1 审计报告的基本内容	15
§7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	18
7.3 净资产变动表	19
7.4 报表附注	21
§8 投资组合报告	52
8.1 期末基金资产组合情况	52
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	53
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	54
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	75
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	77
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	77

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	77
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	77
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	77
8.10	本基金投资股指期货的投资政策	78
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	78
8.12	投资组合报告附注	78
§9	基金份额持有人信息	79
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	79
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	80
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	80
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	80
§10	开放式基金份额变动	81
§11	重大事件揭示	81
11.1	基金份额持有人大会决议	81
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	81
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	81
11.4	基金投资策略的改变	81
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	81
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	82
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	82
11.8	其他重大事件	83
§12	备查文件目录	84
12.1	备查文件目录	84
12.2	存放地点	85
12.3	查阅方式	85

§ 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	147,864,917.18 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	62,951,190.09 份	84,913,727.09 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	2024 年	2023 年 8 月 1 日-2023 年 12 月 31 日
本期已实现收益	3,752,674.58	1,395,645.36
本期利润	8,529,157.73	-273,599.18
加权平均基金份额本期利润	0.1144	-0.0021
本期加权平均净值利润率	12.08%	-0.21%
本期基金份额净值增长率	7.82%	-0.41%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末	2023 年末
期末可供分配利润	4,644,654.81	-339,521.07
期末可供分配基金份额利润	0.0738	-0.0041
期末基金资产净值	67,595,844.90	83,223,491.81
期末基金份额净值	1.0738	0.9959

3.1.3 累计期末指标	2024 年末	2023 年末
基金份额累计净值增长率	7.38%	-0.41%

2、招商国证 2000 指数增强 C

3.1.1 期间数据和指标	2024 年	2023 年 8 月 1 日-2023 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-4,417,166.10	2,963,083.68
本期利润	1,474,907.38	-1,096,677.60
加权平均基金份额本期利润	0.0084	-0.0028
本期加权平均净值利润率	0.90%	-0.28%
本期基金份额净值增长率	7.38%	-0.57%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末	2023 年末
期末可供分配利润	5,748,060.17	-1,664,236.05
期末可供分配基金份额利润	0.0677	-0.0057
期末基金资产净值	90,661,787.26	289,628,914.50
期末基金份额净值	1.0677	0.9943
3.1.3 累计期末指标	2024 年末	2023 年末
基金份额累计净值增长率	6.77%	-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。

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	5.09%	1.97%	5.99%	2.40%	-0.90%	-0.43%
过去六个月	19.70%	1.91%	22.48%	2.21%	-2.78%	-0.30%
过去一年	7.82%	1.93%	-0.39%	2.12%	8.21%	-0.19%
自基金合同生效起至今	7.38%	1.65%	-6.11%	1.86%	13.49%	-0.21%

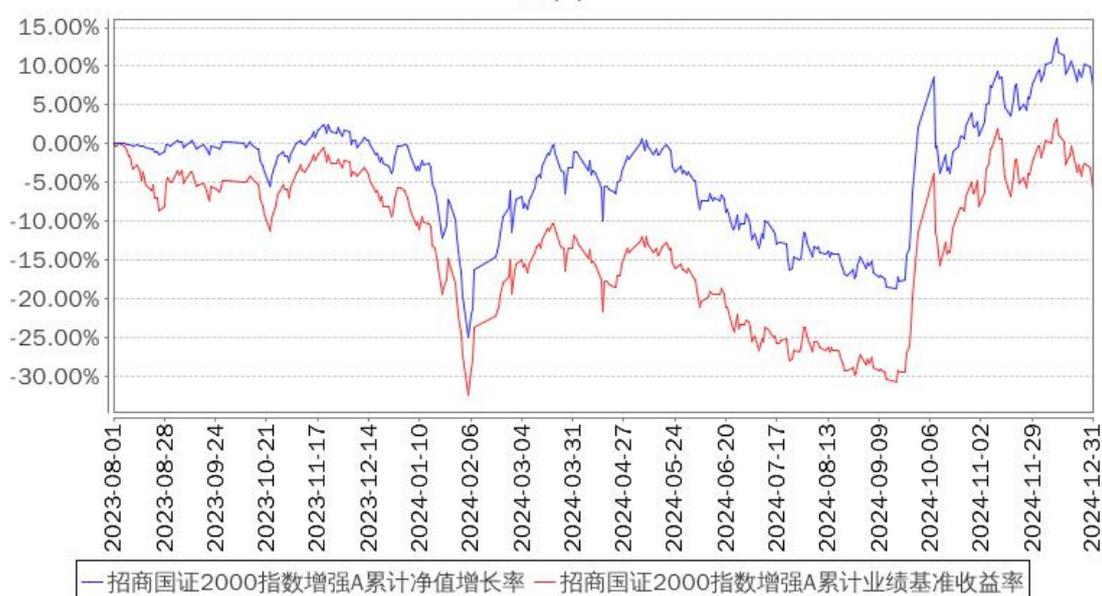
招商国证 2000 指数增强 C

阶段	份额净值	份额净值	业绩比较	业绩比较	①-③	②-④
----	------	------	------	------	-----	-----

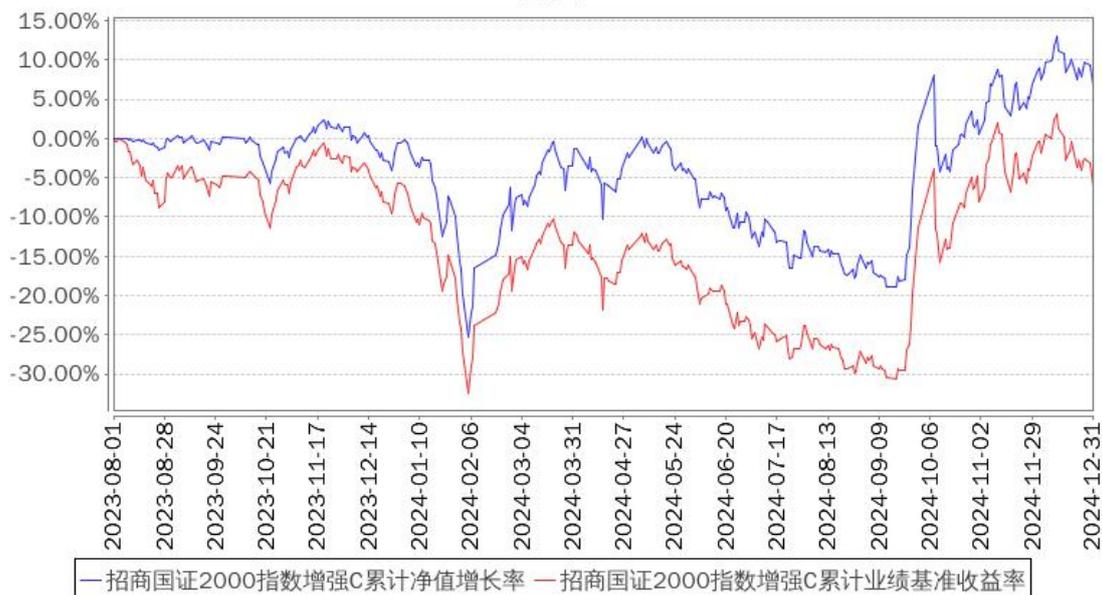
	增长率①	增长率标准差②	基准收益率③	基准收益率标准差④		
过去三个月	4.99%	1.97%	5.99%	2.40%	-1.00%	-0.43%
过去六个月	19.44%	1.91%	22.48%	2.21%	-3.04%	-0.30%
过去一年	7.38%	1.93%	-0.39%	2.12%	7.77%	-0.19%
自基金合同生效起至今	6.77%	1.65%	-6.11%	1.86%	12.88%	-0.21%

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



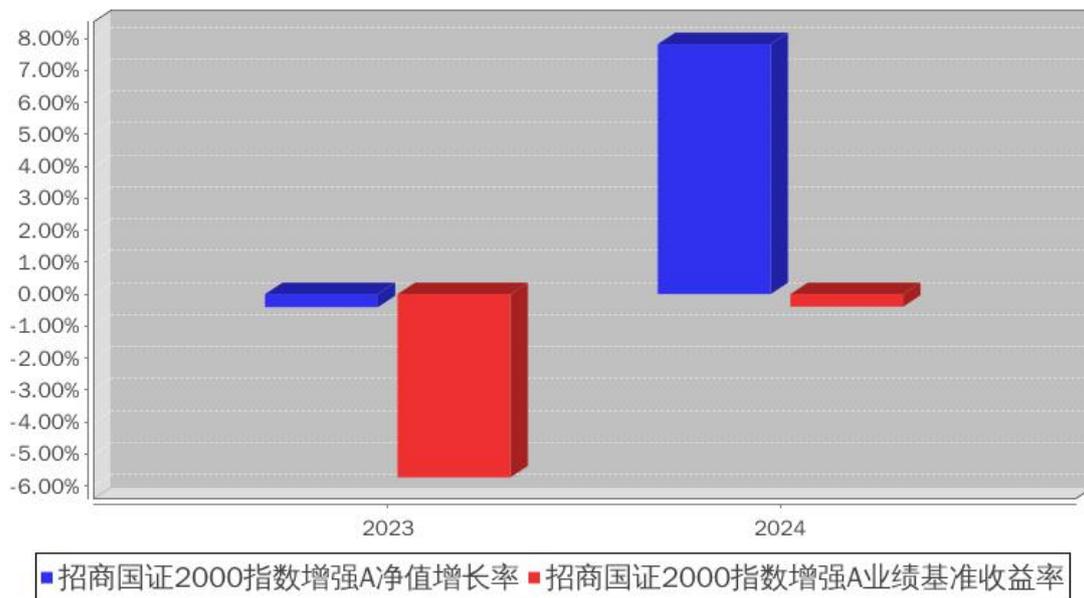
招商国证2000指数增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



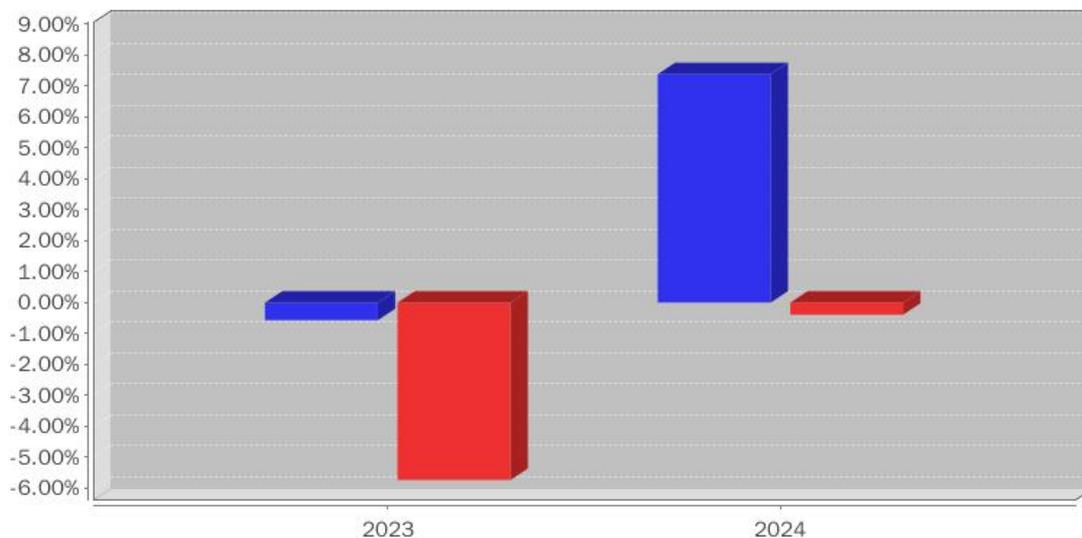
注：本基金建仓期为 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

