华泰柏瑞中证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：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2025年3月31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 28 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。

本年度报告财务资料已经审计，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。

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

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2

1.1 重要提示 2
1.2 目录 3

§2 基金简介 5

2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 6
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 6

3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 7
3.3 过去三年基金的利润分配情况 8

§4 管理人报告 9

4.1 基金管理人及基金经理情况 9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 12
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 13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 14
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 15

§5 托管人报告 15

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 15
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 15
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 15

§6 审计报告 15

6.1 审计报告基本信息 15
6.2 审计报告的基本内容 15

§7 年度财务报表 17

7.1 资产负债表 17
7.2 利润表 19
7.3 净资产变动表 20
7.4 报表附注 22

§8 投资组合报告 55

8.1 期末基金资产组合情况 55
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 56
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 57
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 79
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 88
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 88
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 89
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 89
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 89
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 89
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 89
8.12 投资组合报告附注 89

§9 基金份额持有人信息 90

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 90
9.2 期末上市基金前十名持有人 90
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 91
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 91

§10 开放式基金份额变动 92

§11 重大事件揭示 92

11.1 基金份额持有人大会决议 92
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 92
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 92
11.4 基金投资策略的改变 92
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 93
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 93
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 93
11.8 其他重大事件 95

§12 影响投资者决策的其他重要信息 98

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 98
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 98

§13 备查文件目录 98

13.1 备查文件目录 98
13.2 存放地点 98
13.3 查阅方式 98

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	中证 2000
场内简称	中证 2000（扩位证券简称：中证 2000ETF）
基金主代码	563300
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	华泰柏瑞基金管理有限公司
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	2,883,674,000.00 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	紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	1、股票（含存托凭证）的投资策略 本基金主要采用最优化抽样复制标的指数。最优化抽样依托量化投资平台，利用长期稳定的风险模型，使用“跟踪误差最小化”的最优化方式创建目标组合，从而实现对标的指数的紧密跟踪。在正常市场情况下，本基金力争做到日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。 为了更好地实现跟踪标的指数的目的，基金管理人还可以综合考虑标的指数成份股的流动性、投资限制、交易成本及基金规模等因素，决定是否采用完全复制法的策略。完全复制法指完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整；当标的指数进行定期调整、指数样本空间或者编制规则变更时，将根据标的指数的编制规则及调整公告，及时进行投资组合的优化调整，尽量降低跟踪误差，力争将日均跟踪偏离度控制在 0.2%以内，年化跟踪误差控制在 2%以内。若本基金决定修改复制方法，将在更换复制方法前按规定履行适当程序并公告。 本基金将根据投资目标，在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素的基础上，根据审慎原则合理参与存托凭证的投资，以更好地跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。 2、债券投资策略；3、股指期货的投资策略；4、资产支持证券的投资策略；5、融资及转融通证券出借业务
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为中证 2000 指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益率理论上高于混

	合型基金、债券型基金和货币市场基金。 本基金属于股票型基金中的指数型基金，跟踪中证 2000 指数，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场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		华泰柏瑞基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘万方	张姗
	联系电话	021-38601777	400-61-95555
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		400-888-0001	400-61-95555
传真		021-38601799	0755-83195201
注册地址		上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号 17 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址		上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号 17 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		200135	518040
法定代表人		贾波	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	http://www.huatai-pb.com
基金年度报告备置地点	上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼17层及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	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）-2023 年 12 月 31 日
本期已实现收益	1,138,862,036.87	2,787,636.90
本期利润	1,048,659,552.26	19,081,946.23
加权平均基金份额本期利润	0.5742	0.0408
本期加权平均净值利润率	63.07%	4.09%
本期基金份额净	0.60%	0.96%

值增长率		
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末	2023 年末
期末可供分配利润	45,378,841.85	8,534,506.47
期末可供分配基金份额利润	0.0157	0.0085
期末基金资产净值	2,929,052,841.85	1,013,267,454.02
期末基金份额净值	1.0157	1.0096
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	1.57%	0.96%

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

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。

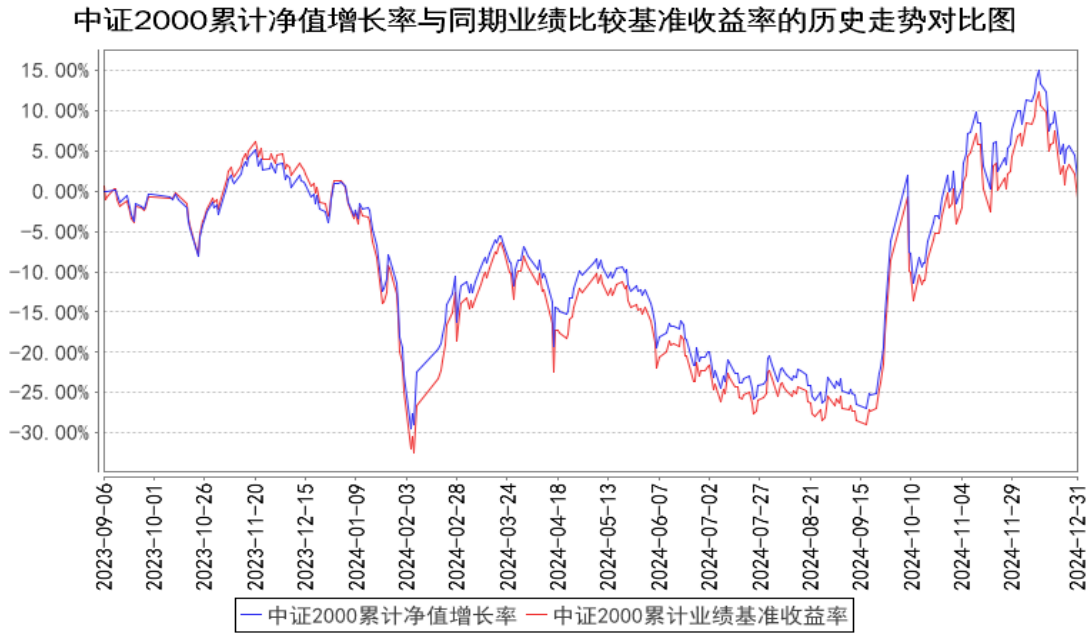
3、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	8.30%	2.62%	8.40%	2.66%	-0.10%	-0.04%
过去六个月	27.86%	2.36%	27.56%	2.39%	0.30%	-0.03%
过去一年	0.60%	2.35%	-2.14%	2.45%	2.74%	-0.10%
自基金合同生效起至今	1.57%	2.10%	-0.92%	2.19%	2.49%	-0.09%

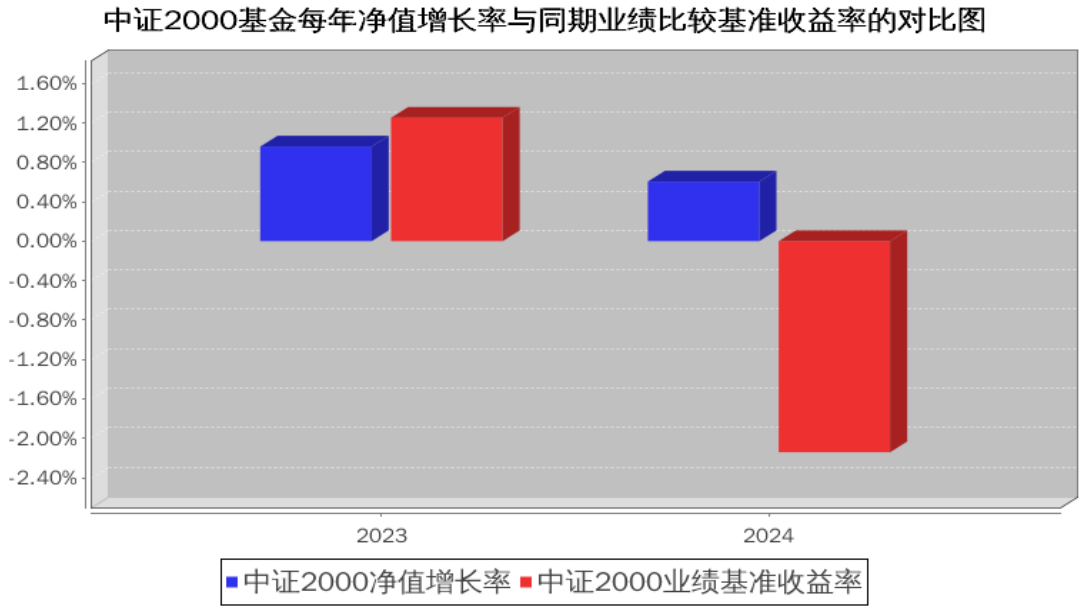
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、图示日期为 2023 年 9 月 6 日至 2024 年 12 月 31 日。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期，截至报告期末本基金的各项投资比例已达到基金合同投资范围中规定的比例。

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



注：本基金合同自 2023 年 9 月 6 日起生效，2023 年度的相关数据根据当年的实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金未实施过利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司。华泰柏瑞基金管理有限公司是经中国证监会批准，于 2004 年 11 月 18 日成立的合资基金管理公司，注册资本为 2 亿元人民币。目前的股东构成为华泰证券股份有限公司、柏瑞投资有限责任公司（原 AIGGIC）和苏州新区高新技术产业股份有限公司，出资比例分别为 49%、49%和 2%。截至 2024 年 12 月 31 日，公司旗下管理 165 只基金，其中包括股票型基金、混合型基金、债券型基金、货币型基金、QDII 基金、基金中基金等。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
柳叶青	本基金的基金经理助理	2024 年 4 月 22 日	-	6 年	英国萨塞克斯大学公司和财务风险管理专业硕士。2018 年 12 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，现任指数投资部基金经理助理。
柳军	副总经理、指数投资部总监、本基金的基金经理	2023 年 9 月 6 日	-	23 年	副总经理，硕士，2000-2001 年任上海汽车集团财务有限公司财务，2001-2004 年任华安基金管理有限公司高级基金核算员，2004 年 7 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任基金事务部总监、指数投资部总监、总经理助理兼指数投资部总监，现任公司副总经理兼指数投资部总监。2009 年 6 月起任上证红利交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2011 年 1 月至 2020 年 2 月任华泰柏瑞上证中小盘 ETF 基金、华泰柏瑞上证中小盘 ETF 联接基金基金经理。2012 年 5 月起任华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2015 年 2 月起任指数投资部总监。2015 年 5 月起任华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2018 年 3 月至 2018 年 11 月任华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 3 月至 2018 年 10 月任华泰柏瑞泰利灵活配置混合型证券投资基金

					的基金经理。2018 年 4 月起任华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2018 年 10 月起任华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2018 年 12 月起任华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 7 月起任华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019 年 9 月至 2021 年 4 月任华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2020 年 2 月至 2021 年 4 月任华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2020 年 9 月起任华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月起任华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2021 年 5 月起任华泰柏瑞南方东英恒生科技指数交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2021 年 7 月至 2023 年 8 月任华泰柏瑞中证沪港深创新药产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 8 月至 2023 年 12 月任华泰柏瑞中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 12 月起任华泰柏瑞中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 8 月起任华泰柏瑞南方东英恒生科技指数交易型开放式指数证券投资基金联接基金（QDII）的基金经理。2022 年 11 月起任华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 3 月起任华泰柏瑞纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2023 年 9 月起任华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 10 月起任华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。
李沐阳	指数投资部总监助	2023 年 9 月 6 日	-	7 年	美国哥伦比亚大学应用统计学硕士。2017 年 8 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，

	理、本基金的基金经理				历任指数投资部助理研究员、研究员、基金经理助理。2021 年 1 月起任华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月起任华泰柏瑞中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 8 月起任华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022 年 4 月起任华泰柏瑞中证全指电力公用事业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 11 月起任华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 3 月起任华泰柏瑞纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2023 年 4 月起任华泰柏瑞中证全指电力公用事业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2023 年 9 月起任华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）的基金经理。2023 年 10 月起任华泰柏瑞纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）的基金经理。2023 年 11 月起任华泰柏瑞南方东英新交所泛东南亚科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）、华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2024 年 1 月起任华泰柏瑞南方东英新交所泛东南亚科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(QDII)的基金经理。2024 年 7 月起任华泰柏瑞南方东英沙特阿拉伯交易型开放式指数证券投资基金(QDII)基金经理。2024 年 10 月起任华泰柏瑞中证油气产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 10 月起任华泰柏瑞恒生消费交易型开放式指数证券投资基金(QDII)基金经理。2024 年 12 月起任华泰柏瑞上证科创板 200 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

注：证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。任职日期和离任日期指基金管理公司作出决定之日。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：截至本报告期末，本基金的基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《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》及其他相关法律、法规的规定以及本基金的《基金合同》的约定，在严格控制风险的基础上，忠实履行基金管理职责，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金投资管理符合有关法律、法规的规定及基金合同的约定，不存在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

报告期内，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》的要求，建立了科学完善的公平交易管理制度，从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能发生的利益输送。投资部和研究部通过规范的决策流程公平对待不同投资组合。交易部对投资指令的合规性、有效性及合理性进行独立审核，对于场内交易的非组合指令启用投资管理系统中的公平交易模块；对于场外交易按照时间优先价格优先的原则公平对待不同帐户。风险管理部对报告期内的交易进行日常监控和分析评估， 同时对投资组合的交易价差在不同时间窗（如日内、3 日、5 日）下进行分析，综合判断各基金之间是否存在不公平交易或利益输送的可能，确保公平交易的实施。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司将投资管理职能和交易执行职能完全隔离，实行集中交易制度，由交易部为公募基金、专户理财和海外投资等业务统一交易服务，为公平交易的实施提供了较好的保障。

目前公司公募基金经理有兼任私募资产管理计划投资经理的情况，兼任业务遵照相关法律法规要求进行，同时遵守公司公平交易制度。公司机构设置合理，公平交易的相关管理制度健全，投资决策流程完善，各项制度执行情况良好。交易价差分析表明公司旗下各基金均得到了公平对待，不存在非公平交易和利益输送的行为。经过对不同基金之间交易相同证券时的同向交易价差进行分析发现，报告期内基金之间的买卖交易价差总体上处于正常的合理水平。

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 29 次，都为指数投资组合因跟踪指数需要而发生的反向交易。

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

2024 年中证 2000 指数相对跑输主流宽基指数，主要源于政策规范、流动性分层及市场风格切换三重压力。年初小微盘股流动性冲击，叠加新“国九条”对微盘股监管的持续收紧，加速资金向大盘蓝筹迁移，指数波动率显著高于市场均值。尽管行业轮动中部分科技制造细分领域展现韧性，但成分股盈利稳定性不足导致整体承压，高换手率折射出博弈属性主导而非基本面驱动。政策组合拳虽在 9 月提振市场情绪，但增量资金偏好高股息及大盘蓝筹的逻辑未改，中小市值估值折价进一步加深，风险溢价升至历史高位。

我们严格按照基金合同的规定，紧密跟踪标的指数、跟踪偏离最小化的投资策略进行被动投资。本报告期内，本基金的日均绝对跟踪偏离度为 0.149%，期间日跟踪误差为 0.212%，较好地实现了本基金的投资目标。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0157 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.60%，业绩比较基准收益率为-2.14%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2025 年，中证 2000 指数或迎来结构性修复机遇。“专精特新”扶持与全球供应链重构背景下，中小企业在细分领域的创新优势有望转化为业绩弹性，叠加央行宽松周期延续，流动性分层压力或边际缓和。长期而言，作为中小市值企业的重要表征指数，其战略配置价值在于力争捕捉经济转型期的非线性增长机会，特别短期市场不追求盈利兑现，同时又有明确的产业趋势时（DEEPSEEK），小盘指数弹性或更容易凸显。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2024 年度，本基金管理人在为基金份额持有人谋求最大利益的同时，始终将合规运作、防范风险工作放在各项工作的首位。依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。公司合规法律部按照规定的权限和程序，通过实时监控、现场检查、重点抽查和人员询问等方法，独立地开展基金运作和公司管理的合规性稽核，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向董事会和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

(1)全面开展基金运作合规监察工作，确保基金投资的独立性、公平性及合法合规

主要措施有：严格执行集中交易制度，各基金相互独立，交易指令由中央交易室统一执行完成；对基金投资交易系统进行事先合规性设置，并由风险控制部门进行实时监控，杜绝出现违规行为；严格检查基金的投资决策、研究支持、交易过程是否符合规定的程序；通过以上措施，保证了投资运作遵循投资决策程序与业务流程，保证了基金投资组合符合相关法规及基金合同规定，确保了基金投资行为的独立、公平及合法合规。

(2)开展定期和专项监察稽核工作，确保各项业务活动的合法合规

本年度公司合规法律部开展了对公司基金投资、研究、销售、后台运营、反洗钱等方面的专项监察稽核活动。对稽核中发现问题及时发出合规提示函，要求相关部门限期整改，并对改进情况安排后续跟踪检查，确保各项业务开展合法合规。

