

嘉实中证 2000 交易型开放式指数证券投资
基金
2024 年年度报告

2024 年 12 月 31 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中信证券股份有限公司

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、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的法律责任。本年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中信证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 03 月 24 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。

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
3.4 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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	13
4.10 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	13
§ 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真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 审计报告	14
6.1 审计报告基本信息	14
6.2 审计报告的基本内容	14
§ 7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表	16
7.2 利润表	18
7.3 净资产变动表	19
7.4 报表附注	21

§ 8 投资组合报告	47
8.1 期末基金资产组合情况	47
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	48
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	49
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	72
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	73
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	74
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	74
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	74
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	74
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	74
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	74
8.12 投资组合报告附注	74
§ 9 基金份额持有人信息	75
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	75
9.2 期末上市基金前十名持有人	75
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	76
9.4 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	76
9.5 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	76
§ 10 开放式基金份额变动	76
§ 11 重大事件揭示	76
11.1 基金份额持有人大会决议	76
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	76
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	77
11.4 基金投资策略的改变	77
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	77
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	77
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	77
11.8 其他重大事件	78
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	80
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	80
§ 13 备查文件目录	81
13.1 备查文件目录	81
13.2 存放地点	81
13.3 查阅方式	81

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	嘉实中证 2000ETF
场内简称	中证 2000ETF 指数
基金主代码	159535
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023 年 9 月 14 日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中信证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	28,981,088.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易 所	深圳证券交易所
上市日期	2023 年 9 月 22 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。
投资策略	本基金主要采取抽样复制法，基金管理人将综合考虑代表性、相关性、估值、流动性等因素挑选标的指数中成份股或备选成份股构建指数化投资组合，使构建的投资组合与标的指数在风险收益特征上尽可能相似，达到复制标的指数、降低交易成本的目的。 如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过投资目标所述范围的，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。 为了更好地实现跟踪标的指数的目的，基金管理人还可以综合考虑标的指数成份股的流动性、投资限制、交易成本及基金规模等因素，决定是否采用完全复制法的策略。 具体投资策略包括：股票投资策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、衍生品投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略等。
业绩比较基准	中证 2000 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。 本基金为被动式投资的股票型指数基金，跟踪标的指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		嘉实基金管理有限公司	中信证券股份有限公司
信息披露	姓名	郭松	杨军智

负责人	联系电话	(010)65215588	010-60834299
	电子邮箱	service@jsfund.cn	yjz@citics.com
客户服务电话		400-600-8800	010-60836588
传真		(010)65215588	010-60834004
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 1806A 单元	广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座
办公地址		北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层	北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦 5 层
邮政编码		100020	100125
法定代表人		经雷	张佑君

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
基金年度报告备置地点	北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层嘉实基金管理有限公司

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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标、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

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2024 年	2023 年 9 月 14 日（基金合同生效日） -2023 年 12 月 31 日
本期已实现收益	1,913,640.87	4,751,265.98
本期利润	2,232,185.16	4,508,395.20
加权平均基金份额本期利润	0.0623	0.0318
本期加权平均净值利润率	6.85%	3.16%
本期基金份额净值增长率	2.32%	2.14%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末	2023 年末
期末可供分配利润	1,306,961.74	941,802.87
期末可供分配基	0.0451	0.0214

金份额利润		
期末基金资产净值	30,288,049.74	44,922,890.87
期末基金份额净值	1.0451	1.0214
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	4.51%	2.14%

注：（1）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。

（2）上述基金业绩指标不包括持有人认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。

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

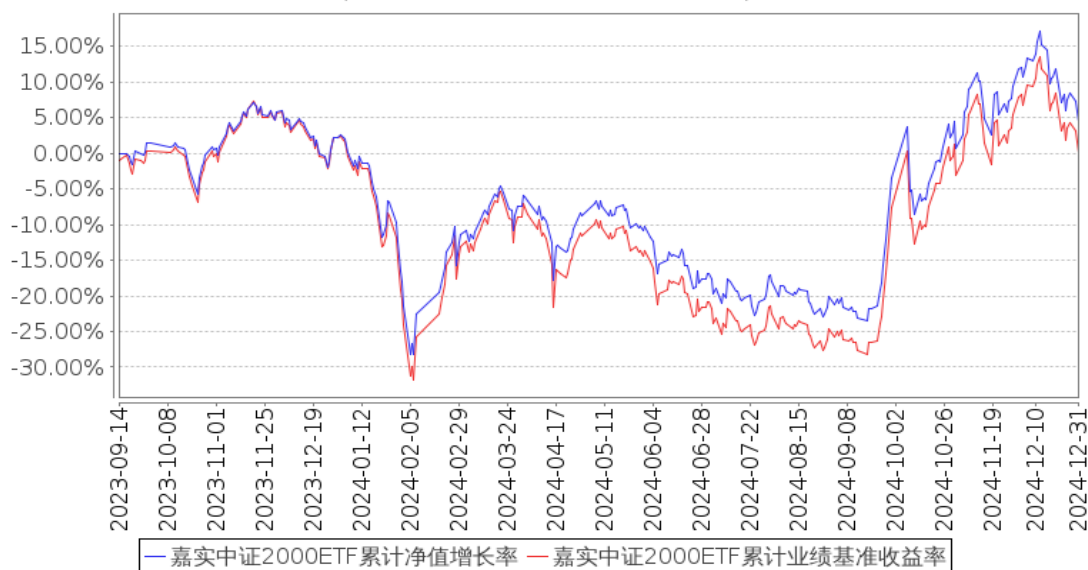
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	8.20%	2.40%	8.40%	2.66%	-0.20%	-0.26%
过去六个月	26.83%	2.17%	27.56%	2.39%	-0.73%	-0.22%
过去一年	2.32%	2.21%	-2.14%	2.45%	4.46%	-0.24%
自基金合同生效起至今	4.51%	2.00%	0.12%	2.21%	4.39%	-0.21%

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

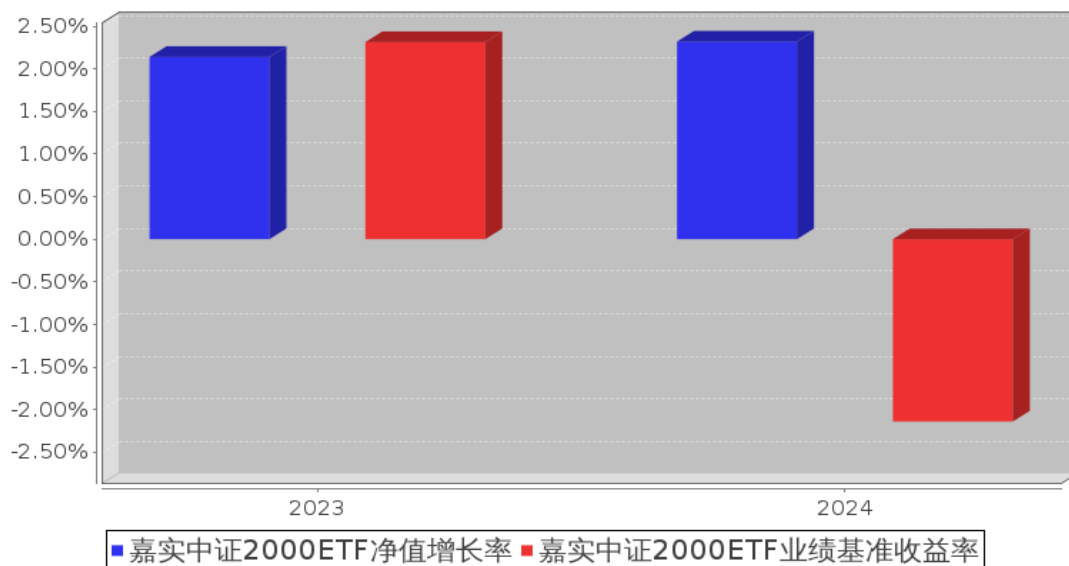
嘉实中证2000ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2023年09月14日至2024年12月31日)



注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起 6 个月为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

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

嘉实中证2000ETF基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：上述数据根据基金当年实际存续期计算。

3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

无。

§ 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

嘉实基金管理有限公司经中国证监会证监基字[1999]5 号文批准，于 1999 年 3 月 25 日成立。公司注册地上海，总部设在北京并设北京、深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州、北京怀柔、武汉分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人、QDII 和特定资产管理业务等资格。

截止 2024 年 12 月 31 日，基金管理人共管理 355 只公募基金，覆盖主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、资产配置、海外投资、FOF、基础设施基金等不同类别。同时，还管理多个全国社保、基本养老保险、企业年金、职业年金和单一/集合资产管理计划。

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		
李直	本基金、嘉实基本 面 50 指数 (LOF)、嘉 实深证基 本 面 120ETF、 嘉实深证 基 本 面 120ETF 联 接、嘉实 中 证 500ETF、 嘉实中证 500ETF 联 接、嘉实 基 本 面 50ETF、嘉 实中证大 农业 ETF、 嘉实恒生 科技 ETF	2023 年 9 月 14 日	-	10 年	2014 年 7 月加入嘉实基金管理有限公司，从事指数基金投资研究工作，现任基金经理。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。

	(QDII)、 嘉实中证 科创创业 50ETF、嘉 实中证新 能源汽车 指数、嘉 实中证科 创 创 业 50ETF 发 起联接、 嘉实中证 光伏产业 指数发起 式、嘉实 中证大农 业 ETF 发 起联接、 嘉实标普 石油天然 气勘探及 生产精选 行业 ETF (QDII)、 嘉实中证 A100ETF、 嘉实中证 A100ETF 发起联接 基金经理				
--	---	--	--	--	--

注：（1）首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日，此后的非首任基金经理的“任职日期”指根据公司决定确定的聘任日期；“离任日期”指根据公司决定确定的解聘日期。

（2）证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

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

公司制定了《公平交易管理制度》，按照证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规的规定，从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度建设、内控措施和信息披露等多方面，境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易、境外投资以及投资管理过程中各个相关环节应当符合公平交易的监管要求，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，杜绝不同投资组合之间进行利益输送，保护投资者合法权益。

公司严格执行《公平交易管理制度》，各投资组合能够公平地获得投资信息、投资建议，实施投资决策时享有公平的机会。所有组合投资决策与交易执行保持隔离，任何组合必须经过公司交易部门集中交易。各组合享有平等的交易权利，共享交易资源。对交易所公开竞价交易以及银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易制定专门的交易规则，保证各投资组合获得公平的交易机会。对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，严格遵循各投资组合交易前独立确定交易要素，交易后按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司公平交易制度，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现；对投资交易行为进行监察稽核，通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控和定期分析评估并完整详实记录相关信息，及时完成每季度和年度公平交易专项稽核。

报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，未发现违反公平交易制度的异常行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中，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，合计 11 次，均为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，未发现不公平交易和利益输送行为。

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

本基金跟踪中证 2000 指数，中证 2000 指数从沪深市场中选取市值规模较小且流动性较好的

2000 只证券作为指数样本。中证 2000 与沪深 300、中证 500 和中证 1000 指数共同构成中证规模指数系列，反映沪深市场不同市值规模上市公司证券的整体表现。本基金主要采用抽样复制法及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。

2024 年，经济复苏态势曲折向好。一季度，1-2 月信贷弱于预期，但制造业开始回暖，为后续发展奠定基础。3 月制造业景气上升并延续到 4 月，期间出口拉动需求，经济超预期恢复，不过受稳增长政策落地效果滞后影响，5、6 月制造业 PMI 回落至荣枯线以下。三季度，7、8 月为制造业淡季，受多种因素影响 PMI 降幅较大，好在大型企业等处于扩张区间，外需也在支撑总需求，9 月政策发力使 PMI 超季节性回升。至 11 月，前期逆周期调节政策效果逐步显现，PMI 明显回升，企业生产和市场需求均有修复迹象，需求侧订单指数好转。海外方面，美国经济的韧性与通胀是决定市场对降息预期的主要因素，也进一步影响着市场走势。上半年通胀整体成降温态势，但经济活动的疲软推动美联储降息预期上升，市场整体上行；三季度全球制造业走弱，9 月 PMI 创 15 个月以来新低，宏观经济承压促使美联储开启降息周期，但市场早已计入降息溢价，总体表现以震荡为主；四季度承压的经济有部分好转，全球制造业 PMI 在连续 5 个月下行后开始回升，欧美主要市场震荡上行。

作为 ETF 基金，本基金秉承指数化被动投资策略，积极应对成份股调整、基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击，降低基金的跟踪误差。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0451 元；本报告期基金份额净值增长率为 2.32%，业绩比较基准收益率为-2.14%。

