
华夏创业板综合交易型开放式指数

证券投资基金

2024 年年度报告

2024 年 12 月 31 日

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：国泰君安证券股份有限公司

送出日期：二〇二五年三月三十一日

§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。

基金托管人国泰君安证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中的财务资料经审计，安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2024 年 2 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	1
§2 基金简介	3
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	4
3.1 主要会计数据和财务指标	4
3.2 基金净值表现	4
3.3 过去三年基金的利润分配情况	6
§4 管理人报告	6
§5 托管人报告	13
§6 审计报告	13
§7 年度财务报表	15
7.1 资产负债表	15
7.2 利润表	16
7.3 净资产变动表	18
7.4 报表附注	18
§8 投资组合报告	40
8.1 期末基金资产组合情况	40
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	41
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	57
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	59
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	59
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	59
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	59
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	59
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	59
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	60
8.12 投资组合报告附注	60
§9 基金份额持有人信息	60
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	60
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	61
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的情况	61
§10 开放式基金份额变动	61
§11 重大事件揭示	62
§12 影响投资者决策的其他重要信息	65
§13 备查文件目录	67

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏创业板综合交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华夏创业板综合 ETF
场内简称	创业板综 ETF 华夏
基金主代码	159563
交易代码	159563
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2024 年 2 月 1 日
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	国泰君安证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	59,360,773.00 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	2024 年 2 月 23 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。
投资策略	主要投资策略包括组合复制策略，替代性策略，存托凭证投资策略，衍生品投资策略，债券投资策略，可转换债券、可交换债券投资策略，资产支持证券投资策略，融资、转融通证券出借业务投资策略等。
业绩比较基准	创业板综合指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，紧密跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

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		华夏基金管理有限公司	国泰君安证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李彬	帅芳
	联系电话	400-818-6666	021-38031815
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	tgrxp@tg.gtja.com
客户服务电话		400-818-6666	021-38917599-5
传真		010-63136700	021-38677819
注册地址		北京市顺义区安庆大街甲3号院	中国（上海）自由贸易试验区商城路618号
办公地址		北京市朝阳区北辰西路6号院北辰中心C座5层	上海市静安区新闻路669号博华广场19楼
邮政编码		100101	200041
法定代表人		张佑君	朱健

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.ChinaAMC.com
基金年度报告备置地点	基金管理人和/或基金托管人的住所/办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层
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 2 月 1 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
本期已实现收益	21,326,269.52
本期利润	19,327,698.15
加权平均基金份额本期利润	0.4115
本期加权平均净值利润率	36.82%
本期基金份额净值增长率	24.62%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末
期末可供分配利润	14,615,247.69
期末可供分配基金份额利润	0.2462
期末基金资产净值	73,976,020.69
期末基金份额净值	1.2462
3.1.3 累计期末指标	2024 年末
基金份额累计净值增长率	24.62%

注：①所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。

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

④本基金合同于 2024 年 2 月 1 日生效。

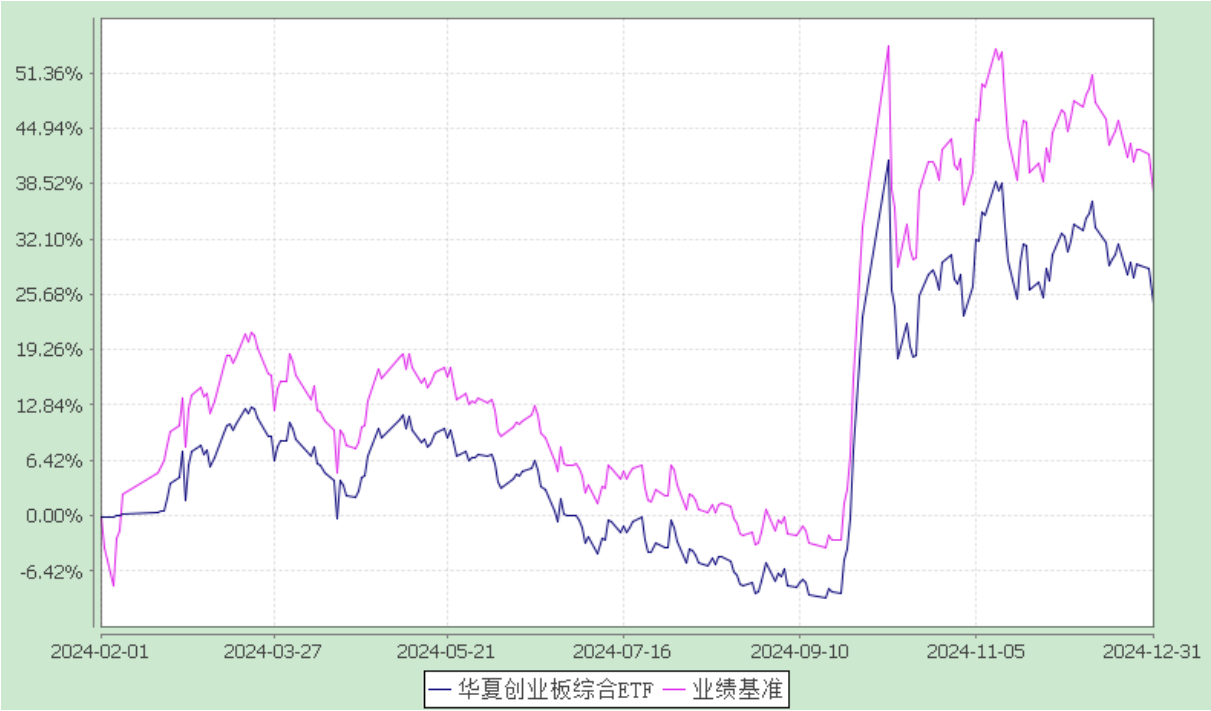
3.2 基金净值表现

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	1.35%	3.19%	3.06%	3.31%	-1.71%	-0.12%
过去六个月	24.64%	2.83%	29.93%	2.95%	-5.29%	-0.12%
自基金合同生效起至今	24.62%	2.34%	37.49%	2.55%	-12.87%	-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

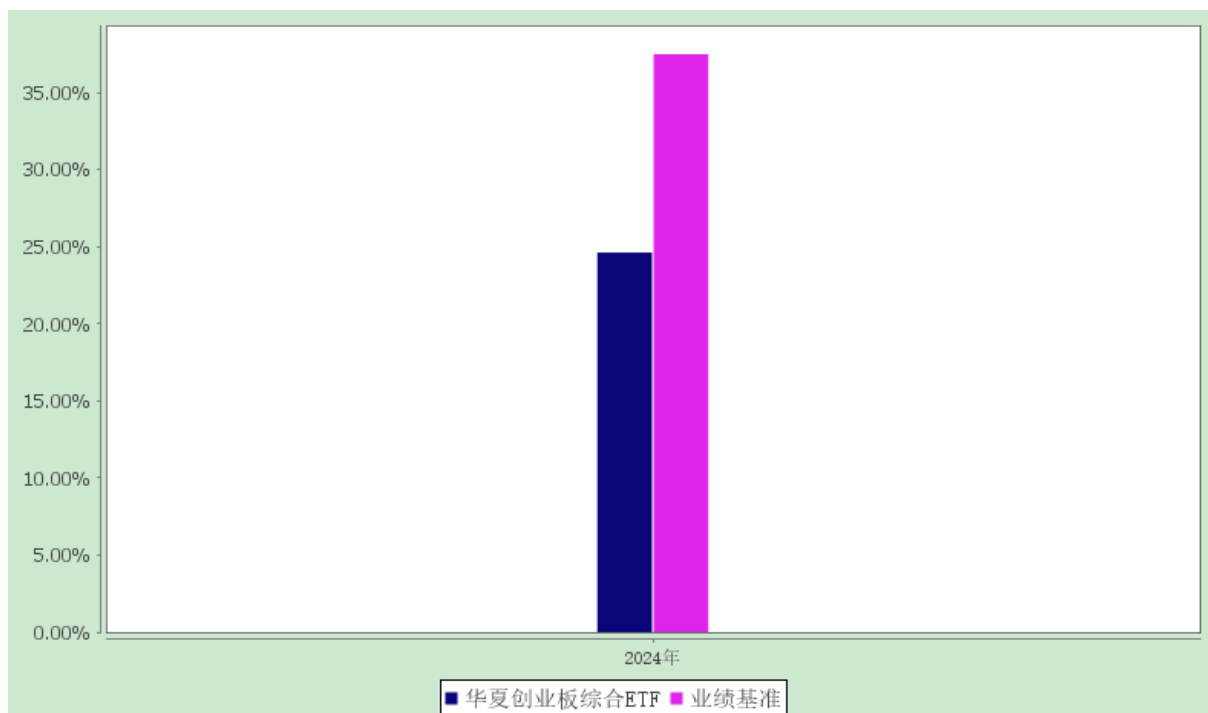
华夏创业板综合交易型开放式指数证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2024 年 2 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日)



注：①本基金合同于 2024 年 2 月 1 日生效。
②根据本基金的基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同中投资范围、投资限制的有关约定。

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

华夏创业板综合交易型开放式指数证券投资基金
自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同于 2024 年 2 月 1 日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效以来无利润分配事项。

§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

华夏基金管理有限公司成立于 1998 年 4 月 9 日，是经中国证监会批准成立的首批全国性基金管理公司之一。公司总部设在北京，在北京、上海、深圳、成都、南京、杭州、广州、青岛、武汉及沈阳设有分公司，在香港、深圳、上海、北京设有子公司。公司是首批全国社保基金管理人、首批企业年金基金管理人、境内首批 QDII 基金管理人、境内首只 ETF 基金管理人、境内首只沪港通 ETF 基金管理人、首批内地与香港基金互认基金管理人、首批基本养老保险基金投资管理人资格、首家加入联合国责任投资原则组织的公募基金公司、首批公募 FOF 基金管理人、首批公募养老目标基金管理人、首批个人养老金基金管理人、境内首批中日互通 ETF 基金管理人、首批商品期货 ETF 基金管理人、首批公募 MOM 基金管理人、首批纳入互联互通 ETF 基金管理人、首批北交所主题基金管理人以及特定客户资产管理人、保险资金投资管理人、公募 REITs 管理人，境内首家承诺“碳中和”具体目标和路径的公募基金公司，香港子公司是首批 RQFII 基金管理人。华夏基金是业务领域最广泛

的基金管理公司之一。

华夏基金是境内权益 ETF 管理规模最大的基金管理公司之一，在指数基金管理方面积累了丰富的经验，形成了覆盖宽基、港股、行业主题、策略、跨境、商品等较为完整的指数产品线。

华夏基金以深入的投资研究为基础，尽力捕捉市场机会，为投资人谋求良好的回报。根据银河证券基金研究中心《中国基金业绩评价报告》，截至 2024 年 12 月 31 日，华夏基金旗下多只产品近 1 年同类排名领先（基金排名不作为产品未来表现的保证），其中：

