

---

# 华夏中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

## 2023 年年度报告

### 2023 年 12 月 31 日

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：二〇二四年三月二十八日

## §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 2024 年 3 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告期自 2023 年 9 月 6 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录 .....	1
§2 基金简介 .....	3
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 .....	4
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	4
3.2 基金净值表现 .....	5
3.3 过去三年基金的利润分配情况 .....	6
§4 管理人报告 .....	6
§5 托管人报告 .....	12
§6 审计报告 .....	13
§7 年度财务报表 .....	15
7.1 资产负债表 .....	15
7.2 利润表 .....	16
7.3 净资产变动表 .....	17
7.4 报表附注 .....	18
§8 投资组合报告 .....	41
8.1 期末基金资产组合情况 .....	41
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	42
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 .....	42
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	61
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	63
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 .....	64
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 .....	64
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 .....	64
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 .....	64
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	64
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	64
8.12 投资组合报告附注 .....	64
§9 基金份额持有人信息 .....	65
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	65
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	66
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	66
§10 开放式基金份额变动 .....	66
§11 重大事件揭示 .....	66
§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....	69
§13 备查文件目录 .....	70

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华夏中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华夏中证 2000ETF
场内简称	ZZ2000（扩位简称：中证 2000ETF 华夏）
基金主代码	562660
交易代码	562660
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023 年 9 月 6 日
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	88,874,000.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2023 年 9 月 14 日

注：根据 2023 年 12 月 15 日发布的《华夏基金管理有限公司关于旗下部分上交所 ETF 变更场内扩位简称的公告》，自 2023 年 12 月 15 日起，本基金场内扩位简称由“中证 2000ETF 基金”变更为“中证 2000ETF 华夏”。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。
投资策略	主要投资策略包括组合复制策略，替代性策略，存托凭证投资策略，金融衍生品投资策略，债券投资策略，可转换债券、可交换债券投资策略，资产支持证券投资策略，融资、转融通证券出借业务投资策略等。
业绩比较基准	中证 2000 指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

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

办公地址	北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码	100033	518040
法定代表人	张佑君	缪建民

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2023 年 9 月 6 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
本期已实现收益	3,242,426.94
本期利润	3,884,816.38
加权平均基金份额本期利润	0.0224
本期加权平均净值利润率	2.23%
本期基金份额净值增长率	4.61%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末
期末可供分配利润	3,824,797.16
期末可供分配基金份额利润	0.0430
期末基金资产净值	92,970,343.03
期末基金份额净值	1.0461
3.1.3 累计期末指标	2023 年末
基金份额累计净值增长率	4.61%

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

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

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

④本基金合同于 2023 年 9 月 6 日生效。

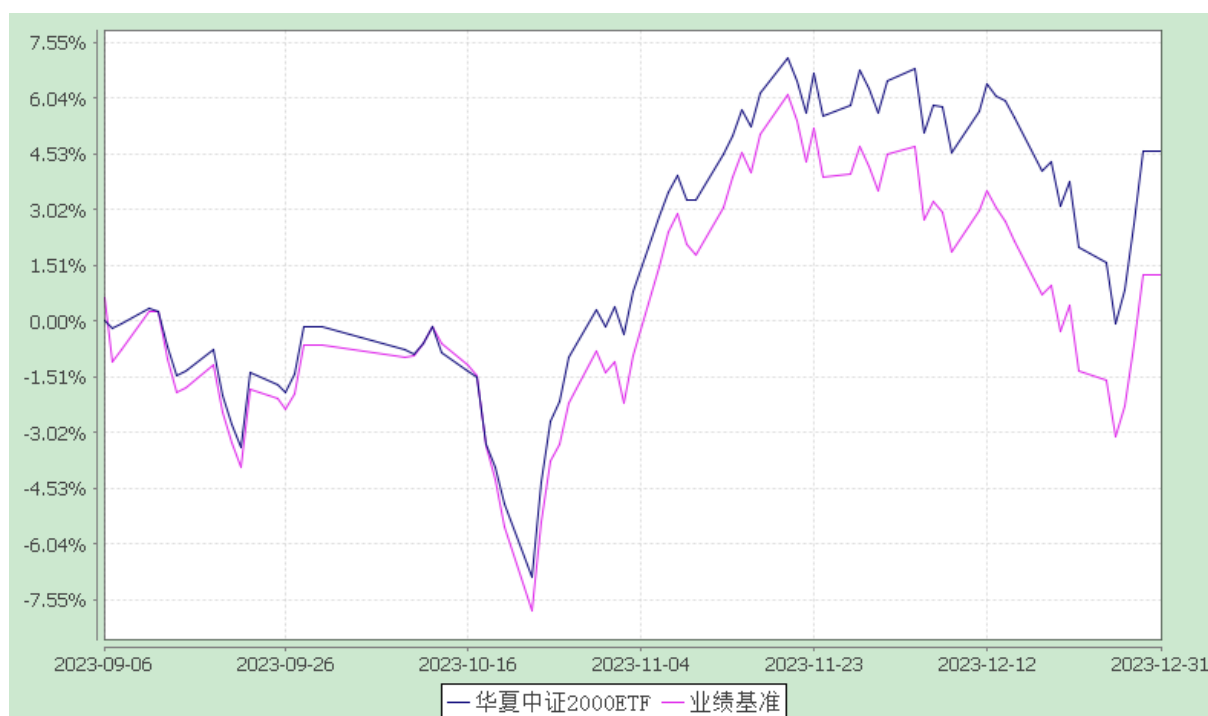
### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	4.79%	1.04%	1.92%	1.10%	2.87%	-0.06%
自基金合同生效起至今	4.61%	0.99%	1.25%	1.08%	3.36%	-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

华夏中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金  
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
 (2023 年 9 月 6 日至 2023 年 12 月 31 日)

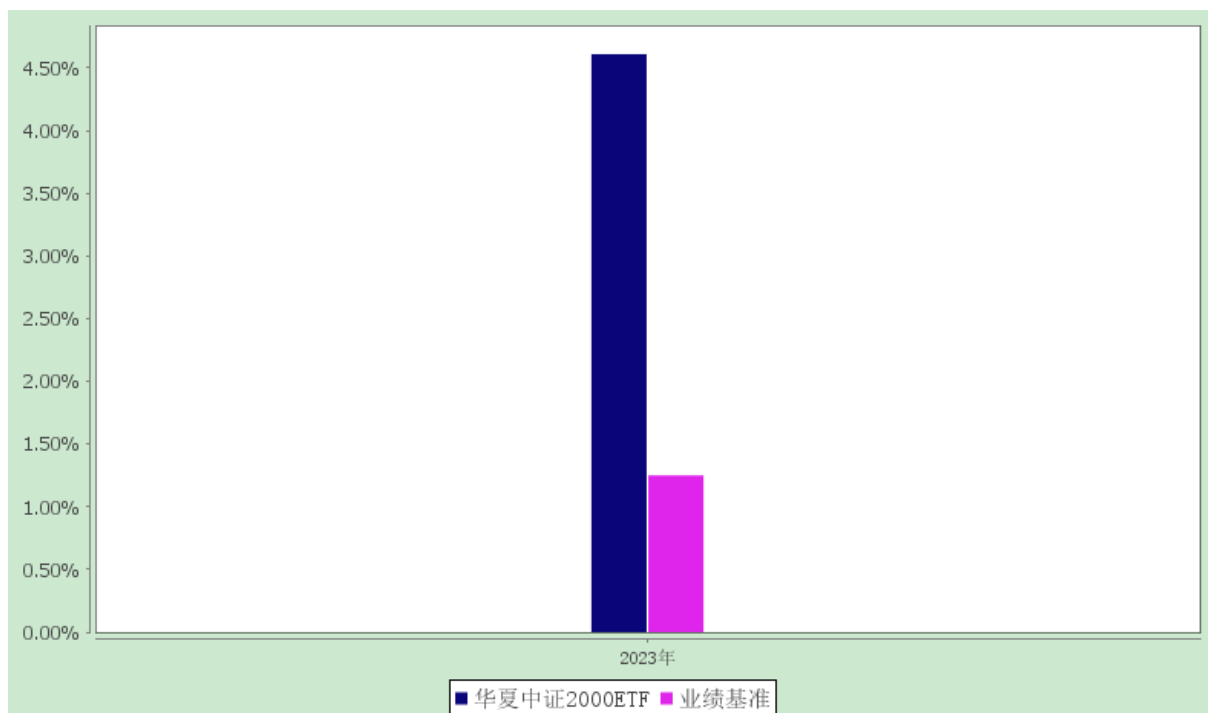


注：①本基金合同于 2023 年 9 月 6 日生效。

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

#### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华夏中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金  
 自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同于 2023 年 9 月 6 日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效以来无利润分配事项。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

的基金管理公司之一。

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

华夏基金以深入的投资研究为基础，尽力捕捉市场机会，为投资人谋求良好的回报。根据银河证券基金研究中心《中国基金业绩评价报告》，截至 2023 年 12 月 31 日，华夏基金旗下多只产品近 1 年同类排名领先（基金排名不作为产品未来表现的保证），其中：

主动权益产品：在北交所主题偏股型基金(A 类)中华夏北交所创新中小企业精选两年定开混合发起式排名第 1/10；在对冲策略绝对收益目标基金(A 类)中华夏安泰对冲策略 3 个月定开混合排名第 1/22；在消费行业偏股型基金(A 类)中华夏网购精选混合(A 类)排名第 2/68、华夏消费升级混合(A 类)排名第 11/68、华夏消费龙头混合(A 类)排名第 13/68、华夏新兴消费混合(A 类)排名第 21/68；在低碳环保行业股票型基金(A 类)中华夏节能环保股票(A 类)排名第 3/10；在增强规模指数股票型基金(A 类)中华夏中证 500 指数增强(A 类)排名第 3/145、华夏中证 500 指数智选增强(A 类)排名第 4/145、华夏中证 1000 指数增强(A 类)排名第 20/145；在 TMT 与信息技术行业偏股型基金(A 类)中华夏数字经济龙头混合发起式(A 类)排名第 4/30；在新能源主题股票型基金(A 类)中华夏能源革新股票(A 类)排名第 4/14；在汽车主题行业偏股型基金(A 类)中华夏新能源车龙头混合发起式(A 类)排名第 4/13；在灵活配置型基金(基准股票比例 30%-60%)(A 类)中华夏新锦绣混合(A 类)排名第 4/421、华夏稳增混合排名第 10/421；在偏股型基金(股票上限 95%)(A 类)中华夏磐锐一年定开混合(A 类)排名第 4/216、华夏磐利一年定开混合(A 类)排名第 21/216、华夏新兴经济一年持有混合(A 类)排名第 33/216；在标准股票型基金(A 类)中华夏智胜先锋股票（LOF）(A 类)排名第 8/326、华夏智胜价值成长股票(A 类)排名第 15/326。

固收与固收+产品：在普通偏债型基金(股票上限不高于 30%)(A 类)中华夏磐泰混合（LOF）(A 类)排名第 1/349、华夏稳福六个月持有混合(A 类)排名第 17/349、华夏睿磐泰兴混合(A 类)排名第 28/349；在长期纯债债券型基金(A 类)中华夏鼎成一年定开债券排名第 12/1340、华夏鼎航债券(A 类)排名第 14/1340；在普通债券型基金(二级)(A 类)中华夏稳享增利 6 个月债券(A 类)排名第 13/402、华夏鼎源债券(A 类)排名第 14/402、华夏卓信一年定开债券发起式排名第 25/402、华夏希望债券(A 类)排名第 32/402、华夏鼎泓债券(A 类)排名第 34/402、华夏卓享债券(A 类)排名第 38/402；在中短期纯债债券型基金(A 类)中华夏中短债债券(A 类)排名第 34/137。