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



■招商国证2000指数增强C净值增长率 ■招商国证2000指数增强C业绩基准收益率

注：本基金于 2023 年 8 月 1 日成立，成立当年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	-	12	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。

理				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

金额单位：人民币元

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	13,762,433,698.53	2021 年 11 月 23 日
	私募资产管理计划	1	223,325,180.25	2013 年 11 月 26 日
	其他组合	-	-	-
	合计	12	13,985,758,878.78	-

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，其薪酬奖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合规守信情况的说明

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

体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围以及投资运作符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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 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。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 指数波动较大, 一季度市场快速下跌, 在流动性担忧缓解后逐步反弹, 5 月份后市场再度整体持续性下跌, 持续的下跌造成市场信心非常疲弱, 在此背景下三季度末政策利好频出, 市场在此刺激下快速反弹。2024 年国证 2000 指数的年内振幅较大同时风格整体切换, 下半年因子表现与上半年相比完全逆转, 一季度对流动性的担忧造成小盘快速下跌, 技术因子短时间内快速回撤, 传统基本面因子表现较好, 三季度反弹以来价值因子等传统基本面因子表现疲弱, 技术因子超额收益突出。由于风格切换频繁, 本组合年内超额收益也出现了数次波动, 上半年由于市场下跌且组合基本面因子较多积累了一定超额收益, 但市场快速反弹以来, 由于风格切换较快且基本面因子回撤较大, 组合超额收益也出现了一定回撤。

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 7.82%, 同期业绩基准增长率为-0.39%, C 类份额净值增长率为 7.38%, 同期业绩基准增长率为-0.39%。

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 2025 年, 市场信心相对 2024 年低点有了明显的恢复, 同时在多个热点驱动下科技板块表现强势。后续指数能否进一步走强取决于整体基本面能否反弹, 过度的个股分化不利于量化模型, 市场整体企稳也有助于超额收益的恢复。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的专业胜任能力和相关工作经历。公司估值委员会主要负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，定期评价现有估值政策和程序的适用性及对估值程序执行情况进行监督。

投资和研究部门以及基金核算部共同负责关注相关投资品种的动态，评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种；投资和研究部门定期审核公允价值的确认和计量；研究部提出合理的数量分析模型对需

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

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

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配,符合相关法规及基金合同的约定。

4.9 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,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,本托管人严格遵守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

本托管人对本年年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 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年度的利润表、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 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度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</p>

	<p>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	2025 年 3 月 27 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：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	10,521,730.18	19,890,966.60
结算备付金		973,443.37	7,202,847.31
存出保证金		285,878.40	2,397,336.00
交易性金融资产	7.4.7.2	147,577,978.95	331,946,093.78
其中：股票投资		147,057,748.34	331,928,092.72
基金投资		-	-
债券投资		520,230.61	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		1,230,013.83	12,746,839.03
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		160,589,044.73	374,184,082.72
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-

应付赎回款		2,113,052.39	927,798.10
应付管理人报酬		143,559.93	280,681.58
应付托管费		14,355.99	28,068.16
应付销售服务费		33,552.05	84,126.30
应付投资顾问费		-	-
应交税费		6,892.21	2.27
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	20,000.00	11,000.00
负债合计		2,331,412.57	1,331,676.41
净资产:			
实收基金	7.4.7.7	147,864,917.18	374,856,163.43
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	10,392,714.98	-2,003,757.12
净资产合计		158,257,632.16	372,852,406.31
负债和净资产总计		160,589,044.73	374,184,082.72

注：报告截止日 2024 年 12 月 31 日，招商国证 2000 指数增强 A 份额净值 1.0738 元，基金份额总额 62,951,190.09 份；招商国证 2000 指数增强 C 份额净值 1.0677 元，基金份额总额 84,913,727.09 份；总份额合计 147,864,917.18 份。

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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 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		13,418,700.41	1,669,164.13
1.利息收入		157,026.75	1,174,186.21
其中：存款利息收入	7.4.7.9	157,026.75	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）		2,499,628.08	6,212,050.73
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-5,131,968.56	5,461,636.27
基金投资收益		-	-

债券投资收益	7.4.7.11	223,118.04	111,349.87
资产支持证券投资 收益	7.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.13	-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	3,164,588.19	90,579.98
股利收益	7.4.7.15	4,243,890.41	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	10,668,556.63	-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	93,488.95	11,933.01
减：二、营业总支出		3,414,635.30	3,039,440.91
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	2,365,297.65	2,163,797.80
其中：暂估管理人报酬		-	-
2.托管费	7.4.10.2.2	236,529.77	216,379.79
3.销售服务费	7.4.10.2.3	661,397.34	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		11,410.54	701.05
8.其他费用	7.4.7.19	140,000.00	12,200.00
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		10,004,065.11	-1,370,276.78
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		10,004,065.11	-1,370,276.78
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		10,004,065.11	-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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	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）	-226,991,246.25	-	12,396,472.10	-214,594,774.15
（一）、综合收益总额	-	-	10,004,065.11	10,004,065.11
（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）	-226,991,246.25	-	2,392,406.99	-224,598,839.26
其中：1.基金申购款	334,779,699.49	-	-20,083,810.77	314,695,888.72
2.基金赎回款	-561,770,945.74	-	22,476,217.76	-539,294,727.98
（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	147,864,917.18	-	10,392,714.98	158,257,632.16
项目	上年度可比期间 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 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2024 年 1 月 1 日至 2024 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。

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。

本基金在上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。

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后的差额确认。

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

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

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

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

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

3) 公允价值变动收益

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

4) 信用减值损失

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

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》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]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[2021]33号《关于北京证券交易所税收政策适用问题的公告》、财税[2024]8号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公

告》、财税[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。其中，对基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所挂牌交易的上市公司限售股，解禁后取得的股息红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	1,385,029.39	6,195,733.42
等于：本金	1,384,169.75	6,193,315.91
加：应计利息	859.64	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	9,136,700.79	13,695,233.18
等于：本金	9,135,917.43	13,693,339.84
加：应计利息	783.36	1,893.34
减：坏账准备	-	-
合计	10,521,730.18	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 2024 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	142,011,957.53	-	147,057,748.34	5,045,790.81	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	516,989.94	2,980.67	520,230.61	260.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	516,989.94	2,980.67	520,230.61	260.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	142,528,947.47	2,980.67	147,577,978.95	5,046,050.81	
项目	上年度末 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 2024 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	2,488,820.00	-	-	-
其中：股指期货投资	2,488,820.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	2,488,820.00	-	-	-
项目	上年度末 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
IM2501	IM2501	2.00	2,382,320.00	-106,500.00
合计				-106,500.00
减：可抵销期货暂收款				-106,500.00
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

本基金本报告期末及上年度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

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 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	20,000.00	11,000.00
合计	20,000.00	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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 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	87,095,177.79	87,095,177.79
本期赎回 (以“-”号填列)	-107,707,000.58	-107,707,000.58
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	62,951,190.09	62,951,190.09

招商国证 2000 指数增强 C		
项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 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	247,684,521.70	247,684,521.70
本期赎回 (以“-”号填列)	-454,063,945.16	-454,063,945.16
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	84,913,727.09	84,913,727.09

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。

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
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	3,752,674.58	4,776,483.15	8,529,157.73

本期基金份额交易产生的变动数	407,320.51	-3,952,302.36	-3,544,981.85
其中：基金申购款	-4,307,653.18	-2,052,067.42	-6,359,720.60
基金赎回款	4,714,973.69	-1,900,234.94	2,814,738.75
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,264,989.96	-620,335.15	4,644,654.81

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	-4,417,166.10	5,892,073.48	1,474,907.38
本期基金份额交易产生的变动数	7,631,295.45	-1,693,906.61	5,937,388.84
其中：基金申购款	-14,885,844.53	1,161,754.36	-13,724,090.17
基金赎回款	22,517,139.98	-2,855,660.97	19,661,479.01
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,580,831.41	-832,771.24	5,748,060.17

7.4.7.9 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 12 月 31 日	上年度可比期间 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	54,444.08	195,495.53
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	40,661.37	85,120.50
结算备付金利息收入	61,918.04	582,816.44
其他	3.26	-
合计	157,026.75	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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 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	-5,131,968.56	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	-5,131,968.56	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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 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	1,159,068,796.25	620,617,984.40
减：卖出股票成本总额	1,162,532,047.26	613,724,342.50
减：交易费用	1,668,717.55	1,432,005.63
买卖股票差价收入	-5,131,968.56	5,461,636.27

7.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间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

本基金本报告期内及上年度可比期间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

本基金本报告期内及上年度可比期间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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 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	3,015.13	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	220,102.91	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	223,118.04	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 2024 年 1 月 1 日至 2024	上年度可比期间 2023 年 8 月
----	-------------------------	--------------------

	年 12 月 31 日	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	513,157.33	615,584.89
减: 卖出债券 (债转股及债券到期兑付) 成本总额	292,798.73	504,197.73
减: 应计利息总额	224.75	171.92
减: 交易费用	30.94	30.75
买卖债券差价收入	220,102.91	111,184.49

7.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间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

本基金本报告期内及上年度可比期间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

本基金本报告期内及上年度可比期间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

本基金本报告期内及上年度可比期间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

本基金本报告期内及上年度可比期间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

本基金本报告期内及上年度可比期间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

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.13.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间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

本基金本报告期内及上年度可比期间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

本基金本报告期内及上年度可比期间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

本基金本报告期内及上年度可比期间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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 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	3,164,588.19	90,579.98

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 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	4,243,890.41	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	4,243,890.41	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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 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	10,896,006.63	-5,849,955.82
——股票投资	10,895,746.63	-5,849,955.82
——债券投资	260.00	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-227,450.00	120,950.00
——权证投资	-	-
——期货投资	-227,450.00	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	10,668,556.63	-5,729,005.82

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 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	93,488.95	11,933.01
合计	93,488.95	11,933.01

7.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内及上年度可比期间无信用减值损失。

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 8 月 1 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
审计费用	20,000.00	11,000.00
信息披露费	120,000.00	-
证券出借违约金	-	-
其他	-	1,200.00
合计	140,000.00	12,200.00

注：本期报告将“审计费用”、“信息披露费”、“证券出借违约金”之外的费用类型归入“其他”，同时对上年度可比期间数据（如有）的列报口径进行相应调整。

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 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	成交金额	占当期股票成交总额的比例
财通证券	917,916,111.86	43.25%	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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 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	成交金额	占当期债券成交总额的比例
财通证券	649,794.63	63.88%	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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 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	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

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	398,821.18	41.84%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 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%	-	-
------	------------	--------	---	---

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

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

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

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 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	2,365,297.65	2,163,797.80
其中：应支付销售机构的客户维护费	645,255.49	548,958.67
应支付基金管理人的净管理费	1,720,042.16	1,614,839.13

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 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	236,529.77	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 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	-	343,965.57	343,965.57
招商基金管理有限公司	-	1,290.01	1,290.01
招商银行	-	5,765.03	5,765.03
招商证券	-	181.23	181.23
合计	-	351,201.84	351,201.84
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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

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

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

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

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

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

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

本报告期内及上年度可比期间基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

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。

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 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	期末余额	当期利息收入
财通证券-活期	1,385,029.39	54,444.08	6,195,733.42	195,495.53
财通证券-其他存款	5,445,251.13	27,230.60	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 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	301539	宏鑫科技	网下申购	3,607	38,378.48
招商证券	688692	达梦数据	网下申购	872	75,829.12
招商证券	301631	壹连科技	网下申购	915	66,785.85

