

平安中证 2000 增强策略交易型开放式指数
证券投资基金
2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：平安基金管理有限公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 29 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。本中期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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 08 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告除特别注明外，金额单位均为人民币元。

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
7.3 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	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	58
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	59

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	59
7.7 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	60
7.8 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	60
7.9 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	60
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	60
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	60
7.12 投资组合报告附注	60
§ 8 基金份额持有人信息	61
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	61
8.2 期末上市基金前十名持有人	61
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	62
8.4 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	62
§ 9 开放式基金份额变动	62
§ 10 重大事件揭示	62
10.1 基金份额持有人大会决议	62
10.2 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	62
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	62
10.4 基金投资策略的改变	62
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	63
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	63
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	63
10.8 其他重大事件	64
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	65
11.1 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	65
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	65
§ 12 备查文件目录	65
12.1 备查文件目录	65
12.2 存放地点	65
12.3 查阅方式	65

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	平安中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	平安中证 2000 增强策略 ETF
场内简称	中证 2000ETF 增强
基金主代码	159556
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023 年 12 月 27 日
基金管理人	平安基金管理有限公司
基金托管人	中国民生银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	138,556,089.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2024 年 1 月 10 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强策略交易型开放式指数证券投资基金，在力求对中证 2000 指数进行有效跟踪的基础上，通过科学的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	<p>本基金采用指数增强策略，在标的指数成份券权重的基础上对行业配置及个股权重等进行主动调整，力争在控制跟踪误差的基础上获取超越标的指数的投资收益。</p> <p>本基金将以量化多因子模型构建股票组合。本模型通过数量化的方式，配置一批具有显著选股效用的、逻辑互补的、相关性低的因子，进而得到具有稳定超额回报的股票组合。本基金定时进行绩效归因评价，对因子的有效性进行持续的跟踪，实现对于模型的动态风险管理。基金经理根据市场状况结合因子变化趋势，对模型使用的因子结构进行动态调整。</p> <p>在正常情况下，本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值小于 0.35%，年化跟踪误差不超过 6.5%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致基金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、跟踪误差的进一步扩大。</p>
业绩比较基准	中证 2000 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

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		平安基金管理有限公司	中国民生银行股份有限公司
信息披露	姓名	陈特正	袁耀光

负责人	联系电话	0755-22626828	010-58560666
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn	tgxxpl@cmbc.com.cn
客户服务电话		400-800-4800	95568
传真		0755-23997878	010-57093382
注册地址		深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层	北京市西城区复兴门内大街 2 号
办公地址		深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层	北京市西城区复兴门内大街 2 号
邮政编码		518048	100031
法定代表人		罗春风	高迎欣

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.fund.pingan.com
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
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 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2024年1月1日-2024年6月30日)
本期已实现收益	-49,920,598.87
本期利润	-54,619,782.50
加权平均基金份额本期利润	-0.2721
本期加权平均净值利润率	-31.19%
本期基金份额净值增长率	-22.06%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)
期末可供分配利润	-33,978,324.01
期末可供分配基金份额利润	-0.2452
期末基金资产净值	108,459,967.61
期末基金份额净值	0.7828
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-21.72%

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

2. 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（为

期末余额，而非当期发生数)；

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

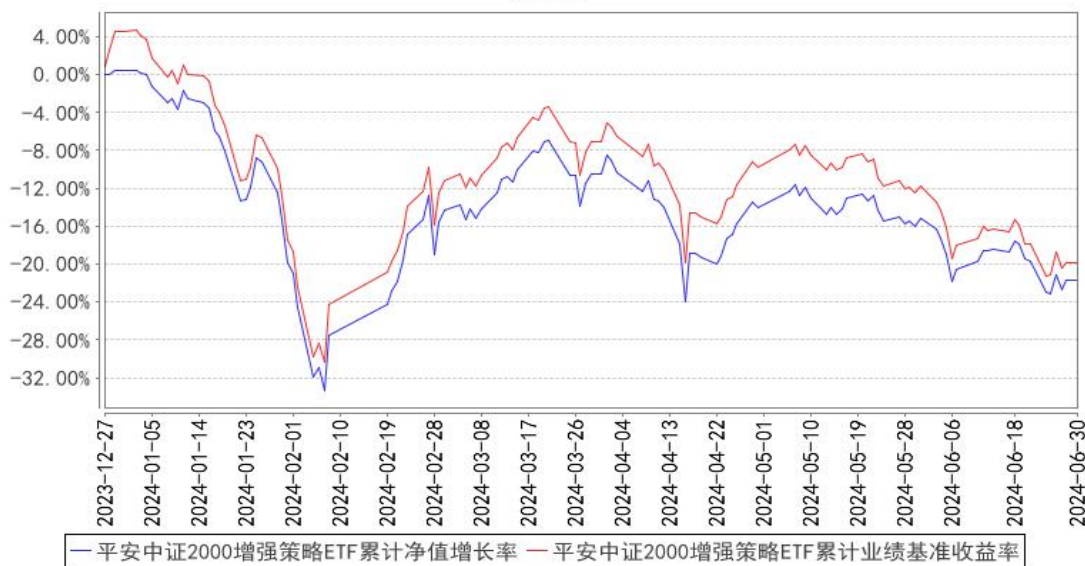
3.2 基金净值表现

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
过去一个月	-7.80%	1.73%	-9.15%	1.85%	1.35%	-0.12%
过去三个月	-12.54%	2.02%	-13.75%	2.01%	1.21%	0.01%
过去六个月	-22.06%	2.52%	-23.28%	2.50%	1.22%	0.02%
自基金合同生效起至今	-21.72%	2.48%	-19.82%	2.47%	-1.90%	0.01%

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

平安中证2000增强策略ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2023 年 12 月 27 日正式生效，截至报告期末未满一年；

2、按照本基金的基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定，截至报告期末本基金已完成建仓，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.3 其他指标

注：本基金本报告期无其他指标。

§ 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

平安基金管理有限公司成立于 2011 年 1 月 7 日，平安基金总部位于深圳，注册资本为 13 亿元人民币。作为中国平安集团旗下成员，平安基金“以专业承载信赖”，为海内外各类机构和个人投资者提供专业、全面的资产管理服务。依托中国平安集团综合金融优势，平安基金建立了以固收投资、权益投资、指数投资、资产配置、资产证券化、专户六大业务板块（其中资产证券化及非标专户业务通过旗下全资子公司深圳平安汇通投资管理有限公司开展）。基于平安集团四大研究院和集团整体科技基础设施，平安基金构建了以智能投研、智能运营、智能销售、智慧风控四大应用方向为基础的资产管理智能解决方案，致力于成为国内领先的科技赋能型智慧资产管理公司。截至 2024 年 6 月 30 日，平安基金共管理 206 只公募基金，公募资产管理总规模约为 6655 亿元人民币。

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		
俞瑶	平安中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理	2023 年 12 月 27 日	-	12 年	俞瑶女士，香港科技大学投资管理专业硕士，曾先后担任南京证券股份有限公司投资顾问、深圳市万博汇投资控股有限公司运营风险管理经理、天风证券股份有限公司项目经理。2015 年 9 月加入平安基金管理有限公司，曾担任投资经理，现任平安深证 300 指数增强型证券投资基金、平安沪深 300 指数量化增强证券投资基金、平安中证 500 指数增强型发起式证券投资基金、平安兴鑫回报一年定期开放混合型证券投资基金、平安中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理。
钱晶	ETF 指数中心投资副总监，平安中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理	2023 年 12 月 27 日	-	13 年	钱晶先生，美国纽约大学理工学院硕士。曾先后担任国信证券股份有限公司量化分析师、华安基金管理有限公司基金经理。2017 年 10 月加入平安基金管理有限公司，曾任 ETF 指数投资中心投资经理。现任 ETF 指数中心投资副总监，同时担任平安 MSCI 中国 A 股低波动交易型开放式指数证券投资基金、平安中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金、平安中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基

					金发起式联接基金、平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金、平安中证港股通医药卫生综合交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、平安中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金、平安中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安上证红利低波动指数型证券投资基金、平安中证汽车零部件主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理。
李严	平安中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理	2024 年 1 月 29 日	-	3 年	李严先生, 复旦大学应用统计学专业硕士, 曾担任东北证券股份有限公司上海证券研究咨询分公司证券分析师。2023 年 4 月加入平安基金管理有限公司, 现任 ETF 指数投资中心高级研究员、平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安创业板交易型开放式指数证券投资基金、平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、平安创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金、平安中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金、平安中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。同时担任平安 MSCI 中国 A 股低波动交易型开放式指数证券投资基金、平安港股通恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金、平安中证 5-10 年期国债活跃券交易型开放式指数证券投资基金、平安中债-中高等级公司债利差因子交易型开放式指数证券投资基金、平安中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金、平安中证粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金、平安中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金、平安中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金、平安中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、平安中证医药及医疗器械创新交易型开放式指数证券投资基

