

嘉实中证 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：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中信证券股份有限公司

送出日期：2024 年 3 月 28 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。本年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中信证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 03 月 22 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。

本报告期自 2023 年 09 月 14 日（基金合同生效日）起至 2023 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
3.4 过去三年基金的利润分配情况	8
§ 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	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	13
4.10 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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 审计报告	13
6.1 审计报告基本信息	13
6.2 审计报告的基本内容	14
§ 7 年度财务报表	15
7.1 资产负债表	15
7.2 利润表	17
7.3 净资产变动表	18
7.4 报表附注	19

§ 8 投资组合报告	44
8.1 期末基金资产组合情况	44
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	45
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	67
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	71
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	71
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	71
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	71
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	71
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	71
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	72
8.12 投资组合报告附注	72
§ 9 基金份额持有人信息	73
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	73
9.2 期末上市基金前十名持有人	73
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	73
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	73
9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	74
§ 10 开放式基金份额变动	74
§ 11 重大事件揭示	74
11.1 基金份额持有人大会决议	74
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	74
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	75
11.4 基金投资策略的改变	75
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	75
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	75
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	75
11.8 其他重大事件	76
§ 12 备查文件目录	76
12.1 备查文件目录	76
12.2 存放地点	77
12.3 查阅方式	77

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	嘉实中证 2000ETF
场内简称	中证 2000ETF 指数
基金主代码	159535
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023 年 9 月 14 日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中信证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	43,981,088.00 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	2023 年 9 月 22 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。
投资策略	<p>本基金主要采取抽样复制法，基金管理人将综合考虑代表性、相关性、估值、流动性等因素挑选标的指数中成份股或备选成份股构建指数化投资组合，使构建的投资组合与标的指数在风险收益特征上尽可能相似，达到复制标的指数、降低交易成本的目的。</p> <p>如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过投资目标所述范围的，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。</p> <p>为了更好地实现跟踪标的指数的目的，基金管理人还可以综合考虑标的指数成份股的流动性、投资限制、交易成本及基金规模等因素，决定是否采用完全复制法的策略。</p> <p>具体投资策略包括：股票投资策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、衍生品投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略等。</p>
业绩比较基准	中证 2000 指数收益率
风险收益特征	<p>本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。</p> <p>本基金为被动式投资的股票型指数基金，跟踪标的指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。</p>

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		嘉实基金管理有限公司	中信证券股份有限公司
信息披露	姓名	胡勇钦	杨军智

负责人	联系电话	(010)65215588	010-60834299
	电子邮箱	service@jsfund.cn	yjz@citics.com
客户服务电话		400-600-8800	010-60836588
传真		(010)65215588	010-60834004
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 1806A 单元	广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座
办公地址		北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层	北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦 5 层
邮政编码		100020	100125
法定代表人		经雷	张佑君

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
基金年度报告备置地点	北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层嘉实基金管理有限公司

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）	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场二座普华永道中心 11 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 14 日（基金合同生效日）-2023 年 12 月 31 日
本期已实现收益	4,751,265.98
本期利润	4,508,395.20
加权平均基金份额本期利润	0.0318
本期加权平均净值利润率	3.16%
本期基金份额净值增长率	2.14%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末
期末可供分配利润	941,802.87
期末可供分配基金份额利润	0.0214
期末基金资产净值	44,922,890.87
期末基金份额净值	1.0214
3.1.3 累计期末指标	2023 年末
基金份额累计净值增长率	2.14%

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) 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) 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。

(4) 本基金合同生效日为 2023 年 09 月 14 日，本报告期自 2023 年 09 月 14 日起至 2023 年 12 月 31 日止。

3.2 基金净值表现

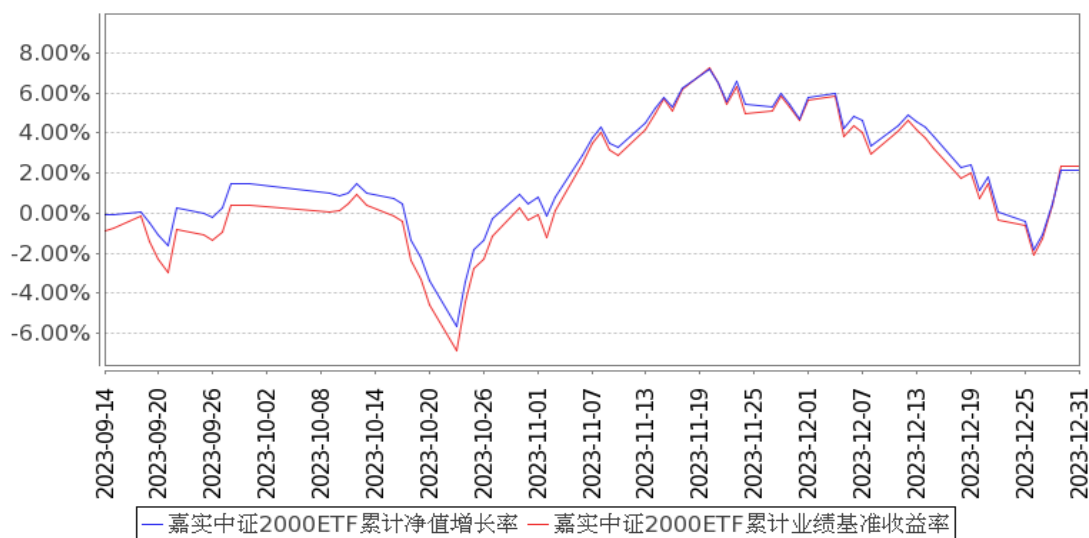
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.69%	1.02%	1.92%	1.10%	-1.23%	-0.08%
自基金合同生效起至今	2.14%	0.98%	2.31%	1.08%	-0.17%	-0.10%

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

嘉实中证2000ETF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

(2023年09月14日至2023年12月31日)

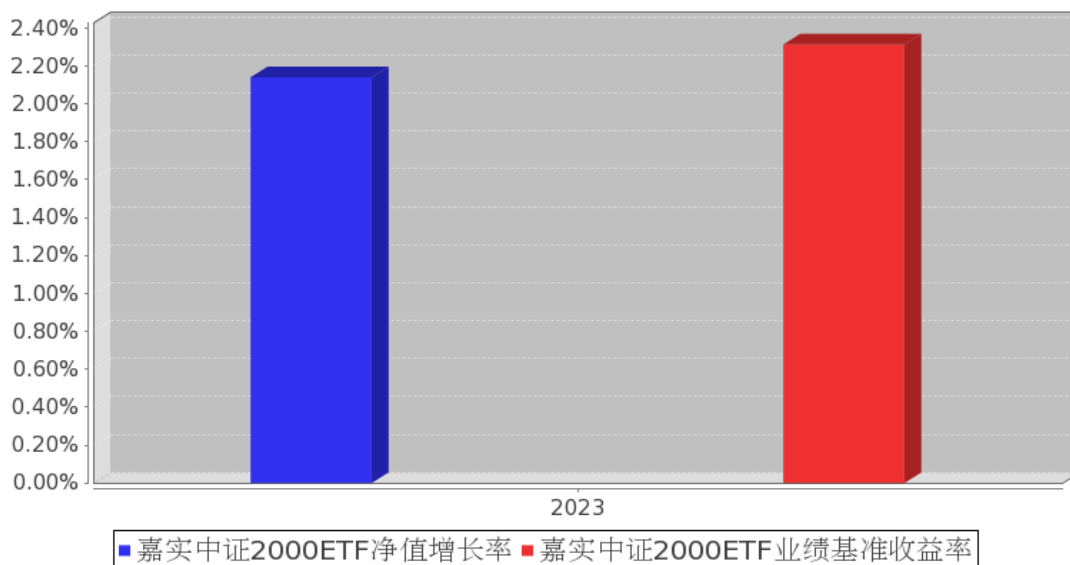


注：(1) 本基金合同生效日 2023 年 09 月 14 日至报告期末未满 1 年。

(2) 按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日 6 个月为建仓期，本报告期处于建仓期内。

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

嘉实中证2000ETF基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：上述数据根据基金当年实际存续期计算。

3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

无。

§ 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

嘉实基金管理有限公司经中国证监会证监基字[1999]5号文批准，于1999年3月25日成立，是中国第一批基金管理公司之一，是中外合资基金管理公司。公司注册地上海，总部设在北京并设北京、深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州、北京怀柔、武汉分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人、QDII和特定资产管理业务等资格。