指数产品：在主题指数股票 ETF 基金中华夏中证动漫游戏 ETF 排名第 2/343、华夏中证 5G 通信主题 ETF 排名第 10/343、华夏中证云计算与大数据主题 ETF 排名第 16/343、华夏中证人工智能主题 ETF 排名第 20/343、华夏国证消费电子主题 ETF 排名第 24/343、华夏中证智能汽车主题 ETF 排



名第 25/343、华夏中证金融科技主题 ETF 排名第 28/343、华夏中证文化传媒 ETF 排名第 31/343、华夏中证机器人 ETF 排名第 39/343；在策略指数股票 ETF 基金中华夏中证智选 500 价值稳健策略 ETF 排名第 6/37、华夏中证智选 1000 价值稳健策略 ETF 排名第 10/37；在行业指数股票 ETF 基金中华夏中证全指证券公司 ETF 排名第 10/66；在规模指数股票 ETF 基金中华夏中证 1000ETF 排名第 17/146、华夏中证 500ETF 排名第 26/146；在主题指数股票 ETF 联接基金(A 类)中华夏中证动漫游戏 ETF 发起式联接(A 类)排名第 2/125、华夏中证 5G 通信主题 ETF 联接(A 类)排名第 6/125、华夏中证人工智能主题 ETF 联接(A 类)排名第 9/125、华夏中证央企 ETF 联接(A 类)排名第 25/125；在行业指数股票 ETF 联接基金(A 类)中华夏中证全指证券公司 ETF 联接(A 类)排名第 6/36；在规模指数股票 ETF 联接基金(A 类)中华夏中证 1000ETF 发起式联接(A 类)排名第 11/106、华夏中证 500ETF 联接(A 类)排名第 19/106；在信用债指数债券型基金(A 类)中华夏亚债中国指数(A 类)排名第 5/16；在利率债指数债券型基金(A 类)中华夏彭博政金债 1-5 年(A 类)排名第 13/115。

在《证券时报》主办的第十八届中国基金业“明星基金奖”评选活动上，华夏基金将两大奖项收入囊中：公司层面，华夏基金荣获“三年海外投资明星基金公司”；产品层面，华夏沪深 300ETF 荣获“三年持续回报指数型明星基金奖”。在《上海证券报》主办的第二十届“金基金”奖评选活动上，华夏基金荣膺三项大奖，公司层面获得“被动投资基金管理公司奖”，产品层面华夏创新前沿股票和华夏行业景气混合分别荣获股票型基金五年期奖和偏股混合型基金五年期奖。

在客户服务方面，2023 年，华夏基金继续以客户需求为导向，努力提高客户使用的便利性和服务体验：（1）华夏基金直销渠道优化页面显示，升级搜索及查询功能，让客户操作更加便利；（2）华夏基金管家客户端优化“忘记密码”功能及定投模块，上线亲子账户、资产诊断等功能，贴合客户投资需求，进一步提升使用体验；（3）与华润银行、贵州银行、武汉农商行等代销机构合作，拓展更加丰富的客户理财渠道；（4）开展“帮你问了 ChatGPT”、“指数攻防值来啦！”、“华夏基金模拟投基大赛”、“煎熬的磨底期里找机会”等活动，为客户提供了多样化的投资者教育和关怀服务。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
鲁亚运	本基金的基金经理	2023-09-06	-	8 年	硕士。曾任国泰基金管理有限公司研究员、银华基金管理有限公司营销经理。2020 年 6 月加入华夏基金管理有限公司。历任数量投资部研究员、基金经理助理

					理。
陈国峰	本基金的基金经理	2023-09-26	-	8 年	硕士。曾任世坤投资咨询有限公司（WorldQuant）中国区研究总监等。2020 年加入华夏基金管理有限公司。历任数量投资部研究员、投资经理助理。

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

②证券从业的含义遵从行业协会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

#### 4.1.3 基金经理薪酬机制

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》等法律法规和基金合同，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

##### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

#### 4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

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

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

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 255 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪的标的指数为中证 2000 指数，中证 2000 指数从沪深市场中选取市值规模较小且流动性较好的 2000 只证券作为指数样本，中证 2000 与沪深 300、中证 500 和中证 1000 指数共同构成中证规模指数系列，反映沪深市场不同市值规模上市公司证券的整体表现。本基金通过综合考虑标的指数成份股的流动性、投资限制、交易成本、交易限制等因素，采取抽样复制法构建基金的股票投资组合，实现基金投资目标。

2023 年开年国内经济复苏势头较好，进入二季度受欧美经济下行压力、海外需求下滑等不确定因素影响，叠加美国硅谷银行破产、瑞信事件对全球金融市场的冲击扰动，A 股主要宽基指数经历调整。下半年经济运行仍面临有效需求不足，居民消费和企业投资意愿不够强，部分行业产能过剩等问题，四季度叠加生产淡季和需求持续回落的影响，经济复苏节奏再遇波折，导致了市场情绪的波动。

2023 年股市整体承压，但也看到一些结构性机会，比如 2023 年上半年以人工智能、游戏为代表的主题投资机会，以及贯穿全年的高股息、高分红相关的红利投资机会，具体来看 2023 年通信、传媒、计算机、电子等相关指数仍收获正收益，美容护理、商贸零售、房地产、电力设备等相关指数表现靠后。

基金投资运作方面，报告期内，本基金在做好跟踪标的指数的基础上，认真应对投资者日常申

购、赎回和成份股调整等工作。

为促进本基金的市场流动性和平稳运行，经上海证券交易所同意，部分证券公司被确认为本基金的流动性服务商。目前，本基金的流动性服务商包括东海证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、国信证券股份有限公司等。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.0461 元，本报告期份额净值增长率为 4.61%，同期业绩比较基准增长率 1.25%。本基金本报告期跟踪偏离度为+3.36%，与业绩比较基准产生偏离的主要原因为基金尚处于建仓期，基金组合的结构与指数结构尚存在差异等产生的差异。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2024 年，当前 A 股整体估值已处在历史较低水平，从历史经验来看，指数估值越低，出现反弹的概率往往也就越大。从年度的周期维度看，国内经济复苏仍是影响股市表现的主要因素之一，随着宏观政策效力持续显现，一些经济指标已呈现边际改善迹象，相信在 2024 年经济基本面会有所改善，进而推动企业盈利的改善，为市场信心修复提供有力支撑。

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

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

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人持续加强合规管理、风险控制和监察稽核工作。

在合规管理方面，公司通过合规审核、合规检查、合规咨询、合规宣传与合规培训等对合规风险进行管理，确保公司合规体系高效运行，合规风险有效控制。报告期内，公司不断加强合规制度建设，结合法律法规和业务实际，在信息披露、洗钱风险管理、关联交易管理等方面新增和修订多项管理制度，制度化水平显著提高。持续开展合规培训，在全员覆盖的基础上，着重加强投资研究和基金销售等重点业务领域的合规督导培训，强化员工主动合规意识。积极优化合规管理的机制化和系统化，完善合规考核评价机制、子公司管理机制，大力推进合规管理综合服务、制度管理、知识搜索等系统化建设，提高合规管理效能。持续做好信息披露业务，通过流程优化、系统优化及强化培训持续保障信息披露的完整性、准确性、及时性。持续规范基金销售业务，通过严格审查宣传

推介材料,认真开展投资者适当性管理工作等,确保基金销售业务依法合规。公司高度重视洗钱风险管理,深入实践风险为本方法,认真贯彻落实各项反洗钱监管要求,持续加强“风险评估+合规检查”双支柱管理框架,深入推进洗钱风险管理数智化转型,持续提升洗钱风险管理水平。

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

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配,符合相关法规及基金合同的规定。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明:

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度,我行在履行托管职责

中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

## 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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

普华永道中天审字（2024）第 21433 号

华夏中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人：

## 6.1 审计意见

### （一）我们审计的内容

我们审计了华夏中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“华夏中证 2000ETF”)的财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年 9 月 6 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日止期间的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。

### （二）我们的意见

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了华夏中证 2000ETF 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年 9 月 6 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

## 6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。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。

按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于华夏中证 2000ETF，并履行了职业道德方面的其他责任。

### 6.3 管理层和治理层对财务报表的责任

华夏中证 2000ETF 的基金管理人华夏基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，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，基金管理人管理层负责评估华夏中证 2000ETF 的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算华夏中证 2000ETF、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督华夏中证 2000ETF 的财务报告过程。

### 6.4 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：

(一) 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。

(二) 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。

(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对华夏中证 2000ETF 持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致华夏中证 2000ETF 不能持续经营。

(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容, 并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通, 包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

中国注册会计师

朱宏宇 朱寅婷

上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼

2024 年 3 月 26 日

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体: 华夏中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日: 2023 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产:</b>		
货币资金	7.4.7.1	2,771,148.80
结算备付金		953,121.59
存出保证金		656,667.64
交易性金融资产	7.4.7.2	89,045,581.31
其中: 股票投资		89,040,580.94
基金投资		-
债券投资		5,000.37
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收清算款		698.68
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.5	-
资产总计		93,427,218.02



负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日
<b>负 债:</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		15,864.03
应付赎回款		-
应付管理人报酬		40,719.23
应付托管费		8,143.82
应付销售服务费		-
应付投资顾问费		-
应交税费		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.6	392,147.91
负债合计		456,874.99
<b>净 资 产:</b>		
实收基金	7.4.7.7	88,874,000.00
未分配利润	7.4.7.8	4,096,343.03
净资产合计		92,970,343.03
负债和净资产总计		93,427,218.02

注：①报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0461 元，基金份额总额 88,874,000.00 份。

②本基金合同于 2023 年 9 月 6 日生效，本报告期自 2023 年 9 月 6 日至 2023 年 12 月 31 日。

## 7.2 利润表

会计主体：华夏中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 9 月 6 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2023 年 9 月 6 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		4,337,436.07
1.利息收入		33,145.86
其中：存款利息收入	7.4.7.9	33,145.86
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-

2.投资收益（损失以“-”填列）		4,264,459.47
其中：股票投资收益	7.4.7.10	4,156,521.56
基金投资收益	7.4.7.11	-
债券投资收益	7.4.7.12	43,009.90
资产支持证券投资收益	7.4.7.13	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-95.02
股利收益	7.4.7.16	65,023.03
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	642,389.44
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-602,558.70
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>452,619.69</b>
1.管理人报酬		311,823.11
2.托管费		62,364.59
3.销售服务费		-
4.投资顾问费		-
5.利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6.信用减值损失	7.4.7.20	-
7.税金及附加		0.07
8.其他费用	7.4.7.21	78,431.92
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>3,884,816.38</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>3,884,816.38</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>3,884,816.38</b>

注：本基金合同于 2023 年 9 月 6 日生效，本报告期自 2023 年 9 月 6 日至 2023 年 12 月 31 日。

### 7.3 净资产变动表

会计主体：华夏中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 9 月 6 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 9 月 6 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-
二、本期期初净资产	310,874,000.00	-	310,874,000.00
三、本期增减变动额	-222,000,000.00	4,096,343.03	-217,903,656.97

(减少以“-”号填列)			
(一)、综合收益总额	-	3,884,816.38	3,884,816.38
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-222,000,000.00	211,526.65	-221,788,473.35
其中: 1.基金申购款	328,000,000.00	-2,584,426.56	325,415,573.44
2.基金赎回款	-550,000,000.00	2,795,953.21	-547,204,046.79
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	88,874,000.00	4,096,343.03	92,970,343.03

注: 本基金合同于 2023 年 9 月 6 日生效, 本报告期自 2023 年 9 月 6 日至 2023 年 12 月 31 日。报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4, 财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人: 张佑君, 主管会计工作负责人: 朱威, 会计机构负责人: 朱威