主动权益产品：在消费行业偏股型基金(A 类)中华夏消费臻选混合发起式(A 类)排名第 1/81；在新能源主题行业偏股型基金(A 类)中华夏清洁能源龙头混合发起式(A 类)排名第 1/27；在北交所主题偏股型基金(A 类)中华夏北交所创新中小企业精选两年定开混合发起式排名第 1/11；在标准股票型基金(A 类)中华夏优势精选股票排名第 2/336、华夏潜龙精选股票排名第 15/336、华夏创新前沿股票排名第 64/336；在汽车主题行业偏股型基金(A 类)中华夏新能源车龙头混合发起式(A 类)排名第 3/16；在港股通标准股票型基金(A 类)中华夏港股通精选股票（LOF）(A 类)排名第 3/14；在 QDII 混合基金(A 类)中华夏全球科技先锋混合（QDII）排名第 5/51；在偏股型基金(股票上限 80%)(A 类)中华夏经典混合排名第 5/148、华夏常阳三年定开混合排名第 19/148、华夏策略混合排名第 29/148；在 TMT 与信息技术行业偏股型基金(A 类)中华夏半导体龙头混合发起式(A 类)排名第 11/47；在医药医疗健康行业偏股型基金(A 类)中华夏乐享健康混合(A 类)排名第 13/78；在 QDII 股票型基金(A 类)中华夏全球股票（QDII）排名第 14/72；在偏股型基金(股票上下限 60%-95%)(A 类)中华夏见龙精选混合排名第 13/1719、华夏阿尔法精选混合(A 类)排名第 40/1719、华夏融盛可持续一年持有混合(A 类)排名第 101/1719、华夏远见成长一年持有混合(A 类)排名第 169/1719、华夏 ESG 可持续投资一年持有混合(A 类)排名第 177/1719、华夏先进制造龙头混合(A 类)排名第 184/1719、华夏行业景气混合排名第 214/1719、华夏景气成长一年持有混合发起式(A 类)排名第 257/1719、华夏科技前沿 6 个月定开混合(A 类)排名第 278/1719；在灵活配置型基金(基准股票比例 30%-60%)(A 类)中华夏磐晟混合（LOF）排名第 28/425、华夏高端制造混合(A 类)排名第 64/425、华夏新机遇混合(A 类)排名第 76/425；在偏股型基金(股票上限 95%)(A 类) 华夏新兴经济一年持有混合(A 类)排名第 34/221、华夏大盘精选混合(A 类)排名第 49/221。

固收与固收+产品：在信用债指数债券型基金(A 类)中华夏亚债中国指数(A 类)排名第 1/18；在普通债券型基金(可投转债)(A 类)中华夏双债债券(A 类)排名第 2/246；在定开纯债债券型基金(A 类)中华夏鼎华一年定开债券排名第 9/647、华夏鼎誉三个月定开债券(A 类)排名第 51/647；在定开普通债券型基金(二级)(A 类)中华夏卓信一年定开债券发起式排名第 11/24；在可转换债券型基金(A 类)中华夏可转债增强债券(A 类)排名第 12/38；在普通偏债型基金(股票上限不高于 30%)(A 类)中华夏磐泰

混合（LOF）(A 类)排名第 14/333；在中短期纯债债券型基金(A 类)中华夏中短债债券(A 类)排名第 15/165；在定开普通债券型基金(可投转债)(A 类)中华夏鼎禄三个月定开债券(A 类)排名第 22/157、华夏鼎福三个月定开债券(A 类)排名第 31/157；在长期纯债债券型基金(A 类)中华夏鼎茂债券(A 类)排名第 20/851、华夏鼎通债券(A 类)排名第 37/851；在普通债券型基金(二级)(A 类)中华夏稳享增利 6 个月债券(A 类)排名第 79/443。

指数产品：在标准策略指数股票型基金(A 类)中华夏上证 50AH 优选指数（LOF）(A 类)排名第 6/25；在策略指数股票 ETF 基金中华夏中证智选 300 价值稳健策略 ETF 排名第 8/48；在规模指数股票 ETF 基金中华夏 MSCI 中国 A50 互联互通 ETF 排名第 14/161、华夏中证沪港深 500ETF 排名第 20/161、华夏上证 50ETF 排名第 29/161；在行业指数股票 ETF 基金中华夏中证银行 ETF 排名第 5/72、华夏中证全指证券公司 ETF 排名第 15/72；在增强规模指数股票型基金(A 类)中华夏沪深 300 指数增强(A 类)排名第 5/191、华夏上证科创板 50 成份指数增强发起式(A 类)排名第 17/191；在主题指数股票 ETF 基金中华夏金融 ETF 发起式排名第 2/357、华夏国证半导体芯片 ETF 排名第 19/357、华夏中证金融科技主题 ETF 排名第 21/357、华夏中证 5G 通信主题 ETF 排名第 60/357、华夏中证人工智能主题 ETF 排名第 72/357、华夏中证云计算与大数据主题 ETF 排名第 83/357。

在客户服务方面，2024 年，华夏基金继续以客户需求为导向，努力提高客户使用的便利性和服务体验：（1）华夏基金直销渠道继续优化页面显示，升级搜索及查询功能，给客户更方便、直观的使用感受；（2）华夏基金管家客户端从客户需求出发持续优化操作页面，进一步提升操作体验；（3）与常熟农商银行、长春农商银行、贵文基金等代销机构合作，拓展更加丰富的客户理财渠道；（4）开展“送你长期主义的花朵”、“换个角度，世界可能不一样”、“聊聊新赛道”等活动，为客户提供了多样化的投资者教育和关怀服务。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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		
华龙	本基金的基金经理	2024-02-01	-	8 年	硕士。2016 年 7 月加入华夏基金管理有限公司。历任数量投资部研究员、基金经理助理、华夏粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理（2022 年 8 月 22 日至 2023 年 5 月 4 日期

					间)、华夏粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2022 年 8 月 22 日至 2023 年 12 月 27 日期间)等。
孙然晔	本基金的基金经理	2024-02-01	-	10 年	博士。曾任美国银行企业投资部资深量化研究员, 美国 AQR 资本管理公司量化研究员。2019 年 8 月加入华夏基金管理有限公司。历任数量投资部研究员、基金经理助理。

注: ①上述“任职日期”和“离任日期”为根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。首任基金经理的, 其“任职日期”为基金合同生效日。

②证券从业的含义遵从行业协会《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》的相关规定。

4.1.3 基金经理薪酬机制

本基金管理人旗下基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的, 公司对其进行年度综合考核, 考核结果作为确定其薪酬激励的重要参考因素之一。因此, 基金经理个人薪酬激励与其管理的私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩表现不直接挂钩。

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》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》等法律法规和基金合同, 本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产, 在严格控制投资风险的基础上, 为基金份额持有人谋求最大利益, 没有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

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《华夏基金管理有限公司公平交易制度》。公司通过科学、制衡的投资决策体系, 加强交易分配环节的内部控制, 并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时, 通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《华夏基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本基金管理人一贯严格执行公平交易原则，对兼任基金经理的交易情况进行持续监测。本年度所有相关组合的交易行为均符合法规、制度和流程要求，未发现违反公平交易原则的情况。本年度同一基金经理管理的不同组合在邻近交易日的同向和反向交易，交易时机和交易价差均可合理解释，未发现异常。

本基金管理人根据《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》要求，针对同经理管理多个组合间的收益率差异进行归因分析，本年度各组合间收益率差异均属正常情况，主要原因为业绩基准不同、投资策略不同，收益率差异可以合理解释。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合参与的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% 的交易共有 197 次，其中 1 次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，有关基金经理已根据公司管理要求提供决策依据；其余均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

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

本基金跟踪的标的指数为创业板综合指数，创业板综合指数选取深圳证券交易所创业板上市的全部股票作为样本，反映了在深圳证券交易所创业板上市的全部股票的价格综合变动情况以及市场总体走势。本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好地跟踪标的指数，实现基金投资目标。

宏观层面，国内经济整体平稳运行，全年 GDP 同比增速 5%，完成了年初设定的增长目标。分季度来看，GDP 同比增速分别为 5.3%、4.7%、4.6% 和 5.4%，全年经济呈现“U 型”走势，在相关政策刺激下四季度经济增速明显回升。整体来看，24 年全年出口数据相对亮眼而内需消费相对疲软。政策方面，中央年内推出一揽子政策如降低二手房首付门槛和贷款利率，商品以旧换新补贴等，有效提振消费和投资者信心推动经济企稳回升。海外方面，美联储于下半年正式开启降息进程，年内累计降息 100 基点，预计未来降息仍有很大可能持续。

市场层面，权益市场整体呈现“V 型”走势：前三季度，市场整体呈现震荡下行走势；9 月下旬，

受到降准降息以及下调存量房贷利率等利好政策影响，股市企稳反弹，上证指数全年涨幅超 10%。从市值上看，全年上证 50，沪深 300 等大盘指数表现相对强势，而中证 1000，中证 2000 等中小盘指数由于前半年表现较差，全年表现要逊于大盘指数。分板块而言，银行、非银金融、家电等防御性板块表现最优，医药、农林牧渔、消费者服务等板块表现相对靠后。

基金投资运作方面，本基金在做好跟踪标的指数的基础上，认真应对投资者日常申购、赎回等工作。

为促进本基金的市场流动性和平稳运行，经深圳证券交易所同意，部分证券公司被确认为本基金的流动性服务商。目前，本基金的流动性服务商包括东方证券股份有限公司、中信证券股份有限公司等。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2024 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.2462 元，本报告期份额净值增长率为 24.62%，同期业绩比较基准增长率 37.49%。本基金本报告期跟踪偏离度为-12.87%，与业绩比较基准产生偏离的主要原因为成份股分红、日常运作费用、指数结构调整、申购赎回等产生的差异。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望明年，国内经济目前处于复苏过程中，整体经济呈现企稳回升迹象，未来基本面会越来越好；美国通胀目前已相对温和，预计美联储 25 年内继续降息是大概率事件，货币政策有望宽松，国内货币政策也有望放松。估值层面，创业板板块目前整体估值处于历史中枢位置，未来可以重点关注下相关货币政策以及板块内公司盈利改善情况，指数估值在未来仍有扩张空间。

我们将继续有效控制基金的跟踪偏离度和跟踪误差，以实现投资者获取指数投资收益及其他模式盈利的投资目标。同时，我们也将积极争取推动产品的进一步创新，充分发挥指数基金的功能，为各类投资者提供更多、更好的投资机会。

珍惜基金份额持有人的每一份投资和每一份信任，本基金将继续奉行华夏基金管理有限公司“为信任奉献回报”的经营理念，规范运作，审慎投资，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求长期、稳定的回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人持续加强合规管理、风险控制和监察稽核工作。

在合规管理方面，公司通过合规审核、合规检查、合规咨询、合规宣传与合规培训等对合规风险进行管理，确保公司合规体系高效运行，合规风险有效控制。报告期内，公司不断加强合规制度建设，结合法律法规和业务实际，在廉洁从业风险防控、信息披露、洗钱风险管理等方面新增和修订多项管理制度，制度化水平显著提高。持续开展合规培训，在全员覆盖的基础上，着重加强投资

研究和基金销售等重点业务领域的合规督导培训，强化员工主动合规意识和公募基金信息披露责任意识。持续优化合规管理的机制化和系统化，完善合规管理综合服务平台，提高合规管理效能。持续做好信息披露业务，通过流程优化、系统优化及强化培训持续保障信息披露的完整性、准确性、及时性。持续规范基金销售业务，通过严格审查宣传推介材料，认真开展投资者适当性管理工作等，确保基金销售业务依法合规。公司高度重视洗钱风险管理，深入实践风险为本方法，认真贯彻落实各项反洗钱监管要求，持续加强“风险评估+合规检查”双支柱管理框架，深入推进洗钱风险管理数字化转型，持续提升洗钱风险管理水平。

在风险控制方面，公司秉承数字化管理理念，持续完善内部风险管理系统建设，稳步夯实投资风险基础。紧密跟踪各项法律法规要求、加强风险研究，在严格管控基金日常投资运作风险的同时，持续完善风险管理制度建设，提升基金流动性风险、市场风险、合规风险、操作风险等关键风险的管控水平，努力保障各项风险管理措施落实到位。

在监察稽核方面，公司按照法规要求，做好日常合规监控，定期及不定期开展内部检查，排查业务风险隐患，促进公司整体业务合规运作、稳健经营。

报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将继续以风险控制为核心，坚持基金份额持有人利益优先的原则，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金合规稳健运作。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人作为准确、及时进行基金估值和份额净值计价，制定了基金估值和份额净值计价的业务管理制度，建立了估值委员会，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。本基金托管人审阅本基金管理人采用的估值原则及技术，并复核、审查基金资产净值和基金份额申购、赎回价格。会计师事务所对估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性发表专业意见。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金自 2024 年 2 月 29 日至 2024 年 10 月 7 日出现基金资产净值低于五千万元的情形。本报告期内，自 2024 年 5 月 30 日起至 2024 年 10 月 8 日，由本基金管理人承担本基金的固定费用。基金管理人已召开基金份额持有人大会，并发布持有人大会会议情况的公告。