上年度可比期间 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

注：本表已包含托管人的关联方承销期内承销的证券。

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 (2024 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
001279	强邦新材	2024 年 9 月 27 日	6 个月	新股流通受限	9.68	27.91	265	2,565.20	7,396.15	-
001391	国货航	2024 年 12 月 23 日	6 个月	新股流通受限	2.30	6.80	1,365	3,139.50	9,282.00	-
301522	上大股份	2024 年 10 月 9 日	6 个月	新股流通受限	6.88	24.84	816	5,614.08	20,269.44	-
301551	无线传媒	2024 年 9 月 19 日	6 个月	新股流通受限	9.40	43.23	652	6,128.80	28,185.96	-
301552	科力装备	2024 年 7 月 15 日	6 个月	新股流通受限	30.00	56.87	143	4,290.00	8,132.41	-
301556	托普云农	2024 年 10 月 10 日	6 个月	新股流通受限	14.50	59.05	267	3,871.50	15,766.35	-
301571	国科天成	2024 年 8 月 14 日	6 个月	新股流通受限	11.14	40.83	350	3,899.00	14,290.50	-
301585	蓝宇股份	2024 年 12 月 10 日	6 个月	新股流通受限	23.95	35.85	210	5,029.50	7,528.50	-
301586	佳力奇	2024 年 8 月 21 日	6 个月	新股流通受限	18.09	53.14	215	3,889.35	11,425.10	-
301603	乔锋智能	2024 年 7 月 3 日	6 个月	新股流通受限	26.50	41.98	206	5,459.00	8,647.88	-
301606	绿联科技	2024 年 7 月 17 日	6 个月	新股流通受限	21.21	36.49	281	5,960.01	10,253.69	-
301607	富特科技	2024 年 8 月 28 日	6 个月	新股流通受限	14.00	36.14	257	3,598.00	9,287.98	-
301608	博实结	2024 年	6 个月	新股流通	44.50	65.38	135	6,007.50	8,826.30	-

		7月25日		受限							
301611	珂玛科技	2024年8月7日	6个月	新股流通受限	8.00	56.10	766	6,128.00	42,972.60	-	
301613	新铝时代	2024年10月18日	6个月	新股流通受限	27.70	41.77	255	7,063.50	10,651.35	-	
301617	博苑股份	2024年12月3日	6个月	新股流通受限	27.76	39.79	185	5,135.60	7,361.15	-	
301622	英思特	2024年11月26日	6个月	新股流通受限	22.36	44.92	261	5,835.96	11,724.12	-	
301626	苏州天脉	2024年10月17日	6个月	新股流通受限	21.23	65.78	957	20,317.11	62,951.46	-	
301631	壹连科技	2024年11月12日	6个月	新股流通受限	72.99	101.96	92	6,715.08	9,380.32	-	
603072	天和磁材	2024年12月24日	1个月内(含)	新股流通受限	12.30	12.30	1,329	16,346.70	16,346.70	-	
603072	天和磁材	2024年12月24日	6个月	新股流通受限	12.30	12.30	148	1,820.40	1,820.40	-	
603091	众鑫股份	2024年9月10日	6个月	新股流通受限	26.50	44.43	94	2,491.00	4,176.42	-	
603194	中力股份	2024年12月17日	6个月	新股流通受限	20.32	28.13	142	2,885.44	3,994.46	-	
603205	健尔康	2024年10月29日	6个月	新股流通受限	14.65	27.35	128	1,875.20	3,500.80	-	
603207	小方制药	2024年8月19日	6个月	新股流通受限	12.47	26.65	185	2,306.95	4,930.25	-	
603285	键邦股份	2024年6月28日	6个月	新股流通受限	18.65	22.61	117	2,182.05	2,645.37	-	
603310	巍华新材	2024年8月7日	6个月	新股流通受限	17.39	17.95	129	2,243.31	2,315.55	-	

603350	安乃达	2024 年 6 月 26 日	6 个月	新股流通 受限	20.56	36.17	106	2,179.36	3,834.02	-
603391	力聚热能	2024 年 7 月 24 日	6 个月	新股流通 受限	40.00	41.35	85	3,400.00	3,514.75	-
603395	红四方	2024 年 11 月 19 日	6 个月	新股流通 受限	7.98	35.77	154	1,228.92	5,508.58	-
688449	联芸科技	2024 年 11 月 20 日	6 个月	新股流通 受限	11.25	29.44	859	9,663.75	25,288.96	-
688605	先锋精科	2024 年 12 月 4 日	6 个月	新股流通 受限	11.29	53.68	744	8,399.76	39,937.92	-
688615	合合信息	2024 年 9 月 19 日	6 个月	新股流通 受限	55.18	165.78	149	8,221.82	24,701.22	-
688708	佳驰科技	2024 年 11 月 27 日	6 个月	新股流通 受限	27.08	48.95	349	9,450.92	17,083.55	-
688710	益诺思	2024 年 8 月 27 日	6 个月	新股流通 受限	19.06	33.58	332	6,327.92	11,148.56	-
688721	龙图光罩	2024 年 7 月 30 日	6 个月	新股流通 受限	18.50	56.85	279	5,161.50	15,861.15	-
688726	拉普拉斯	2024 年 10 月 22 日	6 个月	新股流通 受限	17.58	33.06	956	16,806.48	31,605.36	-
688750	金天钛业	2024 年 11 月 12 日	6 个月	新股流通 受限	7.16	15.44	1,491	10,675.56	23,021.04	-

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 位: 张)	期末成本总 额	期末估值总 额	备 注
110098	南药转债	2024 年 12 月 25 日	1 个月 内 (含)	新债未上 市	100.00	100.00	130	12,999.94	13,000.34	-

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

7.4.12.2 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。

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

本基金本报告期末及上年度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

本基金本报告期末及上年度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

本基金本报告期末及上年度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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	13,000.34	18,001.06
未评级	-	-
合计	13,000.34	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

本基金本报告期末及上年度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

本基金本报告期末及上年度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 2024 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	10,521,730.18	-	-	-	10,521,730.18
结算备付金	973,443.37	-	-	-	973,443.37
存出保证金	-	-	-	285,878.40	285,878.40
交易性金融资产	507,230.27	-	13,000.34	147,057,748.34	147,577,978.95
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	-	-	-	1,230,013.83	1,230,013.83
应收清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	12,002,403.82	-	13,000.34	148,573,640.57	160,589,044.73
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,113,052.39	2,113,052.39

应付管理人报酬	-	-	-	143,559.93	143,559.93
应付托管费	-	-	-	14,355.99	14,355.99
应付清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	33,552.05	33,552.05
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	6,892.21	6,892.21
其他负债	-	-	-	20,000.00	20,000.00
负债总计	-	-	-	2,331,412.57	2,331,412.57
利率敏感度缺口	12,002,403.82	-	13,000.34	146,242,228.00	158,257,632.16
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（2024 年 12 月 31 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	1. 市场利率平行上升 50 个基点	-2,208.61	-427.39
	2. 市场利率平行下降 50 个基点	2,229.30	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 2024 年 12 月 31 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	147,057,748.34	92.92	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	147,057,748.34	92.92	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 (2024 年 12 月 31 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%	7,352,887.42	16,596,404.64
	2. 权益性投资的市场价格下降 5%	-7,352,887.42	-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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	146,512,180.02	331,398,788.52
第二层次	538,397.71	254,899.06
第三层次	527,401.22	292,406.20
合计	147,577,978.95	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 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	-	292,406.20	292,406.20

当期购买	-	380,661.01	380,661.01
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	580,445.69	580,445.69
当期利得或损失总额	-	434,779.70	434,779.70
其中：计入损益的利得或损失	-	434,779.70	434,779.70
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	527,401.22	527,401.22
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	-	321,254.59	321,254.59
项目	上年度可比期间 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	527,401.22	平均价格亚式	流通受限股票	0.2665-5.7444	负相关

项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	期权模型		
			名称	范围/加权平均值	预期波动率
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	与公允价值之间的关系 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

本基金本报告期末及上年度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

本基金本报告期内及上年度可比期间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	147,057,748.34	91.57
	其中：股票	147,057,748.34	91.57
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	520,230.61	0.32
	其中：债券	520,230.61	0.32
	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	11,495,173.55	7.16
8	其他资产	1,515,892.23	0.94
9	合计	160,589,044.73	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	445,211.00	0.28
B	采矿业	2,661,318.00	1.68
C	制造业	80,644,479.10	50.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,657,235.00	3.57
E	建筑业	4,649,142.00	2.94
F	批发和零售业	4,303,157.50	2.72
G	交通运输、仓储和邮政业	6,435,449.33	4.07
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,942,813.00	3.76
J	金融业	3,333,233.00	2.11
K	房地产业	670,122.00	0.42
L	租赁和商务服务业	646,801.00	0.41
M	科学研究和技术服务业	2,987,227.80	1.89
N	水利、环境和公共设施管理业	1,702,758.00	1.08
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	1,138,224.00	0.72
S	综合	14,872.00	0.01
	合计	121,232,042.73	76.60

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	204,886.00	0.13
B	采矿业	855,372.00	0.54
C	制造业	18,874,743.18	11.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	514,512.00	0.33
E	建筑业	736,243.00	0.47
F	批发和零售业	569,138.00	0.36
G	交通运输、仓储和邮政业	901,237.00	0.57
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,072,724.87	0.68
J	金融业	1,298,927.00	0.82

K	房地产业	94,202.00	0.06
L	租赁和商务服务业	487,968.00	0.31
M	科学研究和技术服务业	81,972.56	0.05
N	水利、环境和公共设施管理业	133,780.00	0.08
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	25,825,705.61	16.32

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	002275	桂林三金	62,400	941,616.00	0.59
2	002980	华盛昌	31,600	810,540.00	0.51
3	000823	超声电子	74,300	766,776.00	0.48
4	603408	建霖家居	60,600	759,318.00	0.48
5	002768	国恩股份	32,100	740,547.00	0.47
6	002688	金河生物	164,900	737,103.00	0.47
7	002534	西子洁能	65,200	724,372.00	0.46
8	301377	鼎泰高科	32,300	683,145.00	0.43
9	000498	山东路桥	113,700	676,515.00	0.43
10	603995	甬金股份	36,000	658,440.00	0.42
11	600710	苏美达	67,800	630,540.00	0.40
12	002139	拓邦股份	45,600	620,616.00	0.39
13	000885	城发环境	47,000	616,170.00	0.39
14	600420	国药现代	50,800	606,552.00	0.38
15	000928	中钢国际	94,100	599,417.00	0.38
16	603301	振德医疗	27,000	593,730.00	0.38
17	603209	兴通股份	34,800	556,104.00	0.35
18	002483	润邦股份	106,700	555,907.00	0.35
19	002967	广电计量	33,700	552,680.00	0.35
20	002026	山东威达	55,800	549,072.00	0.35
21	601311	骆驼股份	66,000	547,140.00	0.35
22	603158	腾龙股份	67,500	545,400.00	0.34