					<p>金、平安中证新材料主题交易型开放式指数证券投资基金、平安中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、平安中证光伏产业指数型发起式证券投资基金、平安中证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金、平安中证沪港深线上消费主题交易型开放式指数证券投资基金、平安中证港股通医药卫生综合交易型开放式指数证券投资基金、平安富时中国国企开放共赢交易型开放式指数证券投资基金、平安中证医药及医疗器械创新指数型发起式证券投资基金、平安中证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、平安中债-0-3 年国开行债券交易型开放式指数证券投资基金、平安中证港股通医药卫生综合交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理助理。</p>
李严	平安中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理	2024 年 1 月 11 日	2024 年 1 月 29 日	3 年	<p>李严先生, 复旦大学应用统计学专业硕士, 曾担任东北证券股份有限公司上海证券研究咨询分公司证券分析师。2023 年 4 月加入平安基金管理有限公司, 现任 ETF 指数投资中心高级研究员、平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安创业板交易型开放式指数证券投资基金、平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、平安创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金、平安中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金、平安中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。同时担任平安 MSCI 中国 A 股低波动交易型开放式指数证券投资基金、平安港股通恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金、平安中证 5-10 年期国债活跃券交易型开放式指数证券投资基金、平安中债-中高等级公司债利差因子交易型开放式指数证券投资基金、平安中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金、平</p>

				<p>安中证粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金、平安中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金、平安中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金、平安中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、平安中证医药及医疗器械创新交易型开放式指数证券投资基金、平安中证新材料主题交易型开放式指数证券投资基金、平安中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、平安中证光伏产业指数型发起式证券投资基金、平安中证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金、平安中证沪港深线上消费主题交易型开放式指数证券投资基金、平安中证港股通医药卫生综合交易型开放式指数证券投资基金、平安富时中国国企开放共赢交易型开放式指数证券投资基金、平安中证医药及医疗器械创新指数型发起式证券投资基金、平安中证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、平安中债-0-3 年国开行债券交易型开放式指数证券投资基金、平安中证港股通医药卫生综合交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理助理。</p>
--	--	--	--	---

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确认的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确认的聘任日期和解聘日期。

2、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。

3、自 2024 年 4 月 12 日起，俞瑶女士因休产假，休假期间本基金由共同管理该基金的钱晶先生、李严先生管理。

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：无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和本基金基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及

基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

本基金管理人按日内、3 日内、5 日内三个不同的时间窗口，对本基金管理人管理的全部投资组合在本报告期内的交易情况进行了同向交易价差分析，各投资组合交易过程中不存在显著的交易价差，不存在不公平交易的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。

报告期内，所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的 5%。

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

本基金为指数增强基金，采用量化多因子的方法在中证 2000 成分股内进行抽样选股构建组合，达到跟踪指数的基础上增强收益的目的。报告期内，本基金较好的完成了基金的投资目标。

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 0.7828 元，本报告期基金份额净值增长率为-22.06%，业绩比较基准收益率为-23.28%。

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 年下半年，中国经济将继续在“稳中求进”的总基调下运行，经济增速有望保持在合理区间。从外部宏观上看，全球流动性有望宽松，一部分主要经济体央行已进入降息周期，全球经济或将持续复苏，分母端的压力减退有望提振权益资产的投资价值。从国内宏观来看，房地产产业的支持性政策刺激下，商品房销售面积数据出现了较为明显的改善，叠加地产开工增速放缓，地产下行最快的时候已经过去。出口端强劲，外贸持续保持顺差，我国的出口市场更加多元化，展现了更强的跨越周期波动的能力。投资端，在三中全会的定调下，对于财政端发力预期会更加清晰。

对于下半年股票投资上看，可以适当更积极乐观一些。对于市场掣肘的因素正在逐步消退，外部流动性随着降息的落地会有回流的诉求，国内基本面的维稳改善提振了投资预期，资产间性

价比中股票市场的价值正在逐步突出，政策端对于股票市场机制的不断完善保障了长期的投资价值。

指数化投资在经历市场的震荡中进一步凸显了该投资范式的普遍性，作为基金管理人，我们将继续坚持紧密跟踪标的指数表现的投资目标。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人设有估值委员会，由研究中心及投资管理部门、运营部、风险管理室及法律合规监察部相关人员组成。估值委员会负责公司基金估值政策、程序及方法的制定和修订，负责定期审议公司估值政策、程序及方法的科学合理性，保证基金估值的公平、合理。估值委员会的相关人员均具有一定年限的专业从业经验，具有良好的专业能力，并能在相关工作中保持独立性。

基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值发生重大变化的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

本基金管理人已与第三方定价服务机构签署服务协议，由其按约定提供相关参考数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配，符合基金合同的约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数低于 200 人、基金资产净值低于 5,000 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

本报告期内，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规的规定和基金合同、托管协议的约定，依法安全保管了基金财产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，按照相关法律法规规定和基金合同、托管协议的有关约定，本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开

支及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的约定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：平安中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	11,796,338.82	348,273,456.02
结算备付金		43,346.94	-
存出保证金		164,510.90	-
交易性金融资产	6.4.7.2	99,999,921.69	147,877,347.00
其中：股票投资		99,999,921.69	147,877,347.00
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	94,000,000.00
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	75,409.12	21,739.70
资产总计		112,079,527.47	590,172,542.72
负债和净资产	附注号	本期末	上年度末

		2024 年 6 月 30 日	2023 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		3,236,969.43	116,393,039.11
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		46,776.08	25,894.96
应付托管费		9,355.21	5,178.99
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	6.4.7.9	326,459.14	117,177.47
负债合计		3,619,559.86	116,541,290.53
净 资 产：			
实收基金	6.4.7.10	138,556,089.00	471,556,089.00
未分配利润	6.4.7.12	-30,096,121.39	2,075,163.19
净资产合计		108,459,967.61	473,631,252.19
负债和净资产总计		112,079,527.47	590,172,542.72

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.7828 元，基金份额总额 138,556,089.00 份。

6.2 利润表

会计主体：平安中证 2000 增强策略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 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本 期
		2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-53,919,238.49
1. 利息收入		40,236.50
其中：存款利息收入	6.4.7.13	31,789.38
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		8,447.12
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-49,376,164.51
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-50,156,221.22
基金投资收益		-

债券投资收益	6.4.7.15	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-
股利收益	6.4.7.19	780,056.71
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-4,699,183.63
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	115,873.15
减：二、营业总支出		700,544.01
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	437,910.23
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	6.4.10.2.2	87,582.04
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
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	6.4.7.22	-
7. 税金及附加		-
8. 其他费用	6.4.7.23	175,051.74
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-54,619,782.50
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-54,619,782.50
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-54,619,782.50

6.3 净资产变动表

会计主体：平安中证 2000 增强策略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 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 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	471,556,089.00	-	2,075,163.19	473,631,252.19
二、本期期初净资产	471,556,089.00	-	2,075,163.19	473,631,252.19
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-333,000,000.00	-	-32,171,284.58	-365,171,284.58
（一）、综合收益	-	-	-54,619,782.50	-54,619,782.50

总额				
(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)	-333,000,000.00	-	22,448,497.92	-310,551,502.08
其中：1. 基金申购款	168,000,000.00	-	-39,179,321.59	128,820,678.41
2. 基金赎回款	-501,000,000.00	-	61,627,819.51	-439,372,180.49
(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	138,556,089.00	-	-30,096,121.39	108,459,967.61

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

罗春风	林婉文	张南南
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

平安中证 2000 增强策略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]2239 号《关于准予平安中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》核准,由平安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《平安中证 2000 增强策略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 471,531,000.00 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 0633 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《平安中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2023 年 12 月 27 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 471,556,089.00 份,其中认购资金利息折合 25,089.00 份基金份额。本基金的基金管理人为平安基金管理有限公司,基金托管人为民生银行股份有限公司。

经深圳证券交易所（以下简称“深交所”）深证上[2024]3 号文审核同意，本基金 471,556,089.00 份基金份额于 2024 年 1 月 10 日在深交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于中证 2000 指数的成份股及其备选成份股（包括存托凭证）。为更好地实现投资目标，本基金还可投资于非成份股（包括主板、创业板及其他经中国证监会允许投资的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、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、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债券、政府支持债券等）、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权、信用衍生品、银行存款（协议存款、通知存款以及定期存款等）、同业存单、资产支持证券、债券回购、现金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的相关规定）。

本基金将根据法律法规的规定参与融资和转融通证券出借业务。未来在法律法规允许的前提下，本基金可根据相关法律法规规定参与融券业务。如法律法规或中国证监会以后允许基金投资其他品种，本基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入本基金的投资范围。基金的投资组合比例为：本基金所持有的股票、存托凭证资产占基金资产的比例不低于 80%，其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%。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。

本基金的业绩比较基准为标的指数收益率，即中证 2000 指数收益率。

6.4.2 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”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金本报告期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 06 月 30 日的财务状况以及 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系自 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 6 月 30 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

6.4.4.3 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。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或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，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。

6.4.4.5 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。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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。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。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

6.4.4.8 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)。

6.4.4.9 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。

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。

6.4.4.10 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。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金的收益分配政策为:(1) 基金收益评价日核定的基金份额净值增长率超过同期标的指数增长率达到 1%以上时,基金管理人可进行收益分配;(2) 本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近同期标的指数增长率为原则进行收益分配。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除息后的基金份额净值低于面值;(3) 本基金的收益分配采取现金分红的方式;(4) 《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配;(5) 每一基金份额享有同等分配权;(6) 法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

6.4.4.12 分部报告

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) 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) 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。

本基金目前以一个经营分部运作,不需要进行分部报告的披露。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