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，积极的财政政策仍将持续，宽松的货币环境或逐渐转化为信用端的扩张，促进企业盈利的进一步修复。在相关部门的大力推动下，保险等长线资金持续流入资本市场，财富效应有助于进一步刺激内需。

本基金作为一只投资于中证 2000 指数的被动投资管理产品，我们继续秉承指数化被动投资策略，积极应对基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击，降低本基金的跟踪误差，给投资者提供一个标准化的中证 2000 指数的投资工具。

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，基金管理人有关监察稽核工作情况如下：

（1）继续内控前置。在基金营销、投资交易、信息披露以及新产品设计开发、海外业务、另类业务、制度建设、合同管理、法律咨询等方面，事前进行合规性审核、监控。全力支持新业务开展，

对新产品、新投资工具等进行合规性判断。在制度流程、投资范围、投资工具、运作规则等方面，防控重大风险。

(2) 全流程动态开展投资交易监督。一是事前防范，主要从事前研讨，合规风险识别、评估和分析，IT 事前设置，建立禁限库，合规培训、承诺书等方面开展；二是事中实时监控，如实时回答组合经理、交易员投资交易事项，盘中实时监控等；三是事后检查及改进，如检查投资交易合规情况，对异常行为进行提示、处理建议并督促改正。优化和升级合规风控系统，不断提高自动化监控能力，保障各类组合合规运作，保护投资者利益。

(3) 按计划对销售、投资、后台和其它业务开展内部稽核，完成相应内审报告及其后续改进跟踪。完成公司及基金的外审、公司 GIPS 第三方验证、ISAE3402 国际鉴证等。

(4) 基金法务工作。包括合同、协议审查，主动解决各项法律文件以及实务运作中存在的差错和风险隐患，重点防控新增产品、新增业务以及日常业务的法律风险问题。

(5) 加强差错管理。继续推动各业务单元梳理流程、制度，落实风险责任授权体系，确保所有识别的关键风险点均有相应措施控制。

此外，我们还积极配合监管，按时完成合规报告和各项统计报表以及专题报告。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照《企业会计准则》及中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于基金资产估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求，履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，研究、指导基金估值业务。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，具备投研、风险管理、基金估值运作、法律合规等方面的专业胜任能力。

本基金管理人使用可靠的估值业务系统，设有完善的风险监测、控制和报告机制，与估值相关的机构包括基金投资市场的证券交易场所以及境内相关机构等。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期，本基金未实施利润分配，符合法律法规和基金合同的相关约定。具体参见本报告“7.4.11 利润分配情况”。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.10 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，本基金存在连续 20 个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，时间范围为 2024

年 1 月 1 日至 2024 年 2 月 7 日，2024 年 2 月 28 日至 2024 年 5 月 6 日；存在连续 60 个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，时间范围为 2024 年 5 月 8 日至 2024 年 12 月 31 日；未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满两百人的情形。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的有关规定，本基金管理人已向中国证监会报告并提出解决方案。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中信证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在对嘉实中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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，嘉实基金管理有限公司在嘉实中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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

本报告期，由嘉实基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关嘉实中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	德师报(审)字(25)第 P00523 号

6.2 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	嘉实中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了嘉实中证 2000 交易型开放式指数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。 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，公允反映了嘉实中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金 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。
形成审计意见的基础	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，我们独立于嘉实中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金，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。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	嘉实基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括嘉实中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年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。 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。 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。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。
管理层和治理层对财务报表的责任	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而导致的重大错报。 在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估嘉实中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算嘉实中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金、终止运营或别无其他现实的选择。 基金管理人治理层负责监督嘉实中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	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。 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： (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。 (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。 (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。 (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，就可能对导致对嘉实中证 2000 交易型开放式指数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嘉实中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金不能持续经营。 (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。 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。	
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	汪芳	姜金玲
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 03 月 26 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：嘉实中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

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	1,047,349.11	1,211,531.67

结算备付金		105,952.90	261,856.81
存出保证金		12,927.11	378,709.58
交易性金融资产	7.4.7.2	29,154,792.47	43,388,083.47
其中：股票投资		29,149,792.27	43,364,363.21
基金投资		-	-
债券投资		5,000.20	23,720.26
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	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		30,321,021.59	45,240,181.53
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		-	92,519.60
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		10,188.62	22,811.55
应付托管费		2,244.90	4,562.32
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	20,538.33	197,397.19
负债合计		32,971.85	317,290.66
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	28,981,088.00	43,981,088.00
未分配利润	7.4.7.12	1,306,961.74	941,802.87

净资产合计		30,288,049.74	44,922,890.87
负债和净资产总计		30,321,021.59	45,240,181.53

注： 报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0451 元，基金份额总额 28,981,088.00 份。

7.2 利润表

会计主体：嘉实中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

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 9 月 14 日（基金 合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		2,439,808.09	4,870,267.98
1. 利息收入		25,574.67	177,220.90
其中：存款利息收入	7.4.7.13	25,574.67	177,220.90
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）		1,807,186.96	4,245,255.42
其中：股票投资收益	7.4.7.14	1,452,211.34	4,160,708.97
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	11,384.30	44,168.27
资产支持证券投资 收益	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	343,591.32	40,378.18
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	7.4.7.20	318,544.29	-242,870.78
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	7.4.7.21	288,502.17	690,662.44
减：二、营业总支出		207,622.93	361,872.78
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	163,625.01	218,898.16
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	32,932.12	43,779.60

3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	0.02
8. 其他费用	7.4.7.23	11,065.80	99,195.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,232,185.16	4,508,395.20
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,232,185.16	4,508,395.20
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		2,232,185.16	4,508,395.20

7.3 净资产变动表

会计主体：嘉实中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

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	43,981,088.00	-	941,802.87	44,922,890.87
二、本期期初净资产	43,981,088.00	-	941,802.87	44,922,890.87
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-15,000,000.00	-	365,158.87	-14,634,841.13
（一）、综合收益总额	-	-	2,232,185.16	2,232,185.16
（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）	-15,000,000.00	-	-1,867,026.29	-16,867,026.29
其中：1. 基金申购款	147,000,000.00	-	-19,088,082.37	127,911,917.63
2. 基金赎回款	-162,000,000.00	-	17,221,056.08	-144,778,943.92

（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、本期期末净资产	28,981,088.00	-	1,306,961.74	30,288,049.74
项目	上年度可比期间 2023 年 9 月 14 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	-	-	-	-
二、本期期初净资产	490,981,088.00	-	-	490,981,088.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-447,000,000.0 0	-	941,802.87	-446,058,197.13
（一）、综合收益总额	-	-	4,508,395.20	4,508,395.20
（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）	-447,000,000.0 0	-	-3,566,592.33	-450,566,592.33
其中：1. 基金申购款	33,000,000.00	-	462,256.87	33,462,256.87
2. 基金赎回款	-480,000,000.0 0	-	-4,028,849.20	-484,028,849.20
（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、本期期末净资产	43,981,088.00	-	941,802.87	44,922,890.87

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：

经雷
基金管理人负责人

梁凯
主管会计工作负责人

李袁
会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

嘉实中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)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]1936 号《关于准予嘉实中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》注册,由嘉实基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《嘉实中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式,存续期限不定。经向中国证监会备案,《嘉实中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2023 年 9 月 14 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 490,981,088.00 份基金份额。本基金的基金管理人为嘉实基金管理有限公司,基金托管人为中信证券股份有限公司。

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。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定,开放式基金在基金合同生效后,连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5,000 万元情形的,基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案,如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等,并召开基金份额持有人大会进行表决。于 2024 年 12 月 31 日,本基金出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5,000 万元的情形,本基金的基金管理人已向中国证监会报告并在评估后续处理方案,故本财务报表仍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

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。比较财务报表的实际编制期间为 2023 年 9 月 14 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，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的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公允价值变动计入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，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券或资产支持证券已到付息期但尚未领取的利息，单独确认为应收项目。

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

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

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

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

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，将其公允价值划分为三个层次。第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值原则如下：

(1) 对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采

用最近交易市价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市价不能真实反映公允价值的，应对市价进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

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。

(3) 公允价值变动收益

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

(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

基金的管理人报酬、托管费等费用在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

- (1) 每份基金份额享有同等分配权；
- (2) 本基金收益评价日核定的基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，基金管理人可以进行收益分配；
- (3) 在符合上述基金分红条件的前提下，由基金管理人根据本基金特点自行约定收益分配次数，每次基金收益分配数额的确定原则为：使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率；若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；
- (4) 基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补亏损为前提，收益分配后有可能使基金份额净值低于面值，即基金收益分配基准日(即收益评价日)的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后可能低于面值；
- (5) 本基金收益分配采取现金方式；
- (6) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 外币交易

无。

7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据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，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) 对于在锁定期内的非公开发行股票、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流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《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》之附件《证券投资基金投资流

受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”),按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(2)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

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[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运营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, 暂不缴纳企业所得税;
- (3) 对基金取得的股票股息、红利收入, 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; 对于基金通过深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票, 按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税; 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) 本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3%、2%缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

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	1,047,349.11	1,211,531.67
等于：本金	1,046,869.07	1,210,905.97
加：应计利息	480.04	625.70
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-

存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	1, 047, 349. 11	1, 211, 531. 67

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		29, 074, 118. 76	-	29, 149, 792. 27	75, 673. 51
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	5, 000. 00	0. 20	5, 000. 20	0. 00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	5, 000. 00	0. 20	5, 000. 20	0. 00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		29, 079, 118. 76	0. 20	29, 154, 792. 47	75, 673. 51
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		43, 608, 553. 11	-	43, 364, 363. 21	-244, 189. 90
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	22, 400. 00	1. 14	23, 720. 26	1, 319. 12
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	22, 400. 00	1. 14	23, 720. 26	1, 319. 12
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		43, 630, 953. 11	1. 14	43, 388, 083. 47	-242, 870. 78

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

无。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

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

无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

无。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

7.4.7.8 其他资产

无。

7.4.7.9 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	9,472.53	98,602.19
其中：交易所市场	9,472.53	98,602.19
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	11,065.80	98,795.00
合计	20,538.33	197,397.19

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

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	43,981,088.00	43,981,088.00
本期申购	147,000,000.00	147,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-162,000,000.00	-162,000,000.00
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	28,981,088.00	28,981,088.00

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.11 其他综合收益

无。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,613,157.23	-1,671,354.36	941,802.87
本期期初	2,613,157.23	-1,671,354.36	941,802.87
本期利润	1,913,640.87	318,544.29	2,232,185.16
本期基金份额交易产生的变动数	1,004,811.30	-2,871,837.59	-1,867,026.29
其中：基金申购款	3,317,671.48	-22,405,753.85	-19,088,082.37
基金赎回款	-2,312,860.18	19,533,916.26	17,221,056.08
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,531,609.40	-4,224,647.66	1,306,961.74

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31	2023 年 9 月 14 日（基金合

	日	同生效日)至2023年12月31日
活期存款利息收入	21,530.02	170,516.90
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	1,916.93	5,341.51
其他	2,127.72	1,362.49
合计	25,574.67	177,220.90

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 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9月14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	1,864,230.24	571,981.50
股票投资收益——赎回差价收入	-412,018.90	3,588,727.47
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	1,452,211.34	4,160,708.97

7.4.7.14.2 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9月14日(基金合同生效日)至2023年12月31日
卖出股票成交总额	98,837,644.49	206,851,527.96
减：卖出股票成本总额	96,815,795.84	205,648,608.49
减：交易费用	157,618.41	630,937.97
买卖股票差价收入	1,864,230.24	571,981.50

7.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

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9月14日(基金合同生效日)至2023年12月31日
----	-----------------------------	--

		日
赎回基金份额对价总额	144,778,943.92	484,028,849.20
减：现金支付赎回款总额	50,985,718.92	164,095,211.20
减：赎回股票成本总额	94,205,243.90	316,344,910.53
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	-412,018.90	3,588,727.47

7.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 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9月14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	7.77	16.71
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	11,376.53	44,151.56
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	11,384.30	44,168.27

7.4.7.15.2 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年12月31日	上年度可比期间 2023年9月14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	70,888.09	158,973.71
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本	59,500.00	114,800.00

总额		
减：应计利息总额	8.71	15.78
减：交易费用	2.85	6.37
买卖债券差价收入	11,376.53	44,151.56

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

7.4.7.19 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 9 月 14 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	343,591.32	40,378.18
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	343,591.32	40,378.18

7.4.7.20 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 9 月 14 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	318,544.29	-242,870.78
股票投资	319,863.41	-244,189.90
债券投资	-1,319.12	1,319.12
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	318,544.29	-242,870.78

7.4.7.21 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 9 月 14 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	288,502.17	690,662.44
合计	288,502.17	690,662.44