§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

在本报告期内，国泰君安证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在华夏创业板综合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

本报告期内，本托管人根据《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规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况（如有）、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整。

§6 审计报告

安永华明（2025）审字第 70035283_A190 号

华夏创业板综合交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

我们审计了华夏创业板综合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 2 月 1 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日止期间的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的华夏创业板综合交易型开放式指数证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了华夏创业板综合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 2 月 1 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.2 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，我们独立于华夏创业板综合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。

6.3 其他信息

华夏创业板综合交易型开放式指数证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括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。

6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，管理层负责评估华夏创业板综合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，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。

治理层负责监督华夏创业板综合交易型开放式指数证券投资基金的财务报告过程。

6.5 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，就可能导致对华夏创业板综合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华夏创业板综合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。

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
中国注册会计师
蒋燕华 王海彦
北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层
2025 年 3 月 27 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华夏创业板综合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
资 产：		
货币资金	7.4.7.1	1,307,590.09
结算备付金		47,750.27
存出保证金		97,541.70
交易性金融资产	7.4.7.2	72,719,587.37
其中：股票投资		72,719,587.37

基金投资		-
债券投资		-
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	-
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	7.4.7.5	-
资产总计		74,172,469.43
负债和净资产	附注号	本期末 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	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		46,499.01
应付赎回款		-
应付管理人报酬		33,556.92
应付托管费		6,711.39
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	7.4.7.6	109,681.42
负债合计		196,448.74
净资产：		
实收基金	7.4.7.7	59,360,773.00
未分配利润	7.4.7.8	14,615,247.69
净资产合计		73,976,020.69
负债和净资产总计		74,172,469.43

注：①报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.2462 元，基金份额总额 59,360,773.00 份。

②本基金合同于 2024 年 2 月 1 日生效，本报告期自 2024 年 2 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日。

7.2 利润表

会计主体：华夏创业板综合交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 2 月 1 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024 年 2 月 1 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
一、营业总收入		19,716,569.53
1.利息收入		298,461.65
其中：存款利息收入	7.4.7.9	298,461.65
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）		21,640,731.96
其中：股票投资收益	7.4.7.10	21,381,387.01
基金投资收益	7.4.7.11	-
债券投资收益	7.4.7.12	2,838.83
资产支持证券投资收益	7.4.7.13	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-
股利收益	7.4.7.16	256,506.12
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-1,998,571.37
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-224,052.71
减：二、营业总支出		388,871.38
1.管理人报酬		256,614.36
2.托管费		51,322.86
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	7.4.7.20	-
7.税金及附加		-
8.其他费用	7.4.7.21	80,934.16
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		19,327,698.15
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		19,327,698.15
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		19,327,698.15

注：本基金合同于 2024 年 2 月 1 日生效，本报告期自 2024 年 2 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日。

7.3 净资产变动表

会计主体：华夏创业板综合交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 2 月 1 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 2 月 1 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日		
	实收基金	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	283,360,773.00	-	283,360,773.00
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填列）	-224,000,000.00	14,615,247.69	-209,384,752.31
（一）、综合收益总额	-	19,327,698.15	19,327,698.15
（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）	-224,000,000.00	-4,712,450.46	-228,712,450.46
其中：1.基金申购款	208,000,000.00	44,582,963.86	252,582,963.86
2.基金赎回款	-432,000,000.00	-49,295,414.32	-481,295,414.32
（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	59,360,773.00	14,615,247.69	73,976,020.69

注：本基金合同于 2024 年 2 月 1 日生效，本报告期自 2024 年 2 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日。
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：

基金管理人负责人：张佑君，主管会计工作负责人：朱威，会计机构负责人：朱威

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华夏创业板综合交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）已获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]2339 号文《关于准予华夏创业板综合交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》，由华夏基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《华夏创业板综合交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规负责公开募集。本基金为交易型开放式，存续期限为不定期。本基金自 2024 年 1 月 15 日至 2024 年 1 月 26 日共募集

283,337,027.00 元(不含认购资金利息),业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2024)验字第 70035283_A09 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华夏创业板综合交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2024 年 2 月 1 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 283,360,773.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 23,746.00 份基金份额。本基金的基金管理人为华夏基金管理有限公司,基金托管人为国泰君安证券股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和本基金基金合同的有关规定,本基金的标的指数为创业板综合指数。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标,基金还可投资于非成份股(含创业板、存托凭证及其他中国证监会注册或核准上市的股票)、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、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、衍生品(包括股指期货、股票期权、国债期货)、资产支持证券、货币市场工具(含同业存单、债券回购等)、银行存款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。本基金可根据法律法规的规定参与融资、转融通证券出借业务。

基金的投资组合比例为:通常情况下,基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%,且不低于非现金基金资产的 80%,因法律法规的规定而受限制的情形除外。本基金在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,应当保持不低于交易保证金一倍的现金。其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布和修订的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则(以下合称“企业会计准则”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会发布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》和中国证监会、中国基金业协会允许的如财务报表附注 7.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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间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。本会计报表的实际编制期间为 2024 年 2 月

1 日（基金合同生效日）至 2024 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

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

1、金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类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。

（1）债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即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。基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益。基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资、资产支持证券投资 and 基金投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

（2）权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

2、金融负债的分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债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。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

3、衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

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

本基金于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。

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金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

本基金对以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础，进行减值处理并确认损失准备。本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入。

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是否已显著增加。本基金以单

项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况。当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产。当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然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的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

1、存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，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、当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

3、如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。对于曾经实施份额拆分或折算的基金，由于基金份额拆分或折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日或基金份额折算日根据拆分前或折算前的基金份额数及确定的拆分或折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。对于已开放转换业务的基金，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

境内基金投资在持有期间应取得的现金红利于除息日确认为投资收益；境外基金投资在持有期间应取得的基金分红收益扣除基金交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。境内股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益；境外股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除股票交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。境内债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。境外债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在交易所在地适用的预缴所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

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；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，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。

本基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司(以下简称“证金公司”)出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息确认为利息收入，将出借证

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

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

针对基金合同约定费率和计算方法的费用，本基金在费用涵盖期间按合同约定进行确认。

其他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按直线法近似计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。期末可供分配利润指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率达到 1%以上，方可进行收益分配。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

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

1、对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金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》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

2、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通受限股票估值指引(试行)》进行估值。

3、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。本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。本基金持有的银行间同业市场交易的固定收益品种，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

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

根据财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103 号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《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[2014]81 号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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[2015]125 号《财政部、国家税务总局、证监会关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、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《财政部、国家税务总局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]70 号《财政部、国家税务总局关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于增值税征收范围，不征收增值税。

(2) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

(3) 基金买卖股票、债券的差价收入免征增值税，暂不征收企业所得税。

(4) 存款利息收入不征收增值税。

(5) 国债、地方政府债利息收入，金融同业往来利息收入免征增值税。

(6) 对基金取得的债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(7) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(8) 对基金在境内取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利收入时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。基金在境内从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，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，减按 50% 计入应纳税所得额，持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。对香港市场投资者取得的股息、红利收入按照 10% 的税率代扣所得税。

(9) 基金在境内卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。基金通过沪港通/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，证券交易印花税实施减半征收。

(10) 基金在境外证券交易所进行交易或取得的源自境外证券市场的收益，其涉及的税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行。

(11) 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
活期存款	1,307,590.09
等于：本金	1,306,969.54
加：应计利息	620.55
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
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	-
合计	1,307,590.09

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		74,718,158.74	-	72,719,587.37	-1,998,571.37
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		74,718,158.74	-	72,719,587.37	-1,998,571.37

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款的估值增值。

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。

7.4.7.4 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。

7.4.7.5 其他资产
无。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日
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	29,147.26
其中：交易所市场	29,147.26
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	80,534.16
合计	109,681.42

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 2 月 1 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	283,360,773.00	283,360,773.00
本期申购	208,000,000.00	208,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-432,000,000.00	-432,000,000.00
本期末	59,360,773.00	59,360,773.00

注：本基金在募集期间共募集有效净认购资金 283,337,027.00 元，根据本基金招募说明书的规定，认购资金在募集期间产生的利息 23,746.00 元在本基金合同生效后折算为 23,746.00 份基金份额，计入基金份额持有人账户。

7.4.7.8 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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	21,326,269.52	-1,998,571.37	19,327,698.15
本期基金份额交易产生的变动数	-1,985,503.62	-2,726,946.84	-4,712,450.46
其中：基金申购款	45,110,087.07	-527,123.21	44,582,963.86
基金赎回款	-47,095,590.69	-2,199,823.63	-49,295,414.32
本期已分配利润	-	-	-
本期末	19,340,765.90	-4,725,518.21	14,615,247.69

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 2 月 1 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	290,929.23

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	5,145.57
其他	2,386.85
合计	298,461.65

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 2 月 1 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	4,043,300.11
股票投资收益——赎回差价收入	17,338,086.90
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	21,381,387.01

7.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 2 月 1 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	95,680,628.59
减：卖出股票成本总额	91,380,996.35
减：交易费用	256,332.13
买卖股票差价收入	4,043,300.11

7.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 2 月 1 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
赎回基金份额对价总额	481,295,414.32
减：现金支付赎回款总额	13,829,635.32
减：赎回股票成本总额	450,127,692.10
减：交易费用	-
赎回差价收入	17,338,086.90

7.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.10.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

7.4.7.11 基金投资收益

无。

7.4.7.12 债券投资收益

7.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年2月1日（基金合同生效日）至2024年12月31日
债券投资收益——利息收入	1.30
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	2,837.53
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	2,838.83

7.4.7.12.2 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2月1日（基金合同生效日）至2024年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	9,039.19
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	6,200.00
减：应计利息总额	1.30
减：交易费用	0.36
买卖债券差价收入	2,837.53

7.4.7.13 资产支持证券投资收益

无。

7.4.7.14 贵金属投资收益

无。

7.4.7.15 衍生工具收益

无。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年2月1日（基金合同生效日）至2024年12月31日
股票投资产生的股利收益	256,506.12
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	256,506.12

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年2月1日（基金合同生效日）至2024年12月31日
1.交易性金融资产	-1,998,571.37
——股票投资	-1,998,571.37
——债券投资	-
——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	-1,998,571.37

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年2月1日（基金合同生效日）至2024年12月31日
基金赎回费收入	-
替代损益	-224,052.71
合计	-224,052.71

7.4.7.19 持有基金产生的费用

无。

7.4.7.20 信用减值损失

无。

7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2024年2月1日（基金合同生效日）至2024年12月31日
审计费用	13,877.08
信息披露费	66,657.08
证券出借违约金	-
其他	400.00
合计	80,934.16

注：本基金固定费用为其他费用项目中“审计费”、“信息披露费”、“银行间账户维护费”、“银行间咨询服务费”、“持有人大会费”等费用。自 2024 年 5 月 30 日起至 2024 年 10 月 8 日，本基金的固定费用由本基金管理人承担，共计 52,365.84 元。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华夏基金管理有限公司	基金管理人
国泰君安证券股份有限公司（“国泰君安证券”）	基金托管人
中信证券股份有限公司（“中信证券”）	基金管理人的股东
MACKENZIE FINANCIAL CORPORATION	基金管理人的股东
天津海鹏科技咨询有限公司	基金管理人的股东
华夏创业板综合交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（“华夏创业板综合 ETF 发起式联接”）	该基金是本基金的联接基金
上海华夏财富投资管理有限公司（“华夏财富”）	基金管理人的子公司
China Asset Management (Hong Kong) Limited（中文名：华夏基金(香港)有限公司）	基金管理人的子公司
华夏股权投资基金管理（北京）有限公司	基金管理人的子公司
华夏资本管理有限公司（“华夏资本”）	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年2月1日（基金合同生效日）至2024年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国泰君安证券	374,745,893.99	80.52%

