

招商国证 2000 指数增强型证券投资基金 2025 年中期报告

2025 年 06 月 30 日

基金管理人：招商基金管理有限公司

基金托管人：财通证券股份有限公司

送出日期：2025 年 8 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人财通证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2025 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	4
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
§4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明	11
§5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	16
§7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	60
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	62
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	62
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	62
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	62
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	62
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	62

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	63
7.12 投资组合报告附注	63
§8 基金份额持有人信息	64
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	64
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	64
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	65
§9 开放式基金份额变动	65
§10 重大事件揭示	65
10.1 基金份额持有人大会决议	65
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	65
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	66
10.4 基金投资策略的改变	66
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	66
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	66
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	66
10.8 其他重大事件	67
§11 备查文件目录	68
11.1 备查文件目录	68
11.2 存放地点	68
11.3 查阅方式	69

§ 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	99,630,076.59 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	27,843,760.88 份	71,786,315.71 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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.cmfchina.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

1、招商国证 2000 指数增强 A

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2025 年 1 月 1 日 - 2025 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	8,321,940.57
本期利润	7,871,072.97
加权平均基金份额本期利润	0.1781
本期加权平均净值利润率	15.78%
本期基金份额净值增长率	17.33%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	7,237,718.81
期末可供分配基金份额利润	0.2599
期末基金资产净值	35,081,479.69
期末基金份额净值	1.2599
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	25.99%

2、招商国证 2000 指数增强 C

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2025 年 1 月 1 日 - 2025 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	12,818,176.45
本期利润	13,513,908.23
加权平均基金份额本期利润	0.1831
本期加权平均净值利润率	16.23%
本期基金份额净值增长率	17.10%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	17,971,380.92
期末可供分配基金份额利润	0.2503
期末基金资产净值	89,757,696.63
期末基金份额净值	1.2503
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	25.03%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

招商国证 2000 指数增强 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	7.20%	0.79%	5.71%	1.00%	1.49%	-0.21%
过去三个月	8.92%	1.70%	4.25%	1.90%	4.67%	-0.20%
过去六个月	17.33%	1.44%	10.26%	1.71%	7.07%	-0.27%
过去一年	40.44%	1.70%	35.04%	1.98%	5.40%	-0.28%
自基金合同生效起至今	25.99%	1.60%	3.53%	1.82%	22.46%	-0.22%

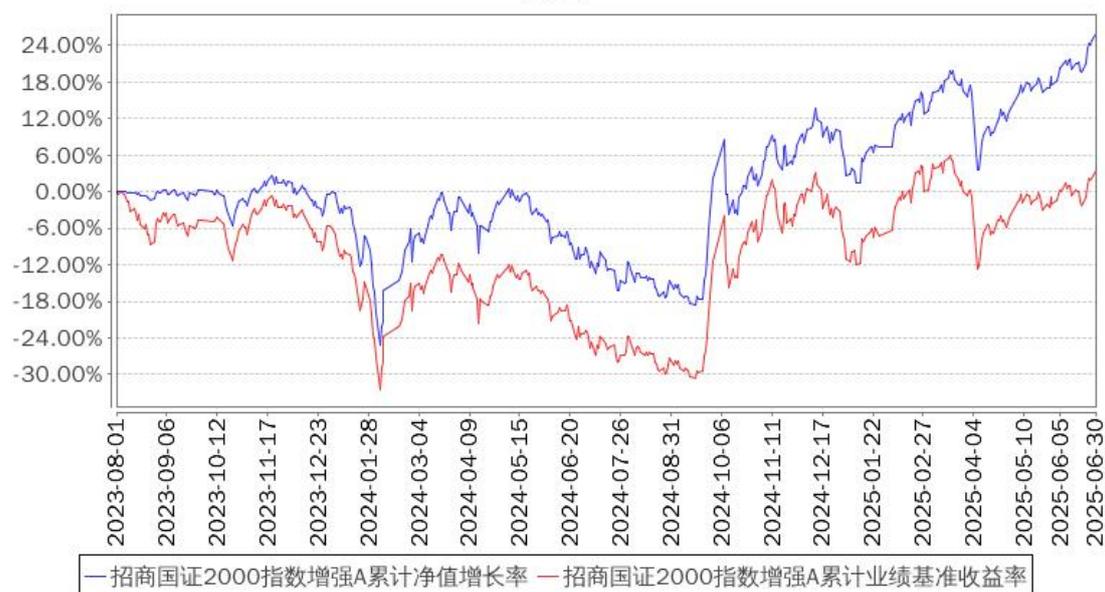
招商国证 2000 指数增强 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	7.16%	0.79%	5.71%	1.00%	1.45%	-0.21%

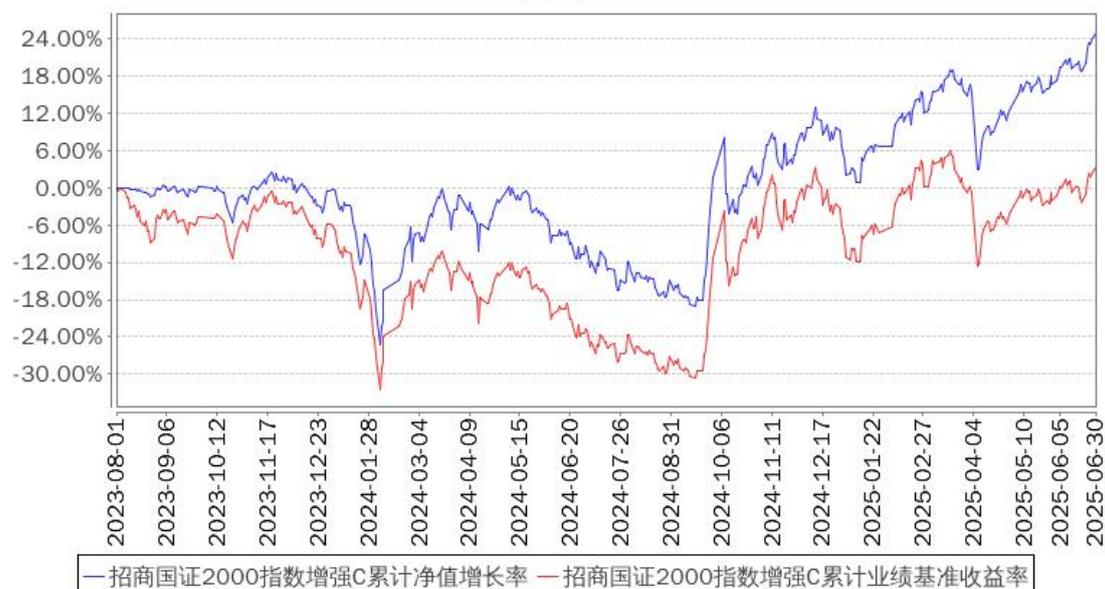
过去三个月	8.82%	1.70%	4.25%	1.90%	4.57%	-0.20%
过去六个月	17.10%	1.44%	10.26%	1.71%	6.84%	-0.27%
过去一年	39.87%	1.70%	35.04%	1.98%	4.83%	-0.28%
自基金合同生效起至今	25.03%	1.60%	3.53%	1.82%	21.50%	-0.22%

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



§ 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, 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、招商上证综合指数增强型发起式证券投资基金、招商中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、招商中证 A500 指数增强型发起式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《证券投资基金经营机构董事、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	14	10,902,181,141.69	2021 年 11 月 23 日
	私募资产管理计划	1	49,690,786.21	2013 年 11 月 26 日
	其他组合	1	3,772,902,061.10	2024 年 8 月 19 日
	合计	16	14,724,773,989.00	-

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 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，本基金各项交易均严格按照相关法律法规、基金合同的有关要求执行，公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当

日成交量的 5% 的交易共有 12 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 指数上涨超 10%，本组合相对国证指数也有一定的超额收益，涨幅超过 17%。4 月初指数在外部环境因素干扰下快速回调，但随后市场情绪企稳后逐步反弹。从市场风格上看，一季度成长风格快速拉升，价值风格则在二季度有所反弹，扭转了一季度相对弱勢的局面，同时小市值风格持续强于大市值风格。量化模型在价值风格上普遍有一定的暴露，同时传统量价因子在一季度高波动高流动性环境下表现较弱，二季度市场逐步恢复正常，超额收益也逐步企稳反弹。当前外部环境的不确定性依然较高，市场信心可能有一定反复，同时由于小市值风格上半年持续强势，市值风格的风险加大，博弈情绪较重的背景下需要密切观察市场波动率同时做好风险应对。指数整体表现难以预测，相对基准的超额收益就显得更加重要，在策略方面，本产品会继续采用多模型配置的框架，力争在较低的跟踪误差下创造出持续的超额收益。我们也将持续加强新因子及新方法的研究，尽力保持策略超额收益的持续性和多元性。

4.4.2 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 17.33%，同期业绩基准增长率为 10.26%，C 类份额净值增长率为 17.10%，同期业绩基准增长率为 10.26%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2025 年上半年国内经济呈“生产稳、需求弱、价格低”特征，政策端以“宽货币+稳财政+促消费”为主线，央行 5 月降准、降息及调降存款利率，财政端加快专项债与超长期特别国债发行，地产供需两端政策持续加码，但传导至信用扩张与实物工作量仍需时间。展望下半年，盈利预测仍有下修压力，但 A 股整体估值仍处于相对低位，叠加美元上行空间受限、国内稳增长政策落地预期升温，市场或呈现“震荡上行、结构再平衡”特征。风格层面，当前小市值风格正处于相对高位，需警惕其回调风险。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金的估值业务严格按照相关的法律法规、基金合同以及《招商基金管理有限公司基金估值委员会管理办法》进行。基金核算部负责日常的基金资产的估值业务，执行基金估值政策。另外，公司设立由投资和研究部门、风险管理部、基金核算部、法律合规部负责人和基金经理代表组成的估值委员会。公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业

胜任能力和相关工作经历。公司估值委员会主要负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，定期评价现有估值政策和程序的适用性及对估值程序执行情况进行监督。

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配，符合相关法规及基金合同的约定。

4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期内，本托管人严格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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人对本报告中主要财务指标、投资组合报告、财务会计报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：招商国证 2000 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	15,961,094.59	10,521,730.18
结算备付金		751,556.91	973,443.37
存出保证金		751,608.00	285,878.40
交易性金融资产	6.4.7.2	111,011,536.41	147,577,978.95
其中：股票投资		111,011,536.41	147,057,748.34
基金投资		-	-
债券投资		-	520,230.61
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		1,246,473.69	1,230,013.83
递延所得税资产		-	-