7.4.7.22 信用减值损失

无。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	2023 年 9 月 14 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
审计费用	11,065.80	54,000.00
信息披露费	-	44,795.00
证券出借违约金	-	-
其他	-	400.00
合计	11,065.80	99,195.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
嘉实基金管理有限公司（“嘉实基金”）	基金管理人
中信证券股份有限公司（“中信证券”）	基金托管人
DWS Investments Singapore Limited	基金管理人的股东
立信投资有限责任公司	基金管理人的股东
中诚信托有限责任公司	基金管理人的股东
嘉实资本管理有限公司（“嘉实资本”）	基金管理人的控股子公司
嘉实财富管理有限公司（“嘉实财富”）	基金管理人的控股子公司

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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		上年度可比期间	
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		2023 年 9 月 14 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（%）
中信证券股份有限公司	173,049,077.41	88.84	742,764,373.09	100.00

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9月14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（%）
中信证券股份 有限公司	70,888.09	100.00	158,973.71	100.00

7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

7.4.10.1.4 权证交易

无。

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（%）
中信证券股份有 限公司	91,650.79	95.78	5,430.40	57.33
关联方名称	上年度可比期间 2023年9月14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（%）
中信证券股份有 限公司	479,737.44	100.00	98,602.19	100.00

注：上述佣金按市场佣金率计算；根据证监会公告[2024]3 号《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，针对被动股票型基金，不再通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用。

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 9 月 14 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	163,625.01	218,898.16

其中：应支付销售机构的客户维护费	16,836.75	-
应支付基金管理人的净管理费	146,788.26	218,898.16

注：1. 支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50%/0.15%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：日管理人报酬＝前一日基金资产净值×该日适用费率/当年天数。

2. 自 2024 年 12 月 20 日起，本基金管理费率由 0.50%调整为 0.15%。

3. 根据本基金的基金管理人与各代销机构签订的基金代销协议，客户维护费按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算。

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 9 月 14 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	32,932.12	43,779.60

注：1. 支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.10%/0.05%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：日托管费＝前一日基金资产净值×该日适用费率/当年天数。

2. 自 2024 年 12 月 20 日起，本基金托管费率由 0.10%调整为 0.05%。

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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024 年 12 月 31 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）
中信证券	852,885.00	2.94	2,691,215.00	6.12

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 9 月 14 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
中信证券股份有限公司_活期	1,047,349.11	21,530.02	1,211,531.67	170,516.90

注：本基金的上述存款，按银行同业利率或约定利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期，基金管理人主动承担部分固定费用，如审计费用、信息披露费等。

7.4.11 利润分配情况

本期（2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日），本基金未实施利润分配。

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：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
123251	华医转债	2024 年 12 月 23 日	1 个月内（含）	新债未上市	100.00	100.00	50	5,000.00	5,000.20	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	------	------	------	--------	------	--------	-------	--------	--------	----

002379	宏创 控股	2024 年 12 月 23 日	重大事 项停牌	8.97	2025 年 01 月 07 日	9.87	8,500	55,209.05	76,245.00	-
000777	中核 科技	2024 年 12 月 30 日	重大事 项停牌	18.07	2025 年 01 月 14 日	19.88	3,300	58,668.00	59,631.00	-
000421	南京 公用	2024 年 12 月 27 日	重大事 项停牌	6.48	2025 年 01 月 13 日	7.13	3,600	25,284.00	23,328.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人按照法律法规和中国证监会的规定，建立组织机构健全、职责划分清晰、制衡监督有效、激励约束合理的治理结构，建立健全内部控制机制和 risk 管理制度，坚持审慎经营理念，保护投资者利益和公司合法权益。

公司建立包括董事会、管理层、各部门及一线员工组成的四道风控防线，还有董事会风险控制与内审委员会、公司风险控制委员会、督察长及其合规管理部门、风险管理部门，评估各项风险并提出防控措施并有效执行。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法，主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融

工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

基金的银行存款存放在托管人和其他拥有相关资质的银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。基金在交易所进行的交易均与授权的证券结算机构完成证券交收和款项清算或通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在场外交易市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

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	5,000.20	23,720.26
未评级	-	-
合计	5,000.20	23,720.26

注：评级取自第三方评级机构。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.3 流动性风险

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。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。

于本报告期末，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照相关法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%。本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

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	1,047,349.11	-	-	-	1,047,349.11
结算备付金	105,952.90	-	-	-	105,952.90
存出保证金	12,927.11	-	-	-	12,927.11
交易性金融资产	-	-	5,000.20	29,149,792.27	29,154,792.47
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,166,229.12	-	5,000.20	29,149,792.27	30,321,021.59
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	10,188.62	10,188.62
应付托管费	-	-	-	2,244.90	2,244.90
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	20,538.33	20,538.33
负债总计	-	-	-	32,971.85	32,971.85
利率敏感度缺口	1,166,229.12	-	5,000.20	29,116,820.42	30,288,049.74

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	1,211,531.67	-	-	-	1,211,531.67
结算备付金	261,856.81	-	-	-	261,856.81
存出保证金	378,709.58	-	-	-	378,709.58
交易性金融资产	-	-	23,720.26	43,364,363.21	43,388,083.47
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,852,098.06	-	23,720.26	43,364,363.21	45,240,181.53
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	92,519.60	92,519.60
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	22,811.55	22,811.55
应付托管费	-	-	-	4,562.32	4,562.32
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	197,397.19	197,397.19
负债总计	-	-	-	317,290.66	317,290.66
利率敏感度缺口	1,852,098.06	-	23,720.26	43,047,072.55	44,922,890.87

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的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）

	市场利率上升 25 个基点	-70.80	-339.69
	市场利率下降 25 个基点	72.00	345.51

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

无。

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的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）
	所有外币相对人民币升值 5%	-	-
	所有外币相对人民币贬值 5%	-	-

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格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除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。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股票、债券及基金，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 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	29,149,792.27	96.24	43,364,363.21	96.53
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	29,149,792.27	96.24	43,364,363.21	96.53

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩基准以外的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）
	业绩比较基准上升 5%	1,367,696.34	2,002,635.85
	业绩比较基准下降 5%	-1,367,696.34	-2,002,635.85

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	28,990,588.27	43,370,082.74
第二层次	164,204.20	18,000.73
第三层次	-	-
合计	29,154,792.47	43,388,083.47

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

无。

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

无。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产或金融负债(上年度末：无)。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	29,149,792.27	96.14
	其中：股票	29,149,792.27	96.14
2	基金投资	-	-

3	固定收益投资	5,000.20	0.02
	其中：债券	5,000.20	0.02
	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	1,153,302.01	3.80
8	其他各项资产	12,927.11	0.04
9	合计	30,321,021.59	100.00

注：股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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	322,327.00	1.06
B	采矿业	151,719.00	0.50
C	制造业	19,903,200.75	65.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	610,389.00	2.02
E	建筑业	394,272.00	1.30
F	批发和零售业	1,581,860.40	5.22
G	交通运输、仓储和邮政业	503,184.60	1.66
H	住宿和餐饮业	86,627.00	0.29
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,949,738.80	9.74
J	金融业	80,451.00	0.27
K	房地产业	511,001.00	1.69
L	租赁和商务服务业	398,171.80	1.31
M	科学研究和技术服务业	627,579.82	2.07
N	水利、环境和公共设施管理业	621,838.50	2.05
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	64,580.00	0.21
Q	卫生和社会工作	20,120.00	0.07
R	文化、体育和娱乐业	322,731.60	1.07

S	综合	-	-
	合计	29,149,792.27	96.24

8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

无。

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

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 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	300377	赢时胜	5,700	157,092.00	0.52
2	002031	巨轮智能	25,300	125,741.00	0.42
3	002045	国光电器	5,500	119,295.00	0.39
4	300290	荣科科技	5,400	109,890.00	0.36
5	300493	润欣科技	3,800	106,894.00	0.35
6	603009	北特科技	2,600	101,608.00	0.34
7	300184	力源信息	10,700	99,831.00	0.33
8	002073	软控股份	11,700	96,642.00	0.32
9	002611	东方精工	9,800	95,550.00	0.32
10	300098	高新兴	17,000	93,160.00	0.31
11	300102	乾照光电	8,900	92,204.00	0.30
12	603516	淳中科技	1,600	88,448.00	0.29
13	600609	金杯汽车	11,900	85,680.00	0.28
14	300131	英唐智控	10,500	85,155.00	0.28
15	600410	华胜天成	11,700	84,708.00	0.28
16	300053	航宇微	6,400	83,776.00	0.28
17	300561	汇金科技	1,500	82,440.00	0.27
18	002449	国星光电	6,000	81,720.00	0.27
19	002149	西部材料	4,500	79,650.00	0.26
20	603887	城地香江	4,900	78,008.00	0.26
21	600789	鲁抗医药	8,100	77,355.00	0.26
22	603227	雪峰科技	8,800	76,472.00	0.25
23	300790	宇瞳光学	4,000	76,360.00	0.25
24	002379	宏创控股	8,500	76,245.00	0.25
25	300046	台基股份	2,100	76,167.00	0.25
26	600200	江苏吴中	8,000	74,560.00	0.25
27	002106	莱宝高科	6,800	74,188.00	0.24
28	300276	三丰智能	8,200	73,718.00	0.24
29	300010	豆神教育	11,800	73,278.00	0.24
30	300972	万辰集团	900	72,369.00	0.24

31	300061	旗天科技	5,600	72,240.00	0.24
32	300401	花园生物	4,900	71,834.00	0.24
33	600694	大商股份	2,720	71,726.40	0.24
34	603099	长白山	1,700	71,604.00	0.24
35	000589	贵州轮胎	14,100	70,923.00	0.23
36	300041	回天新材	7,600	69,920.00	0.23
37	300353	东土科技	6,000	68,880.00	0.23
38	002467	二六三	12,100	66,792.00	0.22
39	600255	鑫科材料	19,500	66,690.00	0.22
40	300468	四方精创	4,000	65,200.00	0.22
41	600619	海立股份	5,300	64,660.00	0.21
42	300326	凯利泰	9,900	64,350.00	0.21
43	000793	华闻集团	24,000	64,320.00	0.21
44	002437	誉衡药业	25,700	63,993.00	0.21
45	300607	拓斯达	2,500	63,725.00	0.21
46	600611	大众交通	9,200	63,480.00	0.21
47	002510	天汽模	10,700	62,488.00	0.21
48	300925	法本信息	2,800	62,384.00	0.21
49	002102	能特科技	23,700	62,094.00	0.21
50	600686	金龙汽车	4,400	61,864.00	0.20
51	300355	蒙草生态	12,000	61,560.00	0.20
52	300056	中创环保	4,600	61,088.00	0.20
53	600292	远达环保	4,700	61,053.00	0.20
54	300100	双林股份	2,200	60,808.00	0.20
55	300322	硕贝德	4,600	60,306.00	0.20
56	603859	能科科技	2,016	60,278.40	0.20
57	000777	中核科技	3,300	59,631.00	0.20
58	000501	武商集团	5,700	59,622.00	0.20
59	000815	美利云	5,200	59,540.00	0.20
60	002334	英威腾	7,900	59,408.00	0.20
61	300063	天龙集团	6,500	59,280.00	0.20
62	600973	宝胜股份	9,400	59,220.00	0.20
63	000036	华联控股	14,400	58,752.00	0.19
64	300360	炬华科技	3,500	58,695.00	0.19
65	002526	山东矿机	16,400	57,892.00	0.19
66	600391	航发科技	2,900	57,565.00	0.19
67	300278	华昌达	9,800	57,330.00	0.19
68	002175	东方智造	13,700	57,266.00	0.19
69	300007	汉威科技	2,800	57,260.00	0.19
70	300263	隆华科技	7,800	56,940.00	0.19
71	603667	五洲新春	2,300	56,925.00	0.19
72	600496	精工钢构	18,800	56,776.00	0.19
73	000912	泸天化	12,900	56,502.00	0.19