截止2023年12月31日，基金管理人共管理334只公募基金，覆盖主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、资产配置、海外投资、FOF、基础设施基金等不同类别。同时，还管理多个全国社保、基本养老保险、企业年金、职业年金和单一/集合资产管理计划。

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		
李直	本基金、嘉实基本面 50 指数 (LOF)、嘉实深证基本面 120ETF、嘉实深证基本面 120ETF 联接、嘉实中证 500ETF、嘉实中证 500ETF 联接、嘉实基本面 50ETF、嘉实中证大农业 ETF、嘉实恒生科技 ETF (QDII)、嘉实中证科创创业 50ETF、嘉实中证新能源汽车指数、嘉实中证科创创业 50ETF 发起联接、嘉实中证信息安全主题 ETF、嘉实中证光伏产业指数发起式、嘉实中证大农业 ETF 发起联接、嘉实标普	2023 年 9 月 14 日	-	9 年	2014 年 7 月加入嘉实基金管理有限公司，从事指数基金投资研究工作，现任基金经理。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。

	石油天然气勘探及生产精选行业 ETF (QDII)、嘉实中证 100ETF 基金经理				
--	--------------------------------------------	--	--	--	--

注：（1）首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日，此后的非首任基金经理的“任职日期”指根据公司决定确定的聘任日期；“离任日期”指根据公司决定确定的解聘日期。

（2）证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

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循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，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。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无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

公司制定了《公平交易管理制度》，按照证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规的规定，从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度建设、内控措施和信息披露等多方面，境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易以及投资管理过程中各个相关环节应当符合公平交易的监管要求，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，杜绝不同投资组合之间进行利益输送，保护投资者合法权益。

公司严格执行《公平交易管理制度》，各投资组合能够公平地获得投资信息、投资建议，实施投资决策时享有公平的机会。所有组合投资决策与交易执行保持隔离，任何组合必须经过公司交易部门集中交易。各组合享有平等的交易权利，共享交易资源。对交易所公开竞价交易以及银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易制定专门的交易规则，保证各投资组合获得公平的交易机会。对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，严格遵循各投资组合交易前独立确定交易要素，交易后按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司公

公平交易制度，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现；对投资交易行为进行监察稽核，通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控和定期分析评估并完整详实记录相关信息，及时完成每季度和年度公平交易专项稽核。

报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，未发现违反公平交易制度的异常行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合参与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，合计 13 次，均为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，未发现不公平交易和利益输送行为。

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。本基金主要采用抽样复制法及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。

国内方面，2023 年我国经济总体呈现恢复态势，GDP 同比增长 5.2%。全年政策支持力度较高，至下半年多项经济数据已经回正，虽然受美联储加息波及，外资多有流出，致市场承压，但在长线资金入市、稳地产政策出台、投资消费数据恢复影响下，触底反转预期逐渐强化。进入四季度美联储已暂停加息，也为国内货币政策提供更充足空间。国外方面，在高通胀、美联储加息、地缘政治的影响下，全球经济波动加剧。主要经济体制造业 PMI 进入下行趋势。扩张性的财政政策导向推动美国债务水平大幅攀升，持续推高利率水平。进入四季度降息预期高企，但美国超预期的经济数据为联储货币政策的选择增加了不确定性。

本报告期内，本基金仍处于 6 个月建仓期内。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0214 元；本报告期基金份额净值增长率为 2.14%，业绩比较基准收益率为 2.31%。

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，降准降息等货币工具或可为宏观流动性提供充足支持，降低融资成本，企业利

润有望逐步恢复。在经济基本面符合预期的背景下，长线资金持续流入及更多稳增长政策落地有望强化市场信心，A股有望迎来复苏行情。

本基金作为一只投资于中证 2000 指数的被动投资管理产品，我们继续秉承指数化被动投资策略，积极应对基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击，降低本基金的跟踪误差，给投资者提供一个标准化的中证 2000 指数的投资工具。

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，基金管理人有关监察稽核工作情况如下：

(1) 继续内控前置。在基金营销、投资交易、信息披露以及新产品设计开发、海外业务、另类业务、制度建设、合同管理、法律咨询等方面，事前进行合规性审核、监控。全力支持新产品新业务新制度新客户新投资工具并进行合规性判断。在制度流程、投资范围、投资工具、运作规则等方面，防控重大风险。

(2) 全流程动态开展投资交易监督。一是事前防范，主要从事前研讨，合规风险识别、评估和分析，IT 事前设置，建立禁限库，合规培训、承诺书等方面开展；二是事中实时监控，如实时回答组合经理、交易员投资交易事项，盘中实时监控等；三是事后检查及改进，如检查投资交易合规情况，对异常行为进行提示、处理建议并督促改正。

(3) 按计划对销售、投资、后台和其它业务开展内部稽核，完成相应内审报告及其后续改进跟踪。完成公司及基金的外审、公司 GIPS 第三方验证、ISAE3402 国际鉴证等。

(4) 基金法务工作。包括合同、协议审查，主动解决各项法律文件以及实务运作中存在的差错和风险隐患，重点防控新增产品、新增业务以及日常业务的法律风险问题。

(5) 加强差错管理。继续推动各业务单元梳理流程、制度，落实风险责任授权体系，确保所有识别的关键风险点均有相应措施控制。

此外，我们还积极配合监管，按时完成合规报告和各项统计报表以及专题报告。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值专业委员会，委员由固定收益、交易、运营、风险管理、合规等部门负责人组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。报告期内，固定收益部门负责人同时兼任基金经理、估值委员，基金经理参

加估值专业委员会会议，但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；与估值相关的机构包括基金投资市场的各证券交易所以及境内相关机构等。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期，本基金未实施利润分配，符合法律法规和基金合同的相关约定。具体参见本报告“7.4.11 利润分配情况”。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中信证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在对嘉实中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期，嘉实基金管理有限公司在嘉实中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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

本报告期，由嘉实基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关嘉实中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2024)第 23409 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	嘉实中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了嘉实中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“嘉实中证 2000ETF 基金”)的财务报表,包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表,2023 年 9 月 14 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。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>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,公允反映了嘉实中证 2000ETF 基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年 9 月 14 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。</p>
形成审计意见的基础	<p>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。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于嘉实中证 2000ETF 基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	无
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>嘉实中证 2000ETF 基金的基金管理人嘉实基金管理有限公司(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。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估嘉实中证 2000ETF 基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算嘉实中证 2000ETF 基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督嘉实中证 2000ETF 基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>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</p>

	<p>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。</p> <p>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：</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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，就可能对嘉实中证 2000ETF 基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致嘉实中证 2000ETF 基金不能持续经营。</p> <p>(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。</p> <p>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。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	张勇 柴瀚英
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2024 年 03 月 25 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：嘉实中证 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
----	-----	-------------------------

资产：		
货币资金	7.4.7.1	1,211,531.67
结算备付金		261,856.81
存出保证金		378,709.58
交易性金融资产	7.4.7.2	43,388,083.47
其中：股票投资		43,364,363.21
基金投资		-
债券投资		23,720.26
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
债权投资	7.4.7.5	-
其中：债券投资		-
资产支持证券投资		-
其他投资		-
其他债权投资	7.4.7.6	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-
应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.8	-
资产总计		45,240,181.53
负债和净资产	附注号	本期末 2023年12月31日
负 债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		92,519.60
应付赎回款		-
应付管理人报酬		22,811.55
应付托管费		4,562.32
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	7.4.7.9	197,397.19
负债合计		317,290.66

净资产：		
实收基金	7.4.7.10	43,981,088.00
未分配利润	7.4.7.12	941,802.87
净资产合计		44,922,890.87
负债和净资产总计		45,240,181.53

注：本基金合同生效日为 2023 年 09 月 14 日，本报告期自基金合同生效日 2023 年 09 月 14 日起至 2023 年 12 月 31 日止。报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0214 元，基金份额总额 43,981,088.00 份。

7.2 利润表

会计主体：嘉实中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 9 月 14 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 14 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		4,870,267.98
1. 利息收入		177,220.90
其中：存款利息收入	7.4.7.13	177,220.90
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）		4,245,255.42
其中：股票投资收益	7.4.7.14	4,160,708.97
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.15	44,168.27
资产支持证券投资收益	7.4.7.16	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-
股利收益	7.4.7.19	40,378.18
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.20	-242,870.78
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	690,662.44
减：二、营业总支出		361,872.78
1. 管理人报酬		218,898.16
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费		43,779.60
3. 销售服务费		-

