
华夏中证 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：华夏基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商银行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 1 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	12
§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.....	19
§8 投资组合报告	44
8.1 期末基金资产组合情况.....	44
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
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	45
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	66
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	68
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	68
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	68
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	68
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	68
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	68
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	68
8.12 投资组合报告附注	68
§9 基金份额持有人信息	69
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	69
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	70
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	70
§10 开放式基金份额变动	70
§11 重大事件揭示	70
§12 影响投资者决策的其他重要信息	74
§13 备查文件目录	75

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华夏中证 2000ETF
场内简称	ZZ2000（扩位简称：中证 2000ETF 华夏）
基金主代码	562660
交易代码	562660
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023 年 9 月 6 日
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	144,874,000.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2023 年 9 月 14 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，金融衍生品投资策略，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	中证 2000 指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华夏基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李彬	张姗
	联系电话	400-818-6666	400-61-95555
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		400-818-6666	400-61-95555
传真		010-63136700	0755-83195201
注册地址		北京市顺义区安庆大街甲3号院	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
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	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码		100101	518040
法定代表人		张佑君	缪建民

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	2023 年 9 月 6 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
本期已实现收益	26,121,994.84	3,242,426.94
本期利润	21,799,033.97	3,884,816.38
加权平均基金份额本期利润	0.1943	0.0224
本期加权平均净值利润率	20.51%	2.23%
本期基金份额净值增长率	7.94%	4.61%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末	2023 年末
期末可供分配利润	18,715,515.14	3,824,797.16
期末可供分配基金份额利润	0.1292	0.0430
期末基金资产净值	163,589,515.14	92,970,343.03
期末基金份额净值	1.1292	1.0461
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	12.92%	4.61%

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。

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

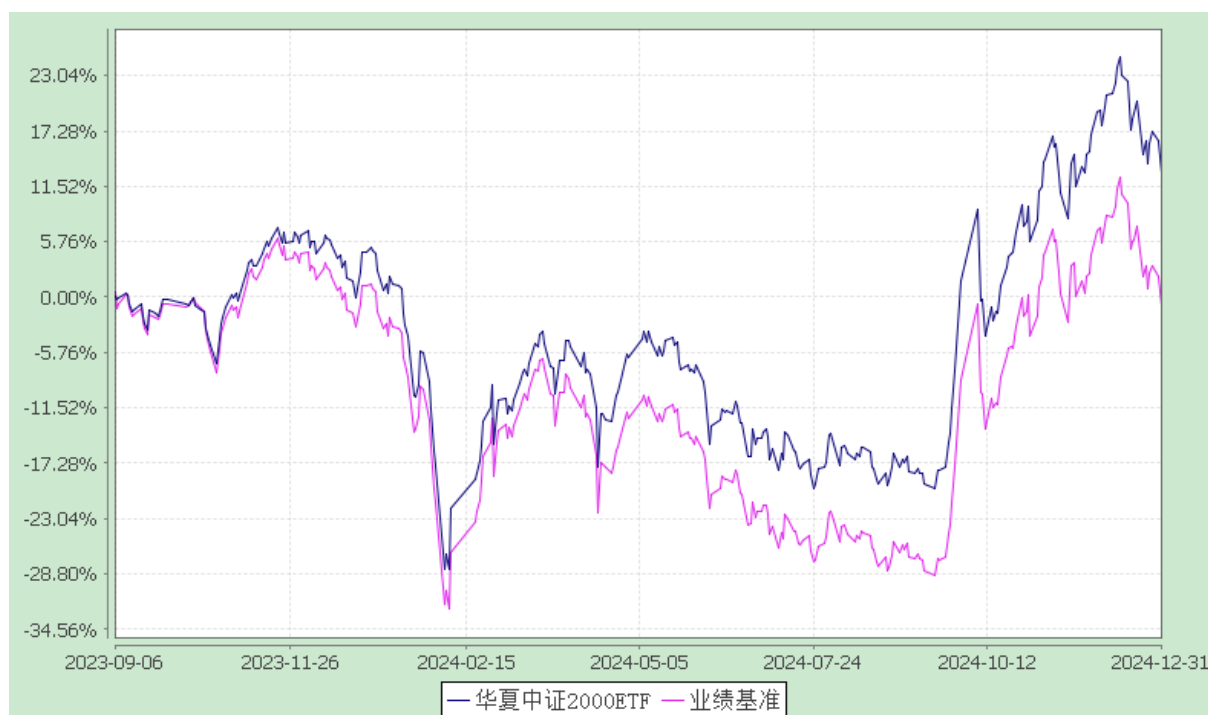
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	11.14%	2.40%	8.40%	2.66%	2.74%	-0.26%
过去六个月	32.43%	2.20%	27.56%	2.39%	4.87%	-0.19%
过去一年	7.94%	2.32%	-2.14%	2.45%	10.08%	-0.13%
自基金合同生效起至今	12.92%	2.07%	-0.92%	2.19%	13.84%	-0.12%

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

华夏中证 2000 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

(2023 年 9 月 6 日至 2024 年 12 月 31 日)

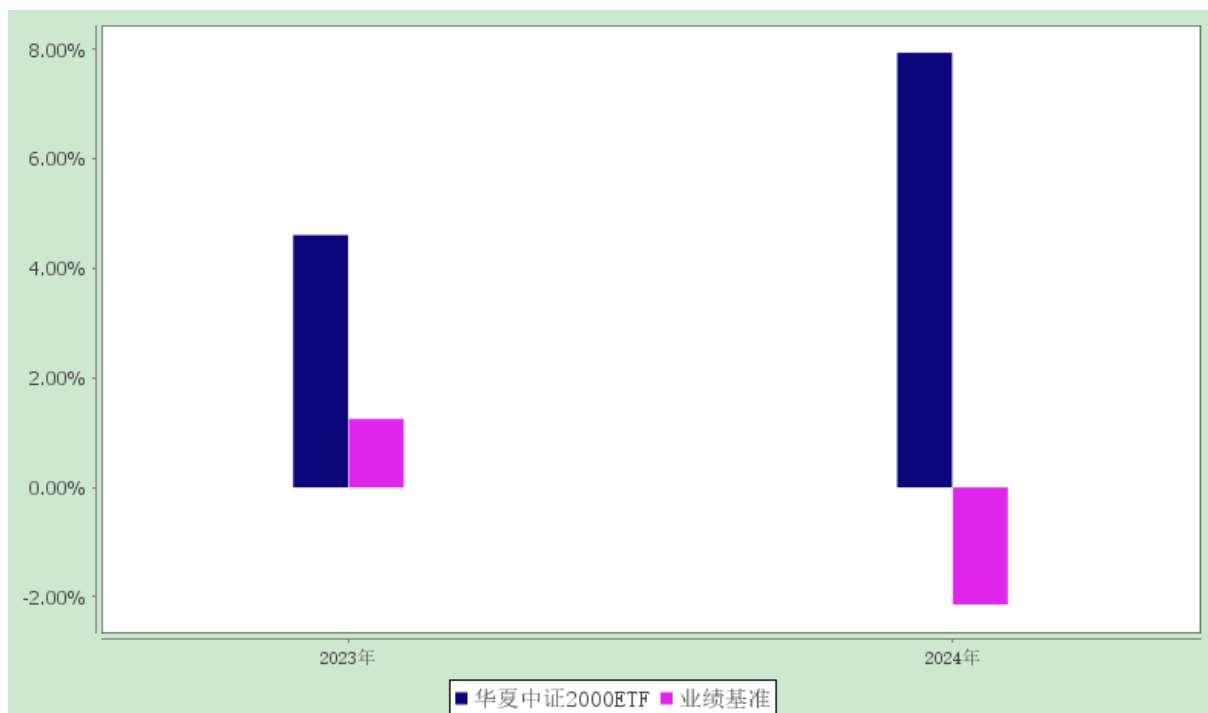


注：根据本基金的基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同中投资范围、投资限制的有关约定。

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

华夏中证 2000 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 2023 年 9 月 6 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		
鲁亚运	本基金的基金经理	2023-09-06	-	9 年	硕士。曾任国泰基金管理有限公司研究员、银华基金管理有限公司营销经理。2020 年 6 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。
陈国峰	本基金的基金经理	2023-09-26	-	9 年	硕士。曾任世坤投资咨询有限公司

					(WorldQuant) 中国区研究总监等。2020 年加入华夏基金管理有限公司。历任数量投资部研究员、投资经理助理、华夏网购精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2022 年 9 月 26 日至 2023 年 11 月 16 日期间)等。
--	--	--	--	--	---

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。本基金通过综合考虑标的指数成份股的流动性、投资限制、交易成本、交易限制等因素，采取抽样复制法构建基金的股票投资组合，实现基金投资目标。

2024 年我国经济发展面临内外环境带来的各种困难和挑战，一季度开局良好，二季度、三季度经济运行压力加大，对股市形成一定扰动，9 月 24 日以来针对经济、地产、股市等多方面稳定市场相关政策密集发布，政策的广度、力度超预期，四季度经济明显回升，股市有所回暖。回望 2024 全年，国内生产总值（GDP）首次突破 130 万亿元，按不变价格计算，比上年增长 5.0%，其中消费需求拉动 GDP 增长 2.2 个百分点，投资增长总体平稳，拉动 GDP 增长 1.3 个百分点，净出口拉动 GDP 增长 1.5 个百分点。

具体来看，全年以中证 2000 指数为代表的小微盘小幅回撤，大盘、红利风格相对稳健。板块方面，银行、非银金融、通信、家用电器、电子等行业表现靠前，医药生物、农林牧渔、美容护理等行

业跌幅较大。港股方面，美联储降息落地，港股表现更具弹性，尤其是港股高分红风格配置价值凸显。

基金投资运作方面，报告期内，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，经上海证券交易所同意，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海通证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、国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 1.1292 元，本报告期份额净值增长率为 7.94%，同期业绩比较基准增长率-2.14%。本基金本报告期跟踪偏离度为+10.08%，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

展望未来，在美联储降息周期的大背景下，国内货币政策仍有空间，稳增长、稳市场相关政策加码信号明确，支持宏观经济向好的积极因素继续增多，与此同时，随着新质生产力加速发展，以 AI 为首的科创产业正在重塑全球科技格局，有望带来中国资产的估值提升，市场或将迎来结构性估值重塑机会。

风格方面，在经济增速换挡、无风险利率下行趋势下，红利类资产股息率相对国债收益率息差走阔，多部门打出“组合拳”大力引导推动中长期资金入市，股市资金面将得到改善，红利类资产仍具备配置价值。

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智化转型，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。会计师事务所在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

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明:

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度, 我行在履行托管职责中, 严格遵守有关法律法规、托管协议的规定, 尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款, 对托管产品的投资行为进行监督, 并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则, 独立地设置、登录和保管本产品的全套账册, 进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

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

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确, 不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 审计报告

安永华明(2025)审字第 70035283_A295 号

华夏中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人:

6.1 审计意见

我们审计了华夏中证 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, 后附的华夏中证 2000 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。