6.4.5.3 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。

6.4.6 税项

(1) 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1%，由出让方缴纳。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(2) 增值税及附加

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金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。对证券投资基金在 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，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按 7%、3% 和 2% 的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

（3）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

（4）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 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。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	11,796,338.82
等于：本金	11,795,757.92
加：应计利息	580.90
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	11,796,338.82

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	102,464,083.62	-	99,999,921.69	-2,464,161.93
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	102,464,083.62	-	99,999,921.69	-2,464,161.93

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 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。

6.4.7.3.3 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。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金于本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末无其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末无其他债权投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末无其他权益工具投资。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末无其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	75,409.12
合计	75,409.12

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 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	146,261.49
其中：交易所市场	146,261.49
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	99,955.86
应退退补款	80,241.79
合计	326,459.14

注：应退退补款指投资者采用可以现金替代方式申购(赎回)本基金时，替代价格与实际买入成本(实际卖出金额)或强制退款成本之差乘以替代数量的金额。

6.4.7.10 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 6 月 30 日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	471,556,089.00	471,556,089.00
本期申购	168,000,000.00	168,000,000.00
本期赎回(以“-”号填列)	-501,000,000.00	-501,000,000.00
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	138,556,089.00	138,556,089.00

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。

6.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期无其他综合收益。

6.4.7.12 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	-159,858.51	2,235,021.70	2,075,163.19
本期期初	-159,858.51	2,235,021.70	2,075,163.19
本期利润	-49,920,598.87	-4,699,183.63	-54,619,782.50
本期基金份额交易产生的变动数	16,102,133.37	6,346,364.55	22,448,497.92
其中：基金申购款	-16,242,663.01	-22,936,658.58	-39,179,321.59
基金赎回款	32,344,796.38	29,283,023.13	61,627,819.51
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-33,978,324.01	3,882,202.62	-30,096,121.39

6.4.7.13 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6月30日
活期存款利息收入	23,782.31
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	6,821.87
其他	1,185.20
合计	31,789.38

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 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6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-23,746,349.58
股票投资收益——赎回差价收入	-26,409,871.64
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	-50,156,221.22

6.4.7.14.2 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6月30日
卖出股票成交总额	204,822,612.01
减：卖出股票成本总额	227,955,633.24
减：交易费用	613,328.35

买卖股票差价收入	-23,746,349.58
----------	----------------

6.4.7.14.3 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6月30日
赎回基金份额对价总额	439,372,180.49
减：现金支付赎回款总额	134,433,032.49
减：赎回股票成本总额	331,349,019.64
减：交易费用	-
赎回差价收入	-26,409,871.64

6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无股票申购差价收入。

6.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期无股票投资收益——证券出借差价收入。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期内无债券买卖差价收入。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.17 贵金属投资收益**6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金本报告期内无贵金属投资。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资。

6.4.7.18 衍生工具收益**6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期内无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期内无衍生工具收益——其他投资收益。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	780,056.71
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	780,056.71

6.4.7.20 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6月30日
1. 交易性金融资产	-4,699,183.63
股票投资	-4,699,183.63
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-

减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-4,699,183.63

注：本基金上半年公允价值变动收益-股票投资中包含的可退替代款产生的公允价值变动收益为零。

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	115,873.15
合计	115,873.15

注：替代损益收入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)被替代成分证券的实际买入成本(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成分证券在强制退款计算日与申购(赎回)确认日估值的差额。

6.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	30,830.80
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行费用	105.00
其他	84,443.60
合计	175,051.74

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 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。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
平安基金管理有限公司(“平安基金”)	基金管理人
中国民生银行股份有限公司(“民生银行”)	基金托管人
大华资产管理有限公司	基金管理人的股东
三亚盈湾旅业有限公司	基金管理人的股东
平安信托有限责任公司	基金管理人的股东
深圳平安汇通投资管理有限公司(“平安汇通”)	基金管理人的子公司
平安证券股份有限公司(“平安证券”)	基金管理人的股东的子公司、基金销售机构
方正证券股份有限公司(“方正证券”)	基金销售机构、与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
中国平安保险(集团)股份有限公司(“平安集团”)	基金管理人的最终控股母公司

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	437,910.23
其中：应支付销售机构的客户维护费	33,367.53
应支付基金管理人的净管理费	404,542.70

注：支付基金管理人平安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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	87,582.04

注：支付基金托管行民生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。

6.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 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

6.4.10.4.1 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：本基金本报告期内转融通证券出借业务未发生重大关联交易事项。

6.4.10.4.2 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：本基金本报告期内转融通证券出借业务未发生重大关联交易事项。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

6.4.10.5.2 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 6 月 30 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 (%)
方正证券	2,498,289.00	1.8031	-	-

注：投资相关费率符合基金合同和招募说明书等法律文件的约定

6.4.10.6 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 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
民生银行-活期	11,796,338.82	23,782.31

注：本基金的银行存款由基金托管人民生银行保管，按银行同业存款利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 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
001359	平安电工	2024 年 3 月 19 日	6 个月	新股锁定	17.39	20.60	101	1,756.39	2,080.60	-
301536	星宸科技	2024 年 3 月 20 日	6 个月	新股锁定	16.16	32.27	280	4,524.80	9,035.60	-
301538	骏鼎达	2024 年 3 月 13 日	6 个月	新股锁定	39.94	91.24	109	4,353.96	9,945.16	-
301539	宏鑫科技	2024 年 4 月 3 日	6 个月	新股锁定	10.64	19.82	355	3,777.20	7,036.10	-
301565	中仑新材	2024 年 6 月 13 日	6 个月	新股锁定	11.88	18.98	266	3,160.08	5,048.68	-
301587	中瑞股份	2024 年 3 月 27 日	6 个月	新股锁定	21.73	25.26	199	4,324.27	5,026.74	-
301588	美新科技	2024 年 3 月 6 日	6 个月	新股锁定	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-

301591	肯特股份	2024 年 2 月 20 日	6 个月	新股锁定	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	-
--------	------	-----------------------	------	------	-------	-------	-----	----------	----------	---

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。

6.4.12.2 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
000040	ST 旭蓝	2024 年 5 月 6 日	重大事项停牌	0.00	2024 年 07 月 09 日	2.29	40,900	136,200.07	0.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金管理人秉承全面风险管理的理念，将风险管理融入业务中，建立了由风险管理委员会、风险控制委员会、督察长、风险管理部门以及各个业务部门构成的风险管理架构体系。各部门负责人为其所在部门风险管理的第一责任人，公司员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。本基金管理人设立风险管理部门，风险管理部门对公司的风险管理进行独立评估、监控、检查并及时向管理层汇报。

6.4.13.2 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的发行人出现违约、拒绝支付到期本息等导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的投资范围及投资比例符合相关法律法规的要求、相关监管机构的相关规定及本基金的合同要求。本基金管理人通过建立和完善内部信用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。本基金的活期银行存款存放在具有托管资格的银行；本基金存放定期存款前，均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险，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与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在银行间同业市场仅与达到本基金管理人既定信用政策标准的交易对手进行交易，并对证券交割方式进行限制，以控制相应的信用风险。

本基金管理人还通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券余额的 10%。（完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的基金品种可以不受此条款规定的比例限制）

于本报告期末，本基金未持有债券和资产支持证券投资（上年度末：同）。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险，是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难，另一方面来自于基金份额持有人可依据基金合同约定要求赎回其持有的基金份额。

本基金的基金管理人专业审慎、勤勉尽责地管控本基金的流动性风险，全覆盖、多维度的建立以压力测试为核心的流动性风险监测与预警制度，确保本基金组合的资产变现能力与投资者赎回需求匹配与平衡。

6.4.13.3.1 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》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)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。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%,且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。由本基金的基金管理人管理的所有开放式基金于开放期内共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%,由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市,其余亦可在银行间同业市场交易,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 6.4.12。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%。

本基金的基金管理人对其管理的所有开放式基金于开放期内,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。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场价格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。本基金管理人通过对不同类型的风险分别设定风险限制,并由独立于投资部门的风险管理人员监控、报告以及定期风险回顾的方法管理投资组合的市场风险。

6.4.13.4.1 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因市场利率变动而发生波动的风险。

本基金管理人通过由风险管理人员定期监控组合中债券投资部分的利率风险，及时调整投资组合久期等方法管理利率风险。

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的重新定价日或到期日进行了分类。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	11,796,338.82	-	-	-	11,796,338.82
结算备付金	43,346.94	-	-	-	43,346.94
存出保证金	164,510.90	-	-	-	164,510.90
交易性金融资产	-	-	-	99,999,921.69	99,999,921.69
其他资产	-	-	-	75,409.12	75,409.12
资产总计	12,004,196.66	-	-	100,075,330.81	112,079,527.47
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	46,776.08	46,776.08
应付托管费	-	-	-	9,355.21	9,355.21
应付清算款	-	-	-	3,236,969.43	3,236,969.43
其他负债	-	-	-	326,459.14	326,459.14
负债总计	-	-	-	3,619,559.86	3,619,559.86
利率敏感度缺口	12,004,196.66	-	-	96,455,770.95	108,459,967.61
上年度末 2023年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	348,273,456.02	-	-	-	348,273,456.02
交易性金融资产	-	-	-	147,877,347.00	147,877,347.00
买入返售金融资产	94,000,000.00	-	-	-	94,000,000.00
其他资产	-	-	-	21,739.70	21,739.70
资产总计	442,273,456.02	-	-	147,899,086.70	590,172,542.72
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	25,894.96	25,894.96
应付托管费	-	-	-	5,178.99	5,178.99
应付清算款	-	-	-	116,393,039.11	116,393,039.11
其他负债	-	-	-	117,177.47	117,177.47
负债总计	-	-	-	116,541,290.53	116,541,290.53
利率敏感度缺口	442,273,456.02	-	-	31,357,796.17	473,631,252.19