4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-
7. 税金及附加		0.02
8. 其他费用	7.4.7.23	99,195.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,508,395.20
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,508,395.20
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		4,508,395.20

7.3 净资产变动表

会计主体：嘉实中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 9 月 14 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 14 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-	-
二、本期期初净资产	490,981,088.00	-	-	490,981,088.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-447,000,000.0 0	-	941,802.87	-446,058,197.13
（一）、综合收益总额	-	-	4,508,395.20	4,508,395.20
（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）	-447,000,000.0 0	-	-3,566,592.33	-450,566,592.33
其中：1. 基金申购款	33,000,000.00	-	462,256.87	33,462,256.87
2. 基金赎回款	-480,000,000.0 0	-	-4,028,849.20	-484,028,849.20
（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）	-	-	-	-

填列)				
四、本期期末净资产	43,981,088.00	-	941,802.87	44,922,890.87

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：

<u>经雷</u>	<u>梁凯</u>	<u>李袁</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

嘉实中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2023]1936 号《关于准予嘉实中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》注册,由嘉实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《嘉实中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式,存续期限不定。经向中国证监会备案,《嘉实中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2023 年 9 月 14 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 490,981,088.00 份基金份额。本基金的基金管理人为嘉实基金管理有限公司,基金托管人为中信证券股份有限公司。

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于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、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》、《嘉实中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、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。

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。本期财务报表的实际编制期间为 2023 年 9 月 14 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

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

债务工具

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

以摊余成本计量：

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，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。

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

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。基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

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

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

基金持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所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。

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。

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分配的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

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。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。

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。

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

基金的管理人报酬、托管费等费用在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每份基金份额享有同等分配权。本基金收益评价日核定的基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到1%以上时,基金管理人可以进行收益分配。在符合上述基金分红条件的前提下,由基金管理人根据本基金特点自行约定收益分配次数,每次基金收益分配数额的确定原则为:使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率。基于本基金的性质和特点,本基金收益分配不须以弥补亏损为前提,收益分配后有可能使基金份额净值低于面值,即基金收益分配基准日(即收益评价日)的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后可能低于面值。本基金收益分配采取现金方式。

经宣告的拟分配基金收益于分红除息日从净资产转出。

7.4.4.12 外币交易

无。

7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据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，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) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(2) 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。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。基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期末未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、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) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售

股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。
自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	1,211,531.67
等于：本金	1,210,905.97
加：应计利息	625.70
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	1,211,531.67

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	43,608,553.11	-	43,364,363.21	-244,189.90	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	22,400.00	1.14	23,720.26	1,319.12
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	22,400.00	1.14	23,720.26	1,319.12

资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	43,630,953.11	1.14	43,388,083.47	-242,870.78

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

无。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

7.4.7.8 其他资产

无。

7.4.7.9 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	98,602.19
其中：交易所市场	98,602.19
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	98,795.00
合计	197,397.19

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 9 月 14 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	490,981,088.00	490,981,088.00
本期申购	33,000,000.00	33,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-480,000,000.00	-480,000,000.00
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	43,981,088.00	43,981,088.00

注：(1) 申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

(2) 本基金合同于 2023 年 09 月 14 日生效，基金合同生效日的基金份额总额为 490,981,088.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 21,509.00 份基金份额。

7.4.7.11 其他综合收益

无。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	4,751,265.98	-242,870.78	4,508,395.20
本期基金份额交易产生的变动数	-2,138,108.75	-1,428,483.58	-3,566,592.33
其中：基金申购款	631,341.40	-169,084.53	462,256.87
基金赎回款	-2,769,450.15	-1,259,399.05	-4,028,849.20
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,613,157.23	-1,671,354.36	941,802.87

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年9月14日（基金合同生效日）至2023年12月31日
活期存款利息收入	170,516.90
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	5,341.51
其他	1,362.49
合计	177,220.90

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年9月14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	571,981.50
股票投资收益——赎回差价收入	3,588,727.47
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	4,160,708.97

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年9月14日（基金合同生效日）至2023年12月31日
卖出股票成交总额	206,851,527.96
减：卖出股票成本总额	205,648,608.49
减：交易费用	630,937.97

买卖股票差价收入	571,981.50
----------	------------

7.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年9月14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	484,028,849.20
减：现金支付赎回款总额	164,095,211.20
减：赎回股票成本总额	316,344,910.53
减：交易费用	-
赎回差价收入	3,588,727.47

7.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年9月14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	16.71
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	44,151.56
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	44,168.27

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年9月14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	158,973.71
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	114,800.00
减：应计利息总额	15.78
减：交易费用	6.37
买卖债券差价收入	44,151.56

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年9月14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	40,378.18
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	40,378.18

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年9月14日（基金合同生效日）至2023年12月31日
1. 交易性金融资产	-242,870.78
股票投资	-244,189.90
债券投资	1,319.12
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	-242,870.78

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年9月14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	690,662.44
合计	690,662.44

7.4.7.22 信用减值损失

无。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年9月14日（基金合同生效日）至2023年12月31日
审计费用	54,000.00
信息披露费	44,795.00
证券出借违约金	-

其他	400.00
合计	99,195.00

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

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
嘉实基金管理有限公司(“嘉实基金”)	基金管理人
中信证券股份有限公司(“中信证券”)	基金托管人
DWS Investments Singapore Limited	基金管理人的股东
立信投资有限责任公司	基金管理人的股东
中诚信托有限责任公司	基金管理人的股东
嘉实资本管理有限公司(“嘉实资本”)	基金管理人的控股子公司
嘉实财富管理有限公司(“嘉实财富”)	基金管理人的控股子公司

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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14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(%)
中信证券股份有限公司	742,764,373.09	100.00

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年9月14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(%)
中信证券股份有限公司	158,973.71	100.00

7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

7.4.10.1.4 权证交易

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14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（%）
中信证券股份有 限公司	479,737.44	100.00	98,602.19	100.00

注：上述佣金按市场佣金率计算。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14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	218,898.16
其中：应支付销售机构的客户维护 费	-
应支付基金管理人的净管理费	218,898.16

注：1. 支付基金管理人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。2. 根据本基金的基金管理人与各代销机构签订的基金代销协议，客户维护费按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年9月14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	43,779.60

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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（%）
中信证券	2,691,215.00	6.12

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14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
中信证券股份有限公司_活期	1,211,531.67	170,516.90

注：本基金的上述存款，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

无。

7.4.11 利润分配情况

本期(2023年9月14日(基金合同生效日)至2023年12月31日)，本基金未实施利润分配。

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：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
111018	华康转债	2023 年 12 月 26 日	1 个月内（含）	新债未上市	100.00	100.00	140	14,000.00	14,000.43	-
118046	诺泰转债	2023 年 12 月 18 日	1 个月内（含）	新债未上市	100.00	100.01	40	4,000.00	4,000.30	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为被动式投资的股票型指数基金，跟踪标的指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及基金投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。本基金的基金管理人按照法律法规和中国证监会的规定，建立组织机构健全、职责划分清晰、制衡监督有效、激励约束合理的治理结构，

建立健全内部控制机制和风险管理制 度，坚持审慎经营理念，保护投资者利益和公司合法权益。

公司建立包括董事会、管理层、各部门及一线员工组成的四道风控防线，还有董事会风险控制与内审委员会、公司风险控制委员会、督察长及其合规管理部门、风险管理部门，评估各项风险并提出防控措施并有效执行。

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

7.4.13.2 信用风险

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

基金的银行存款存放在托管人和其他拥有相关资质的银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。基金在交易所进行的交易均与授权的证券结算机构完成证券交收和款项清算或通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在场外交易市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023 年 12 月 31 日
AAA	-
AAA 以下	23,720.26
未评级	-

合计	23,720.26
----	-----------

注：评级取自第三方评级机构。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.3 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。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。

于本报告期末，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照相关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期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。

本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%。本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%。本基金与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上述比例限制)。

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，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。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。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允

价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	1,211,531.67	-	-	-	1,211,531.67
结算备付金	261,856.81	-	-	-	261,856.81
存出保证金	378,709.58	-	-	-	378,709.58
交易性金融资产	-	-	23,720.26	43,364,363.21	43,388,083.47
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,852,098.06	-	23,720.26	43,364,363.21	45,240,181.53
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	92,519.60	92,519.60
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	22,811.55	22,811.55
应付托管费	-	-	-	4,562.32	4,562.32

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	-	-	197,397.19	197,397.19
负债总计	-	-	317,290.66	317,290.66
利率敏感度缺口	1,852,098.06	-	23,720.26	43,047,072.55
				44,922,890.87