74	300047	天源迪科	4,800	56,400.00	0.19
75	002301	齐心集团	7,800	55,458.00	0.18
76	300048	合康新能	11,000	55,440.00	0.18
77	002979	雷赛智能	1,800	55,422.00	0.18
78	300825	阿尔特	4,900	55,370.00	0.18
79	600198	大唐电信	6,400	55,232.00	0.18
80	688165	埃夫特	2,082	54,964.80	0.18
81	000925	众合科技	6,300	54,621.00	0.18
82	600226	亨通股份	21,400	54,570.00	0.18
83	688158	优刻得	3,886	54,326.28	0.18
84	603018	华设集团	6,600	54,186.00	0.18
85	600843	上工申贝	4,300	54,094.00	0.18
86	600105	永鼎股份	10,900	54,064.00	0.18
87	300766	每日互动	3,700	54,057.00	0.18
88	002055	得润电子	7,500	54,000.00	0.18
89	000652	泰达股份	13,000	53,820.00	0.18
89	002277	友阿股份	9,200	53,820.00	0.18
90	300342	天银机电	3,300	53,559.00	0.18
91	688518	联赢激光	3,364	53,285.76	0.18
92	002685	华东重机	7,900	53,167.00	0.18
93	002640	跨境通	13,800	52,992.00	0.17
94	002338	奥普光电	1,400	52,808.00	0.17
95	002146	荣盛发展	31,800	52,470.00	0.17
96	300248	新开普	5,400	52,326.00	0.17
97	603686	福龙马	5,000	52,000.00	0.17
98	300378	鼎捷数智	2,000	51,740.00	0.17
99	603031	安孚科技	1,800	51,480.00	0.17
100	002122	汇洲智能	15,100	51,340.00	0.17
101	000700	模塑科技	7,300	51,246.00	0.17
102	300337	银邦股份	4,600	51,152.00	0.17
103	600525	长园集团	10,400	50,752.00	0.17
104	600503	华丽家族	19,500	50,700.00	0.17
105	300520	科大国创	2,200	50,336.00	0.17
106	600106	重庆路桥	9,000	50,310.00	0.17
107	000612	焦作万方	7,800	50,076.00	0.17
108	002947	恒铭达	1,500	49,995.00	0.17
109	603508	思维列控	2,100	49,938.00	0.16
110	300147	香雪制药	5,100	49,827.00	0.16
111	000521	长虹美菱	6,100	49,776.00	0.16
112	002361	神剑股份	9,100	49,595.00	0.16
113	300566	激智科技	2,500	49,300.00	0.16
114	603010	万盛股份	4,800	49,296.00	0.16
115	002533	金杯电工	5,000	49,200.00	0.16

116	000936	华西股份	6,000	49,020.00	0.16
117	603867	新化股份	2,000	48,760.00	0.16
118	600756	浪潮软件	3,400	48,722.00	0.16
119	300008	天海防务	10,400	48,672.00	0.16
120	002515	金字火腿	10,600	48,018.00	0.16
121	688591	泰凌微	1,526	47,916.40	0.16
122	002283	天润工业	9,000	47,880.00	0.16
123	002255	海陆重工	8,600	47,816.00	0.16
124	300194	福安药业	10,700	47,722.00	0.16
125	000731	四川美丰	6,500	47,710.00	0.16
126	002392	北京利尔	10,100	47,672.00	0.16
127	002970	锐明技术	1,000	47,630.00	0.16
128	002250	联化科技	8,600	47,386.00	0.16
129	600868	梅雁吉祥	19,000	47,120.00	0.16
130	300310	宜通世纪	6,200	46,872.00	0.15
131	688510	航亚科技	2,677	46,633.34	0.15
132	002119	康强电子	3,000	46,440.00	0.15
133	002364	中恒电气	4,300	46,397.00	0.15
134	002438	江苏神通	3,800	46,360.00	0.15
135	001283	豪鹏科技	800	46,312.00	0.15
136	002035	华帝股份	6,300	46,242.00	0.15
137	002919	名臣健康	2,800	46,060.00	0.15
138	600108	亚盛集团	15,700	46,001.00	0.15
139	300153	科泰电源	2,900	45,907.00	0.15
140	002039	黔源电力	3,000	45,780.00	0.15
141	002733	雄韬股份	3,300	45,672.00	0.15
142	300292	吴通控股	9,400	45,590.00	0.15
143	002166	莱茵生物	6,100	45,567.00	0.15
144	002570	贝因美	10,800	45,468.00	0.15
145	002111	威海广泰	4,100	45,182.00	0.15
146	002536	飞龙股份	3,900	45,162.00	0.15
147	603738	泰晶科技	3,000	44,940.00	0.15
148	002263	大东南	18,100	44,888.00	0.15
149	002022	科华生物	7,100	44,801.00	0.15
150	002892	科力尔	2,900	44,660.00	0.15
151	603890	春秋电子	3,800	44,650.00	0.15
152	000541	佛山照明	7,200	44,640.00	0.15
153	300213	佳讯飞鸿	5,800	44,602.00	0.15
154	002922	伊戈尔	2,500	44,550.00	0.15
155	002965	祥鑫科技	1,300	44,499.00	0.15
156	300228	富瑞特装	6,300	44,415.00	0.15
157	600742	一汽富维	5,000	44,250.00	0.15
158	002445	中南文化	18,000	44,100.00	0.15

159	002115	三维通信	6,600	43,890.00	0.14
160	000948	南天信息	2,600	43,498.00	0.14
161	002819	东方中科	1,600	43,488.00	0.14
162	000417	合百集团	6,800	43,384.00	0.14
163	300629	新劲刚	2,000	43,200.00	0.14
164	002491	通鼎互联	8,400	43,176.00	0.14
165	603035	常熟汽饰	3,000	43,170.00	0.14
166	002419	天虹股份	7,300	42,778.00	0.14
167	300684	中石科技	1,900	42,617.00	0.14
168	002406	远东传动	6,600	42,570.00	0.14
169	002639	雪人股份	6,200	42,470.00	0.14
170	300349	金卡智能	3,100	42,377.00	0.14
171	300469	信息发展	1,800	42,300.00	0.14
172	002884	凌霄泵业	2,300	42,021.00	0.14
172	600351	亚宝药业	6,900	42,021.00	0.14
173	002029	七匹狼	6,400	41,856.00	0.14
174	688508	芯朋微	974	41,852.78	0.14
175	603078	江化微	2,500	41,850.00	0.14
176	603322	超讯通信	1,100	41,800.00	0.14
177	603067	振华股份	3,300	41,679.00	0.14
178	688550	瑞联新材	1,322	41,365.38	0.14
179	002057	中钢天源	5,700	41,154.00	0.14
180	002876	三利谱	1,600	41,056.00	0.14
181	002224	三力士	9,500	41,040.00	0.14
182	002845	同兴达	2,700	40,932.00	0.14
183	600830	香溢融通	3,500	40,915.00	0.14
184	605196	华通线缆	3,500	40,880.00	0.13
185	002279	久其软件	6,500	40,755.00	0.13
186	000404	长虹华意	5,500	40,700.00	0.13
187	000561	烽火电子	4,600	40,664.00	0.13
188	600979	广安爱众	8,800	40,656.00	0.13
189	002935	天奥电子	2,520	40,572.00	0.13
190	603936	博敏电子	4,800	40,416.00	0.13
191	600251	冠农股份	5,500	40,095.00	0.13
192	002642	荣联科技	5,600	40,040.00	0.13
193	601929	吉视传媒	21,300	39,831.00	0.13
194	605305	中际联合	1,400	39,662.00	0.13
195	002474	榕基软件	6,600	39,534.00	0.13
196	600284	浦东建设	6,300	39,501.00	0.13
197	000926	福星股份	15,480	39,474.00	0.13
197	002662	京威股份	10,200	39,474.00	0.13
198	000551	创元科技	3,300	39,468.00	0.13
199	002538	司尔特	7,000	39,340.00	0.13

200	300467	迅游科技	2,500	39,325.00	0.13
201	002218	拓日新能	9,900	39,303.00	0.13
202	002386	天原股份	8,600	39,302.00	0.13
203	002046	国机精工	2,800	39,200.00	0.13
204	002033	丽江股份	4,400	39,028.00	0.13
205	002177	御银股份	8,600	38,700.00	0.13
205	002284	亚太股份	5,000	38,700.00	0.13
206	603855	华荣股份	1,900	38,551.00	0.13
207	600054	黄山旅游	3,400	38,420.00	0.13
208	000409	云鼎科技	4,300	38,313.00	0.13
209	002303	美盈森	10,700	38,306.00	0.13
210	300219	鸿利智汇	5,100	38,199.00	0.13
211	002580	圣阳股份	4,500	38,160.00	0.13
212	300081	恒信东方	5,300	38,054.00	0.13
213	000096	广聚能源	3,100	38,006.00	0.13
214	000852	石化机械	5,500	37,950.00	0.13
215	301096	百诚医药	1,000	37,940.00	0.13
216	603629	利通电子	1,900	37,829.00	0.12
217	002587	奥拓电子	6,300	37,800.00	0.12
218	002367	康力电梯	5,500	37,785.00	0.12
219	002137	实益达	4,200	37,758.00	0.12
220	002759	天际股份	4,300	37,711.00	0.12
221	300664	鹏鹞环保	6,400	37,632.00	0.12
222	002093	国脉科技	4,800	37,440.00	0.12
223	002328	新朋股份	6,100	37,393.00	0.12
224	300193	佳士科技	4,200	37,338.00	0.12
225	002296	辉煌科技	3,800	37,278.00	0.12
226	002225	濮耐股份	7,500	37,275.00	0.12
227	002014	永新股份	3,400	37,264.00	0.12
228	000922	佳电股份	3,300	37,257.00	0.12
229	002298	中电兴发	7,000	37,240.00	0.12
229	002869	金溢科技	1,400	37,240.00	0.12
230	002067	景兴纸业	9,400	37,224.00	0.12
231	002897	意华股份	900	37,215.00	0.12
232	002344	海宁皮城	8,000	37,200.00	0.12
232	002792	通宇通讯	2,500	37,200.00	0.12
233	002104	恒宝股份	5,500	37,180.00	0.12
233	603969	银龙股份	5,500	37,180.00	0.12
234	000823	超声电子	3,600	37,152.00	0.12
235	002483	润邦股份	7,100	36,991.00	0.12
236	002562	兄弟科技	8,700	36,975.00	0.12
237	002768	国恩股份	1,600	36,912.00	0.12
238	002519	银河电子	6,200	36,828.00	0.12

239	002401	中远海科	2,300	36,524.00	0.12
240	002962	五方光电	2,100	36,519.00	0.12
241	601226	华电科工	5,400	36,504.00	0.12
242	600230	沧州大化	3,400	36,448.00	0.12
243	600300	维维股份	11,300	36,386.00	0.12
244	001314	亿道信息	700	36,295.00	0.12
245	300241	瑞丰光电	6,600	36,234.00	0.12
246	600846	同济科技	4,200	36,204.00	0.12
247	601588	北辰实业	19,400	36,084.00	0.12
248	600855	航天长峰	2,800	36,064.00	0.12
249	002881	美格智能	1,200	35,952.00	0.12
250	002565	顺灏股份	11,800	35,872.00	0.12
251	000726	鲁 泰 A	5,500	35,860.00	0.12
252	603258	电魂网络	1,800	35,802.00	0.12
253	300441	鲍斯股份	4,100	35,752.00	0.12
254	603889	新澳股份	5,100	35,751.00	0.12
255	002540	亚太科技	5,800	35,728.00	0.12
256	603223	恒通股份	3,400	35,632.00	0.12
257	002452	长高电新	4,800	35,616.00	0.12
258	603111	康尼机电	5,900	35,577.00	0.12
259	600512	腾达建设	15,000	35,550.00	0.12
260	603878	武进不锈	6,200	35,464.00	0.12
261	605183	确成股份	2,100	35,385.00	0.12
262	301080	百普赛斯	800	35,312.00	0.12
263	603518	锦泓集团	3,600	35,280.00	0.12
264	002017	东信和平	3,400	35,258.00	0.12
265	603987	康德莱	4,900	35,182.00	0.12
266	002297	博云新材	5,100	35,088.00	0.12
267	000601	韶能股份	8,600	34,916.00	0.12
268	002345	潮宏基	6,000	34,860.00	0.12
269	600794	保税科技	9,600	34,848.00	0.12
270	600784	鲁银投资	5,900	34,751.00	0.11
271	002083	孚日股份	7,100	34,719.00	0.11
272	603387	基蛋生物	4,200	34,650.00	0.11
273	000713	丰乐种业	4,900	34,545.00	0.11
274	603367	辰欣药业	2,500	34,350.00	0.11
275	002752	昇兴股份	5,400	34,290.00	0.11
276	002735	王子新材	3,700	34,262.00	0.11
277	300976	达瑞电子	500	34,250.00	0.11
278	002165	红 宝 丽	8,000	34,240.00	0.11
279	600713	南京医药	6,900	34,224.00	0.11
280	600479	千金药业	3,200	34,176.00	0.11
281	000900	现代投资	7,700	33,957.00	0.11