(3)促进公司各项内部管理制度的完善

按照相关法规、证监会等监管机关的相关规定和公司业务的发展的要求，公司合规法律部及时要求各部门制订或修改相应制度，促进公司各项内部管理制度的进一步完善。

(4)通过各种合规培训提高员工合规意识

本年度公司合规法律部通过对公司所有新入职员工进行入职前合规培训、对全体人员开展行为规范培训、对基金投资管理人员进行专项合规培训、对员工进行反洗钱培训等，有效提高了公司员工的合规意识。

通过以上工作的开展，在本报告期内本基金运作过程中未发生违规情形，基金运作整体合法合规。在今后的工作中，本基金管理人承诺将一如既往的本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，为基金持有人谋求最大利益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，基金管理人严格执行基金估值控制流程，定期评估估值技术的合理性，每日将估值结果报托管银行复核后对外披露。参与估值流程的人员包括负责运营的副总经理以及投资研究、风险控制和基金事务部门负责人，基金经理不参与估值流程。参与人员的相关工作经历均在五年以上。参与各方之间不存在任何重大利益冲突。已采用的估值技术相关参数或定价服务均来自独立第三方。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定，在符合有关基金收益分配条件的前提下，本基金收益每年最多分配 4

次，每次基金收益分配数额由基金管理人根据实际情况确定。基于本基金的性质和特点，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。截止本报告期末，本基金未进行利润分配，本基金可分配收益为 45,378,841.85 元。

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

无。

§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遵规守信、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

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2025）审字第 70025451_B16 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了华泰柏瑞中证 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，后附的华泰柏瑞中证 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，公允反映了华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	华泰柏瑞中证 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。
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，管理层负责评估华泰柏瑞中证 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。 治理层负责监督华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： （1） 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能

	涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 （2） 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 （3） 评价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，就可能导致对华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致华泰柏瑞中证 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。
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	施翊洲　　张晓阳
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层
审计报告日期	2025 年 3 月 28 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞中证 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	66,367,750.19	26,804,358.36
结算备付金		18,481,504.35	1,366,651.69
存出保证金		3,291,305.71	278,844.84
交易性金融资产	7.4.7.2	2,878,836,325.68	998,720,096.10
其中：股票投资		2,878,127,297.71	998,448,084.77
基金投资		-	-
债券投资		709,027.97	272,011.33

资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		1,243,135.75	11,353,723.52
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		2,968,220,021.68	1,038,523,674.51
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		1,289,810.73	302,267.09
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		164,987.34	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,261,254.82	210,063.00
应付托管费		252,250.96	42,012.59
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.91	0.60
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	36,198,875.07	24,701,877.21
负债合计		39,167,179.83	25,256,220.49
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	2,883,674,000.00	1,003,674,000.00
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	45,378,841.85	9,593,454.02
净资产合计		2,929,052,841.85	1,013,267,454.02
负债和净资产总计		2,968,220,021.68	1,038,523,674.51

注： 报告截止日2024年12月31日，基金份额净值1.0157元，基金份额总额2,883,674,000.00份。

7.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞中证 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		1,059,826,332.72	20,150,559.51
1.利息收入		452,577.39	57,113.75
其中：存款利息收入	7.4.7.13	452,577.39	57,113.75
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,249,491,426.00	4,132,680.57
其中：股票投资收益	7.4.7.14	1,237,048,901.03	3,880,924.47
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	283,639.49	104,488.56
资产支持证券投资收益	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	12,158,885.48	147,267.54
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.20	-90,202,484.61	16,294,309.33
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	-99,915,186.06	-333,544.14
减：二、营业总支出		11,166,780.46	1,068,613.28
1．管理人报酬	7.4.10.2.1	8,994,105.58	745,838.95
其中：暂估管理人报酬		-	-
2．托管费	7.4.10.2.2	1,798,821.20	149,167.75
3．销售服务费		-	-
4．投资顾问费		-	-

5．利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6．信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7．税金及附加		0.50	0.23
8．其他费用	7.4.7.23	373,853.18	173,606.35
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,048,659,552.26	19,081,946.23
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,048,659,552.26	19,081,946.23
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		1,048,659,552.26	19,081,946.23

7.3 净资产变动表

会计主体：华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1,003,674,000.00	-	9,593,454.02	1,013,267,454.02
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,003,674,000.00	-	9,593,454.02	1,013,267,454.02
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1,880,000,000.00	-	35,785,387.83	1,915,785,387.83
（一）、综合收益总额	-	-	1,048,659,552.26	1,048,659,552.26
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以	1,880,000,000.00	-	-1,012,874,164.43	867,125,835.57

“-”号填列）				
其中：1.基金申购款	22,280,000,000.00	-	-2,751,129,691.09	19,528,870,308.91
2.基金赎回款	-20,400,000,000.00	-	1,738,255,526.66	-18,661,744,473.34
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	2,883,674,000.00	-	45,378,841.85	2,929,052,841.85

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	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	588,674,000.00	-	-	588,674,000.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	415,000,000.00	-	9,593,454.02	424,593,454.02
（一）、综合收益总额	-	-	19,081,946.23	19,081,946.23
（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）	415,000,000.00	-	-9,488,492.21	405,511,507.79
其中：1.基金申购款	917,500,000.00	-	-12,179,917.28	905,320,082.72

2.基金赎回款	-502,500,000.00	-	2,691,425.07	-499,808,574.93
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	1,003,674,000.00	-	9,593,454.02	1,013,267,454.02

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：

韩勇	房伟力	赵景云
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2023]1940 号《关于准予华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》注册，由华泰柏瑞基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 588,674,000.00 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2023)第 0459 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华泰柏瑞中证 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 588,674,000.00 份基金份额，无认购资金利息折合基金份额。本基金的基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2023]210 号核准，本基金 588,674,000.00 份基金份额于 2023 年 9 月 14 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资

基金基金合同》的有关规定，本基金以标的指数成份股、备选成份股(含存托凭证)为主要投资对象。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股(包括创业板以及其他经中国证监会核准或注册发行的股票)、存托凭证、债券(包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。本基金投资标的指数成份股及备选成份股(均含存托凭证)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%。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。本基金的业绩比较基准为中证 2000 指数收益率。

本基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司以本基金为目标 ETF，募集成立了华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(以下简称“华泰柏瑞中证 2000ETF 联接基金”)。华泰柏瑞中证 2000ETF 联接基金为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

本财务报表由本基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于 2025 年 3 月 28 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

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

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2024 年度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 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等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。比较财务报表的实际编制期间为 2023 年 9 月 6 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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、金融负债或权益工具。

(1) 金融资产

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。

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。本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，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本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和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

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

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。本基金在投资人申购、赎回过程中而待与投资人结算的可退替代款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，在资产负债表中以交易性金融负债列示。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

金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于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，相关交易费用计入当期损益；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。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

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。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生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 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 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对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金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基金净资产比例计

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

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。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。

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扣除按票面利率(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后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额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，以及出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为当期损益。

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则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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；基金管理人每季度定期对基金相对标的指数的超额收益率进行一次评估，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，方可对超额收益进行分配；本基金的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还原后基金份额净值低于面值。基金收益分配比例为收益评价日符

合上述分红条件的基金超额收益的 100%，基金收益分配每年至多 4 次。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 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

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

(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固定收益品种按照中债金融

估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 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。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。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。

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	66,367,750.19	26,804,358.36
等于：本金	66,357,673.58	26,802,887.20
加：应计利息	10,076.61	1,471.16
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	66,367,750.19	26,804,358.36

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		2,951,917,147.99	-	2,878,127,297.71	-73,789,850.28
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	709,000.00	27.97	709,027.97	0.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	709,000.00	27.97	709,027.97	0.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		2,952,626,147.99	27.97	2,878,836,325.68	-73,789,850.28
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		982,189,272.90	-	998,448,084.77	16,258,811.87
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	272,000.00	11.33	272,011.33	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	272,000.00	11.33	272,011.33	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		982,461,272.90	11.33	998,720,096.10	16,258,811.87

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

注：本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末未持有期货合约。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

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

注：本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

注：无。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有债权投资。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有债权投资。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他债权投资。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他债权投资。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他权益工具投资。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他权益工具投资。

7.4.7.8 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	1,942,783.95	482,000.30

其中：交易所市场	1,942,783.95	482,000.30
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	210,000.00	120,000.00
应退退补款	34,046,091.12	24,099,876.91
合计	36,198,875.07	24,701,877.21

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,003,674,000.00	1,003,674,000.00
本期申购	22,280,000,000.00	22,280,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-20,400,000,000.00	-20,400,000,000.00
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	2,883,674,000.00	2,883,674,000.00

注：投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购赎回单位的整数倍。

7.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期末无其他综合收益。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	8,534,506.47	1,058,947.55	9,593,454.02
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	8,534,506.47	1,058,947.55	9,593,454.02
本期利润	1,138,862,036.87	-90,202,484.61	1,048,659,552.26
本期基金份额交易产生的变动数	-215,115,768.52	-797,758,395.91	-1,012,874,164.43
其中：基金申购款	2,182,488,396.85	-4,933,618,087.94	-2,751,129,691.09
基金赎回款	-2,397,604,165.37	4,135,859,692.03	1,738,255,526.66
本期已分配利润	-	-	-
本期末	932,280,774.82	-886,901,932.97	45,378,841.85

7.4.7.13 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	172,317.89	47,393.43
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	237,178.85	8,820.11
其他	43,080.65	900.21
合计	452,577.39	57,113.75

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年9月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	894,187,578.07	5,236,378.34
股票投资收益——赎回差价收入	342,861,322.96	-1,355,453.87
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	1,237,048,901.03	3,880,924.47

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年9月6日（基金合同生效日）至2023年12月31日
卖出股票成交总额	12,531,973,973.48	534,684,649.86
减：卖出股票成本总额	11,625,900,533.29	528,009,006.61
减：交易费用	11,885,862.12	1,439,264.91
买卖股票差价收入	894,187,578.07	5,236,378.34

7.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年9月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	18,661,744,473.34	499,808,574.93
减：现金支付赎回款总额	12,282,685,902.34	317,067,172.93
减：赎回股票成本总额	6,036,197,248.04	184,096,855.87
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	342,861,322.96	-1,355,453.87

7.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无股票投资收益——申购差价收入。

7.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无股票投资收益——证券出借差价收入。

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年9月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	136.05	58.90
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	283,503.44	104,429.66
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	283,639.49	104,488.56

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间

	2024年1月1日至2024年12月31日	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	1,314,179.60	489,798.64
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,030,500.00	385,300.00
减：应计利息总额	123.60	49.40
减：交易费用	52.56	19.58
买卖债券差价收入	283,503.44	104,429.66

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益——赎回差价收入。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益——申购差价收入。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益——赎回差价收入。

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益——申购差价收入。

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益——赎回差价收入。

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益——申购差价收入。

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——其他投资收益。

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 9 月 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	12,158,885.48	147,267.54
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	12,158,885.48	147,267.54

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 9 月 6 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	-90,048,662.15	16,258,811.87
股票投资	-90,048,662.15	16,258,811.87
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	-153,822.46	35,497.46
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-90,202,484.61	16,294,309.33

注：其他为可退替代款的公允价值变动。

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间

	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	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	-99,915,186.06	-386,524.80
其他	-	52,980.66
合计	-99,915,186.06	-333,544.14

注：替代损益是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申购(赎回)本基金时，补入(卖出)被替代股票的实际买入成本(实际卖出金额)与申购(赎回)确认日估值的差额或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购(赎回)确认日估值的差额。

7.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期及上年度可比期间无信用减值损失。

7.4.7.23 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	70,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	40,000.00
证券出借违约金	-	-
开户费	-	400.00
注册登记费	150,000.00	50,000.00
IOPV 计算发布费	5,972.60	20,000.00
银行划款手续费	27,880.58	3,206.35
合计	373,853.18	173,606.35

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，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华泰柏瑞基金管理有限公司(“华泰柏瑞基金”)	基金管理人、基金销售机构
招商银行股份有限公司(“招商银行”)	基金托管人
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、申购赎回代理券商、基金销售机构
PineBridge Investment LLC	基金管理人的股东

苏州新区高新技术产业股份有限公司	基金管理人的股东
华泰联合证券有限责任公司(“华泰联合证券”)	基金管理人的股东华泰证券的控股子公司
华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(“中证 2000 联接”)	本基金的基金管理人管理的其他基金

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	占当期股票成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
华泰证券	4,049,958.76	0.02	223,840.10	0.01

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023年9月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（%）
华泰证券	-	-	191,571.71	39.11

7.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
华泰证券	3,705.57	0.09	33.63	0.00

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（%）
华泰证券	209.49	0.02	-	-

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

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

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	8,994,105.58	745,838.95
其中：应支付销售机构的客户维护费	212,685.64	31,900.41
应支付基金管理人的净管理费	8,781,419.94	713,938.54

注：自2023年9月6日起，支付基金管理人华泰柏瑞基金的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。其计算公式为：

日管理人报酬＝前一日基金资产净值 × 0.50% / 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	1,798,821.20	149,167.75

注：自2023年9月6日起，支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费＝前一日基金资产净值 × 0.10% / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：本基金本报告期及上年度可比期间未发生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。

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

注：本基金本报告期及上年度可比期间未发生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。

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

注：本报告期及上年度可比期间，基金管理人未投资本基金。

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（%）
华泰柏瑞中证2000交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	56,036,400.00	1.9432	17,418,900.00	1.7355
华泰证券股份有限公司	7,966,148.00	0.2762	139,071,000.00	13.8562

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	66,367,750.19	172,317.89	26,804,358.36	47,393.43

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。

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
华泰联合证券	688709	成都华微	网下申购	7,139	112,010.91
华泰联合证券	301392	汇成真空	网下申购	2,189	26,705.80
华泰联合证券	688726	拉普拉斯	网下申购	9,785	172,020.30
华泰联合证券	603341	龙旗科技	网下申购	2,978	77,428.00
华泰联合证券	301606	绿联科技	网下申购	3,959	83,970.39
华泰联合证券	603312	西典新能	网下申购	1,296	37,609.92
华泰联合证券	688605	先锋精科	网下申购	7,433	83,918.57
华泰联合证券	301622	英思特	网下申购	3,056	68,332.16
华泰联合证券	301587	中瑞股份	网下申购	3,056	66,406.88
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
华泰联合证券	301413	安培龙	网下申购	1,633	54,297.25
华泰联合证券	301566	达利凯普	网下申购	5,755	51,219.50
华泰联合证券	688720	艾森股份	网下申购	1,644	46,081.32

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

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

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001279	强邦新	2024 年 9 月 27	6 个月	新股锁定期内	9.68	27.91	265	2,565.20	7,396.15	-

	材	日								
001391	国货航	2024年12月23日	6个月	新股锁定期内	2.30	6.80	4,686	10,777.80	31,864.80	-
301522	上大股份	2024年10月9日	6个月	新股锁定期内	6.88	24.84	816	5,614.08	20,269.44	-
301551	无线传媒	2024年9月19日	6个月	新股锁定期内	9.40	43.23	652	6,128.80	28,185.96	-
301552	科力装备	2024年7月15日	6个月	新股锁定期内	30.00	56.87	143	4,290.00	8,132.41	-
301556	托普云农	2024年10月10日	6个月	新股锁定期内	14.50	59.05	267	3,871.50	15,766.35	-
301571	国科天成	2024年8月14日	6个月	新股锁定期内	11.14	40.83	350	3,899.00	14,290.50	-
301585	蓝宇股份	2024年12月10日	6个月	新股锁定期内	23.95	35.85	210	5,029.50	7,528.50	-
301586	佳力奇	2024年8月21日	6个月	新股锁定期内	18.09	53.14	215	3,889.35	11,425.10	-
301603	乔锋智能	2024年7月3日	6个月	新股锁定期内	26.50	41.98	233	6,174.50	9,781.34	-
301606	绿联科技	2024年7月17日	6个月	新股锁定期内	21.21	36.49	396	8,399.16	14,450.04	-
301607	富特科	2024年8月28	6个月	新股锁定期内	14.00	36.14	257	3,598.00	9,287.98	-

	技	日								
301608	博实结	2024年7月25日	6个月	新股锁定期内	44.50	65.38	184	8,188.00	12,029.92	-
301611	珂玛科技	2024年8月7日	6个月	新股锁定期内	8.00	56.10	804	6,432.00	45,104.40	-
301613	新铝时代	2024年10月18日	6个月	新股锁定期内	27.70	41.77	276	7,645.20	11,528.52	-
301617	博苑股份	2024年12月3日	6个月	新股锁定期内	27.76	39.79	253	7,023.28	10,066.87	-
301622	英思特	2024年11月26日	6个月	新股锁定期内	22.36	44.92	306	6,842.16	13,745.52	-
301626	苏州天脉	2024年10月17日	6个月	新股锁定期内	21.23	65.78	957	20,317.11	62,951.46	-
301631	壹连科技	2024年11月12日	6个月	新股锁定期内	72.99	101.96	153	11,167.47	15,599.88	-
603072	天和磁材	2024年12月24日	1个月内（含）	新股未上市	12.30	12.30	2,029	24,956.70	24,956.70	-
603072	天和磁材	2024年12月24日	6个月以上	新股锁定期内	12.30	12.30	226	2,779.80	2,779.80	-
603091	众鑫股份	2024年9月10日	6个月	新股锁定期内	26.50	44.43	94	2,491.00	4,176.42	-
603194	中力股	2024年12月17	6个月	新股锁定期内	20.32	28.13	291	5,913.12	8,185.83	-