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年2月1日（基金合同生效日）至2024年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
国泰君安证券	5,652.15	62.53%

7.4.10.1.4 债券回购交易

无。

7.4.10.1.5 基金交易

无。

7.4.10.1.6 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2月1日（基金合同生效日）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
国泰君安证券	160,854.15	90.06%	11,385.52	39.06%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。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。针对其他类型基金，不再通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

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2月1日（基金合同生效日）至2024年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	256,614.36
其中：应支付销售机构的客户维护费	8,873.71
应支付基金管理人的净管理费	247,740.65

注：①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 0.50%的年费率计提，逐日累

计至每月月底，按月支付。

②基金管理人报酬计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×年费率/当年天数。

③客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用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，从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2024年2月1日（基金合同生效日）至2024年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	51,322.86

注：①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。

②基金托管费计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×年费率/当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

无。

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	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
华夏创业板综合ETF发起式联接	13,380,158.00	22.54%
中信证券	1,035,356.00	1.74%

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的相关费用符合基金招募说明书、交易所、登记结算机构的有关规定。

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2月1日（基金合同生效日）至2024年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
国泰君安证券活期存款	1,307,590.09	290,929.23

注：本基金的活期银行存款由基金托管人国泰君安证券保管，存放在具有基金托管资格的银行，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

金额单位：人民币元

本期					
2024 年 2 月 1 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
中信证券	001391	国货航	新股发行	5,907	13,586.10

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金固定费用为其他费用项目中“审计费”、“信息披露费”、“银行间账户维护费”、“银行间咨询服务费”、“持有人大会费”等费用。自 2024 年 5 月 30 日起至 2024 年 10 月 8 日，本基金的固定费用由本基金管理人承担，共计 52,365.84 元。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

7.4.12 期末（2024 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
301622	英思特	2024-11-26	6 个月	新发流通	22.36	44.92	100	2,236.00	4,492.00	-

				受限						
001391	国货航	2024-12-23	6个月	新发流通受限	2.30	6.80	591	1,359.30	4,018.80	-
301617	博苑股份	2024-12-03	6个月	新发流通受限	27.76	39.79	81	2,248.56	3,222.99	-

注：①根据中国证监会《上市公司证券发行注册管理办法》，基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

②基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

③根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

④基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的设定限售期的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

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

本基金的风险管理政策是使基金投资风险可测、可控、可承担。本基金管理人建立了由风险管理委员会、督察长、法律部、合规部、稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的多层次风险管理架构体系。风险管理团队在识别、衡量投资风险后，通过正式报告的方式，将分析结果及时传达给基金经理、投资总监、投资决策委员会和风险管理委员会，协助制定风险控制决策，实现风险管理

目标。

本基金管理人主要通过定性分析和定量分析的方法，估测各种金融工具风险可能产生的损失。本基金管理人从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重性；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的金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型和日常的量化报告，参考压力测试结果，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时对各种风险进行监督、检查和评估，并制定相应决策，将风险控制在预期可承受的范围之内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指由于基金所投资债券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息，债券发行人信用评级降低导致债券价格下降，或基金在交易过程中发生交收违约，而造成基金资产损失的可能性。

本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是在市场或持有资产流动性不足的情况下，基金管理人可能无法迅速、低成本地调整基金投资组合，从而对基金收益造成不利影响。

除在“7.4.12 期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制的情况外，本基金所投资的证券均能及时变现。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

在日常运作中，本基金的流动性安排能够与基金合同约定的申购赎回安排以及投资者的申购赎回规律相匹配。

在资产端，本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股，如需对组合进行调整时，由于投资标的的流动性较好，市场冲击成本较小，基金投资组合收益偏离投资目标收益的风险较小。基金管理人持续监测本基金持有资产的市场交易量、交易集中度等涉及资产流动性水平的风险指标，并定期开展压力测试，详细评估在不同的压力情景下资产变现情况的变化。

在负债端，基金管理人持续监测本基金投资者历史申赎、投资者类型和结构变化等数据，审慎评估不同市场环境可能带来的投资者潜在赎回需求，当市场环境或投资者结构发生变化时，及时调整组合资产结构，预留充足现金头寸，保持基金资产可变现规模和期限与负债赎回规模和期限的匹配。

如遭遇极端市场情形或投资者非预期巨额赎回情形，基金管理人将采用本基金合同约定的赎回申请处理方式及其他各类流动性风险管理工具，控制极端情况下的潜在流动性风险。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指由于市场变化或波动所引起的资产损失的可能性，本基金管理人通过监测组合敏感性指标来衡量市场风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率变动引起组合中资产特别是债券投资的市场价格变动，从而影响基金投资收益的风险。

本基金为指数型基金，采用完全复制策略。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。因此，利率风险不是本基金的主要风险。

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。本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素（单个证券发行主体自身经营情况或证券市场整体波动）发生变动时导致基金资产发生损失的风险。

本基金为指数型基金，采用完全复制策略。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。本基金管理人通常用敏感性指标来衡量市场价格风险。

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	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	72,719,587.37	98.30
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	72,719,587.37	98.30

注：①本表中交易性金融资产-债券投资科目仅包含可转换公司债券和可交换公司债券等。
②由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除创业板综合指数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
	-5%	-3,651,381.52

	+5%	3,651,381.52
--	-----	--------------

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
第一层次	72,707,853.58
第二层次	-
第三层次	11,733.79
合计	72,719,587.37

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内证券涨跌停等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策以导致各层次之间转换的事项发生日作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 2 月 1 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	5,843.86	5,843.86
转出第三层次	-	-	-

当期利得或损失总额	-	5,889.93	5,889.93
其中：计入损益的利得或损失	-	5,889.93	5,889.93
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	11,733.79	11,733.79
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	5,889.93	5,889.93

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

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	11,733.79	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	1.662-2.3782	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

截至 2024 年 12 月 31 日止，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

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，其账面价值与公允价值差异很小。

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	72,719,587.37	98.04
	其中：股票	72,719,587.37	98.04
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	1,355,340.36	1.83
8	其他各项资产	97,541.70	0.13
9	合计	74,172,469.43	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	1,315,813.00	1.78
B	采矿业	32,472.00	0.04
C	制造业	51,888,009.55	70.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	98,712.80	0.13
E	建筑业	204,439.00	0.28
F	批发和零售业	1,001,036.00	1.35
G	交通运输、仓储和邮政业	142,680.80	0.19
H	住宿和餐饮业	20,870.00	0.03
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,764,706.60	11.85
J	金融业	3,616,834.16	4.89
K	房地产业	82,246.00	0.11
L	租赁和商务服务业	522,998.00	0.71
M	科学研究和技术服务业	1,924,698.46	2.60
N	水利、环境和公共设施管理业	667,237.00	0.90
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,180,251.00	1.60
R	文化、体育和娱乐业	1,256,583.00	1.70
S	综合	-	-
	合计	72,719,587.37	98.30

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

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	占基金资产净值比例(%)
----	------	------	-------	------	--------------

1	300750	宁德时代	27,500	7,315,000.00	9.89
2	300059	东方财富	103,688	2,677,224.16	3.62
3	300760	迈瑞医疗	9,100	2,320,500.00	3.14
4	300308	中际旭创	9,520	1,175,815.20	1.59
5	300124	汇川技术	19,388	1,135,749.04	1.54
6	300433	蓝思科技	44,600	976,740.00	1.32
7	300274	阳光电源	12,840	947,977.20	1.28
8	300015	爱尔眼科	69,700	923,525.00	1.25
9	300498	温氏股份	55,500	916,305.00	1.24
10	300979	华利集团	8,800	692,120.00	0.94
11	300014	亿纬锂能	13,700	640,338.00	0.87
12	300502	新易盛	5,440	628,755.20	0.85
13	300033	同花顺	2,000	575,000.00	0.78
14	300408	三环集团	12,500	481,375.00	0.65
15	300394	天孚通信	5,020	458,627.20	0.62
16	300476	胜宏科技	9,150	385,123.50	0.52
17	300919	中伟股份	10,300	372,036.00	0.50
18	300207	欣旺达	16,500	368,115.00	0.50
19	300803	指南针	3,800	364,610.00	0.49
20	300418	昆仑万维	8,800	338,624.00	0.46
21	300114	中航电测	4,700	337,366.00	0.46
22	300122	智飞生物	12,800	336,640.00	0.46
23	300474	景嘉微	3,500	327,215.00	0.44
24	300144	宋城演艺	35,100	326,079.00	0.44
25	300339	润和软件	6,200	310,186.00	0.42
26	300001	特锐德	14,000	307,300.00	0.42
27	300496	中科创达	5,100	303,756.00	0.41
28	301236	软通动力	5,100	299,421.00	0.40
29	300913	兆龙互连	5,200	299,052.00	0.40
30	300896	爱美客	1,620	295,650.00	0.40
31	300347	泰格医药	5,400	294,948.00	0.40
32	300765	新诺威	10,960	291,426.40	0.39
33	300832	新产业	4,100	290,485.00	0.39
34	300757	罗博特科	1,280	288,409.60	0.39
35	300316	晶盛机电	9,000	287,100.00	0.39
36	300548	博创科技	6,100	283,101.00	0.38
37	300759	康龙化成	11,000	282,700.00	0.38
38	300363	博腾股份	17,100	269,667.00	0.36
39	300413	芒果超媒	10,000	268,900.00	0.36
40	300661	圣邦股份	3,100	253,518.00	0.34
41	300251	光线传媒	26,300	248,272.00	0.34
42	300699	光威复材	7,100	246,015.00	0.33
43	300451	创业慧康	53,500	239,680.00	0.32
44	300580	贝斯特	10,411	238,932.45	0.32

45	300450	先导智能	11,900	238,238.00	0.32
46	300230	永利股份	52,100	231,845.00	0.31
47	300751	迈为股份	2,200	231,330.00	0.31
48	300024	机器人	12,800	229,760.00	0.31
49	300003	乐普医疗	20,000	226,800.00	0.31
50	300223	北京君正	3,300	225,060.00	0.30
51	300693	盛弘股份	8,300	223,768.00	0.30
52	300229	拓尔思	10,500	219,870.00	0.30
53	300055	万邦达	45,500	217,945.00	0.29
54	300623	捷捷微电	6,300	215,208.00	0.29
55	300415	伊之密	10,700	214,642.00	0.29
56	300983	尤安设计	12,526	211,814.66	0.29
57	301290	东星医疗	9,100	211,484.00	0.29
58	300957	贝泰妮	4,900	209,181.00	0.28
59	300058	蓝色光标	22,300	206,944.00	0.28
60	300509	新美星	29,800	206,514.00	0.28
61	300458	全志科技	5,300	205,428.00	0.28
62	300857	协创数据	1,912	204,373.68	0.28
63	300724	捷佳伟创	3,100	195,951.00	0.26
64	300002	神州泰岳	16,700	193,553.00	0.26
65	300972	万辰集团	2,400	192,984.00	0.26
66	300809	华辰装备	6,060	191,980.80	0.26
67	300085	银之杰	5,000	191,250.00	0.26
68	300604	长川科技	4,300	189,759.00	0.26
69	300346	南大光电	4,900	189,091.00	0.26
70	300558	贝达药业	3,500	188,755.00	0.26
71	300628	亿联网络	4,800	185,280.00	0.25
72	300763	锦浪科技	3,000	183,210.00	0.25
73	300761	立华股份	9,400	182,924.00	0.25
74	300017	网宿科技	17,300	182,861.00	0.25
75	300232	洲明科技	25,800	177,246.00	0.24
76	300573	兴齐眼药	2,540	177,241.20	0.24
77	300364	中文在线	7,200	176,616.00	0.24
78	300136	信维通信	6,900	175,536.00	0.24
79	300212	易华录	7,400	173,160.00	0.23
80	300679	电连技术	2,900	173,130.00	0.23
81	301109	军信股份	10,300	171,804.00	0.23
82	300475	香农芯创	6,000	170,940.00	0.23
83	300782	卓胜微	1,900	170,430.00	0.23
84	300748	金力永磁	9,520	170,217.60	0.23
85	300373	扬杰科技	3,900	169,728.00	0.23
86	300428	立中集团	10,400	169,520.00	0.23
87	300054	鼎龙股份	6,500	169,130.00	0.23
88	300735	光弘科技	6,000	167,940.00	0.23