#### 7.4 报表附注

##### 7.4.1 基金基本情况

华夏中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)已获中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2023]1932 号文《关于准予华夏中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》, 由华夏基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《华夏中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规负责公开募集。本基金为交易型开放式, 存续期限为不定期。本基金于 2023 年 9 月 1 日共募集 310,874,000.00 元(不含认购资金利息), 业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2023)验字第 60739337\_A44 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华夏中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2023 年 9 月 6 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 310,874,000.00 份基金份额。本基金的基金管理人为华夏基金管理有限公司, 基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和本基金基金合同的有关规定, 本基金的标的指数为中证 2000 指数。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标, 基金还可投资于非成份股(含存托凭证、创业板及其他中国证监会注册或核准上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、金融

衍生品（包括股指期货、股票期权、国债期货）、资产支持证券、货币市场工具（含同业存单、债券回购等）、银行存款以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金可根据法律法规的规定参与融资、转融通证券出借业务。

基金的投资组合比例为：基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。本基金在每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本会计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或金融负债。

##### 1、金融资产分类

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

分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

#### (1) 债务工具

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

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

#### (2) 权益工具

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

### 2、金融负债的分类

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

### 3、衍生金融工具

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

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计

利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。

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

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

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

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

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

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

1、存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

2、当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

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

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

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

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/（累计亏损）。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。期末可供分配利润指期末资产负



债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率达到 1% 以上，方可进行收益分配。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

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

1、对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

2、对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》进行估值。

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

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 7.4.6 税项

根据财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103 号《关于股权分置

试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]125 号《财政部、国家税务总局、证监会关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《财政部、国家税务总局关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《财政部、国家税务总局关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于增值税征收范围，不征收增值税。

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

(3) 基金买卖股票、债券的差价收入免征增值税，暂不征收企业所得税。

(4) 存款利息收入不征收增值税。

(5) 国债、地方政府债利息收入，金融同业往来利息收入免征增值税。

(6) 对基金取得的债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

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

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

股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。对香港市场投资者取得的股息、红利收入按照 10% 的税率代扣所得税。

(9) 基金在境内卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

(11) 本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3%、2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	2,771,148.80
等于：本金	2,770,816.43
加：应计利息	332.37
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	2,771,148.80

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	88,305,831.50	-	89,040,580.94	734,749.44
贵金属投资- 金交所黄金	-	-	-	-

合约					
债券	交易所市场	5,000.00	0.37	5,000.37	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	5,000.00	0.37	5,000.37	-
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	88,310,831.50	0.37	89,045,581.31	734,749.44	

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款的估值增值。

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

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

##### 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IM2403	中证 1000 期货 IM2403 合约	3	3,507,960.00	-92,360.00
合计	-	-	-	-92,360.00
减：可抵销期货暂 收款	-	-	-	-92,360.00
净额				-

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

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.5 其他资产

无。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 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	217,686.00
其中：交易所市场	217,686.00
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	75,000.00
应退替代款	99,460.61
可退替代款	1.30
合计	392,147.91

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 9 月 6 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	310,874,000.00	310,874,000.00
本期申购	328,000,000.00	328,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-550,000,000.00	-550,000,000.00
本期末	88,874,000.00	88,874,000.00

注：本基金在募集期间共募集有效净认购资金 310,874,000.00 元，根据本基金招募说明书的规定，认购资金在募集期间产生的利息 27,978.66 元在本基金合同生效后折算为 0 份基金份额，计入基金份额持有人账户。

7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	3,242,426.94	642,389.44	3,884,816.38
本期基金份额交易产	582,370.22	-370,843.57	211,526.65

生的变动数			
其中：基金申购款	-2,322,520.34	-261,906.22	-2,584,426.56
基金赎回款	2,904,890.56	-108,937.35	2,795,953.21
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,824,797.16	271,545.87	4,096,343.03

#### 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 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	22,794.31
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	9,567.28
其他	784.27
合计	33,145.86

#### 7.4.7.10 股票投资收益

##### 7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 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	5,502,839.94
股票投资收益——赎回差价收入	-1,346,318.38
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	4,156,521.56

##### 7.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 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	512,134,839.60
减：卖出股票成本总额	505,768,583.97
减：交易费用	863,415.69
买卖股票差价收入	5,502,839.94

##### 7.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 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	547,204,046.79
减：现金支付赎回款总额	327,283,333.05
减：赎回股票成本总额	221,267,032.12
减：交易费用	-
赎回差价收入	-1,346,318.38

7.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.10.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

7.4.7.11 基金投资收益

无。

7.4.7.12 债券投资收益

7.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年9月6日（基金合同生效日）至2023年12月31日
债券投资收益——利息收入	17.41
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	42,992.49
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	43,009.90

7.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 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	182,517.36
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	139,500.00
减：应计利息总额	17.54
减：交易费用	7.33
买卖债券差价收入	42,992.49

7.4.7.13 资产支持证券投资收益

无。

7.4.7.14 贵金属投资收益

无。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年9月6日（基金合同生效日）至2023年12月31日
股指期货投资收益	-95.02

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

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

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 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	734,749.44
——股票投资	734,749.44
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-92,360.00
——权证投资	-
——期货投资	-92,360.00
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	642,389.44

7.4.7.18 其他收入



单位：人民币元

项目	本期
	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	-630,537.36
其他	27,978.66
合计	-602,558.70

#### 7.4.7.19 持有基金产生的费用

无。

#### 7.4.7.20 信用减值损失

无。

#### 7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023年9月6日（基金合同生效日）至2023年12月31日
审计费用	35,000.00
信息披露费	40,000.00
证券出借违约金	-
银行费用	3,031.92
其他	400.00
合计	78,431.92

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华夏基金管理有限公司	基金管理人
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人
中信证券股份有限公司（“中信证券”）	基金管理人的股东
天津海鹏科技咨询有限公司	基金管理人的股东
MACKENZIE FINANCIAL CORPORATION	基金管理人的股东
华夏中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金发起式	该基金是本基金的联接基金

联接基金（“华夏中证 2000ETF 发起式联接”）	
上海华夏财富投资管理有限公司（“华夏财富”）	基金管理人的子公司
华夏股权投资基金管理（北京）有限公司	基金管理人的子公司
China Asset Management (Hong Kong) Limited（中文名：华夏基金(香港)有限公司）	基金管理人的子公司
华夏资本管理有限公司（“华夏资本”）	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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
中信证券	188,565,549.67	15.84%

##### 7.4.10.1.2 权证交易

无。

##### 7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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
中信证券	168,235.13	92.17%

##### 7.4.10.1.4 债券回购交易

无。

##### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年9月6日（基金合同生效日）至2023年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
中信证券	84,084.71	15.84%	10,610.36	4.87%

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

##### 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
	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	311,823.11
应支付基金管理人的净管理费	311,823.11

注：①支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金管理人报酬计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×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
	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	62,364.59

注：①支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金托管费计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

无。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 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
华夏中证 2000ETF 发起式联接	17,330,000.00	19.50%
中信证券	4,617,898.00	5.20%

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

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 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
招商银行活期存款	2,771,148.80	22,794.31

注：本基金的活期银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率或约定利率计息。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

#### 7.4.12 期末（2023 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
301489	思泉新材	2023-10-16	6 个月	新发流通受限	41.66	64.11	115	4,790.90	7,372.65	-
301555	惠柏新材	2023-10-24	6 个月	新发流通受限	22.88	32.44	224	5,125.12	7,266.56	-
688648	中邮科技	2023-11-06	6 个月	新发流通受限	15.18	21.43	286	4,341.48	6,128.98	-

301516	中远通	2023-12-01	6 个月	新发流通受限	6.87	15.51	365	2,507.55	5,661.15	-
301508	中机认检	2023-11-23	6 个月	新发流通受限	16.82	26.68	151	2,539.82	4,028.68	-
301568	思泰克	2023-11-21	6 个月	新发流通受限	23.23	35.58	110	2,555.30	3,913.80	-
603273	天元智能	2023-10-16	6 个月	新发流通受限	9.50	18.97	178	1,691.00	3,376.66	-
301459	丰茂股份	2023-12-06	6 个月	新发流通受限	31.90	39.84	80	2,552.00	3,187.20	-
001306	夏厦精密	2023-11-09	6 个月	新发流通受限	53.63	75.36	33	1,769.79	2,486.88	-
001239	永达股份	2023-12-04	6 个月	新发流通受限	12.05	19.92	95	1,144.75	1,892.40	-
603062	麦加芯彩	2023-10-31	6 个月	新发流通受限	58.08	57.81	32	1,858.56	1,849.92	-

## 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：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
118046	诺泰转债	2023-12-15	6 个月内 (含)	新发流通受限	100.00	100.01	50	5,000.00	5,000.37	期末估值单价为含息价格

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

②基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份

自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

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

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

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300096	ST 易联众	2023-12-29	重大事项	6.82	2024-01-02	5.46	21,400	142,605.05	145,948.00	

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金管理人主要通过定性分析和定量分析的方法，估测各种金融工具风险可能产生的损失。本基金管理人从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重性；从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用的金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型和日常的量

化报告，参考压力测试结果，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时对各种风险进行监督、检查和评估，并制定相应决策，将风险控制在预期可承受的范围內。

#### 7.4.13.2 信用风险

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

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

#### 7.4.13.3 流动性风险

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

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

##### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

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

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

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

益的风险。

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

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	89,040,580.94	95.77
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	5,000.37	0.01
交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
其他	-	-
合计	89,045,581.31	95.78

注：①本表中交易性金融资产-债券投资科目仅包含可转换公司债券和可交换公司债券等。

②由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

##### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证 2000 指数以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2023 年 12 月 31 日
	-5%	-4,298,761.25
+5%	4,298,761.25	

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低



层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

#### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	88,847,468.06
第二层次	150,948.37
第三层次	47,164.88
合计	89,045,581.31

##### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

##### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

###### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 9 月 6 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	30,876.27	30,876.27
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	16,288.61	16,288.61
其中：计入损益的利得或损失	-	16,288.61	16,288.61
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-

(若有)			
期末余额	-	47,164.88	47,164.88
期末仍持有的第三层次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	-	16,288.61	16,288.61

## 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	47,164.88	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	0.5512-2.1988	负相关

## 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

截至 2023 年 12 月 31 日止，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

## 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

## 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §8 投资组合报告

## 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	89,040,580.94	95.30
	其中：股票	89,040,580.94	95.30
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,000.37	0.01
	其中：债券	5,000.37	0.01
	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	3,724,270.39	3.99
8	其他各项资产	657,366.32	0.70
9	合计	93,427,218.02	100.00

注：股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	477,732.13	0.51
B	采矿业	235,764.00	0.25
C	制造业	61,409,170.64	66.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,952,710.00	2.10
E	建筑业	1,722,643.00	1.85
F	批发和零售业	3,172,238.00	3.41
G	交通运输、仓储和邮政业	1,239,143.00	1.33
H	住宿和餐饮业	115,672.00	0.12
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,314,366.92	10.02
J	金融业	13,338.00	0.01
K	房地产业	2,211,126.00	2.38
L	租赁和商务服务业	1,068,716.00	1.15
M	科学研究和技术服务业	1,620,395.45	1.74
N	水利、环境和公共设施管理业	1,596,345.80	1.72
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	355,119.00	0.38
Q	卫生和社会工作	137,385.00	0.15
R	文化、体育和娱乐业	1,978,192.00	2.13
S	综合	419,383.00	0.45
	合计	89,039,439.94	95.77

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	603590	康辰药业	15,300	582,624.00	0.63
2	600576	祥源文旅	66,400	494,016.00	0.53
3	300708	聚灿光电	42,600	480,528.00	0.52
4	300566	激智科技	25,500	476,340.00	0.51
5	603758	秦安股份	38,100	435,864.00	0.47