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。

6.3 其他信息

华夏中证 2000 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中证 2000 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

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 张晓阳
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	3,667,390.04	2,771,148.80
结算备付金		1,086,437.19	953,121.59
存出保证金		476,593.91	656,667.64
交易性金融资产	7.4.7.2	158,858,050.02	89,045,581.31
其中：股票投资		158,858,050.02	89,040,580.94
基金投资		-	-
债券投资		-	5,000.37
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		-	698.68
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		164,088,471.16	93,427,218.02
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		1,608.10	15,864.03
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		69,559.34	40,719.23
应付托管费		13,911.87	8,143.82
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	413,876.71	392,147.91
负债合计		498,956.02	456,874.99
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	144,874,000.00	88,874,000.00
未分配利润	7.4.7.8	18,715,515.14	4,096,343.03
净资产合计		163,589,515.14	92,970,343.03
负债和净资产总计		164,088,471.16	93,427,218.02

注：①报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.1292 元，基金份额总额 144,874,000.00 份。

②本基金合同于 2023 年 9 月 6 日生效，上年度可比期间自 2023 年 9 月 6 日至 2023 年 12 月 31 日。

7.2 利润表

会计主体：华夏中证 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 6 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		22,551,472.33	4,337,436.07
1.利息收入		35,567.13	33,145.86
其中：存款利息收入	7.4.7.9	35,567.13	33,145.86
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）		27,330,423.51	4,264,459.47
其中：股票投资收益	7.4.7.10	26,901,247.50	4,156,521.56
基金投资收益	7.4.7.11	-	-
债券投资收益	7.4.7.12	30,508.67	43,009.90
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	-774,912.26	-95.02
股利收益	7.4.7.16	1,173,579.60	65,023.03
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	-4,322,960.87	642,389.44
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	-491,557.44	-602,558.70
减：二、营业总支出		752,438.36	452,619.69
1.管理人报酬		536,504.69	311,823.11
2.托管费		107,300.95	62,364.59
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		-	0.07
8.其他费用	7.4.7.21	108,632.72	78,431.92
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		21,799,033.97	3,884,816.38
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		21,799,033.97	3,884,816.38
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		21,799,033.97	3,884,816.38

注：本基金合同于 2023 年 9 月 6 日生效，上年度可比期间自 2023 年 9 月 6 日至 2023 年 12 月 31 日。

7.3 净资产变动表

会计主体：华夏中证 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	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	88,874,000.00	4,096,343.03	92,970,343.03
二、本期期初净资产	88,874,000.00	4,096,343.03	92,970,343.03
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	56,000,000.00	14,619,172.11	70,619,172.11
(一)、综合收益总额	-	21,799,033.97	21,799,033.97
(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)	56,000,000.00	-7,179,861.86	48,820,138.14
其中：1.基金申购款	324,000,000.00	-21,823,222.28	302,176,777.72
2.基金赎回款	-268,000,000.00	14,643,360.42	-253,356,639.58
(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	144,874,000.00	18,715,515.14	163,589,515.14
项目	上年度可比期间 2023 年 9 月 6 日(基金合同生效日)至 2023 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	310,874,000.00	-	310,874,000.00
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-222,000,000.00	4,096,343.03	-217,903,656.97
(一)、综合收益总额	-	3,884,816.38	3,884,816.38
(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)	-222,000,000.00	211,526.65	-221,788,473.35
其中：1.基金申购款	328,000,000.00	-2,584,426.56	325,415,573.44
2.基金赎回款	-550,000,000.00	2,795,953.21	-547,204,046.79
(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	88,874,000.00	4,096,343.03	92,970,343.03

注：本基金合同于 2023 年 9 月 6 日生效，上年度可比期间自 2023 年 9 月 6 日至 2023 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

华夏中证 2000 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]1932 号文《关于准予华夏中证 2000 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》、《华夏中证 2000 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。本基金于 2023 年 9 月 1 日共募集 310,874,000.00 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（2023）验字第 60739337_A44 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2023 年 9 月 6 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 310,874,000.00 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，基金托管人为招商银行股份有限公司。

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中证 2000 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（含存托凭证、创业板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、公开发行的次级债券、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）、金融衍生品（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：基金投资于标的指数成份股及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。

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商业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商业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。本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使基金份额净值低于面值。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	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	3,667,390.04	2,771,148.80
等于：本金	3,666,851.32	2,770,816.43
加：应计利息	538.72	332.37
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	3,667,390.04	2,771,148.80

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	163,511,461.45	-	158,858,050.02	-4,653,411.43
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	163,511,461.45	-	158,858,050.02	-4,653,411.43	
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	88,305,831.50	-	89,040,580.94	734,749.44	
贵金属投资- 金交所黄金 合约	-	-	-	-	
债券	交易所市 场	5,000.00	0.37	5,000.37	-
	银行 间市 场	-	-	-	-
	合计	5,000.00	0.37	5,000.37	-
资产支持证 券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	88,310,831.50	0.37	89,045,581.31	734,749.44	

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

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	2,556,000.00	-	-	-
其中：股指期货	2,556,000.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	2,556,000.00	-	-	-
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	3,600,320.00	-	-	-

其中：股指期货	3,600,320.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	3,600,320.00	-	-	-

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IM2503	中证 1000 期货 IM2503 合约	3	3,528,840.00	972,840.00
合计	-	-	-	972,840.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	972,840.00
净额				-

注：衍生金融资产项下的利率/权益/其他衍生工具为国债/股指/商品期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指/商品/国债期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指/商品/国债期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

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	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	159,303.71	217,686.00
其中：交易所市场	159,303.71	217,686.00
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	102,900.00	75,000.00
应退替代款	139,563.50	99,460.61
可退替代款	12,109.50	1.30
合计	413,876.71	392,147.91

7.4.7.7 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	88,874,000.00	88,874,000.00
本期申购	324,000,000.00	324,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-268,000,000.00	-268,000,000.00
本期末	144,874,000.00	144,874,000.00

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
上年度末	3,824,797.16	271,545.87	4,096,343.03
本期期初	3,824,797.16	271,545.87	4,096,343.03
本期利润	26,121,994.84	-4,322,960.87	21,799,033.97
本期基金份额交易产生的变动数	7,298,710.90	-14,478,572.76	-7,179,861.86
其中：基金申购款	17,227,605.02	-39,050,827.30	-21,823,222.28
基金赎回款	-9,928,894.12	24,572,254.54	14,643,360.42
本期已分配利润	-	-	-
本期末	37,245,502.90	-18,529,987.76	18,715,515.14

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 9 月 6 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
	活期存款利息收入	15,375.19
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	18,519.18	9,567.28
其他	1,672.76	784.27
合计	35,567.13	33,145.86

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 9 月 6 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	24,348,721.90

股票投资收益——赎回差价收入	2,552,525.60	-1,346,318.38
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	26,901,247.50	4,156,521.56

7.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年9月6日（基金合同生效日）至2023年12月31日
卖出股票成交总额	654,012,886.09	512,134,839.60
减：卖出股票成本总额	628,854,498.23	505,768,583.97
减：交易费用	809,665.96	863,415.69
买卖股票差价收入	24,348,721.90	5,502,839.94

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1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年9月6日（基金合同生效日）至2023年12月31日
赎回基金份额对价总额	253,356,639.58	547,204,046.79
减：现金支付赎回款总额	162,697,297.43	327,283,333.05
减：赎回股票成本总额	88,106,816.55	221,267,032.12
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	2,552,525.60	-1,346,318.38

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1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年9月6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	17.59	17.41

债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	30,491.08	42,992.49
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	30,508.67	43,009.90

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1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年9月6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	175,616.09	182,517.36
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	145,100.00	139,500.00
减：应计利息总额	17.96	17.54
减：交易费用	7.05	7.33
买卖债券差价收入	30,491.08	42,992.49

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

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年9月6日（基金合同生效日）至2023年12月31日
股指期货投资收益	-774,912.26	-95.02

7.4.7.16 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6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	1,173,579.60	65,023.03

其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	1,173,579.60	65,023.03

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1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年9月6日（基金合同生效日）至2023年12月31日
1.交易性金融资产	-5,388,160.87	734,749.44
——股票投资	-5,388,160.87	734,749.44
——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	1,065,200.00	-92,360.00
——权证投资	-	-
——期货投资	1,065,200.00	-92,360.00
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-4,322,960.87	642,389.44

7.4.7.18 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6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	-491,557.44	-630,537.36
其他	-	27,978.66
合计	-491,557.44	-602,558.70

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1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年9月6日（基金合同生效日）至2023年12月31日
审计费用	22,900.00	35,000.00
信息披露费	80,000.00	40,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	5,732.72	3,031.92
其他	-	400.00
合计	108,632.72	78,431.92

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
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	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
华夏中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（“华夏中证 2000ETF 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
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
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1月1日至2024年12月31日		上年度可比期间 2023年9月6日（基金合同生效日） 至2023年12月31日	
	成交金额	占当期股	成交金额	占当期股

		票成交总 额的比例		票成交总 额的比例
中信证券	176,365,911.15	13.07%	188,565,549.67	15.84%

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1月1日至2024年12月31日		上年度可比期间 2023年9月6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	30,461.72	17.35%	168,235.13	92.17%

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	77,549.79	19.58%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2023年9月6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	84,084.71	15.84%	10,610.36	4.87%

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1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年9月6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	536,504.69	311,823.11
其中：应支付销售机构的客户维护费	-	-
应支付基金管理人的净管理费	536,504.69	311,823.11

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。

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6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	107,300.95	62,364.59

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		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
华夏中证 2000ETF 发起式联接	86,540,890.00	59.74%	17,330,000.00	19.50%
中信证券	1,422,900.00	0.98%	4,617,898.00	5.20%

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1月1日至2024年12月31日		上年度可比期间 2023年9月6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
招商银行活期存款	3,667,390.04	15,375.19	2,771,148.80	22,794.31

注：本基金的活期银行存款由基金托管人招商银行保管，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 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
中信证券	301613	新铝时代	新股发行	1,171	32,436.70
中信证券	001391	国货航	新股发行	10,388	23,892.40
中信证券	001359	平安电工	新股发行	803	13,964.17
上年度可比期间 2023 年 9 月 6 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额

中信证券	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---

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

无。

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
301626	苏州天脉	2024-10-17	6个月	新发流通受限	21.23	65.78	503	10,678.69	33,087.34	-
301551	无线传媒	2024-09-19	6个月	新发流通受限	9.40	43.23	474	4,455.60	20,491.02	-
301556	托普云农	2024-10-10	6个月	新发流通受限	14.50	59.05	267	3,871.50	15,766.35	-
301522	上大股份	2024-10-09	6个月	新发流通受限	6.88	24.84	392	2,696.96	9,737.28	-
301571	国科天成	2024-08-14	6个月	新发流通受限	11.14	40.83	236	2,629.04	9,635.88	-
301586	佳力奇	2024-08-21	6个月	新发流通受限	18.09	53.14	161	2,912.49	8,555.54	-
301622	英思特	2024-11-26	6个月	新发流通受限	22.36	44.92	190	4,248.40	8,534.80	-
301607	富特科技	2024-08-28	6个月	新发流通受限	14.00	36.14	210	2,940.00	7,589.40	-
001391	国货航	2024-12-23	6个月	新发流通受限	2.30	6.80	1,039	2,389.70	7,065.20	-
001279	强邦	2024-	6个月	新发	9.68	27.91	249	2,410.32	6,949.59	-