89	300298	三诺生物	6,500	167,765.00	0.23
90	300492	华图山鼎	2,300	167,440.00	0.23
91	300188	国投智能	12,100	166,859.00	0.23
92	300255	常山药业	8,300	165,917.00	0.22
93	300276	三丰智能	18,400	165,416.00	0.22
94	300695	兆丰股份	3,700	165,020.00	0.22
95	301190	善水科技	10,400	164,216.00	0.22
96	301358	湖南裕能	3,600	163,152.00	0.22
97	300762	上海瀚讯	7,700	161,931.00	0.22
98	300455	航天智装	12,400	160,704.00	0.22
99	300747	锐科激光	8,350	159,986.00	0.22
100	301269	华大九天	1,300	157,430.00	0.21
101	300088	长信科技	23,900	156,306.00	0.21
102	301110	青木科技	2,520	155,080.80	0.21
103	300907	康平科技	7,300	153,592.00	0.21
104	300115	长盈精密	9,420	152,980.80	0.21
105	300838	浙江力诺	11,900	150,654.00	0.20
106	300529	健帆生物	5,100	149,634.00	0.20
107	300561	汇金科技	2,700	148,392.00	0.20
108	300655	晶瑞电材	15,800	147,888.00	0.20
109	300482	万孚生物	6,500	145,665.00	0.20
110	300641	正丹股份	5,800	144,072.00	0.19
111	300772	运达股份	10,800	142,992.00	0.19
112	300012	华测检测	11,500	142,945.00	0.19
113	300672	国科微	2,100	140,175.00	0.19
114	300814	中富电路	4,300	139,406.00	0.19
115	300638	广和通	6,900	139,035.00	0.19
116	300873	海晨股份	8,200	138,662.00	0.19
117	300545	联得装备	4,300	134,719.00	0.18
118	300285	国瓷材料	7,900	134,616.00	0.18
119	300182	捷成股份	22,800	133,836.00	0.18
120	300910	瑞丰新材	2,800	133,252.00	0.18
121	300811	铂科新材	2,460	132,618.60	0.18
122	300852	四会富仕	5,000	131,100.00	0.18
123	300101	振芯科技	6,000	129,960.00	0.18
124	300633	开立医疗	4,400	129,316.00	0.17
125	300595	欧普康视	6,800	128,860.00	0.17
126	300607	拓斯达	5,000	127,450.00	0.17
127	300773	拉卡拉	7,200	127,440.00	0.17
128	300377	赢时胜	4,600	126,776.00	0.17
129	300620	光库科技	2,600	126,360.00	0.17
130	300738	奥飞数据	8,700	126,150.00	0.17
131	300196	长海股份	11,500	125,235.00	0.17
132	300357	我武生物	6,100	123,952.00	0.17

133	300037	新宙邦	3,300	123,552.00	0.17
134	300601	康泰生物	7,200	123,480.00	0.17
135	300049	福瑞股份	3,900	123,006.00	0.17
136	300315	掌趣科技	22,200	122,100.00	0.17
137	300406	九强生物	9,100	121,576.00	0.16
138	300541	先进数通	8,935	121,069.25	0.16
139	300779	惠城环保	1,240	121,024.00	0.16
140	300973	立高食品	3,100	120,993.00	0.16
141	300034	钢研高纳	7,700	120,120.00	0.16
142	300487	蓝晓科技	2,500	119,675.00	0.16
143	301345	涛涛车业	1,800	118,980.00	0.16
144	300453	三鑫医疗	15,900	118,614.00	0.16
145	301056	森赫股份	14,500	118,610.00	0.16
146	300432	富临精工	7,700	118,426.00	0.16
147	301270	汉仪股份	3,300	117,942.00	0.16
148	300190	维尔利	33,500	117,585.00	0.16
149	300073	当升科技	2,900	116,812.00	0.16
150	300100	双林股份	4,200	116,088.00	0.16
151	301323	新莱福	2,900	115,623.00	0.16
152	300488	恒锋工具	4,200	114,912.00	0.16
153	301317	鑫磊股份	5,700	113,373.00	0.15
154	300395	菲利华	3,000	112,830.00	0.15
155	300634	彩讯股份	5,100	111,180.00	0.15
156	300166	东方国信	11,700	109,980.00	0.15
157	300068	南都电源	6,800	109,752.00	0.15
158	301280	珠城科技	2,625	109,383.75	0.15
159	301111	粤万年青	6,700	109,076.00	0.15
160	300236	上海新阳	2,900	108,373.00	0.15
161	300383	光环新网	7,400	107,966.00	0.15
162	300777	中简科技	3,800	107,502.00	0.15
163	301191	菲菱科思	1,200	107,340.00	0.15
164	300454	深信服	1,868	107,223.20	0.14
165	301349	信德新材	3,300	106,194.00	0.14
166	300253	卫宁健康	14,800	105,968.00	0.14
167	301362	民爆光电	2,700	105,894.00	0.14
168	301051	信濠光电	3,900	105,534.00	0.14
169	300827	上能电气	2,400	105,360.00	0.14
170	301333	诺思格	2,100	104,979.00	0.14
171	300035	中科电气	6,900	103,155.00	0.14
172	300133	华策影视	14,200	102,524.00	0.14
173	300723	一品红	6,000	102,360.00	0.14
174	301015	百洋医药	4,200	101,682.00	0.14
175	300148	天舟文化	28,000	101,640.00	0.14
175	300598	诚迈科技	2,100	101,640.00	0.14

176	300459	汤姆猫	17,700	101,598.00	0.14
177	300457	赢合科技	5,300	101,442.00	0.14
178	301078	孩子王	8,900	101,282.00	0.14
179	300438	鹏辉能源	3,600	101,196.00	0.14
180	301153	中科江南	3,580	100,025.20	0.14
181	301220	亚香股份	2,700	99,954.00	0.14
182	300244	迪安诊断	8,800	99,880.00	0.14
183	301327	华宝新能	1,300	99,723.00	0.13
184	300769	德方纳米	2,700	99,576.00	0.13
185	300569	天能重工	19,900	99,102.00	0.13
186	301127	天源环保	6,520	98,712.80	0.13
187	301196	唯科科技	3,000	98,610.00	0.13
188	300348	长亮科技	6,800	97,240.00	0.13
189	300045	华力创通	4,600	96,094.00	0.13
190	300982	苏文电能	5,000	95,550.00	0.13
191	301515	港通医疗	5,300	95,294.00	0.13
192	300657	弘信电子	4,200	95,172.00	0.13
193	300532	今天国际	8,315	94,957.30	0.13
194	301188	力诺药包	6,300	94,626.00	0.13
195	300290	荣科科技	4,600	93,610.00	0.13
196	300625	三雄极光	8,000	93,280.00	0.13
197	300130	新国都	4,300	93,138.00	0.13
198	300689	澄天伟业	3,620	92,382.40	0.12
199	300284	苏交科	9,100	92,365.00	0.12
200	300673	佩蒂股份	5,200	92,196.00	0.12
201	301305	朗坤环境	5,200	91,624.00	0.12
202	300168	万达信息	11,500	91,310.00	0.12
203	300593	新雷能	8,100	90,720.00	0.12
204	300077	国民技术	3,800	90,592.00	0.12
205	300568	星源材质	9,300	90,396.00	0.12
206	300926	博俊科技	4,090	90,020.90	0.12
207	300398	飞凯材料	5,700	89,832.00	0.12
208	300624	万兴科技	1,419	89,609.85	0.12
209	301391	卡莱特	2,420	89,564.20	0.12
210	300456	赛微电子	5,200	89,336.00	0.12
211	300389	艾比森	7,500	89,325.00	0.12
212	301459	丰茂股份	2,204	89,284.04	0.12
213	301398	星源卓镁	1,900	88,160.00	0.12
214	301399	英特科技	3,200	88,096.00	0.12
215	300674	宇信科技	4,500	87,840.00	0.12
216	300627	华测导航	2,100	87,780.00	0.12
217	300278	华昌达	14,900	87,165.00	0.12
218	301259	艾布鲁	1,800	86,400.00	0.12
219	300540	蜀道装备	3,500	85,820.00	0.12

220	300897	山科智能	3,500	85,645.00	0.12
221	301067	显盈科技	2,700	85,482.00	0.12
222	300083	创世纪	13,100	85,281.00	0.12
223	300889	爱克股份	6,100	84,119.00	0.11
224	300660	江苏雷利	2,200	84,084.00	0.11
225	300725	药石科技	2,500	84,000.00	0.11
226	300449	汉邦高科	10,700	83,995.00	0.11
227	301267	华夏眼科	4,400	83,776.00	0.11
228	301205	联特科技	1,100	83,259.00	0.11
229	300698	万马科技	2,400	82,704.00	0.11
230	300499	高澜股份	4,100	82,656.00	0.11
231	300776	帝尔激光	1,300	82,654.00	0.11
232	301325	曼恩斯特	1,520	82,368.80	0.11
233	300917	特发服务	1,700	82,246.00	0.11
234	301045	天禄科技	3,700	81,844.00	0.11
235	301171	易点天下	2,900	81,751.00	0.11
236	300379	东方通	5,400	81,486.00	0.11
237	300609	汇纳科技	3,300	81,312.00	0.11
238	300491	通合科技	5,100	81,192.00	0.11
239	301328	维峰电子	1,900	80,313.00	0.11
240	300570	太辰光	1,100	79,970.00	0.11
241	301155	海力风电	1,500	79,965.00	0.11
242	300111	向日葵	24,600	79,704.00	0.11
243	300184	力源信息	8,500	79,305.00	0.11
244	300596	利安隆	2,600	79,300.00	0.11
245	300909	汇创达	3,300	78,705.00	0.11
246	300072	海新能科	22,100	78,455.00	0.11
247	301286	侨源股份	2,200	77,968.00	0.11
248	300968	格林精密	4,700	77,456.00	0.10
249	300102	乾照光电	7,400	76,664.00	0.10
250	300920	润阳科技	4,500	76,140.00	0.10
251	300677	英科医疗	3,000	75,840.00	0.10
252	300925	法本信息	3,400	75,752.00	0.10
253	300134	大富科技	6,400	75,072.00	0.10
254	300870	欧陆通	700	74,746.00	0.10
255	300036	超图软件	4,400	74,712.00	0.10
256	300671	富满微	2,100	74,634.00	0.10
257	300712	永福股份	3,100	74,617.00	0.10
258	300098	高新兴	13,600	74,528.00	0.10
259	300808	久量股份	3,200	73,504.00	0.10
260	300310	宜通世纪	9,700	73,332.00	0.10
261	300260	新莱应材	2,700	73,143.00	0.10
262	301320	豪江智能	4,900	73,059.00	0.10
263	301101	明月镜片	1,700	72,896.00	0.10