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率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）
	市场利率上升25个基点	-339.69
	市场利率下降25个基点	345.51

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

无。

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率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）
	所有外币相对人民币升值5%	-
	所有外币相对人民币贬值5%	-

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交

易的股票、债券及基金，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	43,364,363.21	96.53
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	43,364,363.21	96.53

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩基准以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2023 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	2,002,635.85
	业绩比较基准下降 5%	-2,002,635.85

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	43,370,082.74
第二层次	18,000.73
第三层次	-
合计	43,388,083.47

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

无。

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

无。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产或金融负债。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	43,364,363.21	95.85
	其中：股票	43,364,363.21	95.85
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	23,720.26	0.05
	其中：债券	23,720.26	0.05
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,473,388.48	3.26
8	其他各项资产	378,709.58	0.84
9	合计	45,240,181.53	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	361,154.00	0.80
B	采矿业	328,024.00	0.73
C	制造业	29,279,460.53	65.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,018,382.00	2.27
E	建筑业	858,613.00	1.91
F	批发和零售业	1,526,009.00	3.40
G	交通运输、仓储和邮政业	804,227.00	1.79
H	住宿和餐饮业	167,378.00	0.37
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,634,287.84	10.32
J	金融业	-	-
K	房地产业	888,199.00	1.98
L	租赁和商务服务	853,292.00	1.90

	业		
M	科学研究和技术服务业	1,018,845.84	2.27
N	水利、环境和公共设施管理业	615,947.00	1.37
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	117,274.00	0.26
Q	卫生和社会工作	72,968.00	0.16
R	文化、体育和娱乐业	639,852.00	1.42
S	综合	180,450.00	0.40
	合计	43,364,363.21	96.53

8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

无。

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000766	通化金马	14,000	279,160.00	0.62
2	300049	福瑞股份	4,300	187,437.00	0.42
3	600133	东湖高新	14,700	158,319.00	0.35
4	603283	赛腾股份	2,100	152,376.00	0.34
5	300857	协创数据	2,600	137,774.00	0.31
6	002654	万润科技	10,900	135,378.00	0.30
7	600114	东睦股份	8,600	133,214.00	0.30
8	600410	华胜天成	17,800	119,616.00	0.27
9	002031	巨轮智能	28,600	118,404.00	0.26
10	300705	九典制药	3,500	116,305.00	0.26
11	300098	高新兴	28,500	115,710.00	0.26
12	002334	英威腾	12,800	111,744.00	0.25
13	002045	国光电器	6,700	111,555.00	0.25
14	688279	峰昭科技	883	111,363.96	0.25
15	688062	迈威生物	3,397	111,047.93	0.25
16	002512	达华智能	17,400	110,142.00	0.25
17	300181	佐力药业	10,300	109,798.00	0.24
18	600186	莲花健康	18,100	109,505.00	0.24
19	603220	中贝通信	3,200	108,672.00	0.24

20	002154	报喜鸟	18,900	107,352.00	0.24
21	603496	恒为科技	3,400	105,944.00	0.24
22	300041	回天新材	10,300	103,206.00	0.23
23	300678	中科信息	3,400	101,932.00	0.23
24	002270	华明装备	7,200	101,664.00	0.23
25	000589	贵州轮胎	16,600	101,592.00	0.23
26	601020	华钰矿业	9,800	100,940.00	0.22
27	002122	汇洲智能	24,200	100,914.00	0.22
28	300766	每日互动	6,500	100,295.00	0.22
29	300131	英唐智控	16,600	99,766.00	0.22
30	600742	一汽富维	10,300	98,365.00	0.22
31	300494	盛天网络	6,200	98,022.00	0.22
32	002106	莱宝高科	9,100	96,824.00	0.22
33	002681	奋达科技	19,400	96,030.00	0.21
34	300048	合康新能	18,800	95,128.00	0.21
35	300081	恒信东方	8,200	94,710.00	0.21
36	002022	科华生物	8,300	94,454.00	0.21
37	000628	高新发展	1,900	94,392.00	0.21
38	300415	伊之密	5,300	93,439.00	0.21
39	002664	信质集团	5,600	93,128.00	0.21
40	002315	焦点科技	2,800	92,764.00	0.21
41	002642	荣联科技	10,800	92,664.00	0.21
42	600105	永鼎股份	16,700	92,518.00	0.21
43	600226	瀚叶股份	35,400	92,394.00	0.21
44	300053	航宇微	7,500	91,725.00	0.20
45	300548	博创科技	3,400	91,698.00	0.20
46	600525	长园集团	17,100	91,485.00	0.20
47	300217	东方电热	16,900	90,922.00	0.20
48	600106	重庆路桥	13,500	90,180.00	0.20
49	300570	太辰光	2,300	89,815.00	0.20
50	300280	紫天科技	2,100	89,733.00	0.20
51	002149	西部材料	5,700	89,604.00	0.20
52	002559	亚威股份	7,700	88,781.00	0.20
53	000912	泸天化	19,100	88,624.00	0.20
54	600609	金杯汽车	18,100	87,966.00	0.20
55	603918	金桥信息	4,700	87,890.00	0.20
56	002527	新时达	8,900	87,309.00	0.19
57	603035	常熟汽饰	4,600	86,802.00	0.19
58	002073	软控股份	13,200	86,724.00	0.19
59	688076	诺泰生物	1,913	85,989.35	0.19
60	600200	江苏吴中	10,400	85,488.00	0.19
61	600461	洪城环境	9,300	85,002.00	0.19
62	002055	得润电子	8,600	84,108.00	0.19

63	300042	朗科科技	2,400	84,000.00	0.19
64	300825	阿尔特	6,100	83,875.00	0.19
64	600571	信雅达	6,100	83,875.00	0.19
65	603383	顶点软件	1,700	83,810.00	0.19
66	002102	冠福股份	30,800	83,468.00	0.19
67	000670	盈方微	12,300	83,394.00	0.19
68	300480	光力科技	3,900	83,265.00	0.19
69	600537	亿晶光电	15,100	83,201.00	0.19
70	300355	蒙草生态	22,100	82,875.00	0.18
71	002803	吉宏股份	4,000	82,240.00	0.18
72	002386	天原股份	15,900	82,044.00	0.18
73	000812	陕西金叶	16,100	81,466.00	0.18
74	688095	福昕软件	1,164	81,305.40	0.18
75	600094	大名城	27,000	81,000.00	0.18
76	002437	誉衡药业	32,100	80,571.00	0.18
77	002639	雪人股份	10,700	80,250.00	0.18
78	603590	康辰药业	2,100	79,968.00	0.18
79	002611	东方精工	16,100	79,856.00	0.18
80	300184	力源信息	13,400	79,730.00	0.18
81	002510	天汽模	16,400	79,704.00	0.18
82	603668	天马科技	4,300	78,862.00	0.18
83	002115	三维通信	10,900	78,698.00	0.18
84	002445	中南文化	33,200	78,684.00	0.18
85	300302	同有科技	5,800	78,532.00	0.17
86	002075	沙钢股份	20,500	78,310.00	0.17
87	600590	泰豪科技	11,700	78,156.00	0.17
88	688550	瑞联新材	1,969	78,129.92	0.17
89	600351	亚宝药业	11,300	77,970.00	0.17
90	002197	证通电子	7,500	77,925.00	0.17
91	000819	岳阳兴长	4,300	77,744.00	0.17
92	300129	泰胜风能	7,200	77,544.00	0.17
93	000777	中核科技	5,300	77,062.00	0.17
94	603078	江化微	4,800	76,896.00	0.17
95	600509	天富能源	11,800	76,818.00	0.17
96	002533	金杯电工	9,500	76,760.00	0.17
96	603018	华设集团	10,100	76,760.00	0.17
97	300396	迪瑞医疗	2,600	76,570.00	0.17
98	300138	晨光生物	5,700	76,551.00	0.17
99	603619	中曼石油	4,100	75,932.00	0.17
100	002449	国星光电	8,000	75,760.00	0.17
101	002146	荣盛发展	44,200	75,582.00	0.17
102	300020	银江技术	9,100	75,530.00	0.17
103	603859	能科科技	2,000	75,460.00	0.17