	份	日								
603205	健尔康	2024 年 10 月 29 日	6 个月	新股锁定期内	14.65	27.35	128	1,875.20	3,500.80	-
603207	小方制药	2024 年 8 月 19 日	6 个月	新股锁定期内	12.47	26.65	185	2,306.95	4,930.25	-
603285	键邦股份	2024 年 6 月 28 日	6 个月	新股锁定期内	18.65	22.61	129	2,405.85	2,916.69	-
603310	巍华新材	2024 年 8 月 7 日	6 个月	新股锁定期内	17.39	17.95	254	4,417.06	4,559.30	-
603350	安乃达	2024 年 6 月 26 日	6 个月	新股锁定期内	20.56	36.17	106	2,179.36	3,834.02	-
603391	力聚热能	2024 年 7 月 24 日	6 个月	新股锁定期内	40.00	41.35	100	4,000.00	4,135.00	-
603395	红四方	2024 年 11 月 19 日	6 个月	新股锁定期内	7.98	35.77	154	1,228.92	5,508.58	-
688449	联芸科技	2024 年 11 月 20 日	6 个月	新股锁定期内	11.25	29.44	1,406	15,817.50	41,392.64	-
688605	先锋精科	2024 年 12 月 4 日	6 个月	新股锁定期内	11.29	53.68	744	8,399.76	39,937.92	-
688615	合合信息	2024 年 9 月 19 日	6 个月	新股锁定期内	55.18	165.78	289	15,947.02	47,910.42	-
688708	佳驰科	2024 年 11 月 27	6 个月	新股锁定期内	27.08	48.95	780	21,122.40	38,181.00	-

	技	日								
688710	益诺思	2024 年 8 月 27 日	6 个月	新股锁定期内	19.06	33.58	332	6,327.92	11,148.56	-
688721	龙图光罩	2024 年 7 月 30 日	6 个月	新股锁定期内	18.50	56.85	279	5,161.50	15,861.15	-
688726	拉普拉斯	2024 年 10 月 22 日	6 个月	新股锁定期内	17.58	33.06	979	17,210.82	32,365.74	-
688750	金天钛业	2024 年 11 月 12 日	6 个月	新股锁定期内	7.16	15.44	1,685	12,064.60	26,016.40	-

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
123251	华医转债	2024 年 12 月 23 日	1 个月	配债未上市	100.00	100.00	7,090	709,027.97	709,027.97	-

注：1、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新股中需要限售的部分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。

2、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。

3、基金作为特定投资者，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。

4、基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后 6 个月内不得转让。

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（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002379	宏创控股	2024年12月23日	重大事项	8.97	2025年1月7日	9.87	551,400	4,446,437.29	4,946,058.00	-
000777	中核科技	2024年12月30日	重大事项	18.07	2025年1月14日	19.88	236,200	4,059,800.19	4,268,134.00	-
000421	南京公用	2024年12月27日	重大事项	6.48	2025年1月13日	7.13	480,400	3,022,173.44	3,112,992.00	-

注：本基金截至 2024 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

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

注：本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未参与转融通证券出借业务。

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

本基金为被动式指数基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金，主要投资于标的指数成份股和备选成份股。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，力争实现保持基金净值增长率与标的指数增长率间的高度正相关，并保持跟踪误差在合同约定的范围内。

本基金的基金管理人建立的风险管理体系由“组织、制度、流程和报告”等四个方面构成。组织是指公司的风险管理组织架构包括董事会下设的风险管理与审计委员会、公司管理层的风险控制委员会、风险管理部和合规法律部以及公司各业务部门，董事会对建立基金风险管理内部控制系统和维持其有效性承担最终责任；制度是指风险管理相关的规章制度，是对组织职能及其工作流程等的具体规定；流程是风险管理的工作流程，它详细规定了各部门之间风险管理工作的内容和程序；报告是对流程的必要反映和记录，既是风险管理工作的重要环节，也是对风险管理工作的总结和披露。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人开立的托管账户或其他商业银行开立的存款账户，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2024 年 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.02%(2023 年 12 月 31 日：0.03%)。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，

或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

于 2024 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2024 年 12 月 31 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合法律法规的相关要求。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

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

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	66,367,750.19	-	-	-	-	-	66,367,750.19
结算备付金	18,481,504.35	-	-	-	-	-	18,481,504.35
存出保证金	3,291,305.71	-	-	-	-	-	3,291,305.71
交易性金融资产	-	-	-	-	709,027.97	2,878,127,297.71	2,878,836,325.68
应收清算款	-	-	-	-	-	1,243,135.75	1,243,135.75
资产总计	88,140,560.25	-	-	-	709,027.97	2,879,370,433.46	2,968,220,021.68
负债							
交易性金融负债	-	-	-	-	-	1,289,810.73	1,289,810.73
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,261,254.82	1,261,254.82
应付托管费	-	-	-	-	-	252,250.96	252,250.96
应付清算款	-	-	-	-	-	164,987.34	164,987.34
应交税费	-	-	-	-	-	0.91	0.91
其他负债	-	-	-	-	-	36,198,875.07	36,198,875.07
负债总计	-	-	-	-	-	39,167,179.83	39,167,179.83
利率敏感度缺口	88,140,560.25	-	-	-	709,027.97	2,840,203,253.63	2,929,052,841.85
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	26,804,358.36	-	-	-	-	-	26,804,358.36
结算备付金	1,366,651.69	-	-	-	-	-	1,366,651.69
存出保证金	278,844.84	-	-	-	-	-	278,844.84
交易性金融资产	-	-	-	-	272,011.33	998,448,084.77	998,720,096.10

应收清算款	-	-	-	-	-	11,353,723.52	11,353,723.52
资产总计	28,449,854.89	-	-	-	272,011.33	1,009,801,808.29	1,038,523,674.51
负债							
交易性金融负债	-	-	-	-	-	302,267.09	302,267.09
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	210,063.00	210,063.00
应付托管费	-	-	-	-	-	42,012.59	42,012.59
应交税费	-	-	-	-	-	0.60	0.60
其他负债	-	-	-	-	-	24,701,877.21	24,701,877.21
负债总计	-	-	-	-	-	25,256,220.49	25,256,220.49
利率敏感度缺口	28,449,854.89	-	-	-	272,011.33	984,545,587.80	1,013,267,454.02

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2024 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.02%(2023 年 12 月 31 日：0.03%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2023 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023年12月31日

	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产－股票投资	2,878,127,297.71	98.26	998,448,084.77	98.54
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	-1,289,810.73	-0.04	-302,267.09	-0.03
合计	2,876,837,486.98	98.22	998,145,817.68	98.51

注：其他包含可退替代款。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 12 月 31 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	137,732,544.66	49,285,648.58
	业绩比较基准下降 5%	-137,732,544.66	-49,285,648.58

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	2,865,128,411.35	997,504,536.45
第二层次	13,063,948.47	998,341.33
第三层次	643,965.86	217,218.32
合计	2,878,836,325.68	998,720,096.10

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	217,218.32	217,218.32
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	474,303.54	474,303.54
转出第三层次	-	593,737.43	593,737.43
当期利得或损失总额	-	546,181.43	546,181.43
其中：计入损益的利得或损失	-	546,181.43	546,181.43
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	643,965.86	643,965.86
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—	-	383,244.77	383,244.77

—公允价值变动损益			
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	-	139,227.20	139,227.20
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	77,991.12	77,991.12
其中：计入损益的利得或损失	-	77,991.12	77,991.12
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	217,218.32	217,218.32
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	-	77,991.12	77,991.12

注：于 2024 年 12 月 31 日，本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。于 2024 年度，本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资。

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

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
证券交易所上市但尚在限售期内的股票	643,965.86	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.2665~5.7444	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
证券交易所上市但尚在限售	217,218.32	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.5141~2.1988	负相关

期内的股票					

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2024 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2023 年 12 月 31 日：同)。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)基金申购款

于 2024 年度,本基金申购基金份额的对价总额为 19,528,870,308.91 元(2023 年 9 月 6 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日止期间：905,320,082.72 元)，其中包括以股票支付的申购款 6,233,074,947.00 元和以现金支付的申购款 13,295,795,361.91 元(2023 年 9 月 6 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日止期间:其中包括以股票支付的申购款 318,083,157.95 元和以现金支付的申购款 587,236,924.77 元)。

(2)除基金申购款外，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	2,878,127,297.71	96.96
	其中：股票	2,878,127,297.71	96.96
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	709,027.97	0.02
	其中：债券	709,027.97	0.02
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	84,849,254.54	2.86
8	其他各项资产	4,534,441.46	0.15
9	合计	2,968,220,021.68	100.00

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	18,925,256.00	0.65
B	采矿业	20,011,798.20	0.68
C	制造业	1,926,878,167.26	65.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	59,138,943.23	2.02
E	建筑业	41,223,630.58	1.41
F	批发和零售业	138,332,372.43	4.72
G	交通运输、仓储和邮政业	52,385,347.17	1.79
H	住宿和餐饮业	5,383,132.00	0.18
I	信息传输、软件和信息技术服务业	310,114,241.53	10.59
J	金融业	2,651,292.00	0.09
K	房地产业	63,130,697.00	2.16
L	租赁和商务服务业	59,112,979.00	2.02
M	科学研究和技术服务业	66,344,932.27	2.27
N	水利、环境和公共设施管理业	66,925,151.03	2.28
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	21,484,623.00	0.73
Q	卫生和社会工作	1,247,792.00	0.04
R	文化、体育和娱乐业	18,834,425.00	0.64
S	综合	4,942,476.00	0.17
	合计	2,877,067,255.70	98.23

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	495,433.63	0.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-

G	交通运输、仓储和邮政业	420,204.45	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	133,255.37	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	11,148.56	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,060,042.01	0.04

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688205	德科立	225,992	20,565,272.00	0.70
2	300355	蒙草生态	2,515,600	12,905,028.00	0.44
3	603067	振华股份	904,100	11,418,783.00	0.39
4	300622	博士眼镜	228,700	11,389,260.00	0.39
5	003000	劲仔食品	803,700	11,010,690.00	0.38
6	000589	贵州轮胎	2,165,200	10,890,956.00	0.37
7	002970	锐明技术	228,569	10,886,741.47	0.37
8	300815	玉禾田	684,200	10,666,678.00	0.36
9	600897	厦门空港	676,579	10,304,298.17	0.35
10	688049	炬芯科技	227,408	10,203,796.96	0.35
11	600425	青松建化	2,590,966	10,156,586.72	0.35
12	600611	大众交通	1,470,700	10,147,830.00	0.35
13	688698	伟创电气	228,678	10,061,832.00	0.34
14	603859	能科科技	335,820	10,041,018.00	0.34

15	301101	明月镜片	230,250	9,873,120.00	0.34
16	300592	华凯易佰	686,294	9,800,278.32	0.33
17	688418	震有科技	335,920	9,795,427.20	0.33
18	300377	赢时胜	345,000	9,508,200.00	0.32
19	603711	香飘飘	579,683	9,506,801.20	0.32
20	300444	双杰电气	1,361,700	9,436,581.00	0.32
21	300842	帝科股份	228,703	9,381,397.06	0.32
22	300969	恒帅股份	114,400	9,343,048.00	0.32
23	600576	祥源文旅	1,353,500	9,325,615.00	0.32
24	300349	金卡智能	678,400	9,273,728.00	0.32
25	000521	长虹美菱	1,131,600	9,233,856.00	0.32
26	002301	齐心集团	1,253,700	8,913,807.00	0.30
27	600694	大商股份	335,400	8,844,498.00	0.30
28	603009	北特科技	225,400	8,808,632.00	0.30
29	002752	昇兴股份	1,368,600	8,690,610.00	0.30
30	688621	阳光诺和	225,767	8,511,415.90	0.29
31	605128	上海沿浦	224,992	8,313,454.40	0.28
32	002285	世联行	3,196,800	8,279,712.00	0.28
33	601588	北辰实业	4,265,500	7,933,830.00	0.27
34	002031	巨轮智能	1,588,400	7,894,348.00	0.27
35	688259	创耀科技	224,336	7,876,436.96	0.27
36	688533	上声电子	225,606	7,855,600.92	0.27
37	688510	航亚科技	450,715	7,851,455.30	0.27
38	002478	常宝股份	1,483,400	7,847,186.00	0.27
39	603366	日出东方	669,795	7,843,299.45	0.27
40	688258	卓易信息	224,520	7,768,392.00	0.27
41	600180	瑞茂通	1,805,037	7,761,659.10	0.26
42	688662	富信科技	225,304	7,732,433.28	0.26
43	002947	恒铭达	228,720	7,623,237.60	0.26
44	605167	利柏特	790,300	7,618,492.00	0.26
45	002452	长高电新	1,023,400	7,593,628.00	0.26
46	000888	峨眉山 A	572,161	7,569,690.03	0.26
47	002919	名臣健康	458,312	7,539,232.40	0.26
48	003038	鑫铂股份	454,218	7,530,934.44	0.26
49	301195	北路智控	228,750	7,345,162.50	0.25
50	300729	乐歌股份	458,330	7,278,280.40	0.25
51	300192	科德教育	457,500	7,274,250.00	0.25
52	300545	联得装备	228,600	7,162,038.00	0.24
53	002870	香山股份	228,800	7,161,440.00	0.24
54	301061	匠心家居	114,850	7,097,730.00	0.24
55	300718	长盛轴承	228,700	7,018,803.00	0.24
56	300105	龙源技术	914,200	6,975,346.00	0.24
57	300460	惠伦晶体	571,600	6,939,224.00	0.24

58	002641	公元股份	1,576,900	6,938,360.00	0.24
59	688302	海创药业	225,755	6,932,936.05	0.24
60	300840	酷特智能	342,900	6,864,858.00	0.23
61	002983	芯瑞达	344,947	6,774,759.08	0.23
62	605286	同力日升	224,400	6,767,904.00	0.23
63	002630	华西能源	1,937,600	6,742,848.00	0.23
64	300147	香雪制药	689,100	6,732,507.00	0.23
65	300290	荣科科技	325,800	6,630,030.00	0.23
66	002083	孚日股份	1,347,200	6,587,808.00	0.22
67	300493	润欣科技	228,600	6,430,518.00	0.22
68	300421	力星股份	571,900	6,399,561.00	0.22
69	300532	今天国际	557,715	6,369,105.30	0.22
70	002971	和远气体	339,280	6,361,500.00	0.22
71	688365	光云科技	555,688	6,284,831.28	0.21
72	300561	汇金科技	114,300	6,281,928.00	0.21
73	301051	信濠光电	230,010	6,224,070.60	0.21
74	300184	力源信息	666,200	6,215,646.00	0.21
75	603516	淳中科技	111,200	6,147,136.00	0.21
76	002922	伊戈尔	343,100	6,114,042.00	0.21
77	688039	当虹科技	225,233	6,097,057.31	0.21
78	605300	佳禾食品	448,340	6,025,689.60	0.21
79	605377	华旺科技	451,260	6,024,321.00	0.21
80	002170	芭田股份	685,900	5,987,907.00	0.20
81	300378	鼎捷数智	228,600	5,913,882.00	0.20
82	300061	旗天科技	457,300	5,899,170.00	0.20
83	301011	华立科技	228,651	5,874,044.19	0.20
84	688165	埃夫特	220,400	5,818,560.00	0.20
85	300938	信测标准	225,780	5,798,030.40	0.20
86	300654	世纪天鸿	571,400	5,765,426.00	0.20
87	300360	炬华科技	343,100	5,753,787.00	0.20
88	002912	中新赛克	224,259	5,738,787.81	0.20
89	600251	冠农股份	786,600	5,734,314.00	0.20
90	688269	凯立新材	228,549	5,709,154.02	0.19
91	300473	德尔股份	228,600	5,694,426.00	0.19
92	002073	软控股份	685,900	5,665,534.00	0.19
93	002956	西麦食品	339,200	5,654,464.00	0.19
94	002878	元隆雅图	339,200	5,590,016.00	0.19
95	300098	高新兴	1,016,800	5,572,064.00	0.19
96	603887	城地香江	349,100	5,557,672.00	0.19
97	000655	金岭矿业	901,800	5,546,070.00	0.19
98	600255	鑫科材料	1,618,300	5,534,586.00	0.19
99	301030	仕净科技	228,680	5,520,335.20	0.19
100	603518	锦泓集团	562,100	5,508,580.00	0.19