其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		129,722,269.60	160,589,044.73
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		4,688,324.25	2,113,052.39
应付管理人报酬		94,649.36	143,559.93
应付托管费		9,464.94	14,355.99
应付销售服务费		26,576.12	33,552.05
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	6,892.21
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	64,078.61	20,000.00
负债合计		4,883,093.28	2,331,412.57
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	99,630,076.59	147,864,917.18
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	25,209,099.73	10,392,714.98
净资产合计		124,839,176.32	158,257,632.16
负债和净资产总计		129,722,269.60	160,589,044.73

注：报告截止日 2025 年 6 月 30 日，招商国证 2000 指数增强 A 份额净值 1.2599 元，基金份额总额 27,843,760.88 份；招商国证 2000 指数增强 C 份额净值 1.2503 元，基金份额总额 71,786,315.71 份；总份额合计 99,630,076.59 份。

6.2 利润表

会计主体：招商国证 2000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		22,346,740.95	-33,135,081.52
1.利息收入		31,803.69	90,507.00
其中：存款利息收入	6.4.7.9	31,803.69	90,507.00
债券利息收入		-	-

资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		22,058,365.14	-26,534,306.65
其中：股票投资收益	6.4.7.10	20,690,247.26	-30,922,038.88
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	12,388.64	71.47
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	135,203.82	1,147,511.49
股利收益	6.4.7.15	1,220,525.42	3,240,149.27
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	244,864.18	-6,735,336.55
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	11,707.94	44,054.68
减：二、营业总支出		961,759.75	1,914,350.72
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	665,259.66	1,328,617.38
其中：暂估管理人报酬		-	-
2.托管费	6.4.10.2.2	66,525.97	132,861.73
3.销售服务费	6.4.10.2.3	166,430.36	378,026.07
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7.税金及附加		710.15	5,173.20
8.其他费用	6.4.7.19	62,833.61	69,672.34
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		21,384,981.20	-35,049,432.24
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		21,384,981.20	-35,049,432.24
五、其他综合收益的税后		-	-

净额			
六、综合收益总额		21,384,981.20	-35,049,432.24

6.3 净资产变动表

会计主体：招商国证 2000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	147,864,917.18	-	10,392,714.98	158,257,632.16
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	147,864,917.18	-	10,392,714.98	158,257,632.16
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-48,234,840.59	-	14,816,384.75	-33,418,455.84
（一）、综合收益总额	-	-	21,384,981.20	21,384,981.20
（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）	-48,234,840.59	-	-6,568,596.45	-54,803,437.04
其中：1.基金申购款	112,907,669.52	-	15,983,526.69	128,891,196.21
2.基金赎回款	-161,142,510.11	-	-22,552,123.14	-183,694,633.25
（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	99,630,076.59	-	25,209,099.73	124,839,176.32
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	374,856,163.43	-	-2,003,757.12	372,852,406.31

产				
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	374,856,163.43	-	-2,003,757.12	372,852,406.31
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-137,620,958.46	-	-22,962,305.34	-160,583,263.80
（一）、综合收益总额	-	-	-35,049,432.24	-35,049,432.24
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-137,620,958.46	-	12,087,126.90	-125,533,831.56
其中：1.基金申购款	176,972,081.08	-	-11,443,073.09	165,529,007.99
2.基金赎回款	-314,593,039.54	-	23,530,199.99	-291,062,839.55
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	237,235,204.97	-	-24,966,062.46	212,269,142.51

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

____钟文岳____ ____欧志明____ ____何剑萍____
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

招商国证 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%。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2025 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策，会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期间未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

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

(1) 证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税；2018年1月1日起，公开募集证券投资基金管理人运营公开募集证券投资基金过程中发生的资管产品运营业务，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
活期存款	8,756,068.46
等于：本金	8,755,369.53
加：应计利息	698.93
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	7,205,026.13
等于：本金	7,204,498.57
加：应计利息	527.56
减：坏账准备	-
合计	15,961,094.59

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	105,966,721.42	-	111,011,536.41	5,044,814.99
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	-	-	-	-
交易所	-	-	-	-

	市场				
	银行间 市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		105,966,721.42	-	111,011,536.41	5,044,814.99

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 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	6,123,800.00	-	-	-
其中：股指期货 投资	6,123,800.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	6,123,800.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IM2507	IM2507	3.00	3,773,640.00	126,080.00
IM2508	IM2508	2.00	2,489,760.00	13,520.00
合计				139,600.00
减：可抵销期货暂收款				139,600.00
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。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	62,833.61
其他	1,245.00
合计	64,078.61

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

招商国证 2000 指数增强 A		
项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	62,951,190.09	62,951,190.09
本期申购	7,878,954.23	7,878,954.23
本期赎回（以“-”号填列）	-42,986,383.44	-42,986,383.44
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	27,843,760.88	27,843,760.88

招商国证 2000 指数增强 C		
项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	84,913,727.09	84,913,727.09
本期申购	105,028,715.29	105,028,715.29
本期赎回（以“-”号填列）	-118,156,126.67	-118,156,126.67
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	71,786,315.71	71,786,315.71

注：本期申购含红利再投、转换入份（金）额，本期赎回含转换出份（金）额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

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

上年度末	5,264,989.96	-620,335.15	4,644,654.81
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	5,264,989.96	-620,335.15	4,644,654.81
本期利润	8,321,940.57	-450,867.60	7,871,072.97
本期基金份额交易产生的变动数	-6,126,235.75	848,226.78	-5,278,008.97
其中：基金申购款	1,433,501.37	-329,868.34	1,103,633.03
基金赎回款	-7,559,737.12	1,178,095.12	-6,381,642.00
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,460,694.78	-222,975.97	7,237,718.81

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	6,580,831.41	-832,771.24	5,748,060.17
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	6,580,831.41	-832,771.24	5,748,060.17
本期利润	12,818,176.45	695,731.78	13,513,908.23
本期基金份额交易产生的变动数	-851,053.87	-439,533.61	-1,290,587.48
其中：基金申购款	18,483,934.82	-3,604,041.16	14,879,893.66
基金赎回款	-19,334,988.69	3,164,507.55	-16,170,481.14
本期已分配利润	-	-	-
本期末	18,547,953.99	-576,573.07	17,971,380.92

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	13,644.88
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	11,515.04
结算备付金利息收入	6,621.46
其他	22.31
合计	31,803.69

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	20,690,247.26

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	20,690,247.26

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	327,650,777.32
减：卖出股票成本总额	306,632,849.89
减：交易费用	327,680.17
买卖股票差价收入	20,690,247.26

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无股票赎回差价收入。

6.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无股票申购差价收入。

6.4.7.10.5 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内无证券出借差价收入。

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	1,921.92
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	10,466.72
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	12,388.64

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	567,770.60
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	552,389.77
减：应计利息总额	4,902.76
减：交易费用	11.35

买卖债券差价收入	10,466.72
----------	-----------

6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券申购差价收入。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内无买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.12.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券赎回差价收入。

6.4.7.12.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券申购差价收入。

6.4.7.13 贵金属投资收益

6.4.7.13.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.13.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

6.4.7.13.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无贵金属赎回差价收入。

6.4.7.13.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无贵金属申购差价收入。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具买卖权证差价收入。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	135,203.82

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,220,525.42
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,220,525.42

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-1,235.82
——股票投资	-975.82
——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	246,100.00
——权证投资	-
——期货投资	246,100.00
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	244,864.18

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	11,707.94
合计	11,707.94

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	3,326.24
信息披露费	59,507.37

证券出借违约金	-
合计	62,833.61

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报告批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

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

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
财通证券	298,233,146.69	49.93%	532,079,507.28	42.92%

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
财通证券	528,267.45	93.85%	-	-

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
财通证券	56,825.29	45.26%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
财通证券	319,977.00	42.87%	-	-

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

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

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	665,259.66	1,328,617.38
其中：应支付销售机构的客户维护费	237,544.83	357,412.14
应支付基金管理人的净管理费	427,714.83	971,205.24

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：

日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×1.00%÷当年天数

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	66,525.97	132,861.73

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

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%÷当年天数

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	招商国证 2000 指数增强 A	招商国证 2000 指数增强 C	合计
财通证券	-	85,162.42	85,162.42
招商基金管理有限公司	-	904.73	904.73
招商银行	-	1,024.64	1,024.64
招商证券	-	28.33	28.33
合计	-	87,120.12	87,120.12
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	招商国证 2000 指数增强 A	招商国证 2000 指数增强 C	合计
财通证券	-	187,294.99	187,294.99
招商基金管理有限公司	-	428.61	428.61
招商银行	-	1,651.92	1,651.92
招商证券	-	130.52	130.52
合计	-	189,506.04	189,506.04

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

其计算公式为：

C 类份额日销售服务费=前一日 C 类基金资产净值×0.40%÷当年天数

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

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

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
财通证券-活期	8,756,068.46	13,644.88	2,361,448.86	30,258.56
财通证券-其他存款	5,550,475.93	9,536.37	8,986,467.74	11,409.27

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。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

单位：人民币元

本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
招商证券	001388	信通电子	网下申购	676	11,099.92
上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	

				数量（单位： 股/张）	总金额
财通证券	301539	宏鑫科技	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

注：本表已包含托管人的关联方承销期内承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2025 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001335	信凯科技	2025 年 4 月 2 日	6 个月	新股流通受限	12.80	28.05	80	1,024.00	2,244.00	-
001356	富岭股份	2025 年 1 月 16 日	6 个月	新股流通受限	5.30	14.44	449	2,379.70	6,483.56	-
001382	新亚电缆	2025 年 3 月 13 日	6 个月	新股流通受限	7.40	20.21	341	2,523.40	6,891.61	-
001388	信通电子	2025 年 6 月 24 日	1 个月内（含）	新股流通受限	16.42	16.42	608	9,983.36	9,983.36	-
001388	信通电子	2025 年 6 月 24 日	6 个月	新股流通受限	16.42	16.42	68	1,116.56	1,116.56	-
001390	古麒绒材	2025 年 5 月 21 日	6 个月	新股流通受限	12.08	18.12	112	1,352.96	2,029.44	-
001395	亚联机械	2025 年 1 月 20 日	6 个月	新股流通受限	19.08	47.25	80	1,526.40	3,780.00	-
301173	毓恬冠佳	2025 年 2 月 24 日	6 个月	新股流通受限	28.33	44.98	150	4,249.50	6,747.00	-
301275	汉朔科技	2025 年 3 月 4 日	6 个月	新股流通受限	27.50	56.19	153	4,207.50	8,597.07	-