104	000925	众合科技	8,700	75,342.00	0.17
105	000612	焦作万方	13,100	75,325.00	0.17
106	600757	长江传媒	10,100	75,245.00	0.17
107	600255	鑫科材料	33,900	74,919.00	0.17
108	002935	天奥电子	4,100	74,784.00	0.17
109	600084	中信尼雅	9,500	74,670.00	0.17
110	600789	鲁抗医药	10,400	74,256.00	0.17
111	002279	久其软件	11,400	74,214.00	0.17
112	002438	江苏神通	6,200	74,090.00	0.16
113	002042	华孚时尚	17,200	73,960.00	0.16
114	000070	特发信息	9,300	73,842.00	0.16
115	600664	哈药股份	22,000	73,700.00	0.16
116	600973	宝胜股份	15,600	73,476.00	0.16
117	300326	凯利泰	11,600	73,428.00	0.16
118	300708	聚灿光电	6,500	73,320.00	0.16
119	300481	濮阳惠成	4,200	73,290.00	0.16
120	600269	赣粤高速	17,800	73,158.00	0.16
121	300551	古鳌科技	4,200	73,080.00	0.16
122	002833	弘亚数控	4,100	72,734.00	0.16
123	600756	浪潮软件	5,200	72,124.00	0.16
124	301096	百诚医药	1,100	71,610.00	0.16
125	002293	罗莱生活	7,700	71,533.00	0.16
126	002707	众信旅游	10,000	71,400.00	0.16
126	600868	梅雁吉祥	28,000	71,400.00	0.16
127	600108	亚盛集团	25,600	71,168.00	0.16
128	300019	硅宝科技	4,300	70,993.00	0.16
129	000922	佳电股份	6,900	70,863.00	0.16
130	000815	美利云	6,400	70,784.00	0.16
131	002733	雄韬股份	4,700	70,688.00	0.16
132	300145	中金环境	23,400	70,668.00	0.16
133	000078	海王生物	22,500	70,650.00	0.16
134	300057	万顺新材	11,400	70,338.00	0.16
135	002169	智光电气	10,200	70,176.00	0.16
136	002298	中电兴发	12,100	69,696.00	0.16
137	000948	南天信息	4,600	69,322.00	0.15
138	688035	德邦科技	1,299	69,314.64	0.15
139	300533	冰川网络	2,500	69,250.00	0.15
140	002255	海陆重工	13,000	68,770.00	0.15
141	688658	悦康药业	3,280	68,420.80	0.15
142	603227	雪峰科技	9,800	67,620.00	0.15
143	002039	黔源电力	4,900	67,571.00	0.15
144	601500	通用股份	16,300	67,482.00	0.15
145	002526	山东矿机	23,200	67,280.00	0.15

146	300468	四方精创	6,200	67,270.00	0.15
147	300008	天海防务	16,900	67,262.00	0.15
148	002474	榕基软件	10,200	67,116.00	0.15
149	002570	贝因美	16,900	66,755.00	0.15
150	688299	长阳科技	4,771	66,555.45	0.15
151	002716	金贵银业	23,600	66,552.00	0.15
152	002491	通鼎互联	12,700	66,548.00	0.15
153	600620	天宸股份	7,000	65,800.00	0.15
154	603686	福龙马	6,400	65,472.00	0.15
155	002238	天威视讯	4,200	65,226.00	0.15
156	000731	四川美丰	8,800	65,120.00	0.14
157	300258	精锻科技	5,000	64,600.00	0.14
158	002057	中钢天源	8,000	64,320.00	0.14
159	002540	亚太科技	9,700	64,117.00	0.14
160	002345	潮宏基	9,400	64,014.00	0.14
161	300490	华自科技	5,500	63,855.00	0.14
162	002104	恒宝股份	8,300	63,744.00	0.14
163	301051	信濠光电	1,000	63,670.00	0.14
164	600794	保税科技	15,600	63,648.00	0.14
165	300066	三川智慧	12,600	63,630.00	0.14
166	000822	山东海化	9,300	63,612.00	0.14
167	300566	激智科技	3,400	63,512.00	0.14
168	600237	铜峰电子	8,200	63,468.00	0.14
169	300349	金卡智能	5,100	63,342.00	0.14
170	600880	博瑞传播	12,600	63,126.00	0.14
171	603626	科森科技	6,900	62,721.00	0.14
172	000859	国风新材	11,800	62,658.00	0.14
173	000973	佛塑科技	12,800	62,592.00	0.14
174	002301	齐心集团	8,800	62,568.00	0.14
175	300055	万邦达	10,100	62,317.00	0.14
176	300239	东宝生物	10,000	62,300.00	0.14
177	000713	丰乐种业	8,100	62,127.00	0.14
178	600230	沧州大化	4,600	61,962.00	0.14
179	600790	轻纺城	15,600	61,932.00	0.14
180	300304	云意电气	9,100	61,789.00	0.14
181	002579	中京电子	7,000	61,390.00	0.14
182	002132	恒星科技	19,500	61,035.00	0.14
183	000861	海印股份	30,500	61,000.00	0.14
184	300353	东土科技	6,300	60,984.00	0.14
185	000816	智慧农业	20,100	60,702.00	0.14
186	603703	盛洋科技	4,700	60,207.00	0.13
187	000409	云鼎科技	6,500	60,190.00	0.13
188	002565	顺灏股份	17,700	60,003.00	0.13

189	300680	隆盛科技	3,200	59,840.00	0.13
190	002277	友阿股份	14,800	59,644.00	0.13
191	000501	武商集团	7,000	59,640.00	0.13
192	300099	尤洛卡	9,600	59,424.00	0.13
193	000823	超声电子	6,200	59,334.00	0.13
194	002297	博云新材	7,400	58,978.00	0.13
195	300420	五洋停车	19,400	58,976.00	0.13
196	000099	中信海直	6,700	58,960.00	0.13
197	002196	方正电机	8,200	58,876.00	0.13
198	600187	国中水务	22,200	58,608.00	0.13
199	600103	青山纸业	24,500	58,555.00	0.13
200	600651	飞乐音响	16,200	58,320.00	0.13
201	603977	国泰集团	5,600	58,240.00	0.13
202	002367	康力电梯	7,700	57,904.00	0.13
203	605108	同庆楼	1,900	57,836.00	0.13
204	000521	长虹美菱	10,200	57,426.00	0.13
205	600640	国脉文化	5,000	57,350.00	0.13
206	300094	国联水产	12,200	57,340.00	0.13
207	300046	台基股份	3,600	57,276.00	0.13
208	300219	鸿利智汇	6,800	57,256.00	0.13
209	000751	锌业股份	17,600	57,200.00	0.13
210	600866	星湖科技	12,200	56,852.00	0.13
211	002452	长高电新	8,000	56,800.00	0.13
212	002630	华西能源	22,900	56,792.00	0.13
213	002588	史丹利	8,900	56,782.00	0.13
214	300900	广联航空	2,300	56,764.00	0.13
215	000957	中通客车	6,300	56,574.00	0.13
216	300307	慈星股份	8,800	56,496.00	0.13
216	600495	晋西车轴	13,200	56,496.00	0.13
217	002469	三维化学	9,300	56,358.00	0.13
218	600992	贵绳股份	3,500	56,350.00	0.13
219	000906	浙商中拓	7,700	56,287.00	0.13
220	002303	美盈森	16,000	56,160.00	0.13
221	002029	七匹狼	9,800	56,154.00	0.13
222	002328	新朋股份	9,400	56,118.00	0.12
223	600736	苏州高新	11,700	55,692.00	0.12
224	300248	新开普	5,800	55,622.00	0.12
225	300278	华昌达	14,500	55,390.00	0.12
226	600300	维维股份	17,800	55,358.00	0.12
227	603987	康德莱	5,800	55,332.00	0.12
228	002322	理工能科	4,300	55,040.00	0.12
229	002538	司尔特	9,100	54,964.00	0.12
230	603611	诺力股份	2,900	54,897.00	0.12