101	688358	祥生医疗	224,819	5,490,079.98	0.19
102	300559	佳发教育	457,300	5,469,308.00	0.19
103	300389	艾比森	457,600	5,450,016.00	0.19
104	301093	华兰股份	228,700	5,443,060.00	0.19
105	300320	海达股份	566,700	5,440,320.00	0.19
106	300131	英唐智控	667,800	5,415,858.00	0.18
107	002443	金洲管道	915,000	5,380,200.00	0.18
108	002611	东方精工	550,800	5,370,300.00	0.18
109	002431	棕榈股份	2,560,000	5,350,400.00	0.18
110	300548	博创科技	114,300	5,304,663.00	0.18
111	300092	科新机电	457,300	5,277,242.00	0.18
112	300430	诚益通	344,100	5,264,730.00	0.18
113	300010	豆神教育	847,100	5,260,491.00	0.18
114	688339	亿华通	217,726	5,247,196.60	0.18
115	688233	神工股份	223,362	5,237,838.90	0.18
116	300293	蓝英装备	229,700	5,218,784.00	0.18
117	301162	国能日新	114,314	5,201,287.00	0.18
118	600794	保税科技	1,432,400	5,199,612.00	0.18
119	300276	三丰智能	574,900	5,168,351.00	0.18
120	603727	博迈科	448,890	5,153,257.20	0.18
121	300314	戴维医疗	457,500	5,151,450.00	0.18
122	688186	广大特材	334,022	5,127,237.70	0.18
123	300925	法本信息	230,000	5,124,400.00	0.17
124	000417	合百集团	798,700	5,095,706.00	0.17
125	002467	二六三	919,800	5,077,296.00	0.17
126	600054	黄山旅游	449,300	5,077,090.00	0.17
127	603569	长久物流	674,500	5,018,280.00	0.17
128	300139	晓程科技	342,900	5,002,911.00	0.17
129	003029	吉大正元	228,700	4,990,234.00	0.17
130	688663	新风光	228,549	4,961,798.79	0.17
131	002045	国光电器	228,700	4,960,503.00	0.17
132	002379	宏创控股	551,400	4,946,058.00	0.17
133	300331	苏大维格	228,600	4,944,618.00	0.17
134	603825	华扬联众	327,500	4,941,975.00	0.17
135	300731	科创新源	228,600	4,940,046.00	0.17
136	688085	三友医疗	228,549	4,842,953.31	0.17
137	688121	卓然股份	449,665	4,842,892.05	0.17
138	600609	金杯汽车	672,400	4,841,280.00	0.17
139	600410	华胜天成	668,600	4,840,664.00	0.17
140	688687	凯因科技	224,254	4,839,401.32	0.17
141	000526	学大教育	115,000	4,836,900.00	0.17
142	301181	标榜股份	228,600	4,798,314.00	0.16
143	000670	盈方微	574,400	4,779,008.00	0.16

144	688569	铁科轨道	224,489	4,765,901.47	0.16
145	300102	乾照光电	459,900	4,764,564.00	0.16
146	000554	泰山石油	800,200	4,753,188.00	0.16
147	002017	东信和平	457,300	4,742,201.00	0.16
148	600686	金龙汽车	336,700	4,734,002.00	0.16
149	002339	积成电子	685,900	4,725,851.00	0.16
150	300990	同飞股份	114,300	4,720,590.00	0.16
151	603722	阿科力	112,300	4,716,600.00	0.16
152	002449	国星光电	345,000	4,698,900.00	0.16
153	300278	华昌达	800,600	4,683,510.00	0.16
154	688588	凌志软件	337,233	4,653,815.40	0.16
155	600979	广安爱众	1,004,300	4,639,866.00	0.16
156	603855	华荣股份	228,600	4,638,294.00	0.16
157	300499	高澜股份	230,000	4,636,800.00	0.16
158	603050	科林电气	224,594	4,635,620.16	0.16
159	688179	阿拉丁	335,222	4,626,063.60	0.16
160	300709	精研科技	115,000	4,619,550.00	0.16
161	688519	南亚新材	217,070	4,614,908.20	0.16
162	000531	穗恒运 A	800,200	4,609,152.00	0.16
163	300795	米奥会展	228,700	4,576,287.00	0.16
164	603367	辰欣药业	331,700	4,557,558.00	0.16
165	002115	三维通信	683,600	4,545,940.00	0.16
166	688135	利扬芯片	226,400	4,543,848.00	0.16
167	300566	激智科技	228,600	4,507,992.00	0.15
168	002533	金杯电工	457,300	4,499,832.00	0.15
169	300053	航宇微	342,900	4,488,561.00	0.15
170	603010	万盛股份	435,200	4,469,504.00	0.15
171	600525	长园集团	914,260	4,461,588.80	0.15
172	688277	天智航	446,532	4,460,854.68	0.15
173	603960	克来机电	224,000	4,457,600.00	0.15
174	688382	益方生物	333,978	4,441,907.40	0.15
175	688292	浩瀚深度	223,846	4,432,150.80	0.15
176	000949	新乡化纤	1,104,900	4,430,649.00	0.15
177	300048	合康新能	877,500	4,422,600.00	0.15
178	301018	申菱环境	114,300	4,405,122.00	0.15
179	300790	宇瞳光学	230,000	4,390,700.00	0.15
180	002896	中大力德	114,300	4,390,263.00	0.15
181	600368	五洲交通	913,000	4,355,010.00	0.15
182	688015	交控科技	219,304	4,348,798.32	0.15
183	002803	吉宏股份	342,900	4,347,972.00	0.15
184	601199	江南水务	786,191	4,347,636.23	0.15
185	002338	奥普光电	115,000	4,337,800.00	0.15
186	002829	星网宇达	228,582	4,333,914.72	0.15

187	002394	联发股份	571,600	4,298,432.00	0.15
188	300708	聚灿光电	342,900	4,282,821.00	0.15
189	000777	中核科技	236,200	4,268,134.00	0.15
190	603322	超讯通信	112,300	4,267,400.00	0.15
191	300384	三联虹普	228,600	4,256,532.00	0.15
192	300518	新迅达	344,200	4,254,312.00	0.15
193	300189	神农种业	1,082,200	4,253,046.00	0.15
194	300041	回天新材	457,300	4,207,160.00	0.14
195	300465	高伟达	228,700	4,198,932.00	0.14
196	002035	华帝股份	571,600	4,195,544.00	0.14
197	001339	智微智能	114,400	4,185,896.00	0.14
198	000592	平潭发展	1,455,800	4,178,146.00	0.14
199	688133	泰坦科技	228,549	4,168,733.76	0.14
200	301391	卡莱特	112,120	4,149,561.20	0.14
201	300046	台基股份	114,300	4,145,661.00	0.14
202	600035	楚天高速	898,600	4,133,560.00	0.14
203	003028	振邦智能	115,000	4,122,750.00	0.14
204	301270	汉仪股份	115,020	4,110,814.80	0.14
205	300081	恒信东方	572,400	4,109,832.00	0.14
206	300452	山河药辅	339,215	4,107,893.65	0.14
207	000551	创元科技	342,900	4,101,084.00	0.14
208	600351	亚宝药业	672,700	4,096,743.00	0.14
209	300719	安达维尔	228,700	4,096,017.00	0.14
210	600200	江苏吴中	438,428	4,086,148.96	0.14
211	603357	设计总院	450,901	4,085,163.06	0.14
212	300895	铜牛信息	115,055	4,062,592.05	0.14
213	002102	能特科技	1,545,800	4,049,996.00	0.14
214	300047	天源迪科	342,900	4,029,075.00	0.14
215	300005	探路者	571,600	4,006,916.00	0.14
216	002884	凌霄泵业	219,300	4,006,611.00	0.14
217	000912	泸天化	914,600	4,005,948.00	0.14
218	300341	麦克奥迪	228,700	4,004,537.00	0.14
219	301278	快可电子	114,350	3,996,532.50	0.14
220	688182	灿勤科技	223,315	3,992,872.20	0.14
221	002997	瑞鹄模具	115,000	3,984,750.00	0.14
222	002628	成都路桥	879,400	3,983,682.00	0.14
223	002184	海得控制	340,800	3,980,544.00	0.14
224	002510	天汽模	681,200	3,978,208.00	0.14
225	002225	濮耐股份	800,200	3,976,994.00	0.14
226	300354	东华测试	114,300	3,976,497.00	0.14
227	600619	海立股份	324,800	3,962,560.00	0.14
228	300353	东土科技	345,000	3,960,600.00	0.14
229	688711	宏微科技	228,549	3,949,326.72	0.13

230	605098	行动教育	111,500	3,929,260.00	0.13
231	000815	美利云	342,900	3,926,205.00	0.13
232	002122	汇洲智能	1,149,500	3,908,300.00	0.13
233	301185	鸥玛软件	228,800	3,907,904.00	0.13
234	600605	汇通能源	112,600	3,906,094.00	0.13
235	600101	明星电力	443,780	3,905,264.00	0.13
236	688148	芳源股份	784,215	3,881,864.25	0.13
237	300173	福能东方	686,500	3,878,725.00	0.13
238	300825	阿尔特	343,100	3,877,030.00	0.13
239	000544	中原环保	442,700	3,864,771.00	0.13
240	301266	宇邦新材	114,270	3,828,045.00	0.13
241	000948	南天信息	228,730	3,826,652.90	0.13
242	605016	百龙创园	224,720	3,797,768.00	0.13
243	603199	九华旅游	112,300	3,790,125.00	0.13
244	002685	华东重机	561,800	3,780,914.00	0.13
245	002609	捷顺科技	457,300	3,777,298.00	0.13
246	000957	中通客车	343,300	3,776,300.00	0.13
247	300546	雄帝科技	224,200	3,771,044.00	0.13
248	002575	群兴玩具	457,101	3,766,512.24	0.13
249	002014	永新股份	342,900	3,758,184.00	0.13
250	603078	江化微	224,200	3,753,108.00	0.13
251	300008	天海防务	800,200	3,744,936.00	0.13
252	002785	万里石	114,300	3,743,325.00	0.13
253	300396	迪瑞医疗	228,700	3,736,958.00	0.13
254	300436	广生堂	114,300	3,734,181.00	0.13
255	603660	苏州科达	556,400	3,733,444.00	0.13
256	300468	四方精创	228,700	3,727,810.00	0.13
257	601579	会稽山	336,800	3,725,008.00	0.13
258	688697	纽威数控	223,350	3,716,544.00	0.13
259	300252	金信诺	342,900	3,689,604.00	0.13
260	300688	创业黑马	115,000	3,681,150.00	0.13
261	603227	雪峰科技	423,600	3,681,084.00	0.13
262	600108	亚盛集团	1,244,200	3,645,506.00	0.12
263	300745	欣锐科技	228,800	3,642,496.00	0.12
264	000819	岳阳兴长	217,500	3,638,775.00	0.12
265	002401	中远海科	228,600	3,630,168.00	0.12
266	603938	三孚股份	335,600	3,627,836.00	0.12
267	300809	华辰装备	114,300	3,621,024.00	0.12
268	688518	联赢激光	228,549	3,620,216.16	0.12
269	300302	同有科技	228,700	3,604,312.00	0.12
270	688317	之江生物	221,403	3,597,798.75	0.12
271	002667	威领股份	339,200	3,595,520.00	0.12
272	002279	久其软件	571,600	3,583,932.00	0.12

273	300239	东宝生物	572,200	3,581,972.00	0.12
274	002732	燕塘乳业	227,900	3,580,309.00	0.12
275	002483	润邦股份	686,500	3,576,665.00	0.12
276	300491	通合科技	224,200	3,569,264.00	0.12
277	300194	福安药业	800,200	3,568,892.00	0.12
278	301076	新瀚新材	114,300	3,534,156.00	0.12
279	300881	盛德鑫泰	114,920	3,532,640.80	0.12
280	000900	现代投资	800,200	3,528,882.00	0.12
281	300213	佳讯飞鸿	457,400	3,517,406.00	0.12
282	002935	天奥电子	218,080	3,511,088.00	0.12
283	001215	千味央厨	114,300	3,506,724.00	0.12
284	002328	新朋股份	571,600	3,503,908.00	0.12
285	688334	西高院	213,595	3,488,006.35	0.12
286	688371	菲沃泰	224,421	3,483,013.92	0.12
287	300217	东方电热	771,300	3,478,563.00	0.12
288	603811	诚意药业	449,300	3,468,596.00	0.12
289	688306	均普智能	447,400	3,467,350.00	0.12
290	603111	康尼机电	571,400	3,445,542.00	0.12
291	000978	桂林旅游	569,800	3,441,592.00	0.12
292	002540	亚太科技	557,400	3,433,584.00	0.12
293	002526	山东矿机	967,600	3,415,628.00	0.12
294	000973	佛塑科技	574,900	3,414,906.00	0.12
295	600105	永鼎股份	685,700	3,401,072.00	0.12
296	600212	绿能慧充	448,900	3,393,684.00	0.12
297	600488	津药药业	799,300	3,389,032.00	0.12
298	000404	长虹华意	457,500	3,385,500.00	0.12
299	002491	通鼎互联	658,600	3,385,204.00	0.12
300	300401	花园生物	230,000	3,371,800.00	0.12
301	002860	星帅尔	343,100	3,365,811.00	0.11
302	300174	元力股份	228,600	3,364,992.00	0.11
303	300766	每日互动	230,000	3,360,300.00	0.11
304	000078	海王生物	1,314,900	3,352,995.00	0.11
305	002523	天桥起重	1,024,000	3,348,480.00	0.11
306	600533	栖霞建设	1,424,400	3,333,096.00	0.11
307	002334	英威腾	442,500	3,327,600.00	0.11
308	300248	新开普	342,900	3,322,701.00	0.11
309	688299	长阳科技	226,000	3,322,200.00	0.11
310	002345	潮宏基	571,700	3,321,577.00	0.11
311	002057	中钢天源	457,300	3,301,706.00	0.11
312	002669	康达新材	342,800	3,301,164.00	0.11
313	002009	天奇股份	216,100	3,289,042.00	0.11
314	003015	日久光电	228,700	3,272,697.00	0.11
315	002282	博深股份	439,100	3,253,731.00	0.11

316	605305	中际联合	114,300	3,238,119.00	0.11
317	300228	富瑞特装	457,900	3,228,195.00	0.11
318	000713	丰乐种业	457,400	3,224,670.00	0.11
319	002175	东方智造	770,100	3,219,018.00	0.11
320	002210	飞马国际	1,209,900	3,218,334.00	0.11
321	300110	华仁药业	913,600	3,215,872.00	0.11
322	000151	中成股份	227,900	3,215,669.00	0.11
323	300120	经纬辉开	342,900	3,188,970.00	0.11
324	600630	龙头股份	336,000	3,185,280.00	0.11
325	688207	格灵深瞳	223,326	3,180,162.24	0.11
326	002255	海陆重工	571,600	3,178,096.00	0.11
327	600769	祥龙电业	330,300	3,174,183.00	0.11
328	300547	川环科技	114,900	3,164,346.00	0.11
329	000852	石化机械	458,060	3,160,614.00	0.11
330	300100	双林股份	114,300	3,159,252.00	0.11
331	600789	鲁抗医药	329,100	3,142,905.00	0.11
332	002367	康力电梯	457,400	3,142,338.00	0.11
333	603035	常熟汽饰	217,700	3,132,703.00	0.11
334	300063	天龙集团	342,900	3,127,248.00	0.11
335	300862	蓝盾光电	115,000	3,124,550.00	0.11
336	000036	华联控股	764,400	3,118,752.00	0.11
337	000610	西安旅游	227,900	3,113,114.00	0.11
338	000421	南京公用	480,400	3,112,992.00	0.11
339	600113	浙江东日	223,500	3,111,120.00	0.11
340	002819	东方中科	114,300	3,106,674.00	0.11
341	002471	中超控股	1,136,200	3,101,826.00	0.11
342	002559	亚威股份	345,000	3,094,650.00	0.11
343	002104	恒宝股份	457,400	3,092,024.00	0.11
344	300410	正业科技	571,600	3,075,208.00	0.10
345	300507	苏奥传感	458,600	3,072,620.00	0.10
346	000716	黑芝麻	444,300	3,056,784.00	0.10
347	688176	亚虹医药	449,762	3,053,883.98	0.10
348	002632	道明光学	342,900	3,051,810.00	0.10
348	300211	亿通科技	342,900	3,051,810.00	0.10
349	300193	佳士科技	342,900	3,048,381.00	0.10
350	600868	梅雁吉祥	1,226,300	3,041,224.00	0.10
351	002869	金溢科技	114,300	3,040,380.00	0.10
352	300411	金盾股份	230,000	3,033,700.00	0.10
353	002033	丽江股份	341,900	3,032,653.00	0.10
354	002527	新时达	345,000	3,029,100.00	0.10
355	300791	仙乐健康	115,020	3,028,476.60	0.10
356	301257	普蕊斯	112,070	3,021,407.20	0.10
357	000532	华金资本	228,700	3,018,840.00	0.10