23	603855	华荣股份	26,700	541,743.00	0.34
24	301061	匠心家居	8,766	541,738.80	0.34
25	600308	华泰股份	148,000	538,720.00	0.34
26	605507	国邦医药	25,300	526,999.00	0.33
27	600284	浦东建设	84,000	526,680.00	0.33
28	002839	张家港行	120,300	525,711.00	0.33
29	000600	建投能源	92,800	525,248.00	0.33
30	603727	博迈科	45,700	524,636.00	0.33
31	002970	锐明技术	11,000	523,930.00	0.33
32	600618	氯碱化工	53,000	522,580.00	0.33
33	002083	孚日股份	106,700	521,763.00	0.33
34	603055	台华新材	45,300	501,924.00	0.32
35	600320	振华重工	127,100	498,232.00	0.31
36	002788	鹭燕医药	60,600	497,526.00	0.31
37	002020	京新药业	38,300	490,240.00	0.31
38	603309	维力医疗	40,400	483,992.00	0.31
39	603680	今创集团	58,100	482,230.00	0.30
40	002233	塔牌集团	62,800	481,676.00	0.30
41	600750	江中药业	21,200	481,240.00	0.30
42	603612	索通发展	35,500	479,605.00	0.30
43	600269	赣粤高速	84,300	472,923.00	0.30
44	603337	杰克股份	15,500	472,130.00	0.30
45	603588	高能环境	89,600	469,504.00	0.30
46	600742	一汽富维	53,000	469,050.00	0.30
47	300685	艾德生物	20,500	467,400.00	0.30
48	600908	无锡银行	78,800	465,708.00	0.29
49	002881	美格智能	15,500	464,380.00	0.29
50	002807	江阴银行	106,500	463,275.00	0.29
51	301004	嘉益股份	4,000	462,600.00	0.29
52	600064	南京高科	59,300	460,761.00	0.29
53	688128	中国电研	21,929	460,728.29	0.29
54	600218	全柴动力	58,300	460,570.00	0.29
55	601528	瑞丰银行	81,700	459,971.00	0.29
56	002043	兔宝宝	38,700	459,756.00	0.29
57	002376	新北洋	70,200	457,704.00	0.29
58	000090	天健集团	111,100	456,621.00	0.29
59	600982	宁波能源	110,500	455,260.00	0.29
60	601860	紫金银行	159,500	454,575.00	0.29
61	605333	沪光股份	13,900	453,557.00	0.29
62	600017	日照港	140,500	449,600.00	0.28
63	002543	万和电气	43,800	448,512.00	0.28
64	603193	润本股份	19,100	445,985.00	0.28
65	000544	中原环保	50,900	444,357.00	0.28

66	600993	马应龙	16,900	441,259.00	0.28
67	002284	亚太股份	56,900	440,406.00	0.28
68	603165	荣晟环保	35,800	438,192.00	0.28
69	600874	创业环保	73,300	437,601.00	0.28
70	600894	广日股份	29,900	436,540.00	0.28
71	601326	秦港股份	129,900	435,165.00	0.27
72	002550	千红制药	69,700	432,140.00	0.27
73	603551	奥普科技	40,000	427,200.00	0.27
74	600428	中远海特	58,300	425,590.00	0.27
75	300181	佐力药业	27,700	425,472.00	0.27
76	600746	江苏索普	60,500	424,105.00	0.27
77	601518	吉林高速	151,100	420,058.00	0.27
78	605009	豪悦护理	10,300	411,588.00	0.26
79	300415	伊之密	20,500	411,230.00	0.26
80	601137	博威合金	20,100	408,030.00	0.26
81	002884	凌霄泵业	22,300	407,421.00	0.26
82	603508	思维列控	16,300	387,614.00	0.24
83	605183	确成股份	23,000	387,550.00	0.24
84	600502	安徽建工	81,000	387,180.00	0.24
85	603323	苏农银行	73,100	386,699.00	0.24
86	603126	中材节能	46,000	386,400.00	0.24
87	301389	隆扬电子	23,000	384,560.00	0.24
88	002538	司尔特	68,300	383,846.00	0.24
89	603167	渤海轮渡	43,400	383,656.00	0.24
90	600648	外高桥	31,900	379,929.00	0.24
91	002479	富春环保	80,000	379,200.00	0.24
92	600268	国电南自	56,100	376,992.00	0.24
93	603618	杭电股份	69,100	375,213.00	0.24
94	002440	闰土股份	55,900	375,089.00	0.24
95	601886	江河集团	68,000	367,200.00	0.23
96	002014	永新股份	33,400	366,064.00	0.23
97	000899	赣能股份	41,900	364,949.00	0.23
98	600897	厦门空港	23,900	363,997.00	0.23
99	601827	三峰环境	42,300	362,934.00	0.23
100	301439	泓淋电力	26,300	361,625.00	0.23
101	002367	康力电梯	52,300	359,301.00	0.23
102	600469	风神股份	58,200	358,512.00	0.23
103	002053	云南能投	31,300	356,820.00	0.23
104	000690	宝新能源	79,300	355,264.00	0.22
105	601083	锦江航运	37,300	355,096.00	0.22
106	600020	中原高速	84,100	354,902.00	0.22
107	002206	海利得	82,500	353,925.00	0.22
108	600551	时代出版	41,100	353,871.00	0.22

109	600758	辽宁能源	102,800	353,632.00	0.22
110	002061	浙江交科	86,600	353,328.00	0.22
111	002412	汉森制药	58,600	352,186.00	0.22
112	300428	立中集团	21,600	352,080.00	0.22
113	603299	苏盐井神	31,600	352,024.00	0.22
114	600575	淮河能源	88,200	350,154.00	0.22
115	002613	北玻股份	86,300	348,652.00	0.22
116	600458	时代新材	27,200	348,432.00	0.22
117	002004	华邦健康	76,900	347,588.00	0.22
118	000404	长虹华意	46,800	346,320.00	0.22
119	300232	洲明科技	50,400	346,248.00	0.22
120	000030	富奥股份	67,400	345,762.00	0.22
121	002063	远光软件	60,000	345,600.00	0.22
122	001258	立新能源	43,300	344,668.00	0.22
123	002454	松芝股份	51,800	344,470.00	0.22
124	301215	中汽股份	57,800	343,910.00	0.22
125	600229	城市传媒	49,100	342,227.00	0.22
126	600033	福建高速	88,200	342,216.00	0.22
127	300172	中电环保	66,800	337,340.00	0.21
128	002578	闽发铝业	112,500	336,375.00	0.21
129	603368	柳药集团	18,800	335,768.00	0.21
130	002818	富森美	22,300	333,162.00	0.21
131	000422	湖北宜化	26,200	330,644.00	0.21
132	605399	晨光新材	28,000	327,040.00	0.21
133	000950	重药控股	60,500	325,490.00	0.21
134	600587	新华医疗	19,500	324,675.00	0.21
135	300705	九典制药	17,960	322,382.00	0.20
136	000913	钱江摩托	17,900	322,379.00	0.20
137	002948	青岛银行	82,400	319,712.00	0.20
138	688687	凯因科技	14,800	319,384.00	0.20
139	600496	精工钢构	105,100	317,402.00	0.20
140	002048	宁波华翔	25,100	316,762.00	0.20
141	000411	英特集团	29,500	314,175.00	0.20
142	002204	大连重工	62,500	311,250.00	0.20
143	688508	芯朋微	7,189	308,911.33	0.20
144	603416	信捷电气	7,300	306,235.00	0.19
145	603111	康尼机电	50,600	305,118.00	0.19
146	301031	中熔电气	2,900	301,658.00	0.19
147	301179	泽宇智能	16,100	300,587.00	0.19
148	002815	崇达技术	29,400	299,880.00	0.19
149	002649	博彦科技	24,200	293,304.00	0.19
150	601609	金田股份	49,400	291,460.00	0.18
151	300570	太辰光	4,000	290,800.00	0.18

152	688336	三生国健	13,551	290,262.42	0.18
153	688550	瑞联新材	9,248	289,369.92	0.18
154	601500	通用股份	54,000	287,820.00	0.18
155	688334	西高院	17,600	287,408.00	0.18
156	002609	捷顺科技	34,700	286,622.00	0.18
157	601101	昊华能源	34,800	286,404.00	0.18
158	688103	国力股份	6,925	281,639.75	0.18
159	002237	恒邦股份	27,800	280,780.00	0.18
160	002327	富安娜	31,700	280,228.00	0.18
161	600328	中盐化工	35,600	280,172.00	0.18
162	000026	飞亚达	26,900	278,953.00	0.18
163	000990	诚志股份	35,700	276,675.00	0.17
164	000993	闽东电力	33,100	276,385.00	0.17
165	300978	东箭科技	25,300	275,517.00	0.17
166	603018	华设集团	33,500	275,035.00	0.17
167	600167	联美控股	47,700	273,321.00	0.17
168	002034	旺能环境	17,600	272,800.00	0.17
169	600433	冠豪高新	86,000	272,620.00	0.17
170	603730	岱美股份	30,180	271,318.20	0.17
171	300455	航天智装	20,900	270,864.00	0.17
172	002096	易普力	22,600	268,488.00	0.17
173	603987	康德莱	37,300	267,814.00	0.17
174	600694	大商股份	10,150	267,655.50	0.17
175	000900	现代投资	60,600	267,246.00	0.17
176	688146	中船特气	9,189	266,848.56	0.17
177	300255	常山药业	13,300	265,867.00	0.17
178	600035	楚天高速	57,600	264,960.00	0.17
179	688798	艾为电子	3,785	264,268.70	0.17
180	000828	东莞控股	24,700	264,043.00	0.17
181	603358	华达科技	7,900	263,860.00	0.17
182	300946	恒而达	9,700	263,452.00	0.17
183	601975	招商南油	83,400	261,042.00	0.16
184	003006	百亚股份	10,800	259,092.00	0.16
185	601619	嘉泽新能	78,000	258,960.00	0.16
186	600973	宝胜股份	41,100	258,930.00	0.16
187	601968	宝钢包装	52,100	257,895.00	0.16
188	603766	隆鑫通用	28,300	257,530.00	0.16
189	000685	中山公用	27,600	254,748.00	0.16
190	002655	共达电声	20,000	254,600.00	0.16
191	000028	国药一致	8,700	254,475.00	0.16
192	603693	江苏新能	25,700	253,145.00	0.16
193	603075	热威股份	13,500	251,505.00	0.16
194	603916	苏博特	33,500	249,910.00	0.16

195	300814	中富电路	7,700	249,634.00	0.16
196	300045	华力创通	11,700	244,413.00	0.15
197	600252	中恒集团	99,300	244,278.00	0.15
198	300674	宇信科技	12,500	244,000.00	0.15
199	605123	派克新材	4,500	241,920.00	0.15
200	688190	云路股份	2,609	240,028.00	0.15
201	600073	光明肉业	34,500	239,430.00	0.15
202	603538	美诺华	18,400	233,864.00	0.15
203	603113	金能科技	41,400	233,082.00	0.15
204	300048	合康新能	46,100	232,344.00	0.15
205	688588	凌志软件	16,758	231,260.40	0.15
206	300768	迪普科技	13,000	227,500.00	0.14
207	300855	图南股份	10,300	225,776.00	0.14
208	300627	华测导航	5,400	225,720.00	0.14
208	300933	中辰股份	27,000	225,720.00	0.14
209	301332	德尔玛	22,300	223,446.00	0.14
210	600248	陕建股份	48,900	219,072.00	0.14
211	603619	中曼石油	11,300	218,768.00	0.14
212	603610	麒盛科技	17,300	218,153.00	0.14
213	300327	中颖电子	8,900	217,783.00	0.14
214	600255	鑫科材料	62,700	214,434.00	0.14
215	688510	航亚科技	12,306	214,370.52	0.14
216	603109	神驰机电	12,000	213,000.00	0.13
217	300579	数字认证	6,600	207,372.00	0.13
218	300821	东岳硅材	26,700	207,192.00	0.13
219	600012	皖通高速	11,700	206,505.00	0.13
220	002003	伟星股份	14,500	205,465.00	0.13
221	301260	格力博	15,500	205,375.00	0.13
222	002160	常铝股份	55,000	204,600.00	0.13
223	000821	京山轻机	16,400	204,180.00	0.13
224	603308	应流股份	14,400	203,040.00	0.13
225	300105	龙源技术	26,500	202,195.00	0.13
226	000551	创元科技	16,900	202,124.00	0.13
227	002036	联创电子	21,400	201,160.00	0.13
228	002635	安洁科技	12,600	200,592.00	0.13
229	600459	贵研铂业	14,600	200,458.00	0.13
230	300772	运达股份	15,100	199,924.00	0.13
231	002651	利君股份	27,200	199,376.00	0.13
232	301217	铜冠铜箔	17,700	196,116.00	0.12
233	600728	佳都科技	41,700	195,156.00	0.12
234	300161	华中数控	7,400	194,916.00	0.12
235	000923	河钢资源	14,000	194,600.00	0.12
236	603936	博敏电子	23,100	194,502.00	0.12