6	600251	冠农股份	49,600	431,024.00	0.46
7	002393	力生制药	16,400	428,040.00	0.46
8	300161	华中数控	11,800	423,620.00	0.46
9	600866	星湖科技	89,000	414,740.00	0.45
10	002947	恒铭达	12,600	405,468.00	0.44
11	605266	健之佳	6,500	386,100.00	0.42
12	600757	长江传媒	48,300	359,835.00	0.39
13	603878	武进不锈	47,300	357,115.00	0.38
14	300867	圣元环保	22,200	354,090.00	0.38
15	603383	顶点软件	7,000	345,100.00	0.37
16	688003	天准科技	9,104	341,582.08	0.37
17	000589	贵州轮胎	55,600	340,272.00	0.37
18	000973	佛塑科技	68,600	335,454.00	0.36
19	601500	通用股份	80,800	334,512.00	0.36
20	002803	吉宏股份	16,100	331,016.00	0.36
21	300019	硅宝科技	19,800	326,898.00	0.35
22	688580	伟思医疗	5,071	324,189.03	0.35
23	688025	杰普特	3,494	323,369.70	0.35
24	300138	晨光生物	23,800	319,634.00	0.34
25	605377	华旺科技	16,700	318,803.00	0.34
26	002491	通鼎互联	60,500	317,020.00	0.34
27	000531	穗恒运 A	46,500	311,085.00	0.33
28	300389	艾比森	17,900	310,386.00	0.33
29	300066	三川智慧	60,700	306,535.00	0.33
30	002588	史丹利	48,000	306,240.00	0.33
31	000045	深纺织 A	25,700	303,260.00	0.33
32	002818	富森美	24,200	301,532.00	0.32
33	300706	阿石创	11,500	297,620.00	0.32
34	300872	天阳科技	21,400	292,752.00	0.31
35	002073	软控股份	44,500	292,365.00	0.31
36	300219	鸿利智汇	34,600	291,332.00	0.31
37	000852	石化机械	46,100	283,515.00	0.30
38	300426	唐德影视	25,700	283,471.00	0.30
39	603508	思维列控	17,700	277,890.00	0.30
40	600300	维维股份	89,200	277,412.00	0.30
41	300349	金卡智能	22,300	276,966.00	0.30
42	300870	欧陆通	6,200	274,474.00	0.30
43	300843	胜蓝股份	11,800	271,164.00	0.29
44	600301	华锡有色	21,500	270,470.00	0.29
45	300265	通光线缆	29,100	269,466.00	0.29
46	003028	振邦智能	6,100	268,766.00	0.29
47	688398	赛特新材	8,490	268,284.00	0.29
48	002327	富安娜	29,800	266,710.00	0.29
49	300468	四方精创	24,400	264,740.00	0.28

50	002452	长高电新	37,100	263,410.00	0.28
51	002376	新北洋	34,500	262,890.00	0.28
52	002170	芭田股份	47,200	261,960.00	0.28
53	600345	长江通信	13,500	261,495.00	0.28
54	300857	协创数据	4,900	259,651.00	0.28
55	300430	诚益通	18,100	258,649.00	0.28
56	002533	金杯电工	31,900	257,752.00	0.28
57	002282	博深股份	31,400	254,340.00	0.27
58	002154	报喜鸟	44,700	253,896.00	0.27
59	603258	电魂网络	11,000	252,780.00	0.27
60	601038	一拖股份	17,200	250,604.00	0.27
61	603377	东方时尚	59,500	250,495.00	0.27
62	300092	科新机电	18,800	250,416.00	0.27
63	002922	伊戈尔	16,800	249,480.00	0.27
64	603859	能科科技	6,600	249,018.00	0.27
65	002438	江苏神通	20,800	248,560.00	0.27
66	688589	力合微	6,129	244,608.39	0.26
67	002148	北纬科技	39,800	240,392.00	0.26
68	603611	诺力股份	12,600	238,518.00	0.26
68	688181	八亿时空	8,834	238,518.00	0.26
70	300779	惠城环保	4,600	237,360.00	0.26
71	002483	润邦股份	45,000	234,900.00	0.25
72	300829	金丹科技	11,200	233,856.00	0.25
73	603698	航天工程	16,200	232,794.00	0.25
74	300396	迪瑞医疗	7,900	232,655.00	0.25
75	000905	厦门港务	32,300	231,591.00	0.25
76	601388	怡球资源	87,600	229,512.00	0.25
77	603848	好太太	14,800	229,104.00	0.25
78	600084	中信尼雅	29,100	228,726.00	0.25
79	688080	映翰通	5,635	228,668.30	0.25
80	002419	天虹股份	41,300	228,389.00	0.25
81	600880	博瑞传播	45,100	225,951.00	0.24
82	002039	黔源电力	16,300	224,777.00	0.24
83	000949	新乡化纤	69,500	224,485.00	0.24
84	000533	顺钠股份	47,800	224,182.00	0.24
85	688078	龙软科技	5,538	223,292.16	0.24
86	000551	创元科技	21,300	223,011.00	0.24
87	300589	江龙船艇	15,977	221,760.76	0.24
88	688168	安博通	6,107	220,829.12	0.24
89	300415	伊之密	12,500	220,375.00	0.24
90	002016	世荣兆业	35,000	220,150.00	0.24
91	002613	北玻股份	44,800	219,968.00	0.24
92	600694	大商股份	13,000	219,570.00	0.24
93	300140	节能环境	29,400	216,678.00	0.23

94	300550	和仁科技	14,280	214,057.20	0.23
95	603886	元祖股份	11,700	213,291.00	0.23
96	600094	大名城	70,900	212,700.00	0.23
97	300909	汇创达	6,800	211,480.00	0.23
98	300922	天秦装备	12,300	209,961.00	0.23
99	002835	同为股份	11,700	209,898.00	0.23
100	002879	长缆科技	13,100	209,862.00	0.23
101	002877	智能自控	19,900	208,353.00	0.22
102	603078	江化微	13,000	208,260.00	0.22
103	300355	蒙草生态	55,200	207,000.00	0.22
104	000790	华神科技	40,900	206,954.00	0.22
105	603067	振华股份	20,300	206,857.00	0.22
106	300756	金马游乐	12,600	204,120.00	0.22
107	601579	会稽山	19,000	204,060.00	0.22
108	600756	浪潮软件	14,700	203,889.00	0.22
109	300543	朗科智能	18,500	202,020.00	0.22
110	300532	今天国际	12,300	201,966.00	0.22
111	600215	派斯林	23,600	201,544.00	0.22
112	002149	西部材料	12,800	201,216.00	0.22
113	300617	安靠智电	6,600	200,376.00	0.22
114	688569	铁科轨道	7,216	199,233.76	0.21
115	002628	成都路桥	60,000	198,000.00	0.21
116	002669	康达新材	16,600	197,872.00	0.21
117	300120	经纬辉开	27,200	197,472.00	0.21
118	002208	合肥城建	30,800	197,428.00	0.21
119	300221	银禧科技	32,900	197,400.00	0.21
120	002090	金智科技	19,600	195,608.00	0.21
121	002296	辉煌科技	23,700	195,525.00	0.21
122	600617	国新能源	50,600	195,316.00	0.21
123	002623	亚玛顿	7,300	195,275.00	0.21
124	300452	山河药辅	13,600	193,664.00	0.21
125	300193	佳士科技	24,900	193,473.00	0.21
126	688369	致远互联	5,579	193,089.19	0.21
127	600180	瑞茂通	31,700	193,053.00	0.21
128	300651	金陵体育	9,600	191,808.00	0.21
129	300046	台基股份	12,000	190,920.00	0.21
130	603897	长城科技	9,300	190,464.00	0.20
131	600237	铜峰电子	24,500	189,630.00	0.20
132	600939	重庆建工	57,800	189,584.00	0.20
133	300718	长盛轴承	10,200	189,210.00	0.20
134	688258	卓易信息	3,807	188,446.50	0.20
135	002529	海源复材	14,800	187,664.00	0.20
136	600512	腾达建设	75,400	186,992.00	0.20
137	300292	吴通控股	50,200	186,744.00	0.20

138	002980	华盛昌	6,800	186,320.00	0.20
139	300440	运达科技	25,000	186,250.00	0.20
140	300752	隆利科技	10,200	185,334.00	0.20
141	300884	狄耐克	14,000	183,120.00	0.20
142	000411	英特集团	16,300	182,723.00	0.20
143	300882	万胜智能	7,500	182,700.00	0.20
144	002035	华帝股份	29,100	180,711.00	0.19
145	603676	卫信康	17,300	180,439.00	0.19
146	300248	新开普	18,800	180,292.00	0.19
147	603757	大元泵业	7,400	179,376.00	0.19
148	603708	家家悦	13,700	179,059.00	0.19
149	300286	安科瑞	6,900	178,917.00	0.19
150	300227	光韵达	22,700	177,968.00	0.19
151	300712	永福股份	6,600	176,880.00	0.19
151	600855	航天长峰	16,500	176,880.00	0.19
153	002983	芯瑞达	5,700	175,902.00	0.19
154	002132	恒星科技	56,100	175,593.00	0.19
155	600665	天地源	46,300	175,014.00	0.19
156	000698	沈阳化工	41,400	174,708.00	0.19
157	002937	兴瑞科技	6,700	174,602.00	0.19
158	603602	纵横通信	11,800	173,932.00	0.19
159	000544	中原环保	25,000	173,500.00	0.19
160	002769	普路通	20,200	173,316.00	0.19
161	000920	沃顿科技	17,400	172,782.00	0.19
162	300314	戴维医疗	11,400	172,596.00	0.19
163	002578	闽发铝业	38,500	172,480.00	0.19
164	300441	鲍斯股份	25,000	172,250.00	0.19
165	603931	格林达	6,700	171,453.00	0.18
166	000751	锌业股份	52,700	171,275.00	0.18
167	603303	得邦照明	13,200	169,620.00	0.18
168	300005	探路者	25,600	169,472.00	0.18
169	002949	华阳国际	12,100	169,037.00	0.18
170	002570	贝因美	42,700	168,665.00	0.18
171	603689	皖天然气	19,400	168,586.00	0.18
172	603809	豪能股份	14,200	168,270.00	0.18
173	600033	福建高速	54,200	168,020.00	0.18
174	603333	尚纬股份	29,400	167,874.00	0.18
175	002449	国星光电	17,700	167,619.00	0.18
176	300559	佳发教育	10,800	167,400.00	0.18
177	300719	安达维尔	12,500	166,625.00	0.18
178	300365	恒华科技	24,600	166,296.00	0.18
179	002474	榕基软件	25,200	165,816.00	0.18
180	603109	神驰机电	10,000	164,200.00	0.18
181	300412	迦南科技	28,800	163,872.00	0.18