358	300322	硕贝德	230,000	3,015,300.00	0.10
359	300246	宝莱特	457,100	3,012,289.00	0.10
360	300700	岱勒新材	342,940	3,011,013.20	0.10
361	300161	华中数控	114,300	3,010,662.00	0.10
362	002733	雄韬股份	217,500	3,010,200.00	0.10
363	600824	益民集团	671,400	3,001,158.00	0.10
364	600106	重庆路桥	536,600	2,999,594.00	0.10
365	000925	众合科技	345,000	2,991,150.00	0.10
366	002224	三力士	689,900	2,980,368.00	0.10
367	300806	斯迪克	230,000	2,978,500.00	0.10
368	002765	蓝黛科技	345,000	2,967,000.00	0.10
369	002406	远东传动	459,900	2,966,355.00	0.10
370	002529	海源复材	333,200	2,955,484.00	0.10
371	002553	南方精工	229,700	2,953,942.00	0.10
372	002480	新筑股份	572,000	2,951,520.00	0.10
373	002876	三利谱	115,000	2,950,900.00	0.10
374	600130	波导股份	625,000	2,950,000.00	0.10
375	600684	珠江股份	890,500	2,938,650.00	0.10
376	002640	跨境通	763,500	2,931,840.00	0.10
377	300607	拓斯达	115,000	2,931,350.00	0.10
378	002655	共达电声	229,300	2,918,989.00	0.10
379	002570	贝因美	689,900	2,904,479.00	0.10
380	600846	同济科技	336,800	2,903,216.00	0.10
381	600512	腾达建设	1,223,600	2,899,932.00	0.10
382	000920	沃顿科技	324,900	2,898,108.00	0.10
383	002827	高争民爆	114,300	2,892,933.00	0.10
384	300056	中创环保	217,700	2,891,056.00	0.10
385	001238	浙江正特	106,800	2,886,804.00	0.10
386	600629	华建集团	312,700	2,883,094.00	0.10
387	600843	上工申贝	228,600	2,875,788.00	0.10
388	301012	扬电科技	115,000	2,869,250.00	0.10
389	300853	申昊科技	114,300	2,866,644.00	0.10
390	600300	维维股份	889,000	2,862,580.00	0.10
391	688560	明冠新材	223,756	2,861,839.24	0.10
392	600187	国中水务	851,600	2,861,376.00	0.10
393	603380	易德龙	114,300	2,856,357.00	0.10
394	002552	宝鼎科技	217,600	2,854,912.00	0.10
395	300681	英搏尔	114,300	2,842,641.00	0.10
396	000612	焦作万方	442,500	2,840,850.00	0.10
397	002165	红 宝 丽	662,700	2,836,356.00	0.10
398	603667	五洲新春	114,300	2,828,925.00	0.10
399	000936	华西股份	346,200	2,828,454.00	0.10
400	300307	慈星股份	342,900	2,825,496.00	0.10

401	000862	银星能源	571,600	2,823,704.00	0.10
402	300867	圣元环保	218,100	2,820,033.00	0.10
403	002846	英联股份	342,921	2,818,810.62	0.10
404	000859	国风新材	557,000	2,818,420.00	0.10
405	600571	信雅达	224,200	2,815,952.00	0.10
406	300647	超频三	457,500	2,813,625.00	0.10
407	002169	智光电气	457,300	2,812,395.00	0.10
408	300540	蜀道装备	114,300	2,802,636.00	0.10
409	603628	清源股份	224,400	2,800,512.00	0.10
410	000793	华闻集团	1,044,200	2,798,456.00	0.10
411	002590	万安科技	228,700	2,794,714.00	0.10
412	300721	怡达股份	229,400	2,794,092.00	0.10
413	603867	新化股份	114,300	2,786,634.00	0.10
414	688222	成都先导	225,800	2,781,856.00	0.09
415	002107	沃华医药	581,900	2,781,482.00	0.09
416	600495	晋西车轴	730,600	2,776,280.00	0.09
417	002514	宝馨科技	345,000	2,763,450.00	0.09
418	600496	精工钢构	914,200	2,760,884.00	0.09
419	601388	怡球资源	1,121,200	2,758,152.00	0.09
420	300429	强力新材	230,000	2,757,700.00	0.09
421	301302	华如科技	114,600	2,756,130.00	0.09
422	603135	中重科技	310,700	2,752,802.00	0.09
423	300619	金银河	114,320	2,749,396.00	0.09
424	300099	尤洛卡	457,500	2,745,000.00	0.09
425	300304	云意电气	342,900	2,743,200.00	0.09
426	300565	科信技术	228,600	2,740,914.00	0.09
427	605166	聚合顺	228,600	2,736,342.00	0.09
428	300909	汇创达	114,300	2,726,055.00	0.09
429	002676	顺威股份	457,300	2,725,508.00	0.09
430	002512	达华智能	574,900	2,725,026.00	0.09
431	000931	中 关 村	572,200	2,723,672.00	0.09
432	000751	锌业股份	967,600	2,718,956.00	0.09
433	002479	富春环保	573,600	2,718,864.00	0.09
434	002519	银河电子	457,500	2,717,550.00	0.09
435	600279	重庆港	562,600	2,717,358.00	0.09
436	002579	中京电子	342,900	2,708,910.00	0.09
437	000816	智慧农业	894,800	2,702,296.00	0.09
438	002522	浙江众成	689,900	2,697,509.00	0.09
439	603982	泉峰汽车	338,200	2,692,072.00	0.09
440	300469	信息发展	114,300	2,686,050.00	0.09
441	603918	金桥信息	210,800	2,681,376.00	0.09
442	000886	海南高速	345,000	2,680,650.00	0.09
443	603508	思维列控	112,578	2,677,104.84	0.09

444	002093	国脉科技	342,900	2,674,620.00	0.09
445	603018	华设集团	325,600	2,673,176.00	0.09
446	001212	中旗新材	114,300	2,672,334.00	0.09
446	002902	铭普光磁	114,300	2,672,334.00	0.09
447	301226	祥明智能	114,800	2,665,656.00	0.09
448	000863	三湘印象	685,900	2,661,292.00	0.09
449	600830	香溢融通	226,800	2,651,292.00	0.09
450	002536	飞龙股份	228,700	2,648,346.00	0.09
451	002375	亚厦股份	685,900	2,647,574.00	0.09
452	300042	朗科科技	114,300	2,640,330.00	0.09
453	603590	康辰药业	112,100	2,636,592.00	0.09
454	000812	陕西金叶	572,200	2,632,120.00	0.09
455	605133	嵘泰股份	111,700	2,628,301.00	0.09
456	002858	力盛体育	228,600	2,615,184.00	0.09
456	300520	科大国创	114,300	2,615,184.00	0.09
457	002703	浙江世宝	230,000	2,615,100.00	0.09
458	002377	国创高新	789,200	2,612,252.00	0.09
459	000523	红棉股份	853,300	2,602,565.00	0.09
460	000922	佳电股份	230,000	2,596,700.00	0.09
461	002362	汉王科技	114,300	2,590,038.00	0.09
462	300625	三雄极光	222,000	2,588,520.00	0.09
463	002042	华孚时尚	574,900	2,587,050.00	0.09
464	300494	盛天网络	230,000	2,585,200.00	0.09
465	600784	鲁银投资	438,900	2,585,121.00	0.09
466	300684	中石科技	115,000	2,579,450.00	0.09
467	300975	商络电子	228,700	2,572,875.00	0.09
468	600310	广西能源	562,900	2,566,824.00	0.09
469	300581	晨曦航空	228,800	2,564,848.00	0.09
470	002455	百川股份	342,900	2,561,463.00	0.09
471	002112	三变科技	228,600	2,560,320.00	0.09
472	000659	珠海中富	907,700	2,559,714.00	0.09
473	603187	海容冷链	228,600	2,558,034.00	0.09
474	603626	科森科技	327,800	2,556,840.00	0.09
475	600238	海南椰岛	334,100	2,552,524.00	0.09
476	002708	光洋股份	228,600	2,546,604.00	0.09
477	002331	皖通科技	344,200	2,540,196.00	0.09
478	600616	金枫酒业	445,100	2,537,070.00	0.09
479	300632	光莆股份	228,700	2,536,283.00	0.09
480	000797	中国武夷	914,600	2,533,442.00	0.09
481	000731	四川美丰	345,000	2,532,300.00	0.09
482	603878	武进不锈	442,700	2,532,244.00	0.09
483	300900	广联航空	115,060	2,531,320.00	0.09
484	002132	恒星科技	919,800	2,520,252.00	0.09

485	301331	恩威医药	108,800	2,513,280.00	0.09
486	600162	香江控股	1,308,800	2,512,896.00	0.09
487	000014	沙河股份	228,600	2,512,314.00	0.09
488	605266	健之佳	108,600	2,505,402.00	0.09
489	002995	天地在线	114,300	2,504,313.00	0.09
490	002469	三维化学	342,900	2,503,170.00	0.09
491	603687	大胜达	342,900	2,499,741.00	0.09
492	000576	甘化科工	343,100	2,490,906.00	0.09
493	300629	新劲刚	115,000	2,484,000.00	0.08
494	301218	华是科技	114,300	2,483,739.00	0.08
495	002445	中南文化	1,011,600	2,478,420.00	0.08
496	300310	宜通世纪	327,700	2,477,412.00	0.08
497	603333	尚纬股份	444,500	2,475,865.00	0.08
498	000753	漳州发展	574,900	2,472,070.00	0.08
499	000911	广农糖业	343,100	2,470,320.00	0.08
500	600858	银座股份	444,500	2,466,975.00	0.08
501	600293	三峡新材	780,742	2,459,337.30	0.08
502	300025	华星创业	228,600	2,457,450.00	0.08
503	300247	融捷健康	686,200	2,456,596.00	0.08
504	002725	跃岭股份	228,600	2,452,878.00	0.08
505	600665	天地源	781,000	2,444,530.00	0.08
506	600353	旭光电子	338,300	2,442,526.00	0.08
507	688022	瀚川智能	222,728	2,441,098.88	0.08
508	600503	华丽家族	937,800	2,438,280.00	0.08
509	002218	拓日新能	612,700	2,432,419.00	0.08
510	600189	泉阳泉	336,000	2,422,560.00	0.08
511	300662	科锐国际	115,000	2,421,900.00	0.08
512	300201	海伦哲	459,900	2,419,074.00	0.08
513	300631	久吾高科	114,400	2,413,840.00	0.08
514	300328	宜安科技	327,700	2,411,872.00	0.08
515	300280	紫天科技	114,300	2,411,730.00	0.08
516	601116	三江购物	221,600	2,411,008.00	0.08
517	301282	金禄电子	114,300	2,394,585.00	0.08
518	600479	千金药业	224,000	2,392,320.00	0.08
519	002235	安妮股份	455,600	2,387,344.00	0.08
520	002055	得润电子	331,400	2,386,080.00	0.08
521	603012	创力集团	449,300	2,385,783.00	0.08
522	002208	合肥城建	335,100	2,382,561.00	0.08
523	688319	欧林生物	224,609	2,380,855.40	0.08
524	300500	启迪设计	224,200	2,378,762.00	0.08
525	002297	博云新材	344,500	2,370,160.00	0.08
526	300603	立昂技术	212,600	2,368,364.00	0.08
527	688609	九联科技	223,179	2,365,697.40	0.08

528	002300	太阳电缆	442,800	2,364,552.00	0.08
529	600758	辽宁能源	686,100	2,360,184.00	0.08
530	002167	东方锆业	320,700	2,353,938.00	0.08
531	300007	汉威科技	115,000	2,351,750.00	0.08
532	300542	新晨科技	114,300	2,347,722.00	0.08
533	600071	凤凰光学	112,600	2,347,710.00	0.08
534	600278	东方创业	335,800	2,347,242.00	0.08
535	300095	华伍股份	345,000	2,342,550.00	0.08
536	002560	通达股份	342,900	2,338,578.00	0.08
537	000601	韶能股份	574,900	2,334,094.00	0.08
538	002246	北化股份	228,600	2,320,290.00	0.08
538	600668	尖峰集团	228,600	2,320,290.00	0.08
539	603011	合锻智能	337,200	2,309,820.00	0.08
540	301201	诚达药业	114,386	2,308,309.48	0.08
541	002521	齐峰新材	230,000	2,304,600.00	0.08
542	300584	海辰药业	114,300	2,304,288.00	0.08
543	603686	福龙马	221,300	2,301,520.00	0.08
544	300485	赛升药业	328,100	2,299,981.00	0.08
545	301322	绿通科技	104,490	2,296,690.20	0.08
546	002067	景兴纸业	579,800	2,296,008.00	0.08
547	603222	济民医疗	337,720	2,293,118.80	0.08
548	301046	能辉科技	114,243	2,291,714.58	0.08
549	300071	福石控股	483,100	2,289,894.00	0.08
550	000509	华塑控股	686,200	2,285,046.00	0.08
551	600526	菲达环保	508,700	2,284,063.00	0.08
552	002614	奥佳华	345,000	2,283,900.00	0.08
553	300551	古鳌科技	228,600	2,279,142.00	0.08
554	600230	沧州大化	212,600	2,279,072.00	0.08
555	000721	西安饮食	228,700	2,277,852.00	0.08
556	300537	广信材料	114,900	2,272,722.00	0.08
557	600744	华银电力	730,100	2,270,611.00	0.08
558	603315	福鞍股份	211,600	2,268,352.00	0.08
559	605058	澳弘电子	114,300	2,266,569.00	0.08
560	300691	联合光电	114,900	2,265,828.00	0.08
561	000906	浙商中拓	343,000	2,263,800.00	0.08
562	002272	川润股份	229,800	2,263,530.00	0.08
563	300533	冰川网络	114,300	2,258,568.00	0.08
564	002296	辉煌科技	230,000	2,256,300.00	0.08
565	300426	唐德影视	228,600	2,256,282.00	0.08
566	600860	京城股份	223,800	2,255,904.00	0.08
567	300066	三川智慧	572,000	2,253,680.00	0.08
568	300326	凯利泰	345,000	2,242,500.00	0.08
569	300111	向日葵	689,900	2,235,276.00	0.08

570	600513	联环药业	225,400	2,233,714.00	0.08
571	688238	和元生物	452,000	2,232,880.00	0.08
572	603969	银龙股份	329,900	2,230,124.00	0.08
573	002361	神剑股份	407,700	2,221,965.00	0.08
574	688108	赛诺医疗	227,400	2,219,424.00	0.08
575	300225	金力泰	343,300	2,217,718.00	0.08
576	300057	万顺新材	459,900	2,216,718.00	0.08
577	600853	龙建股份	553,700	2,214,800.00	0.08
578	603319	湘油泵	112,300	2,212,310.00	0.08
579	603629	利通电子	110,900	2,208,019.00	0.08
580	600237	铜峰电子	337,100	2,208,005.00	0.08
581	601956	东贝集团	457,100	2,207,793.00	0.08
582	301235	华康医疗	109,200	2,206,932.00	0.08
583	300578	会畅通讯	114,600	2,206,050.00	0.08
584	002082	万邦德	343,000	2,205,490.00	0.08
585	300335	迪森股份	457,300	2,204,186.00	0.08
586	002369	卓翼科技	345,200	2,195,472.00	0.07
587	600127	金健米业	325,600	2,191,288.00	0.07
588	300420	五洋自控	700,900	2,179,799.00	0.07
589	300094	国联水产	574,900	2,178,871.00	0.07
590	300556	丝路视觉	114,300	2,177,415.00	0.07
591	603178	圣龙股份	112,100	2,175,861.00	0.07
592	300471	厚普股份	228,600	2,162,556.00	0.07
592	300503	昊志机电	114,300	2,162,556.00	0.07
593	603015	弘讯科技	221,000	2,159,170.00	0.07
594	002448	中原内配	342,900	2,146,554.00	0.07
594	002731	萃华珠宝	228,600	2,146,554.00	0.07
595	002374	中锐股份	782,300	2,143,502.00	0.07
596	300439	美康生物	205,000	2,142,250.00	0.07
597	600653	申华控股	999,500	2,138,930.00	0.07
598	600838	上海九百	219,800	2,138,654.00	0.07
599	600379	宝光股份	225,638	2,136,791.86	0.07
600	002551	尚荣医疗	688,300	2,119,964.00	0.07
601	002264	新 华 都	343,000	2,119,740.00	0.07
602	002786	银宝山新	228,700	2,115,475.00	0.07
603	000153	丰原药业	345,000	2,114,850.00	0.07
604	000505	京粮控股	342,900	2,112,264.00	0.07
604	002380	科远智慧	114,300	2,112,264.00	0.07
605	301118	恒光股份	114,600	2,109,786.00	0.07
606	300375	鹏翎股份	457,400	2,108,614.00	0.07
607	300365	恒华科技	342,900	2,105,406.00	0.07
608	002561	徐家汇	228,200	2,104,004.00	0.07
609	688579	山大地纬	228,549	2,100,365.31	0.07