	新材	09-27	月	流通受限						
301631	壹连科技	2024-11-12	6个月	新发流通受限	72.99	101.96	58	4,233.42	5,913.68	-
301613	新铝时代	2024-10-18	6个月	新发流通受限	27.70	41.77	118	3,268.60	4,928.86	-
301617	博苑股份	2024-12-03	6个月	新发流通受限	27.76	39.79	119	3,303.44	4,735.01	-

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

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(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002379	宏创控股	2024-12-23	重大事项	8.97	2025-01-07	9.87	101,200	711,106.60	907,764.00	-

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		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	158,858,050.02	97.11	89,040,580.94	95.77
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	5,000.37	0.01

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	158,858,050.02	97.11	89,045,581.31	95.78

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	除中证 2000 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	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	-5%	-7,614,851.81	-4,298,761.25
	+5%	7,614,851.81	4,298,761.25

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	157,807,296.07	88,847,468.06
第二层次	907,764.00	150,948.37
第三层次	142,989.95	47,164.88
合计	158,858,050.02	89,045,581.31

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 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	47,164.88	47,164.88
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	66,432.12	66,432.12
转出第三层次	-	76,175.33	76,175.33
当期利得或损失总额	-	105,568.28	105,568.28
其中：计入损益的利得或损失	-	105,568.28	105,568.28
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	142,989.95	142,989.95
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	-	92,951.79	92,951.79
项目	上年度可比期间 2023 年 9 月 6 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	30,876.27	30,876.27
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	16,288.61	16,288.61
其中：计入损益的利得或损失	-	16,288.61	16,288.61
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	47,164.88	47,164.88
期末仍持有的第三层次	-	16,288.61	16,288.61

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			
-----------------------------------	--	--	--

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	142,989.95	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	0.4607-5.7444	负相关
项目	上年度末公允价值	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	47,164.88	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	0.5512-2.1988	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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	158,858,050.02	96.81
	其中：股票	158,858,050.02	96.81
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	4,753,827.23	2.90
8	其他各项资产	476,593.91	0.29
9	合计	164,088,471.16	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	1,322,030.00	0.81
B	采矿业	518,709.00	0.32
C	制造业	110,348,119.72	67.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,741,212.00	2.29
E	建筑业	2,066,163.00	1.26
F	批发和零售业	5,401,268.70	3.30
G	交通运输、仓储和邮政业	1,989,577.20	1.22
H	住宿和餐饮业	414,177.00	0.25
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,405,041.81	10.64
J	金融业	336,820.00	0.21
K	房地产业	3,717,205.00	2.27
L	租赁和商务服务业	2,356,057.00	1.44
M	科学研究和技术服务业	3,109,901.00	1.90
N	水利、环境和公共设施管理业	3,111,874.00	1.90
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	317,818.00	0.19
Q	卫生和社会工作	278,760.00	0.17
R	文化、体育和娱乐业	2,339,804.59	1.43
S	综合	83,512.00	0.05
	合计	158,858,050.02	97.11

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	002379	宏创控股	101,200	907,764.00	0.55
2	603508	思维列控	35,000	832,300.00	0.51

3	000541	佛山照明	128,600	797,320.00	0.49
4	300548	博创科技	15,900	737,919.00	0.45
5	002491	通鼎互联	138,400	711,376.00	0.43
6	000823	超声电子	66,900	690,408.00	0.42
7	002970	锐明技术	14,400	685,872.00	0.42
8	000544	中原环保	68,700	599,751.00	0.37
9	300360	炬华科技	35,700	598,689.00	0.37
10	600184	光电股份	55,800	575,856.00	0.35
11	002483	润邦股份	107,900	562,159.00	0.34
12	300708	聚灿光电	43,900	548,311.00	0.34
13	600268	国电南自	79,800	536,256.00	0.33
14	002577	雷柏科技	28,300	535,719.00	0.33
15	002881	美格智能	17,600	527,296.00	0.32
16	002376	新北洋	79,800	520,296.00	0.32
17	000755	山西高速	100,700	509,542.00	0.31
18	600693	东百集团	72,300	506,100.00	0.31
19	002655	共达电声	39,700	505,381.00	0.31
20	002768	国恩股份	21,500	496,005.00	0.30
21	600488	津药药业	116,600	494,384.00	0.30
22	000404	长虹华意	65,800	486,920.00	0.30
23	300447	全信股份	34,200	484,614.00	0.30
24	002947	恒铭达	14,500	483,285.00	0.30
25	002578	闽发铝业	160,700	480,493.00	0.29
26	300515	三德科技	40,200	478,782.00	0.29
27	002546	新联电子	110,500	478,465.00	0.29
28	301377	鼎泰高科	22,500	475,875.00	0.29
29	300252	金信诺	44,100	474,516.00	0.29
30	002282	博深股份	62,900	466,089.00	0.28
31	603987	康德莱	64,700	464,546.00	0.28
32	002880	卫光生物	17,100	461,871.00	0.28
33	002111	威海广泰	41,600	458,432.00	0.28
34	603315	福鞍股份	42,500	455,600.00	0.28
35	002059	云南旅游	82,000	441,980.00	0.27
36	002980	华盛昌	16,800	430,920.00	0.26
37	000852	石化机械	62,300	429,870.00	0.26
38	002724	海洋王	80,700	429,324.00	0.26
39	002284	亚太股份	54,800	424,152.00	0.26
40	600592	龙溪股份	42,600	420,888.00	0.26
41	002148	北纬科技	63,400	419,074.00	0.26
42	002552	宝鼎科技	31,700	415,904.00	0.25
43	300241	瑞丰光电	75,300	413,397.00	0.25
44	002160	常铝股份	110,800	412,176.00	0.25
45	002206	海利得	96,000	411,840.00	0.25
46	000524	岭南控股	42,500	411,400.00	0.25

47	600310	广西能源	89,400	407,664.00	0.25
48	002107	沃华医药	85,000	406,300.00	0.25
49	300048	合康新能	80,400	405,216.00	0.25
50	002093	国脉科技	51,800	404,040.00	0.25
51	002752	昇兴股份	63,300	401,955.00	0.25
52	002863	今飞凯达	86,000	399,040.00	0.24
53	603158	腾龙股份	48,900	395,112.00	0.24
54	002688	金河生物	88,300	394,701.00	0.24
55	688365	光云科技	34,873	394,413.63	0.24
56	300972	万辰集团	4,900	394,009.00	0.24
57	300771	智莱科技	37,100	390,292.00	0.24
58	000042	中洲控股	86,300	385,761.00	0.24
59	000931	中关村	80,900	385,084.00	0.24
60	002218	拓日新能	95,800	380,326.00	0.23
61	002412	汉森制药	62,400	375,024.00	0.23
62	300414	中光防雷	47,100	374,916.00	0.23
63	603053	成都燃气	37,300	374,119.00	0.23
64	002035	华帝股份	50,500	370,670.00	0.23
65	603111	康尼机电	61,300	369,639.00	0.23
66	300193	佳士科技	41,500	368,935.00	0.23
67	300523	辰安科技	18,600	368,094.00	0.23
68	002935	天奥电子	22,820	367,402.00	0.22
69	603969	银龙股份	54,200	366,392.00	0.22
70	601226	华电科工	54,150	366,054.00	0.22
71	688588	凌志软件	26,519	365,962.20	0.22
72	300727	润禾材料	10,800	364,392.00	0.22
73	688233	神工股份	15,528	364,131.60	0.22
74	300485	赛升药业	51,900	363,819.00	0.22
75	300489	光智科技	6,600	360,888.00	0.22
76	688579	山大地纬	39,223	360,459.37	0.22
77	002419	天虹股份	61,500	360,390.00	0.22
78	300805	电声股份	32,500	360,100.00	0.22
78	002907	华森制药	27,700	360,100.00	0.22
79	688313	仕佳光子	21,802	357,334.78	0.22
80	002380	科远智慧	19,300	356,664.00	0.22
81	301061	匠心家居	5,700	352,260.00	0.22
82	002996	顺博合金	52,800	350,592.00	0.21
83	603380	易德龙	14,000	349,860.00	0.21
84	600851	海欣股份	60,200	349,160.00	0.21
85	300758	七彩化学	29,100	348,618.00	0.21
86	603386	骏亚科技	31,300	348,056.00	0.21
87	002364	中恒电气	31,800	343,122.00	0.21
88	603227	雪峰科技	39,400	342,386.00	0.21
89	300102	乾照光电	33,000	341,880.00	0.21

90	301389	隆扬电子	20,400	341,088.00	0.21
90	600284	浦东建设	54,400	341,088.00	0.21
91	000419	通程控股	59,600	340,316.00	0.21
92	002666	德联集团	78,000	340,080.00	0.21
93	300306	远方信息	29,100	337,560.00	0.21
94	601177	杭齿前进	40,200	332,856.00	0.20
95	002438	江苏神通	27,200	331,840.00	0.20
96	002017	东信和平	31,900	330,803.00	0.20
97	300105	龙源技术	43,100	328,853.00	0.20
98	002073	软控股份	39,800	328,748.00	0.20
99	002367	康力电梯	47,800	328,386.00	0.20
100	002454	松芝股份	49,100	326,515.00	0.20
101	301215	中汽股份	54,800	326,060.00	0.20
102	600391	航发科技	16,400	325,540.00	0.20
103	002949	华阳国际	18,200	324,324.00	0.20
104	000652	泰达股份	78,000	322,920.00	0.20
105	688550	瑞联新材	10,237	320,315.73	0.20
106	603538	美诺华	25,200	320,292.00	0.20
107	002972	科安达	30,700	319,280.00	0.20
108	600746	江苏索普	45,500	318,955.00	0.19
109	002845	同兴达	21,000	318,360.00	0.19
110	603861	白云电器	35,100	315,900.00	0.19
111	002250	联化科技	57,200	315,172.00	0.19
112	300540	蜀道装备	12,700	311,404.00	0.19
113	605058	澳弘电子	15,700	311,331.00	0.19
114	002363	隆基机械	47,300	310,761.00	0.19
115	688252	天德钰	12,970	310,631.50	0.19
116	300513	恒实科技	33,900	309,507.00	0.19
117	603855	华荣股份	15,100	306,379.00	0.19
118	603618	杭电股份	56,000	304,080.00	0.19
119	300508	维宏股份	11,200	302,960.00	0.19
120	603937	丽岛新材	33,300	301,698.00	0.18
121	300752	隆利科技	17,700	300,900.00	0.18
122	000607	华媒控股	81,000	300,510.00	0.18
123	603936	博敏电子	35,600	299,752.00	0.18
124	605066	天正电气	49,725	299,344.50	0.18
125	300870	欧陆通	2,800	298,984.00	0.18
126	000533	顺钠股份	49,000	296,940.00	0.18
127	002606	大连电瓷	32,100	295,962.00	0.18
128	002636	金安国纪	38,200	295,668.00	0.18
129	300933	中辰股份	35,300	295,108.00	0.18
130	000501	武商集团	28,200	294,972.00	0.18
131	002543	万和电气	28,700	293,888.00	0.18
132	002328	新朋股份	47,600	291,788.00	0.18