282	002339	积成电子	4,900	33,761.00	0.11
283	600724	宁波富达	5,300	33,655.00	0.11
284	002358	森源电气	7,300	33,580.00	0.11
285	603416	信捷电气	800	33,560.00	0.11
286	603687	大胜达	4,600	33,534.00	0.11
287	600268	国电南自	4,980	33,465.60	0.11
288	002206	海利得	7,800	33,462.00	0.11
289	002783	凯龙股份	4,100	33,415.00	0.11
290	002376	新北洋	5,100	33,252.00	0.11
291	002448	中原内配	5,300	33,178.00	0.11
292	002132	恒星科技	12,100	33,154.00	0.11
293	002135	东南网架	7,800	33,150.00	0.11
294	002589	瑞康医药	11,100	32,967.00	0.11
295	002632	道明光学	3,700	32,930.00	0.11
296	002955	鸿合科技	1,400	32,928.00	0.11
297	000949	新乡化纤	8,200	32,882.00	0.11
298	300057	万顺新材	6,800	32,776.00	0.11
299	603002	宏昌电子	6,100	32,757.00	0.11
300	000507	珠海港	6,400	32,640.00	0.11
301	002140	东华科技	3,300	32,604.00	0.11
301	300481	濮阳惠成	2,200	32,604.00	0.11
302	688135	利扬芯片	1,624	32,593.68	0.11
303	300239	东宝生物	5,200	32,552.00	0.11
304	600425	青松建化	8,300	32,536.00	0.11
305	600590	泰豪科技	6,000	32,520.00	0.11
306	002026	山东威达	3,300	32,472.00	0.11
307	605555	德昌股份	1,500	32,460.00	0.11
308	603187	海容冷链	2,900	32,451.00	0.11
309	000592	平潭发展	11,300	32,431.00	0.11
310	300439	美康生物	3,100	32,395.00	0.11
311	002579	中京电子	4,100	32,390.00	0.11
312	600368	五洲交通	6,780	32,340.60	0.11
313	002664	信质集团	2,300	32,338.00	0.11
314	002556	辉隆股份	5,800	32,306.00	0.11
315	600103	青山纸业	12,600	32,256.00	0.11
316	600088	中视传媒	1,800	32,148.00	0.11
317	600207	安彩高科	7,200	32,112.00	0.11
318	002116	中国海诚	3,200	31,936.00	0.11
319	603668	天马科技	2,500	31,850.00	0.11
320	002669	康达新材	3,300	31,779.00	0.10
321	600880	博瑞传播	6,700	31,758.00	0.10
322	300740	水羊股份	2,400	31,728.00	0.10
323	000906	浙商中拓	4,800	31,680.00	0.10

324	002584	西陇科学	4,400	31,636.00	0.10
325	001338	永顺泰	2,900	31,552.00	0.10
326	002322	理工能科	2,500	31,475.00	0.10
327	600237	铜峰电子	4,800	31,440.00	0.10
328	300639	凯普生物	5,300	31,429.00	0.10
329	603012	创力集团	5,900	31,329.00	0.10
330	600035	楚天高速	6,800	31,280.00	0.10
331	601968	宝钢包装	6,300	31,185.00	0.10
332	600992	贵绳股份	2,100	31,080.00	0.10
333	002521	齐峰新材	3,100	31,062.00	0.10
334	002757	南兴股份	2,000	31,060.00	0.10
335	000863	三湘印象	8,000	31,040.00	0.10
336	002462	嘉事堂	2,400	31,008.00	0.10
337	601199	江南水务	5,600	30,968.00	0.10
338	002404	嘉欣丝绸	5,000	30,950.00	0.10
339	603167	渤海轮渡	3,500	30,940.00	0.10
340	300569	天能重工	6,200	30,876.00	0.10
341	000407	胜利股份	9,000	30,780.00	0.10
342	300066	三川智慧	7,800	30,732.00	0.10
342	300490	华自科技	3,900	30,732.00	0.10
343	003019	宸展光电	1,200	30,696.00	0.10
344	000544	中原环保	3,500	30,555.00	0.10
344	002950	奥美医疗	3,500	30,555.00	0.10
345	300105	龙源技术	4,000	30,520.00	0.10
346	603611	诺力股份	1,700	30,515.00	0.10
347	603199	九华旅游	900	30,375.00	0.10
348	002577	雷柏科技	1,600	30,288.00	0.10
349	300230	永利股份	6,800	30,260.00	0.10
350	603126	中材节能	3,600	30,240.00	0.10
351	603633	徕木股份	3,700	30,229.00	0.10
352	688073	毕得医药	613	30,135.08	0.10
353	688238	和元生物	6,098	30,124.12	0.10
354	600693	东百集团	4,300	30,100.00	0.10
355	000159	国际实业	5,000	30,000.00	0.10
356	000531	穗恒运 A	5,200	29,952.00	0.10
357	002771	真视通	1,700	29,886.00	0.10
358	300622	博士眼镜	600	29,880.00	0.10
359	301525	儒竞科技	500	29,800.00	0.10
360	600939	重庆建工	9,900	29,799.00	0.10
361	000751	锌业股份	10,600	29,786.00	0.10
362	002522	浙江众成	7,600	29,716.00	0.10
363	688687	凯因科技	1,374	29,650.92	0.10
364	600495	晋西车轴	7,800	29,640.00	0.10

364	600592	龙溪股份	3,000	29,640.00	0.10
365	603396	金辰股份	1,100	29,590.00	0.10
366	600510	黑牡丹	6,200	29,574.00	0.10
367	002471	中超控股	10,800	29,484.00	0.10
368	601616	广电电气	6,700	29,413.00	0.10
369	605377	华旺科技	2,200	29,370.00	0.10
370	001339	智微智能	800	29,272.00	0.10
371	002803	吉宏股份	2,300	29,164.00	0.10
372	603507	振江股份	1,210	29,088.40	0.10
373	600851	海欣股份	5,000	29,000.00	0.10
374	603357	设计总院	3,200	28,992.00	0.10
375	603912	佳力图	3,500	28,980.00	0.10
376	002282	博深股份	3,900	28,899.00	0.10
377	000530	冰山冷热	4,800	28,848.00	0.10
378	603061	金海通	400	28,832.00	0.10
379	300617	安靠智电	1,000	28,810.00	0.10
380	000045	深纺织 A	2,700	28,701.00	0.09
381	000905	厦门港务	4,000	28,640.00	0.09
382	300729	乐歌股份	1,800	28,584.00	0.09
383	002805	丰元股份	2,400	28,560.00	0.09
384	300258	精锻科技	3,200	28,512.00	0.09
385	600616	金枫酒业	5,000	28,500.00	0.09
386	002614	奥佳华	4,300	28,466.00	0.09
387	002479	富春环保	6,000	28,440.00	0.09
388	002264	新华都	4,600	28,428.00	0.09
389	000822	山东海化	5,000	28,400.00	0.09
390	688317	之江生物	1,747	28,388.75	0.09
391	300160	秀强股份	5,200	28,288.00	0.09
392	600526	菲达环保	6,300	28,287.00	0.09
393	605277	新亚电子	2,000	28,220.00	0.09
394	000788	北大医药	4,700	28,200.00	0.09
395	600814	杭州解百	3,400	28,186.00	0.09
396	600288	大恒科技	3,300	28,182.00	0.09
397	002870	香山股份	900	28,170.00	0.09
398	002350	北京科锐	3,700	28,120.00	0.09
399	688589	力合微	1,027	28,108.99	0.09
400	002609	捷顺科技	3,400	28,084.00	0.09
401	600551	时代出版	3,260	28,068.60	0.09
402	002478	常宝股份	5,300	28,037.00	0.09
403	002758	浙农股份	3,200	28,000.00	0.09
404	002560	通达股份	4,100	27,962.00	0.09
405	002454	松芝股份	4,200	27,930.00	0.09
406	688207	格灵深瞳	1,960	27,910.40	0.09

407	000710	贝瑞基因	3,300	27,885.00	0.09
408	600345	长江通信	1,200	27,744.00	0.09
409	603929	亚翔集成	1,000	27,730.00	0.09
410	300523	辰安科技	1,400	27,706.00	0.09
411	002606	大连电瓷	3,000	27,660.00	0.09
412	688678	福立旺	1,862	27,650.70	0.09
413	601579	会稽山	2,500	27,650.00	0.09
414	002543	万和电气	2,700	27,648.00	0.09
415	600152	维科技术	4,600	27,646.00	0.09
416	603896	寿仙谷	1,300	27,573.00	0.09
417	002090	金智科技	3,100	27,528.00	0.09
418	688620	安凯微	2,724	27,376.20	0.09
419	600626	申达股份	7,500	27,375.00	0.09
420	600826	兰生股份	3,180	27,348.00	0.09
421	002730	电光科技	2,000	27,320.00	0.09
422	600558	大西洋	6,700	27,269.00	0.09
423	000850	华茂股份	6,600	27,258.00	0.09
424	000862	银星能源	5,500	27,170.00	0.09
425	600721	百花医药	4,100	27,019.00	0.09
426	605108	同庆楼	1,100	26,961.00	0.09
427	600218	全柴动力	3,400	26,860.00	0.09
428	002933	新兴装备	900	26,847.00	0.09
429	002660	茂硕电源	2,600	26,832.00	0.09
430	300756	金马游乐	1,800	26,802.00	0.09
431	002917	金奥博	2,800	26,768.00	0.09
432	000554	泰山石油	4,500	26,730.00	0.09
433	603011	合锻智能	3,900	26,715.00	0.09
434	300381	溢多利	3,800	26,676.00	0.09
435	603158	腾龙股份	3,300	26,664.00	0.09
436	600730	中国高科	4,400	26,620.00	0.09
437	600278	东方创业	3,800	26,562.00	0.09
438	002829	星网宇达	1,400	26,544.00	0.09
439	601113	华鼎股份	6,800	26,520.00	0.09
440	301051	信濠光电	980	26,518.80	0.09
441	002342	巨力索具	8,200	26,486.00	0.09
442	002878	元隆雅图	1,600	26,368.00	0.09
443	600135	乐凯胶片	4,000	26,360.00	0.09
444	600467	好当家	11,400	26,334.00	0.09
445	000797	中国武夷	9,500	26,315.00	0.09
446	300636	同和药业	3,300	26,301.00	0.09
447	300259	新天科技	7,500	26,250.00	0.09
448	300939	秋田微	800	26,240.00	0.09
449	600523	贵航股份	2,200	26,224.00	0.09

450	300291	百纳千成	5,200	26,156.00	0.09
451	300440	运达科技	3,300	26,136.00	0.09
452	688456	有研粉材	783	26,026.92	0.09
453	603528	多伦科技	3,300	26,004.00	0.09
454	002398	垒知集团	5,900	25,901.00	0.09
455	301313	凡拓数创	1,000	25,880.00	0.09
456	600488	津药药业	6,100	25,864.00	0.09
457	002375	亚厦股份	6,700	25,862.00	0.09
458	000707	双环科技	3,500	25,830.00	0.09
458	002286	保龄宝	3,500	25,830.00	0.09
458	002331	皖通科技	3,500	25,830.00	0.09
459	300095	华伍股份	3,800	25,802.00	0.09
460	002213	大为股份	1,900	25,783.00	0.09
461	002148	北纬科技	3,900	25,779.00	0.09
462	600684	珠江股份	7,800	25,740.00	0.08
463	601089	福元医药	1,600	25,600.00	0.08
464	300447	全信股份	1,800	25,506.00	0.08
465	300265	通光线缆	3,100	25,482.00	0.08
466	600067	冠城新材	9,600	25,440.00	0.08
467	688233	神工股份	1,083	25,396.35	0.08
468	600668	尖峰集团	2,500	25,375.00	0.08
469	600228	返利科技	4,100	25,297.00	0.08
470	603339	四方科技	2,000	25,280.00	0.08
471	601008	连云港	6,600	25,278.00	0.08
472	688381	帝奥微	1,311	25,276.08	0.08
473	002551	尚荣医疗	8,200	25,256.00	0.08
473	600469	风神股份	4,100	25,256.00	0.08
474	001207	联科科技	1,300	25,207.00	0.08
475	601700	风范股份	5,600	25,200.00	0.08
476	600727	鲁北化工	3,400	25,194.00	0.08
477	605166	聚合顺	2,100	25,137.00	0.08
478	000153	丰原药业	4,100	25,133.00	0.08
479	002418	康盛股份	10,300	25,132.00	0.08
480	002957	科瑞技术	1,600	25,104.00	0.08
481	600892	大晟文化	6,800	25,092.00	0.08
482	605088	冠盛股份	1,000	25,080.00	0.08
483	603380	易德龙	1,000	24,990.00	0.08
484	000920	沃顿科技	2,800	24,976.00	0.08
485	603313	梦百合	3,700	24,975.00	0.08
486	600468	百利电气	5,300	24,910.00	0.08
487	000026	飞亚达	2,400	24,888.00	0.08
488	603601	再升科技	7,400	24,864.00	0.08
489	002321	华英农业	10,400	24,856.00	0.08