237	300062	中能电气	32,800	192,864.00	0.12
238	002895	川恒股份	7,800	191,880.00	0.12
239	601369	陕鼓动力	21,600	187,920.00	0.12
240	603009	北特科技	4,800	187,584.00	0.12
241	002401	中远海科	11,800	187,384.00	0.12
242	603118	共进股份	20,900	186,010.00	0.12
243	002132	恒星科技	67,800	185,772.00	0.12
244	000758	中色股份	37,500	185,250.00	0.12
245	002332	仙琚制药	18,600	184,884.00	0.12
246	000552	甘肃能化	66,800	183,700.00	0.12
247	603876	鼎胜新材	20,700	183,195.00	0.12
248	603357	设计总院	20,200	183,012.00	0.12
249	600331	宏达股份	24,000	182,880.00	0.12
250	601678	滨化股份	48,600	182,736.00	0.12
251	002724	海洋王	34,300	182,476.00	0.12
252	002375	亚厦股份	47,100	181,806.00	0.11
253	600351	亚宝药业	29,800	181,482.00	0.11
254	002100	天康生物	27,600	180,780.00	0.11
255	600088	中视传媒	10,100	180,386.00	0.11
256	601069	西部黄金	15,600	178,620.00	0.11
257	000837	秦川机床	19,700	176,709.00	0.11
258	002749	国光股份	12,400	176,328.00	0.11
259	300779	惠城环保	1,800	175,680.00	0.11
260	300881	盛德鑫泰	5,700	175,218.00	0.11
261	002396	星网锐捷	9,200	174,708.00	0.11
262	688007	光峰科技	11,800	174,522.00	0.11
263	301327	华宝新能	2,270	174,131.70	0.11
264	300596	利安隆	5,700	173,850.00	0.11
265	300360	炬华科技	10,300	172,731.00	0.11
266	002393	力生制药	9,760	172,166.40	0.11
267	002540	亚太科技	27,900	171,864.00	0.11
268	002116	中国海诚	17,100	170,658.00	0.11
269	002533	金杯电工	17,300	170,232.00	0.11
270	600812	华北制药	32,800	169,576.00	0.11
271	600488	津药药业	39,800	168,752.00	0.11
272	605365	立达信	10,700	167,990.00	0.11
273	605337	李子园	14,800	167,092.00	0.11
274	300548	博创科技	3,600	167,076.00	0.11
275	000655	金岭矿业	27,100	166,665.00	0.11
276	000657	中钨高新	18,000	165,780.00	0.10
277	600962	国投中鲁	12,500	164,375.00	0.10
278	003013	地铁设计	10,800	163,296.00	0.10
279	600850	电科数字	6,800	162,520.00	0.10

280	688315	诺禾致源	13,000	162,500.00	0.10
281	000541	佛山照明	26,100	161,820.00	0.10
282	603609	禾丰股份	18,700	161,194.00	0.10
283	000049	德赛电池	6,847	160,972.97	0.10
284	300523	辰安科技	8,100	160,299.00	0.10
285	002969	嘉美包装	51,400	159,854.00	0.10
286	002870	香山股份	5,100	159,630.00	0.10
287	002462	嘉事堂	12,100	156,332.00	0.10
288	600783	鲁信创投	12,200	154,574.00	0.10
289	300903	科翔股份	19,300	154,207.00	0.10
290	002772	众兴菌业	20,900	154,033.00	0.10
291	300196	长海股份	14,100	153,549.00	0.10
292	603929	亚翔集成	5,500	152,515.00	0.10
293	603279	景津装备	8,300	148,404.00	0.09
294	688207	格灵深瞳	10,360	147,526.40	0.09
295	000917	电广传媒	20,800	147,056.00	0.09
296	002666	德联集团	33,400	145,624.00	0.09
297	301345	涛涛车业	2,200	145,420.00	0.09
298	688489	三未信安	4,213	145,348.50	0.09
299	600210	紫江企业	21,600	142,776.00	0.09
300	002158	汉钟精机	7,700	142,604.00	0.09
301	300613	富瀚微	2,400	140,400.00	0.09
302	001309	德明利	1,600	139,520.00	0.09
303	300870	欧陆通	1,300	138,814.00	0.09
304	300702	天宇股份	8,300	138,278.00	0.09
305	300236	上海新阳	3,700	138,269.00	0.09
306	688131	皓元医药	3,800	135,660.00	0.09
307	002489	浙江永强	41,500	134,460.00	0.08
308	300785	值得买	4,000	134,000.00	0.08
309	300770	新媒股份	3,100	125,271.00	0.08
310	002361	神剑股份	22,800	124,260.00	0.08
311	300303	聚飞光电	18,200	124,124.00	0.08
312	603558	健盛集团	11,500	123,740.00	0.08
313	600664	哈药股份	29,800	123,074.00	0.08
314	605305	中际联合	4,300	121,819.00	0.08
315	688519	南亚新材	5,644	119,991.44	0.08
316	600216	浙江医药	7,400	117,364.00	0.07
317	603208	江山欧派	6,300	115,920.00	0.07
318	001201	东瑞股份	7,300	115,486.00	0.07
319	000811	冰轮环境	9,400	115,244.00	0.07
320	002668	TCL 智家	8,600	112,832.00	0.07
321	002567	唐人神	22,100	112,710.00	0.07
322	002991	甘源食品	1,200	112,224.00	0.07

323	300737	科顺股份	22,100	112,047.00	0.07
324	600814	杭州解百	13,500	111,915.00	0.07
325	300351	永贵电器	6,300	111,762.00	0.07
326	002897	意华股份	2,700	111,645.00	0.07
327	688025	杰普特	2,345	111,387.50	0.07
328	300766	每日互动	7,600	111,036.00	0.07
329	600757	长江传媒	11,600	111,012.00	0.07
330	000905	厦门港务	15,500	110,980.00	0.07
331	301369	联动科技	2,100	109,998.00	0.07
332	002965	祥鑫科技	3,200	109,536.00	0.07
333	600662	外服控股	21,500	109,005.00	0.07
334	603633	徕木股份	13,300	108,661.00	0.07
335	603039	泛微网络	2,200	107,800.00	0.07
336	300404	博济医药	12,300	107,379.00	0.07
337	002328	新朋股份	17,500	107,275.00	0.07
338	300456	赛微电子	6,200	106,516.00	0.07
339	688238	和元生物	21,400	105,716.00	0.07
340	688533	上声电子	3,000	104,460.00	0.07
341	002191	劲嘉股份	24,700	103,740.00	0.07
342	603100	川仪股份	4,800	103,440.00	0.07
343	000968	蓝焰控股	15,500	103,075.00	0.07
344	601963	重庆银行	11,100	103,008.00	0.07
345	000680	山推股份	10,600	102,820.00	0.06
346	002345	潮宏基	17,600	102,256.00	0.06
347	600508	上海能源	7,700	101,871.00	0.06
348	300299	富春股份	18,500	101,195.00	0.06
349	603507	振江股份	4,200	100,968.00	0.06
350	688093	世华科技	5,000	100,950.00	0.06
351	300696	爱乐达	6,500	100,945.00	0.06
352	000788	北大医药	16,800	100,800.00	0.06
353	002287	奇正藏药	4,700	100,580.00	0.06
354	600810	神马股份	12,400	100,316.00	0.06
355	002051	中工国际	12,200	99,552.00	0.06
356	688596	正帆科技	2,800	99,540.00	0.06
357	002448	中原内配	15,900	99,534.00	0.06
358	605286	同力日升	3,300	99,528.00	0.06
358	688586	江航装备	10,400	99,528.00	0.06
359	600997	开滦股份	14,700	99,372.00	0.06
360	002106	莱宝高科	9,100	99,281.00	0.06
361	688351	微电生理	5,200	99,008.00	0.06
362	300835	龙磁科技	3,200	98,944.00	0.06
363	600523	贵航股份	8,300	98,936.00	0.06
364	603008	喜临门	5,900	98,884.00	0.06

365	603530	神马电力	4,000	98,840.00	0.06
366	301302	华如科技	4,100	98,605.00	0.06
367	002845	同兴达	6,500	98,540.00	0.06
368	603906	龙蟠科技	9,500	98,420.00	0.06
369	688150	莱特光电	4,366	98,322.32	0.06
370	001323	慕思股份	2,600	98,306.00	0.06
371	600389	江山股份	6,800	98,260.00	0.06
372	603690	至纯科技	3,900	97,929.00	0.06
373	688553	汇宇制药	6,437	97,842.40	0.06
374	300463	迈克生物	7,400	97,680.00	0.06
375	002250	联化科技	17,700	97,527.00	0.06
376	605555	德昌股份	4,500	97,380.00	0.06
377	002088	鲁阳节能	7,600	97,204.00	0.06
378	605377	华旺科技	7,280	97,188.00	0.06
379	300545	联得装备	3,100	97,123.00	0.06
380	688606	奥泰生物	1,531	96,912.30	0.06
381	002140	东华科技	9,800	96,824.00	0.06
382	300972	万辰集团	1,200	96,492.00	0.06
383	002380	科远智慧	5,200	96,096.00	0.06
384	002627	三峡旅游	19,000	95,380.00	0.06
385	002242	九阳股份	9,200	95,312.00	0.06
386	002641	公元股份	21,600	95,040.00	0.06
387	603277	银都股份	4,100	94,997.00	0.06
388	603387	基蛋生物	11,500	94,875.00	0.06
389	601068	中铝国际	21,500	94,815.00	0.06
390	002039	黔源电力	6,200	94,612.00	0.06
391	688371	菲沃泰	6,096	94,609.92	0.06
392	603171	税友股份	3,100	94,550.00	0.06
393	600063	皖维高新	23,600	94,400.00	0.06
394	002434	万里扬	15,100	93,620.00	0.06
395	600729	重庆百货	3,200	93,600.00	0.06
395	688337	普源精电	2,400	93,600.00	0.06
396	688376	美埃科技	2,800	93,492.00	0.06
397	002562	兄弟科技	21,900	93,075.00	0.06
398	002556	辉隆股份	16,700	93,019.00	0.06
399	688789	宏华数科	1,400	92,932.00	0.06
400	300587	天铁科技	21,100	92,629.00	0.06
401	002900	哈三联	9,400	92,590.00	0.06
402	300648	星云股份	4,000	92,000.00	0.06
403	300261	雅本化学	13,400	91,790.00	0.06
404	301058	中粮科工	8,700	91,785.00	0.06
405	002212	天融信	14,200	91,590.00	0.06
406	600461	洪城环境	9,200	91,540.00	0.06