264	300322	硕贝德	5,500	72,105.00	0.10
265	300847	中船汉光	4,200	71,988.00	0.10
266	301273	瑞晨环保	3,900	71,331.00	0.10
267	300652	雷迪克	2,400	71,328.00	0.10
268	300802	矩子科技	3,900	71,253.00	0.10
269	300080	易成新能	16,300	71,231.00	0.10
270	301282	金禄电子	3,400	71,230.00	0.10
271	300567	精测电子	1,100	70,730.00	0.10
272	301498	乖宝宠物	900	70,488.00	0.10
273	300019	硅宝科技	4,800	70,272.00	0.09
274	300663	科蓝软件	4,000	69,440.00	0.09
275	301310	鑫宏业	2,700	69,120.00	0.09
276	300678	中科信息	1,900	69,103.00	0.09
277	300401	花园生物	4,700	68,902.00	0.09
278	300010	豆神教育	11,000	68,310.00	0.09
279	300469	信息发展	2,900	68,150.00	0.09
280	300131	英唐智控	8,400	68,124.00	0.09
281	301393	昊帆生物	1,700	67,847.00	0.09
282	300687	赛意信息	3,700	67,340.00	0.09
283	300834	星辉环材	3,400	67,184.00	0.09
284	300390	天华新能	2,900	66,845.00	0.09
285	300468	四方精创	4,100	66,830.00	0.09
286	301091	深城交	1,400	66,794.00	0.09
287	300880	迦南智能	3,000	66,600.00	0.09
288	300783	三只松鼠	1,800	66,366.00	0.09
289	300324	旋极信息	19,700	65,207.00	0.09
290	300366	创意信息	7,000	65,100.00	0.09
291	300337	银邦股份	5,800	64,496.00	0.09
292	301108	洁雅股份	2,500	64,375.00	0.09
293	300898	熊猫乳品	2,500	64,275.00	0.09
294	300727	润禾材料	1,900	64,106.00	0.09
295	301000	肇民科技	2,520	64,033.20	0.09
296	301370	国科恒泰	5,900	63,720.00	0.09
297	300859	西域旅游	1,800	63,324.00	0.09
298	300843	胜蓝股份	1,800	63,018.00	0.09
299	301255	通力科技	1,900	62,510.00	0.08
300	301031	中熔电气	600	62,412.00	0.08
301	300565	科信技术	5,200	62,348.00	0.08
302	300722	新余国科	2,300	62,146.00	0.08
303	300582	英飞特	4,400	61,952.00	0.08
304	301283	聚胶股份	2,400	61,704.00	0.08
305	300996	普联软件	3,400	61,608.00	0.08
306	300963	中洲特材	7,020	61,565.40	0.08
307	300288	朗玛信息	4,200	61,404.00	0.08

308	300380	安硕信息	1,300	61,399.00	0.08
309	300203	聚光科技	4,000	60,920.00	0.08
310	301488	豪恩汽电	1,100	60,819.00	0.08
311	300576	容大感光	1,340	60,541.20	0.08
312	300709	精研科技	1,500	60,255.00	0.08
313	301125	腾亚精工	5,400	59,940.00	0.08
314	300319	麦捷科技	4,800	59,904.00	0.08
314	300181	佐力药业	3,900	59,904.00	0.08
315	300440	运达科技	7,500	59,400.00	0.08
316	300006	莱美药业	16,100	58,926.00	0.08
317	301118	恒光股份	3,200	58,912.00	0.08
318	300613	富瀚微	1,000	58,500.00	0.08
319	301035	润丰股份	1,200	58,464.00	0.08
320	300210	森远股份	5,700	58,368.00	0.08
321	300713	英可瑞	3,700	58,349.00	0.08
322	300061	旗天科技	4,500	58,050.00	0.08
323	301516	中远通	3,000	57,900.00	0.08
324	301027	华蓝集团	3,600	57,816.00	0.08
325	300387	富邦科技	7,200	57,600.00	0.08
326	300369	绿盟科技	8,000	57,520.00	0.08
327	300648	星云股份	2,500	57,500.00	0.08
328	300520	科大国创	2,500	57,200.00	0.08
329	300806	斯迪克	4,400	56,980.00	0.08
330	300921	南凌科技	2,100	56,910.00	0.08
331	300071	福石控股	12,000	56,880.00	0.08
332	300603	立昂技术	5,100	56,814.00	0.08
333	300669	沪宁股份	2,700	56,349.00	0.08
334	300328	宜安科技	7,500	55,200.00	0.07
335	300342	天银机电	3,400	55,182.00	0.07
336	300563	神宇股份	1,000	55,160.00	0.07
337	300681	英搏尔	2,200	54,714.00	0.07
338	300841	康华生物	1,000	54,520.00	0.07
339	300378	鼎捷数智	2,100	54,327.00	0.07
340	301456	盘古智能	2,400	54,216.00	0.07
341	300218	安利股份	3,500	53,900.00	0.07
342	300327	中颖电子	2,200	53,834.00	0.07
343	300602	飞荣达	2,800	53,816.00	0.07
344	300242	佳云科技	13,200	53,724.00	0.07
345	301221	光庭信息	1,100	53,438.00	0.07
346	300823	建科智能	4,100	53,341.00	0.07
347	301178	天亿马	1,900	53,105.00	0.07
348	300397	天和防务	4,800	52,752.00	0.07
349	300030	阳普医疗	9,500	52,440.00	0.07
350	300543	朗科智能	5,000	52,400.00	0.07

351	300718	长盛轴承	1,700	52,173.00	0.07
352	300129	泰胜风能	7,400	52,170.00	0.07
353	301068	大地海洋	1,700	51,833.00	0.07
354	300252	金信诺	4,800	51,648.00	0.07
355	300145	中金环境	13,900	51,569.00	0.07
356	300248	新开普	5,300	51,357.00	0.07
357	300374	中铁装配	2,900	51,243.00	0.07
358	300583	赛托生物	2,600	50,830.00	0.07
359	301165	锐捷网络	700	50,540.00	0.07
360	300676	华大基因	1,200	50,364.00	0.07
361	300405	科隆股份	10,400	50,336.00	0.07
362	300682	朗新集团	4,100	50,020.00	0.07
363	301130	西点药业	1,900	49,875.00	0.07
364	300043	星辉娱乐	13,700	49,868.00	0.07
365	300344	立方数科	11,180	49,751.00	0.07
366	300542	新晨科技	2,400	49,296.00	0.07
367	300069	金利华电	3,700	48,729.00	0.07
368	300719	安达维尔	2,700	48,357.00	0.07
369	300494	盛天网络	4,300	48,332.00	0.07
370	300848	美瑞新材	2,960	48,100.00	0.07
371	301193	家联科技	2,900	47,937.00	0.06
372	300388	节能国祯	6,300	47,565.00	0.06
373	300292	吴通控股	9,800	47,530.00	0.06
374	300355	蒙草生态	9,000	46,170.00	0.06
375	301152	天力锂能	1,400	45,990.00	0.06
376	300817	双飞集团	3,300	45,771.00	0.06
377	300238	冠昊生物	3,800	45,752.00	0.06
378	300067	安诺其	7,400	45,658.00	0.06
379	300720	海川智能	2,600	45,656.00	0.06
380	300171	东富龙	3,400	45,152.00	0.06
381	300866	安克创新	460	44,914.40	0.06
382	300813	泰林生物	2,600	44,902.00	0.06
383	300161	华中数控	1,700	44,778.00	0.06
384	300466	赛摩智能	6,000	44,700.00	0.06
385	300326	凯利泰	6,800	44,200.00	0.06
386	300547	川环科技	1,600	44,064.00	0.06
387	301021	英诺激光	1,700	44,013.00	0.06
388	301397	溯联股份	1,700	43,775.00	0.06
389	301038	深水规院	2,300	43,309.00	0.06
390	300590	移为通信	2,800	43,288.00	0.06
391	301036	双乐股份	1,100	43,120.00	0.06
392	300737	科顺股份	8,500	43,095.00	0.06
393	301413	安培龙	800	42,808.00	0.06
394	300928	华安鑫创	1,300	42,757.00	0.06

395	300775	三角防务	1,700	42,381.00	0.06
396	301383	天键股份	800	42,120.00	0.06
397	300341	麦克奥迪	2,400	42,024.00	0.06
398	301001	凯淳股份	1,200	42,000.00	0.06
399	300093	金刚光伏	3,000	41,430.00	0.06
400	300822	贝仕达克	2,000	41,300.00	0.06
400	300990	同飞股份	1,000	41,300.00	0.06
401	300788	中信出版	1,300	41,041.00	0.06
402	301028	东亚机械	3,800	41,002.00	0.06
403	300610	晨化股份	4,100	41,000.00	0.06
404	300579	数字认证	1,300	40,846.00	0.06
405	300245	天玑科技	2,600	40,638.00	0.05
406	301257	普蕊斯	1,505	40,574.80	0.05
407	300770	新媒股份	1,000	40,410.00	0.05
408	300505	川金诺	2,800	40,320.00	0.05
408	300287	飞利信	9,600	40,320.00	0.05
409	301103	何氏眼科	2,000	40,240.00	0.05
410	300128	锦富技术	7,800	40,170.00	0.05
411	301141	中科磁业	1,100	39,930.00	0.05
412	301357	北方长龙	1,200	39,888.00	0.05
413	300987	川网传媒	2,800	39,648.00	0.05
414	301291	明阳电气	900	39,528.00	0.05
415	300533	冰川网络	2,000	39,520.00	0.05
416	300213	佳讯飞鸿	5,100	39,219.00	0.05
417	300824	北鼎股份	4,000	39,120.00	0.05
418	300256	星星科技	8,900	38,982.00	0.05
419	300400	劲拓股份	2,400	38,928.00	0.05
420	300997	欢乐家	2,500	38,650.00	0.05
421	301126	达嘉维康	3,700	38,628.00	0.05
422	300150	世纪瑞尔	8,800	38,544.00	0.05
423	301011	华立科技	1,500	38,535.00	0.05
424	300668	杰恩设计	1,700	38,522.00	0.05
425	300027	华谊兄弟	14,700	38,514.00	0.05
426	301486	致尚科技	800	38,280.00	0.05
427	300586	美联新材	4,700	38,258.00	0.05
428	301297	富乐德	900	38,250.00	0.05
429	300850	新强联	2,000	38,220.00	0.05
430	300176	鸿特科技	5,500	38,060.00	0.05
431	301183	东田微	700	37,660.00	0.05
432	300986	志特新材	3,100	37,634.00	0.05
433	301306	西测测试	1,000	37,370.00	0.05
434	300473	德尔股份	1,500	37,365.00	0.05
435	301121	紫建电子	700	37,142.00	0.05
436	300118	东方日升	3,100	37,138.00	0.05

437	300901	中胤时尚	3,100	36,766.00	0.05
438	300409	道氏技术	2,700	36,747.00	0.05
439	300226	上海钢联	1,600	36,592.00	0.05
440	300493	润欣科技	1,300	36,569.00	0.05
441	301550	斯菱股份	500	36,395.00	0.05
442	300906	日月明	1,400	36,372.00	0.05
443	300075	数字政通	2,100	36,330.00	0.05
444	300046	台基股份	1,000	36,270.00	0.05
445	300863	卡倍亿	800	35,760.00	0.05
446	301132	满坤科技	1,300	35,750.00	0.05
447	300805	电声股份	3,200	35,456.00	0.05
448	300180	华峰超纤	5,600	35,280.00	0.05
449	300173	福能东方	6,200	35,030.00	0.05
450	300277	海联讯	3,100	34,937.00	0.05
451	300119	瑞普生物	1,900	34,903.00	0.05
452	300622	博士眼镜	700	34,860.00	0.05
453	301366	一博科技	800	34,728.00	0.05
454	301208	中亦科技	900	34,695.00	0.05
455	300257	开山股份	3,800	34,656.00	0.05
456	300553	集智股份	1,260	34,650.00	0.05
457	300333	兆日科技	1,900	34,504.00	0.05
458	300842	帝科股份	840	34,456.80	0.05
459	300120	经纬辉开	3,700	34,410.00	0.05
460	301122	采纳股份	1,700	34,391.00	0.05
461	300654	世纪天鸿	3,400	34,306.00	0.05
462	300649	杭州园林	3,200	34,272.00	0.05
463	300201	海伦哲	6,500	34,190.00	0.05
464	300755	华致酒行	1,900	33,896.00	0.05
465	300642	透景生命	2,400	33,888.00	0.05
466	300142	沃森生物	2,800	33,824.00	0.05
467	300875	捷强装备	1,200	33,792.00	0.05
468	300307	慈星股份	4,100	33,784.00	0.05
469	300785	值得买	1,000	33,500.00	0.05
470	300343	联创股份	5,800	33,466.00	0.05
471	300294	博雅生物	1,100	33,308.00	0.05
472	301207	华兰疫苗	1,900	33,269.00	0.04
473	300871	回盛生物	3,300	33,198.00	0.04
474	300820	英杰电气	600	33,150.00	0.04
475	301023	江南奕帆	700	33,040.00	0.04
476	301239	普瑞眼科	700	32,830.00	0.04
477	300969	恒帅股份	400	32,668.00	0.04
478	300426	唐德影视	3,300	32,571.00	0.04
479	300572	安车检测	1,800	32,526.00	0.04
480	300483	首华燃气	3,300	32,472.00	0.04