490	603060	国检集团	3,400	24,854.00	0.08
491	002838	道恩股份	2,100	24,801.00	0.08
492	002187	广百股份	3,500	24,780.00	0.08
493	301305	朗坤环境	1,400	24,668.00	0.08
494	301026	浩通科技	900	24,660.00	0.08
495	603950	长源东谷	1,400	24,654.00	0.08
496	300513	恒实科技	2,700	24,651.00	0.08
497	603648	畅联股份	2,400	24,624.00	0.08
498	688581	安杰思	412	24,592.28	0.08
499	600617	国新能源	9,100	24,570.00	0.08
500	300867	圣元环保	1,900	24,567.00	0.08
501	688560	明冠新材	1,914	24,480.06	0.08
502	300632	光莆股份	2,200	24,398.00	0.08
503	603365	水星家纺	1,500	24,300.00	0.08
504	301330	熵基科技	900	24,192.00	0.08
505	688033	天宜上佳	4,200	24,150.00	0.08
506	603538	美诺华	1,900	24,149.00	0.08
507	300706	阿石创	1,000	24,050.00	0.08
508	000505	京粮控股	3,900	24,024.00	0.08
509	002393	力生制药	1,360	23,990.40	0.08
510	603309	维力医疗	2,000	23,960.00	0.08
511	603610	麒盛科技	1,900	23,959.00	0.08
512	300365	恒华科技	3,900	23,946.00	0.08
513	603191	望变电气	1,900	23,921.00	0.08
514	002734	利民股份	3,000	23,910.00	0.08
515	300491	通合科技	1,500	23,880.00	0.08
515	300745	欣锐科技	1,500	23,880.00	0.08
516	300683	海特生物	1,000	23,840.00	0.08
517	300801	泰和科技	1,500	23,805.00	0.08
518	301093	华兰股份	1,000	23,800.00	0.08
519	600184	光电股份	2,300	23,736.00	0.08
520	603325	博隆技术	300	23,733.00	0.08
521	300215	电科院	4,000	23,720.00	0.08
522	002908	德生科技	2,700	23,652.00	0.08
523	603990	麦迪科技	2,300	23,644.00	0.08
524	600798	宁波海运	7,800	23,634.00	0.08
525	300483	首华燃气	2,400	23,616.00	0.08
526	301150	中一科技	1,100	23,584.00	0.08
527	002150	通润装备	1,900	23,560.00	0.08
528	002666	德联集团	5,400	23,544.00	0.08
529	603590	康辰药业	1,000	23,520.00	0.08
530	300375	鹏翎股份	5,100	23,511.00	0.08
531	603897	长城科技	1,000	23,500.00	0.08

531	605080	浙江自然	1,000	23,500.00	0.08
532	002442	龙星化工	3,900	23,439.00	0.08
533	002337	赛象科技	4,700	23,359.00	0.08
534	000421	南京公用	3,600	23,328.00	0.08
535	688458	美芯晟	709	23,219.75	0.08
536	301215	中汽股份	3,900	23,205.00	0.08
537	002186	全聚德	2,000	23,200.00	0.08
537	600636	国新文化	2,500	23,200.00	0.08
538	605319	无锡振华	1,100	23,155.00	0.08
539	002623	亚玛顿	1,500	23,145.00	0.08
540	600746	江苏索普	3,300	23,133.00	0.08
541	300575	中旗股份	3,800	23,066.00	0.08
542	000919	金陵药业	3,500	23,030.00	0.08
543	688210	统联精密	1,153	23,013.88	0.08
544	002788	鹭燕医药	2,800	22,988.00	0.08
545	605158	华达新材	1,800	22,950.00	0.08
546	002641	公元股份	5,200	22,880.00	0.08
547	603155	新亚强	1,700	22,865.00	0.08
548	000419	通程控股	4,000	22,840.00	0.08
549	600853	龙建股份	5,700	22,800.00	0.08
550	003026	中晶科技	700	22,785.00	0.08
551	600876	凯盛新能	2,400	22,776.00	0.08
552	002782	可立克	1,800	22,770.00	0.08
553	688186	广大特材	1,479	22,702.65	0.07
554	600052	东望时代	5,000	22,600.00	0.07
555	301123	奕东电子	1,100	22,495.00	0.07
556	603628	清源股份	1,800	22,464.00	0.07
557	301322	绿通科技	1,020	22,419.60	0.07
558	002658	雪迪龙	3,500	22,400.00	0.07
559	600222	太龙药业	4,400	22,396.00	0.07
560	603811	诚意药业	2,900	22,388.00	0.07
561	300903	科翔股份	2,800	22,372.00	0.07
562	300884	狄耐克	2,000	22,360.00	0.07
563	000978	桂林旅游	3,700	22,348.00	0.07
564	002552	宝鼎科技	1,700	22,304.00	0.07
564	600229	城市传媒	3,200	22,304.00	0.07
565	000779	甘咨询	2,700	22,221.00	0.07
566	603189	网达软件	1,500	22,185.00	0.07
567	002380	科远智慧	1,200	22,176.00	0.07
568	601218	吉鑫科技	6,800	22,168.00	0.07
569	000705	浙江震元	2,800	22,148.00	0.07
570	002329	皇氏集团	6,100	22,143.00	0.07
571	002661	克明食品	2,200	22,132.00	0.07

572	603053	成都燃气	2,200	22,066.00	0.07
573	300139	晓程科技	1,500	21,885.00	0.07
574	688399	硕世生物	333	21,884.76	0.07
575	601566	九牧王	2,600	21,866.00	0.07
576	002613	北玻股份	5,400	21,816.00	0.07
577	002863	今飞凯达	4,700	21,808.00	0.07
578	600513	联环药业	2,200	21,802.00	0.07
579	300818	耐普矿机	800	21,728.00	0.07
580	600594	益佰制药	6,100	21,716.00	0.07
581	002343	慈文传媒	3,500	21,700.00	0.07
582	002636	金安国纪	2,800	21,672.00	0.07
583	600858	银座股份	3,900	21,645.00	0.07
584	603916	苏博特	2,900	21,634.00	0.07
585	300940	南极光	1,600	21,600.00	0.07
586	603777	来伊份	1,400	21,588.00	0.07
587	002627	三峡旅游	4,300	21,586.00	0.07
588	002160	常铝股份	5,800	21,576.00	0.07
589	600716	凤凰股份	5,700	21,546.00	0.07
590	601177	杭齿前进	2,600	21,528.00	0.07
591	600982	宁波能源	5,200	21,424.00	0.07
592	603600	永艺股份	1,800	21,402.00	0.07
593	001288	运机集团	700	21,385.00	0.07
594	688609	九联科技	2,017	21,380.20	0.07
595	002885	京泉华	1,500	21,375.00	0.07
596	300501	海顺新材	1,600	21,360.00	0.07
597	605050	福然德	2,200	21,340.00	0.07
598	600960	渤海汽车	6,400	21,312.00	0.07
599	002864	盘龙药业	700	21,287.00	0.07
600	600168	武汉控股	4,800	21,264.00	0.07
601	688507	索辰科技	388	21,223.60	0.07
602	002546	新联电子	4,900	21,217.00	0.07
603	600215	派斯林	3,100	21,204.00	0.07
604	301260	格力博	1,600	21,200.00	0.07
605	603125	常青科技	1,100	21,120.00	0.07
606	603166	福达股份	2,900	21,083.00	0.07
607	600180	瑞茂通	4,900	21,070.00	0.07
608	601065	江盐集团	2,400	21,048.00	0.07
609	301379	天山电子	1,040	21,008.00	0.07
610	600785	新华百货	1,600	20,912.00	0.07
611	000655	金岭矿业	3,400	20,910.00	0.07
611	600638	新黄浦	4,100	20,910.00	0.07
611	603999	读者传媒	3,400	20,910.00	0.07
612	002196	方正电机	3,900	20,904.00	0.07

613	603520	司太立	2,400	20,856.00	0.07
614	002554	惠博普	8,300	20,833.00	0.07
615	002365	永安药业	2,600	20,774.00	0.07
616	603776	永安行	1,600	20,752.00	0.07
617	003043	华亚智能	500	20,700.00	0.07
618	002443	金洲管道	3,500	20,580.00	0.07
619	600419	天润乳业	2,200	20,482.00	0.07
620	688391	钜泉科技	672	20,395.20	0.07
621	603315	福鞍股份	1,900	20,368.00	0.07
622	600121	郑州煤电	4,700	20,351.00	0.07
623	002659	凯文教育	4,500	20,340.00	0.07
623	603081	大丰实业	1,800	20,340.00	0.07
624	301307	美利信	1,000	20,330.00	0.07
625	600257	大湖股份	4,300	20,296.00	0.07
626	601956	东贝集团	4,200	20,286.00	0.07
627	605167	利柏特	2,100	20,244.00	0.07
628	002441	众业达	2,600	20,228.00	0.07
629	601133	柏诚股份	1,800	20,196.00	0.07
630	301201	诚达药业	1,000	20,180.00	0.07
631	603136	天目湖	1,785	20,170.50	0.07
632	600854	春兰股份	4,400	20,152.00	0.07
633	600981	汇鸿集团	7,800	20,124.00	0.07
634	301103	何氏眼科	1,000	20,120.00	0.07
635	002961	瑞达期货	1,400	20,118.00	0.07
636	000965	天保基建	6,700	20,100.00	0.07
637	300571	平治信息	800	20,064.00	0.07
638	603333	尚纬股份	3,600	20,052.00	0.07
639	000607	华媒控股	5,400	20,034.00	0.07
640	002956	西麦食品	1,200	20,004.00	0.07
641	603112	华翔股份	1,600	20,000.00	0.07
642	300771	智莱科技	1,900	19,988.00	0.07
643	002381	双箭股份	3,000	19,980.00	0.07
644	002772	众兴菌业	2,700	19,899.00	0.07
645	600980	北矿科技	1,300	19,864.00	0.07
646	605399	晨光新材	1,700	19,856.00	0.07
647	002722	物产金轮	1,400	19,852.00	0.07
648	002852	道道全	2,400	19,824.00	0.07
648	300987	川网传媒	1,400	19,824.00	0.07
649	603170	宝立食品	1,300	19,786.00	0.07
650	603381	永臻股份	900	19,728.00	0.07
651	300306	远方信息	1,700	19,720.00	0.07
652	002687	乔治白	4,500	19,710.00	0.07
653	002799	环球印务	2,600	19,708.00	0.07

654	002227	奥 特 迅	1,600	19,696.00	0.07
655	603330	天洋新材	3,100	19,654.00	0.06
656	688606	奥泰生物	310	19,623.00	0.06
657	002860	星帅尔	2,000	19,620.00	0.06
658	603808	歌力思	2,800	19,572.00	0.06
659	000698	沈阳化工	5,800	19,546.00	0.06
660	688576	西山科技	315	19,523.70	0.06
661	600053	九鼎投资	1,400	19,418.00	0.06
662	600191	华资实业	2,800	19,376.00	0.06
663	603681	永冠新材	1,500	19,335.00	0.06
664	603232	格尔软件	1,500	19,320.00	0.06
665	002686	亿利达	3,600	19,296.00	0.06
665	600749	西藏旅游	1,800	19,296.00	0.06
666	603051	鹿山新材	800	19,288.00	0.06
667	603186	华正新材	800	19,272.00	0.06
668	002835	同为股份	1,000	19,200.00	0.06
669	300402	宝色股份	1,300	19,175.00	0.06
670	300195	长荣股份	3,400	19,142.00	0.06
671	300246	宝莱特	2,900	19,111.00	0.06
672	300909	汇创达	800	19,080.00	0.06
673	688468	科美诊断	2,785	19,077.25	0.06
674	002796	世嘉科技	1,700	19,074.00	0.06
675	001208	华菱线缆	2,100	19,068.00	0.06
676	301332	德尔玛	1,900	19,038.00	0.06
677	002918	蒙娜丽莎	1,800	19,008.00	0.06
678	002880	卫光生物	700	18,907.00	0.06
679	002598	山东章鼓	2,000	18,900.00	0.06
680	000529	广弘控股	3,200	18,880.00	0.06
681	603116	红蜻蜓	3,400	18,870.00	0.06
682	300805	电声股份	1,700	18,836.00	0.06
683	000570	苏常柴 A	3,700	18,833.00	0.06
684	605133	嵘泰股份	800	18,824.00	0.06
685	603135	中重科技	2,120	18,783.20	0.06
686	002731	萃华珠宝	2,000	18,780.00	0.06
687	002825	纳尔股份	2,400	18,768.00	0.06
688	002300	太阳电缆	3,500	18,690.00	0.06
689	002082	万邦德	2,900	18,647.00	0.06
690	603931	格林达	800	18,552.00	0.06
691	603966	法兰泰克	2,400	18,528.00	0.06
692	688246	嘉和美康	746	18,500.80	0.06
693	603618	杭电股份	3,400	18,462.00	0.06
694	600081	东风科技	1,800	18,450.00	0.06
695	603107	上海汽配	1,100	18,414.00	0.06