407	002645	华宏科技	13,400	91,388.00	0.06
408	603058	永吉股份	10,300	90,846.00	0.06
409	001208	华菱线缆	10,000	90,800.00	0.06
410	600649	城投控股	20,400	90,780.00	0.06
411	688236	春立医疗	7,071	90,508.80	0.06
412	002537	海联金汇	15,700	90,275.00	0.06
413	002997	瑞鹄模具	2,600	90,090.00	0.06
414	688566	吉贝尔	4,006	89,734.40	0.06
415	600512	腾达建设	37,800	89,586.00	0.06
416	603186	华正新材	3,700	89,133.00	0.06
417	002752	昇兴股份	14,000	88,900.00	0.06
418	603708	家家悦	7,800	88,842.00	0.06
419	000589	贵州轮胎	17,600	88,528.00	0.06
420	603997	继峰股份	7,700	88,165.00	0.06
421	605338	巴比食品	5,100	88,077.00	0.06
422	301322	绿通科技	4,000	87,920.00	0.06
423	601616	广电电气	20,000	87,800.00	0.06
424	300369	绿盟科技	12,200	87,718.00	0.06
425	301050	雷电微力	1,700	87,686.00	0.06
426	300620	光库科技	1,800	87,480.00	0.06
427	603162	海通发展	9,500	87,400.00	0.06
428	000852	石化机械	12,600	86,940.00	0.05
429	688308	欧科亿	4,800	86,640.00	0.05
430	000517	荣安地产	38,700	86,301.00	0.05
431	300857	协创数据	800	85,512.00	0.05
432	603567	珍宝岛	7,300	84,680.00	0.05
433	603267	鸿远电子	2,300	83,329.00	0.05
434	601089	福元医药	5,200	83,200.00	0.05
435	002322	理工能科	6,600	83,094.00	0.05
436	002545	东方铁塔	11,700	82,251.00	0.05
437	300976	达瑞电子	1,200	82,200.00	0.05
438	688658	悦康药业	5,700	82,137.00	0.05
439	002267	陕天然气	9,700	81,965.00	0.05
440	300973	立高食品	2,100	81,963.00	0.05
441	301219	腾远钴业	1,800	81,378.00	0.05
442	300145	中金环境	21,800	80,878.00	0.05
443	300191	潜能恒信	6,300	80,640.00	0.05
444	603897	长城科技	3,400	79,900.00	0.05
445	000417	合百集团	12,500	79,750.00	0.05
446	002996	顺博合金	12,000	79,680.00	0.05
447	000048	京基智农	4,400	79,200.00	0.05
448	002243	力合科创	9,800	78,988.00	0.05
449	688522	纳睿雷达	1,400	78,876.00	0.05

450	600713	南京医药	15,900	78,864.00	0.05
451	300031	宝通科技	4,300	78,776.00	0.05
452	300638	广和通	3,900	78,585.00	0.05
453	603367	辰欣药业	5,700	78,318.00	0.05
454	605599	莱百股份	6,900	78,315.00	0.05
455	300911	亿田智能	3,000	78,240.00	0.05
456	300752	隆利科技	4,600	78,200.00	0.05
457	000920	沃顿科技	8,700	77,604.00	0.05
458	002446	盛路通信	11,800	77,290.00	0.05
459	605188	国光连锁	10,100	77,164.00	0.05
460	300656	民德电子	3,100	77,128.00	0.05
461	002225	濮耐股份	15,500	77,035.00	0.05
462	002150	通润装备	6,200	76,880.00	0.05
463	603713	密尔克卫	1,500	76,800.00	0.05
464	300193	佳士科技	8,600	76,454.00	0.05
465	301046	能辉科技	3,800	76,228.00	0.05
466	603515	欧普照明	4,600	75,670.00	0.05
467	300811	铂科新材	1,400	75,474.00	0.05
468	603711	香飘飘	4,600	75,440.00	0.05
469	001301	尚太科技	1,100	75,405.00	0.05
470	002300	太阳电缆	14,100	75,294.00	0.05
471	600640	国脉文化	6,300	75,222.00	0.05
472	000415	渤海租赁	19,900	75,023.00	0.05
473	002615	哈尔斯	9,400	74,730.00	0.05
474	002351	漫步者	4,500	74,250.00	0.05
475	603583	捷昌驱动	3,000	74,130.00	0.05
476	002979	雷赛智能	2,400	73,896.00	0.05
477	002588	史丹利	10,000	73,800.00	0.05
478	002404	嘉欣丝绸	11,900	73,661.00	0.05
479	600388	龙净环保	5,800	73,370.00	0.05
480	600477	杭萧钢构	28,500	73,245.00	0.05
481	001339	智微智能	2,000	73,180.00	0.05
482	603699	纽威股份	3,300	73,161.00	0.05
483	000707	双环科技	9,900	73,062.00	0.05
484	000919	金陵药业	11,100	73,038.00	0.05
485	603328	依顿电子	7,400	72,964.00	0.05
486	688293	奥浦迈	2,000	72,960.00	0.05
487	688699	明微电子	2,010	72,239.40	0.05
488	600452	涪陵电力	6,800	72,012.00	0.05
489	002135	东南网架	16,900	71,825.00	0.05
490	600212	绿能慧充	9,500	71,820.00	0.05
491	603099	长白山	1,700	71,604.00	0.05
492	300806	斯迪克	5,500	71,225.00	0.05

493	688408	中信博	988	71,136.00	0.04
494	600217	中再资环	13,400	71,020.00	0.04
495	601900	南方传媒	4,700	71,017.00	0.04
496	603983	丸美生物	2,200	70,972.00	0.04
497	601368	绿城水务	14,900	70,924.00	0.04
498	601330	绿色动力	10,800	70,848.00	0.04
499	002833	弘亚数控	4,200	70,686.00	0.04
500	002923	润都股份	7,400	70,596.00	0.04
501	000751	锌业股份	25,100	70,531.00	0.04
502	600207	安彩高科	15,800	70,468.00	0.04
503	002539	云图控股	9,000	70,380.00	0.04
504	600480	凌云股份	6,500	70,265.00	0.04
505	603355	莱克电气	3,100	70,215.00	0.04
506	300008	天海防务	15,000	70,200.00	0.04
507	603050	科林电气	3,400	70,176.00	0.04
508	300525	博思软件	4,500	70,110.00	0.04
509	603896	寿仙谷	3,300	69,993.00	0.04
510	301333	诺思格	1,400	69,986.00	0.04
511	600531	豫光金铅	10,900	69,978.00	0.04
512	001328	登康口腔	2,200	69,872.00	0.04
513	300304	云意电气	8,700	69,600.00	0.04
514	601133	柏诚股份	6,200	69,564.00	0.04
515	688246	嘉和美康	2,800	69,440.00	0.04
516	300447	全信股份	4,900	69,433.00	0.04
517	000676	智度股份	8,200	69,372.00	0.04
518	600345	长江通信	3,000	69,360.00	0.04
519	002611	东方精工	7,100	69,225.00	0.04
520	300533	冰川网络	3,500	69,160.00	0.04
521	603566	普莱柯	5,400	68,904.00	0.04
522	301025	读客文化	7,200	68,616.00	0.04
523	002297	博云新材	9,900	68,112.00	0.04
524	688478	晶升股份	2,400	67,704.00	0.04
525	002632	道明光学	7,600	67,640.00	0.04
526	301123	奕东电子	3,300	67,485.00	0.04
527	300852	四会富仕	2,500	65,550.00	0.04
528	300953	震裕科技	900	62,676.00	0.04
529	002675	东诚药业	5,000	61,100.00	0.04
530	600882	妙可蓝多	3,400	60,860.00	0.04
531	002455	百川股份	7,800	58,266.00	0.04
532	600223	福瑞达	7,300	55,188.00	0.03
533	300057	万顺新材	10,800	52,056.00	0.03
534	600123	兰花科创	5,700	48,792.00	0.03
535	300320	海达股份	4,700	45,120.00	0.03

536	002111	威海广泰	4,000	44,080.00	0.03
537	002614	奥佳华	6,600	43,692.00	0.03
538	300409	道氏技术	3,200	43,552.00	0.03
539	688252	天德钰	1,797	43,038.15	0.03
540	000672	上峰水泥	5,300	40,545.00	0.03
541	688209	英集芯	2,200	38,874.00	0.02
542	300353	东土科技	3,300	37,884.00	0.02
543	002560	通达股份	5,500	37,510.00	0.02
544	300781	因赛集团	500	29,515.00	0.02
545	688076	诺泰生物	536	27,829.12	0.02
546	600633	浙数文化	2,600	27,196.00	0.02
547	688095	福昕软件	402	26,998.32	0.02
548	688591	泰凌微	800	25,120.00	0.02
549	002847	盐津铺子	400	25,040.00	0.02
550	688513	苑东生物	800	24,104.00	0.02
551	688208	道通科技	613	24,005.08	0.02
552	688157	松井股份	600	23,586.00	0.01
553	688232	新点软件	800	23,192.00	0.01
554	002912	中新赛克	900	23,031.00	0.01
555	301152	天力锂能	700	22,995.00	0.01
556	301363	美好医疗	700	22,694.00	0.01
557	002073	软控股份	2,700	22,302.00	0.01
558	688680	海优新材	659	22,261.02	0.01
559	300402	宝色股份	1,500	22,125.00	0.01
560	300398	飞凯材料	1,400	22,064.00	0.01
561	600525	长园集团	4,500	21,960.00	0.01
562	002093	国脉科技	2,800	21,840.00	0.01
563	002658	雪迪龙	3,400	21,760.00	0.01
564	000948	南天信息	1,300	21,749.00	0.01
565	688663	新风光	1,000	21,710.00	0.01
566	002255	海陆重工	3,900	21,684.00	0.01
567	002166	莱茵生物	2,900	21,663.00	0.01
568	600468	百利电气	4,600	21,620.00	0.01
569	300477	合纵科技	7,600	21,584.00	0.01
570	300213	佳讯飞鸿	2,800	21,532.00	0.01
571	301150	中一科技	1,000	21,440.00	0.01
572	300593	新雷能	1,900	21,280.00	0.01
573	002838	道恩股份	1,800	21,258.00	0.01
574	000969	安泰科技	1,900	21,185.00	0.01
575	300667	必创科技	1,300	21,021.00	0.01
576	300354	东华测试	600	20,874.00	0.01
577	688377	迪威尔	1,057	20,378.96	0.01
578	002801	微光股份	800	19,568.00	0.01

579	002215	诺普信	1,700	19,091.00	0.01
580	300809	华辰装备	600	19,008.00	0.01
581	688206	概伦电子	1,000	18,910.00	0.01
582	002946	新乳业	1,300	18,863.00	0.01
583	603076	乐惠国际	800	18,432.00	0.01
584	600828	茂业商业	4,200	18,354.00	0.01
585	001378	德冠新材	800	18,336.00	0.01
586	301339	通行宝	900	18,306.00	0.01
587	688046	药康生物	1,400	17,990.00	0.01
588	688383	新益昌	400	17,948.00	0.01
589	600971	恒源煤电	1,900	17,879.00	0.01
590	600266	城建发展	3,500	17,850.00	0.01
591	300893	松原安全	600	17,508.00	0.01
592	603639	海利尔	1,400	17,360.00	0.01
593	600987	航民股份	2,500	17,350.00	0.01
594	002852	道道全	2,100	17,346.00	0.01
595	000059	华锦股份	3,600	17,244.00	0.01
596	688121	卓然股份	1,600	17,232.00	0.01
597	688526	科前生物	1,200	17,148.00	0.01
598	000848	承德露露	1,900	17,043.00	0.01
599	002707	众信旅游	2,300	16,997.00	0.01
600	001322	箭牌家居	2,100	16,989.00	0.01
601	688319	欧林生物	1,600	16,960.00	0.01
602	688179	阿拉丁	1,226	16,918.80	0.01
603	300873	海晨股份	1,000	16,910.00	0.01
604	002546	新联电子	3,900	16,887.00	0.01
605	600866	星湖科技	2,600	16,822.00	0.01
606	000603	盛达资源	1,400	16,786.00	0.01
607	000501	武商集团	1,600	16,736.00	0.01
608	688368	晶丰明源	188	16,732.00	0.01
609	688579	山大地纬	1,800	16,542.00	0.01
610	002283	天润工业	3,100	16,492.00	0.01
611	688535	华海诚科	221	16,431.35	0.01
612	600595	中孚实业	5,800	16,414.00	0.01
613	002573	清新环境	4,100	16,318.00	0.01
614	300326	凯利泰	2,500	16,250.00	0.01
615	603313	梦百合	2,400	16,200.00	0.01
616	603601	再升科技	4,800	16,128.00	0.01
617	601279	英利汽车	4,200	16,086.00	0.01
618	002081	金螳螂	4,500	16,065.00	0.01
619	603065	宿迁联盛	2,200	15,994.00	0.01
620	603386	骏亚科技	1,400	15,568.00	0.01
621	600846	同济科技	1,800	15,516.00	0.01