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早

者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于本报告期末，本基金未持有交易性债券资产投资和交易性资产支持证券投资（上年度末：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年度末：同）。

6.4.13.4.2 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。本基金持有的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.2.1 外汇风险的敏感性分析

注：无

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因除外汇风险和利率风险以外的市场价格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证券，所面临的重大价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其它价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

经测算本基金面临的其他价格风险列示如下：

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30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	99,999,921.69	92.20	147,877,347.00	31.22
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	99,999,921.69	92.20	147,877,347.00	31.22

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除“沪深 300 指数”以外的其他市场变量保持不变
	沪深 300 指数上升 5%

	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 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
分析	沪深 300 指数上升 5%	7,518,035.59	-2,405,633.14
	沪深 300 指数下降 5%	-7,518,035.59	2,405,633.14

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 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 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	99,948,188.94	147,877,347.00
第二层次	-	-
第三层次	51,732.75	-
合计	99,999,921.69	147,877,347.00

6.4.14.2.2 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、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。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 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。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期末无需要说明有助于理解和分析会计报表的其他事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	99,999,921.69	89.22
	其中：股票	99,999,921.69	89.22
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	11,839,685.76	10.56
8	其他各项资产	239,920.02	0.21
9	合计	112,079,527.47	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	-	-
B	采矿业	630,297.00	0.58
C	制造业	77,783,619.63	71.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,070,145.00	2.83
E	建筑业	1,341,743.00	1.24
F	批发和零售业	1,884,891.80	1.74
G	交通运输、仓储和邮政业	2,235,976.00	2.06

H	住宿和餐饮业	168,744.00	0.16
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,903,970.25	4.52
J	金融业	-	-
K	房地产业	1,133,298.00	1.04
L	租赁和商务服务业	906,680.00	0.84
M	科学研究和技术服务业	2,999,197.50	2.77
N	水利、环境和公共设施管理业	1,231,054.00	1.14
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	472,486.00	0.44
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	833,990.00	0.77
S	综合	265,320.00	0.24
	合计	99,861,412.18	92.07

7.2.2 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	138,509.51	0.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	0.00	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
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	-	-
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	138,509.51	0.13

7.2.3 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股票。

7.3 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

7.3.1 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	300181	佐力药业	48,900	739,368.00	0.68
2	002106	莱宝高科	62,900	685,610.00	0.63
3	000099	中信海直	40,700	660,968.00	0.61
4	300401	花园生物	41,600	596,544.00	0.55
5	000680	山推股份	63,500	588,645.00	0.54
6	002947	恒铭达	15,300	538,560.00	0.50
7	600114	东睦股份	36,100	519,479.00	0.48
8	300779	惠城环保	10,700	517,880.00	0.48
9	603031	安孚科技	22,800	514,824.00	0.47
10	300138	晨光生物	60,900	513,387.00	0.47
11	300917	特发服务	14,700	508,179.00	0.47
12	603619	中曼石油	21,600	505,872.00	0.47
13	603018	华设集团	50,400	458,136.00	0.42
14	603738	泰晶科技	33,500	456,940.00	0.42
15	300360	炬华科技	26,200	445,400.00	0.41
16	002039	黔源电力	24,900	438,240.00	0.40
17	002922	伊戈尔	18,900	413,154.00	0.38
18	002533	金杯电工	40,300	400,985.00	0.37
19	000014	沙河股份	41,300	395,241.00	0.36
20	603508	思维列控	20,300	380,625.00	0.35
21	002334	英威腾	63,000	376,740.00	0.35
22	002876	三利谱	15,600	376,272.00	0.35
23	600284	浦东建设	68,400	365,256.00	0.34
24	002833	弘亚数控	19,800	361,152.00	0.33
25	000922	佳电股份	30,200	360,286.00	0.33
26	688210	统联精密	15,700	347,755.00	0.32
27	002149	西部材料	24,500	342,020.00	0.32
28	603516	淳中科技	10,600	334,642.00	0.31
29	002979	雷赛智能	18,200	331,240.00	0.31
30	301096	百诚医药	5,700	331,056.00	0.31

31	002338	奥普光电	9,900	326,898.00	0.30
32	300566	激智科技	23,300	325,967.00	0.30
33	002206	海利得	85,300	325,846.00	0.30
34	002035	华帝股份	51,400	320,222.00	0.30
35	003019	宸展光电	12,600	319,158.00	0.29
36	300793	佳禾智能	22,600	313,236.00	0.29
37	603067	振华股份	26,700	311,322.00	0.29
38	688601	力芯微	7,100	310,199.00	0.29
39	002588	史丹利	41,000	308,730.00	0.28
40	002170	芭田股份	51,100	307,111.00	0.28
41	000888	峨眉山 A	28,200	307,098.00	0.28
42	300041	回天新材	38,500	305,690.00	0.28
43	300174	元力股份	22,300	304,395.00	0.28
44	603739	蔚蓝生物	23,500	303,620.00	0.28
45	002438	江苏神通	28,000	302,680.00	0.28
46	002955	鸿合科技	12,900	301,602.00	0.28
47	605196	华通线缆	28,500	299,820.00	0.28
48	000900	现代投资	81,900	299,754.00	0.28
49	605305	中际联合	11,600	299,164.00	0.28
50	301030	仕净科技	12,100	297,902.00	0.27
51	002962	五方光电	19,700	297,864.00	0.27
52	603258	电魂网络	18,200	293,930.00	0.27
53	002965	祥鑫科技	9,600	293,472.00	0.27
54	600694	大商股份	17,400	292,494.00	0.27
55	300217	东方电热	77,500	292,175.00	0.27
56	000819	岳阳兴长	16,300	291,281.00	0.27
57	002937	兴瑞科技	12,400	289,044.00	0.27
58	300680	隆盛科技	15,100	287,957.00	0.27
59	603009	北特科技	15,900	285,087.00	0.26
60	002296	辉煌科技	27,600	284,556.00	0.26
61	002452	长高电新	34,100	282,348.00	0.26
62	300545	联得装备	11,500	282,325.00	0.26
63	000731	四川美丰	42,500	281,775.00	0.26
64	300337	银邦股份	34,600	280,260.00	0.26
65	300219	鸿利智汇	50,000	279,500.00	0.26
66	603507	振江股份	8,400	275,688.00	0.25
67	002119	康强电子	24,600	275,520.00	0.25
68	300480	光力科技	17,400	275,442.00	0.25
69	605368	蓝天燃气	20,100	274,164.00	0.25
70	002897	意华股份	7,200	271,152.00	0.25
71	002749	国光股份	18,000	270,720.00	0.25
72	300349	金卡智能	22,400	267,008.00	0.25
73	002198	嘉应制药	35,100	266,760.00	0.25

74	300913	兆龙互连	8,000	265,760.00	0.25
75	300740	水羊股份	18,100	265,708.00	0.24
76	000532	华金资本	22,000	265,320.00	0.24
77	600229	城市传媒	38,200	263,198.00	0.24
78	688668	鼎通科技	6,660	261,671.40	0.24
79	603167	渤海轮渡	32,000	261,440.00	0.24
80	688378	奥来德	11,100	260,406.00	0.24
81	300396	迪瑞医疗	12,800	259,968.00	0.24
82	300378	鼎捷软件	15,900	258,693.00	0.24
83	603855	华荣股份	11,700	258,687.00	0.24
84	300629	新劲刚	14,600	257,836.00	0.24
85	300304	云意电气	39,600	257,796.00	0.24
86	603227	雪峰科技	41,200	255,440.00	0.24
87	300684	中石科技	14,700	254,898.00	0.24
88	603633	徕木股份	32,200	254,702.00	0.23
89	603889	新澳股份	32,800	253,872.00	0.23
90	002519	银河电子	51,400	252,374.00	0.23
91	603662	柯力传感	10,800	252,072.00	0.23
92	603960	克来机电	11,900	251,090.00	0.23
93	002997	瑞鹄模具	7,800	249,366.00	0.23
94	600101	明星电力	20,200	248,460.00	0.23
95	605377	华旺科技	18,700	247,775.00	0.23
96	688677	海泰新光	6,300	247,149.00	0.23
97	301263	泰恩康	19,700	246,841.00	0.23
98	002768	国恩股份	13,200	246,840.00	0.23
99	300662	科锐国际	15,300	246,789.00	0.23
100	002401	中远海科	16,500	246,510.00	0.23
101	300320	海达股份	30,200	246,432.00	0.23
102	688478	晶升股份	8,400	244,608.00	0.23
103	003000	劲仔食品	20,200	243,410.00	0.22
104	300430	诚益通	16,100	242,788.00	0.22
105	688195	腾景科技	9,900	242,649.00	0.22
106	002478	常宝股份	48,500	241,530.00	0.22
107	300435	中泰股份	20,500	241,285.00	0.22
108	688300	联瑞新材	5,000	240,500.00	0.22
109	603367	辰欣药业	17,200	239,768.00	0.22
110	000534	万泽股份	24,100	239,313.00	0.22
111	688621	阳光诺和	5,600	239,120.00	0.22
112	000822	山东海化	41,000	239,030.00	0.22
113	300193	佳士科技	32,000	237,440.00	0.22
114	603611	诺力股份	13,900	236,856.00	0.22
115	600479	千金药业	23,200	235,944.00	0.22
116	300590	移为通信	20,600	235,252.00	0.22