610	300796	贝斯美	205,400	2,097,134.00	0.07
611	600592	龙溪股份	211,400	2,088,632.00	0.07
612	002565	顺灏股份	685,900	2,085,136.00	0.07
613	600624	复旦复华	317,000	2,082,690.00	0.07
614	300479	神思电子	114,300	2,080,260.00	0.07
615	002923	润都股份	217,700	2,076,858.00	0.07
616	300504	天邑股份	115,000	2,073,450.00	0.07
617	002659	凯文教育	458,600	2,072,872.00	0.07
618	300572	安车检测	114,300	2,065,401.00	0.07
619	300424	航新科技	114,300	2,064,258.00	0.07
620	000788	北大医药	343,900	2,063,400.00	0.07
621	300032	金龙机电	457,300	2,062,423.00	0.07
622	000159	国际实业	342,900	2,057,400.00	0.07
623	600730	中国高科	339,700	2,055,185.00	0.07
624	688373	盟科药业	414,770	2,048,963.80	0.07
625	301215	中汽股份	343,900	2,046,205.00	0.07
626	605066	天正电气	339,650	2,044,693.00	0.07
627	603069	海汽集团	111,800	2,041,468.00	0.07
628	002133	广宇集团	800,200	2,040,510.00	0.07
629	002849	威星智能	114,300	2,036,826.00	0.07
630	600501	航天晨光	112,200	2,035,308.00	0.07
631	301120	新特电气	205,350	2,035,018.50	0.07
632	002090	金智科技	228,700	2,030,856.00	0.07
633	002393	力生制药	115,000	2,028,600.00	0.07
634	301305	朗坤环境	115,000	2,026,300.00	0.07
635	300279	和晶科技	334,300	2,025,858.00	0.07
636	002771	真视通	115,000	2,021,700.00	0.07
637	603611	诺力股份	112,300	2,015,785.00	0.07
638	300374	中铁装配	114,000	2,014,380.00	0.07
639	002342	巨力索具	623,600	2,014,228.00	0.07
640	000530	冰山冷热	335,100	2,013,951.00	0.07
641	300259	新天科技	574,900	2,012,150.00	0.07
642	300221	银禧科技	343,300	2,004,872.00	0.07
643	300441	鲍斯股份	229,700	2,002,984.00	0.07
644	002687	乔治白	457,282	2,002,895.16	0.07
645	002047	宝鹰股份	644,700	1,998,570.00	0.07
646	300534	陇神戎发	229,300	1,994,910.00	0.07
647	002666	德联集团	457,400	1,994,264.00	0.07
648	600408	安泰集团	969,600	1,987,680.00	0.07
649	002546	新联电子	457,400	1,980,542.00	0.07
650	600354	敦煌种业	333,900	1,976,688.00	0.07
651	002084	海鸥住工	686,200	1,976,256.00	0.07
652	002766	索菱股份	342,900	1,971,675.00	0.07

653	688079	美迪凯	225,600	1,953,696.00	0.07
654	300164	通源石油	457,600	1,949,376.00	0.07
655	002520	日发精机	338,400	1,945,800.00	0.07
656	002682	龙洲股份	458,500	1,939,455.00	0.07
657	300510	金冠股份	457,400	1,939,376.00	0.07
658	601789	宁波建工	433,800	1,926,072.00	0.07
659	600620	天宸股份	336,300	1,923,636.00	0.07
660	002474	榕基软件	320,700	1,920,993.00	0.07
661	300052	中青宝	114,300	1,917,954.00	0.07
662	603817	海峡环保	342,900	1,913,382.00	0.07
663	300933	中辰股份	228,800	1,912,768.00	0.07
664	001896	豫能控股	457,300	1,897,795.00	0.06
665	002094	青岛金王	345,000	1,897,500.00	0.06
666	601177	杭齿前进	228,600	1,892,808.00	0.06
667	002852	道道全	228,700	1,889,062.00	0.06
668	002395	双象股份	114,300	1,887,093.00	0.06
669	300968	格林精密	114,300	1,883,664.00	0.06
670	000593	德龙汇能	343,900	1,874,255.00	0.06
671	300342	天银机电	115,000	1,866,450.00	0.06
672	600960	渤海汽车	559,900	1,864,467.00	0.06
673	300667	必创科技	115,000	1,859,550.00	0.06
674	300400	劲拓股份	114,300	1,853,946.00	0.06
675	300831	派瑞股份	115,000	1,851,500.00	0.06
676	300345	华民股份	327,700	1,848,228.00	0.06
677	600203	福日电子	205,800	1,843,968.00	0.06
678	600405	动力源	325,400	1,841,764.00	0.06
679	002686	亿利达	342,900	1,837,944.00	0.06
680	600814	杭州解百	221,213	1,833,855.77	0.06
681	600558	大西洋	449,659	1,830,112.13	0.06
682	300903	科翔股份	228,600	1,826,514.00	0.06
683	301248	杰创智能	115,000	1,826,200.00	0.06
684	002298	中电兴发	342,900	1,824,228.00	0.06
685	002548	金新农	458,600	1,820,642.00	0.06
686	000037	深南电 A	228,600	1,819,656.00	0.06
687	600280	中央商场	442,700	1,819,497.00	0.06
688	600439	瑞贝卡	539,300	1,817,441.00	0.06
689	002420	毅昌科技	343,100	1,811,568.00	0.06
690	002547	春兴精工	442,300	1,809,007.00	0.06
691	300612	宣亚国际	114,400	1,806,376.00	0.06
692	300713	英可瑞	114,300	1,802,511.00	0.06
693	300490	华自科技	228,600	1,801,368.00	0.06
694	300872	天阳科技	114,300	1,800,225.00	0.06
695	600218	全柴动力	227,600	1,798,040.00	0.06

696	300467	迅游科技	114,300	1,797,939.00	0.06
697	300245	天玑科技	115,000	1,797,450.00	0.06
698	600628	新世界	220,000	1,797,400.00	0.06
699	688509	正元地信	452,400	1,796,028.00	0.06
700	002248	华东数控	229,700	1,789,363.00	0.06
701	688488	艾迪药业	227,600	1,788,936.00	0.06
702	002441	众业达	228,700	1,779,286.00	0.06
703	002119	康强电子	114,900	1,778,652.00	0.06
704	000635	英 力 特	228,600	1,778,508.00	0.06
705	600545	卓郎智能	740,300	1,776,720.00	0.06
706	002757	南兴股份	114,300	1,775,079.00	0.06
707	300560	中富通	114,300	1,769,364.00	0.06
708	300997	欢乐家	114,400	1,768,624.00	0.06
709	300707	威唐工业	114,800	1,764,476.00	0.06
710	002037	保利联合	229,700	1,759,502.00	0.06
711	301518	长华化学	109,400	1,758,058.00	0.06
712	001267	汇绿生态	230,000	1,757,200.00	0.06
713	600622	光大嘉宝	543,200	1,754,536.00	0.06
714	000570	苏常柴 A	344,500	1,753,505.00	0.06
715	300538	同益股份	114,900	1,749,927.00	0.06
716	000010	美丽生态	620,400	1,743,324.00	0.06
717	002593	日上集团	342,900	1,738,503.00	0.06
718	002799	环球印务	228,600	1,732,788.00	0.06
718	002845	同兴达	114,300	1,732,788.00	0.06
719	300291	百纳千成	343,100	1,725,793.00	0.06
720	002350	北京科锐	225,600	1,714,560.00	0.06
721	300756	金马游乐	115,000	1,712,350.00	0.06
722	002337	赛象科技	342,900	1,704,213.00	0.06
723	300466	赛摩智能	228,700	1,703,815.00	0.06
724	603916	苏博特	228,200	1,702,372.00	0.06
725	600249	两面针	334,000	1,700,060.00	0.06
726	300434	金石亚药	205,100	1,692,075.00	0.06
727	002772	众兴菌业	228,600	1,684,782.00	0.06
728	002198	嘉应制药	230,000	1,683,600.00	0.06
729	002323	雅博股份	1,038,100	1,681,722.00	0.06
730	000926	福星股份	659,400	1,681,470.00	0.06
731	300645	正元智慧	114,300	1,679,067.00	0.06
732	300019	硅宝科技	114,400	1,674,816.00	0.06
733	300288	朗玛信息	114,200	1,669,604.00	0.06
734	600992	贵绳股份	112,700	1,667,960.00	0.06
735	601798	蓝科高新	222,400	1,665,776.00	0.06
736	300505	川金诺	115,000	1,656,000.00	0.06
737	603065	宿迁联盛	227,600	1,654,652.00	0.06

738	002584	西陇科学	230,000	1,653,700.00	0.06
739	002712	思美传媒	323,900	1,651,890.00	0.06
740	600560	金自天正	112,800	1,651,392.00	0.06
741	002306	中科云网	572,000	1,647,360.00	0.06
742	000510	新金路	457,300	1,646,280.00	0.06
743	300636	同和药业	205,400	1,637,038.00	0.06
744	603110	东方材料	113,600	1,635,840.00	0.06
745	002642	荣联科技	228,700	1,635,205.00	0.06
746	002187	广百股份	230,000	1,628,400.00	0.06
747	600159	大龙地产	674,100	1,617,840.00	0.06
748	603777	来伊份	104,600	1,612,932.00	0.06
749	300582	英飞特	114,300	1,609,344.00	0.05
750	301115	建科股份	115,000	1,608,850.00	0.05
751	300786	国林科技	114,800	1,595,720.00	0.05
752	603318	水发燃气	221,500	1,594,800.00	0.05
753	600257	大湖股份	337,400	1,592,528.00	0.05
754	300412	迦南科技	344,500	1,591,590.00	0.05
755	300093	金刚光伏	115,000	1,588,150.00	0.05
756	002253	川大智胜	114,900	1,587,918.00	0.05
757	000838	财信发展	571,700	1,583,609.00	0.05
758	000715	中兴商业	227,800	1,583,210.00	0.05
759	603665	康隆达	112,100	1,582,852.00	0.05
760	001219	青岛食品	115,020	1,579,224.60	0.05
761	300486	东杰智能	229,700	1,571,148.00	0.05
762	603701	德宏股份	112,147	1,570,058.00	0.05
763	300512	中亚股份	230,000	1,566,300.00	0.05
764	688468	科美诊断	228,549	1,565,560.65	0.05
765	000407	胜利股份	457,400	1,564,308.00	0.05
766	000782	恒申新材	342,900	1,563,624.00	0.05
767	002730	电光科技	114,100	1,558,606.00	0.05
768	300541	先进数通	114,860	1,556,353.00	0.05
769	300940	南极光	115,000	1,552,500.00	0.05
770	002213	大为股份	114,300	1,551,051.00	0.05
771	603808	歌力思	221,800	1,550,382.00	0.05
772	600613	神奇制药	225,700	1,548,302.00	0.05
773	605068	明新旭腾	114,300	1,537,335.00	0.05
774	600215	派斯林	224,200	1,533,528.00	0.05
775	002638	勤上股份	680,800	1,531,800.00	0.05
776	600698	湖南天雁	338,200	1,528,664.00	0.05
777	300501	海顺新材	114,300	1,525,905.00	0.05
778	603630	拉芳家化	110,694	1,525,363.32	0.05
779	002940	昂利康	115,000	1,515,700.00	0.05
780	300740	水羊股份	114,300	1,511,046.00	0.05

781	002363	隆基机械	228,700	1,502,559.00	0.05
782	002875	安奈儿	115,000	1,490,400.00	0.05
783	603421	鼎信通讯	207,500	1,479,475.00	0.05
784	300149	睿智医药	230,000	1,476,600.00	0.05
785	688189	南新制药	224,573	1,468,707.42	0.05
786	600785	新华百货	112,100	1,465,147.00	0.05
787	300249	依米康	114,600	1,464,588.00	0.05
788	600721	百花医药	221,300	1,458,367.00	0.05
789	000428	华天酒店	455,600	1,457,920.00	0.05
790	002022	科华生物	230,000	1,451,300.00	0.05
791	002495	佳隆股份	568,700	1,444,498.00	0.05
792	002729	好利科技	115,000	1,444,400.00	0.05
793	002451	摩恩电气	228,700	1,436,236.00	0.05
794	002343	慈文传媒	230,000	1,426,000.00	0.05
795	000850	华茂股份	345,000	1,424,850.00	0.05
796	300589	江龙船艇	114,300	1,423,035.00	0.05
797	002150	通润装备	114,297	1,417,282.80	0.05
798	000955	欣龙控股	341,800	1,415,052.00	0.05
799	000514	渝 开 发	342,900	1,409,319.00	0.05
800	000698	沈阳化工	414,500	1,396,865.00	0.05
801	603330	天洋新材	219,900	1,394,166.00	0.05
802	300730	科创信息	114,300	1,391,031.00	0.05
803	002613	北玻股份	342,900	1,385,316.00	0.05
804	603165	荣晟环保	112,600	1,378,224.00	0.05
805	002348	高乐股份	460,000	1,366,200.00	0.05
806	002589	瑞康医药	459,900	1,365,903.00	0.05
807	002805	丰元股份	114,600	1,363,740.00	0.05
808	600228	返利科技	220,800	1,362,336.00	0.05
809	300515	三德科技	114,300	1,361,313.00	0.05
810	603429	集友股份	217,300	1,360,298.00	0.05
811	603999	读者传媒	219,600	1,350,540.00	0.05
812	301013	利和兴	114,600	1,346,550.00	0.05
813	300062	中能电气	228,600	1,344,168.00	0.05
814	603339	四方科技	106,000	1,339,840.00	0.05
815	000790	华神科技	342,100	1,334,190.00	0.05
816	603767	中马传动	112,500	1,325,250.00	0.05
817	603917	合力科技	112,300	1,319,525.00	0.05
818	600661	昂立教育	112,300	1,316,156.00	0.04
819	300650	太龙股份	114,300	1,314,450.00	0.04
820	600540	新赛股份	333,400	1,313,596.00	0.04
821	600818	中路股份	112,300	1,298,188.00	0.04
822	600573	惠泉啤酒	114,300	1,287,018.00	0.04
823	600683	京投发展	337,800	1,283,640.00	0.04

824	300884	狄耐克	114,300	1,277,874.00	0.04
825	300778	新城市	114,300	1,275,588.00	0.04
826	300317	珈伟新能	342,900	1,258,443.00	0.04
827	002524	光正眼科	342,800	1,247,792.00	0.04
828	000663	永安林业	228,600	1,234,440.00	0.04
829	002953	日丰股份	122,220	1,229,533.20	0.04
830	002319	乐通股份	115,000	1,222,450.00	0.04
831	002689	远大智能	343,800	1,199,862.00	0.04
832	300543	朗科智能	114,300	1,197,864.00	0.04
833	603648	畅联股份	113,600	1,165,536.00	0.04
834	002634	棒杰股份	308,500	1,159,960.00	0.04
835	000518	四环生物	457,500	1,157,475.00	0.04
836	600222	太龙药业	225,700	1,148,813.00	0.04
837	603990	麦迪科技	111,530	1,146,528.40	0.04
838	600822	上海物贸	111,200	1,136,464.00	0.04
839	002136	安 纳 达	115,000	1,121,250.00	0.04
840	300086	康芝药业	228,700	1,120,630.00	0.04
841	300340	科恒股份	114,900	1,094,997.00	0.04
842	300614	百川畅银	114,800	1,088,304.00	0.04
843	002329	皇氏集团	299,800	1,088,274.00	0.04
844	002968	新大正	115,000	1,059,150.00	0.04
845	600636	国新文化	113,500	1,053,280.00	0.04
846	000701	厦门信达	230,000	1,051,100.00	0.04
847	600892	大晟文化	277,800	1,025,082.00	0.03
848	000042	中洲控股	229,200	1,024,524.00	0.03
849	603778	乾景园林	337,500	1,022,625.00	0.03
850	002908	德生科技	114,600	1,003,896.00	0.03
851	300404	博济医药	114,200	996,966.00	0.03
852	603336	宏辉果蔬	224,590	958,999.30	0.03
853	002795	永和智控	228,500	932,280.00	0.03
854	300414	中光防雷	114,900	914,604.00	0.03
855	603017	中衡设计	112,600	904,178.00	0.03
856	002905	金逸影视	113,800	896,744.00	0.03
857	603779	威龙股份	111,800	860,860.00	0.03
858	603617	君禾股份	112,100	821,693.00	0.03
859	603987	康德莱	114,300	820,674.00	0.03
860	002723	小崧股份	114,300	794,385.00	0.03
861	002769	普路通	113,800	793,186.00	0.03
862	603122	合富中国	110,100	771,801.00	0.03
863	603028	赛福天	112,400	681,144.00	0.02
864	002762	金发拉比	115,000	667,000.00	0.02
865	603818	曲美家居	227,200	617,984.00	0.02
866	300264	佳创视讯	114,600	617,694.00	0.02