		日								
301458	钧崴电子	2025 年 1 月 2 日	6 个月	新股流通 受限	10.40	34.11	522	5,428.80	17,805.42	-
301479	弘景光电	2025 年 3 月 6 日	6 个月	新股流通 受限	41.90	77.87	132	3,938.60	10,278.84	-
301501	恒鑫生活	2025 年 3 月 11 日	6 个月	新股流通 受限	39.92	45.22	141	3,872.24	6,376.02	-
301535	浙江华远	2025 年 3 月 18 日	6 个月	新股流通 受限	4.92	18.99	734	3,611.28	13,938.66	-
301560	众捷汽车	2025 年 4 月 17 日	6 个月	新股流通 受限	16.50	27.45	152	2,508.00	4,172.40	-
301590	优优绿能	2025 年 5 月 28 日	6 个月	新股流通 受限	89.60	139.48	30	2,688.00	4,184.40	-
301595	太力科技	2025 年 5 月 12 日	6 个月	新股流通 受限	17.05	29.10	164	2,796.20	4,772.40	-
301601	惠通科技	2025 年 1 月 8 日	6 个月	新股流通 受限	11.80	33.85	342	4,035.60	11,576.70	-
301602	超研股份	2025 年 1 月 15 日	6 个月	新股流通 受限	6.70	24.80	658	4,408.60	16,318.40	-
301658	首航新能	2025 年 3 月 26 日	6 个月	新股流通 受限	11.80	22.98	303	3,575.40	6,962.94	-
301662	宏工科技	2025 年 4 月 10 日	6 个月	新股流通 受限	26.60	82.50	115	3,059.00	9,487.50	-
301665	泰禾股份	2025 年 4 月 2 日	6 个月	新股流通 受限	10.27	22.39	317	3,255.59	7,097.63	-
301678	新恒汇	2025 年 6 月 13 日	6 个月	新股流通 受限	12.80	44.54	191	2,444.80	8,507.14	-
603072	天和磁材	2024 年 12 月 24 日	6 个月	新股流通 受限	12.30	54.45	148	1,820.40	8,058.60	-
603124	江南新材	2025 年	6 个月	新股流通	10.54	46.31	88	927.52	4,075.28	-

		3月12日		受限						
603210	泰鸿万立	2025年4月1日	6个月	新股流通受限	8.60	15.61	200	1,720.00	3,122.00	-
603257	中国瑞林	2025年3月28日	6个月	新股流通受限	20.52	37.47	55	1,128.60	2,060.85	-
603271	永杰新材	2025年3月4日	6个月	新股流通受限	20.60	35.08	76	1,565.60	2,666.08	-
603409	汇通控股	2025年2月25日	6个月	新股流通受限	24.18	33.32	66	1,595.88	2,199.12	-
688411	海博思创	2025年1月20日	6个月	新股流通受限	19.38	83.49	332	6,434.16	27,718.68	-
688545	兴福电子	2025年1月15日	6个月	新股流通受限	11.68	26.95	518	6,050.24	13,960.10	-
688583	思看科技	2025年1月8日	6个月	新股流通受限	33.46	79.68	209	5,387.06	16,653.12	-
688757	胜科纳米	2025年3月18日	6个月	新股流通受限	9.08	25.94	536	4,866.88	13,903.84	-
688758	赛分科技	2025年1月2日	6个月	新股流通受限	4.32	16.97	777	3,356.64	13,185.69	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

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

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688313	仕佳光子	2025年6月30日	重大事项	38.05	2025年7	39.98	1,941	55,549.00	73,855.05	-

			停牌		月 11 日					
--	--	--	----	--	--------------	--	--	--	--	--

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

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

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	13,000.34
未评级	-	-
合计	-	13,000.34

注：债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

定到期日均为一年以内且不计息,可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息,因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2025 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	15,961,094.59	-	-	-	15,961,094.59
结算备付金	751,556.91	-	-	-	751,556.91
存出保证金	-	-	-	751,608.00	751,608.00
交易性金融资产	-	-	-	111,011,536.41	111,011,536.41
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	-	-	-	1,246,473.69	1,246,473.69
应收清算款	-	-	-	-	-

其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	16,712,651.50	-	-	113,009,618.10	129,722,269.60
负债					
应付赎回款	-	-	-	4,688,324.25	4,688,324.25
应付管理人报酬	-	-	-	94,649.36	94,649.36
应付托管费	-	-	-	9,464.94	9,464.94
应付清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	26,576.12	26,576.12
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	64,078.61	64,078.61
负债总计	-	-	-	4,883,093.28	4,883,093.28
利率敏感度缺口	16,712,651.50	-	-	108,126,524.82	124,839,176.32
上年度末 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 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

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1.若市场利率平行上升或下降 50 个基点		
	2.其他市场变量保持不变		
	3.仅存在公允价值变动对基金资产净值的影响		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	1. 市场利率平行上升 50 个基点	-	-2,208.61
2. 市场利率平行下降 50 个基点	-	2,229.30	

6.4.13.4.2 其他价格风险

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

6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024 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	111,011,536.41	88.92	147,057,748.34	92.92
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	111,011,536.41	88.92	147,057,748.34	92.92

6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1.若对市场价格敏感的权益性投资的市场价格上升或下降 5%		
	2.其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	1. 权益性投资的市场价格上升 5%	5,550,576.82	7,352,887.42
	2. 权益性投资的市场价格下降 5%	-5,550,576.82	-7,352,887.42

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	110,660,726.95	146,512,180.02
第二层次	84,954.97	538,397.71
第三层次	265,854.49	527,401.22
合计	111,011,536.41	147,577,978.95

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内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。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	111,011,536.41	85.58
	其中：股票	111,011,536.41	85.58
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	16,712,651.50	12.88
8	其他各项资产	1,998,081.69	1.54
9	合计	129,722,269.60	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	89,166.00	0.07
B	采矿业	1,085,904.00	0.87
C	制造业	63,198,500.04	50.62
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,863,892.00	1.49
E	建筑业	2,801,467.00	2.24
F	批发和零售业	1,784,604.75	1.43
G	交通运输、仓储和邮政业	1,401,052.00	1.12
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,837,134.91	8.68
J	金融业	1,643,544.70	1.32
K	房地产业	983,004.00	0.79
L	租赁和商务服务业	515,043.00	0.41
M	科学研究和技术服务业	2,241,948.12	1.80
N	水利、环境和公共设施管理业	642,635.00	0.51
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	1,618,816.00	1.30
S	综合	-	-
	合计	90,706,711.52	72.66

7.2.2 期末积极投资按行业分类境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	10,892.00	0.01
B	采矿业	295,990.00	0.24
C	制造业	13,446,173.59	10.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	375,492.20	0.30
E	建筑业	233,856.00	0.19
F	批发和零售业	411,506.00	0.33
G	交通运输、仓储和邮政业	123,200.45	0.10
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,225,246.94	1.78
J	金融业	2,249,318.00	1.80

K	房地产业	38,025.00	0.03
L	租赁和商务服务业	299,364.00	0.24
M	科学研究和技术服务业	414,615.71	0.33
N	水利、环境和公共设施管理业	181,145.00	0.15
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	20,304,824.89	16.26

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	603386	骏亚科技	88,100	1,114,465.00	0.89
2	300369	绿盟科技	122,900	954,933.00	0.76
3	300787	海能实业	68,392	947,229.20	0.76
4	688562	航天软件	47,132	883,253.68	0.71
5	301195	北路智控	24,400	873,520.00	0.70
6	603989	艾华集团	55,600	856,240.00	0.69
7	601311	骆驼股份	93,600	845,208.00	0.68
8	002876	三利谱	31,500	793,485.00	0.64
9	688391	钜泉科技	26,089	774,582.41	0.62
10	300909	汇创达	29,100	768,531.00	0.62
11	002322	理工能科	62,700	758,670.00	0.61
12	688579	山大地纬	65,800	736,302.00	0.59
13	300616	尚品宅配	55,800	734,886.00	0.59
14	002881	美格智能	15,500	719,200.00	0.58
15	603633	徕木股份	82,300	715,187.00	0.57
16	002396	星网锐捷	31,600	709,420.00	0.57
17	300219	鸿利智汇	101,900	684,768.00	0.55
18	301391	卡莱特	15,800	676,240.00	0.54
19	300389	艾比森	58,300	675,114.00	0.54
20	002206	海利得	129,700	662,767.00	0.53
21	603583	捷昌驱动	18,000	657,360.00	0.53

22	688508	芯朋微	11,645	650,023.90	0.52
23	002284	亚太股份	58,300	644,215.00	0.52
24	603966	法兰泰克	68,500	635,680.00	0.51
25	301051	信濠光电	31,300	624,435.00	0.50
26	603876	鼎胜新材	67,400	612,666.00	0.49
27	002637	赞宇科技	59,200	590,816.00	0.47
28	688711	宏微科技	33,372	587,013.48	0.47
29	600268	国电南自	74,600	583,372.00	0.47
30	001287	中电港	30,300	554,793.00	0.44
31	688179	阿拉丁	42,200	536,784.00	0.43
32	603466	风语筑	52,300	527,707.00	0.42
33	300083	创世纪	63,600	522,792.00	0.42
34	001339	智微智能	10,800	521,964.00	0.42
35	301221	光庭信息	10,000	519,700.00	0.42
36	688147	微导纳米	17,218	519,639.24	0.42
37	603612	索通发展	27,800	510,964.00	0.41
38	688089	嘉必优	20,000	503,000.00	0.40
39	002315	焦点科技	11,000	502,590.00	0.40
40	688252	天德钰	20,497	499,716.86	0.40
41	003037	三和管桩	68,200	489,676.00	0.39
42	605198	安德利	12,100	487,751.00	0.39
43	688076	ST 诺泰	13,006	484,083.32	0.39
44	002649	博彦科技	33,200	482,396.00	0.39
45	603766	隆鑫通用	37,700	481,052.00	0.39
46	002428	云南锗业	23,100	459,690.00	0.37
47	000498	山东路桥	76,700	450,996.00	0.36
48	300685	艾德生物	20,600	443,518.00	0.36
49	600742	富维股份	46,500	442,215.00	0.35
50	301080	百普赛斯	5,600	400,568.00	0.32
51	000823	超声电子	33,000	391,050.00	0.31
52	000030	富奥股份	66,100	389,329.00	0.31
53	300358	楚天科技	49,000	382,200.00	0.31
54	600866	星湖科技	54,000	373,140.00	0.30
55	300492	华图山鼎	5,400	366,552.00	0.29
56	002063	远光软件	61,600	366,520.00	0.29
57	002454	松芝股份	46,900	362,068.00	0.29
58	601595	上海电影	11,400	337,896.00	0.27
59	000090	天健集团	92,000	325,680.00	0.26
60	002479	富春环保	63,800	319,638.00	0.26
61	002014	永新股份	26,300	318,756.00	0.26
62	300978	东箭科技	28,500	318,060.00	0.25
63	002061	浙江交科	79,800	316,008.00	0.25
64	002020	京新药业	23,600	307,980.00	0.25