133	600638	新黄浦	57,000	290,700.00	0.18
134	688079	美迪凯	33,498	290,092.68	0.18
135	300512	中亚股份	42,300	288,063.00	0.18
136	601616	广电电气	65,500	287,545.00	0.18
137	002342	巨力索具	88,900	287,147.00	0.18
138	603421	鼎信通讯	40,100	285,913.00	0.17
139	600855	航天长峰	22,100	284,648.00	0.17
140	000788	北大医药	47,300	283,800.00	0.17
141	600551	时代出版	32,940	283,613.40	0.17
142	688519	南亚新材	13,326	283,310.76	0.17
143	003013	地铁设计	18,700	282,744.00	0.17
144	603681	永冠新材	21,900	282,291.00	0.17
145	300872	天阳科技	17,900	281,925.00	0.17
146	002627	三峡旅游	56,100	281,622.00	0.17
147	603966	法兰泰克	36,400	281,008.00	0.17
148	002782	可立克	22,200	280,830.00	0.17
149	600173	卧龙地产	70,800	280,368.00	0.17
150	600379	宝光股份	29,600	280,312.00	0.17
151	002132	恒星科技	102,200	280,028.00	0.17
152	300565	科信技术	23,300	279,367.00	0.17
153	601999	出版传媒	44,500	279,015.00	0.17
154	300143	盈康生命	30,300	278,760.00	0.17
155	603998	方盛制药	26,700	278,214.00	0.17
156	300468	四方精创	17,000	277,100.00	0.17
157	605183	确成股份	16,400	276,340.00	0.17
158	300697	电工合金	21,900	276,159.00	0.17
159	002442	龙星科技	45,900	275,859.00	0.17
160	600694	大商股份	10,460	275,830.20	0.17
161	301260	格力博	20,700	274,275.00	0.17
162	002033	丽江股份	30,900	274,083.00	0.17
163	600814	杭州解百	32,700	271,083.00	0.17
164	600495	晋西车轴	71,200	270,560.00	0.17
165	600665	天地源	86,400	270,432.00	0.17
166	300145	中金环境	72,800	270,088.00	0.17
167	002479	富春环保	56,900	269,706.00	0.16
168	603390	通达电气	24,500	269,010.00	0.16
169	605005	合兴股份	16,500	268,950.00	0.16
170	600749	西藏旅游	24,900	266,928.00	0.16
171	600496	精工钢构	88,300	266,666.00	0.16
172	300445	康斯特	16,300	265,201.00	0.16
173	002106	莱宝高科	24,300	265,113.00	0.16
174	603950	长源东谷	15,020	264,502.20	0.16
175	600980	北矿科技	17,200	262,816.00	0.16
176	603258	电魂网络	13,200	262,548.00	0.16

177	600229	城市传媒	37,600	262,072.00	0.16
178	301282	金禄电子	12,500	261,875.00	0.16
179	002919	名臣健康	15,900	261,555.00	0.16
180	000655	金岭矿业	42,300	260,145.00	0.16
181	688428	诺诚健华	20,974	257,560.72	0.16
182	603031	安孚科技	9,000	257,400.00	0.16
183	603528	多伦科技	32,600	256,888.00	0.16
184	300326	凯利泰	39,300	255,450.00	0.16
185	300730	科创信息	20,900	254,353.00	0.16
186	600053	九鼎投资	18,300	253,821.00	0.16
187	600590	泰豪科技	46,500	252,030.00	0.15
188	300467	迅游科技	16,000	251,680.00	0.15
189	300290	荣科科技	12,300	250,305.00	0.15
190	301123	奕东电子	12,200	249,490.00	0.15
191	300852	四会富仕	9,500	249,090.00	0.15
192	002884	凌霄泵业	13,600	248,472.00	0.15
193	688699	明微电子	6,889	247,590.66	0.15
194	002908	德生科技	28,200	247,032.00	0.15
195	002057	中钢天源	34,200	246,924.00	0.15
196	603067	振华股份	19,500	246,285.00	0.15
197	600368	五洲交通	51,600	246,132.00	0.15
198	300302	同有科技	15,600	245,856.00	0.15
199	603703	盛洋科技	22,300	245,523.00	0.15
200	300941	创识科技	8,100	245,430.00	0.15
201	600476	湘邮科技	16,400	245,180.00	0.15
202	002977	天箭科技	9,000	244,890.00	0.15
203	300994	久祺股份	21,700	244,776.00	0.15
204	002632	道明光学	27,400	243,860.00	0.15
205	603817	海峡环保	43,700	243,846.00	0.15
206	002917	金奥博	25,500	243,780.00	0.15
207	605056	咸亨国际	19,500	243,555.00	0.15
208	603558	健盛集团	22,600	243,176.00	0.15
209	300925	法本信息	10,900	242,852.00	0.15
210	000551	创元科技	20,300	242,788.00	0.15
211	300812	易天股份	11,000	242,440.00	0.15
212	300587	天铁科技	54,700	240,133.00	0.15
213	600525	长园集团	49,100	239,608.00	0.15
214	002540	亚太科技	38,700	238,392.00	0.15
215	300922	天秦装备	16,600	238,210.00	0.15
216	301028	东亚机械	22,000	237,380.00	0.15
217	002224	三力士	54,900	237,168.00	0.14
218	300516	久之洋	7,000	236,810.00	0.14
219	688158	优刻得	16,915	236,471.70	0.14
220	002749	国光股份	16,600	236,052.00	0.14

221	002331	皖通科技	31,800	234,684.00	0.14
222	688179	阿拉丁	16,995	234,531.00	0.14
223	002838	道恩股份	19,800	233,838.00	0.14
224	002445	中南文化	95,300	233,485.00	0.14
225	688371	菲沃泰	15,035	233,343.20	0.14
226	002014	永新股份	21,200	232,352.00	0.14
227	002166	莱茵生物	31,100	232,317.00	0.14
228	001208	华菱线缆	25,500	231,540.00	0.14
229	688095	福昕软件	3,447	231,500.52	0.14
230	603232	格尔软件	17,800	229,264.00	0.14
231	600113	浙江东日	16,400	228,288.00	0.14
232	300453	三鑫医疗	30,500	227,530.00	0.14
233	300335	迪森股份	46,900	226,058.00	0.14
234	002133	广宇集团	88,200	224,910.00	0.14
235	002574	明牌珠宝	48,300	222,663.00	0.14
236	002909	集泰股份	44,800	222,656.00	0.14
237	603787	新日股份	21,300	221,946.00	0.14
238	000612	焦作万方	34,400	220,848.00	0.14
239	600468	百利电气	46,900	220,430.00	0.13
240	300153	科泰电源	13,900	220,037.00	0.13
241	600626	申达股份	60,100	219,365.00	0.13
242	603929	亚翔集成	7,900	219,067.00	0.13
243	603256	宏和科技	26,200	218,770.00	0.13
244	002661	克明食品	21,600	217,296.00	0.13
245	002401	中远海科	13,600	215,968.00	0.13
246	002766	索菱股份	37,400	215,050.00	0.13
247	300288	朗玛信息	14,700	214,914.00	0.13
248	002703	浙江世宝	18,900	214,893.00	0.13
249	601518	吉林高速	77,200	214,616.00	0.13
250	300814	中富电路	6,600	213,972.00	0.13
251	603416	信捷电气	5,100	213,945.00	0.13
252	300247	融捷健康	59,600	213,368.00	0.13
253	603109	神驰机电	12,000	213,000.00	0.13
254	603367	辰欣药业	15,500	212,970.00	0.13
255	600684	珠江股份	64,500	212,850.00	0.13
256	002772	众兴菌业	28,800	212,256.00	0.13
257	300378	鼎捷数智	8,200	212,134.00	0.13
258	000726	鲁泰 A	32,500	211,900.00	0.13
259	600035	楚天高速	45,600	209,760.00	0.13
260	600683	京投发展	55,000	209,000.00	0.13
261	603977	国泰集团	16,100	208,495.00	0.13
262	002849	威星智能	11,700	208,494.00	0.13
263	603098	森特股份	21,700	208,320.00	0.13
264	002431	棕榈股份	99,600	208,164.00	0.13

265	600742	一汽富维	23,500	207,975.00	0.13
266	002523	天桥起重	63,500	207,645.00	0.13
267	000411	英特集团	19,400	206,610.00	0.13
268	000570	苏常柴 A	40,500	206,145.00	0.13
269	603811	诚意药业	26,700	206,124.00	0.13
270	603698	航天工程	13,200	205,392.00	0.13
271	002012	凯恩股份	39,800	205,368.00	0.13
272	600533	栖霞建设	87,100	203,814.00	0.12
273	002783	凯龙股份	25,000	203,750.00	0.12
274	300021	大禹节水	50,000	203,500.00	0.12
275	003002	壶化股份	9,000	203,040.00	0.12
276	688509	正元地信	51,000	202,470.00	0.12
277	000948	南天信息	12,100	202,433.00	0.12
278	301379	天山电子	10,000	202,000.00	0.12
279	600198	大唐电信	23,300	201,079.00	0.12
280	002522	浙江众成	51,300	200,583.00	0.12
281	002686	亿利达	37,400	200,464.00	0.12
282	301185	鸥玛软件	11,700	199,836.00	0.12
283	002616	长青集团	41,700	199,326.00	0.12
284	605166	聚合顺	16,600	198,702.00	0.12
285	000936	华西股份	24,300	198,531.00	0.12
286	300797	钢研纳克	16,800	198,408.00	0.12
287	300426	唐德影视	20,100	198,387.00	0.12
288	300862	蓝盾光电	7,300	198,341.00	0.12
289	605305	中际联合	7,000	198,310.00	0.12
290	600419	天润乳业	21,300	198,303.00	0.12
291	000523	红棉股份	65,000	198,250.00	0.12
292	300822	贝仕达克	9,600	198,240.00	0.12
293	600858	银座股份	35,600	197,580.00	0.12
294	300542	新晨科技	9,600	197,184.00	0.12
295	600973	宝胜股份	31,200	196,560.00	0.12
296	002548	金新农	49,300	195,721.00	0.12
297	002375	亚厦股份	50,400	194,544.00	0.12
298	000888	峨眉山 A	14,700	194,481.00	0.12
299	300895	铜牛信息	5,500	194,205.00	0.12
300	300541	先进数通	14,300	193,765.00	0.12
301	002104	恒宝股份	28,600	193,336.00	0.12
302	002365	永安药业	24,100	192,559.00	0.12
303	600661	昂立教育	16,400	192,208.00	0.12
304	688201	信安世纪	21,704	191,646.32	0.12
305	600756	浪潮软件	13,300	190,589.00	0.12
306	603617	君禾股份	26,000	190,580.00	0.12
307	600636	国新文化	20,500	190,240.00	0.12
308	601579	会稽山	17,200	190,232.00	0.12