182	603096	新经典	8,300	163,344.00	0.18
183	601956	东贝集团	27,300	162,981.00	0.18
184	002104	恒宝股份	21,200	162,816.00	0.18
185	000534	万泽股份	12,400	162,316.00	0.17
186	603421	鼎信通讯	17,200	161,680.00	0.17
187	002870	香山股份	4,500	161,415.00	0.17
188	688365	光云科技	14,732	160,431.48	0.17
189	002303	美盈森	45,600	160,056.00	0.17
190	600495	晋西车轴	37,300	159,644.00	0.17
191	002919	名臣健康	6,200	158,968.00	0.17
192	600819	耀皮玻璃	31,200	158,808.00	0.17
193	000055	方大集团	35,000	158,200.00	0.17
194	300540	蜀道装备	6,400	157,760.00	0.17
195	000880	潍柴重机	14,700	156,261.00	0.17
196	688058	宝兰德	3,288	155,226.48	0.17
197	002730	电光科技	16,300	154,524.00	0.17
198	600162	香江控股	88,800	154,512.00	0.17
199	300205	天喻信息	14,200	154,212.00	0.17
200	300619	金银河	2,768	154,039.20	0.17
201	603232	格尔软件	11,200	153,328.00	0.16
202	002616	长青集团	29,200	153,300.00	0.16
203	300490	华自科技	13,200	153,252.00	0.16
204	300345	华民股份	19,900	153,230.00	0.16
205	000823	超声电子	16,000	153,120.00	0.16
206	688020	方邦股份	3,155	152,954.40	0.16
207	300061	旗天科技	26,100	152,946.00	0.16
208	300908	仲景食品	3,700	152,699.00	0.16
209	300228	富瑞特装	21,400	151,940.00	0.16
210	002133	广宇集团	43,400	151,466.00	0.16
211	688157	松井股份	2,796	150,816.24	0.16
212	002689	远大智能	33,600	149,520.00	0.16
213	600429	三元股份	33,400	148,964.00	0.16
214	300590	移为通信	12,400	148,924.00	0.16
215	000910	大亚圣象	18,600	148,800.00	0.16
216	002264	新华都	27,000	148,770.00	0.16
217	600379	宝光股份	14,800	148,740.00	0.16
218	603339	四方科技	12,500	148,625.00	0.16
219	600558	大西洋	36,500	148,555.00	0.16
220	600831	广电网络	28,300	148,292.00	0.16
221	300605	恒锋信息	9,900	148,203.00	0.16
222	603949	雪龙集团	7,900	147,967.00	0.16
223	002650	加加食品	36,000	146,880.00	0.16
224	300328	宜安科技	21,100	146,856.00	0.16
225	300096	ST 易联众	21,400	145,948.00	0.16



226	600054	黄山旅游	13,400	145,792.00	0.16
227	300791	仙乐健康	4,200	145,572.00	0.16
228	688095	福昕软件	2,080	145,288.00	0.16
229	000931	中关村	24,700	144,989.00	0.16
230	300239	东宝生物	23,200	144,536.00	0.16
231	600479	千金药业	13,300	143,241.00	0.15
232	300501	海顺新材	9,900	142,857.00	0.15
233	002140	东华科技	16,800	142,800.00	0.15
234	688051	佳华科技	4,278	142,671.30	0.15
235	688588	凌志软件	11,977	142,526.30	0.15
236	002823	凯中精密	11,200	142,240.00	0.15
237	300020	银江技术	17,000	141,100.00	0.15
238	603507	振江股份	5,400	139,914.00	0.15
239	688089	嘉必优	7,814	139,870.60	0.15
240	600551	时代出版	12,700	138,303.00	0.15
241	603960	克来机电	9,300	138,291.00	0.15
242	002342	巨力索具	32,000	137,920.00	0.15
243	002817	黄山胶囊	15,700	137,532.00	0.15
244	002524	光正眼科	21,300	137,385.00	0.15
245	600351	亚宝药业	19,900	137,310.00	0.15
246	002638	勤上股份	50,300	136,313.00	0.15
247	600609	金杯汽车	27,900	135,594.00	0.15
248	688138	清溢光电	5,954	134,679.48	0.14
249	300353	东土科技	13,900	134,552.00	0.14
250	000965	天保基建	42,900	134,277.00	0.14
251	000404	长虹华意	22,700	133,703.00	0.14
252	300439	美康生物	11,500	133,515.00	0.14
253	603040	新坐标	5,100	133,365.00	0.14
254	300508	维宏股份	4,700	133,010.00	0.14
255	688488	艾迪药业	10,616	132,806.16	0.14
256	000561	烽火电子	15,800	132,720.00	0.14
257	600594	益佰制药	23,300	132,577.00	0.14
258	603035	常熟汽饰	7,000	132,090.00	0.14
259	688136	科兴制药	6,437	130,349.25	0.14
260	002829	星网宇达	4,800	129,792.00	0.14
261	002442	龙星化工	18,800	129,156.00	0.14
262	603076	乐惠国际	4,800	128,640.00	0.14
263	000042	中洲控股	22,400	128,576.00	0.14
264	688519	南亚新材	4,966	127,924.16	0.14
265	688579	山大地纬	10,064	127,812.80	0.14
266	300453	三鑫医疗	16,700	127,421.00	0.14
267	300149	睿智医药	16,600	126,990.00	0.14
268	002972	科安达	9,800	126,714.00	0.14
269	603917	合力科技	7,100	126,096.00	0.14

270	000548	湖南投资	23,100	125,895.00	0.14
271	300436	广生堂	4,900	125,587.00	0.14
272	002297	博云新材	15,700	125,129.00	0.13
273	600212	绿能慧充	17,400	124,932.00	0.13
274	600664	哈药股份	37,200	124,620.00	0.13
275	002662	京威股份	35,100	123,201.00	0.13
276	603227	雪峰科技	17,800	122,820.00	0.13
277	603990	麦迪科技	9,500	122,740.00	0.13
278	600653	申华控股	66,300	122,655.00	0.13
279	603901	永创智能	10,300	122,570.00	0.13
280	002687	乔治白	22,900	122,057.00	0.13
281	002551	尚荣医疗	29,800	120,988.00	0.13
282	002627	三峡旅游	22,600	120,684.00	0.13
283	688108	赛诺医疗	9,610	120,605.50	0.13
284	300698	万马科技	3,300	120,450.00	0.13
285	000850	华茂股份	31,600	120,396.00	0.13
286	000715	中兴商业	16,400	119,884.00	0.13
287	300673	佩蒂股份	9,000	119,700.00	0.13
288	002679	福建金森	9,700	119,601.00	0.13
289	300131	英唐智控	19,900	119,599.00	0.13
290	300306	远方信息	9,900	119,592.00	0.13
291	002386	天原股份	23,100	119,196.00	0.13
292	002111	威海广泰	13,100	118,686.00	0.13
293	603811	诚意药业	11,400	118,218.00	0.13
294	600858	银座股份	22,200	118,104.00	0.13
295	002454	松芝股份	15,700	117,907.00	0.13
296	600114	东睦股份	7,600	117,724.00	0.13
297	002270	华明装备	8,300	117,196.00	0.13
298	600505	西昌电力	13,800	117,162.00	0.13
299	600368	五洲交通	29,600	116,920.00	0.13
300	300384	三联虹普	7,300	116,508.00	0.13
301	300447	全信股份	8,000	116,000.00	0.12
302	603618	杭电股份	18,100	115,840.00	0.12
303	605108	同庆楼	3,800	115,672.00	0.12
304	300053	航宇微	9,400	114,962.00	0.12
305	603817	海峡环保	18,000	114,840.00	0.12
306	002160	常铝股份	27,400	114,806.00	0.12
307	600758	辽宁能源	31,700	114,754.00	0.12
308	603358	华达科技	4,900	114,562.00	0.12
309	300515	三德科技	9,900	114,246.00	0.12
310	300853	申昊科技	4,200	114,240.00	0.12
311	300771	智莱科技	10,500	114,135.00	0.12
312	002059	云南旅游	20,300	113,477.00	0.12
313	002900	哈三联	8,300	113,295.00	0.12

314	300391	长药控股	14,600	113,004.00	0.12
315	605088	冠盛股份	4,900	112,700.00	0.12
316	300766	每日互动	7,300	112,639.00	0.12
317	000888	峨眉山 A	12,600	112,518.00	0.12
318	002543	万和电气	12,600	112,392.00	0.12
319	002873	新天药业	9,000	112,140.00	0.12
320	002479	富春环保	23,500	112,095.00	0.12
321	300099	尤洛卡	18,000	111,420.00	0.12
322	002553	南方精工	9,100	111,020.00	0.12
323	688386	泛亚微透	2,699	110,119.20	0.12
324	603017	中衡设计	11,000	110,110.00	0.12
325	000948	南天信息	7,300	110,011.00	0.12
326	600969	郴电国际	16,900	109,850.00	0.12
327	300344	立方数科	19,300	109,817.00	0.12
328	002075	沙钢股份	28,700	109,634.00	0.12
329	600624	复旦复华	19,200	109,632.00	0.12
330	002014	永新股份	13,100	109,385.00	0.12
331	002546	新联电子	21,800	109,000.00	0.12
332	002377	国创高新	43,000	108,790.00	0.12
333	600798	宁波海运	29,700	108,702.00	0.12
334	603138	海量数据	6,100	108,580.00	0.12
335	603822	嘉澳环保	3,900	108,459.00	0.12
336	300616	尚品宅配	6,000	107,520.00	0.12
337	002663	普邦股份	59,200	107,152.00	0.12
338	300217	东方电热	19,900	107,062.00	0.12
339	300711	广哈通信	8,000	106,800.00	0.11
340	603639	海利尔	6,800	106,760.00	0.11
341	688357	建龙微纳	2,054	106,171.26	0.11
342	600278	东方创业	15,200	106,096.00	0.11
343	600371	万向德农	9,801	105,164.73	0.11
344	688788	科思科技	2,710	104,822.80	0.11
345	600226	瀚叶股份	40,100	104,661.00	0.11
346	002622	皓宸医疗	32,000	104,640.00	0.11
347	002165	红宝丽	24,700	104,481.00	0.11
348	002540	亚太科技	15,800	104,438.00	0.11
349	600461	洪城环境	11,400	104,196.00	0.11
350	300211	亿通科技	10,300	104,133.00	0.11
351	002598	山东章鼓	10,000	104,000.00	0.11
352	002827	高争民爆	6,200	103,850.00	0.11
353	002666	德联集团	19,200	103,680.00	0.11
354	688077	大地熊	4,344	103,604.40	0.11
355	002196	方正电机	14,400	103,392.00	0.11
356	002306	中科云网	17,700	103,191.00	0.11
357	300758	七彩化学	10,200	103,122.00	0.11

358	300399	天利科技	7,400	102,416.00	0.11
359	603823	百合花	10,400	102,336.00	0.11
360	300289	利德曼	16,600	102,090.00	0.11
361	300062	中能电气	16,300	101,549.00	0.11
362	300523	辰安科技	5,000	101,500.00	0.11
363	002360	同德化工	13,900	101,470.00	0.11
364	000607	华媒控股	22,100	101,218.00	0.11
365	002448	中原内配	15,200	100,928.00	0.11
366	688279	峰岬科技	800	100,896.00	0.11
367	002394	联发股份	12,100	100,551.00	0.11
368	300852	四会富仕	2,600	100,204.00	0.11
369	300705	九典制药	3,000	99,690.00	0.11
370	300848	美瑞新材	5,185	99,189.05	0.11
371	002923	润都股份	8,000	98,720.00	0.11
372	688221	前沿生物	9,949	98,694.08	0.11
373	300280	紫天科技	2,300	98,279.00	0.11
374	002225	濮耐股份	25,800	97,524.00	0.10
375	300516	久之洋	2,900	97,034.00	0.10
376	002106	莱宝高科	9,100	96,824.00	0.10
377	688299	长阳科技	6,937	96,771.15	0.10
378	002284	亚太股份	11,000	96,470.00	0.10
379	600525	长园集团	18,000	96,300.00	0.10
380	300258	精锻科技	7,400	95,608.00	0.10
381	603889	新澳股份	13,400	95,408.00	0.10
382	002909	集泰股份	12,400	94,612.00	0.10
383	300110	华仁药业	22,300	94,106.00	0.10
384	300467	迅游科技	5,400	93,852.00	0.10
385	002863	今飞凯达	15,100	93,771.00	0.10
386	002492	恒基达鑫	15,600	93,444.00	0.10
387	002022	科华生物	8,200	93,316.00	0.10
388	002057	中钢天源	11,600	93,264.00	0.10
389	688212	澳华内镜	1,500	93,045.00	0.10
390	300082	奥克股份	13,300	92,701.00	0.10
391	600742	一汽富维	9,700	92,635.00	0.10
392	603012	创力集团	15,600	92,196.00	0.10
393	688076	诺泰生物	2,046	91,967.70	0.10
394	600693	东百集团	22,800	91,428.00	0.10
395	600268	国电南自	13,100	91,307.00	0.10
396	605066	天正电气	9,900	90,882.00	0.10
397	603367	辰欣药业	6,100	89,304.00	0.10
398	002614	奥佳华	11,900	89,250.00	0.10
399	600774	汉商集团	9,000	88,740.00	0.10
400	002102	冠福股份	32,700	88,617.00	0.10
401	002047	宝鹰股份	30,600	88,434.00	0.10