481	301195	北路智控	1,000	32,110.00	0.04
482	300743	天地数码	2,100	31,983.00	0.04
483	300694	蠡湖股份	2,000	31,900.00	0.04
484	301048	金鹰重工	3,400	31,858.00	0.04
485	301378	通达海	1,100	31,504.00	0.04
486	300174	元力股份	2,100	30,912.00	0.04
487	300224	正海磁材	2,500	30,775.00	0.04
488	300605	恒锋信息	2,600	30,446.00	0.04
489	300460	惠伦晶体	2,500	30,350.00	0.04
490	300911	亿田智能	1,160	30,252.80	0.04
491	300780	德恩精工	2,100	30,156.00	0.04
492	300267	尔康制药	10,800	30,024.00	0.04
493	300222	科大智能	3,000	29,910.00	0.04
494	300900	广联航空	1,340	29,480.00	0.04
495	301082	久盛电气	2,200	29,326.00	0.04
496	301577	美信科技	500	29,300.00	0.04
497	300056	中创环保	2,200	29,216.00	0.04
498	300421	力星股份	2,600	29,094.00	0.04
499	300697	电工合金	2,300	29,003.00	0.04
500	300915	海融科技	900	28,980.00	0.04
501	300792	壹网壹创	1,200	28,800.00	0.04
502	301285	鸿日达	1,000	28,680.00	0.04
503	300592	华凯易佰	2,000	28,560.00	0.04
504	300258	精锻科技	3,200	28,512.00	0.04
505	300940	南极光	2,100	28,350.00	0.04
506	301279	金道科技	1,400	28,266.00	0.04
507	301169	零点有数	700	28,028.00	0.04
508	300726	宏达电子	900	27,990.00	0.04
509	300247	融捷健康	7,800	27,924.00	0.04
510	300354	东华测试	800	27,832.00	0.04
511	300818	耐普矿机	1,020	27,703.20	0.04
512	300490	华自科技	3,500	27,580.00	0.04
513	300489	光智科技	500	27,340.00	0.04
514	300070	碧水源	5,400	27,324.00	0.04
515	300293	蓝英装备	1,200	27,264.00	0.04
516	301029	怡合达	1,100	27,192.00	0.04
517	301419	阿莱德	900	27,171.00	0.04
518	300047	天源迪科	2,300	27,025.00	0.04
519	301421	波长光电	500	26,835.00	0.04
520	301266	宇邦新材	800	26,800.00	0.04
521	301448	开创电气	1,300	26,728.00	0.04
522	300715	凯伦股份	3,600	26,712.00	0.04
523	301369	联动科技	500	26,190.00	0.04
524	300608	思特奇	2,400	26,112.00	0.04

525	300442	润泽科技	500	25,980.00	0.04
526	301529	福赛科技	900	25,884.00	0.03
527	301211	亨迪药业	1,200	25,512.00	0.03
528	301389	隆扬电子	1,500	25,080.00	0.03
529	301099	雅创电子	600	24,870.00	0.03
530	300890	翔丰华	800	24,208.00	0.03
531	301168	通灵股份	900	24,147.00	0.03
532	301189	奥尼电子	1,000	24,050.00	0.03
533	300311	任子行	4,100	23,985.00	0.03
534	300429	强力新材	2,000	23,980.00	0.03
535	301017	漱玉平民	2,000	23,900.00	0.03
536	300063	天龙集团	2,600	23,712.00	0.03
537	300781	因赛集团	400	23,612.00	0.03
538	300087	荃银高科	2,000	23,600.00	0.03
539	300444	双杰电气	3,400	23,562.00	0.03
540	301487	盟固利	1,100	23,397.00	0.03
541	300199	翰宇药业	1,800	23,202.00	0.03
542	301004	嘉益股份	200	23,130.00	0.03
543	301520	万邦医药	600	23,100.00	0.03
544	301379	天山电子	1,140	23,028.00	0.03
545	300371	汇中股份	2,400	23,016.00	0.03
545	300154	瑞凌股份	2,100	23,016.00	0.03
546	300009	安科生物	2,600	22,464.00	0.03
546	301396	宏景科技	800	22,464.00	0.03
547	301567	贝隆精密	500	22,440.00	0.03
548	300005	探路者	3,200	22,432.00	0.03
549	301129	瑞纳智能	800	22,120.00	0.03
550	300959	线上线下	500	22,080.00	0.03
551	301387	光大同创	640	21,952.00	0.03
552	301326	捷邦科技	300	21,930.00	0.03
553	300412	迦南科技	4,700	21,714.00	0.03
554	300868	杰美特	800	21,664.00	0.03
555	300707	威唐工业	1,400	21,518.00	0.03
556	300382	斯莱克	2,000	21,480.00	0.03
557	300683	海特生物	900	21,456.00	0.03
558	300942	易瑞生物	2,500	21,425.00	0.03
559	300183	东软载波	1,100	21,285.00	0.03
560	300079	数码视讯	3,900	21,099.00	0.03
561	301073	君亭酒店	1,000	20,870.00	0.03
562	300666	江丰电子	300	20,835.00	0.03
562	300711	广哈通信	900	20,835.00	0.03
563	300177	中海达	1,900	20,729.00	0.03
564	301533	威马农机	700	20,650.00	0.03
565	300318	博晖创新	3,600	20,592.00	0.03

566	300465	高伟达	1,100	20,196.00	0.03
567	300840	酷特智能	1,000	20,020.00	0.03
568	301596	瑞迪智驱	200	20,000.00	0.03
569	301013	利和兴	1,700	19,975.00	0.03
570	301268	铭利达	1,200	19,896.00	0.03
571	300606	金太阳	1,000	19,190.00	0.03
572	301376	致欧科技	1,000	19,120.00	0.03
573	300448	浩云科技	2,900	19,111.00	0.03
574	301356	天振股份	1,200	18,912.00	0.03
574	300302	同有科技	1,200	18,912.00	0.03
575	301367	怡和嘉业	300	18,900.00	0.03
576	300042	朗科科技	800	18,480.00	0.02
577	300169	天晟新材	2,400	18,264.00	0.02
578	300539	横河精密	1,700	18,054.00	0.02
579	301066	万事利	1,300	17,953.00	0.02
580	300951	博硕科技	600	17,922.00	0.02
581	300523	辰安科技	900	17,811.00	0.02
582	300204	舒泰神	2,400	17,784.00	0.02
583	300885	海昌新材	1,600	17,600.00	0.02
584	300147	香雪制药	1,800	17,586.00	0.02
585	300893	松原安全	600	17,508.00	0.02
586	301589	诺瓦星云	100	17,360.00	0.02
587	300399	天利科技	700	17,192.00	0.02
588	300746	汉嘉设计	1,500	17,115.00	0.02
589	301128	强瑞技术	300	17,100.00	0.02
590	300658	延江股份	3,300	17,094.00	0.02
591	301072	中捷精工	900	17,046.00	0.02
592	301309	万得凯	700	16,919.00	0.02
593	300386	飞天诚信	1,000	16,800.00	0.02
594	300538	同益股份	1,100	16,753.00	0.02
595	300786	国林科技	1,200	16,680.00	0.02
596	301100	风光股份	1,000	16,600.00	0.02
597	300041	回天新材	1,800	16,560.00	0.02
598	300291	百纳千成	3,200	16,096.00	0.02
599	301177	迪阿股份	700	15,988.00	0.02
600	300851	交大思诺	600	15,900.00	0.02
601	300705	九典制药	880	15,796.00	0.02
602	300531	优博讯	1,100	15,345.00	0.02
603	300132	青松股份	3,100	15,283.00	0.02
604	300546	雄帝科技	900	15,138.00	0.02
605	300295	三六五网	900	14,949.00	0.02
606	301377	鼎泰高科	700	14,805.00	0.02
607	301097	天益医疗	400	14,640.00	0.02
608	300411	金盾股份	1,100	14,509.00	0.02

609	300680	隆盛科技	600	14,376.00	0.02
610	300521	爱司凯	700	14,343.00	0.02
611	300819	聚杰微纤	1,100	14,300.00	0.02
612	300464	星徽股份	2,700	13,959.00	0.02
613	300074	华平股份	3,500	13,930.00	0.02
614	301368	丰立智能	300	13,845.00	0.02
615	300594	朗进科技	800	13,712.00	0.02
616	300094	国联水产	3,600	13,644.00	0.02
617	300690	双一科技	600	13,566.00	0.02
618	300756	金马游乐	900	13,401.00	0.02
619	301228	实朴检测	1,000	13,230.00	0.02
620	300766	每日互动	900	13,149.00	0.02
621	300905	宝丽迪	500	13,030.00	0.02
622	301509	金凯生科	500	12,940.00	0.02
623	300353	东土科技	1,100	12,628.00	0.02
624	301016	雷尔伟	600	12,576.00	0.02
625	300423	昇辉科技	1,800	12,456.00	0.02
626	301117	佳缘科技	400	12,252.00	0.02
627	300904	威力传动	200	12,034.00	0.02
628	300269	联建光电	3,000	11,940.00	0.02
629	300053	航宇微	900	11,781.00	0.02
630	300812	易天股份	500	11,020.00	0.01
631	300815	玉禾田	700	10,913.00	0.01
632	301212	联盛化学	500	10,335.00	0.01
633	301187	欧圣电气	300	10,230.00	0.01
634	300932	三友联众	700	10,213.00	0.01
635	300215	电科院	1,700	10,081.00	0.01
636	300537	广信材料	500	9,890.00	0.01
637	300564	筑博设计	800	9,888.00	0.01
638	301578	辰奕智能	200	9,770.00	0.01
639	300675	建科院	600	9,672.00	0.01
640	301518	长华化学	600	9,642.00	0.01
641	300619	金银河	400	9,620.00	0.01
642	300417	南华仪器	800	9,424.00	0.01
643	300430	诚益通	600	9,180.00	0.01
644	301060	兰卫医学	1,000	9,110.00	0.01
645	301162	国能日新	200	9,100.00	0.01
646	300424	航新科技	500	9,030.00	0.01
647	300833	浩洋股份	200	8,830.00	0.01
648	300644	南京聚隆	400	8,744.00	0.01
649	300365	恒华科技	1,400	8,596.00	0.01
650	300931	通用电梯	1,300	8,541.00	0.01
651	300151	昌红科技	500	8,500.00	0.01
652	300888	稳健医疗	200	8,416.00	0.01