309	603708	家家悦	16,700	190,213.00	0.12
310	002393	力生制药	10,760	189,806.40	0.12
311	000978	桂林旅游	31,400	189,656.00	0.12
312	300218	安利股份	12,300	189,420.00	0.12
313	300603	立昂技术	17,000	189,380.00	0.12
314	688496	清越科技	22,095	189,354.15	0.12
315	600706	曲江文旅	19,700	189,120.00	0.12
316	002322	理工能科	15,000	188,850.00	0.12
317	000417	合百集团	29,600	188,848.00	0.12
318	603982	泉峰汽车	23,600	187,856.00	0.11
319	603387	基蛋生物	22,692	187,209.00	0.11
320	688080	映翰通	5,657	186,228.44	0.11
321	300766	每日互动	12,700	185,547.00	0.11
322	600067	冠城新材	70,000	185,500.00	0.11
323	000797	中国武夷	66,900	185,313.00	0.11
324	605198	安德利	6,700	184,719.00	0.11
325	000863	三湘印象	47,600	184,688.00	0.11
326	301025	读客文化	19,323	184,148.19	0.11
327	301187	欧圣电气	5,400	184,140.00	0.11
328	300648	星云股份	8,000	184,000.00	0.11
329	300272	开能健康	29,900	183,885.00	0.11
330	300423	昇辉科技	26,500	183,380.00	0.11
331	002333	罗普斯金	35,500	182,825.00	0.11
332	300698	万马科技	5,300	182,638.00	0.11
333	688186	广大特材	11,883	182,404.05	0.11
334	002337	赛象科技	36,700	182,399.00	0.11
335	688609	九联科技	17,205	182,373.00	0.11
336	001207	联科科技	9,400	182,266.00	0.11
337	300615	欣天科技	15,800	181,542.00	0.11
338	603687	大胜达	24,900	181,521.00	0.11
339	002771	真视通	10,300	181,074.00	0.11
340	605196	华通线缆	15,500	181,040.00	0.11
341	300950	德固特	11,200	180,880.00	0.11
342	601089	福元医药	11,300	180,800.00	0.11
343	002187	广百股份	25,500	180,540.00	0.11
344	600818	中路股份	15,600	180,336.00	0.11
345	301020	密封科技	9,600	180,000.00	0.11
346	300583	赛托生物	9,200	179,860.00	0.11
347	002788	鹭燕医药	21,900	179,799.00	0.11
348	301158	德石股份	12,800	179,584.00	0.11
349	300706	阿石创	7,400	177,970.00	0.11
350	605366	宏柏新材	32,800	177,776.00	0.11
351	601700	风范股份	39,300	176,850.00	0.11
352	002609	捷顺科技	21,400	176,764.00	0.11

353	300533	冰川网络	8,900	175,864.00	0.11
354	301127	天源环保	11,600	175,624.00	0.11
355	301270	汉仪股份	4,900	175,126.00	0.11
356	300341	麦克奥迪	10,000	175,100.00	0.11
357	603112	华翔股份	14,000	175,000.00	0.11
358	688418	震有科技	5,998	174,901.68	0.11
359	688205	德科立	1,921	174,811.00	0.11
360	300569	天能重工	35,100	174,798.00	0.11
361	002912	中新赛克	6,800	174,012.00	0.11
362	301391	卡莱特	4,700	173,947.00	0.11
363	600617	国新能源	64,400	173,880.00	0.11
364	002394	联发股份	23,100	173,712.00	0.11
365	301004	嘉益股份	1,500	173,475.00	0.11
366	300560	中富通	11,200	173,376.00	0.11
367	002377	国创高新	52,300	173,113.00	0.11
368	688025	杰普特	3,640	172,900.00	0.11
369	600054	黄山旅游	15,300	172,890.00	0.11
370	600826	兰生股份	20,100	172,860.00	0.11
371	002835	同为股份	9,000	172,800.00	0.11
372	300292	吴通控股	35,400	171,690.00	0.10
373	002420	毅昌科技	32,500	171,600.00	0.10
374	600226	亨通股份	67,100	171,105.00	0.10
375	603322	超讯通信	4,500	171,000.00	0.10
376	601218	吉鑫科技	52,400	170,824.00	0.10
377	301048	金鹰重工	18,200	170,534.00	0.10
378	300918	南山智尚	16,500	170,115.00	0.10
379	002671	龙泉股份	37,500	169,875.00	0.10
380	002026	山东威达	17,200	169,248.00	0.10
381	688768	容知日新	4,650	168,981.00	0.10
382	002707	众信旅游	22,700	167,753.00	0.10
383	300225	金力泰	25,900	167,314.00	0.10
384	000096	广聚能源	13,600	166,736.00	0.10
385	600088	中视传媒	9,300	166,098.00	0.10
386	000037	深南电 A	20,800	165,568.00	0.10
387	002712	思美传媒	32,400	165,240.00	0.10
388	603916	苏博特	22,100	164,866.00	0.10
389	600300	维维股份	50,900	163,898.00	0.10
390	300479	神思电子	9,000	163,800.00	0.10
391	002642	荣联科技	22,900	163,735.00	0.10
392	002181	粤传媒	29,100	163,251.00	0.10
393	002533	金杯电工	16,500	162,360.00	0.10
394	000789	万年青	32,400	162,324.00	0.10
395	300788	中信出版	5,100	161,007.00	0.10
396	300946	恒而达	5,900	160,244.00	0.10

397	688033	天宜上佳	27,756	159,597.00	0.10
398	300996	普联软件	8,800	159,456.00	0.10
399	688028	沃尔德	7,195	159,225.35	0.10
400	603579	荣泰健康	10,900	158,050.00	0.10
401	000601	韶能股份	38,900	157,934.00	0.10
402	601798	蓝科高新	21,000	157,290.00	0.10
403	300645	正元智慧	10,600	155,714.00	0.10
404	002566	益盛药业	22,700	154,814.00	0.09
405	600512	腾达建设	64,900	153,813.00	0.09
406	300389	艾比森	12,900	153,639.00	0.09
407	000850	华茂股份	37,100	153,223.00	0.09
408	600892	大晟文化	41,400	152,766.00	0.09
409	002933	新兴装备	5,100	152,133.00	0.09
410	000710	贝瑞基因	18,000	152,100.00	0.09
411	605118	力鼎光电	8,500	151,385.00	0.09
412	300553	集智股份	5,500	151,250.00	0.09
413	002169	智光电气	24,500	150,675.00	0.09
414	000862	银星能源	30,400	150,176.00	0.09
415	300903	科翔股份	18,700	149,413.00	0.09
416	603165	荣晟环保	12,200	149,328.00	0.09
417	000715	中兴商业	21,400	148,730.00	0.09
418	000078	海王生物	58,300	148,665.00	0.09
419	300275	梅安森	10,100	148,470.00	0.09
420	300732	设研院	22,200	148,296.00	0.09
421	002887	绿茵生态	21,100	147,067.00	0.09
422	603360	百傲化学	6,600	146,850.00	0.09
423	300792	壹网壹创	6,100	146,400.00	0.09
424	300018	中元股份	21,600	146,232.00	0.09
425	300259	新天科技	41,700	145,950.00	0.09
426	300986	志特新材	12,000	145,680.00	0.09
427	688662	富信科技	4,243	145,619.76	0.09
428	002598	山东章鼓	15,400	145,530.00	0.09
429	300293	蓝英装备	6,400	145,408.00	0.09
430	603101	汇嘉时代	15,500	144,615.00	0.09
431	603933	睿能科技	9,300	144,522.00	0.09
432	603040	新坐标	6,300	144,396.00	0.09
433	300365	恒华科技	23,500	144,290.00	0.09
434	603010	万盛股份	14,000	143,780.00	0.09
435	601007	金陵饭店	20,500	143,705.00	0.09
436	002787	华源控股	18,200	143,416.00	0.09
437	603818	曲美家居	52,600	143,072.00	0.09
438	002886	沃特股份	8,600	142,932.00	0.09
439	002779	中坚科技	2,100	142,800.00	0.09
440	600939	重庆建工	47,400	142,674.00	0.09

441	300608	思特奇	13,100	142,528.00	0.09
442	603138	海量数据	9,900	142,263.00	0.09
443	688003	天准科技	3,281	142,067.30	0.09
444	002164	宁波东力	28,100	140,781.00	0.09
445	002343	慈文传媒	22,700	140,740.00	0.09
446	002813	路畅科技	6,300	140,679.00	0.09
447	688566	吉贝尔	6,266	140,358.40	0.09
448	002480	新筑股份	27,200	140,352.00	0.09
449	002395	双象股份	8,500	140,335.00	0.09
450	300095	华伍股份	20,600	139,874.00	0.09
451	000036	华联控股	34,200	139,536.00	0.09
452	002734	利民股份	17,500	139,475.00	0.09
453	002300	太阳电缆	26,100	139,374.00	0.09
454	603897	长城科技	5,900	138,650.00	0.08
455	688510	航亚科技	7,945	138,401.90	0.08
456	300571	平治信息	5,500	137,940.00	0.08
457	000798	中水渔业	18,600	137,826.00	0.08
458	300283	温州宏丰	25,000	137,250.00	0.08
459	000897	津滨发展	57,900	137,223.00	0.08
460	300684	中石科技	6,100	136,823.00	0.08
461	300121	阳谷华泰	11,300	136,617.00	0.08
462	603309	维力医疗	11,400	136,572.00	0.08
463	300843	胜蓝股份	3,900	136,539.00	0.08
464	002186	全聚德	11,700	135,720.00	0.08
465	300404	博济医药	15,500	135,315.00	0.08
466	002386	天原股份	29,600	135,272.00	0.08
467	002535	林州重机	35,100	134,433.00	0.08
468	603223	恒通股份	12,800	134,144.00	0.08
469	300643	万通智控	11,200	133,952.00	0.08
470	000635	英力特	17,200	133,816.00	0.08
471	300337	银邦股份	12,000	133,440.00	0.08
472	300471	厚普股份	14,100	133,386.00	0.08
473	002301	齐心集团	18,700	132,957.00	0.08
474	603015	弘讯科技	13,600	132,872.00	0.08
475	300179	四方达	11,800	132,750.00	0.08
476	300662	科锐国际	6,300	132,678.00	0.08
477	300500	启迪设计	12,500	132,625.00	0.08
478	300940	南极光	9,800	132,300.00	0.08
479	300160	秀强股份	24,200	131,648.00	0.08
480	603701	德宏股份	9,400	131,600.00	0.08
481	000561	烽火电子	14,800	130,832.00	0.08
482	000677	恒天海龙	31,900	130,790.00	0.08
483	000010	美丽生态	46,400	130,384.00	0.08
484	002286	保龄宝	17,600	129,888.00	0.08