402	000717	中南股份	34,800	88,392.00	0.10
403	688766	普冉股份	900	88,182.00	0.09
404	002644	佛慈制药	9,000	87,750.00	0.09
405	002301	齐心集团	12,300	87,453.00	0.09
406	300465	高伟达	8,700	86,913.00	0.09
407	300700	岱勒新材	5,100	86,547.00	0.09
408	300642	透景生命	4,900	86,485.00	0.09
409	002971	和远气体	3,100	85,932.00	0.09
410	600854	春兰股份	16,300	85,901.00	0.09
411	603966	法兰泰克	10,500	85,890.00	0.09
412	300585	奥联电子	5,100	85,476.00	0.09
413	300615	欣天科技	5,400	85,374.00	0.09
414	300402	宝色股份	4,300	85,312.00	0.09
415	002722	物产金轮	5,500	84,755.00	0.09
416	301096	百诚医药	1,300	84,630.00	0.09
417	300610	晨化股份	7,500	84,525.00	0.09
418	000753	漳州发展	20,100	84,420.00	0.09
419	002164	宁波东力	12,500	84,375.00	0.09
420	600469	风神股份	13,600	83,912.00	0.09
421	300469	信息发展	5,700	83,904.00	0.09
422	002462	嘉事堂	5,900	83,839.00	0.09
423	600067	冠城大通	33,300	83,583.00	0.09
424	300491	通合科技	3,700	82,436.00	0.09
425	002437	誉衡药业	32,800	82,328.00	0.09
426	300195	长荣股份	12,100	82,280.00	0.09
427	603018	华设集团	10,800	82,080.00	0.09
428	300513	恒实科技	6,900	81,972.00	0.09
429	000530	冰山冷热	15,200	81,168.00	0.09
430	300632	光莆股份	6,400	80,768.00	0.09
431	603319	湘油泵	4,600	80,684.00	0.09
432	600992	贵绳股份	5,000	80,500.00	0.09
433	002037	保利联合	9,300	80,073.00	0.09
434	300903	科翔股份	7,900	79,474.00	0.09
435	600230	沧州大化	5,900	79,473.00	0.09
436	300686	智动力	7,500	79,350.00	0.09
437	002735	王子新材	6,100	79,300.00	0.09
438	603655	朗博科技	3,800	79,116.00	0.09
439	600892	大晟文化	13,000	79,040.00	0.09
440	300381	溢多利	10,700	78,859.00	0.08
441	002639	雪人股份	10,500	78,750.00	0.08
442	603610	麒盛科技	6,600	78,672.00	0.08
443	300488	恒锋工具	3,200	78,656.00	0.08
444	300245	天玑科技	8,900	78,498.00	0.08
445	300472	新元科技	8,300	78,352.00	0.08

446	300246	宝莱特	7,600	78,280.00	0.08
447	000788	北大医药	11,600	77,836.00	0.08
448	603088	宁波精达	9,000	77,580.00	0.08
449	600198	大唐电信	11,800	77,526.00	0.08
450	002146	荣盛发展	45,300	77,463.00	0.08
451	605599	菜百股份	5,200	77,428.00	0.08
452	601086	国芳集团	14,700	77,322.00	0.08
453	601339	百隆东方	15,800	76,946.00	0.08
454	603313	梦百合	7,300	76,650.00	0.08
455	688305	科德数控	1,000	76,450.00	0.08
456	002469	三维化学	12,600	76,356.00	0.08
457	600789	鲁抗医药	10,600	75,684.00	0.08
458	688609	九联科技	5,700	75,240.00	0.08
459	300414	中光防雷	7,800	75,114.00	0.08
460	300680	隆盛科技	4,000	74,800.00	0.08
461	300448	浩云科技	13,900	74,782.00	0.08
462	605289	罗曼股份	1,300	74,750.00	0.08
463	002878	元隆雅图	4,000	74,440.00	0.08
464	603165	荣晟环保	6,200	74,276.00	0.08
465	603516	淳中科技	3,300	74,151.00	0.08
466	002339	积成电子	10,200	74,052.00	0.08
467	300787	海能实业	4,400	74,008.00	0.08
468	688677	海泰新光	1,390	73,989.70	0.08
469	000036	华联控股	19,000	73,910.00	0.08
470	000803	山高环能	12,700	73,787.00	0.08
471	300916	朗特智能	3,000	73,320.00	0.08
472	000514	渝开发	17,500	72,975.00	0.08
473	601199	江南水务	14,700	72,912.00	0.08
474	002107	沃华医药	12,000	72,840.00	0.08
475	002094	青岛金王	19,200	72,768.00	0.08
476	000777	中核科技	5,000	72,700.00	0.08
477	603283	赛腾股份	1,000	72,560.00	0.08
478	002930	宏川智慧	3,700	71,743.00	0.08
479	300520	科大国创	3,300	71,742.00	0.08
480	300518	新讯达	4,200	71,736.00	0.08
481	688199	久日新材	2,648	71,575.44	0.08
482	600620	天宸股份	7,600	71,440.00	0.08
483	603628	清源股份	3,400	71,400.00	0.08
484	688135	利扬芯片	3,178	70,901.18	0.08
485	300326	凯利泰	11,200	70,896.00	0.08
486	300304	云意电气	10,400	70,616.00	0.08
487	603701	德宏股份	4,500	70,605.00	0.08
488	600749	西藏旅游	6,000	70,560.00	0.08
489	000159	国际实业	10,800	70,092.00	0.08

490	002083	孚日股份	13,900	70,056.00	0.08
491	002066	瑞泰科技	6,300	69,993.00	0.08
492	002315	焦点科技	2,100	69,573.00	0.07
493	300473	德尔股份	3,800	69,464.00	0.07
494	300145	中金环境	23,000	69,460.00	0.07
495	600605	汇通能源	2,500	69,425.00	0.07
496	300071	福石控股	20,000	69,200.00	0.07
497	688359	三孚新科	1,000	68,890.00	0.07
498	300732	设研院	7,800	68,874.00	0.07
499	000819	岳阳兴长	3,800	68,704.00	0.07
500	002298	中电兴发	11,900	68,544.00	0.07
501	000635	英力特	7,600	68,172.00	0.07
502	000816	智慧农业	22,500	67,950.00	0.07
503	300815	玉禾田	4,600	67,160.00	0.07
504	002871	伟隆股份	6,000	67,080.00	0.07
505	688687	凯因科技	1,921	66,966.06	0.07
506	300592	华凯易佰	2,700	66,879.00	0.07
507	603648	畅联股份	6,800	66,368.00	0.07
508	603518	锦泓集团	6,600	66,132.00	0.07
509	600035	楚天高速	17,300	66,086.00	0.07
510	600359	新农开发	8,900	65,949.00	0.07
511	002969	嘉美包装	16,000	65,920.00	0.07
512	002515	金字火腿	11,600	65,424.00	0.07
513	003016	欣贺股份	8,000	65,360.00	0.07
514	301263	泰恩康	4,000	65,320.00	0.07
515	002982	湘佳股份	3,040	64,782.40	0.07
516	002733	雄韬股份	4,300	64,672.00	0.07
517	002996	顺博合金	5,900	64,428.00	0.07
518	688277	天智航	4,887	64,410.66	0.07
519	300817	双飞集团	3,800	64,334.00	0.07
520	002731	萃华珠宝	5,800	64,148.00	0.07
521	603755	日辰股份	2,400	63,792.00	0.07
522	300622	博士眼镜	3,200	63,456.00	0.07
523	688382	益方生物	4,191	63,451.74	0.07
524	300279	和晶科技	9,800	63,406.00	0.07
525	600533	栖霞建设	21,600	63,288.00	0.07
526	000952	广济药业	7,900	63,121.00	0.07
527	600020	中原高速	17,000	62,560.00	0.07
528	300636	同和药业	5,900	62,186.00	0.07
529	603937	丽岛新材	4,900	62,083.00	0.07
530	601595	上海电影	2,400	61,992.00	0.07
531	300514	友讯达	3,800	61,940.00	0.07
532	300681	英搏尔	3,200	61,664.00	0.07
533	002790	瑞尔特	5,900	61,596.00	0.07

534	605598	上海港湾	2,300	61,548.00	0.07
535	002288	超华科技	14,100	61,476.00	0.07
536	002116	中国海诚	5,900	60,711.00	0.07
537	688150	莱特光电	2,798	60,408.82	0.06
538	002197	证通电子	5,800	60,262.00	0.06
539	002788	鹭燕医药	6,700	60,233.00	0.06
540	003000	劲仔食品	4,900	59,878.00	0.06
541	002431	棕榈股份	23,400	59,436.00	0.06
542	688222	成都先导	3,923	58,805.77	0.06
543	688035	德邦科技	1,100	58,696.00	0.06
544	002860	星帅尔	4,500	58,275.00	0.06
545	688553	汇宇制药	3,819	57,781.47	0.06
546	688319	欧林生物	3,634	57,417.20	0.06
547	002554	惠博普	18,200	56,966.00	0.06
548	300546	雄帝科技	3,600	56,772.00	0.06
549	002443	金洲管道	8,200	56,170.00	0.06
550	603085	天成自控	5,500	56,100.00	0.06
551	300710	万隆光电	2,300	55,936.00	0.06
552	002117	东港股份	6,500	55,575.00	0.06
553	688269	凯立新材	1,500	55,515.00	0.06
554	688308	欧科亿	1,981	55,269.90	0.06
555	603617	君禾股份	6,000	55,200.00	0.06
556	600540	新赛股份	11,300	55,144.00	0.06
557	603959	百利科技	6,200	55,118.00	0.06
558	300117	嘉寓股份	19,000	55,100.00	0.06
559	002845	同兴达	3,100	55,025.00	0.06
560	688678	福立旺	2,954	54,383.14	0.06
561	002412	汉森制药	8,000	54,240.00	0.06
562	300176	派生科技	7,900	53,404.00	0.06
563	002997	瑞鹄模具	1,600	53,312.00	0.06
564	002589	瑞康医药	16,300	53,301.00	0.06
565	600686	金龙汽车	7,000	52,990.00	0.06
566	300125	聆达股份	4,200	52,962.00	0.06
567	688636	智明达	810	52,812.00	0.06
568	001215	千味央厨	1,000	52,810.00	0.06
569	688332	中科蓝讯	700	52,794.00	0.06
569	300926	博俊科技	1,800	52,794.00	0.06
571	605368	蓝天燃气	4,900	52,773.00	0.06
572	002752	昇兴股份	10,100	52,318.00	0.06
573	300425	中建环能	11,100	51,948.00	0.06
574	300160	秀强股份	8,800	51,920.00	0.06
575	600644	乐山电力	7,400	51,504.00	0.06
576	002661	克明食品	5,400	51,462.00	0.06
577	001267	汇绿生态	9,800	51,254.00	0.06