65	600750	江中药业	13,700	299,071.00	0.24
66	002160	常铝股份	68,500	295,920.00	0.24
67	002483	润邦股份	46,500	290,625.00	0.23
68	600063	皖维高新	63,100	288,998.00	0.23
69	002782	可立克	21,400	277,772.00	0.22
70	002606	大连电瓷	30,900	275,628.00	0.22
71	688275	万润新能	6,697	271,563.35	0.22
72	600255	鑫科材料	81,100	270,874.00	0.22
73	600595	中孚实业	61,700	270,246.00	0.22
74	605277	新亚电子	15,000	269,400.00	0.22
75	688025	杰普特	3,661	261,761.50	0.21
76	000680	山推股份	29,000	260,130.00	0.21
77	301332	德尔玛	25,100	257,024.00	0.21
78	002375	亚厦股份	65,400	251,790.00	0.20
79	000411	英特集团	23,300	249,776.00	0.20
80	300241	瑞丰光电	43,700	249,090.00	0.20
81	002083	孚日股份	51,100	246,813.00	0.20
82	002533	金杯电工	25,310	246,519.40	0.20
83	301367	瑞迈特	2,900	243,890.00	0.20
84	600169	太原重工	99,900	241,758.00	0.19
85	002957	科瑞技术	14,600	240,024.00	0.19
86	002540	亚太科技	39,400	229,702.00	0.18
87	000404	长虹华意	32,200	228,620.00	0.18
88	002003	伟星股份	20,800	226,928.00	0.18
89	001208	华菱线缆	21,300	226,845.00	0.18
90	603508	思维列控	8,500	225,080.00	0.18
91	300903	科翔股份	19,300	224,073.00	0.18
92	002911	佛燃能源	21,700	222,642.00	0.18
93	603629	利通电子	9,800	220,500.00	0.18
94	300428	立中集团	12,100	220,462.00	0.18
95	002171	楚江新材	22,600	219,898.00	0.18
96	000928	中钢国际	35,000	219,800.00	0.18
97	600479	千金药业	21,000	218,400.00	0.17
98	002588	史丹利	24,400	214,964.00	0.17
99	000751	锌业股份	68,400	214,776.00	0.17
100	605507	国邦医药	10,800	213,516.00	0.17
101	600894	广日股份	20,300	212,947.00	0.17
102	002543	万和电气	18,900	209,979.00	0.17
103	603992	松霖科技	9,600	209,856.00	0.17
104	601886	江河集团	34,000	209,100.00	0.17
105	300360	炬华科技	13,200	207,900.00	0.17
106	000544	中原环保	25,400	206,502.00	0.17
107	601518	吉林高速	74,900	205,226.00	0.16

108	600064	南京高科	26,600	205,086.00	0.16
109	600757	长江传媒	21,900	203,232.00	0.16
110	605305	中际联合	7,300	202,794.00	0.16
111	002948	青岛银行	40,700	202,686.00	0.16
112	601326	秦港股份	62,600	202,198.00	0.16
113	601860	紫金银行	67,100	201,300.00	0.16
114	600682	南京新百	29,900	200,928.00	0.16
115	600908	无锡银行	31,800	200,658.00	0.16
116	000603	盛达资源	13,400	199,526.00	0.16
117	000727	冠捷科技	82,000	199,260.00	0.16
118	002376	新北洋	25,600	198,912.00	0.16
119	002839	张家港行	44,100	198,450.00	0.16
120	601528	瑞丰银行	34,200	198,018.00	0.16
121	600020	中原高速	41,300	197,414.00	0.16
122	300232	洲明科技	27,200	196,928.00	0.16
123	603323	苏农银行	35,070	196,742.70	0.16
124	601963	重庆银行	18,100	196,566.00	0.16
125	002807	江阴银行	41,200	195,700.00	0.16
126	300161	华中数控	7,200	190,728.00	0.15
127	300596	利安隆	6,600	189,882.00	0.15
128	300702	天宇股份	8,000	186,080.00	0.15
129	002539	云图控股	19,800	185,724.00	0.15
130	002668	TCL 智家	18,800	183,676.00	0.15
131	603997	继峰股份	13,900	181,256.00	0.15
132	600248	陕建股份	46,500	177,165.00	0.14
133	301150	中一科技	8,220	176,401.20	0.14
134	300893	松原安全	7,080	173,601.60	0.14
135	688581	安杰思	2,664	172,707.12	0.14
136	000561	烽火电子	16,000	171,680.00	0.14
136	002011	盾安环境	14,800	171,680.00	0.14
137	300982	苏文电能	9,500	170,905.00	0.14
138	000719	中原传媒	13,700	170,017.00	0.14
139	002400	省广集团	22,200	169,608.00	0.14
140	000758	中色股份	33,500	168,505.00	0.13
141	600594	益佰制药	43,400	167,090.00	0.13
141	688663	新风光	6,200	167,090.00	0.13
142	603611	诺力股份	7,700	165,858.00	0.13
143	603103	横店影视	10,300	165,315.00	0.13
144	688377	迪威尔	6,857	163,676.59	0.13
145	300365	恒华科技	24,100	158,819.00	0.13
146	603727	博迈科	10,800	158,004.00	0.13
147	300327	中颖电子	6,500	157,430.00	0.13
148	688636	智明达	4,658	157,393.82	0.13

149	601107	四川成渝	26,100	157,122.00	0.13
150	603519	立霸股份	12,900	156,864.00	0.13
151	301369	联动科技	2,900	155,759.00	0.12
152	002562	兄弟科技	31,600	154,208.00	0.12
153	002245	蔚蓝锂芯	12,000	153,960.00	0.12
154	001301	尚太科技	3,100	151,156.00	0.12
155	600812	华北制药	24,300	150,174.00	0.12
156	603698	航天工程	8,500	149,770.00	0.12
157	000049	德赛电池	6,500	147,940.00	0.12
158	300206	理邦仪器	12,300	147,846.00	0.12
159	300048	合康新能	25,100	147,337.00	0.12
160	002845	同兴达	10,300	147,290.00	0.12
161	002045	国光电器	9,200	146,832.00	0.12
162	603153	上海建科	8,300	146,329.00	0.12
163	603588	高能环境	25,900	146,076.00	0.12
164	002967	广电计量	8,300	145,997.00	0.12
165	002768	国恩股份	5,500	145,255.00	0.12
166	300041	回天新材	15,300	144,126.00	0.12
167	002057	中钢天源	15,500	143,995.00	0.12
168	002970	锐明技术	2,900	143,260.00	0.11
169	300415	伊之密	7,100	143,065.00	0.11
170	603618	杭电股份	23,300	142,130.00	0.11
171	000534	万泽股份	9,500	141,740.00	0.11
172	600496	精工钢构	44,100	141,120.00	0.11
173	000957	中通客车	12,900	140,997.00	0.11
174	002332	仙琚制药	15,300	140,301.00	0.11
175	300057	万顺新材	25,600	139,520.00	0.11
176	600710	苏美达	14,500	139,345.00	0.11
177	301328	维峰电子	3,300	139,095.00	0.11
178	002263	大东南	33,500	138,355.00	0.11
179	002081	金螳螂	40,000	137,200.00	0.11
180	300447	全信股份	8,700	136,329.00	0.11
181	002455	百川股份	18,200	136,136.00	0.11
182	603058	永吉股份	15,500	135,470.00	0.11
183	688478	晶升股份	4,400	134,640.00	0.11
184	000657	中钨高新	11,300	134,018.00	0.11
185	688499	利元亨	3,200	133,152.00	0.11
186	600458	时代新材	9,700	133,084.00	0.11
187	301061	匠心家居	1,696	131,507.84	0.11
188	300648	星云股份	3,800	131,328.00	0.11
189	301550	斯菱股份	1,460	130,363.40	0.10
190	301345	涛涛车业	1,200	129,720.00	0.10
191	002578	闽发铝业	38,700	129,645.00	0.10

192	603530	神马电力	5,000	129,600.00	0.10
193	603197	保隆科技	3,300	128,931.00	0.10
194	603171	税友股份	3,000	128,730.00	0.10
195	000913	钱江摩托	8,500	127,500.00	0.10
196	300821	东岳硅材	16,200	127,332.00	0.10
197	000029	深深房 A	6,700	126,094.00	0.10
198	301215	中汽股份	20,100	124,620.00	0.10
199	600201	生物股份	15,500	124,310.00	0.10
200	600301	华锡有色	6,200	123,814.00	0.10
201	688106	金宏气体	6,890	123,262.10	0.10
202	600531	豫光金铅	15,900	123,066.00	0.10
203	000685	中山公用	14,000	122,920.00	0.10
204	002545	东方铁塔	13,800	122,682.00	0.10
205	003019	宸展光电	3,500	122,605.00	0.10
206	603239	浙江仙通	8,100	122,391.00	0.10
207	603567	珍宝岛	10,400	122,200.00	0.10
208	002988	豪美新材	3,200	121,600.00	0.10
209	600728	佳都科技	22,300	121,535.00	0.10
210	603187	海容冷链	10,300	121,128.00	0.10
211	300772	运达股份	9,400	121,072.00	0.10
212	688128	中国电研	4,941	121,054.50	0.10
213	002412	汉森制药	19,400	120,668.00	0.10
214	000900	现代投资	28,400	120,132.00	0.10
215	002166	莱茵生物	15,500	119,970.00	0.10
216	002267	陕天然气	15,800	119,606.00	0.10
217	603919	金徽酒	6,600	119,460.00	0.10
218	600874	创业环保	20,000	119,400.00	0.10
219	300039	上海凯宝	19,700	119,382.00	0.10
220	601827	三峰环境	14,200	119,280.00	0.10
221	600993	马应龙	4,200	118,776.00	0.10
222	002864	盘龙药业	4,200	118,734.00	0.10
223	002116	中国海诚	11,600	118,668.00	0.10
224	600351	亚宝药业	19,500	118,365.00	0.09
225	000650	仁和药业	21,800	118,156.00	0.09
226	301511	德福科技	5,700	117,990.00	0.09
227	000848	承德露露	12,900	117,777.00	0.09
228	002728	特一药业	14,000	117,740.00	0.09
229	600713	南京医药	23,200	117,392.00	0.09
230	000885	城发环境	8,800	117,216.00	0.09
231	301327	华宝新能	2,280	117,100.80	0.09
232	600269	赣粤高速	23,100	116,886.00	0.09
233	688166	博瑞医药	2,167	116,389.57	0.09
234	688319	欧林生物	7,400	115,884.00	0.09