485	600103	青山纸业	50,700	129,792.00	0.08
486	605286	同力日升	4,300	129,688.00	0.08
487	603697	有友食品	12,700	129,286.00	0.08
488	002170	芭田股份	14,800	129,204.00	0.08
489	000926	福星股份	50,400	128,520.00	0.08
490	000751	锌业股份	45,700	128,417.00	0.08
491	600744	华银电力	41,200	128,132.00	0.08
492	600386	北巴传媒	28,550	127,618.50	0.08
493	300831	派瑞股份	7,900	127,190.00	0.08
494	688195	腾景科技	3,157	126,848.26	0.08
495	688369	致远互联	6,314	126,721.98	0.08
496	002350	北京科锐	16,600	126,160.00	0.08
497	300192	科德教育	7,900	125,610.00	0.08
498	603992	松霖科技	6,800	125,596.00	0.08
499	000026	飞亚达	12,100	125,477.00	0.08
500	300213	佳讯飞鸿	16,300	125,347.00	0.08
501	300590	移为通信	8,100	125,226.00	0.08
502	605299	舒华体育	15,800	124,662.00	0.08
503	002590	万安科技	10,200	124,644.00	0.08
504	300469	信息发展	5,300	124,550.00	0.08
505	002785	万里石	3,800	124,450.00	0.08
506	601588	北辰实业	66,800	124,248.00	0.08
507	301218	华是科技	5,700	123,861.00	0.08
508	688312	燕麦科技	3,995	123,046.00	0.08
509	600609	金杯汽车	17,000	122,400.00	0.07
510	002481	双塔食品	22,600	122,266.00	0.07
511	000534	万泽股份	9,500	122,265.00	0.07
512	603166	福达股份	16,800	122,136.00	0.07
513	000633	合金投资	27,500	121,825.00	0.07
514	300342	天银机电	7,500	121,725.00	0.07
515	600853	龙建股份	30,400	121,600.00	0.07
516	300511	雪榕生物	35,000	121,450.00	0.07
517	300008	天海防务	25,900	121,212.00	0.07
518	688416	恒烁股份	3,107	121,173.00	0.07
519	000520	凤凰航运	25,700	120,276.00	0.07
520	600367	红星发展	10,400	120,016.00	0.07
521	300410	正业科技	22,300	119,974.00	0.07
522	600218	全柴动力	15,100	119,290.00	0.07
523	301248	杰创智能	7,500	119,100.00	0.07
524	300263	隆华科技	16,300	118,990.00	0.07
525	300047	天源迪科	10,100	118,675.00	0.07
526	002560	通达股份	17,400	118,668.00	0.07
527	300928	华安鑫创	3,600	118,404.00	0.07
528	601956	东贝集团	24,400	117,852.00	0.07

529	301331	恩威医药	5,100	117,810.00	0.07
530	601566	九牧王	14,000	117,740.00	0.07
531	603890	春秋电子	10,000	117,500.00	0.07
532	603058	永吉股份	13,300	117,306.00	0.07
533	301110	青木科技	1,900	116,926.00	0.07
534	002374	中锐股份	42,500	116,450.00	0.07
535	300518	新讯达	9,400	116,184.00	0.07
536	300879	大叶股份	7,400	116,032.00	0.07
537	605277	新亚电子	8,200	115,702.00	0.07
538	600523	贵航股份	9,700	115,624.00	0.07
539	600345	长江通信	5,000	115,600.00	0.07
540	300680	隆盛科技	4,800	115,008.00	0.07
541	301119	正强股份	3,700	114,367.00	0.07
542	000151	中成股份	8,100	114,291.00	0.07
543	688010	福光股份	3,995	113,857.50	0.07
544	603815	交建股份	20,200	113,726.00	0.07
545	300739	明阳电路	7,500	113,550.00	0.07
546	830799	艾融软件	2,200	113,454.00	0.07
547	601116	三江购物	10,400	113,152.00	0.07
548	301106	骏成科技	4,000	112,640.00	0.07
549	000521	长虹美菱	13,800	112,608.00	0.07
550	834599	同力股份	8,800	112,288.00	0.07
551	300589	江龙船艇	9,000	112,050.00	0.07
552	002149	西部材料	6,300	111,510.00	0.07
553	603516	淳中科技	2,000	110,560.00	0.07
554	003015	日久光电	7,700	110,187.00	0.07
555	300194	福安药业	24,700	110,162.00	0.07
556	002864	盘龙药业	3,600	109,476.00	0.07
557	600408	安泰集团	53,400	109,470.00	0.07
558	600237	铜峰电子	16,700	109,385.00	0.07
559	605389	长龄液压	4,100	109,183.00	0.07
560	002915	中欣氟材	8,500	108,630.00	0.07
561	300424	航新科技	6,000	108,360.00	0.07
562	688368	晶丰明源	1,214	108,046.00	0.07
563	002613	北玻股份	26,700	107,868.00	0.07
564	002858	力盛体育	9,400	107,536.00	0.07
565	600796	钱江生化	18,700	107,338.00	0.07
566	300539	横河精密	10,100	107,262.00	0.07
566	603012	创力集团	20,200	107,262.00	0.07
567	688246	嘉和美康	4,325	107,260.00	0.07
568	300848	美瑞新材	6,600	107,250.00	0.07
569	300696	爱乐达	6,900	107,157.00	0.07
570	000816	智慧农业	35,300	106,606.00	0.07
571	002029	七匹狼	16,300	106,602.00	0.07

572	688419	耐科装备	3,425	106,449.00	0.07
573	000965	天保基建	35,300	105,900.00	0.06
574	000663	永安林业	19,500	105,300.00	0.06
575	300200	高盟新材	12,700	105,156.00	0.06
576	603889	新澳股份	15,000	105,150.00	0.06
577	000912	泸天化	24,000	105,120.00	0.06
578	002758	浙农股份	12,000	105,000.00	0.06
579	688489	三未信安	3,041	104,914.50	0.06
580	300683	海特生物	4,400	104,896.00	0.06
581	300987	川网传媒	7,400	104,784.00	0.06
582	688182	灿勤科技	5,849	104,580.12	0.06
583	300656	民德电子	4,200	104,496.00	0.06
584	301052	果麦文化	4,100	104,304.00	0.06
585	002361	神剑股份	19,100	104,095.00	0.06
586	300042	朗科科技	4,500	103,950.00	0.06
587	603938	三孚股份	9,600	103,776.00	0.06
588	688381	帝奥微	5,377	103,668.56	0.06
589	002957	科瑞技术	6,600	103,554.00	0.06
590	600249	两面针	20,300	103,327.00	0.06
591	605086	龙高股份	3,300	102,960.00	0.06
592	600628	新世界	12,600	102,942.00	0.06
593	300976	达瑞电子	1,500	102,750.00	0.06
594	002664	信质集团	7,300	102,638.00	0.06
595	688311	盟升电子	3,097	102,541.67	0.06
596	300967	晓鸣股份	8,700	102,225.00	0.06
597	600071	凤凰光学	4,900	102,165.00	0.06
598	002729	好利科技	8,100	101,736.00	0.06
599	603009	北特科技	2,600	101,608.00	0.06
600	300951	博硕科技	3,400	101,558.00	0.06
601	601929	吉视传媒	54,200	101,354.00	0.06
602	300436	广生堂	3,100	101,277.00	0.06
603	002474	榕基软件	16,900	101,231.00	0.06
604	002593	日上集团	19,900	100,893.00	0.06
605	605177	东亚药业	5,100	100,470.00	0.06
606	603335	迪生力	18,100	100,455.00	0.06
607	002860	星帅尔	10,200	100,062.00	0.06
608	002956	西麦食品	6,000	100,020.00	0.06
609	688176	亚虹医药	14,721	99,955.59	0.06
610	603727	博迈科	8,700	99,876.00	0.06
611	002658	雪迪龙	15,600	99,840.00	0.06
612	002520	日发精机	17,300	99,475.00	0.06
613	600351	亚宝药业	16,300	99,267.00	0.06
614	600624	复旦复华	15,100	99,207.00	0.06
615	300016	北陆药业	15,900	98,580.00	0.06

616	300053	航宇微	7,500	98,175.00	0.06
617	688286	敏芯股份	1,628	98,087.00	0.06
618	300052	中青宝	5,800	97,324.00	0.06
619	688569	铁科轨道	4,572	97,063.56	0.06
620	600200	江苏吴中	10,400	96,928.00	0.06
621	603095	越剑智能	4,400	96,844.00	0.06
622	001338	永顺泰	8,900	96,832.00	0.06
623	300566	激智科技	4,900	96,628.00	0.06
624	688168	安博通	2,464	96,342.40	0.06
625	300893	松原安全	3,300	96,294.00	0.06
626	300011	鼎汉技术	13,200	96,096.00	0.06
627	603018	华设集团	11,700	96,057.00	0.06
628	002576	通达动力	5,600	95,984.00	0.06
629	300962	中金辐照	5,700	95,361.00	0.06
630	300514	友讯达	6,600	95,304.00	0.06
631	002140	东华科技	9,600	94,848.00	0.06
632	300791	仙乐健康	3,600	94,788.00	0.06
633	603999	读者传媒	15,400	94,710.00	0.06
634	003019	宸展光电	3,700	94,646.00	0.06
635	002623	亚玛顿	6,100	94,123.00	0.06
636	002733	雄韬股份	6,800	94,112.00	0.06
637	300829	金丹科技	5,000	93,950.00	0.06
638	688135	利扬芯片	4,679	93,907.53	0.06
639	002662	京威股份	24,200	93,654.00	0.06
640	688508	芯朋微	2,158	92,729.26	0.06
641	603408	建霖家居	7,400	92,722.00	0.06
642	688325	赛微微电	1,869	92,702.40	0.06
643	000922	佳电股份	8,200	92,578.00	0.06
644	301221	光庭信息	1,900	92,302.00	0.06
645	300112	万讯自控	10,200	91,902.00	0.06
646	000428	华天酒店	28,700	91,840.00	0.06
647	003029	吉大正元	4,200	91,644.00	0.06
648	300148	天舟文化	25,200	91,476.00	0.06
649	301277	新天地	6,600	91,278.00	0.06
650	300543	朗科智能	8,700	91,176.00	0.06
651	603116	红蜻蜓	16,400	91,020.00	0.06
652	002082	万邦德	14,100	90,663.00	0.06
653	688292	浩瀚深度	4,555	90,189.00	0.06
654	600784	鲁银投资	15,300	90,117.00	0.06
655	000700	模塑科技	12,800	89,856.00	0.05
656	688152	麒麟信安	1,726	89,821.04	0.05
657	002562	兄弟科技	21,100	89,675.00	0.05
658	000753	漳州发展	20,800	89,440.00	0.05
659	603600	永艺股份	7,500	89,175.00	0.05