117	002093	国脉科技	38,600	234,302.00	0.22
118	002803	吉宏股份	21,000	233,730.00	0.22
119	688305	科德数控	3,600	232,056.00	0.21
120	002117	东港股份	32,600	230,808.00	0.21
121	688049	炬芯科技	10,400	230,048.00	0.21
122	300653	正海生物	11,300	229,955.00	0.21
123	002968	新大正	25,800	229,878.00	0.21
124	300939	秋田微	7,600	229,064.00	0.21
125	000544	中原环保	29,100	229,017.00	0.21
126	300872	天阳科技	17,200	227,900.00	0.21
127	603809	豪能股份	28,200	227,856.00	0.21
128	688391	钜泉科技	7,785	227,088.45	0.21
129	300127	银河磁体	15,000	225,750.00	0.21
130	300900	广联航空	12,040	225,509.20	0.21
131	300019	硅宝科技	17,000	225,250.00	0.21
132	300667	必创科技	16,600	224,598.00	0.21
133	000906	浙商中拓	33,100	223,094.00	0.21
134	002543	万和电气	22,300	222,108.00	0.20
135	688589	力合微	8,800	221,848.00	0.20
136	603867	新化股份	9,500	221,635.00	0.20
137	300516	久之洋	7,700	221,067.00	0.20
138	600979	广安爱众	65,600	220,416.00	0.20
139	002469	三维化学	38,600	220,020.00	0.20
140	002017	东信和平	26,400	219,912.00	0.20
141	688181	八亿时空	11,600	219,820.00	0.20
142	603667	五洲新春	13,400	219,760.00	0.20
143	301297	富乐德	10,800	219,348.00	0.20
144	688510	航亚科技	11,900	219,079.00	0.20
145	300286	安科瑞	10,100	218,564.00	0.20
146	300354	东华测试	7,000	217,490.00	0.20
147	300729	乐歌股份	14,000	216,860.00	0.20
148	002033	丽江股份	24,600	215,496.00	0.20
149	300481	濮阳惠成	15,600	215,280.00	0.20
150	002448	中原内配	37,500	215,250.00	0.20
151	688410	山外山	10,100	215,130.00	0.20
152	301366	一博科技	6,300	214,452.00	0.20
153	002014	永新股份	22,500	213,300.00	0.20
154	002677	浙江美大	26,200	212,482.00	0.20
155	300580	贝斯特	14,438	212,238.60	0.20
156	301421	波长光电	4,900	211,827.00	0.20
157	688259	创耀科技	5,300	211,788.00	0.20
158	000899	赣能股份	21,800	210,806.00	0.19
159	300617	安靠智电	7,500	210,375.00	0.19

160	300905	宝丽迪	7,400	210,234.00	0.19
161	603191	望变电气	14,200	210,160.00	0.19
162	688687	凯因科技	8,200	209,182.00	0.19
163	300925	法本信息	20,700	208,863.00	0.19
164	603096	新经典	12,300	207,870.00	0.19
165	603396	金辰股份	6,400	207,808.00	0.19
166	300389	艾比森	16,800	206,304.00	0.19
167	603078	江化微	15,400	206,206.00	0.19
168	002870	香山股份	6,900	205,827.00	0.19
169	301062	上海艾录	20,100	205,221.00	0.19
170	300507	苏奥传感	35,600	204,700.00	0.19
171	603360	百傲化学	17,400	204,450.00	0.19
172	002090	金智科技	23,500	203,040.00	0.19
173	300592	华凯易佰	17,760	202,996.80	0.19
174	002843	泰嘉股份	13,200	202,092.00	0.19
175	002970	锐明技术	5,600	201,768.00	0.19
176	002026	山东威达	24,300	201,690.00	0.19
177	605016	百龙创园	9,900	201,663.00	0.19
178	688356	键凯科技	3,400	199,852.00	0.18
179	603878	武进不锈	30,500	199,470.00	0.18
180	688035	德邦科技	6,100	196,542.00	0.18
181	301251	威尔高	5,700	196,251.00	0.18
182	000707	双环科技	28,600	195,624.00	0.18
183	603357	设计总院	21,200	194,828.00	0.18
184	000551	创元科技	22,300	194,679.00	0.18
185	300403	汉字集团	28,000	191,240.00	0.18
186	301004	嘉益股份	2,100	191,100.00	0.18
187	300870	欧陆通	4,400	190,872.00	0.18
188	300275	梅安森	19,100	190,427.00	0.18
189	002029	七匹狼	37,400	188,496.00	0.17
190	601579	会稽山	18,400	188,416.00	0.17
191	300447	全信股份	15,200	188,176.00	0.17
192	300976	达瑞电子	4,100	187,985.00	0.17
193	300926	博俊科技	9,385	187,887.70	0.17
194	605577	龙版传媒	12,000	186,360.00	0.17
195	002062	宏润建设	53,500	186,180.00	0.17
196	300424	航新科技	15,200	185,896.00	0.17
197	300792	壹网壹创	12,300	185,115.00	0.17
198	300706	阿石创	9,700	185,076.00	0.17
199	301508	中机认检	5,000	184,800.00	0.17
200	002632	道明光学	22,800	183,768.00	0.17
201	300547	川环科技	11,200	183,120.00	0.17
202	688678	福立旺	16,900	183,027.00	0.17

203	301162	国能日新	4,200	182,952.00	0.17
204	603053	成都燃气	18,900	182,574.00	0.17
205	300441	鲍斯股份	30,500	180,865.00	0.17
206	301282	金禄电子	7,600	180,728.00	0.17
207	603012	创力集团	40,300	179,738.00	0.17
208	300453	三鑫医疗	28,000	178,920.00	0.16
209	301486	致尚科技	4,200	177,702.00	0.16
210	603970	中农立华	10,400	177,632.00	0.16
211	002112	三变科技	20,000	177,600.00	0.16
212	300445	康斯特	11,000	177,100.00	0.16
213	300636	同和药业	17,400	176,958.00	0.16
214	603859	能科科技	8,400	176,568.00	0.16
215	603230	内蒙新华	15,300	176,562.00	0.16
216	300791	仙乐健康	7,000	176,400.00	0.16
217	300833	浩洋股份	3,800	176,320.00	0.16
218	688138	清溢光电	8,200	176,300.00	0.16
219	300884	狄耐克	20,400	175,848.00	0.16
220	300040	九洲集团	28,500	175,560.00	0.16
221	600784	鲁银投资	37,000	175,380.00	0.16
222	600268	国电南自	30,400	173,584.00	0.16
223	603408	建霖家居	13,100	172,789.00	0.16
224	688222	成都先导	15,200	172,520.00	0.16
225	300341	麦克奥迪	20,100	172,458.00	0.16
226	300569	天能重工	41,400	172,224.00	0.16
227	300951	博硕科技	5,500	171,325.00	0.16
228	301215	中汽股份	29,200	171,112.00	0.16
229	300484	蓝海华腾	12,400	170,996.00	0.16
230	688376	美埃科技	5,451	170,943.36	0.16
231	300532	今天国际	13,900	170,831.00	0.16
232	300384	三联虹普	13,000	170,560.00	0.16
233	002779	中坚科技	6,000	170,040.00	0.16
234	002943	宇晶股份	8,200	169,494.00	0.16
235	301127	天源环保	14,300	169,026.00	0.16
236	300192	科德教育	17,200	168,904.00	0.16
237	605108	同庆楼	7,900	168,744.00	0.16
238	300802	矩子科技	10,700	168,739.00	0.16
239	002783	凯龙股份	23,000	168,360.00	0.16
240	300239	东宝生物	35,700	168,147.00	0.16
241	603203	快克智能	7,100	167,418.00	0.15
242	300606	金太阳	9,000	167,040.00	0.15
243	300160	秀强股份	35,600	166,608.00	0.15
244	300852	四会富仕	5,700	165,984.00	0.15
245	002140	东华科技	21,400	165,850.00	0.15