867	603359	东珠生态	110,700	612,171.00	0.02

注：上述股票价值不包括可退替代估增。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	001391	国货航	46,851	420,204.45	0.01
2	301626	苏州天脉	957	62,951.46	0.00
3	688615	合合信息	289	47,910.42	0.00
4	301611	珂玛科技	804	45,104.40	0.00
5	688449	联芸科技	1,406	41,392.64	0.00
6	688605	先锋精科	744	39,937.92	0.00
7	688708	佳驰科技	780	38,181.00	0.00
8	688726	拉普拉斯	979	32,365.74	0.00
9	301551	无线传媒	652	28,185.96	0.00
10	603072	天和磁材	2,255	27,736.50	0.00
11	688750	金天钛业	1,685	26,016.40	0.00
12	301522	上大股份	816	20,269.44	0.00
13	688721	龙图光罩	279	15,861.15	0.00
14	301556	托普云农	267	15,766.35	0.00
15	301631	壹连科技	153	15,599.88	0.00
16	301606	绿联科技	396	14,450.04	0.00
17	301571	国科天成	350	14,290.50	0.00
18	301622	英思特	306	13,745.52	0.00
19	301608	博实结	184	12,029.92	0.00
20	301613	新铝时代	276	11,528.52	0.00
21	301586	佳力奇	215	11,425.10	0.00
22	688710	益诺思	332	11,148.56	0.00
23	301617	博苑股份	253	10,066.87	0.00
24	301603	乔锋智能	233	9,781.34	0.00
25	301607	富特科技	257	9,287.98	0.00
26	603194	中力股份	291	8,185.83	0.00
27	301552	科力装备	143	8,132.41	0.00
28	301585	蓝宇股份	210	7,528.50	0.00
29	001279	强邦新材	265	7,396.15	0.00
30	603395	红四方	154	5,508.58	0.00
31	603207	小方制药	185	4,930.25	0.00
32	603310	巍华新材	254	4,559.30	0.00
33	603091	众鑫股份	94	4,176.42	0.00
34	603391	力聚热能	100	4,135.00	0.00
35	603350	安乃达	106	3,834.02	0.00
36	603205	健尔康	128	3,500.80	0.00
37	603285	键邦股份	129	2,916.69	0.00

注：上述股票价值不包括可退替代估增。

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	002588	史丹利	99,393,498.24	9.81
2	003000	劲仔食品	96,577,465.71	9.53
3	300842	帝科股份	95,797,974.29	9.45
4	300815	玉禾田	90,667,702.13	8.95
5	300349	金卡智能	88,281,244.89	8.71
6	300355	蒙草生态	86,914,658.46	8.58
7	003038	鑫铂股份	83,508,462.82	8.24
8	301391	卡莱特	82,967,328.25	8.19
9	000589	贵州轮胎	80,258,607.19	7.92
10	301051	信濠光电	78,776,525.19	7.77
11	301101	明月镜片	78,672,861.77	7.76
12	300729	乐歌股份	72,822,227.19	7.19
13	300444	双杰电气	71,486,588.87	7.06
14	000521	长虹美菱	69,160,017.85	6.83
15	002285	世联行	68,663,350.94	6.78
16	300969	恒帅股份	68,619,642.31	6.77
17	300592	华凯易佰	68,224,684.88	6.73
18	002478	常宝股份	68,221,200.21	6.73
19	300938	信测标准	67,524,867.56	6.66
20	002452	长高电新	67,474,349.38	6.66
21	002971	和远气体	66,952,662.64	6.61
22	301030	仕净科技	66,421,622.07	6.56
23	000099	中信海直	65,895,712.27	6.50
24	002752	昇兴股份	65,774,990.40	6.49
25	002912	中新赛克	65,499,540.52	6.46
26	002947	恒铭达	65,200,148.48	6.43
27	000888	峨眉山 A	64,245,004.09	6.34
28	002870	香山股份	63,706,994.55	6.29
29	300779	惠城环保	63,379,299.98	6.25
30	300795	米奥会展	62,430,636.40	6.16
31	002919	名臣健康	61,845,643.36	6.10
32	003028	振邦智能	60,498,758.96	5.97
33	301195	北路智控	59,365,067.18	5.86
34	002833	弘亚数控	58,982,437.57	5.82
35	002970	锐明技术	58,726,702.21	5.80
36	300181	佐力药业	55,220,708.84	5.45

37	002983	芯瑞达	54,570,923.29	5.39
38	002301	齐心集团	53,152,852.18	5.25
39	301162	国能日新	52,451,509.58	5.18
40	002641	公元股份	50,260,148.00	4.96
41	002630	华西能源	49,454,978.13	4.88
42	301266	宇邦新材	48,846,443.50	4.82
43	301278	快可电子	48,754,337.02	4.81
44	300881	盛德鑫泰	48,697,474.34	4.81
45	301061	匠心家居	48,364,199.80	4.77
46	300389	艾比森	48,176,496.11	4.75
47	300545	联得装备	47,354,961.34	4.67
48	300452	山河药辅	46,982,630.90	4.64
49	002878	元隆雅图	46,686,187.00	4.61
50	300105	龙源技术	45,380,608.70	4.48
51	301257	普蕊斯	44,764,510.85	4.42
52	300460	惠伦晶体	43,555,911.68	4.30
53	301093	华兰股份	43,276,494.14	4.27
54	002956	西麦食品	43,225,184.51	4.27
55	301004	嘉益股份	43,093,469.13	4.25
56	002922	伊戈尔	42,185,777.13	4.16
57	300360	炬华科技	41,950,723.52	4.14
58	300990	同飞股份	41,846,531.39	4.13
59	300622	博士眼镜	41,726,585.12	4.12
60	002083	孚日股份	41,715,819.09	4.12
61	300491	通合科技	41,373,441.48	4.08
62	300421	力星股份	40,598,946.43	4.01
63	300654	世纪天鸿	40,480,071.98	4.00
64	002443	金洲管道	40,398,716.26	3.99
65	300314	戴维医疗	40,037,144.24	3.95
66	003029	吉大正元	39,843,491.48	3.93
67	300396	迪瑞医疗	38,772,913.50	3.83
68	300532	今天国际	38,673,934.96	3.82
69	300192	科德教育	38,335,326.04	3.78
70	300840	酷特智能	38,187,078.64	3.77
71	300559	佳发教育	37,137,313.07	3.67
72	300092	科新机电	37,045,766.40	3.66
73	000680	山推股份	37,024,290.61	3.65
74	000655	金岭矿业	36,845,058.74	3.64
75	002073	软控股份	36,327,041.99	3.59
76	002031	巨轮智能	36,326,582.00	3.59
77	002803	吉宏股份	36,246,998.68	3.58
78	301181	标榜股份	36,196,692.63	3.57
79	002431	棕榈股份	35,565,858.14	3.51

80	300926	博俊科技	35,361,919.88	3.49
81	300320	海达股份	34,989,709.20	3.45
82	300430	诚益通	34,669,354.56	3.42
83	300147	香雪制药	34,556,155.19	3.41
84	300378	鼎捷数智	34,478,415.48	3.40
85	301185	鸥玛软件	33,915,562.87	3.35
86	000531	穗恒运 A	33,766,193.03	3.33
87	300354	东华测试	32,928,624.42	3.25
88	000554	泰山石油	32,801,920.70	3.24
89	300731	科创新源	32,779,234.80	3.24
90	002533	金杯电工	32,390,961.23	3.20
91	002017	东信和平	32,294,153.34	3.19
92	002829	星网宇达	32,215,581.68	3.18
93	001215	千味央厨	31,981,287.48	3.16
94	002170	芭田股份	31,958,864.70	3.15
95	300331	苏大维格	31,794,274.96	3.14
96	300139	晓程科技	31,721,902.10	3.13
97	301235	华康医疗	31,714,146.75	3.13
98	002339	积成电子	31,677,132.45	3.13
99	301011	华立科技	31,597,696.29	3.12
100	300719	安达维尔	30,990,403.45	3.06
101	002394	联发股份	30,726,424.52	3.03
102	300041	回天新材	30,487,175.80	3.01
103	300293	蓝英装备	30,477,507.00	3.01
104	300473	德尔股份	30,415,145.49	3.00
105	000417	合百集团	29,823,336.49	2.94
106	002035	华帝股份	29,365,320.06	2.90
107	002115	三维通信	28,819,206.94	2.84
108	002732	燕塘乳业	28,451,294.62	2.81
109	002184	海得控制	28,384,017.31	2.80
110	002154	报喜鸟	28,290,719.41	2.79
111	300718	长盛轴承	28,127,168.36	2.78
112	300061	旗天科技	27,947,852.32	2.76
113	002401	中远海科	27,928,788.27	2.76
114	002609	捷顺科技	27,912,430.98	2.75
115	000978	桂林旅游	27,894,349.19	2.75
116	000777	中核科技	26,665,925.06	2.63
117	000948	南天信息	26,601,067.19	2.63
118	300708	聚灿光电	26,552,190.00	2.62
119	001339	智微智能	26,542,837.16	2.62
120	300791	仙乐健康	26,396,581.67	2.61
121	002896	中大力德	26,312,849.70	2.60
122	000912	泸天化	26,196,304.84	2.59

123	300566	激智科技	26,032,579.58	2.57
124	002315	焦点科技	25,859,170.13	2.55
125	300008	天海防务	25,759,496.98	2.54
126	300174	元力股份	25,674,176.42	2.53
127	000949	新乡化纤	25,581,557.99	2.52
128	300020	*ST 银江	25,532,843.08	2.52
129	000551	创元科技	25,298,240.71	2.50
130	300005	探路者	25,231,907.54	2.49
131	002345	潮宏基	25,192,686.18	2.49
132	002057	中钢天源	25,132,563.52	2.48
133	002785	万里石	25,069,876.00	2.47
134	300194	福安药业	25,064,545.00	2.47
135	300384	三联虹普	24,966,446.75	2.46
136	002014	永新股份	24,928,104.79	2.46
137	300081	恒信东方	24,547,012.94	2.42
138	300047	天源迪科	24,307,443.98	2.40
139	002033	丽江股份	24,197,175.66	2.39
140	000900	现代投资	24,194,440.49	2.39
141	000957	中通客车	24,187,547.17	2.39
142	300546	雄帝科技	24,151,706.72	2.38
143	002483	润邦股份	24,127,110.42	2.38
144	002669	康达新材	23,971,742.76	2.37
145	002279	久其软件	23,865,755.70	2.36
146	002611	东方精工	23,853,663.88	2.35
147	300580	贝斯特	23,715,452.25	2.34
148	002045	国光电器	23,675,373.39	2.34
149	002270	华明装备	23,669,006.56	2.34
150	000713	丰乐种业	23,603,038.71	2.33
151	000862	银星能源	23,531,481.36	2.32
152	300228	富瑞特装	23,377,952.00	2.31
153	002860	星帅尔	23,362,859.31	2.31
154	300745	欣锐科技	23,296,811.26	2.30
155	300246	宝莱特	23,231,605.88	2.29
156	300213	佳讯飞鸿	23,049,897.94	2.27
157	300110	华仁药业	23,043,517.31	2.27
158	300161	华中数控	23,014,533.01	2.27
159	002367	康力电梯	22,995,833.23	2.27
160	000815	美利云	22,617,427.00	2.23
161	300053	航宇微	22,617,033.52	2.23
162	002510	天汽模	22,569,169.00	2.23
163	002590	万安科技	22,530,332.20	2.22
164	300173	福能东方	22,498,949.27	2.22
165	300184	力源信息	22,467,392.00	2.22

166	002819	东方中科	22,431,272.26	2.21
167	002122	汇洲智能	22,397,209.00	2.21
168	300341	麦克奥迪	22,341,372.00	2.20
169	000670	盈方微	22,340,267.00	2.20
170	002526	山东矿机	22,328,396.29	2.20
171	002328	新朋股份	22,266,400.54	2.20
172	000404	长虹华意	22,251,882.69	2.20
173	000592	平潭发展	22,209,321.98	2.19
174	002225	濮耐股份	22,175,727.37	2.19
175	002104	恒宝股份	22,144,845.98	2.19
176	000610	西安旅游	22,069,821.22	2.18
177	300189	神农种业	21,758,360.36	2.15
178	300278	华昌达	21,640,640.46	2.14
179	002255	海陆重工	21,549,474.98	2.13
180	300518	新迅达	21,427,678.52	2.11
181	300239	东宝生物	21,394,705.20	2.11
182	000532	华金资本	21,302,634.00	2.10
183	000544	中原环保	21,284,992.56	2.10
184	001212	中旗新材	21,227,468.15	2.09
185	002523	天桥起重	21,195,677.94	2.09
186	002471	中超控股	21,188,150.50	2.09
187	002703	浙江世宝	21,123,993.97	2.08
188	300468	四方精创	21,118,442.85	2.08
189	300280	紫天科技	20,911,369.14	2.06
190	300302	同有科技	20,842,664.09	2.06
191	300248	新开普	20,842,466.75	2.06
192	300098	高新兴	20,727,478.00	2.05
193	000852	石化机械	20,705,194.75	2.04
194	300809	华辰装备	20,548,974.06	2.03
195	300042	朗科科技	20,541,967.82	2.03
196	002540	亚太科技	20,437,580.00	2.02
197	300193	佳士科技	20,426,930.91	2.02
198	300857	协创数据	20,367,665.41	2.01
199	002529	海源复材	20,357,144.00	2.01
200	002628	成都路桥	20,323,537.57	2.01

注：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	002588	史丹利	107,701,015.76	10.63
2	300842	帝科股份	95,633,508.80	9.44
3	003000	劲仔食品	93,987,371.80	9.28

4	300815	玉禾田	90,354,948.23	8.92
5	300349	金卡智能	88,969,270.62	8.78
6	300355	蒙草生态	88,838,648.93	8.77
7	003038	鑫铂股份	84,671,567.24	8.36
8	301391	卡莱特	80,479,612.28	7.94
9	301101	明月镜片	78,777,986.65	7.77
10	300779	惠城环保	76,559,786.54	7.56
11	000099	中信海直	76,150,809.01	7.52
12	301051	信濠光电	74,911,863.75	7.39
13	000589	贵州轮胎	74,543,293.34	7.36
14	002912	中新赛克	73,113,228.55	7.22
15	300729	乐歌股份	71,721,819.99	7.08
16	300444	双杰电气	69,741,614.00	6.88
17	002285	世联行	68,949,794.59	6.80
18	002452	长高电新	67,768,522.75	6.69
19	301030	仕净科技	67,663,427.76	6.68
20	300938	信测标准	67,521,721.61	6.66
21	002947	恒铭达	66,634,410.95	6.58
22	002971	和远气体	66,096,841.30	6.52
23	002478	常宝股份	65,604,912.00	6.47
24	002752	昇兴股份	65,435,532.62	6.46
25	300969	恒帅股份	64,893,257.42	6.40
26	300795	米奥会展	64,409,489.29	6.36
27	300592	华凯易佰	63,876,067.40	6.30
28	002870	香山股份	63,646,601.30	6.28
29	000521	长虹美菱	63,529,691.89	6.27
30	002833	弘亚数控	63,514,999.83	6.27
31	000888	峨眉山 A	62,951,349.71	6.21
32	002919	名臣健康	61,947,573.39	6.11
33	003028	振邦智能	61,215,379.83	6.04
34	300181	佐力药业	60,142,135.61	5.94
35	301195	北路智控	57,336,008.29	5.66
36	002970	锐明技术	55,409,740.58	5.47
37	301162	国能日新	55,405,554.74	5.47
38	002983	芯瑞达	55,278,814.71	5.46
39	300881	盛德鑫泰	52,875,309.72	5.22
40	301266	宇邦新材	51,998,242.68	5.13
41	002878	元隆雅图	51,230,268.56	5.06
42	301278	快可电子	50,997,566.53	5.03
43	002301	齐心集团	50,982,016.86	5.03
44	002630	华西能源	49,730,335.80	4.91
45	301004	嘉益股份	49,574,577.74	4.89
46	002641	公元股份	48,166,653.62	4.75