235	600285	羚锐制药	5,100	115,617.00	0.09
236	688502	茂莱光学	400	115,064.00	0.09
237	300228	富瑞特装	14,700	114,513.00	0.09
238	301004	嘉益股份	1,700	112,591.00	0.09
239	600035	楚天高速	26,500	112,360.00	0.09
240	603699	纽威股份	3,600	112,212.00	0.09
241	002925	盈趣科技	6,200	111,476.00	0.09
242	000700	模塑科技	14,200	111,470.00	0.09
243	300662	科锐国际	3,700	109,927.00	0.09
244	300990	同飞股份	2,200	109,780.00	0.09
245	002212	天融信	14,200	109,340.00	0.09
246	688093	世华科技	3,507	108,892.35	0.09
247	600459	贵研铂业	7,000	108,570.00	0.09
248	002226	江南化工	18,700	108,460.00	0.09
249	002658	雪迪龙	13,800	108,054.00	0.09
250	301031	中熔电气	1,336	106,412.40	0.09
251	688131	皓元医药	2,200	106,370.00	0.09
252	000931	中关村	19,500	105,885.00	0.08
253	603421	鼎信通讯	15,700	105,661.00	0.08
254	301408	华人健康	6,900	104,949.00	0.08
255	300443	金雷股份	4,600	103,960.00	0.08
256	300134	大富科技	8,500	103,955.00	0.08
257	300850	新强联	2,900	103,878.00	0.08
258	002139	拓邦股份	7,500	103,575.00	0.08
259	300579	数字认证	3,000	103,530.00	0.08
260	300188	国投智能	7,500	103,500.00	0.08
261	600218	全柴动力	11,500	103,155.00	0.08
262	688208	道通科技	3,368	103,060.80	0.08
263	002075	沙钢股份	17,700	103,014.00	0.08
264	600552	凯盛科技	9,100	102,830.00	0.08
265	000551	创元科技	8,000	102,800.00	0.08
266	002026	山东威达	8,400	102,060.00	0.08
267	600320	振华重工	23,300	101,821.00	0.08
268	601208	东材科技	10,700	101,436.00	0.08
269	002587	奥拓电子	15,700	101,265.00	0.08
270	001359	平安电工	2,900	101,152.00	0.08
271	002815	崇达技术	8,900	100,837.00	0.08
272	688685	迈信林	1,800	100,530.00	0.08
273	603337	杰克股份	2,800	100,464.00	0.08
274	301162	国能日新	1,940	100,259.20	0.08
275	002761	浙江建投	11,300	100,231.00	0.08
276	600618	氯碱化工	10,400	100,152.00	0.08
277	603312	西典新能	2,700	99,009.00	0.08

278	002918	蒙娜丽莎	11,900	98,770.00	0.08
279	300882	万胜智能	5,500	98,670.00	0.08
280	600389	江山股份	5,300	98,580.00	0.08
281	300737	科顺股份	20,400	98,328.00	0.08
282	002302	西部建设	16,900	98,020.00	0.08
283	601126	四方股份	6,000	97,620.00	0.08
284	002959	小熊电器	2,100	97,524.00	0.08
285	688010	福光股份	3,136	97,341.44	0.08
286	300523	辰安科技	4,200	96,810.00	0.08
287	603111	康尼机电	14,700	96,726.00	0.08
288	002293	罗莱生活	11,000	96,140.00	0.08
289	600817	宇通重工	8,100	95,904.00	0.08
290	002275	桂林三金	6,700	95,877.00	0.08
291	002096	易普力	7,700	95,557.00	0.08
292	688233	神工股份	3,000	95,310.00	0.08
293	000811	冰轮环境	9,700	95,060.00	0.08
294	300479	神思电子	4,300	94,901.00	0.08
295	688097	博众精工	3,400	94,894.00	0.08
296	600475	华光环能	9,100	94,822.00	0.08
297	688311	盟升电子	2,200	94,710.00	0.08
298	301291	明阳电气	2,300	94,645.00	0.08
299	688523	航天环宇	4,400	94,644.00	0.08
300	600502	安徽建工	20,100	94,470.00	0.08
301	301285	鸿日达	2,900	94,105.00	0.08
302	688246	嘉和美康	3,200	94,048.00	0.08
303	300303	聚飞光电	14,800	93,832.00	0.08
304	300593	新雷能	7,000	93,800.00	0.08
305	688207	格灵深瞳	6,200	93,620.00	0.07
306	301117	佳缘科技	4,100	92,865.00	0.07
307	688590	新致软件	4,515	92,738.10	0.07
308	688586	江航装备	8,200	92,250.00	0.07
309	688133	泰坦科技	4,000	92,080.00	0.07
310	301488	豪恩汽电	1,300	92,040.00	0.07
311	002036	联创电子	8,500	91,885.00	0.07
312	600810	神马股份	9,800	91,826.00	0.07
313	688533	上声电子	3,406	91,723.58	0.07
314	600331	宏达股份	10,500	91,665.00	0.07
315	688696	极米科技	800	91,488.00	0.07
316	688378	奥来德	5,412	91,192.20	0.07
317	002283	天润工业	15,300	91,188.00	0.07
318	300456	赛微电子	5,300	91,107.00	0.07
319	002609	捷顺科技	7,800	91,104.00	0.07
320	688105	诺唯赞	4,024	91,063.12	0.07

321	688087	英科再生	3,543	91,055.10	0.07
322	688150	莱特光电	3,683	91,043.76	0.07
323	688519	南亚新材	2,031	90,988.80	0.07
324	301268	铭利达	4,900	90,895.00	0.07
325	688410	山外山	6,400	90,880.00	0.07
326	002328	新朋股份	15,600	90,792.00	0.07
327	002225	濮耐股份	18,300	90,585.00	0.07
328	301270	汉仪股份	1,900	90,554.00	0.07
329	603325	博隆技术	1,000	90,290.00	0.07
330	301266	宇邦新材	2,700	90,261.00	0.07
331	688697	纽威数控	6,760	90,178.40	0.07
332	688063	派能科技	2,000	90,160.00	0.07
333	688195	腾景科技	2,000	90,000.00	0.07
334	000922	佳电股份	7,900	89,902.00	0.07
335	688152	麒麟信安	1,918	89,877.48	0.07
336	002334	英威腾	11,300	89,609.00	0.07
337	600400	红豆股份	39,300	89,604.00	0.07
338	688006	杭可科技	4,588	89,466.00	0.07
339	603878	武进不锈	16,500	89,430.00	0.07
340	688238	和元生物	14,400	89,280.00	0.07
341	300236	上海新阳	2,300	89,240.00	0.07
342	300951	博硕科技	2,600	89,180.00	0.07
343	300560	中富通	6,600	89,166.00	0.07
343	600467	好当家	38,600	89,166.00	0.07
344	002303	美盈森	25,000	89,000.00	0.07
345	601388	怡球资源	35,300	88,956.00	0.07
346	605319	无锡振华	2,600	88,816.00	0.07
347	002534	西子洁能	7,900	88,796.00	0.07
348	601616	广电电气	22,900	88,623.00	0.07
349	002662	峰璟股份	25,900	88,578.00	0.07
350	688416	恒烁股份	2,200	88,572.00	0.07
351	300259	新天科技	24,900	88,395.00	0.07
352	600609	金杯汽车	16,700	88,343.00	0.07
353	002953	日丰股份	8,500	88,230.00	0.07
354	688596	正帆科技	2,600	88,192.00	0.07
355	301456	盘古智能	3,600	88,056.00	0.07
356	000926	福星股份	41,100	87,954.00	0.07
357	000718	苏宁环球	40,500	87,885.00	0.07
358	000690	宝新能源	19,300	87,815.00	0.07
359	301152	天力锂能	3,000	87,780.00	0.07
360	603057	紫燕食品	4,000	87,440.00	0.07
361	688588	凌志软件	6,000	87,420.00	0.07
362	002146	荣盛发展	63,800	87,406.00	0.07

363	603701	德宏股份	5,000	87,400.00	0.07
364	600162	香江控股	53,600	87,368.00	0.07
365	600935	华塑股份	36,100	87,362.00	0.07
366	301102	兆讯传媒	8,000	87,360.00	0.07
367	301168	通灵股份	2,500	87,275.00	0.07
368	300239	东宝生物	14,700	87,171.00	0.07
369	605286	同力日升	2,200	87,164.00	0.07
370	002516	旷达科技	16,900	87,035.00	0.07
371	000422	湖北宜化	7,300	87,016.00	0.07
372	002390	信邦制药	25,000	87,000.00	0.07
373	688390	固德威	2,000	86,900.00	0.07
374	688733	壹石通	4,583	86,802.02	0.07
375	603995	甬金股份	4,900	86,632.00	0.07
376	600888	新疆众和	12,700	86,614.00	0.07
377	000517	荣安地产	47,800	86,518.00	0.07
378	300455	航天智装	6,000	86,400.00	0.07
378	600055	万东医疗	5,000	86,400.00	0.07
379	600512	腾达建设	38,200	86,332.00	0.07
380	000897	津滨发展	37,500	86,250.00	0.07
381	603368	柳药集团	5,100	86,241.00	0.07
381	603801	志邦家居	8,900	86,241.00	0.07
382	002538	司尔特	16,700	86,005.00	0.07
383	301339	通行宝	5,020	85,992.60	0.07
384	603730	岱美股份	15,090	85,862.10	0.07
385	600461	洪城环境	8,900	85,796.00	0.07
386	003038	鑫铂股份	4,400	85,756.00	0.07
387	603566	普莱柯	6,300	85,743.00	0.07
388	600433	冠豪高新	27,900	85,653.00	0.07
389	600163	中闽能源	16,700	85,504.00	0.07
390	000552	甘肃能化	34,600	85,462.00	0.07
391	600273	嘉化能源	10,100	85,446.00	0.07
392	601339	百隆东方	18,100	85,432.00	0.07
393	001288	运机集团	4,100	85,403.00	0.07
394	603067	振华股份	5,600	85,344.00	0.07
395	002749	国光股份	5,700	85,044.00	0.07
396	600780	通宝能源	14,300	84,799.00	0.07
397	002997	瑞鹄模具	2,300	84,755.00	0.07
398	600179	安通控股	30,700	84,732.00	0.07
399	601101	昊华能源	11,700	84,708.00	0.07
400	605056	咸亨国际	5,500	84,700.00	0.07
401	603013	亚普股份	4,900	84,672.00	0.07
402	300582	英飞特	6,600	84,612.00	0.07
403	300109	新开源	5,100	84,609.00	0.07