246	300439	美康生物	18,100	165,796.00	0.15
247	603416	信捷电气	5,800	165,764.00	0.15
248	688025	杰普特	4,100	165,599.00	0.15
249	603558	健盛集团	16,600	165,170.00	0.15
250	300543	朗科智能	20,600	164,800.00	0.15
251	603365	水星家纺	10,500	164,325.00	0.15
252	002282	博深股份	25,700	164,223.00	0.15
253	301439	泓淋电力	12,900	163,443.00	0.15
254	002606	大连电瓷	21,600	162,216.00	0.15
255	300822	贝仕达克	13,900	162,074.00	0.15
256	603158	腾龙股份	23,000	161,920.00	0.15
257	002083	孚日股份	38,200	161,586.00	0.15
258	300421	力星股份	17,500	160,475.00	0.15
259	301132	满坤科技	4,200	160,398.00	0.15
260	300809	华辰装备	7,900	160,054.00	0.15
261	603800	道森股份	8,000	160,000.00	0.15
262	300835	龙磁科技	5,500	159,775.00	0.15
263	301061	匠心家居	3,400	159,664.00	0.15
264	300100	双林股份	14,800	159,396.00	0.15
265	600368	五洲交通	44,500	158,865.00	0.15
266	600897	厦门空港	12,500	157,625.00	0.15
267	301018	申菱环境	8,100	157,464.00	0.15
268	603518	锦泓集团	17,800	156,640.00	0.14
269	688103	国力股份	4,500	156,420.00	0.14
270	300105	龙源技术	24,200	156,332.00	0.14
271	300515	三德科技	15,800	155,946.00	0.14
272	300272	开能健康	31,700	155,330.00	0.14
273	601089	福元医药	11,200	155,120.00	0.14
274	600262	北方股份	9,400	154,442.00	0.14
275	600523	贵航股份	15,600	154,440.00	0.14
276	605098	行动教育	3,600	153,432.00	0.14
277	301149	隆华新材	16,600	153,384.00	0.14
278	002674	兴业科技	14,900	152,278.00	0.14
279	300718	长盛轴承	11,000	152,020.00	0.14
280	603199	九华旅游	5,100	151,980.00	0.14
281	688308	欧科亿	7,800	151,476.00	0.14
282	002752	昇兴股份	29,900	151,294.00	0.14
283	603897	长城科技	8,600	150,930.00	0.14
284	300830	金现代	24,800	150,784.00	0.14
285	301387	光大同创	4,500	150,750.00	0.14
286	688269	凯立新材	5,900	150,745.00	0.14
287	003032	传智教育	15,000	150,150.00	0.14
288	300908	仲景食品	5,400	150,012.00	0.14

289	300179	四方达	22,600	149,386.00	0.14
290	001205	盛航股份	9,200	148,672.00	0.14
291	301550	斯菱股份	3,100	148,521.00	0.14
292	688628	优利德	4,500	147,465.00	0.14
293	300938	信测标准	7,400	147,112.00	0.14
294	301191	菲菱科思	2,100	146,937.00	0.14
295	002918	蒙娜丽莎	16,200	146,772.00	0.14
296	600469	风神股份	25,100	146,584.00	0.14
297	301362	民爆光电	4,300	146,458.00	0.14
298	301525	儒竞科技	2,600	146,328.00	0.13
299	301012	扬电科技	5,900	146,084.00	0.13
300	300815	玉禾田	12,500	145,500.00	0.13
301	300795	米奥会展	8,300	145,499.00	0.13
302	301101	明月镜片	6,500	145,210.00	0.13
303	300739	明阳电路	10,200	144,330.00	0.13
304	603929	亚翔集成	6,000	143,400.00	0.13
305	002404	嘉欣丝绸	27,100	143,359.00	0.13
306	300400	劲拓股份	12,500	143,000.00	0.13
307	688028	沃尔德	8,700	142,941.00	0.13
308	002880	卫光生物	5,100	142,902.00	0.13
309	300941	创识科技	7,900	142,674.00	0.13
310	002940	昂利康	9,800	141,904.00	0.13
311	003013	地铁设计	10,000	141,800.00	0.13
312	605058	澳弘电子	7,200	141,696.00	0.13
313	300452	山河药辅	12,400	140,864.00	0.13
314	688059	华锐精密	3,100	140,678.00	0.13
315	688377	迪威尔	10,700	140,170.00	0.13
316	300880	迦南智能	7,100	139,373.00	0.13
317	300632	光莆股份	14,000	139,300.00	0.13
318	603579	荣泰健康	9,000	139,140.00	0.13
319	300092	科新机电	12,900	138,804.00	0.13
320	603380	易德龙	6,900	138,552.00	0.13
321	603119	浙江荣泰	7,800	138,216.00	0.13
322	301345	涛涛车业	2,500	137,750.00	0.13
323	688663	新风光	5,900	137,293.00	0.13
324	603811	诚意药业	21,900	136,875.00	0.13
325	001207	联科科技	9,400	136,488.00	0.13
326	002615	哈尔斯	21,900	135,780.00	0.13
327	600283	钱江水利	10,700	135,248.00	0.12
328	300818	耐普矿机	5,300	135,150.00	0.12
329	301179	泽宇智能	6,800	132,328.00	0.12
330	600814	杭州解百	22,400	132,160.00	0.12
331	605369	拱东医疗	3,300	131,670.00	0.12

332	003020	立方制药	7,200	131,616.00	0.12
333	688799	华纳药厂	3,100	131,533.00	0.12
334	000529	广弘控股	22,200	130,536.00	0.12
335	603058	永吉股份	16,400	130,380.00	0.12
336	301160	翔楼新材	3,500	130,375.00	0.12
337	600738	丽尚国潮	35,400	129,918.00	0.12
338	603339	四方科技	14,300	129,701.00	0.12
339	001208	华菱线缆	17,100	129,618.00	0.12
340	301329	信音电子	6,700	129,511.00	0.12
341	603551	奥普科技	13,200	129,360.00	0.12
342	002823	凯中精密	10,600	129,320.00	0.12
343	301201	诚达药业	7,100	129,220.00	0.12
344	605088	冠盛股份	6,200	129,208.00	0.12
345	301328	维峰电子	3,500	129,185.00	0.12
346	301566	达利凯普	7,600	128,972.00	0.12
347	301280	珠城科技	3,300	128,040.00	0.12
348	300700	岱勒新材	16,420	127,747.60	0.12
349	605337	李子园	13,000	127,660.00	0.12
350	300847	中船汉光	8,800	127,512.00	0.12
351	603052	可川科技	4,520	127,238.00	0.12
352	603602	纵横通信	10,200	127,194.00	0.12
353	300873	海晨股份	8,700	126,846.00	0.12
354	688179	阿拉丁	13,000	125,710.00	0.12
355	605277	新亚电子	9,700	125,324.00	0.12
356	300863	卡倍亿	3,700	125,097.00	0.12
357	603193	润本股份	6,800	125,052.00	0.12
358	301507	民生健康	9,900	124,938.00	0.12
359	300978	东箭科技	13,500	124,605.00	0.11
360	688205	德科立	4,320	124,459.20	0.11
361	300969	恒帅股份	1,800	124,434.00	0.11
362	000655	金岭矿业	22,500	124,425.00	0.11
363	603966	法兰泰克	18,100	124,347.00	0.11
364	301026	浩通科技	5,400	123,984.00	0.11
365	601065	江盐集团	14,300	123,981.00	0.11
366	301509	金凯生科	3,400	123,692.00	0.11
367	300440	运达科技	23,500	123,375.00	0.11
368	300982	苏文电能	6,500	122,590.00	0.11
369	002412	汉森制药	23,600	122,012.00	0.11
370	688698	伟创电气	4,500	121,365.00	0.11
371	603088	宁波精达	16,000	120,480.00	0.11
372	603209	兴通股份	8,700	120,408.00	0.11
373	605378	野马电池	7,800	120,276.00	0.11
374	301086	鸿富瀚	3,000	120,270.00	0.11

375	688117	圣诺生物	4,900	120,246.00	0.11
376	603309	维力医疗	10,900	120,009.00	0.11
377	688551	科威尔	3,800	119,700.00	0.11
378	688697	纽威数控	7,600	119,244.00	0.11
379	603519	立霸股份	10,500	118,755.00	0.11
380	300722	新余国科	5,940	118,681.20	0.11
381	603689	皖天然气	14,400	118,368.00	0.11
382	002790	瑞尔特	13,100	118,293.00	0.11
383	688080	映翰通	3,900	118,287.00	0.11
384	603931	格林达	5,800	117,914.00	0.11
385	603318	水发燃气	20,800	117,728.00	0.11
386	605128	上海沿浦	4,200	117,138.00	0.11
387	300062	中能电气	24,000	116,880.00	0.11
388	002956	西麦食品	8,500	116,790.00	0.11
389	603916	苏博特	17,400	116,754.00	0.11
390	000411	英特集团	12,100	116,523.00	0.11
391	001215	千味央厨	4,100	115,907.00	0.11
392	603136	天目湖	10,600	115,858.00	0.11
393	603061	金海通	1,800	115,704.00	0.11
394	002917	金奥博	13,000	115,440.00	0.11
395	300787	海能实业	9,300	115,413.00	0.11
396	003038	鑫铂股份	7,800	115,206.00	0.11
397	603125	常青科技	6,580	113,241.80	0.10
398	000548	湖南投资	27,800	111,756.00	0.10
399	603165	荣晟环保	10,500	111,510.00	0.10
400	001326	联域股份	3,100	111,166.00	0.10
401	300797	钢研纳克	12,000	111,120.00	0.10
402	003025	思进智能	9,000	110,790.00	0.10
403	300697	电工合金	10,100	110,494.00	0.10
404	300731	科创新源	7,500	109,800.00	0.10
405	603239	浙江仙通	8,000	109,680.00	0.10
406	301129	瑞纳智能	4,300	108,532.00	0.10
407	301303	真兰仪表	9,400	108,288.00	0.10
408	002835	同为股份	6,400	108,096.00	0.10
409	300962	中金辐照	7,900	107,756.00	0.10
410	688357	建龙微纳	4,600	107,180.00	0.10
411	301393	昊帆生物	2,511	106,642.17	0.10
412	301028	东亚机械	12,100	106,117.00	0.10
413	601177	杭齿前进	15,300	105,876.00	0.10
414	301488	豪恩汽电	2,200	105,820.00	0.10
415	605167	利柏特	13,500	105,435.00	0.10
416	002983	芯瑞达	6,300	104,895.00	0.10
417	300756	金马游乐	7,000	104,440.00	0.10