578	600523	贵航股份	3,700	50,949.00	0.05
579	002621	美吉姆	16,200	50,868.00	0.05
580	002334	英威腾	5,800	50,634.00	0.05
581	301091	深城交	2,200	50,490.00	0.05
582	300928	华安鑫创	1,000	50,440.00	0.05
583	301101	明月镜片	1,200	50,232.00	0.05
584	688566	吉贝尔	1,593	50,004.27	0.05
585	002940	昂利康	2,300	49,933.00	0.05
586	002887	绿茵生态	5,700	49,476.00	0.05
587	603999	读者传媒	7,200	49,464.00	0.05
588	002033	丽江股份	6,100	49,349.00	0.05
589	688148	芳源股份	6,400	49,088.00	0.05
590	301215	中汽股份	7,900	48,743.00	0.05
591	600080	金花股份	6,500	48,425.00	0.05
592	603181	皇马科技	4,400	48,092.00	0.05
593	002198	嘉应制药	6,600	48,048.00	0.05
594	603136	天目湖	2,600	47,762.00	0.05
595	603359	东珠生态	6,200	47,616.00	0.05
596	300839	博汇股份	4,600	47,058.00	0.05
597	002630	华西能源	18,700	46,376.00	0.05
598	002975	博杰股份	1,200	45,840.00	0.05
599	603239	浙江仙通	3,000	45,810.00	0.05
600	300350	华鹏飞	8,900	45,657.00	0.05
601	603778	国晟科技	8,200	45,592.00	0.05
602	603058	永吉股份	5,000	45,350.00	0.05
603	300978	东箭科技	3,300	45,309.00	0.05
604	300925	法本信息	3,800	44,650.00	0.05
605	002346	柘中股份	4,000	44,600.00	0.05
606	002732	燕塘乳业	2,300	44,160.00	0.05
607	002213	大为股份	3,100	43,617.00	0.05
608	688087	英科再生	1,810	43,584.80	0.05
609	000037	深南电 A	5,300	43,566.00	0.05
610	002486	嘉麟杰	14,900	43,508.00	0.05
611	300018	中元股份	7,100	43,381.00	0.05
612	600293	三峡新材	11,900	43,316.00	0.05
613	603969	银龙股份	7,200	43,200.00	0.05
614	300335	迪森股份	7,700	43,120.00	0.05
615	603050	科林电气	2,400	43,080.00	0.05
616	002905	金逸影视	3,900	42,744.00	0.05
617	300437	清水源	3,400	42,738.00	0.05
618	000705	浙江震元	3,900	42,471.00	0.05
619	000797	中国武夷	14,200	42,458.00	0.05
620	600802	福建水泥	8,000	41,440.00	0.04
621	600790	轻纺城	10,400	41,288.00	0.04

622	603028	赛福天	3,700	41,255.00	0.04
623	300578	会畅通讯	2,300	41,078.00	0.04
624	301206	三元生物	1,400	40,432.00	0.04
625	002365	永安药业	4,100	40,098.00	0.04
626	688468	科美诊断	3,699	39,912.21	0.04
627	002290	禾盛新材	3,000	39,030.00	0.04
628	688377	迪威尔	1,455	39,023.10	0.04
629	603177	德创环保	3,300	39,006.00	0.04
630	601065	江盐集团	3,400	38,896.00	0.04
631	600207	安彩高科	8,100	38,637.00	0.04
632	600269	赣粤高速	9,400	38,634.00	0.04
633	002095	生意宝	1,900	38,513.00	0.04
634	605388	均瑶健康	3,000	37,620.00	0.04
635	688533	上声电子	980	37,357.60	0.04
636	601133	柏诚股份	2,800	36,876.00	0.04
637	301136	招标股份	2,900	36,685.00	0.04
638	300424	航新科技	2,800	36,680.00	0.04
639	300895	铜牛信息	1,100	36,366.00	0.04
640	688236	春立医疗	1,380	36,294.00	0.04
641	603887	城地香江	4,500	36,180.00	0.04
642	605116	奥锐特	1,400	36,148.00	0.04
643	605133	嵘泰股份	1,300	35,971.00	0.04
644	002695	煌上煌	3,400	35,598.00	0.04
645	300561	汇金科技	3,000	35,400.00	0.04
646	300649	杭州园林	2,100	35,175.00	0.04
647	300631	久吾高科	1,200	35,004.00	0.04
648	605128	上海沿浦	600	34,830.00	0.04
649	301488	豪恩汽电	500	34,820.00	0.04
650	688119	中钢洛耐	7,114	34,716.32	0.04
651	002571	德力股份	5,200	34,684.00	0.04
652	000713	丰乐种业	4,500	34,515.00	0.04
653	000505	京粮控股	5,000	34,200.00	0.04
654	300918	南山智尚	3,300	34,089.00	0.04
655	300238	冠昊生物	2,500	33,900.00	0.04
656	301058	中粮科工	3,100	33,883.00	0.04
657	603950	长源东谷	2,200	33,880.00	0.04
658	600353	旭光电子	3,700	33,818.00	0.04
659	002970	锐明技术	1,100	33,671.00	0.04
660	603908	牧高笛	900	33,489.00	0.04
661	688682	霍莱沃	700	33,397.00	0.04
662	300740	水羊股份	2,000	33,340.00	0.04
663	300871	回盛生物	2,300	33,258.00	0.04
664	688293	奥浦迈	600	33,102.00	0.04
665	002933	新兴装备	900	32,805.00	0.04

666	002062	宏润建设	7,400	32,782.00	0.04
667	002801	微光股份	1,500	32,625.00	0.04
668	600785	新华百货	2,200	32,560.00	0.04
669	002398	垒知集团	6,800	32,436.00	0.03
670	688558	国盛智科	1,139	32,347.60	0.03
671	300898	熊猫乳品	1,300	31,408.00	0.03
672	002636	金安国纪	3,500	31,185.00	0.03
673	688156	路德环境	1,290	30,985.80	0.03
674	688373	盟科药业	4,731	30,893.43	0.03
675	301345	涛涛车业	500	30,450.00	0.03
676	300489	光智科技	1,500	30,360.00	0.03
677	301393	昊帆生物	500	30,005.00	0.03
678	605319	无锡振华	1,300	29,926.00	0.03
679	603009	北特科技	2,000	29,660.00	0.03
680	002707	众信旅游	4,100	29,274.00	0.03
681	301310	鑫宏业	600	29,190.00	0.03
682	300667	必创科技	1,700	29,172.00	0.03
683	002795	永和智控	3,900	29,133.00	0.03
684	600735	新华锦	4,500	29,025.00	0.03
685	000897	津滨发展	13,400	28,944.00	0.03
686	300721	怡达股份	1,900	28,367.00	0.03
687	601121	宝地矿业	4,000	28,240.00	0.03
688	300842	帝科股份	400	28,220.00	0.03
689	603558	健盛集团	2,900	28,101.00	0.03
690	300317	珈伟新能	5,500	27,995.00	0.03
691	000886	海南高速	6,700	27,470.00	0.03
692	603081	大丰实业	2,000	27,240.00	0.03
693	603681	永冠新材	1,800	27,180.00	0.03
694	301297	富乐德	1,000	26,960.00	0.03
695	601588	北辰实业	14,000	26,600.00	0.03
696	601518	吉林高速	10,400	26,520.00	0.03
697	600640	国脉文化	2,300	26,381.00	0.03
698	002852	道道全	2,400	25,968.00	0.03
699	603176	汇通集团	4,200	25,956.00	0.03
700	300951	博硕科技	400	25,912.00	0.03
701	002686	亿利达	3,800	25,726.00	0.03
702	300100	双林股份	2,400	25,032.00	0.03
703	301322	绿通科技	600	24,696.00	0.03
704	002956	西麦食品	1,700	24,361.00	0.03
705	600668	尖峰集团	2,200	24,310.00	0.03
706	300660	江苏雷利	800	24,208.00	0.03
707	002328	新朋股份	4,000	23,880.00	0.03
708	603787	新日股份	1,900	23,769.00	0.03
709	301499	维科精密	800	23,528.00	0.03

710	603200	上海洗霸	1,100	23,419.00	0.03
711	300835	龙磁科技	800	23,208.00	0.02
712	002322	理工能科	1,800	23,040.00	0.02
713	600165	宁科生物	6,800	22,984.00	0.02
714	002659	凯文教育	5,300	22,949.00	0.02
715	600651	飞乐音响	6,300	22,680.00	0.02
716	603869	新智认知	2,400	22,656.00	0.02
717	301397	溯联股份	500	22,590.00	0.02
718	300225	金力泰	2,300	22,494.00	0.02
719	001300	三柏硕	1,100	22,308.00	0.02
720	002112	三变科技	2,100	22,008.00	0.02
721	301052	果麦文化	500	21,890.00	0.02
722	600088	中视传媒	1,700	21,828.00	0.02
723	002379	宏创控股	4,800	21,792.00	0.02
724	301088	戎美股份	1,400	21,322.00	0.02
725	603222	济民医疗	2,600	20,826.00	0.02
726	300192	科德教育	2,100	20,727.00	0.02
727	301066	万事利	1,600	20,608.00	0.02
728	301386	未来电器	800	20,344.00	0.02
729	605068	明新旭腾	900	20,196.00	0.02
730	603727	博迈科	1,600	20,048.00	0.02
731	300645	正元智慧	1,100	20,009.00	0.02
732	603855	华荣股份	1,000	19,960.00	0.02
733	002846	英联股份	1,800	19,710.00	0.02
734	002833	弘亚数控	1,100	19,514.00	0.02
735	600830	香溢融通	2,700	19,251.00	0.02
736	688418	震有科技	1,019	19,218.34	0.02
737	300582	英飞特	1,600	19,216.00	0.02
738	603153	上海建科	900	19,017.00	0.02
739	001896	豫能控股	4,300	18,791.00	0.02
740	300460	惠伦晶体	1,500	18,390.00	0.02
741	002995	天地在线	800	18,200.00	0.02
741	301505	苏州规划	500	18,200.00	0.02
743	001282	三联锻造	500	18,085.00	0.02
744	301188	力诺特玻	1,000	17,890.00	0.02
745	002565	顺灏股份	5,200	17,628.00	0.02
746	001339	智微智能	500	17,190.00	0.02
747	000911	广农糖业	2,100	17,115.00	0.02
748	000798	中水渔业	1,900	16,891.00	0.02
749	605299	舒华体育	1,700	16,830.00	0.02
750	603366	日出东方	2,700	16,821.00	0.02
751	688600	皖仪科技	831	16,786.20	0.02
752	000726	鲁泰 A	2,500	16,200.00	0.02
753	600397	安源煤业	5,200	15,756.00	0.02