622	002154	报喜鸟	3,500	15,435.00	0.01
623	600691	阳煤化工	6,800	15,096.00	0.01
624	688269	凯立新材	600	14,988.00	0.01
625	600594	益佰制药	4,200	14,952.00	0.01
626	600620	天宸股份	2,600	14,872.00	0.01
627	002697	红旗连锁	2,500	14,775.00	0.01
628	688133	泰坦科技	800	14,592.00	0.01
629	600639	浦东金桥	1,300	14,430.00	0.01
630	002075	沙钢股份	2,200	13,772.00	0.01
631	000607	华媒控股	3,700	13,727.00	0.01
632	300994	久祺股份	1,200	13,536.00	0.01
633	600979	广安爱众	2,800	12,936.00	0.01
634	300083	创世纪	1,800	11,718.00	0.01
635	601811	新华文轩	700	11,095.00	0.01
636	600724	宁波富达	1,700	10,795.00	0.01
637	600798	宁波海运	3,300	9,999.00	0.01
638	301262	海看股份	400	9,948.00	0.01
639	002067	景兴纸业	2,100	8,316.00	0.01
640	301200	大族数控	200	7,236.00	0.00
641	688766	普冉股份	56	5,670.56	0.00
642	688138	清溢光电	199	4,557.10	0.00
643	300791	仙乐健康	50	1,316.50	0.00
644	300787	海能实业	80	1,073.60	0.00
645	600368	五洲交通	129	615.33	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	601717	郑煤机	40,400	524,392.00	0.33
2	000429	粤高速 A	27,700	407,190.00	0.26
3	000977	浪潮信息	6,900	357,972.00	0.23
4	002745	木林森	40,200	350,544.00	0.22
5	002128	电投能源	17,200	336,776.00	0.21
6	600075	新疆天业	77,400	336,690.00	0.21
7	002730	电光科技	24,000	327,840.00	0.21
8	002273	水晶光电	14,000	311,080.00	0.20
9	002442	龙星科技	51,100	307,111.00	0.19
10	001238	浙江正特	10,900	294,627.00	0.19
11	002236	大华股份	18,200	291,200.00	0.18
12	600980	北矿科技	18,600	284,208.00	0.18

13	000001	平安银行	24,200	283,140.00	0.18
14	600444	国机通用	18,300	278,343.00	0.18
15	002363	隆基机械	41,700	273,969.00	0.17
16	002371	北方华创	700	273,700.00	0.17
17	603380	易德龙	10,800	269,892.00	0.17
18	600031	三一重工	16,100	265,328.00	0.17
19	300986	志特新材	21,500	261,010.00	0.16
20	000999	华润三九	5,800	257,172.00	0.16
21	002249	大洋电机	43,700	256,519.00	0.16
22	600592	龙溪股份	25,900	255,892.00	0.16
23	600704	物产中大	50,000	253,000.00	0.16
24	600339	中油工程	70,400	252,032.00	0.16
25	301165	锐捷网络	3,400	245,480.00	0.16
26	002636	金安国纪	31,600	244,584.00	0.15
27	000938	紫光股份	8,700	242,121.00	0.15
28	601339	百隆东方	43,500	236,640.00	0.15
29	603595	东尼电子	13,400	229,006.00	0.14
30	600623	华谊集团	32,100	224,700.00	0.14
31	301329	信音电子	10,600	223,130.00	0.14
32	002920	德赛西威	2,000	220,220.00	0.14
33	002475	立讯精密	5,300	216,028.00	0.14
34	600731	湖南海利	37,800	215,460.00	0.14
35	605086	龙高股份	6,800	212,160.00	0.13
36	605166	聚合顺	17,600	210,672.00	0.13
37	600196	复星医药	8,300	206,255.00	0.13
38	002906	华阳集团	6,600	202,950.00	0.13
39	601618	中国中冶	60,500	199,650.00	0.13
40	300689	澄天伟业	7,700	196,504.00	0.12
41	002027	分众传媒	27,600	194,028.00	0.12
42	300290	荣科科技	9,500	193,325.00	0.12
43	000157	中联重科	26,700	193,041.00	0.12
44	603236	移远通信	2,800	191,632.00	0.12
45	000988	华工科技	4,400	190,520.00	0.12
46	688002	睿创微纳	4,000	188,040.00	0.12
47	300001	特锐德	8,500	186,575.00	0.12
48	002975	博杰股份	6,100	185,806.00	0.12
49	601333	广深铁路	54,000	185,220.00	0.12
50	600718	东软集团	17,000	183,090.00	0.12
51	600578	京能电力	51,700	181,984.00	0.11
52	300433	蓝思科技	8,300	181,770.00	0.11
53	002241	歌尔股份	6,800	175,508.00	0.11
54	002432	九安医疗	4,300	175,354.00	0.11
55	603289	泰瑞机器	21,000	173,250.00	0.11

56	002107	沃华医药	36,100	172,558.00	0.11
57	301258	富士莱	7,300	172,426.00	0.11
58	002228	合兴包装	56,600	169,800.00	0.11
59	000050	深天马 A	18,700	168,861.00	0.11
60	300502	新易盛	1,400	161,812.00	0.10
61	601002	晋亿实业	36,200	157,470.00	0.10
62	000039	中集集团	20,100	156,177.00	0.10
63	600271	航天信息	17,000	154,870.00	0.10
64	000554	泰山石油	25,500	151,470.00	0.10
65	002835	同为股份	7,800	149,760.00	0.09
66	300207	欣旺达	5,900	131,629.00	0.08
67	600487	亨通光电	7,400	127,428.00	0.08
68	002831	裕同科技	4,700	127,370.00	0.08
69	002916	深南电路	1,000	125,000.00	0.08
70	000998	隆平高科	11,100	123,987.00	0.08
71	301308	江波龙	1,400	120,400.00	0.08
72	600298	安琪酵母	3,300	118,965.00	0.08
73	600498	烽火通信	6,100	118,706.00	0.08
74	600160	巨化股份	4,900	118,188.00	0.07
75	603681	永冠新材	9,100	117,299.00	0.07
76	600219	南山铝业	29,800	116,518.00	0.07
77	300529	健帆生物	3,900	114,426.00	0.07
78	603836	海程邦达	9,100	110,656.00	0.07
79	000786	北新建材	3,600	109,116.00	0.07
80	002279	久其软件	17,400	109,098.00	0.07
81	600261	阳光照明	32,900	107,583.00	0.07
82	002879	长缆科技	7,100	106,784.00	0.07
83	000423	东阿阿胶	1,700	106,624.00	0.07
84	601919	中远海控	6,800	105,400.00	0.07
85	601229	上海银行	11,500	105,225.00	0.07
86	601992	金隅集团	59,100	105,198.00	0.07
87	600926	杭州银行	7,200	105,192.00	0.07
88	600919	江苏银行	10,700	105,074.00	0.07
89	000528	柳工	8,700	104,922.00	0.07
90	002282	博深股份	14,100	104,481.00	0.07
91	601088	中国神华	2,400	104,352.00	0.07
92	601186	中国铁建	11,300	103,621.00	0.07
93	601166	兴业银行	5,400	103,464.00	0.07
94	002517	恺英网络	7,600	103,436.00	0.07
95	600067	冠城新材	38,900	103,085.00	0.07
96	601877	正泰电器	4,400	103,004.00	0.07
97	300567	精测电子	1,600	102,880.00	0.07
98	601390	中国中铁	16,100	102,879.00	0.07

99	601869	长飞光纤	3,400	101,626.00	0.06
100	601866	中远海发	38,700	101,007.00	0.06
101	600096	云天化	4,500	100,350.00	0.06
102	603600	永艺股份	8,400	99,876.00	0.06
103	605589	圣泉集团	4,200	99,036.00	0.06
104	600143	金发科技	11,400	98,496.00	0.06
105	000425	徐工机械	12,400	98,332.00	0.06
106	002973	侨银股份	9,200	97,336.00	0.06
107	000963	华东医药	2,800	96,880.00	0.06
108	603173	福斯达	4,200	96,810.00	0.06
109	600141	兴发集团	4,400	95,480.00	0.06
110	000910	大亚圣象	12,000	94,440.00	0.06
111	000007	全新好	13,400	94,202.00	0.06
112	603799	华友钴业	3,200	93,632.00	0.06
113	002395	双象股份	5,600	92,456.00	0.06
114	002025	航天电器	1,900	92,264.00	0.06
115	601225	陕西煤业	3,900	90,714.00	0.06
116	002669	康达新材	9,400	90,522.00	0.06
117	600050	中国联通	16,600	88,146.00	0.06
118	002385	大北农	20,300	87,899.00	0.06
119	300427	红相股份	14,700	86,730.00	0.05
120	600000	浦发银行	8,400	86,436.00	0.05
121	300677	英科医疗	3,400	85,952.00	0.05
122	601328	交通银行	10,800	83,916.00	0.05
123	601988	中国银行	15,100	83,201.00	0.05
124	603985	恒润股份	7,100	82,928.00	0.05
125	601288	农业银行	15,500	82,770.00	0.05
126	600015	华夏银行	10,300	82,503.00	0.05
127	002800	天顺股份	7,900	81,528.00	0.05
128	600019	宝钢股份	11,600	81,200.00	0.05
129	603803	瑞斯康达	8,500	81,090.00	0.05
130	000691	亚太实业	23,600	80,948.00	0.05
131	601009	南京银行	7,600	80,940.00	0.05
132	300498	温氏股份	4,900	80,899.00	0.05
133	000692	惠天热电	23,000	80,270.00	0.05
134	600282	南钢股份	17,100	80,199.00	0.05
135	301042	安联锐视	2,200	79,178.00	0.05
136	603030	全筑股份	31,100	78,061.00	0.05
137	300743	天地数码	5,000	76,150.00	0.05
138	000683	远兴能源	13,600	76,024.00	0.05
139	300682	朗新集团	6,200	75,640.00	0.05
140	000333	美的集团	1,000	75,220.00	0.05
141	600418	江淮汽车	2,000	75,000.00	0.05

142	000726	鲁泰 A	11,500	74,980.00	0.05
143	000796	凯撒旅业	18,500	74,925.00	0.05
144	600177	雅戈尔	8,400	74,760.00	0.05
145	601898	中煤能源	6,000	73,080.00	0.05
146	002318	久立特材	3,100	72,571.00	0.05
147	000037	深南电 A	9,000	71,640.00	0.05
148	301280	珠城科技	1,700	70,839.00	0.04
149	603860	中公高科	2,400	70,824.00	0.04
150	301533	威马农机	2,400	70,800.00	0.04
151	002179	中航光电	1,800	70,740.00	0.04
152	600153	建发股份	6,700	70,484.00	0.04
153	003025	思进智能	5,000	70,450.00	0.04
154	002890	弘宇股份	7,140	70,400.40	0.04
155	688125	安达智能	1,800	70,326.00	0.04
156	688603	天承科技	600	69,900.00	0.04
157	300995	奇德新材	4,400	69,564.00	0.04
158	001210	金房能源	4,900	68,453.00	0.04
159	301015	百洋医药	2,800	67,788.00	0.04
160	600589	大位科技	14,800	67,784.00	0.04
161	301163	宏德股份	3,200	67,616.00	0.04
162	600098	广州发展	10,300	66,126.00	0.04
163	600380	健康元	5,700	64,239.00	0.04
164	301626	苏州天脉	957	62,951.46	0.04
165	603429	集友股份	10,000	62,600.00	0.04
166	688223	晶科能源	8,400	59,724.00	0.04
167	000830	鲁西化工	4,800	56,112.00	0.04
168	000951	中国重汽	3,300	56,034.00	0.04
169	603501	韦尔股份	500	52,205.00	0.03
170	002812	恩捷股份	1,500	47,985.00	0.03
171	301611	珂玛科技	766	42,972.60	0.03
172	600967	内蒙一机	4,900	41,650.00	0.03
173	002841	视源股份	1,100	40,601.00	0.03
174	688605	先锋精科	744	39,937.92	0.03
175	600583	海油工程	7,000	38,290.00	0.02
176	600790	轻纺城	10,100	37,875.00	0.02
177	000930	中粮科技	6,517	36,169.35	0.02
178	688726	拉普拉斯	956	31,605.36	0.02
179	300054	鼎龙股份	1,100	28,622.00	0.02
180	301551	无线传媒	652	28,185.96	0.02
181	000958	电投产融	4,300	26,789.00	0.02
182	603177	德创环保	3,600	26,496.00	0.02
183	000156	华数传媒	3,600	25,920.00	0.02
184	688449	联芸科技	859	25,288.96	0.02