418	301333	诺思格	3,100	104,191.00	0.10
419	603066	音飞储存	11,400	104,082.00	0.10
420	300990	同飞股份	3,700	104,007.00	0.10
421	605598	上海港湾	4,700	103,823.00	0.10
422	603097	江苏华辰	3,900	103,428.00	0.10
423	301168	通灵股份	3,700	102,786.00	0.09
424	300622	博士眼镜	8,400	102,228.00	0.09
425	688236	春立医疗	7,200	102,096.00	0.09
426	603040	新坐标	5,100	101,643.00	0.09
427	688569	铁科轨道	4,900	101,283.00	0.09
428	301048	金鹰重工	12,200	101,260.00	0.09
429	301076	新瀚新材	5,200	100,724.00	0.09
430	688468	科美诊断	15,900	100,647.00	0.09
431	300265	通光线缆	14,400	100,512.00	0.09
432	300911	亿田智能	3,930	99,979.20	0.09
433	603062	麦加芯彩	3,000	99,630.00	0.09
434	301338	凯格精机	3,100	99,603.00	0.09
435	301383	天键股份	3,800	99,256.00	0.09
436	301413	安培龙	2,400	99,240.00	0.09
437	301199	迈赫股份	4,100	99,138.00	0.09
438	605319	无锡振华	5,600	99,120.00	0.09
439	301083	百胜智能	6,100	99,003.00	0.09
440	001328	登康口腔	3,900	98,670.00	0.09
441	603817	海峡环保	20,700	98,532.00	0.09
442	301266	宇邦新材	3,200	98,048.00	0.09
443	688636	智明达	4,300	98,040.00	0.09
444	301211	亨迪药业	6,700	97,887.00	0.09
445	002687	乔治白	23,300	97,860.00	0.09
446	301187	欧圣电气	4,000	97,000.00	0.09
447	603706	东方环宇	6,600	96,690.00	0.09
448	300824	北鼎股份	13,300	96,425.00	0.09
449	301391	卡莱特	2,200	96,316.00	0.09
450	605018	长华集团	10,600	96,036.00	0.09
451	002616	长青集团	22,200	95,904.00	0.09
452	301128	强瑞技术	2,400	95,520.00	0.09
453	001217	华尔泰	10,400	95,160.00	0.09
454	002730	电光科技	13,500	95,040.00	0.09
455	688566	吉贝尔	4,200	94,500.00	0.09
456	688112	鼎阳科技	3,500	94,465.00	0.09
457	300993	玉马遮阳	10,500	93,870.00	0.09
458	300616	尚品宅配	8,400	92,904.00	0.09
459	605158	华达新材	14,400	92,592.00	0.09
460	605005	合兴股份	5,800	92,568.00	0.09

461	301046	能辉科技	4,700	92,449.00	0.09
462	301568	思泰克	2,900	92,278.00	0.09
463	001306	夏厦精密	1,700	91,783.00	0.08
464	603757	大元泵业	4,800	91,680.00	0.08
465	301456	盘古智能	3,500	91,315.00	0.08
466	300314	戴维医疗	8,800	90,992.00	0.08
467	301000	肇民科技	6,340	90,979.00	0.08
468	688226	威腾电气	5,200	90,896.00	0.08
469	300918	南山智尚	9,500	90,630.00	0.08
470	688533	上声电子	3,500	90,545.00	0.08
471	301382	蜂助手	5,000	90,450.00	0.08
472	603217	元利科技	6,400	90,240.00	0.08
473	301548	崇德科技	1,700	90,236.00	0.08
474	605286	同力日升	3,700	90,021.00	0.08
475	001216	华瓷股份	7,100	89,176.00	0.08
476	003002	壶化股份	8,100	88,857.00	0.08
477	603324	盛剑环境	3,300	88,143.00	0.08
478	300154	瑞凌股份	16,500	87,945.00	0.08
479	603180	金牌家居	4,600	87,906.00	0.08
480	300727	润禾材料	4,000	87,840.00	0.08
481	301319	唯特偶	2,925	87,837.75	0.08
482	301459	丰茂股份	2,200	87,362.00	0.08
483	603219	富佳股份	5,900	87,084.00	0.08
484	301110	青木科技	2,940	86,818.20	0.08
485	301195	北路智控	2,900	86,246.00	0.08
486	301257	普蕊斯	3,050	86,162.50	0.08
487	002981	朝阳科技	4,680	85,690.80	0.08
488	688580	伟思医疗	3,200	85,632.00	0.08
489	002492	恒基达鑫	18,600	85,560.00	0.08
490	002732	燕塘乳业	5,900	85,373.00	0.08
491	301252	同星科技	2,805	84,458.55	0.08
492	002889	东方嘉盛	5,040	84,168.00	0.08
493	301277	新天地	6,480	84,110.40	0.08
494	301418	协昌科技	2,100	84,000.00	0.08
495	301181	标榜股份	3,700	83,916.00	0.08
496	301020	密封科技	5,300	83,846.00	0.08
496	605080	浙江自然	5,300	83,846.00	0.08
497	300774	倍杰特	12,800	83,584.00	0.08
498	300916	朗特智能	3,300	83,094.00	0.08
499	300943	春晖智控	7,700	83,083.00	0.08
500	301158	德石股份	6,700	82,879.00	0.08
501	688310	迈得医疗	6,300	82,782.00	0.08
502	300997	欢乐家	7,000	82,740.00	0.08

503	603173	福斯达	3,800	82,498.00	0.08
504	300963	中洲特材	7,500	80,700.00	0.07
505	001219	青岛食品	6,790	79,918.30	0.07
506	300539	横河精密	9,900	79,695.00	0.07
507	603856	东宏股份	7,800	79,404.00	0.07
508	301172	君逸数码	2,700	79,326.00	0.07
509	001380	华纬科技	4,048	78,693.12	0.07
510	301520	万邦医药	1,900	78,622.00	0.07
511	603676	卫信康	9,800	78,498.00	0.07
512	301261	恒工精密	2,100	77,847.00	0.07
513	002817	黄山胶囊	14,500	77,430.00	0.07
514	301398	星源卓镁	1,900	77,045.00	0.07
515	300898	熊猫乳品	4,600	76,866.00	0.07
516	300988	津荣天宇	3,600	76,716.00	0.07
517	688501	青达环保	5,600	76,608.00	0.07
518	688160	步科股份	1,900	75,981.00	0.07
519	605299	舒华体育	9,300	75,516.00	0.07
520	301208	中亦科技	2,760	75,513.60	0.07
521	301529	福赛科技	2,300	75,463.00	0.07
522	603102	百合股份	2,500	75,275.00	0.07
523	300828	锐新科技	6,300	74,781.00	0.07
524	300946	恒而达	2,800	74,592.00	0.07
525	301133	金钟股份	3,400	74,086.00	0.07
526	300402	宝色股份	5,700	73,986.00	0.07
527	300488	恒锋工具	3,600	73,260.00	0.07
528	301229	纽泰格	3,100	72,943.00	0.07
529	301310	鑫宏业	3,020	72,782.00	0.07
530	603836	海程邦达	5,400	72,738.00	0.07
531	301323	新莱福	2,300	72,634.00	0.07
532	001228	永泰运	3,400	71,672.00	0.07
533	301122	采纳股份	3,800	71,554.00	0.07
534	605580	恒盛能源	8,000	71,280.00	0.07
535	688722	同益中	6,300	70,497.00	0.06
536	605089	味知香	3,300	70,422.00	0.06
537	301092	争光股份	3,100	70,184.00	0.06
538	001358	兴欣新材	3,400	69,768.00	0.06
539	300950	德固特	4,500	68,580.00	0.06
540	301377	鼎泰高科	3,900	68,445.00	0.06
541	688252	天德钰	4,700	68,291.00	0.06
542	603090	宏盛股份	3,800	67,716.00	0.06
543	688358	祥生医疗	2,600	67,522.00	0.06
544	605389	长龄液压	3,200	67,168.00	0.06
545	603190	亚通精工	2,900	66,584.00	0.06