754	300879	大叶股份	900	15,588.00	0.02
755	300517	海波重科	1,100	15,565.00	0.02
756	002286	保龄宝	1,900	15,428.00	0.02
757	300875	捷强装备	500	14,595.00	0.02
758	603217	元利科技	800	14,592.00	0.02
759	600826	兰生股份	1,600	14,144.00	0.02
760	601999	出版传媒	1,900	14,136.00	0.02
761	300612	宣亚国际	700	13,405.00	0.01
762	002227	奥特迅	1,000	13,370.00	0.01
763	600318	新力金融	1,900	13,338.00	0.01
764	002045	国光电器	800	13,320.00	0.01
765	002641	公元股份	2,600	13,078.00	0.01
766	002391	长青股份	2,000	12,600.00	0.01
767	600503	华丽家族	4,800	12,240.00	0.01
767	002184	海得控制	800	12,240.00	0.01
769	300137	先河环保	2,200	12,232.00	0.01
770	300551	古鳌科技	700	12,180.00	0.01
771	603818	曲美家居	2,200	11,880.00	0.01
772	301299	卓创资讯	200	11,824.00	0.01
773	002348	高乐股份	3,000	11,550.00	0.01
774	002084	海鸥住工	2,900	11,542.00	0.01
775	603843	正平股份	3,300	11,517.00	0.01
776	300112	万讯自控	1,000	11,500.00	0.01
777	002323	雅博股份	4,700	11,421.00	0.01
778	300011	鼎汉技术	1,400	11,172.00	0.01
779	000610	西安旅游	800	11,048.00	0.01
780	300471	厚普股份	800	11,032.00	0.01
781	002632	道明光学	1,100	10,868.00	0.01
782	300189	神农科技	3,300	10,857.00	0.01
783	600565	迪马股份	7,100	10,508.00	0.01
784	002495	佳隆股份	3,200	10,240.00	0.01
785	603315	福鞍股份	700	10,171.00	0.01
786	003032	传智教育	700	10,080.00	0.01
787	300863	卡倍亿	200	10,008.00	0.01
788	603660	苏州科达	1,100	9,669.00	0.01
789	605198	安德利	400	9,320.00	0.01
790	605196	华通线缆	1,200	9,240.00	0.01
791	002760	凤形股份	400	8,768.00	0.01
792	300165	天瑞仪器	1,300	8,671.00	0.01
793	000919	金陵药业	1,100	8,657.00	0.01
794	002380	科远智慧	500	8,515.00	0.01
795	600611	大众交通	2,800	8,344.00	0.01
796	301030	仕净科技	200	8,340.00	0.01
797	000882	华联股份	4,800	8,064.00	0.01

798	600526	菲达环保	1,500	7,410.00	0.01
799	605179	一鸣食品	500	7,400.00	0.01
800	301489	思泉新材	115	7,372.65	0.01
801	301111	粤万年青	300	7,368.00	0.01
802	301555	惠柏新材	224	7,266.56	0.01
803	603825	华扬联众	600	7,248.00	0.01
804	002285	世联行	3,000	7,230.00	0.01
805	002103	广博股份	900	7,209.00	0.01
806	688306	均普智能	1,200	6,684.00	0.01
807	300933	中辰股份	700	6,615.00	0.01
808	605305	中际联合	200	6,462.00	0.01
809	688648	中邮科技	286	6,128.98	0.01
810	301516	中远通	365	5,661.15	0.01
811	001208	华菱线缆	600	5,574.00	0.01
812	688102	斯瑞新材	400	5,276.00	0.01
813	301018	申菱环境	200	5,268.00	0.01
814	001201	东瑞股份	200	4,828.00	0.01
815	300996	普联软件	200	4,580.00	0.00
816	301508	中机认检	151	4,028.68	0.00
817	301568	思泰克	110	3,913.80	0.00
818	603206	嘉环科技	200	3,562.00	0.00
819	603273	天元智能	178	3,376.66	0.00
820	301459	丰茂股份	80	3,187.20	0.00
821	301526	国际复材	500	2,765.00	0.00
822	001306	夏厦精密	33	2,486.88	0.00
823	001239	永达股份	95	1,892.40	0.00
824	603062	麦加芯彩	32	1,849.92	0.00

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	300705	九典制药	5,199,856.00	5.59
2	002270	华明装备	3,650,770.00	3.93
3	300779	惠城环保	3,643,296.00	3.92
4	002609	捷顺科技	3,501,348.00	3.77
5	300349	金卡智能	3,272,976.00	3.52
6	300857	协创数据	3,256,948.00	3.50
7	002033	丽江股份	2,899,008.00	3.12
8	002937	兴瑞科技	2,617,447.00	2.82
9	002393	力生制药	2,566,989.00	2.76

10	300314	戴维医疗	2,445,344.00	2.63
11	300020	银江技术	2,412,170.00	2.59
12	002449	国星光电	2,370,344.00	2.55
13	300426	唐德影视	2,352,239.00	2.53
14	000541	佛山照明	2,316,467.00	2.49
15	300708	聚灿光电	2,281,874.00	2.45
16	300469	信息发展	2,263,772.00	2.43
17	002452	长高电新	2,208,021.00	2.37
18	300729	乐歌股份	2,187,196.00	2.35
19	300523	辰安科技	2,167,537.00	2.33
20	002275	桂林三金	2,163,886.00	2.33
21	000631	顺发恒业	2,131,958.00	2.29
22	000922	佳电股份	2,109,214.01	2.27
23	002149	西部材料	2,091,466.00	2.25
24	002016	世荣兆业	2,057,722.00	2.21
25	002111	威海广泰	2,015,464.00	2.17
26	000531	穗恒运 A	2,002,503.00	2.15
27	300788	中信出版	1,983,715.00	2.13
28	000852	石化机械	1,949,845.00	2.10
29	003029	吉大正元	1,946,310.00	2.09
30	300559	佳发教育	1,937,954.00	2.08
31	000404	长虹华意	1,920,094.00	2.07
32	002238	天威视讯	1,918,699.00	2.06
33	300041	回天新材	1,916,143.00	2.06
34	002983	芯瑞达	1,914,477.47	2.06
35	002117	东港股份	1,913,888.00	2.06
36	000819	岳阳兴长	1,912,146.69	2.06
37	603556	海兴电力	1,911,467.00	2.06
38	002014	永新股份	1,897,231.00	2.04
39	300566	激智科技	1,863,287.00	2.00

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

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	300705	九典制药	5,689,519.60	6.12
2	002270	华明装备	3,919,007.44	4.22
3	300857	协创数据	3,670,024.14	3.95
4	002609	捷顺科技	3,555,243.00	3.82
5	300779	惠城环保	3,323,120.00	3.57
6	300349	金卡智能	2,989,478.00	3.22

7	002033	丽江股份	2,588,378.00	2.78
8	000628	高新发展	2,525,101.00	2.72
9	002937	兴瑞科技	2,470,768.00	2.66
10	000541	佛山照明	2,404,057.00	2.59
11	002238	天威视讯	2,319,018.05	2.49
12	000631	顺发恒业	2,267,153.00	2.44
13	300020	银江技术	2,264,862.00	2.44
14	300314	戴维医疗	2,242,908.46	2.41
15	002449	国星光电	2,213,485.00	2.38
16	002393	力生制药	2,178,976.00	2.34
17	002275	桂林三金	2,163,816.00	2.33
18	300809	华辰装备	2,155,144.60	2.32
19	300729	乐歌股份	2,150,517.00	2.31
20	300523	辰安科技	2,080,547.00	2.24
21	300426	唐德影视	2,065,993.00	2.22
22	300469	信息发展	2,061,120.00	2.22
23	000922	佳电股份	2,007,475.00	2.16
24	002452	长高电新	1,999,529.00	2.15
25	300788	中信出版	1,963,225.00	2.11
26	300280	紫天科技	1,919,232.00	2.06
27	003029	吉大正元	1,914,483.00	2.06
28	002111	威海广泰	1,882,772.00	2.03
29	300041	回天新材	1,881,021.00	2.02
30	300708	聚灿光电	1,869,600.60	2.01
31	300559	佳发教育	1,867,102.09	2.01
32	002149	西部材料	1,863,855.00	2.00

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

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	678,911,217.71
卖出股票收入（成交）总额	512,134,839.60

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

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-



	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	5,000.37	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	5,000.37	0.01

#### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	118046	诺泰转债	50	5,000.37	0.01
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

#### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

#### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

##### 8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

#### 8.12 投资组合报告附注

##### 8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，新疆冠农股份有限公司出现在报告编制日前一年内

受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金为指数型基金，采取完全复制策略，冠农股份系标的指数成份股，上述股票的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

8.12.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	656,667.64
2	应收清算款	698.68
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	657,366.32

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		华夏中证 2000ETF 发起式联接	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
1,163	76,417.88	43,037,484.00	48.43%	28,506,516.00	32.08%	17,330,000.00	19.50%

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	上海证券—国泰君安证券股份有限公司—上海证券正和 2 号 FOF 单一资产管理计划	20,000,000.00	22.50%
2	招商证券股份有限公司	4,644,386.00	5.23%
3	中信证券股份有限公司	4,617,898.00	5.20%
4	广发证券股份有限公司	3,816,100.00	4.29%
5	方正证券股份有限公司	3,217,900.00	3.62%
6	华夏基金华智 2 号股票型养老金产品—中国建设银行股份有限公司	3,091,000.00	3.48%
7	周小鹏	2,170,600.00	2.44%
8	李明杰	2,117,300.00	2.38%
9	王少云	1,500,000.00	1.69%
10	国信证券股份有限公司	1,159,700.00	1.30%
11	招商银行股份有限公司—华夏中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	17,330,000.00	19.50%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	-	-

### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2023 年 9 月 6 日）基金份额总额	310,874,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	328,000,000.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	550,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	88,874,000.00

注：本基金合同于 2023 年 9 月 6 日生效。

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金无基金份额持有人大会决议。

#### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，张佑君先生担任本基金管理人董事长，杨明辉先生离任本基金管理人董事长。

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

#### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及基金托管业务的诉讼。

#### 11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

#### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 35,000 元人民币。本基金本报告期内选聘普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）提供首年审计服务。

#### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

##### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人及其高级管理人员在本报告期内无受稽查或处罚等情况。

##### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，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	
兴业证券	1	481,611,555.88	40.45%	214,758.19	40.45%	-
国泰君安证券	2	235,315,101.00	19.76%	104,901.09	19.76%	-
西部证券	1	210,999,637.70	17.72%	94,092.78	17.72%	-
中信证券	11	188,565,549.67	15.84%	84,084.71	15.84%	-
中金公司	4	47,292,394.10	3.97%	21,088.52	3.97%	-
中信建投证券	3	26,422,127.77	2.22%	11,781.68	2.22%	-
招商证券	5	529,729.34	0.04%	236.35	0.04%	-

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

- i 经营行为规范。
- ii 公司财务状况良好。

iii有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。

iv有较强的全方位金融服务能力和水平：能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

v 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

②券商专用交易单元选择程序：

i 本基金管理人根据上述标准进行评估并确定选用的券商。

ii 本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议/证券经纪服务协议。

③本基金合同于 2023 年 9 月 6 日生效，除本表列示外，本基金还选择了财通证券、长江证券、第一创业证券、东吴证券、方正证券、光大证券、国联证券、华泰证券、华西证券、江海证券、金元证券、联储证券、平安证券、上海证券、申万宏源、中泰证券、中银国际证券的交易单元作为本基金交易单元，本报告期无股票交易及应付佣金。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	168,235.13	92.17%	-	-	-	-	-	-
中金公司	14,282.23	7.83%	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华夏中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-09-07
2	华夏基金管理有限公司关于华夏中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-09-11

	书提示性公告		
3	华夏中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-09-11
4	华夏中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书	中国证监会指定报刊及网站	2023-09-11
5	华夏中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金上市交易提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-09-14
6	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-09-22
7	华夏基金管理有限公司关于杭州分公司营业场所变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-09-27
8	华夏基金管理有限公司关于增聘华夏中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金经理的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-09-28
9	华夏基金管理有限公司关于设立华夏股权投资基金管理（北京）有限公司的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-10-12

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2023-11-09 至 2023-12-03, 2023-12-08 至 2023-12-31	20,000,000.00	-	-	20,000,000.00	22.50%
华夏中证 2000ETF 发起式联接	1	2023-12-19 至 2023-12-25	-	22,480,000.00	5,150,000.00	17,330,000.00	19.50%

产品特有风险

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

## §13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金注册的文件；
- 2、《华夏中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《华夏中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照。

### 13.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

### 13.3 查阅方式

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

华夏基金管理有限公司

二〇二四年三月二十八日