231	002026	山东威达	5,400	54,810.00	0.12
232	002662	京威股份	15,600	54,756.00	0.12
233	300435	中泰股份	3,800	54,644.00	0.12
234	002580	圣阳股份	6,300	54,621.00	0.12
235	601226	华电重工	8,300	54,614.00	0.12
236	002198	嘉应制药	7,500	54,600.00	0.12
237	600033	福建高速	17,600	54,560.00	0.12
238	000040	东旭蓝天	14,800	54,464.00	0.12
239	300292	吴通控股	14,600	54,312.00	0.12
240	601388	怡球资源	20,700	54,234.00	0.12
241	605077	华康股份	2,500	54,100.00	0.12
242	600694	大商股份	3,200	54,048.00	0.12
243	603387	基蛋生物	4,900	53,900.00	0.12
244	600251	冠农股份	6,200	53,878.00	0.12
245	000680	山推股份	10,900	53,846.00	0.12
246	002448	中原内配	8,100	53,784.00	0.12
247	688589	力合微	1,346	53,718.86	0.12
248	002669	康达新材	4,500	53,640.00	0.12
249	300872	天阳科技	3,900	53,352.00	0.12
250	600249	两面针	9,100	53,144.00	0.12
251	002046	国机精工	4,600	53,130.00	0.12
252	002017	东信和平	5,100	53,091.00	0.12
253	300485	赛升药业	5,000	52,950.00	0.12
254	000900	现代投资	13,500	52,920.00	0.12
255	600594	益佰制药	9,300	52,917.00	0.12
256	300193	佳士科技	6,800	52,836.00	0.12
257	603969	银龙股份	8,800	52,800.00	0.12
258	002483	润邦股份	10,100	52,722.00	0.12
259	000936	华西股份	6,500	52,650.00	0.12
260	002358	森源电气	12,100	52,635.00	0.12
261	002014	永新股份	6,300	52,605.00	0.12
262	603416	信捷电气	1,400	52,584.00	0.12
263	300227	光韵达	6,700	52,528.00	0.12
264	300447	全信股份	3,600	52,200.00	0.12
265	002035	华帝股份	8,400	52,164.00	0.12
266	002759	天际股份	4,900	51,989.00	0.12
267	300729	乐歌股份	2,900	51,939.00	0.12
268	300890	翔丰华	1,500	51,870.00	0.12
269	002376	新北洋	6,800	51,816.00	0.12
270	002614	奥佳华	6,900	51,750.00	0.12
271	000926	福星股份	12,400	51,708.00	0.12
272	603990	麦迪科技	4,000	51,680.00	0.12
273	300421	力星股份	4,000	51,640.00	0.11

274	600894	广日股份	7,000	51,450.00	0.11
275	601588	北辰实业	27,000	51,300.00	0.11
276	600433	冠豪高新	14,800	51,208.00	0.11
277	000726	鲁泰 A	7,900	51,192.00	0.11
278	000716	黑芝麻	8,500	51,170.00	0.11
279	002523	天桥起重	18,400	51,152.00	0.11
280	002093	国脉科技	6,800	51,136.00	0.11
281	300513	恒实科技	4,300	51,084.00	0.11
282	601038	一拖股份	3,500	50,995.00	0.11
283	000652	泰达股份	13,100	50,959.00	0.11
284	600658	电子城	11,400	50,958.00	0.11
285	300532	今天国际	3,100	50,902.00	0.11
286	603319	湘油泵	2,900	50,866.00	0.11
287	002623	亚玛顿	1,900	50,825.00	0.11
287	300664	鹏鹞环保	9,500	50,825.00	0.11
288	603633	徕木股份	5,300	50,774.00	0.11
289	300572	安车检测	2,800	50,596.00	0.11
290	600425	青松建化	12,800	50,560.00	0.11
291	002522	浙江众成	10,500	50,505.00	0.11
292	002342	巨力索具	11,700	50,427.00	0.11
293	002632	道明光学	5,100	50,388.00	0.11
294	002765	蓝黛科技	7,500	50,325.00	0.11
295	603012	创力集团	8,500	50,235.00	0.11
296	002441	众业达	5,300	50,191.00	0.11
297	002246	北化股份	6,100	49,959.00	0.11
298	603367	辰欣药业	3,400	49,776.00	0.11
299	600218	全柴动力	5,200	49,764.00	0.11
300	688225	亚信安全	2,713	49,756.42	0.11
301	603191	望变电气	3,200	49,696.00	0.11
302	002361	神剑股份	12,600	49,518.00	0.11
303	002419	天虹股份	8,900	49,217.00	0.11
304	002880	卫光生物	1,400	49,182.00	0.11
305	600308	华泰股份	14,200	49,132.00	0.11
306	002560	通达股份	6,800	49,096.00	0.11
307	300745	欣锐科技	1,800	48,906.00	0.11
308	000882	华联股份	29,100	48,888.00	0.11
309	300205	天喻信息	4,500	48,870.00	0.11
310	002454	松芝股份	6,500	48,815.00	0.11
311	601968	宝钢包装	9,500	48,735.00	0.11
312	000561	烽火电子	5,800	48,720.00	0.11
313	300061	旗天科技	8,300	48,638.00	0.11
314	300617	安靠智电	1,600	48,576.00	0.11
315	688332	中科蓝讯	644	48,570.48	0.11

316	600479	千金药业	4,500	48,465.00	0.11
317	688369	致远互联	1,400	48,454.00	0.11
318	600190	锦州港	16,800	48,384.00	0.11
319	300903	科翔股份	4,800	48,288.00	0.11
320	000836	富通信息	18,000	48,240.00	0.11
321	000888	峨眉山 A	5,400	48,222.00	0.11
322	600523	贵航股份	3,500	48,195.00	0.11
323	600180	瑞茂通	7,900	48,111.00	0.11
324	002442	龙星化工	7,000	48,090.00	0.11
325	300590	移为通信	4,000	48,040.00	0.11
326	000717	中南股份	18,900	48,006.00	0.11
327	000507	珠海港	9,100	47,866.00	0.11
328	002161	远望谷	8,700	47,850.00	0.11
328	002296	辉煌科技	5,800	47,850.00	0.11
329	301302	华如科技	1,900	47,709.00	0.11
330	000592	平潭发展	18,800	47,564.00	0.11
331	688391	钜泉科技	958	47,516.80	0.11
332	600088	中视传媒	3,700	47,508.00	0.11
333	000862	银星能源	7,800	47,502.00	0.11
334	603887	城地香江	5,900	47,436.00	0.11
335	603809	豪能股份	4,000	47,400.00	0.11
336	600268	国电南自	6,800	47,396.00	0.11
337	000852	石化机械	7,700	47,355.00	0.11
338	002562	兄弟科技	11,700	47,268.00	0.11
339	603313	梦百合	4,500	47,250.00	0.11
340	000541	佛山照明	7,100	47,215.00	0.11
341	300120	经纬辉开	6,500	47,190.00	0.11
342	300430	诚益通	3,300	47,157.00	0.10
343	688181	八亿时空	1,745	47,115.00	0.10
344	002343	慈文传媒	7,200	47,088.00	0.10
345	002660	茂硕电源	3,800	47,044.00	0.10
346	600215	派斯林	5,500	46,970.00	0.10
347	603237	五芳斋	1,600	46,880.00	0.10
348	600184	光电股份	4,100	46,863.00	0.10
349	300441	鲍斯股份	6,800	46,852.00	0.10
350	300221	银禧科技	7,800	46,800.00	0.10
351	002589	瑞康医药	14,300	46,761.00	0.10
352	002661	克明食品	4,900	46,697.00	0.10
353	002288	超华科技	10,700	46,652.00	0.10
354	300365	恒华科技	6,900	46,644.00	0.10
355	300706	阿石创	1,800	46,584.00	0.10
356	688306	均普智能	8,350	46,509.50	0.10
357	600636	国新文化	4,400	46,376.00	0.10

358	300384	三联虹普	2,900	46,284.00	0.10
359	603869	新智认知	4,900	46,256.00	0.10
360	002111	威海广泰	5,100	46,206.00	0.10
361	002282	博深股份	5,700	46,170.00	0.10
362	300137	先河环保	8,300	46,148.00	0.10
363	688308	欧科亿	1,653	46,118.70	0.10
364	601700	风范股份	9,200	46,092.00	0.10
365	000551	创元科技	4,400	46,068.00	0.10
366	300165	天瑞仪器	6,900	46,023.00	0.10
367	300112	万讯自控	4,000	46,000.00	0.10
368	603258	电魂网络	2,000	45,960.00	0.10
369	000404	长虹华意	7,800	45,942.00	0.10
370	300149	睿智医药	6,000	45,900.00	0.10
371	000544	中原环保	6,600	45,804.00	0.10
372	002165	红宝丽	10,800	45,684.00	0.10
373	002037	保利联合	5,300	45,633.00	0.10
374	688183	生益电子	4,008	45,570.96	0.10
375	603508	思维列控	2,900	45,530.00	0.10
376	002462	嘉事堂	3,200	45,472.00	0.10
377	000892	欢瑞世纪	11,100	45,399.00	0.10
378	600731	湖南海利	6,900	45,333.00	0.10
379	002398	垒知集团	9,500	45,315.00	0.10
380	002375	亚厦股份	10,000	45,300.00	0.10
381	300095	华伍股份	5,500	45,265.00	0.10
382	000931	中关村	7,700	45,199.00	0.10
383	603518	锦泓集团	4,500	45,090.00	0.10
384	002330	得利斯	8,100	45,036.00	0.10
385	002213	大为股份	3,200	45,024.00	0.10
386	002638	勤上股份	16,600	44,986.00	0.10
387	300245	天玑科技	5,100	44,982.00	0.10
388	688053	思科瑞	900	44,946.00	0.10
389	000530	冰山冷热	8,400	44,856.00	0.10
390	300160	秀强股份	7,600	44,840.00	0.10
391	000159	国际实业	6,900	44,781.00	0.10
392	600558	大西洋	11,000	44,770.00	0.10
393	300523	辰安科技	2,200	44,660.00	0.10
393	300867	圣元环保	2,800	44,660.00	0.10
393	605196	华通线缆	5,800	44,660.00	0.10
394	300121	阳谷华泰	5,000	44,400.00	0.10
395	600135	乐凯胶片	5,500	44,385.00	0.10
396	300259	新天科技	12,200	44,286.00	0.10
397	002225	濮耐股份	11,700	44,226.00	0.10
398	300831	派瑞股份	3,600	44,136.00	0.10