546	301386	未来电器	3,200	66,368.00	0.06
547	300508	维宏股份	3,400	66,062.00	0.06
548	001318	阳光乳业	6,400	65,856.00	0.06
549	301278	快可电子	2,000	65,040.00	0.06
550	605028	世茂能源	4,500	64,935.00	0.06
551	301322	绿通科技	3,440	64,568.80	0.06
552	300881	盛德鑫泰	2,500	64,225.00	0.06
553	301505	苏州规划	2,100	63,000.00	0.06
554	300864	南大环境	3,200	62,720.00	0.06
555	301137	哈焊华通	4,300	62,651.00	0.06
556	001316	润贝航科	2,000	62,620.00	0.06
557	301170	锡南科技	2,400	62,520.00	0.06
558	301255	通力科技	2,000	62,360.00	0.06
559	688078	龙软科技	2,700	62,181.00	0.06
560	605162	新中港	8,600	62,178.00	0.06
561	603948	建业股份	3,800	61,864.00	0.06
562	002887	绿茵生态	9,500	61,845.00	0.06
563	301197	工大科雅	4,700	61,664.00	0.06
564	688618	三旺通信	2,456	61,473.68	0.06
565	301428	世纪恒通	2,100	60,270.00	0.06
566	603908	牧高笛	3,000	60,180.00	0.06
567	301379	天山电子	3,260	60,114.40	0.06
568	301399	英特科技	3,030	59,630.40	0.05
569	603949	雪龙集团	5,200	58,552.00	0.05
570	001360	南矿集团	4,700	57,763.00	0.05
571	301419	阿莱德	2,300	57,109.00	0.05
572	603163	圣晖集成	2,200	56,760.00	0.05
573	301227	森鹰窗业	3,000	56,430.00	0.05
574	001223	欧克科技	1,600	56,304.00	0.05
575	300945	曼卡龙	6,300	56,133.00	0.05
576	001319	铭科精技	3,400	55,420.00	0.05
577	301272	英华特	1,400	54,012.00	0.05
578	603282	亚光股份	3,200	53,952.00	0.05
579	301203	国泰环保	1,900	53,789.00	0.05
580	605300	佳禾食品	4,900	53,606.00	0.05
581	301276	嘉曼服饰	2,500	52,400.00	0.05
582	300817	双飞集团	4,900	52,038.00	0.05
583	301360	荣旗科技	1,200	51,900.00	0.05
584	301380	挖金客	1,600	51,264.00	0.05
585	001299	美能能源	4,300	50,740.00	0.05
586	603213	镇洋发展	6,700	50,116.00	0.05
587	301186	超达装备	1,600	50,080.00	0.05
588	603848	好太太	3,800	47,842.00	0.04

589	603307	扬州金泉	1,500	47,160.00	0.04
590	001367	海森药业	2,000	46,680.00	0.04
591	301119	正强股份	2,400	45,408.00	0.04
592	003033	征和工业	1,900	44,023.00	0.04
593	603280	南方路机	2,200	43,648.00	0.04
594	605151	西上海	2,900	42,485.00	0.04
595	001234	泰慕士	2,400	40,776.00	0.04
596	603291	联合水务	3,300	40,458.00	0.04

7.3.2 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	301539	宏鑫科技	3,549	91,166.06	0.08
2	301591	肯特股份	284	10,745.42	0.01
3	301538	骏鼎达	109	9,945.16	0.01
4	301536	星宸科技	280	9,035.60	0.01
5	301588	美新科技	257	5,461.25	0.01
6	301565	中仑新材	266	5,048.68	0.00
7	301587	中瑞股份	199	5,026.74	0.00
8	001359	平安电工	101	2,080.60	0.00
9	000040	ST 旭蓝	40,900	0.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	300401	花园生物	1,046,537.00	0.22
2	688308	欧科亿	971,796.68	0.21
3	688117	圣诺生物	965,197.93	0.20
4	603619	中曼石油	930,593.00	0.20
5	688353	华盛锂电	890,376.96	0.19
6	688345	博力威	889,700.74	0.19
7	603052	可川科技	887,367.00	0.19
8	300360	炬华科技	885,692.00	0.19
9	603507	振江股份	863,611.00	0.18
10	688199	久日新材	821,642.15	0.17
11	688670	金迪克	813,371.94	0.17
12	603960	克来机电	795,456.00	0.17
13	688292	浩瀚深度	783,690.42	0.17
14	688156	路德环境	774,147.99	0.16
15	300480	光力科技	774,120.00	0.16
16	300181	佐力药业	771,462.00	0.16
17	688121	卓然股份	760,994.53	0.16

18	688077	大地熊	755,193.79	0.16
19	300592	华凯易佰	738,078.40	0.16
20	688613	奥精医疗	735,475.62	0.16

注：“买入金额”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。

7.4.2 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	603960	克来机电	971,247.00	0.21
2	603050	科林电气	871,719.80	0.18
3	688353	华盛锂电	853,020.17	0.18
4	688117	圣诺生物	832,789.67	0.18
5	600200	江苏吴中	820,519.00	0.17
6	688345	博力威	816,781.64	0.17
7	600301	华锡有色	810,706.00	0.17
8	603507	振江股份	802,778.00	0.17
9	600053	九鼎投资	783,891.00	0.17
10	603663	三祥新材	777,232.12	0.16
11	688308	欧科亿	765,930.45	0.16
12	603998	方盛制药	763,073.00	0.16
13	600035	楚天高速	756,415.00	0.16
14	603131	上海沪工	755,051.00	0.16
15	688199	久日新材	744,331.17	0.16
16	600636	国新文化	744,226.00	0.16
17	600706	曲江文旅	742,556.00	0.16
18	603722	阿科力	736,900.00	0.16
19	600318	新力金融	735,678.00	0.16
20	688766	普冉股份	733,570.84	0.15

注：“卖出金额”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。

7.4.3 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	434,085,685.20
卖出股票收入（成交）总额	204,822,612.01

注：“买入股票成本”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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

7.6 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

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期无股指期货投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**7.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期无国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期无国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注**7.12.1 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，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

7.12.2 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，没有投资超出基金合同规定备选库以外的股票。

7.12.3 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	164,510.90
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	75,409.12
8	其他	-
9	合计	239,920.02

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 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无流通受限的股票。

7.12.5.2 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	301538	骏鼎达	9,945.16	0.01	新股锁定
2	301536	星辰科技	9,035.60	0.01	新股锁定
3	301591	肯特股份	8,098.62	0.01	新股锁定
4	301539	宏鑫科技	7,036.10	0.01	新股锁定
5	301588	美新科技	5,461.25	0.01	新股锁定

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
1,389	99,752.40	18,201,376.00	13.14	120,354,713.00	86.86

8.2 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	广发证券股份有限公司	3,747,267.00	2.70
2	东营奥远工贸有限责任公司	3,000,058.00	2.17
3	华泰证券股份有限公司	2,584,939.00	1.87
4	方正证券股份有限公司	2,498,289.00	1.80
5	苏永东	2,000,155.00	1.44
6	王影	2,000,155.00	1.44
7	成都优卡数信信息科技有限公司	2,000,155.00	1.44

8	成都优卡信息科技有限公司	2,000,155.00	1.44
9	高昌	1,990,116.00	1.44
10	张冬梅	1,500,038.00	1.08

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：无。

8.4 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、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2023年12月27日） 基金份额总额	471,556,089.00
本报告期期初基金份额总额	471,556,089.00
本报告期基金总申购份额	168,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	501,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	138,556,089.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人无重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 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、基金财产的诉讼事项。

本报告期内，无涉及基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘用普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 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，托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中未受到相关监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	2	493,915,636.51	77.34	363,474.05	77.34	-
中信证券	2	144,694,726.98	22.66	106,478.65	22.66	-

注：1 基金交易单元的选择标准如下：

- (1) 研究实力
- (2) 业务服务水平
- (3) 综合类研究服务对投资业绩贡献度
- (4) 专题类服务

2 本基金管理人负责根据上述选择标准，考察后与确定选用交易单元的券商签订交易单元租用协议。

3、本基金本报告期合同生效，上述租用席位均为本期新增所用。

10.7.2 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 (%)

兴业证 券	-	-	-	-	-	-
中信证 券	-	-	-	-	-	-

10.8 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	平安基金管理有限公司平安中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金开放申购赎回业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 01 月 05 日
2	平安中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金份额上市交易公告书	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 01 月 05 日
3	平安中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金产品资料概要(更新)	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 01 月 10 日
4	关于平安中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金新增流动性服务商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 01 月 10 日
5	平安中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金上市交易提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 01 月 10 日
6	平安基金管理有限公司关于新增东方财富证券股份有限公司为平安中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金申购赎回代办机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 01 月 10 日
7	平安基金管理有限公司关于提醒投资者及时完善、更新身份信息资料以免影响业务办理的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 01 月 15 日
8	平安中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 01 月 30 日
9	平安中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金产品资料概要更新	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 01 月 31 日
10	平安中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金招募说明书更新	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 01 月 31 日
11	平安基金管理有限公司关于平安中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 02 月 20 日
12	平安基金管理有限公司关于基金经理休假由他人代为履职的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 04 月 11 日
13	平安中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金 2024 年第 1 季度	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 04 月 19 日

	报告		
14	平安基金管理有限公司关于旗下基金估值调整情况的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 06 月 28 日
15	平安中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 06 月 28 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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：无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

(1) 中国证监会准予平安中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金募集注册的文件

(2) 平安中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同

(3) 平安中证 2000 增强策略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、营业执照和公司章程

12.2 存放地点

深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层

12.3 查阅方式

(1) 投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件

(2) 投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人平安基金管理有限公司，客户服务电话：400-800-4800（免长途话费）

平安基金管理有限公司

2024 年 8 月 29 日