185	605499	东鹏饮料	100	24,852.00	0.02
186	688615	合合信息	149	24,701.22	0.02
187	688750	金天钛业	1,491	23,021.04	0.01
188	300454	深信服	400	22,960.00	0.01
189	001380	华纬科技	1,000	21,900.00	0.01
190	688768	容知日新	600	21,804.00	0.01
191	603577	汇金通	2,600	20,774.00	0.01
192	601838	成都银行	1,200	20,532.00	0.01
193	688379	华光新材	1,000	20,420.00	0.01
194	002825	纳尔股份	2,600	20,332.00	0.01
195	301522	上大股份	816	20,269.44	0.01
196	688109	品茗科技	800	19,608.00	0.01
197	601825	沪农商行	2,300	19,573.00	0.01
198	600681	百川能源	5,500	19,250.00	0.01
199	601169	北京银行	3,100	19,065.00	0.01
200	601319	中国人保	2,500	19,050.00	0.01
201	300724	捷佳伟创	300	18,963.00	0.01
202	601998	中信银行	2,700	18,846.00	0.01
203	603072	天和磁材	1,477	18,167.10	0.01
204	002202	金风科技	1,700	17,561.00	0.01
205	002532	天山铝业	2,200	17,314.00	0.01
206	688708	佳驰科技	349	17,083.55	0.01
207	688721	龙图光罩	279	15,861.15	0.01
208	301556	托普云农	267	15,766.35	0.01
209	301571	国科天成	350	14,290.50	0.01
210	002008	大族激光	500	12,500.00	0.01
211	301622	英思特	261	11,724.12	0.01
212	603871	嘉友国际	600	11,610.00	0.01
213	301586	佳力奇	215	11,425.10	0.01
214	688710	益诺思	332	11,148.56	0.01
215	301613	新铝时代	255	10,651.35	0.01
216	301606	绿联科技	281	10,253.69	0.01
217	603811	诚意药业	1,300	10,036.00	0.01
218	001230	劲旅环境	600	9,948.00	0.01
219	601677	明泰铝业	800	9,624.00	0.01
220	301631	壹连科技	92	9,380.32	0.01
221	301607	富特科技	257	9,287.98	0.01
222	001391	国货航	1,365	9,282.00	0.01
223	301608	博实结	135	8,826.30	0.01
224	301603	乔锋智能	206	8,647.88	0.01
225	600764	中国海防	300	8,496.00	0.01
226	301580	爱迪特	141	8,192.10	0.01
227	301552	科力装备	143	8,132.41	0.01

228	301585	蓝宇股份	210	7,528.50	0.00
229	001279	强邦新材	265	7,396.15	0.00
230	301617	博苑股份	185	7,361.15	0.00
231	603395	红四方	154	5,508.58	0.00
232	688226	威腾电气	214	5,377.82	0.00
233	603207	小方制药	185	4,930.25	0.00
234	603091	众鑫股份	94	4,176.42	0.00
235	603194	中力股份	142	3,994.46	0.00
236	603350	安乃达	106	3,834.02	0.00
237	603391	力聚热能	85	3,514.75	0.00
238	603205	健尔康	128	3,500.80	0.00
239	688667	菱电电控	74	2,974.06	0.00
240	688369	致远互联	134	2,689.38	0.00
241	603285	键邦股份	117	2,645.37	0.00
242	603310	巍华新材	129	2,315.55	0.00
243	603381	永臻股份	98	2,148.16	0.00
244	002687	乔治白	129	565.02	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	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002534	西子洁能	2,808,897.00	0.75
2	002043	兔宝宝	2,788,653.00	0.75
3	603995	甬金股份	2,409,895.00	0.65
4	002543	万和电气	2,389,744.00	0.64
5	603855	华荣股份	2,375,408.00	0.64
6	301219	腾远钴业	2,335,316.70	0.63
7	603520	司太立	2,311,581.00	0.62
8	605338	巴比食品	2,305,371.00	0.62
9	600420	国药现代	2,289,184.00	0.61
10	300681	英搏尔	2,087,554.00	0.56
11	002026	山东威达	2,082,371.00	0.56
12	603337	杰克股份	2,045,920.00	0.55
13	002315	焦点科技	2,034,747.00	0.55
14	002322	理工能科	1,966,032.00	0.53
15	300533	冰川网络	1,954,730.00	0.52
16	002788	鹭燕医药	1,953,269.00	0.52
17	300381	溢多利	1,948,106.00	0.52
18	603612	索通发展	1,941,860.00	0.52
19	002048	宁波华翔	1,937,336.00	0.52

20	601886	江河集团	1,924,865.00	0.52
----	--------	------	--------------	------

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	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002533	金杯电工	3,538,727.00	0.95
2	600210	紫江企业	3,315,586.00	0.89
3	002543	万和电气	3,292,442.00	0.88
4	001696	宗申动力	3,180,678.00	0.85
5	603855	华荣股份	3,046,638.71	0.82
6	002534	西子洁能	2,999,315.00	0.80
7	300532	今天国际	2,981,606.00	0.80
8	002540	亚太科技	2,803,702.20	0.75
9	002160	常铝股份	2,779,479.00	0.75
10	300409	道氏技术	2,726,134.00	0.73
11	600835	上海机电	2,716,867.00	0.73
12	300771	智莱科技	2,707,514.37	0.73
13	600577	精达股份	2,699,334.00	0.72
14	603611	诺力股份	2,690,237.00	0.72
15	603897	长城科技	2,674,038.00	0.72
16	600694	大商股份	2,582,589.10	0.69
17	601019	山东出版	2,521,136.00	0.68
18	002645	华宏科技	2,520,210.00	0.68
19	300533	冰川网络	2,511,249.50	0.67
20	002757	南兴股份	2,483,411.00	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	966,765,956.25
卖出股票收入（成交）总额	1,159,068,796.25

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	507,230.27	0.32
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）	13,000.34	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	520,230.61	0.33

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	019723	23 国债 20	5,000	507,230.27	0.32
2	110098	南药转债	130	13,000.34	0.01

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

本报告期内，本基金投资国债期货符合既定的投资政策和投资目的。

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桂林三金（证券代码 002275）、华盛昌（证券代码 002980）、金河生物（证券代码 002688）、西子洁能（证券代码 002534）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、桂林三金（证券代码 002275）

根据 2024 年 1 月 5 日发布的相关公告，该证券发行人因未按期申报税款被国家税务总局长沙市芙蓉区税务局责令改正。

2、华盛昌（证券代码 002980）

根据 2024 年 3 月 28 日发布的相关公告，该证券发行人因涉嫌违反法律法规被国家外汇管理局深圳市分局处以罚款，并警告。

3、金河生物（证券代码 002688）

根据 2024 年 2 月 29 日发布的相关公告，该证券发行人因公司股东及其关联方违规占用公司资金被内蒙古证监局给予警示。

根据 2024 年 4 月 1 日发布的相关公告，该证券发行人因未按期申报税款被国家税务总局北京市朝阳区税务局八里庄税务所责令改正。

4、西子洁能（证券代码 002534）

根据 2024 年 2 月 1 日发布的相关公告，该证券发行人因未按期申报税款被国家税务总局常州市武进区税务局第一税务分局（办税服务厅）责令改正。

根据 2024 年 4 月 10 日发布的相关公告，该证券发行人因未按期申报税款被国家税务总局常州经济开发区税务局责令改正。

根据 2024 年 11 月 19 日发布的相关公告，该证券发行人因未按期申报税款被国家税务总局上海市浦东新区临港税务局第五税务所责令改正。

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。

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	285,878.40
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,230,013.83
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,515,892.23

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	1,154	54,550.42	24,953,308.76	39.64%	37,997,881.33	60.36%
招商国证 2000 指数增强 C	1,716	49,483.52	6,407,278.44	7.55%	78,506,448.65	92.45%
合计	2,870	51,520.88	31,360,587.20	21.21%	116,504,329.98	78.79%

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	7,011.81	0.0111%
	招商国证 2000 指数增强 C	291,436.85	0.3432%
	合计	298,448.66	0.2018%

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	10~50
	合计	10~50

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 product 情况

基金经理姓名	产品类型	持有本人管理的 product 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
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	87,095,177.79	247,684,521.70
减: 报告期基金总赎回份额	107,707,000.58	454,063,945.16
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	62,951,190.09	84,913,727.09

§ 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

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。

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 2 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 20,000.00 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	917,916,111.86	43.25%	398,821.18	41.84%	-
西南证券	3	825,838,444.48	38.91%	346,710.80	36.38%	-
东海证券	3	378,778,556.71	17.85%	207,605.66	21.78%	-

注：（一）选择标准

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

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

3、被动股票型基金以外类型基金选择能够提供优质研究服务的证券公司。

（二）选择程序

1、基金管理人根据上述标准进行评估并确定选用的证券公司。

2、基金管理人与被选择的证券公司签订交易单元租用协议/证券经纪服务协议。

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	成交金额	占当期债券回购成	成交金额	占当期权证成交总

		额的比例		交总额的 比例		额的比例
财通证券	649,794.63	63.88%	-	-	-	-
西南证券	285,118.14	28.03%	-	-	-	-
东海证券	82,234.56	8.08%	-	-	-	-

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 年第 4 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	2024-01-19
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
13	招商基金管理有限公司旗下基金 2024 年第 2	证券时报及基金管理	2024-07-18

	季度报告提示性公告	人网站	
14	招商国证 2000 指数增强型证券投资基金 2024 年第 2 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	2024-07-18
15	招商国证 2000 指数增强型证券投资基金更新的招募说明书（二零二四年第一号）	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	2024-07-31
16	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	2024-07-31
17	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	2024-07-31
18	招商基金管理有限公司关于终止中民财富基金销售（上海）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	2024-08-20
19	招商国证 2000 指数增强型证券投资基金 2024 年中期报告	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	2024-08-30
20	招商基金管理有限公司旗下基金 2024 年中期报告提示性公告	证券时报及基金管理人网站	2024-08-30
21	招商基金管理有限公司旗下基金 2024 年第 3 季度报告提示性公告	证券时报及基金管理人网站	2024-10-24
22	招商国证 2000 指数增强型证券投资基金 2024 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	2024-10-24
23	招商基金管理有限公司关于旗下基金估值变更的公告	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	2024-11-06
24	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	2024-11-13
25	关于警惕冒用招商基金管理有限公司名义进行诈骗活动的特别提示公告	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	2024-12-19

§ 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.cmfchina.com>

招商基金管理有限公司

2025 年 3 月 28 日