399	002391	长青股份	7,000	44,100.00	0.10
399	603628	清源股份	2,100	44,100.00	0.10
400	688560	明冠新材	2,368	44,092.16	0.10
401	600851	海欣股份	6,400	43,968.00	0.10
402	603002	宏昌电子	7,000	43,960.00	0.10
403	688199	久日新材	1,625	43,923.75	0.10
404	601616	广电电气	12,100	43,923.00	0.10
405	002553	南方精工	3,600	43,920.00	0.10
406	600686	金龙汽车	5,800	43,906.00	0.10
407	300504	天邑股份	2,400	43,896.00	0.10
408	300110	华仁药业	10,400	43,888.00	0.10
409	000045	深纺织 A	3,700	43,660.00	0.10
410	600512	腾达建设	17,600	43,648.00	0.10
411	002208	合肥城建	6,800	43,588.00	0.10
412	600730	中国高科	7,700	43,505.00	0.10
413	603931	格林达	1,700	43,503.00	0.10
414	300467	迅游科技	2,500	43,450.00	0.10
415	300493	润欣科技	5,100	43,401.00	0.10
416	301206	三元生物	1,500	43,320.00	0.10
417	688317	之江生物	2,061	43,239.78	0.10
418	002116	中国海诚	4,200	43,218.00	0.10
419	002285	世联行	17,900	43,139.00	0.10
420	600668	尖峰集团	3,900	43,095.00	0.10
421	600713	南京医药	8,900	43,076.00	0.10
422	002360	同德化工	5,900	43,070.00	0.10
423	688286	敏芯股份	600	43,020.00	0.10
424	688628	优利德	1,091	42,985.40	0.10
425	300439	美康生物	3,700	42,957.00	0.10
426	003019	宸展光电	1,900	42,940.00	0.10
427	002253	川大智胜	3,000	42,900.00	0.10
428	300237	美晨生态	20,000	42,800.00	0.10
429	000529	广弘控股	6,300	42,777.00	0.10
430	002636	金安国纪	4,800	42,768.00	0.10
431	600979	广安爱众	12,300	42,558.00	0.09
432	002140	东华科技	5,000	42,500.00	0.09
433	002752	昇兴股份	8,200	42,476.00	0.09
434	688699	明微电子	1,052	42,448.20	0.09
435	300310	宜通世纪	9,600	42,432.00	0.09
436	002083	孚日股份	8,400	42,336.00	0.09
437	600020	中原高速	11,500	42,320.00	0.09
438	000905	厦门港务	5,900	42,303.00	0.09
439	603011	合锻智能	5,600	42,112.00	0.09
440	301093	华兰股份	1,300	41,990.00	0.09

441	002912	中新赛克	1,500	41,985.00	0.09
442	000532	华金资本	3,500	41,965.00	0.09
443	300082	奥克股份	6,000	41,820.00	0.09
444	300829	金丹科技	2,000	41,760.00	0.09
445	300647	超频三	6,500	41,730.00	0.09
446	600611	大众交通	14,000	41,720.00	0.09
447	603222	济民医疗	5,200	41,652.00	0.09
448	002922	伊戈尔	2,800	41,580.00	0.09
449	002479	富春环保	8,700	41,499.00	0.09
450	300448	浩云科技	7,700	41,426.00	0.09
451	000417	合肥百货	8,300	41,417.00	0.09
452	600067	冠城大通	16,500	41,415.00	0.09
453	600616	金枫酒业	6,600	41,316.00	0.09
454	002418	康盛股份	14,800	41,292.00	0.09
455	603601	再升科技	9,600	41,280.00	0.09
456	688283	坤恒顺维	600	41,178.00	0.09
457	002350	北京科锐	6,100	41,175.00	0.09
458	603060	国检集团	4,900	41,160.00	0.09
459	600419	天润乳业	3,500	41,055.00	0.09
460	600207	安彩高科	8,600	41,022.00	0.09
461	000698	沈阳化工	9,700	40,934.00	0.09
462	000788	北大医药	6,100	40,931.00	0.09
463	300582	英飞特	3,400	40,834.00	0.09
464	000910	大亚圣象	5,100	40,800.00	0.09
465	002641	公元股份	8,100	40,743.00	0.09
466	300105	龙源技术	6,000	40,740.00	0.09
467	688231	隆达股份	1,850	40,718.50	0.09
468	000055	方大集团	9,000	40,680.00	0.09
469	600292	远达环保	6,700	40,669.00	0.09
470	002160	常铝股份	9,700	40,643.00	0.09
471	600708	光明地产	18,900	40,635.00	0.09
472	002829	星网宇达	1,500	40,560.00	0.09
473	002095	生意宝	2,000	40,540.00	0.09
474	600526	菲达环保	8,200	40,508.00	0.09
475	002546	新联电子	8,100	40,500.00	0.09
476	002478	常宝股份	7,400	40,330.00	0.09
477	002062	宏润建设	9,100	40,313.00	0.09
478	600054	黄山旅游	3,700	40,256.00	0.09
479	002344	海宁皮城	9,800	40,180.00	0.09
480	600960	渤海汽车	9,900	40,095.00	0.09
481	300569	天能重工	5,600	40,040.00	0.09
482	688165	埃夫特	3,492	40,018.32	0.09
483	603377	东方时尚	9,500	39,995.00	0.09

484	000576	甘化科工	4,300	39,990.00	0.09
484	002524	光正眼科	6,200	39,990.00	0.09
485	002686	亿利达	5,900	39,943.00	0.09
486	300389	艾比森	2,300	39,882.00	0.09
486	301123	奕东电子	1,700	39,882.00	0.09
487	601008	连云港	9,800	39,690.00	0.09
488	300272	开能健康	6,400	39,680.00	0.09
488	601199	江南水务	8,000	39,680.00	0.09
489	300147	香雪制药	7,700	39,655.00	0.09
490	300830	金现代	4,900	39,543.00	0.09
491	600622	光大嘉宝	15,300	39,474.00	0.09
492	300815	玉禾田	2,700	39,420.00	0.09
493	603811	诚意药业	3,800	39,406.00	0.09
494	000601	韶能股份	9,200	39,376.00	0.09
495	600035	楚天高速	10,300	39,346.00	0.09
496	600831	广电网络	7,500	39,300.00	0.09
497	603339	四方科技	3,300	39,237.00	0.09
498	000705	浙江震元	3,600	39,204.00	0.09
499	002346	柘中股份	3,500	39,025.00	0.09
500	300636	同和药业	3,700	38,998.00	0.09
501	002551	尚荣医疗	9,600	38,976.00	0.09
502	002852	道道全	3,600	38,952.00	0.09
503	601065	江盐集团	3,400	38,896.00	0.09
504	600825	新华传媒	8,700	38,889.00	0.09
505	600469	风神股份	6,300	38,871.00	0.09
506	600982	宁波能源	9,500	38,855.00	0.09
507	002860	星帅尔	3,000	38,850.00	0.09
508	002033	丽江股份	4,800	38,832.00	0.09
509	000531	穗恒运 A	5,800	38,802.00	0.09
510	605305	中际联合	1,200	38,772.00	0.09
511	688588	凌志软件	3,254	38,722.60	0.09
512	603916	苏博特	3,800	38,722.00	0.09
513	600488	津药药业	7,900	38,710.00	0.09
514	600162	香江控股	22,200	38,628.00	0.09
515	600830	香溢融通	5,400	38,502.00	0.09
516	002598	山东章鼓	3,700	38,480.00	0.09
517	002186	全聚德	3,300	38,478.00	0.09
518	688015	交控科技	2,050	38,458.00	0.09
519	002869	金溢科技	1,900	38,456.00	0.09
520	002431	棕榈股份	15,000	38,100.00	0.08
521	300486	东杰智能	5,500	38,005.00	0.08
522	002435	长江健康	9,100	37,947.00	0.08
523	300018	中元股份	6,200	37,882.00	0.08