404	000923	河钢资源	6,100	84,424.00	0.07
405	002367	康力电梯	12,000	84,360.00	0.07
406	300105	龙源技术	10,900	84,039.00	0.07
407	600106	重庆路桥	13,700	83,981.00	0.07
408	000682	东方电子	8,200	83,968.00	0.07
409	603230	内蒙新华	6,500	83,915.00	0.07
410	603105	芯能科技	10,200	83,844.00	0.07
411	600640	国脉文化	6,900	83,628.00	0.07
412	600229	城市传媒	11,700	83,421.00	0.07
413	603135	中重科技	8,400	83,328.00	0.07
414	603520	司太立	8,500	83,300.00	0.07
415	300181	佐力药业	4,800	83,184.00	0.07
416	002996	顺博合金	11,300	83,168.00	0.07
417	603668	天马科技	6,300	83,034.00	0.07
418	000672	上峰水泥	10,500	82,950.00	0.07
419	688226	威腾电气	3,170	82,863.80	0.07
420	603381	永臻股份	3,700	82,843.00	0.07
421	600138	中青旅	8,400	82,740.00	0.07
422	600058	五矿发展	10,700	82,711.00	0.07
423	002441	众业达	9,100	82,537.00	0.07
424	002913	奥士康	2,800	82,348.00	0.07
425	603301	振德医疗	3,900	82,329.00	0.07
426	603050	科林电气	5,000	82,300.00	0.07
427	688127	蓝特光学	3,200	82,272.00	0.07
428	603357	设计总院	9,500	82,270.00	0.07
429	688789	宏华数科	1,125	82,170.00	0.07
430	002233	塔牌集团	11,100	82,140.00	0.07
431	000962	东方钨业	5,000	82,050.00	0.07
432	600639	浦东金桥	7,700	81,543.00	0.07
433	601163	三角轮胎	5,800	81,490.00	0.07
434	688146	中船特气	2,816	81,410.56	0.07
435	002174	游族网络	6,700	81,271.00	0.07
436	600758	辽宁能源	21,700	81,158.00	0.07
437	002955	鸿合科技	3,300	81,081.00	0.06
438	688029	南微医学	1,200	81,060.00	0.06
439	000600	建投能源	11,700	80,847.00	0.06
440	601033	永兴股份	5,100	80,631.00	0.06
441	600267	海正药业	8,700	80,475.00	0.06
442	002847	盐津铺子	1,000	80,400.00	0.06
443	688553	汇宇制药	4,910	79,983.90	0.06
444	300770	新媒股份	2,000	79,980.00	0.06
445	688658	悦康药业	4,200	79,968.00	0.06
446	002947	恒铭达	2,400	79,656.00	0.06

447	600694	大商股份	4,265	79,115.75	0.06
448	002895	川恒股份	3,500	78,960.00	0.06
449	688059	华锐精密	1,680	78,556.80	0.06
450	603393	新天然气	2,700	78,165.00	0.06
451	002759	天际股份	7,600	76,380.00	0.06
452	300363	博腾股份	4,400	75,152.00	0.06
453	688313	仕佳光子	1,941	73,855.05	0.06
454	688518	联赢激光	3,352	68,347.28	0.05
455	300620	光库科技	1,400	65,954.00	0.05
456	600662	外服控股	12,800	65,408.00	0.05
457	601137	博威合金	3,500	62,265.00	0.05
458	000968	蓝焰控股	7,700	55,825.00	0.04
459	301312	智立方	1,400	55,580.00	0.04
460	300299	富春股份	7,000	53,760.00	0.04
461	300533	冰川网络	1,600	53,456.00	0.04
462	600643	爱建集团	7,200	53,424.00	0.04
463	688739	成大生物	2,000	52,800.00	0.04
464	000555	神州信息	3,700	52,614.00	0.04
465	300035	中科电气	3,100	52,328.00	0.04
466	301251	威尔高	1,300	50,973.00	0.04
467	300870	欧陆通	400	50,600.00	0.04
468	300976	达瑞电子	1,000	49,790.00	0.04
469	603929	亚翔集成	1,400	49,140.00	0.04
470	688800	瑞可达	970	47,724.00	0.04
471	300133	华策影视	6,300	47,313.00	0.04
472	002111	威海广泰	4,400	47,212.00	0.04
473	002184	海得控制	3,600	47,160.00	0.04
474	002626	金达威	2,300	47,058.00	0.04
475	002208	合肥城建	6,700	46,900.00	0.04
476	000821	京山轻机	4,000	46,360.00	0.04
477	600210	紫江企业	6,700	45,761.00	0.04
478	002440	闰土股份	6,000	45,720.00	0.04
479	300684	中石科技	1,900	45,372.00	0.04
480	002912	中新赛克	1,900	45,315.00	0.04
481	000407	胜利股份	13,200	44,880.00	0.04
482	002095	生意宝	2,200	44,616.00	0.04
483	300768	迪普科技	2,600	44,590.00	0.04
484	000655	金岭矿业	6,300	44,478.00	0.04
485	300962	中金辐照	2,500	44,325.00	0.04
486	300825	阿尔特	4,100	44,321.00	0.04
487	300355	蒙草生态	10,400	44,200.00	0.04
488	000059	华锦股份	8,200	44,198.00	0.04
489	603085	天成自控	3,800	43,738.00	0.04

490	000791	甘肃能源	6,800	43,384.00	0.03
491	601133	柏诚股份	3,400	43,214.00	0.03
492	600428	中远海特	6,900	43,125.00	0.03
493	002239	奥特佳	14,800	42,920.00	0.03
494	300598	诚迈科技	1,000	42,550.00	0.03
495	000756	新华制药	2,800	41,776.00	0.03
496	300785	值得买	1,300	41,379.00	0.03
497	688155	先惠技术	800	41,296.00	0.03
498	300172	中电环保	7,500	41,250.00	0.03
499	300036	超图软件	2,700	41,202.00	0.03
500	603738	泰晶科技	2,800	41,104.00	0.03
501	605399	晨光新材	3,200	40,896.00	0.03
502	000788	北大医药	6,400	40,640.00	0.03
503	603136	天目湖	3,000	40,410.00	0.03
504	603209	兴通股份	2,600	40,352.00	0.03
505	688668	鼎通科技	644	40,224.24	0.03
506	002962	五方光电	2,600	39,832.00	0.03
507	300406	九强生物	2,800	39,620.00	0.03
508	603165	荣晟环保	3,500	39,515.00	0.03
509	002613	北玻股份	10,700	39,483.00	0.03
510	002577	雷柏科技	1,900	39,368.00	0.03
511	600648	外高桥	3,600	39,348.00	0.03
512	601609	金田股份	5,600	39,256.00	0.03
513	002296	辉煌科技	3,500	39,025.00	0.03
514	002783	凯龙股份	4,500	38,835.00	0.03
515	002462	嘉事堂	2,900	38,773.00	0.03
516	603010	万盛股份	3,900	38,766.00	0.03
517	002053	云南能投	3,500	38,535.00	0.03
518	601096	宏盛华源	9,200	38,088.00	0.03
519	300634	彩讯股份	1,400	37,940.00	0.03
520	000950	重药控股	7,600	37,924.00	0.03
521	600587	新华医疗	2,500	37,850.00	0.03
522	300110	华仁药业	11,700	37,791.00	0.03
523	600033	福建高速	10,600	37,524.00	0.03
524	000521	长虹美菱	5,400	37,476.00	0.03
525	600987	航民股份	5,300	37,471.00	0.03
526	002675	东诚药业	2,600	37,414.00	0.03
527	688595	芯海科技	1,000	37,390.00	0.03
528	600252	中恒集团	14,700	37,191.00	0.03
529	600284	浦东建设	5,600	36,960.00	0.03
530	000531	穗恒运 A	6,000	36,900.00	0.03
531	600211	西藏药业	1,000	36,820.00	0.03
532	600572	康恩贝	8,400	36,792.00	0.03