47	300452	山河药辅	47,000,268.43	4.64
48	300389	艾比森	46,924,576.94	4.63
49	300990	同飞股份	46,332,572.98	4.57
50	300545	联得装备	46,047,887.50	4.54
51	301061	匠心家居	45,474,868.15	4.49
52	301257	普蕊斯	44,873,564.35	4.43
53	300105	龙源技术	44,633,124.36	4.40
54	300926	博俊科技	44,476,051.22	4.39
55	300460	惠伦晶体	43,871,625.30	4.33
56	300491	通合科技	43,130,393.40	4.26
57	002956	西麦食品	43,089,210.62	4.25
58	300654	世纪天鸿	41,438,553.69	4.09
59	003029	吉大正元	41,227,244.22	4.07
60	000680	山推股份	40,884,607.34	4.03
61	300622	博士眼镜	40,071,360.04	3.95
62	301093	华兰股份	40,056,210.36	3.95
63	300421	力星股份	39,923,969.58	3.94
64	300360	炬华科技	39,662,272.35	3.91
65	002443	金洲管道	39,543,955.97	3.90
66	002922	伊戈尔	38,797,880.79	3.83
67	002083	孚日股份	38,728,663.38	3.82
68	300314	戴维医疗	38,552,851.97	3.80
69	300192	科德教育	38,112,314.77	3.76
70	300559	佳发教育	37,977,652.01	3.75
71	300092	科新机电	36,791,793.92	3.63
72	300532	今天国际	36,443,119.28	3.60
73	300840	酷特智能	36,378,577.36	3.59
74	002803	吉宏股份	35,988,213.40	3.55
75	300731	科创新源	35,951,434.97	3.55
76	300430	诚益通	35,943,203.80	3.55
77	300396	迪瑞医疗	35,785,815.00	3.53
78	301185	鸥玛软件	35,743,724.66	3.53
79	301181	标榜股份	35,643,346.41	3.52
80	002073	软控股份	34,619,896.18	3.42
81	000655	金岭矿业	34,605,147.77	3.42
82	002431	棕榈股份	34,024,308.00	3.36
83	301235	华康医疗	33,809,776.24	3.34
84	300378	鼎捷数智	33,761,985.89	3.33
85	300147	香雪制药	33,247,439.92	3.28
86	002031	巨轮智能	33,167,633.00	3.27
87	300320	海达股份	33,153,597.00	3.27
88	000531	穗恒运 A	32,548,489.57	3.21
89	300354	东华测试	32,457,517.58	3.20

90	300331	苏大维格	32,232,717.97	3.18
91	002315	焦点科技	32,112,828.40	3.17
92	002829	星网宇达	31,954,699.89	3.15
93	300020	*ST 银江	31,738,880.95	3.13
94	300719	安达维尔	31,681,330.10	3.13
95	000554	泰山石油	31,477,617.90	3.11
96	002154	报喜鸟	31,329,995.48	3.09
97	300293	蓝英装备	31,318,344.65	3.09
98	002017	东信和平	31,260,888.84	3.09
99	002339	积成电子	31,001,894.52	3.06
100	001215	千味央厨	30,742,117.77	3.03
101	002533	金杯电工	30,716,639.91	3.03
102	002170	芭田股份	30,439,483.09	3.00
103	300139	晓程科技	30,423,376.00	3.00
104	301011	华立科技	30,325,713.44	2.99
105	300473	德尔股份	29,296,274.00	2.89
106	002115	三维通信	29,178,304.51	2.88
107	002394	联发股份	29,165,751.34	2.88
108	300041	回天新材	28,618,923.67	2.82
109	300580	贝斯特	28,608,873.74	2.82
110	000417	合百集团	27,935,241.74	2.76
111	002184	海得控制	27,903,758.54	2.75
112	002609	捷顺科技	27,857,974.57	2.75
113	002035	华帝股份	27,346,357.01	2.70
114	002401	中远海科	27,069,966.93	2.67
115	300718	长盛轴承	26,954,992.93	2.66
116	002732	燕塘乳业	26,946,817.53	2.66
117	002270	华明装备	26,894,872.33	2.65
118	000978	桂林旅游	26,327,976.58	2.60
119	001339	智微智能	26,206,304.00	2.59
120	002896	中大力德	26,075,652.65	2.57
121	300857	协创数据	25,782,583.00	2.54
122	300061	旗天科技	25,575,623.80	2.52
123	000948	南天信息	25,497,484.60	2.52
124	300566	激智科技	25,178,412.48	2.48
125	000777	中核科技	25,170,678.48	2.48
126	300708	聚灿光电	25,137,216.60	2.48
127	300791	仙乐健康	24,927,029.62	2.46
128	000912	泸天化	24,876,359.80	2.46
129	000551	创元科技	24,601,365.98	2.43
130	300005	探路者	24,572,427.79	2.43
131	300047	天源迪科	24,396,333.42	2.41
132	300008	天海防务	24,392,324.00	2.41

133	300174	元力股份	24,303,840.82	2.40
134	300384	三联虹普	23,834,085.94	2.35
135	002057	中钢天源	23,814,990.69	2.35
136	000949	新乡化纤	23,664,461.00	2.34
137	002014	永新股份	23,657,401.80	2.33
138	300194	福安药业	23,637,075.00	2.33
139	002611	东方精工	23,622,757.87	2.33
140	002785	万里石	23,607,804.97	2.33
141	300161	华中数控	23,583,588.69	2.33
142	002345	潮宏基	23,506,412.53	2.32
143	300228	富瑞特装	23,452,296.92	2.31
144	002279	久其软件	23,398,909.76	2.31
145	000957	中通客车	23,348,919.00	2.30
146	300081	恒信东方	23,287,558.99	2.30
147	300246	宝莱特	23,197,671.92	2.29
148	002669	康达新材	23,176,831.67	2.29
149	002860	星帅尔	23,132,029.15	2.28
150	002483	润邦股份	23,081,929.18	2.28
151	300049	福瑞股份	23,074,904.71	2.28
152	002045	国光电器	22,905,264.05	2.26
153	000815	美利云	22,852,333.16	2.26
154	300280	紫天科技	22,675,938.03	2.24
155	300255	常山药业	22,595,356.42	2.23
156	300213	佳讯飞鸿	22,557,211.00	2.23
157	000713	丰乐种业	22,501,895.85	2.22
158	000862	银星能源	22,465,365.66	2.22
159	300173	福能东方	22,426,012.22	2.21
160	000900	现代投资	22,387,696.00	2.21
161	002033	丽江股份	22,352,264.54	2.21
162	002367	康力电梯	22,223,116.00	2.19
163	002510	天汽模	22,084,444.72	2.18
164	002819	东方中科	22,073,035.90	2.18
165	300546	雄帝科技	22,022,565.99	2.17
166	300341	麦克奥迪	21,823,048.40	2.15
167	300745	欣锐科技	21,782,955.39	2.15
168	300110	华仁药业	21,707,653.25	2.14
169	000670	盈方微	21,691,174.00	2.14
170	002526	山东矿机	21,687,446.90	2.14
171	002104	恒宝股份	21,598,888.00	2.13
172	000404	长虹华意	21,539,216.00	2.13
173	002654	万润科技	21,516,158.16	2.12
174	002062	宏润建设	21,470,273.30	2.12
175	000592	平潭发展	21,413,823.87	2.11

176	300042	朗科科技	21,360,675.71	2.11
177	002328	新朋股份	21,316,167.11	2.10
178	300239	东宝生物	21,190,874.00	2.09
179	002590	万安科技	21,178,378.00	2.09
180	002122	汇洲智能	21,025,377.80	2.08
181	002225	濮耐股份	20,984,682.00	2.07
182	300468	四方精创	20,982,483.33	2.07
183	002255	海陆重工	20,964,813.90	2.07
184	001212	中旗新材	20,827,807.12	2.06
185	300278	华昌达	20,790,022.05	2.05
186	300248	新开普	20,735,308.89	2.05
187	000610	西安旅游	20,726,178.63	2.05
188	300302	同有科技	20,674,944.52	2.04
189	300189	神农种业	20,630,524.28	2.04
190	000532	华金资本	20,517,491.98	2.02
191	002703	浙江世宝	20,437,089.62	2.02
192	300809	华辰装备	20,300,362.20	2.00

注：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	13,398,750,709.42
卖出股票收入（成交）总额	12,531,973,973.48

注：“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	709,027.97	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	709,027.97	0.02

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	123251	华医转债	7,090	709,027.97	0.02

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

注：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

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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

注：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

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

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

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.2 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

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

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的情形，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情形。

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	3,291,305.71
2	应收清算款	1,243,135.75
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	4,534,441.46

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：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

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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	301626	苏州天脉	62,951.46	0.00	新股锁定期内
2	688615	合合信息	47,910.42	0.00	新股锁定期内
3	301611	珂玛科技	45,104.40	0.00	新股锁定期内
4	688449	联芸科技	41,392.64	0.00	新股锁定期内
5	001391	国货航	31,864.80	0.00	新股锁定期内

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		华泰柏瑞中证2000交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	
		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（%）
25,018	115,263.97	1,498,008,613.00	51.95	1,329,628,987.00	46.11	56,036,400.00	1.94

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	中国平安人寿保险股份有限公司－寿险传统低－自主	95,511,000.00	3.31

2	银华基金－中国人寿保险股份有限公司－传统险－银华基金国寿股份均衡股票传统可供出	85,518,500.00	2.97
3	银华基金－中国人寿保险股份有限公司－分红险－银华基金国寿股份均衡股票型组合单一	84,661,200.00	2.94
4	陆家嘴国泰人寿保险有限责任公司－传统保险产品	80,000,000.00	2.77
5	中国东方国际资产管理有限公司－客户资产账户	65,507,900.00	2.27
6	长城人寿保险股份有限公司－自有资金	60,000,000.00	2.08
7	UBS AG	55,982,981.00	1.94
8	中国太平洋人寿保险股份有限公司－万能－个人万能	52,652,400.00	1.83
9	中国农业银行股份有限公司－华夏养老目标日期 2045 三年持有期混合型基金中基金（FO	42,278,400.00	1.47
10	中国平安人寿保险股份有限公司－分红－个险分红	40,945,771.00	1.42
11	华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	56,036,400.00	1.94

注：前十名持有人为除本基金的联接基金之外的前十名持有人。

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	0.00	0.0000

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§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	588,674,000.00
本报告期期初基金份额总额	1,003,674,000.00
本报告期基金总申购份额	22,280,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	20,400,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,883,674,000.00

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人重大人事变动：

2024 年 1 月 19 日，公司股东会书面决定尹雷先生担任公司独立董事，陆桢女士不再担任公司独立董事。

2024 年 7 月 2 日，经公司董事会审议通过，柳军先生、王文慧女士任公司副总经理。

2024 年 7 月 12 日，经公司董事会审议通过，李晓西先生不再担任公司副总经理。

2024 年 7 月 2 日，柳军先生任公司副总经理，根据法规要求，不再担任职工监事。

2024 年 7 月 11 日，公司全体员工投票推选赵景云女士担任公司职工监事。

2024 年 8 月 16 日，公司股东会书面决定卢龙威先生担任公司监事，卞时珍女士不再担任公司监事。

上述人事变动已按相关规定备案、报告。

报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金提供审计服务的机构由普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)变更为安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)。本基金本年度支付给审计机构安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)的报酬为 70,000.00 元人民币，其已提供审计服务的连续年限为 1 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：报告期内基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：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(%)	
中信证券	2	16,637,339,430.23	64.17	1,731,046.01	43.76	-
广发证券	2	3,470,981,038.64	13.39	724,550.31	18.31	-
方正证券	4	3,293,759,499.04	12.70	659,432.27	16.67	-
招商证券	2	2,054,222,399.29	7.92	410,888.24	10.39	-
中信建投	2	290,595,295.40	1.12	274,391.52	6.94	-
银河证券	2	173,607,255.61	0.67	151,709.58	3.83	-
华泰证券	5	4,049,958.76	0.02	3,705.57	0.09	-
平安证券	2	1,981,268.23	0.01	396.16	0.01	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
上海证券	2	-	-	-	-	-

注：1、选择证券公司参与证券交易的标准

公司选择财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强的证券公司租用基金专用交易席位。公司选择的提供交易单元的券商应当综合考虑下列因素：

(1)具有相应的业务经营资格；

(2)具备研究实力，有固定的研究机构和充足的研究人员，或者获得过知名金融媒体奖项，

能及时为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、股票分析的研究报告，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告和特色研究服务等；

(3)诚信记录良好，最近两年券商研究、交易业务无重大违法违规行为，未受监管机构重大处罚；

(4)财务状况良好，信誉良好，内部管理规范、严格，风控合规管理人员充足，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

(5)具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要；

(6)被动股票型基金选择的提供交易单元的券商需综合考虑上述(1)、(3)、(4)和(5)基本条件，在此基础上可以设置指标进行评价，对相关未公开数据、证券公司内部业务流程及其他适用并纳入评价标准的相关信息，公司相关部门发送《尽职调查函》至各证券公司详询。

根据上述条件标准，公司建立被动股票型基金和其他类型基金证券公司白名单。

证券公司白名单进行定期或不定期更新，每年更新不得少于一次。

2、选择证券公司参与证券交易的程序

公司选择证券公司租用基金专用交易席位，应遵循以下程序：

(1)公司投研部门根据拟合作的证券公司名单，负责安排与券商签订经公司合规法律部审核的《证券研究服务协议》，协议需约定双方的权利义务，明确服务内容、收取交易佣金的价格标准与计算方式。

(2)基金事务部依据公司相关部门对券商的综合评价，根据基金运作需要，与券商签署《证券交易单元租用协议》。

(3)如因业务需要，公司需新增租用已合作券商的交易单元，基金事务部应提出申请，与券商签订《证券交易单元租用协议》。

公司选择代理证券买卖的证券经营机构的程序：

基金管理人根据业务需要与被选择的证券经营机构签订证券经纪服务协议。

3、本部分的数据统计时间区间与本报告的报告期一致，统计范围仅包括本基金；本公司官网披露的本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，统计范围为报告期间存续过的所有公募基金，包括报告期间成立、清算、转型的公募基金。

4、本报告期内，无变更租用证券公司交易单元的情况。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
中信证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	520,552.74	39.61	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	482,736.86	36.73	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	310,890.00	23.66	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-

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	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金的销售机构由北京中植基金销售有限公司变更为华源证券股份有限公司的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 12 月 19 日
2	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 12 月 05 日
3	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 11 月 27 日
4	关于同意浙商证券股份有限公司为华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金提供主做市服务的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 11 月 25 日
5	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止	证监会规定报刊和网站	2024 年 11 月 18 日

	乾道基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告		
6	华泰柏瑞基金管理有限公司旗下部分基金改聘会计师事务所公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 11 月 02 日
7	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 10 月 24 日
8	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金持有停牌证券估值调整的提示性公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 09 月 27 日
9	华泰柏瑞基金管理有限公司关于暂停海银基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 09 月 19 日
10	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止深圳前海财厚基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 09 月 04 日
11	关于同意光大证券股份有限公司为华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金提供一般做市服务的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 08 月 21 日
12	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止中民财富基金销售（上海）有限公司办理旗下基金相关业务公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 08 月 16 日
13	关于同意广发证券股份有限公司为华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金提供一般做市服务的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 07 月 31 日
14	华泰柏瑞基金管理有限公司关于停牌股票估值调整情况的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 07 月 24 日
15	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金参加招商证券股份有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 07 月 19 日
16	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 07 月 18 日
17	华泰柏瑞基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 07 月 13 日
18	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止喜鹊财富基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 07 月 06 日
19	华泰柏瑞基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 07 月 03 日
20	华泰柏瑞基金管理有限公司关于停牌股票估值调整情况的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 06 月 28 日

21	华泰柏瑞基金管理有限公司关于变更网上直销汇款交易业务的收款银行账户的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 06 月 25 日
22	华泰柏瑞基金管理有限公司关于停牌股票估值调整情况的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 06 月 20 日
23	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内分销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 05 月 29 日
24	华泰柏瑞基金管理有限公司关于提醒投资者防范不法分子假冒公司名义从事非法活动的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 03 月 29 日
25	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 03 月 28 日
26	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 02 月 24 日
27	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止和合期货有限公司办理旗下基金相关业务公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 02 月 21 日
28	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 02 月 01 日
29	华泰柏瑞基金管理有限公司关于对营业执照吊销客户采取限制交易措施的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 02 月 01 日
30	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止北京中期时代基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 01 月 06 日
31	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 01 月 05 日
32	关于同意中国银河证券股份有限公司为华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金提供主做市服务的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 01 月 02 日
33	关于同意国泰君安证券股份有限公司为华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金提供主做市服务的公告	证监会规定报刊和网站	2024 年 01 月 02 日

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本基金本报告期内未有单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

1、本基金的中国证监会批准募集文件

2、本基金的《基金合同》

3、本基金的《招募说明书》

4、本基金的《托管协议》

5、基金管理人业务资格批件、营业执照

6、本基金的公告

13.2 存放地点

上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

托管人住所

13.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。 投资者对本报告如有疑问，可咨询基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司。 客户服务热线：400-888-0001（免长途费） 021-3878 4638 公司网址：www.huatai-pb.com

华泰柏瑞基金管理有限公司

2025 年 3 月 31 日