660	002536	飞龙股份	7,700	89,166.00	0.05
661	002022	科华生物	14,100	88,971.00	0.05
662	688015	交控科技	4,472	88,679.76	0.05
663	002952	亚世光电	3,300	88,605.00	0.05
664	001201	东瑞股份	5,600	88,592.00	0.05
665	688173	希荻微	7,990	88,529.20	0.05
666	301299	卓创资讯	1,500	88,380.00	0.05
667	002362	汉王科技	3,900	88,374.00	0.05
668	002443	金洲管道	15,000	88,200.00	0.05
669	603085	天成自控	8,100	87,885.00	0.05
670	300802	矩子科技	4,800	87,696.00	0.05
671	300943	春晖智控	6,800	87,652.00	0.05
672	300384	三联虹普	4,700	87,514.00	0.05
673	603615	茶花股份	3,800	86,944.00	0.05
674	300510	金冠股份	20,500	86,920.00	0.05
675	605319	无锡振华	4,100	86,305.00	0.05
676	001268	联合精密	4,900	85,554.00	0.05
677	301132	满坤科技	3,100	85,250.00	0.05
678	002876	三利谱	3,300	84,678.00	0.05
679	300545	联得装备	2,700	84,591.00	0.05
680	301328	维峰电子	2,000	84,540.00	0.05
681	603189	网达软件	5,700	84,303.00	0.05
682	300546	雄帝科技	5,000	84,100.00	0.05
683	300978	东箭科技	7,700	83,853.00	0.05
684	603823	百合花	9,000	83,700.00	0.05
685	002556	辉隆股份	15,000	83,550.00	0.05
686	600620	天宸股份	14,600	83,512.00	0.05
687	600501	航天晨光	4,600	83,444.00	0.05
688	600854	春兰股份	18,200	83,356.00	0.05
689	688697	纽威数控	4,996	83,133.44	0.05
690	002263	大东南	33,500	83,080.00	0.05
691	000011	深物业 A	9,500	83,030.00	0.05
692	600830	香溢融通	7,100	82,999.00	0.05
693	301117	佳缘科技	2,700	82,701.00	0.05
694	002731	萃华珠宝	8,800	82,632.00	0.05
695	002988	豪美新材	3,900	82,563.00	0.05
696	002398	垒知集团	18,800	82,532.00	0.05
697	688159	有方科技	2,723	82,343.52	0.05
698	300631	久吾高科	3,900	82,290.00	0.05
699	600897	厦门空港	5,400	82,242.00	0.05
700	003000	劲仔食品	6,000	82,200.00	0.05
701	300612	宣亚国际	5,200	82,108.00	0.05
702	300629	新劲刚	3,800	82,080.00	0.05
703	003026	中晶科技	2,500	81,375.00	0.05

704	300745	欣锐科技	5,100	81,192.00	0.05
705	688680	海优新材	2,396	80,936.88	0.05
706	688085	三友医疗	3,801	80,543.19	0.05
707	300733	西菱动力	6,900	80,523.00	0.05
708	002628	成都路桥	17,700	80,181.00	0.05
709	603209	兴通股份	5,000	79,900.00	0.05
710	000153	丰原药业	13,000	79,690.00	0.05
711	001288	运机集团	2,600	79,430.00	0.05
712	600558	大西洋	19,500	79,365.00	0.05
713	836077	吉林碳谷	7,100	79,236.00	0.05
714	688618	三旺通信	3,770	79,207.70	0.05
715	603170	宝立食品	5,200	79,144.00	0.05
716	600180	瑞茂通	18,400	79,120.00	0.05
717	300320	海达股份	8,200	78,720.00	0.05
718	603912	佳力图	9,500	78,660.00	0.05
719	300481	濮阳惠成	5,300	78,546.00	0.05
720	300412	迦南科技	17,000	78,540.00	0.05
721	600708	光明地产	21,100	78,492.00	0.05
722	600159	大龙地产	32,700	78,480.00	0.05
723	603060	国检集团	10,700	78,217.00	0.05
724	002825	纳尔股份	10,000	78,200.00	0.05
725	603663	三祥新材	4,900	78,155.00	0.05
726	300617	安靠智电	2,700	77,787.00	0.05
727	000407	胜利股份	22,700	77,634.00	0.05
728	003020	立方制药	4,300	77,572.00	0.05
729	600168	武汉控股	17,500	77,525.00	0.05
730	003025	思进智能	5,500	77,495.00	0.05
731	301285	鸿日达	2,700	77,436.00	0.05
732	002790	瑞尔特	10,600	77,380.00	0.05
733	300056	中创环保	5,800	77,024.00	0.05
734	300900	广联航空	3,500	77,000.00	0.05
735	002016	世荣兆业	12,400	76,632.00	0.05
736	300149	睿智医药	11,900	76,398.00	0.05
737	600605	汇通能源	2,200	76,318.00	0.05
738	301120	新特电气	7,700	76,307.00	0.05
739	300858	科拓生物	5,300	76,214.00	0.05
740	300873	海晨股份	4,500	76,095.00	0.05
741	600106	重庆路桥	13,600	76,024.00	0.05
742	000900	现代投资	17,100	75,411.00	0.05
743	002448	中原内配	12,000	75,120.00	0.05
744	300480	光力科技	5,800	75,110.00	0.05
745	603499	翔港科技	2,900	74,965.00	0.05
746	603967	中创物流	7,600	74,556.00	0.05
747	688435	英方软件	2,467	74,454.06	0.05

748	300667	必创科技	4,600	74,382.00	0.05
749	688102	斯瑞新材	8,432	74,370.24	0.05
750	000529	广弘控股	12,600	74,340.00	0.05
751	002969	嘉美包装	23,900	74,329.00	0.05
752	300721	怡达股份	6,100	74,298.00	0.05
753	603088	宁波精达	8,200	74,210.00	0.05
754	600774	汉商集团	9,900	74,151.00	0.05
755	001216	华瓷股份	5,800	73,950.00	0.05
756	600162	香江控股	38,500	73,920.00	0.05
757	603586	金麒麟	5,100	73,797.00	0.05
758	300174	元力股份	5,000	73,600.00	0.04
759	603289	泰瑞机器	8,900	73,425.00	0.04
760	301159	三维天地	2,200	73,414.00	0.04
761	300578	会畅通讯	3,800	73,150.00	0.04
762	002069	獐子岛	19,900	73,033.00	0.04
763	001238	浙江正特	2,700	72,981.00	0.04
764	600207	安彩高科	16,300	72,698.00	0.04
765	300176	鸿特科技	10,500	72,660.00	0.04
766	600880	博瑞传播	15,300	72,522.00	0.04
767	002066	瑞泰科技	6,400	72,512.00	0.04
768	300616	尚品宅配	5,900	72,275.00	0.04
769	301149	隆华新材	7,300	72,197.00	0.04
770	301083	百胜智能	5,100	71,757.00	0.04
771	600288	大恒科技	8,400	71,736.00	0.04
772	301191	菲菱科思	800	71,560.00	0.04
773	603155	新亚强	5,300	71,285.00	0.04
774	300215	电科院	12,000	71,160.00	0.04
775	300531	优博讯	5,100	71,145.00	0.04
776	002538	司尔特	12,600	70,812.00	0.04
777	603788	宁波高发	5,100	70,533.00	0.04
778	002953	日丰股份	6,990	70,319.40	0.04
779	002897	意华股份	1,700	70,295.00	0.04
780	603601	再升科技	20,900	70,224.00	0.04
781	688207	格灵深瞳	4,880	69,491.20	0.04
782	688560	明冠新材	5,425	69,385.75	0.04
783	300909	汇创达	2,900	69,165.00	0.04
784	002253	川大智胜	5,000	69,100.00	0.04
785	002238	天威视讯	8,600	69,058.00	0.04
786	300161	华中数控	2,600	68,484.00	0.04
787	688488	艾迪药业	8,583	67,462.38	0.04
788	002695	煌上煌	7,900	67,387.00	0.04
789	002330	得利斯	15,400	67,298.00	0.04
790	688236	春立医疗	5,254	67,251.20	0.04
791	300235	方直科技	6,200	66,836.00	0.04

792	002923	润都股份	7,000	66,780.00	0.04
793	300817	双飞集团	4,800	66,576.00	0.04
794	600191	华资实业	9,600	66,432.00	0.04
795	603668	天马科技	5,200	66,248.00	0.04
796	300582	英飞特	4,700	66,176.00	0.04
797	603206	嘉环科技	3,800	66,044.00	0.04
798	300411	金盾股份	5,000	65,950.00	0.04
799	600560	金自天正	4,500	65,880.00	0.04
800	002296	辉煌科技	6,700	65,727.00	0.04
801	000920	沃顿科技	7,300	65,116.00	0.04
802	603825	华扬联众	4,300	64,887.00	0.04
803	603779	威龙股份	8,400	64,680.00	0.04
804	688356	键凯科技	1,131	64,399.14	0.04
805	688228	开普云	1,430	63,720.80	0.04
806	300291	百纳千成	12,600	63,378.00	0.04
807	300690	双一科技	2,800	63,308.00	0.04
808	600283	钱江水利	6,800	63,104.00	0.04
809	300488	恒锋工具	2,300	62,928.00	0.04
810	300441	鲍斯股份	7,200	62,784.00	0.04
811	835640	富士达	2,300	62,698.00	0.04
812	000631	顺发恒业	21,300	62,622.00	0.04
813	688399	硕世生物	944	62,039.68	0.04
814	301318	维海德	2,100	61,992.00	0.04
815	300304	云意电气	7,700	61,600.00	0.04
816	300718	长盛轴承	2,000	61,380.00	0.04
817	002869	金溢科技	2,300	61,180.00	0.04
818	002638	勤上股份	27,100	60,975.00	0.04
819	300625	三雄极光	5,200	60,632.00	0.04
820	603507	振江股份	2,500	60,100.00	0.04
821	002161	远望谷	10,700	59,599.00	0.04
822	300847	中船汉光	3,400	58,276.00	0.04
823	600846	同济科技	6,700	57,754.00	0.04
824	300632	光莆股份	5,200	57,668.00	0.04
825	300559	佳发教育	4,800	57,408.00	0.04
826	003028	振邦智能	1,600	57,360.00	0.04
827	603776	永安行	4,400	57,068.00	0.03
828	300884	狄耐克	5,100	57,018.00	0.03
829	300025	华星创业	5,300	56,975.00	0.03
830	002090	金智科技	6,400	56,832.00	0.03
831	002137	实益达	6,300	56,637.00	0.03
832	603066	音飞储存	5,300	56,339.00	0.03
833	600594	益佰制药	15,700	55,892.00	0.03
834	002150	通润装备	4,500	55,800.00	0.03
835	600758	辽宁能源	16,200	55,728.00	0.03