533	603358	华达科技	1,100	36,421.00	0.03
534	603219	富佳股份	2,500	36,275.00	0.03
535	603896	寿仙谷	1,700	36,261.00	0.03
536	301377	鼎泰高科	1,000	35,960.00	0.03
537	003006	百亚股份	1,300	35,594.00	0.03
538	001309	德明利	300	35,502.00	0.03
539	605376	博迁新材	900	34,497.00	0.03
540	300255	常山药业	700	32,627.00	0.03
541	600526	菲达环保	6,600	31,680.00	0.03
542	603203	快克智能	1,100	27,357.00	0.02
543	688095	福昕软件	402	27,299.82	0.02
544	300482	万孚生物	1,200	25,620.00	0.02
545	300510	金冠股份	5,500	25,190.00	0.02
546	688326	经纬恒润	200	17,848.00	0.01
547	688368	晶丰明源	188	16,512.04	0.01
548	301302	华如科技	600	16,506.00	0.01
549	600523	贵航股份	1,100	16,269.00	0.01
550	300887	谱尼测试	1,800	15,714.00	0.01
551	688209	英集芯	800	14,776.00	0.01
552	002615	哈尔斯	1,700	14,297.00	0.01
553	300393	中来股份	2,400	13,824.00	0.01
554	002051	中工国际	1,600	13,808.00	0.01
555	300762	上海瀚讯	600	13,578.00	0.01
556	002706	良信股份	1,500	13,365.00	0.01
557	600567	山鹰国际	6,900	13,110.00	0.01
558	603270	金帝股份	500	12,845.00	0.01
559	688550	瑞联新材	287	12,343.87	0.01
560	002869	金溢科技	500	11,965.00	0.01
561	002695	煌上煌	1,200	11,280.00	0.01
562	688336	三生国健	185	10,034.40	0.01
563	300570	太辰光	100	9,638.00	0.01
564	300201	海伦哲	1,700	9,367.00	0.01
565	300101	振芯科技	400	9,052.00	0.01
566	002067	景兴纸业	2,100	8,106.00	0.01
567	688591	泰凌微	157	7,520.30	0.01
568	688392	骄成超声	108	7,358.04	0.01
569	688699	明微电子	189	6,119.82	0.00
570	688138	清溢光电	199	5,410.81	0.00
571	300727	润禾材料	60	1,577.40	0.00
572	300791	仙乐健康	65	1,547.65	0.00
573	300705	九典制药	60	934.20	0.00
574	605377	华旺科技	96	845.76	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产 净值比例 （%）
1	688296	和达科技	55,444	727,979.72	0.58
2	688450	光格科技	26,361	696,457.62	0.56
3	688479	友车科技	36,350	687,015.00	0.55
4	603236	移远通信	7,100	609,180.00	0.49
5	603499	翔港科技	32,480	535,595.20	0.43
6	000977	浪潮信息	7,500	381,600.00	0.31
7	603987	康德莱	48,100	370,370.00	0.30
8	600219	南山铝业	77,100	295,293.00	0.24
9	688060	云涌科技	7,944	290,670.96	0.23
10	600498	烽火通信	13,000	273,390.00	0.22
11	000415	渤海租赁	80,200	267,066.00	0.21
12	688198	佰仁医疗	2,591	266,069.79	0.21
13	688334	西高院	14,124	242,650.32	0.19
14	000425	徐工机械	31,000	240,870.00	0.19
15	603129	春风动力	1,000	216,500.00	0.17
16	605365	立达信	14,600	215,058.00	0.17
17	605567	春雪食品	21,000	214,830.00	0.17
18	688114	华大智造	3,200	207,456.00	0.17
19	601166	兴业银行	8,700	203,058.00	0.16
20	601169	北京银行	29,600	202,168.00	0.16
21	601998	中信银行	23,500	199,750.00	0.16
22	000333	美的集团	2,600	187,720.00	0.15
23	300196	长海股份	14,100	172,020.00	0.14
24	600022	山东钢铁	124,700	162,110.00	0.13
25	603296	华勤技术	2,000	161,360.00	0.13
26	601818	光大银行	38,800	161,020.00	0.13
27	600919	江苏银行	12,900	154,026.00	0.12
28	300627	华测导航	4,280	149,800.00	0.12
29	002230	科大讯飞	3,100	148,428.00	0.12
30	002056	横店东磁	10,400	147,160.00	0.12
31	001238	浙江正特	3,700	145,040.00	0.12
32	002385	大北农	35,800	144,632.00	0.12
33	000039	中集集团	18,300	143,838.00	0.12
34	002645	华宏科技	15,800	143,464.00	0.11
35	603309	维力医疗	10,700	136,104.00	0.11
36	603551	奥普科技	12,100	132,979.00	0.11

37	002102	能特科技	41,600	131,456.00	0.11
38	002273	水晶光电	6,300	125,811.00	0.10
39	603071	物产环能	9,800	124,754.00	0.10
40	605183	确成股份	7,100	124,250.00	0.10
41	603515	欧普照明	6,900	124,131.00	0.10
42	601186	中国铁建	15,400	123,354.00	0.10
43	603075	热威股份	6,100	121,939.00	0.10
44	002788	鹭燕医药	14,200	121,694.00	0.10
45	002266	浙富控股	39,500	121,660.00	0.10
46	601997	贵阳银行	19,400	121,056.00	0.10
47	601009	南京银行	10,300	119,686.00	0.10
48	600488	津药药业	28,500	118,845.00	0.10
49	601665	齐鲁银行	18,800	118,816.00	0.10
50	688329	艾隆科技	6,023	115,882.52	0.09
51	300502	新易盛	900	114,318.00	0.09
52	601077	渝农商行	15,900	113,526.00	0.09
53	002395	双象股份	6,400	113,280.00	0.09
54	002185	华天科技	11,100	112,110.00	0.09
55	300779	惠城环保	600	107,094.00	0.09
56	002585	双星新材	19,200	104,832.00	0.08
57	603486	科沃斯	1,800	104,814.00	0.08
58	600876	凯盛新能	9,900	104,445.00	0.08
59	002705	新宝股份	7,100	104,370.00	0.08
60	300732	设研院	14,400	103,968.00	0.08
61	605080	浙江自然	3,700	102,860.00	0.08
62	603916	苏博特	11,200	101,472.00	0.08
63	001308	康冠科技	4,400	99,528.00	0.08
64	600782	新钢股份	28,100	99,474.00	0.08
65	002624	完美世界	6,500	98,605.00	0.08
66	600075	新疆天业	23,200	98,136.00	0.08
67	688236	春立医疗	5,200	96,668.00	0.08
68	601117	中国化学	12,600	96,642.00	0.08
69	002597	金禾实业	4,100	96,555.00	0.08
70	002001	新和成	4,500	95,715.00	0.08
71	002595	豪迈科技	1,600	94,752.00	0.08
72	301362	民爆光电	2,300	93,863.00	0.08
73	688157	松井股份	2,318	92,441.84	0.07
74	688371	菲沃泰	5,576	92,338.56	0.07
75	688183	生益电子	1,800	92,160.00	0.07
76	002487	大金重工	2,800	92,120.00	0.07
77	600469	风神股份	16,100	90,965.00	0.07
78	603444	吉比特	300	90,585.00	0.07
79	601899	紫金矿业	4,600	89,700.00	0.07

80	000807	云铝股份	5,600	89,488.00	0.07
81	688606	奥泰生物	1,331	89,443.20	0.07
82	688420	美腾科技	3,715	88,565.60	0.07
83	300308	中际旭创	600	87,516.00	0.07
84	002532	天山铝业	10,400	86,424.00	0.07
85	601319	中国人保	9,900	86,229.00	0.07
86	001210	金房能源	6,280	85,973.20	0.07
87	601600	中国铝业	12,200	85,888.00	0.07
88	002871	伟隆股份	7,700	85,701.00	0.07
89	000001	平安银行	7,100	85,697.00	0.07
90	002463	沪电股份	2,000	85,160.00	0.07
91	600582	天地科技	14,200	85,058.00	0.07
92	301181	标榜股份	3,400	84,252.00	0.07
93	603829	洛凯股份	4,900	83,888.00	0.07
94	601318	中国平安	1,500	83,220.00	0.07
95	601658	邮储银行	15,200	83,144.00	0.07
96	600547	山东黄金	2,600	83,018.00	0.07
97	600741	华域汽车	4,700	82,955.00	0.07
98	000705	浙江震元	9,800	82,810.00	0.07
99	603053	成都燃气	8,600	82,646.00	0.07
100	000789	万年青	15,100	82,446.00	0.07
101	600926	杭州银行	4,900	82,418.00	0.07
102	600380	健康元	7,400	81,622.00	0.07
103	600015	华夏银行	10,300	81,473.00	0.07
104	600535	天士力	5,200	81,380.00	0.07
105	000893	亚钾国际	2,700	81,378.00	0.07
106	601225	陕西煤业	4,200	80,808.00	0.06
107	688312	燕麦科技	3,348	80,452.44	0.06
108	600222	太龙药业	14,300	79,937.00	0.06
109	601988	中国银行	14,200	79,804.00	0.06
110	600016	民生银行	16,700	79,325.00	0.06
111	601577	长沙银行	7,900	78,526.00	0.06
112	601939	建设银行	8,300	78,352.00	0.06
113	300207	欣旺达	3,800	76,228.00	0.06
114	688018	乐鑫科技	500	73,050.00	0.06
115	603277	银都股份	4,475	71,600.00	0.06
116	002980	华盛昌	2,920	58,925.60	0.05
117	000938	紫光股份	2,300	55,177.00	0.04
118	600066	宇通客车	1,900	47,234.00	0.04
119	002835	同为股份	2,500	46,925.00	0.04
120	300187	永清环保	9,200	46,920.00	0.04
121	300601	康泰生物	3,000	45,570.00	0.04
122	000063	中兴通讯	1,400	45,486.00	0.04

123	300866	安克创新	400	45,440.00	0.04
124	000156	华数传媒	5,700	45,258.00	0.04
125	002841	视源股份	1,300	44,980.00	0.04
126	000157	中联重科	6,200	44,826.00	0.04
127	000877	天山股份	9,600	44,544.00	0.04
128	300086	康芝药业	8,200	44,526.00	0.04
129	000726	鲁泰 A	7,000	44,380.00	0.04
130	300418	昆仑万维	1,300	43,719.00	0.04
131	002648	卫星化学	2,500	43,325.00	0.03
132	605268	王力安防	4,300	43,258.00	0.03
133	601992	金隅集团	28,300	43,016.00	0.03
134	300677	英科医疗	1,800	42,624.00	0.03
135	603132	金徽股份	3,200	42,464.00	0.03
136	002202	金风科技	4,100	42,025.00	0.03
137	002623	亚玛顿	2,600	41,990.00	0.03
138	605318	法狮龙	1,500	41,775.00	0.03
139	688551	科威尔	1,400	41,146.00	0.03
140	600854	春兰股份	7,900	41,080.00	0.03
141	000554	泰山石油	5,800	41,006.00	0.03
142	603860	中公高科	1,300	40,456.00	0.03
143	300823	建科智能	2,700	40,203.00	0.03
144	603848	好太太	2,600	40,040.00	0.03
145	301163	宏德股份	1,600	40,000.00	0.03
146	301043	绿岛风	1,300	39,988.00	0.03
147	600207	安彩高科	8,400	39,984.00	0.03
148	688317	之江生物	2,200	39,644.00	0.03
149	600096	云天化	1,800	39,546.00	0.03
150	600031	三一重工	2,200	39,490.00	0.03
151	300375	鹏翎股份	7,700	39,347.00	0.03
152	605169	洪通燃气	3,700	39,331.00	0.03
153	300994	久祺股份	2,500	39,100.00	0.03
154	600704	物产中大	7,400	38,998.00	0.03
155	301234	五洲医疗	1,300	38,883.00	0.03
156	601368	绿城水务	8,000	38,800.00	0.03
157	603689	皖天然气	4,600	38,732.00	0.03
158	003025	思进智能	2,860	38,724.40	0.03
159	688067	爱威科技	1,800	38,718.00	0.03
160	600956	新天绿能	5,000	38,600.00	0.03
161	601968	宝钢包装	8,000	38,160.00	0.03
162	000011	深物业 A	4,500	38,025.00	0.03
163	600928	西安银行	9,700	38,024.00	0.03
164	600897	厦门空港	2,600	37,934.00	0.03
165	603898	好莱客	3,400	37,366.00	0.03