653	300758	七彩化学	700	8,386.00	0.01
654	300484	蓝海华腾	400	8,264.00	0.01
655	301227	森鹰窗业	500	8,100.00	0.01
656	300667	必创科技	500	8,085.00	0.01
657	300011	鼎汉技术	1,100	8,008.00	0.01
658	301186	超达装备	200	7,978.00	0.01
659	301120	新特电气	800	7,928.00	0.01
660	300588	熙菱信息	500	7,780.00	0.01
661	301313	凡拓数创	300	7,764.00	0.01
662	300461	田中精机	400	7,464.00	0.01
663	300200	高盟新材	900	7,452.00	0.01
664	300081	恒信东方	1,000	7,180.00	0.01
665	300552	万集科技	200	6,870.00	0.01
666	300303	聚飞光电	1,000	6,820.00	0.01
667	301568	思泰克	200	6,800.00	0.01
668	300195	长荣股份	1,200	6,756.00	0.01
669	300684	中石科技	300	6,729.00	0.01
670	300436	广生堂	200	6,534.00	0.01
671	300892	品渥食品	200	6,400.00	0.01
672	300952	恒辉安防	300	6,249.00	0.01
673	300908	仲景食品	200	6,148.00	0.01
674	301318	维海德	200	5,904.00	0.01
675	300391	长药控股	1,100	5,544.00	0.01
676	301077	星华新材	200	5,346.00	0.01
677	300234	开尔新材	1,100	5,137.00	0.01
678	301052	果麦文化	200	5,088.00	0.01
679	300937	药易购	200	5,004.00	0.01
680	300227	光韵达	600	4,998.00	0.01
681	300656	民德电子	200	4,976.00	0.01
682	301024	霍普股份	200	4,760.00	0.01
683	300615	欣天科技	400	4,596.00	0.01
684	300692	中环环保	800	4,528.00	0.01
685	301622	英思特	100	4,492.00	0.01
686	301213	观想科技	100	4,313.00	0.01
687	300647	超频三	700	4,305.00	0.01
688	300447	全信股份	300	4,251.00	0.01
689	300837	浙矿股份	200	4,032.00	0.01
690	001391	国货航	591	4,018.80	0.01
691	300320	海达股份	400	3,840.00	0.01
692	301617	博苑股份	81	3,222.99	0.00
693	300844	山水比德	100	3,138.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	23,176,233.00	31.33
2	300760	迈瑞医疗	14,307,495.00	19.34
3	300059	东方财富	8,596,524.00	11.62
4	300124	汇川技术	6,381,800.10	8.63
5	300015	爱尔眼科	5,611,489.00	7.59
6	300308	中际旭创	4,795,305.00	6.48
7	300498	温氏股份	4,295,580.00	5.81
8	300433	蓝思科技	2,729,465.00	3.69
9	300122	智飞生物	2,707,028.00	3.66
10	300014	亿纬锂能	2,466,720.00	3.33
11	300274	阳光电源	2,319,798.00	3.14
12	300033	同花顺	2,245,170.00	3.03
13	300418	昆仑万维	2,232,564.00	3.02
14	300782	卓胜微	2,136,748.00	2.89
15	300394	天孚通信	2,034,189.00	2.75
16	300502	新易盛	1,978,595.09	2.67
17	300223	北京君正	1,974,561.00	2.67
18	300454	深信服	1,900,097.28	2.57
19	300474	景嘉微	1,831,827.00	2.48
20	300496	中科创达	1,827,757.00	2.47
21	300676	华大基因	1,787,180.00	2.42
22	300144	宋城演艺	1,728,985.00	2.34
23	300001	特锐德	1,722,697.00	2.33
24	300896	爱美客	1,681,150.00	2.27
25	300765	新诺威	1,551,122.00	2.10
26	300408	三环集团	1,541,391.00	2.08
27	300613	富瀚微	1,495,967.80	2.02

注：“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	300896	爱美客	1,910,115.00	2.58
2	300750	宁德时代	1,797,368.00	2.43
3	300760	迈瑞医疗	1,452,738.00	1.96
4	300308	中际旭创	1,232,353.00	1.67
5	300313	ST 天山	1,046,820.00	1.42

6	300751	迈为股份	1,014,093.00	1.37
7	300624	万兴科技	923,612.00	1.25
8	300866	安克创新	853,735.00	1.15
9	300029	ST 天龙	840,972.00	1.14
10	300301	*ST 长方	812,027.00	1.10
11	300108	*ST 吉药	790,123.00	1.07
12	300757	罗博特科	774,109.00	1.05
13	300495	*ST 美尚	769,905.00	1.04
14	300492	华图山鼎	736,995.00	1.00
15	300782	卓胜微	724,873.00	0.98
16	301269	华大九天	651,519.00	0.88
17	300573	兴齐眼药	603,583.00	0.82
18	301312	智立方	602,696.00	0.81
19	301035	润丰股份	602,209.00	0.81
20	300059	东方财富	575,706.00	0.78

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 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	369,776,569.10
卖出股票收入（成交）总额	95,680,628.59

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期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。

8.12.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

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	97,541.70
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	97,541.70

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§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	户均持有	持有人结构
------	------	-------

数(户)	的基金份额	机构投资者		个人投资者		华夏创业板综合 ETF 发起式联接	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
1,294	45,873.86	16,792,188.00	28.29%	29,188,427.00	49.17%	13,380,158.00	22.54%

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	东方证券股份有限公司	14,861,232.00	25.04%
2	黄永耀	3,335,800.00	5.62%
3	张超杰	1,460,000.00	2.46%
4	陈航	1,188,700.00	2.00%
5	中信证券股份有限公司	1,035,356.00	1.74%
6	何易	980,700.00	1.65%
7	北京和谐天成投资管理中心（有限合伙）	610,300.00	1.03%
8	左丁	600,000.00	1.01%
9	陈翠枚	465,400.00	0.78%
10	吴丹	400,000.00	0.67%
11	国泰君安证券股份有限公司－华夏创业板综合交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	13,380,158.00	22.54%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	-	-

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的情况

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

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2024 年 2 月 1 日）基金份额总额	283,360,773.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	208,000,000.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	432,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	59,360,773.00

注：本基金合同于 2024 年 2 月 1 日生效。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

华夏创业板综合交易型开放式指数证券投资基金于 2024 年 10 月 18 日公告以通讯方式召开基金份额持有人大会，审议《关于华夏创业板综合交易型开放式指数证券投资基金持续运作的议案》，根据计票结果，未达到本次基金份额持有人大会召开条件。基金管理人已就本次会议情况向中国证监会履行备案手续。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，南翰仪同志任职国泰君安证券资产托管部副总经理(主持工作)。陈忠义同志任国泰君安证券公司副总裁，不再兼任资产托管部总经理职务。具体信息参见国泰君安证券资产托管与基金服务网站公告《关于国泰君安证券股份有限公司资产托管部负责人变更的公告》。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期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

本基金本报告期应支付给安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)的报酬为 13,877.08 元人民币。本基金本报告期内选聘安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）提供首年审计服务。

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

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人
受到稽查或处罚等措施的时间	2024-07-05
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证监会北京监管局
受到的具体措施类型	责令改正并暂停办理相关业务行政监管措施
受到稽查或处罚等措施的原因	部分制度不健全或执行不到位，部分业务管控不严
管理人采取整改措施的情况(如提出整改意见)	基金管理人高度重视，已按要求完成了整改，并已将整改落实情况报送监管机构
其他	无
措施 2	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	高级管理人员
受到稽查或处罚等措施的时间	2024-08-16
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证监会北京监管局

受到的具体措施类型	警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	部分制度不健全或执行不到位，部分业务管控不严
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	不适用
其他	无

11.6.1 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，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

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	
国泰君安证券	2	374,745,893.99	80.52%	160,854.15	90.06%	-
招商证券	1	87,112,434.92	18.72%	17,068.09	9.56%	-
中金公司	1	3,540,754.00	0.76%	693.65	0.39%	-

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择研究服务证券公司的标准，即：

i 投研部门根据证券公司的总体资质情况、财务状况、研究服务能力、经营行为及风控合规能力等情况，选择证券公司进入交易合作库，并进行跟踪评估，对合作库证券公司进行调整。

ii 投研部门牵头制定证券公司研究服务评价制度，建立健全对证券公司研究服务的定期评价机制。评价指标包括但不限于：业绩贡献、反馈速度、观点或数据质量等。

②为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择交易服务证券公司的标准，即：

i 投资部门根据证券公司的总体资质、财务状况、经营行为和合规风控能力、交易服务能力等情况，选择证券公司进入交易合作库，并进行跟踪监控，对合作库证券公司进行调整。

ii 投资部门牵头制定证券公司交易服务评价制度，建立健全对证券公司交易服务的定期评价机制。

iii 投资部门定期对证券公司的交易服务开展评价，评价指标包括但不限于：交易服务成本、交易服务能力、交易系统稳定性、交易系统支持能力、应急交易能力等。

③证券公司专用交易单元选择程序：

i 投资、研究部门牵头制定规范、合理的合作证券公司管理制度，明确证券公司准入标准、退出程序等。合规管理部门对合作证券公司管理制度进行合规性审查。

ii 投资、研究部门根据上述标准进行评估并确定选用的证券公司。

iii 本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。

④本基金合同于 2024 年 2 月 1 日生效，除本表列示外，本基金还选择了中信证券的交易单元作为本基金交易单元，本报告期无股票交易及应付佣金。

⑤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《华夏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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
国泰君安证券	5,652.15	62.53%	-	-	-	-	-	-
招商证券	3,387.04	37.47%	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-

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	华夏创业板综合交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-02-02
2	华夏创业板综合交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购、赎回业务公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-02-20
3	华夏创业板综合交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书	中国证监会规定报刊及网站	2024-02-20
4	华夏基金管理有限公司关于华夏创业板综合交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-02-20
5	华夏创业板综合交易型开放式指数证券投资基金上市交易提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-02-23
6	华夏基金管理有限公司关于华夏创业板综合交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-02-23
7	华夏基金管理有限公司关于华夏创业板综合交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-10-08
8	华夏基金管理有限公司关于华夏创业板综合交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-10-09

9	华夏基金管理有限公司关于以通讯方式召开华夏创业板综合交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-10-18
10	华夏基金管理有限公司关于以通讯方式召开华夏创业板综合交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-10-19
11	华夏基金管理有限公司关于以通讯方式召开华夏创业板综合交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-10-21
12	华夏基金管理有限公司关于华夏创业板综合交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会计票日停牌的提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-11-19
13	华夏基金管理有限公司关于华夏创业板综合交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会会议情况的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-11-20
14	华夏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	中国证监会规定报刊及网站	2024-12-25

§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	2024-03-11 至 2024-03-19,2024-04-09 至 2024-04-10,2024-04-18 至 2024-04-28,2024-05-13 至 2024-05-	-	70,986,329.00	69,950,973.00	1,035,356.00	1.74%

		21					
	2	2024-07-31 至 2024-08-15,2024-08-19,2024-08-23 至 2024-09-02,2024-09-19 至 2024-09-24,2024-10-31 至 2024-11-04,2024-11-06,2024-11-08 至 2024-11-11,2024-11-15 至 2024-11-19,2024-11-21 至 2024-11-24,2024-11-28 至 2024-12-31	-	70,982,527.00	56,121,295.00	14,861,232.00	25.04%
个人	1	2024-04-29 至 2024-05-21	-	3,335,494.00	3,335,494.00	-	-
华夏创业板综合ETF发起式联接	1	2024-05-22 至 2024-10-08,2024-11-08 至 2024-11-17,2024-11-20 至 2024-11-25,2024-11-29 至	-	14,269,800.00	889,642.00	13,380,158.00	22.54%

		2024-12-31					
产品特有风险							
本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额20%的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产，有可能对基金净值产生一定的影响，甚至可能引发基金的流动性风险。 在特定情况下，若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平，面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。							

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金注册的文件；
- 2、基金合同；
- 3、托管协议；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照。

13.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

13.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

华夏基金管理有限公司

二〇二五年三月三十一日