836	688377	迪威尔	2,890	55,719.20	0.03
837	603648	畅联股份	5,400	55,404.00	0.03
838	002084	海鸥住工	19,210	55,324.80	0.03
839	603017	中衡设计	6,800	54,604.00	0.03
840	000409	云鼎科技	6,000	53,460.00	0.03
841	002968	新大正	5,800	53,418.00	0.03
842	603686	福龙马	5,100	53,040.00	0.03
843	600255	鑫科材料	15,300	52,326.00	0.03
844	688189	南新制药	8,000	52,320.00	0.03
845	603629	利通电子	2,600	51,766.00	0.03
846	002769	普路通	7,400	51,578.00	0.03
847	600716	凤凰股份	13,500	51,030.00	0.03
848	002040	南京港	7,700	50,743.00	0.03
849	300809	华辰装备	1,600	50,688.00	0.03
850	000698	沈阳化工	15,000	50,550.00	0.03
851	300375	鹏翎股份	10,900	50,249.00	0.03
852	000510	新金路	13,800	49,680.00	0.03
853	300880	迦南智能	2,200	48,840.00	0.03
854	002580	圣阳股份	5,700	48,336.00	0.03
855	300650	太龙股份	4,200	48,300.00	0.03
856	002877	智能自控	5,700	47,253.00	0.03
857	688022	瀚川智能	4,273	46,832.08	0.03
858	600052	东望时代	10,300	46,556.00	0.03
859	601388	怡球资源	18,900	46,494.00	0.03
860	002679	福建金森	5,700	46,284.00	0.03
861	600469	风神股份	7,300	44,968.00	0.03
862	002119	康强电子	2,900	44,892.00	0.03
863	605136	丽人丽妆	5,200	44,876.00	0.03
864	002852	道道全	5,400	44,604.00	0.03
865	600222	太龙药业	8,700	44,283.00	0.03
866	688277	天智航	4,396	43,916.04	0.03
867	002319	乐通股份	4,100	43,583.00	0.03
868	603990	麦迪科技	4,200	43,176.00	0.03
869	002306	中科云网	14,900	42,912.00	0.03
870	603359	东珠生态	7,700	42,581.00	0.03
871	002905	金逸影视	5,400	42,552.00	0.03
872	002677	浙江美大	5,700	41,838.00	0.03
873	600189	泉阳泉	5,800	41,818.00	0.03
874	002614	奥佳华	6,300	41,706.00	0.03
875	603096	新经典	2,200	41,690.00	0.03
876	688308	欧科亿	2,307	41,641.35	0.03
877	830946	森萱医药	4,700	41,407.00	0.03
878	300402	宝色股份	2,800	41,300.00	0.03
879	002971	和远气体	2,190	41,062.50	0.03

880	002982	湘佳股份	2,300	41,055.00	0.03
881	000955	欣龙控股	9,900	40,986.00	0.03
882	603660	苏州科达	6,100	40,931.00	0.03
883	002669	康达新材	4,200	40,446.00	0.02
884	300440	运达科技	5,100	40,392.00	0.02
885	002732	燕塘乳业	2,500	39,275.00	0.02
886	688310	迈得医疗	3,634	39,247.20	0.02
887	600410	华胜天成	5,400	39,096.00	0.02
888	603738	泰晶科技	2,600	38,948.00	0.02
889	600798	宁波海运	12,600	38,178.00	0.02
890	600982	宁波能源	9,200	37,904.00	0.02
891	838402	硅烷科技	4,300	37,797.00	0.02
892	300507	苏奥传感	5,600	37,520.00	0.02
893	002599	盛通股份	4,800	35,664.00	0.02
894	002641	公元股份	8,100	35,640.00	0.02
895	688039	当虹科技	1,260	34,108.20	0.02
896	301626	苏州天脉	503	33,087.34	0.02
897	300830	金现代	3,500	28,490.00	0.02
898	600571	信雅达	2,200	27,632.00	0.02
899	873122	中纺标	500	24,620.00	0.02
900	301551	无线传媒	474	20,491.02	0.01
901	301556	托普云农	267	15,766.35	0.01
902	301522	上大股份	392	9,737.28	0.01
903	301571	国科天成	236	9,635.88	0.01
904	301586	佳力奇	161	8,555.54	0.01
905	301622	英思特	190	8,534.80	0.01
906	301607	富特科技	210	7,589.40	0.00
907	001391	国货航	1,039	7,065.20	0.00
908	001279	强邦新材	249	6,949.59	0.00
909	301631	壹连科技	58	5,913.68	0.00
910	301613	新铝时代	118	4,928.86	0.00
911	301617	博苑股份	119	4,735.01	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002880	卫光生物	2,182,412.00	2.35
2	300708	聚灿光电	2,057,570.00	2.21
3	002947	恒铭达	1,989,695.00	2.14
4	002093	国脉科技	1,762,194.00	1.90

5	002106	莱宝高科	1,696,031.00	1.82
6	002707	众信旅游	1,679,051.00	1.81
7	002845	同兴达	1,678,614.00	1.81
8	002540	亚太科技	1,615,786.00	1.74
9	002491	通鼎互联	1,589,148.00	1.71
10	000544	中原环保	1,584,751.00	1.70
11	002111	威海广泰	1,584,031.00	1.70
12	002937	兴瑞科技	1,580,121.00	1.70
13	002533	金杯电工	1,563,419.00	1.68
14	300790	宇瞳光学	1,555,520.00	1.67
15	002833	弘亚数控	1,540,727.00	1.66
16	002922	伊戈尔	1,522,585.00	1.64
17	002149	西部材料	1,512,314.00	1.63
18	300872	天阳科技	1,498,457.00	1.61
19	002282	博深股份	1,464,670.00	1.58
20	002376	新北洋	1,443,163.00	1.55

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	300708	聚灿光电	2,127,925.00	2.29
2	002947	恒铭达	2,009,793.00	2.16
3	300790	宇瞳光学	1,795,419.44	1.93
4	002937	兴瑞科技	1,762,503.00	1.90
5	002922	伊戈尔	1,735,258.00	1.87
6	002533	金杯电工	1,731,461.00	1.86
7	002588	史丹利	1,727,569.00	1.86
8	002880	卫光生物	1,723,927.00	1.85
9	300909	汇创达	1,717,260.00	1.85
10	002039	黔源电力	1,693,125.00	1.82
11	002707	众信旅游	1,690,611.00	1.82
12	300872	天阳科技	1,623,988.40	1.75
13	000949	新乡化纤	1,617,703.00	1.74
14	000551	创元科技	1,607,310.00	1.73
15	002149	西部材料	1,591,895.46	1.71
16	002106	莱宝高科	1,568,867.00	1.69
17	002833	弘亚数控	1,567,376.00	1.69
18	002393	力生制药	1,556,482.20	1.67
19	000531	穗恒运 A	1,552,624.00	1.67
20	300248	新开普	1,511,855.00	1.63

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	695,881,753.11
卖出股票收入（成交）总额	654,012,886.09

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

本基金为指数型基金，主要投资标的为指数成份股和备选成份股。基金留存的现金头寸根据基金合同规定，投资于以标的指数或与标的指数相关性较高的其他指数为基础资产的股指期货，旨在配合基金日常投资管理需要，更有效地进行流动性管理，以更好地跟踪标的指数，实现投资目标。

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	476,593.91
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	476,593.91

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002379	宏创控股	907,764.00	0.55	重大事项

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		华夏中证 2000ETF 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
1,532	94,565.27	16,157,198.00	11.15%	42,175,912.00	29.11%	86,540,890.00	59.74%

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	招商证券股份有限公司	4,184,496.00	2.89%
2	王少云	2,600,000.00	1.79%
3	罗姣青	1,790,000.00	1.24%

4	浙江连成环保科技有限公司	1,748,600.00	1.21%
5	广发证券股份有限公司	1,512,702.00	1.04%
6	中信证券股份有限公司	1,422,900.00	0.98%
7	国信证券股份有限公司	1,415,100.00	0.98%
8	BARCLAYS BANK PLC	1,140,300.00	0.79%
9	海通证券股份有限公司	1,135,400.00	0.78%
10	杨建华	1,060,000.00	0.73%
11	招商银行股份有限公司—华夏中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	86,540,890.00	59.74%

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（2023 年 9 月 6 日）基金份额总额	310,874,000.00
本报告期期初基金份额总额	88,874,000.00
本报告期基金总申购份额	324,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	268,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	144,874,000.00

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金无基金份额持有人大会决议。

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，基金托管人无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期内，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

为本基金提供审计服务的会计师事务所由普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）更换为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）。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 22,900.00 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没有受到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	

中信建投证券	3	303,007,982.22	22.46%	94,733.13	23.92%	-
中金公司	6	281,975,918.30	20.90%	94,090.17	23.75%	-
国金证券	1	186,442,324.02	13.82%	36,549.94	9.23%	-
中信证券	11	176,365,911.15	13.07%	77,549.79	19.58%	-
广发证券	2	139,914,110.55	10.37%	27,412.25	6.92%	-
招商证券	6	111,883,359.02	8.29%	21,916.34	5.53%	-
兴业证券	1	100,632,099.96	7.46%	29,669.08	7.49%	-
中泰证券	1	24,128,747.12	1.79%	4,727.30	1.19%	-
西部证券	1	18,311,892.00	1.36%	8,165.39	2.06%	-
国信证券	1	6,630,469.42	0.49%	1,299.12	0.33%	-

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除本表列示外，本基金还选择了财通证券、长江证券、第一创业证券、东北证券、东吴证券、方正证券、光大证券、国联证券、国泰君安证券、华泰证券、华西证券、江海证券、金元证券、联储证券、平安证券、上海证券、申万宏源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在上述租用的券商交易单元中，财通证券、方正证券、招商证券、中金公司的部分交易单元、广发证券、国金证券、国信证券、中泰证券的交易单元为本基金本期新增的交易单元，中银国际证

券的交易单元为本期剔除的交易单元。

⑥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
中信建投证券	82,038.49	46.71%	-	-	-	-	-	-
中金公司	54,457.53	31.01%	-	-	-	-	-	-
国金证券	8,658.35	4.93%	-	-	-	-	-	-
中信证券	30,461.72	17.35%	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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	2024-03-21
2	华夏中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金新增东吴证券股份有限公司为申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-04-16
3	华夏基金管理有限公司关于华夏中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金所持停牌股票估值调整情况的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-06-19
4	华夏基金管理有限公司关于华夏中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金所持停牌股票估值调整情况的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-06-28
5	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	2024-10-19
6	华夏基金管理有限公司关于旗下 102 只基金	中国证监会规定报刊及	2024-12-03

	改聘会计师事务所公告	网站	
7	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	2024-01-01 至 2024-02-06	20,000,000.00	-	20,000,000.00	-	-
华夏中证 2000ETF 发起式联接	1	2024-01-03 至 2024-01-24 至 2024-01-30,2024-02-19 至 2024-12-31	17,330,000.00	220,864,390.00	151,653,500.00	86,540,890.00	59.74%
产品特有风险							
<p>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。</p> <p>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</p>							

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