696	300962	中金辐照	1,100	18,403.00	0.06
697	002363	隆基机械	2,800	18,396.00	0.06
698	000993	闽东电力	2,200	18,370.00	0.06
699	002330	得利斯	4,200	18,354.00	0.06
700	603040	新坐标	800	18,336.00	0.06
701	603617	君禾股份	2,500	18,325.00	0.06
702	002975	博杰股份	600	18,276.00	0.06
703	000428	华天酒店	5,700	18,240.00	0.06
704	300485	赛升药业	2,600	18,226.00	0.06
704	601007	金陵饭店	2,600	18,226.00	0.06
705	688519	南亚新材	854	18,156.04	0.06
706	001359	平安电工	700	18,137.00	0.06
707	603324	盛剑科技	700	18,123.00	0.06
708	605286	同力日升	600	18,096.00	0.06
709	605066	天正电气	3,000	18,060.00	0.06
710	003020	立方制药	1,000	18,040.00	0.06
711	603062	麦加芯彩	500	17,995.00	0.06
712	603535	嘉诚国际	1,500	17,985.00	0.06
713	601798	蓝科高新	2,400	17,976.00	0.06
714	300951	博硕科技	600	17,922.00	0.06
715	603217	元利科技	1,100	17,908.00	0.06
716	300445	康斯特	1,100	17,897.00	0.06
717	605366	宏柏新材	3,300	17,886.00	0.06
718	000042	中洲控股	4,000	17,880.00	0.06
718	600386	北巴传媒	4,000	17,880.00	0.06
719	603817	海峡环保	3,200	17,856.00	0.06
720	688579	山大地纬	1,942	17,846.98	0.06
721	603421	鼎信通讯	2,500	17,825.00	0.06
722	301257	普蕊斯	660	17,793.60	0.06
723	601518	吉林高速	6,400	17,792.00	0.06
724	600533	栖霞建设	7,600	17,784.00	0.06
725	605098	行动教育	500	17,620.00	0.06
726	002677	浙江美大	2,400	17,616.00	0.06
727	600792	云煤能源	4,700	17,578.00	0.06
728	600758	辽宁能源	5,100	17,544.00	0.06
729	603408	建霖家居	1,400	17,542.00	0.06
730	000789	万年青	3,500	17,535.00	0.06
730	001298	好上好	700	17,535.00	0.06
731	301248	杰创智能	1,100	17,468.00	0.06
732	300787	海能实业	1,300	17,446.00	0.06
733	002412	汉森制药	2,900	17,429.00	0.06
734	000576	甘化科工	2,400	17,424.00	0.06
735	605299	舒华体育	2,200	17,358.00	0.06

736	603727	博迈科	1,500	17,220.00	0.06
737	002646	天佑德酒	1,600	17,200.00	0.06
738	300616	尚品宅配	1,400	17,150.00	0.06
739	002576	通达动力	1,000	17,140.00	0.06
740	002940	昂利康	1,300	17,134.00	0.06
741	301185	鸥玛软件	1,000	17,080.00	0.06
742	000411	英特集团	1,600	17,040.00	0.06
743	002164	宁波东力	3,400	17,034.00	0.06
744	603275	众辰科技	500	17,020.00	0.06
745	603082	北自科技	500	16,950.00	0.06
746	603665	康隆达	1,200	16,944.00	0.06
747	003025	思进智能	1,200	16,908.00	0.06
747	301328	维峰电子	400	16,908.00	0.06
748	301329	信音电子	800	16,840.00	0.06
749	002133	广宇集团	6,600	16,830.00	0.06
750	301115	建科股份	1,200	16,788.00	0.06
751	301389	隆扬电子	1,000	16,720.00	0.06
752	000715	中兴商业	2,400	16,680.00	0.06
752	603386	骏亚科技	1,500	16,680.00	0.06
753	003013	地铁设计	1,100	16,632.00	0.05
753	600173	卧龙地产	4,200	16,632.00	0.05
754	603153	上海建科	800	16,616.00	0.05
755	603788	宁波高发	1,200	16,596.00	0.05
756	002999	天禾股份	2,800	16,576.00	0.05
757	301261	恒工精密	400	16,552.00	0.05
758	002394	联发股份	2,200	16,544.00	0.05
759	002969	嘉美包装	5,300	16,483.00	0.05
760	301397	溯联股份	640	16,480.00	0.05
761	600262	北方股份	900	16,479.00	0.05
762	001219	青岛食品	1,200	16,476.00	0.05
763	603390	通达电气	1,500	16,470.00	0.05
764	688509	正元地信	4,128	16,388.16	0.05
765	603815	交建股份	2,900	16,327.00	0.05
766	002977	天箭科技	600	16,326.00	0.05
767	605588	冠石科技	400	16,304.00	0.05
768	601999	出版传媒	2,600	16,302.00	0.05
769	600249	两面针	3,200	16,288.00	0.05
770	002548	金新农	4,100	16,277.00	0.05
771	600665	天地源	5,200	16,276.00	0.05
772	002903	宇环数控	1,000	16,250.00	0.05
773	688170	德龙激光	722	16,237.78	0.05
774	001238	浙江正特	600	16,218.00	0.05
775	603689	皖天然气	1,800	16,164.00	0.05

776	300645	正元智慧	1,100	16,159.00	0.05
777	603239	浙江仙通	1,200	16,140.00	0.05
778	688308	欧科亿	894	16,136.70	0.05
779	603173	福斯达	700	16,135.00	0.05
780	300650	太龙股份	1,400	16,100.00	0.05
781	688369	致远互联	802	16,096.14	0.05
782	301349	信德新材	500	16,090.00	0.05
783	301195	北路智控	500	16,055.00	0.05
784	603109	神驰机电	900	15,975.00	0.05
785	603285	键邦股份	700	15,960.00	0.05
786	301323	新莱福	400	15,948.00	0.05
787	603586	金麒麟	1,100	15,917.00	0.05
788	002909	集泰股份	3,200	15,904.00	0.05
789	001328	登康口腔	500	15,880.00	0.05
790	688121	卓然股份	1,469	15,821.13	0.05
791	001201	东瑞股份	1,000	15,820.00	0.05
792	603823	百合花	1,700	15,810.00	0.05
793	301369	联动科技	300	15,714.00	0.05
794	002983	芯瑞达	800	15,712.00	0.05
795	603758	秦安股份	1,900	15,694.00	0.05
796	601996	丰林集团	7,300	15,622.00	0.05
797	688552	航天南湖	935	15,614.50	0.05
798	688080	映翰通	474	15,604.08	0.05
799	603739	蔚蓝生物	1,300	15,587.00	0.05
800	301391	卡莱特	420	15,544.20	0.05
801	301509	金凯生科	600	15,528.00	0.05
802	002989	中天精装	700	15,456.00	0.05
803	002724	海洋王	2,900	15,428.00	0.05
804	301520	万邦医药	400	15,400.00	0.05
805	688334	西高院	942	15,382.86	0.05
806	603661	恒林股份	500	15,320.00	0.05
807	603399	永杉锂业	1,700	15,300.00	0.05
807	603861	白云电器	1,700	15,300.00	0.05
808	300982	苏文电能	800	15,288.00	0.05
809	603230	内蒙新华	1,200	15,192.00	0.05
810	603630	拉芳家化	1,100	15,158.00	0.05
811	603938	三孚股份	1,400	15,134.00	0.05
812	301439	泓淋电力	1,100	15,125.00	0.05
813	300414	中光防雷	1,900	15,124.00	0.05
814	605388	均瑶健康	2,400	15,096.00	0.05
815	002566	益盛药业	2,200	15,004.00	0.05
816	001300	三柏硕	1,300	14,963.00	0.05
817	603375	盛景微	400	14,956.00	0.05

818	000798	中水渔业	2,000	14,820.00	0.05
819	301318	维海德	500	14,760.00	0.05
820	603967	中创物流	1,500	14,715.00	0.05
821	600359	新农开发	2,300	14,697.00	0.05
822	605136	丽人丽妆	1,700	14,671.00	0.05
823	002644	佛慈制药	1,900	14,668.00	0.05
824	301282	金禄电子	700	14,665.00	0.05
825	600573	惠泉啤酒	1,300	14,638.00	0.05
826	603028	赛福天	2,400	14,544.00	0.05
827	002333	罗普斯金	2,800	14,420.00	0.05
827	605378	野马电池	700	14,420.00	0.05
828	301292	海科新源	1,100	14,388.00	0.05
829	300922	天秦装备	1,000	14,350.00	0.05
830	003028	振邦智能	400	14,340.00	0.05
831	301122	采纳股份	700	14,161.00	0.05
832	301235	华康医疗	700	14,147.00	0.05
833	605018	长华集团	1,600	14,048.00	0.05
834	301158	德石股份	1,000	14,030.00	0.05
835	001212	中旗新材	600	14,028.00	0.05
836	603206	嘉环科技	800	13,904.00	0.05
837	300511	雪榕生物	4,000	13,880.00	0.05
838	605208	永茂泰	1,800	13,878.00	0.05
839	002616	长青集团	2,900	13,862.00	0.05
840	002040	南 京 港	2,100	13,839.00	0.05
841	603359	东珠生态	2,500	13,825.00	0.05
842	002900	哈三联	1,400	13,790.00	0.05
843	301102	兆讯传媒	1,260	13,771.80	0.05
844	301387	光大同创	400	13,720.00	0.05
845	600897	厦门空港	900	13,707.00	0.05
846	300488	恒锋工具	500	13,680.00	0.05
847	603278	大业股份	1,800	13,662.00	0.05
848	002136	安 纳 达	1,400	13,650.00	0.05
848	301139	元道通信	600	13,650.00	0.05
848	603270	金帝股份	700	13,650.00	0.05
849	603215	比依股份	800	13,616.00	0.04
850	301126	达嘉维康	1,300	13,572.00	0.04
851	003005	竞业达	500	13,560.00	0.04
852	003027	同兴科技	900	13,536.00	0.04
853	301519	舜禹股份	1,000	13,510.00	0.04
854	603165	荣晟环保	1,100	13,464.00	0.04
855	002495	佳隆股份	5,300	13,462.00	0.04
856	002688	金河生物	3,000	13,410.00	0.04
857	002574	明牌珠宝	2,900	13,369.00	0.04

858	301418	协昌科技	400	13,340.00	0.04
859	603096	新经典	700	13,265.00	0.04
860	603908	牧高笛	600	13,260.00	0.04
861	603095	越剑智能	600	13,206.00	0.04
862	300963	中洲特材	1,500	13,155.00	0.04
863	600828	茂业商业	3,000	13,110.00	0.04
864	603579	荣泰健康	900	13,050.00	0.04
865	002492	恒基达鑫	2,700	12,987.00	0.04
866	301028	东亚机械	1,200	12,948.00	0.04
867	603917	合力科技	1,100	12,925.00	0.04
868	002968	新大正	1,400	12,894.00	0.04
869	301518	长华化学	800	12,856.00	0.04
870	603017	中衡设计	1,600	12,848.00	0.04
871	300958	建工修复	1,100	12,672.00	0.04
872	603391	力聚热能	300	12,627.00	0.04
873	301515	港通医疗	700	12,586.00	0.04
874	002732	燕塘乳业	800	12,568.00	0.04
875	603933	睿能科技	800	12,432.00	0.04
876	688189	南新制药	1,900	12,426.00	0.04
877	603065	宿迁联盛	1,700	12,359.00	0.04
878	301210	金杨股份	400	12,292.00	0.04
879	300512	中亚股份	1,800	12,258.00	0.04
880	603818	曲美家居	4,500	12,240.00	0.04
881	003007	直真科技	400	12,204.00	0.04
882	688201	信安世纪	1,381	12,194.23	0.04
883	002084	海鸥住工	4,200	12,096.00	0.04
884	300732	设研院	1,800	12,024.00	0.04
885	600774	汉商集团	1,600	11,984.00	0.04
886	603373	安邦护卫	400	11,956.00	0.04
887	605058	澳弘电子	600	11,898.00	0.04
888	001360	南矿集团	900	11,880.00	0.04
889	605177	东亚药业	600	11,820.00	0.04
890	301092	争光股份	500	11,665.00	0.04
891	301319	唯特偶	400	11,664.00	0.04
892	300625	三雄极光	1,000	11,660.00	0.04
893	301337	亚华电子	400	11,640.00	0.04
894	603276	恒兴新材	850	11,594.00	0.04
895	688551	科威尔	414	11,587.86	0.04
896	688569	铁科轨道	540	11,464.20	0.04
897	603787	新日股份	1,100	11,462.00	0.04
898	001378	德冠新材	500	11,460.00	0.04
898	301170	锡南科技	500	11,460.00	0.04
899	603231	索宝蛋白	700	11,459.00	0.04