166	002857	三晖电气	1,900	36,575.00	0.03
167	600167	联美控股	6,500	36,530.00	0.03
168	601919	中远海控	2,400	36,096.00	0.03
169	300001	特锐德	1,500	35,955.00	0.03
170	600619	海立股份	3,000	34,230.00	0.03
171	300124	汇川技术	500	32,285.00	0.03
172	600686	金龙汽车	2,500	31,000.00	0.02
173	002831	裕同科技	1,300	30,446.00	0.02
174	002010	传化智联	5,100	28,458.00	0.02
175	688411	海博思创	332	27,718.68	0.02
176	600143	金发科技	2,200	22,682.00	0.02
177	688489	三未信安	538	21,885.84	0.02
178	002414	高德红外	2,100	21,525.00	0.02
179	600584	长电科技	600	20,214.00	0.02
180	600067	冠城新材	6,600	19,668.00	0.02
181	301458	钧崴电子	522	17,805.42	0.01
182	002916	深南电路	160	17,249.60	0.01
183	688583	思看科技	209	16,653.12	0.01
184	688061	灿瑞科技	500	16,400.00	0.01
185	301602	超研股份	658	16,318.40	0.01
186	002709	天赐材料	900	16,308.00	0.01
187	002080	中材科技	800	15,600.00	0.01
188	600487	亨通光电	1,000	15,300.00	0.01
189	603186	华正新材	500	15,090.00	0.01
190	600183	生益科技	500	15,075.00	0.01
191	600168	武汉控股	3,200	14,880.00	0.01
192	600298	安琪酵母	400	14,068.00	0.01
193	688545	兴福电子	518	13,960.10	0.01
194	301535	浙江华远	734	13,938.66	0.01
195	688757	胜科纳米	536	13,903.84	0.01
196	605589	圣泉集团	500	13,875.00	0.01
197	600039	四川路桥	1,400	13,860.00	0.01
198	600482	中国动力	600	13,842.00	0.01
199	605259	绿田机械	700	13,727.00	0.01
200	688758	赛分科技	777	13,185.69	0.01
201	603639	海利尔	900	12,645.00	0.01
202	301305	朗坤科技	700	12,565.00	0.01
203	301387	光大同创	300	11,670.00	0.01
204	301601	惠通科技	342	11,576.70	0.01
205	001388	信通电子	676	11,099.92	0.01
206	001201	东瑞股份	700	10,892.00	0.01
207	301479	弘景光电	132	10,278.84	0.01
208	301662	宏工科技	115	9,487.50	0.01

209	001391	国货航	1,365	9,186.45	0.01
210	301275	汉朔科技	153	8,597.07	0.01
211	301678	新恒汇	191	8,507.14	0.01
212	603072	天和磁材	148	8,058.60	0.01
213	002724	海洋王	900	7,470.00	0.01
214	301665	泰禾股份	317	7,097.63	0.01
215	301658	首航新能	303	6,962.94	0.01
216	001382	新亚电缆	341	6,891.61	0.01
217	301173	毓恬冠佳	150	6,747.00	0.01
218	002486	嘉麟杰	2,500	6,550.00	0.01
219	001356	富岭股份	449	6,483.56	0.01
220	603194	中力股份	142	6,445.38	0.01
221	301501	恒鑫生活	141	6,376.02	0.01
222	603803	瑞斯康达	600	6,024.00	0.00
223	688566	吉贝尔	218	5,927.42	0.00
224	301595	太力科技	164	4,772.40	0.00
225	301590	优优绿能	30	4,184.40	0.00
226	301560	众捷汽车	152	4,172.40	0.00
227	603124	江南新材	88	4,075.28	0.00
228	300242	佳云科技	800	3,840.00	0.00
229	001395	亚联机械	80	3,780.00	0.00
230	688369	致远互联	134	3,536.26	0.00
231	603210	泰鸿万立	200	3,122.00	0.00
232	600378	昊华科技	100	2,707.00	0.00
233	603271	永杰新材	76	2,666.08	0.00
234	001335	信凯科技	80	2,244.00	0.00
235	603409	汇通控股	66	2,199.12	0.00
236	603257	中国瑞林	55	2,060.85	0.00
237	001390	古麒绒材	112	2,029.44	0.00
238	002687	乔治白	129	598.56	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	688562	航天软件	1,728,592.47	1.09
2	002322	理工能科	1,623,606.00	1.03
3	688381	帝奥微	1,425,909.56	0.90
4	300787	海能实业	1,356,734.00	0.86
5	300369	绿盟科技	1,352,016.00	0.85
6	301150	中一科技	1,256,521.70	0.79

7	688579	山大地纬	1,141,539.58	0.72
8	603386	骏亚科技	1,132,880.00	0.72
9	300513	恒实科技	1,079,969.00	0.68
10	002376	新北洋	1,074,108.00	0.68
11	301051	信濠光电	1,059,538.00	0.67
12	300903	科翔股份	1,047,156.00	0.66
13	600248	陕建股份	1,046,402.00	0.66
14	688391	钜泉科技	1,037,780.23	0.66
15	688489	三未信安	1,007,661.03	0.64
16	688371	菲沃泰	992,537.56	0.63
17	688450	光格科技	983,903.95	0.62
18	688296	和达科技	965,221.02	0.61
19	301195	北路智控	958,717.00	0.61
20	688508	芯朋微	950,259.00	0.60

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

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	688381	帝奥微	1,570,930.14	0.99
2	002376	新北洋	1,386,969.00	0.88
3	301150	中一科技	1,332,680.80	0.84
4	300903	科翔股份	1,325,580.00	0.84
5	002724	海洋王	1,307,521.00	0.83
6	300523	辰安科技	1,192,431.00	0.75
7	688489	三未信安	1,188,989.84	0.75
8	688519	南亚新材	1,183,234.39	0.75
9	300513	恒实科技	1,120,499.00	0.71
10	603680	今创集团	1,071,468.80	0.68
11	603408	建霖家居	1,057,874.00	0.67
12	600248	陕建股份	1,005,098.00	0.64
13	002688	金河生物	991,186.00	0.63
14	688562	航天软件	990,332.30	0.63
15	688259	创耀科技	975,132.11	0.62
16	688371	菲沃泰	973,593.30	0.62
17	002980	华盛昌	956,447.20	0.60
18	000099	中信海直	942,791.00	0.60
19	688201	信安世纪	939,009.92	0.59

20	002967	广电计量	931,468.00	0.59
----	--------	------	------------	------

注：1、卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票；

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	270,587,613.78
卖出股票收入（成交）总额	327,650,777.32

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票；

2、“买入股票成本（成交）总额”、“卖出股票收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

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

7.11.2 本期国债期货投资评价

本报告期内，本基金投资国债期货符合既定的投资政策和投资目的。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

报告期基金投资的前十名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。

7.12.2

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	751,608.00
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,246,473.69
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,998,081.69

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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	1,116	24,949.61	2,090,583.98	7.51%	25,753,176.90	92.49%
招商国证 2000 指数增强 C	1,425	50,376.36	3,212,274.28	4.47%	68,574,041.43	95.53%
合计	2,541	39,209.00	5,302,858.26	5.32%	94,327,218.33	94.68%

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

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	招商国证 2000 指数增强 A	65,794.96	0.2363%
	招商国证 2000 指数增强 C	228,575.37	0.3184%
	合计	294,370.33	0.2955%

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

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	招商国证 2000 指数增强 A	招商国证 2000 指数增强 C
基金合同生效日(2023 年 8 月 1 日)基金份额总额	156,315,135.62	471,334,242.22
本报告期期初基金份额总额	62,951,190.09	84,913,727.09
本报告期基金总申购份额	7,878,954.23	105,028,715.29
减：本报告期基金总赎回份额	42,986,383.44	118,156,126.67
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	27,843,760.88	71,786,315.71

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

根据本基金管理人 2025 年 5 月 20 日的公告，经招商基金管理有限公司第七届董事会 2025 年第四次会议审议通过，同意徐勇先生辞任公司总经理职务，聘任钟文岳先生为公司总经理。

根据本基金管理人 2025 年 5 月 30 日的公告，经招商基金管理有限公司第七届董事会 2025 年第五次会议审议通过，同意聘任王景女士、朱红裕先生、陈方元先生为公司首席（副总经理级）。

根据本基金管理人 2025 年 6 月 19 日的公告，经招商基金管理有限公司第七届董事会 2025 年第六次会议审议通过，同意董方先生辞任公司副总经理职务。

根据本基金管理人 2025 年 6 月 27 日的公告，经招商基金管理有限公司第七届董事会 2025 年第五次会议审议通过，同意聘任于立勇先生为公司首席（副总经理级）。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的重大诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
财通证券	3	298,233,146.69	49.93%	56,825.29	45.26%	-
西南证券	3	237,538,627.26	39.77%	45,284.11	36.07%	-
东海证券	3	61,499,419.89	10.30%	23,435.17	18.67%	-

注：（一）选择标准

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

- 2、被动股票型基金选择佣金费率相对较低，能够提供优质证券交易服务的证券公司。
- 3、被动股票型基金以外类型基金选择能够提供优质研究服务的证券公司。

(二) 选择程序

- 1、基金管理人根据上述标准进行评估并确定选用的证券公司。
- 2、基金管理人与被选择的证券公司签订交易单元租用协议/证券经纪服务协议。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
财通证券	528,267.45	93.85%	-	-	-	-
西南证券	26,929.89	4.78%	-	-	-	-
东海证券	7,677.10	1.36%	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	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	2025-01-14
2	招商国证 2000 指数增强型证券投资基金 2024 年第 4 季度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-01-21
3	招商基金管理有限公司旗下基金 2024 年第 4 季度报告提示性公告	证券时报及基金管理人网站	2025-01-21
4	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	2025-02-07
5	招商基金管理有限公司关于招融资本私募股权基金管理（深圳）有限责任公司股东变更的公告	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	2025-03-08
6	招商国证 2000 指数增强型证券投资基金 2024 年年度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-28
7	招商基金管理有限公司旗下基金 2024 年年度报告提示性公告	证券时报及基金管理人网站	2025-03-28
8	招商基金管理有限公司关于运用自有资金投资旗下公募基金的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会	2025-04-08

		基金电子披露网站	
9	招商国证 2000 指数增强型证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-04-21
10	招商基金管理有限公司旗下基金 2025 年第 1 季度报告提示性公告	证券时报及基金管理人网站	2025-04-21
11	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	2025-05-09
12	招商基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-05-20
13	招商基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-05-30
14	招商基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-06-19
15	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	2025-06-25
16	招商基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-06-27

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

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

11.2 存放地点

招商基金管理有限公司

地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

11.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人招商基金管理有限公司。

客户服务中心电话: 400-887-9555

网址: <http://www.cmfcchina.com>

招商基金管理有限公司

2025 年 8 月 28 日