900	301166	优宁维	400	11,352.00	0.04
901	301106	骏成科技	400	11,264.00	0.04
902	603190	亚通精工	500	11,210.00	0.04
903	603982	泉峰汽车	1,400	11,144.00	0.04
904	001358	兴欣新材	500	11,140.00	0.04
905	603261	立航科技	400	11,120.00	0.04
906	603836	海程邦达	900	10,944.00	0.04
907	001367	海森药业	400	10,896.00	0.04
908	300946	恒而达	400	10,864.00	0.04
909	605398	新炬网络	500	10,860.00	0.04
910	603289	泰瑞机器	1,300	10,725.00	0.04
911	002982	湘佳股份	600	10,710.00	0.04
912	605118	力鼎光电	600	10,686.00	0.04
913	605389	长龄液压	400	10,652.00	0.04
914	301151	冠龙节能	700	10,633.00	0.04
915	603163	圣晖集成	400	10,628.00	0.04
916	301225	恒勃股份	400	10,616.00	0.04
917	001282	三联锻造	500	10,500.00	0.03
918	301181	标榜股份	500	10,495.00	0.03
919	002907	华森制药	800	10,400.00	0.03
920	001216	华瓷股份	800	10,200.00	0.03
921	605005	合兴股份	600	9,780.00	0.03
922	002887	绿茵生态	1,400	9,758.00	0.03
923	603353	和顺石油	600	9,630.00	0.03
924	603768	常青股份	800	9,616.00	0.03
925	301258	富士莱	400	9,448.00	0.03
926	605068	明新旭腾	700	9,415.00	0.03
927	301587	中瑞股份	400	9,400.00	0.03
928	002972	科安达	900	9,360.00	0.03
928	605086	龙高股份	300	9,360.00	0.03
929	301112	信邦智能	400	9,348.00	0.03
930	001266	宏英智能	400	9,264.00	0.03
931	001318	阳光乳业	800	9,096.00	0.03
932	001331	胜通能源	800	8,808.00	0.03
933	001268	联合精密	500	8,730.00	0.03
934	001316	润贝航科	300	8,700.00	0.03
935	001234	泰慕士	500	8,385.00	0.03
936	688419	耐科装备	261	8,111.88	0.03
937	000663	永安林业	1,500	8,100.00	0.03
938	688667	菱电电控	200	8,038.00	0.03
939	002858	力盛体育	700	8,008.00	0.03
940	605151	西上海	500	8,005.00	0.03
941	301528	多浦乐	200	7,800.00	0.03

942	301512	智信精密	200	7,760.00	0.03
943	688310	迈得医疗	697	7,527.60	0.02
944	603937	丽岛新材	800	7,248.00	0.02
945	001387	雪祺电气	500	6,935.00	0.02
946	001326	联域股份	200	6,756.00	0.02
947	603280	南方路机	300	6,264.00	0.02
948	688618	三旺通信	297	6,239.97	0.02
949	301279	金道科技	300	6,057.00	0.02
950	002593	日上集团	800	4,056.00	0.01

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
无。

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	600133	东湖高新	526,614.00	1.17
2	600114	东睦股份	447,380.00	1.00
3	600200	江苏吴中	367,925.00	0.82
4	688076	诺泰生物	365,913.50	0.81
5	600226	亨通股份	357,968.00	0.80
6	600094	大名城	353,544.00	0.79
7	601020	华钰矿业	350,813.00	0.78
8	600410	华胜天成	350,772.00	0.78
9	603496	恒为科技	326,564.00	0.73
10	603619	中曼石油	323,090.00	0.72
11	601500	通用股份	310,925.00	0.69
12	603018	华设集团	295,949.92	0.66
13	600088	中视传媒	290,966.00	0.65
14	603227	雪峰科技	285,161.00	0.63
15	600186	莲花控股	284,920.00	0.63
16	600106	重庆路桥	284,877.00	0.63
17	600609	金杯汽车	284,498.00	0.63
18	600742	一汽富维	284,479.00	0.63
19	600525	长园集团	283,215.00	0.63
20	603283	赛腾股份	278,584.00	0.62

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	600133	东湖高新	713,760.49	1.59

2	600114	东睦股份	600,592.00	1.34
3	688076	诺泰生物	491,724.18	1.09
4	601020	华钰矿业	488,246.00	1.09
5	600094	大名城	469,832.00	1.05
6	603283	赛腾股份	445,728.00	0.99
7	603496	恒为科技	434,205.00	0.97
8	603619	中曼石油	421,745.00	0.94
9	601500	通用股份	414,071.00	0.92
10	600200	江苏吴中	394,255.00	0.88
11	600186	莲花控股	392,248.00	0.87
12	600410	华胜天成	385,843.00	0.86
13	600226	亨通股份	385,703.00	0.86
14	600461	洪城环境	364,520.00	0.81
15	688062	迈威生物	362,360.35	0.81
16	600640	国脉文化	349,202.00	0.78
17	600866	星湖科技	348,415.00	0.78
18	600088	中视传媒	347,320.11	0.77
19	600894	广日股份	342,521.00	0.76
20	600664	哈药股份	335,512.00	0.75

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	95,952,965.39
卖出股票收入（成交）总额	98,837,644.49

注：8.4.1 项“买入金额”、8.4.2 项“卖出金额”及 8.4.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额（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	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	5,000.20	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	5,000.20	0.02

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	占基金资产净值比例（%）
1	123251	华医转债	50	5,000.20	0.02

注：报告期末，本基金仅持有上述 1 只债券。

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

无。

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

无。

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

无。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

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

无。

8.11.2 本期国债期货投资评价

无。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

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

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	12,927.11
2	应收清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,927.11

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细
无。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明
无。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明
无。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分
无。

§ 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

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 (%)
544	53,274.06	18,742,648.00	64.67	10,238,440.00	35.33

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	中信建投证券股份有限公司	6,817,113.00	23.52
2	招商证券股份有限公司	3,379,223.00	11.66
3	BARCLAYS BANK PLC	3,132,401.00	10.81
4	左焰	2,030,000.00	7.00
5	华泰证券股份有限公司	1,798,609.00	6.21
6	海通证券股份有限公司	1,520,027.00	5.24
7	中信证券股份有限公司	852,885.00	2.94
8	国泰君安证券股份有限公司	642,368.00	2.22

9	日照市安达爆破工程 有限公司	600,021.00	2.07
10	赵广莉	560,043.00	1.93

注：上述基金持有人份额均为场内基金份额。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

9.5 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情况

无。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2023 年 9 月 14 日） 基金份额总额	490,981,088.00
本报告期期初基金份额总额	43,981,088.00
本报告期基金总申购份额	147,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	162,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	28,981,088.00

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内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

（1）基金管理人的重大人事变动情况

2024 年 8 月 9 日本基金管理人发布公告，赵学军先生辞任公司董事长，由联席董事长安国勇先生代行公司董事长职责。

2024 年 9 月 19 日本基金管理人发布公告，安国勇先生任公司董事长。

2024 年 12 月 4 日本基金管理人发布公告，张峰先生离任公司副总经理、郭杰先生离任机构首席投资官。

2024 年 12 月 19 日本基金管理人发布公告，鲁令飞先生任公司副总经理、张敏女士任公司副总经理。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、本基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）会计师事务所为本基金提供审计服务，自 2024 年 11 月 16 日起，改聘德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）会计师事务所为本基金提供审计服务。报告年度应支付德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）的审计费 11,065.80 元，该审计机构第 1 年提供审计服务。

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，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

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 (%)	
中信证券股份有限公司	6	173,049,077.41	88.84	91,650.79	95.78	—
广发证券股份有限公司	2	18,657,772.28	9.58	3,468.65	3.62	—
中信建投证券股份有限公司	2	3,083,760.19	1.58	573.48	0.60	—

有限公司						
------	--	--	--	--	--	--

注：1. 本表“佣金”指本基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该等券商的佣金合计。

2. 交易单元的选择标准和程序

- (1) 经营行为规范；
- (2) 财务状况良好；
- (3) 合规风控能力较强；
- (4) 交易服务能力较强；

基金管理人根据以上标准进行考察后确定租用券商的交易单元。基金管理人与被选择的券商签订协议，并通知基金托管人。

3. 报告期内，本基金新增以下交易单元：广发证券股份有限公司新增交易单元 2 个，中信建投证券股份有限公司新增交易单元 2 个。

4. 本部分的数据统计时间区间与本报告的报告期一致；本公司网站披露的《嘉实基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）》的报告期为 2024 年 7 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日。敬请投资者关注上述报告统计时间区间的口径差异。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
中信证券股份有限公司	70,888.09	100.00	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

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	嘉实基金管理有限公司关于指定旗下部分证券投资基金主流动性服务商公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 1 月 8 日
2	嘉实基金管理有限公司关于指定旗下部分证券投资基金主流动性服务商的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 1 月 29 日
3	关于嘉实中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金资产净值连续低于 5000 万元的提示性公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 4 月 15 日
4	关于嘉实中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金资产净值连续低于 5000 万元的提示性公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 4 月 29 日
5	关于嘉实中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商终止的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 5 月 20 日
6	关于嘉实中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商终止的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 5 月 29 日
7	关于嘉实中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金资产净值连续低于 5000 万元的提示性公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 6 月 21 日
8	嘉实基金管理有限公司关于指定旗下部分证券投资基金主流动性服务商的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 6 月 28 日
9	关于嘉实中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金资产净值连续低于 5000 万元的提示性公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 7 月 5 日
10	关于嘉实中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金资产净值连续低于 5000 万元的提示性公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 7 月 12 日
11	关于嘉实中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商终止的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 7 月 15 日
12	关于嘉实中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商终止的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 7 月 26 日
13	嘉实基金管理有限公司关于指定旗下部分证券投资基金主流动性服务商的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 8 月 28 日
14	嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 9 月 19 日
15	嘉实中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金溢价风险提示公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基	2024 年 10 月 9 日

		金电子披露网站	
16	嘉实基金管理有限公司关于旗下基金改聘会计师事务所的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 11 月 16 日
17	嘉实基金管理有限公司关于调整证券投资基金主流动性服务商的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 11 月 23 日
18	嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 12 月 4 日
19	嘉实基金管理有限公司关于调低旗下部分基金管理费率、托管费率并修订基金合同及托管协议的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 12 月 19 日
20	嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 12 月 19 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比(%)
机构	1	2024-07-26 至 2024-08-06, 2024-09-24 至 2024-09-26 至 2024-09-29, 2024-11-05 至 2024-11-06, 2024-11-18 至 2024-11-19, 2024-12-24 至 2024-12-31	4, 285, 781 . 00	159, 465, 292. 00	156, 933, 960. 00	6, 817, 113. 00	23. 52
	2	2024-05-15 至 2024-05-15, 2024-05-20 至 2024-05-30, 2024-08-21 至 2024-08-21	2, 037, 924 . 00	59, 378, 287. 00	58, 036, 988. 00	3, 379, 223. 00	11. 66
产品特有风险							

报告期内本基金出现了单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况。

未来本基金如果出现巨额赎回甚至集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产，可能对基金份额净值产生一定的影响；极端情况下可能引发基金的流动性风险，发生暂停赎回或延缓支付赎回款项；若个别投资者巨额赎回后本基金连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元，还可能面临转换运作方式或者与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

注：申购份额包括申购、转换转入、红利再投或份额拆分等导致增加的份额，赎回份额包括赎回、转换转出或份额合并等导致减少的份额。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予嘉实中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复文件。
- (2) 《嘉实中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- (4) 《嘉实中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 报告期内嘉实中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金公告的各项原稿。

13.2 存放地点

北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层嘉实基金管理有限公司

13.3 查阅方式

(1) 书面查询：查阅时间为每工作日 8:30-11:30, 13:00-17:30。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件。

(2) 网站查询：基金管理人网址：<http://www.jsfund.cn>

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人嘉实基金管理有限公司，咨询电话 400-600-8800，或发 E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司

2025 年 3 月 28 日