524	002863	今飞凯达	6,100	37,881.00	0.08
525	300632	光莆股份	3,000	37,860.00	0.08
526	000920	沃顿科技	3,800	37,734.00	0.08
527	002877	智能自控	3,600	37,692.00	0.08
528	601579	会稽山	3,500	37,590.00	0.08
529	600855	航天长峰	3,500	37,520.00	0.08
530	300550	和仁科技	2,500	37,475.00	0.08
531	688609	九联科技	2,839	37,474.80	0.08
532	300195	长荣股份	5,500	37,400.00	0.08
533	603698	航天工程	2,600	37,362.00	0.08
534	300092	科新机电	2,800	37,296.00	0.08
535	002666	德联集团	6,900	37,260.00	0.08
536	300440	运达科技	5,000	37,250.00	0.08
537	605366	宏柏新材	4,500	37,215.00	0.08
538	600629	华建集团	7,200	37,152.00	0.08
539	600980	北矿科技	2,100	37,149.00	0.08
540	000428	华天酒店	9,100	37,128.00	0.08
540	300543	朗科智能	3,400	37,128.00	0.08
541	601339	百隆东方	7,600	37,012.00	0.08
542	300040	九洲集团	6,600	36,960.00	0.08
543	002264	新华都	6,700	36,917.00	0.08
544	300381	溢多利	5,000	36,850.00	0.08
545	002148	北纬科技	6,100	36,844.00	0.08
546	002695	煌上煌	3,500	36,645.00	0.08
547	000607	华媒控股	8,000	36,640.00	0.08
548	300139	晓程科技	3,600	36,612.00	0.08
549	000850	华茂股份	9,600	36,576.00	0.08
550	300100	双林股份	3,500	36,505.00	0.08
551	603357	设计总院	4,100	36,490.00	0.08
552	601956	东贝集团	6,100	36,417.00	0.08
553	301330	熵基科技	1,100	36,410.00	0.08
554	601177	杭齿前进	3,500	36,295.00	0.08
555	002772	众兴菌业	4,600	36,294.00	0.08
556	688119	中钢洛耐	7,437	36,292.56	0.08
557	688371	菲沃泰	2,059	36,258.99	0.08
558	002272	川润股份	5,300	36,252.00	0.08
559	601089	福元医药	2,100	36,204.00	0.08
560	000026	飞亚达	3,300	36,168.00	0.08
561	300610	晨化股份	3,200	36,064.00	0.08
562	300246	宝莱特	3,500	36,050.00	0.08
563	002094	青岛金王	9,500	36,005.00	0.08
564	300686	智动力	3,400	35,972.00	0.08
565	605133	嵘泰股份	1,300	35,971.00	0.08

566	002363	隆基机械	4,400	35,948.00	0.08
567	600551	时代出版	3,300	35,937.00	0.08
568	002181	粤传媒	7,800	35,880.00	0.08
569	603558	健盛集团	3,700	35,853.00	0.08
570	002613	北玻股份	7,300	35,843.00	0.08
571	603618	杭电股份	5,600	35,840.00	0.08
572	000407	胜利股份	9,900	35,838.00	0.08
573	300176	派生科技	5,300	35,828.00	0.08
574	605066	天正电气	3,900	35,802.00	0.08
575	603421	鼎信通讯	3,800	35,720.00	0.08
576	002404	嘉欣丝绸	5,900	35,636.00	0.08
577	603232	格尔软件	2,600	35,594.00	0.08
578	600653	申华控股	19,200	35,520.00	0.08
579	603758	秦安股份	3,100	35,464.00	0.08
580	000919	金陵药业	4,500	35,415.00	0.08
581	603081	大丰实业	2,600	35,412.00	0.08
582	600101	明星电力	4,200	35,322.00	0.08
583	300511	雪榕生物	6,600	35,310.00	0.08
584	002879	长缆科技	2,200	35,244.00	0.08
585	000949	新乡化纤	10,900	35,207.00	0.08
586	301011	华立科技	1,500	35,100.00	0.08
587	600345	长江通信	1,800	34,866.00	0.08
588	300196	长海股份	3,200	34,816.00	0.08
589	600081	东风科技	3,100	34,813.00	0.08
590	688201	信安世纪	1,767	34,774.56	0.08
591	300473	德尔股份	1,900	34,732.00	0.08
592	300501	海顺新材	2,400	34,632.00	0.08
593	002082	万邦德	5,400	34,560.00	0.08
594	002975	博杰股份	900	34,380.00	0.08
595	300153	科泰电源	4,300	34,314.00	0.08
596	000626	远大控股	4,700	34,310.00	0.08
597	603333	尚纬股份	6,000	34,260.00	0.08
598	002365	永安药业	3,500	34,230.00	0.08
599	002380	科远智慧	2,000	34,060.00	0.08
600	601007	金陵饭店	4,200	33,936.00	0.08
601	300578	会畅通讯	1,900	33,934.00	0.08
602	002393	力生制药	1,300	33,930.00	0.08
603	300140	节能环境	4,600	33,902.00	0.08
604	603950	长源东谷	2,200	33,880.00	0.08
605	605388	均瑶健康	2,700	33,858.00	0.08
606	300306	远方信息	2,800	33,824.00	0.08
607	688136	科兴制药	1,669	33,797.25	0.08
608	002659	凯文教育	7,800	33,774.00	0.08

609	300062	中能电气	5,400	33,642.00	0.07
610	002443	金洲管道	4,900	33,565.00	0.07
611	000952	广济药业	4,200	33,558.00	0.07
612	300642	透景生命	1,900	33,535.00	0.07
613	301026	浩通科技	1,100	33,495.00	0.07
614	300516	久之洋	1,000	33,460.00	0.07
615	000570	苏常柴 A	5,800	33,408.00	0.07
616	603610	麒盛科技	2,800	33,376.00	0.07
617	688613	奥精医疗	1,493	33,234.18	0.07
618	600229	城市传媒	4,400	33,220.00	0.07
619	603648	畅联股份	3,400	33,184.00	0.07
620	301109	军信股份	2,100	33,180.00	0.07
621	301201	诚达药业	1,300	33,059.00	0.07
622	002622	皓宸医疗	10,100	33,027.00	0.07
623	688089	嘉必优	1,845	33,025.50	0.07
624	002059	云南旅游	5,900	32,981.00	0.07
625	301103	何氏眼科	1,100	32,978.00	0.07
626	603999	读者传媒	4,800	32,976.00	0.07
627	603639	海利尔	2,100	32,970.00	0.07
628	002969	嘉美包装	8,000	32,960.00	0.07
629	301349	信德新材	700	32,956.00	0.07
630	600467	好当家	13,800	32,844.00	0.07
631	600080	金花股份	4,400	32,780.00	0.07
632	603897	长城科技	1,600	32,768.00	0.07
633	688399	硕世生物	600	32,736.00	0.07
634	002801	微光股份	1,500	32,625.00	0.07
635	300289	利德曼	5,300	32,595.00	0.07
636	603066	音飞储存	2,800	32,480.00	0.07
637	001217	华尔泰	2,300	32,476.00	0.07
638	300412	迦南科技	5,700	32,433.00	0.07
639	002822	中装建设	7,400	32,412.00	0.07
640	002788	鹭燕医药	3,600	32,364.00	0.07
641	002722	物产金轮	2,100	32,361.00	0.07
642	688330	宏力达	1,139	32,358.99	0.07
643	688061	灿瑞科技	808	32,320.00	0.07
644	000655	金岭矿业	4,500	32,265.00	0.07
645	605088	冠盛股份	1,400	32,200.00	0.07
646	002543	万和电气	3,600	32,112.00	0.07
646	600429	三元股份	7,200	32,112.00	0.07
647	002133	广宇集团	9,200	32,108.00	0.07
648	603808	歌力思	3,500	32,095.00	0.07
649	002227	奥特迅	2,400	32,088.00	0.07
650	002388	新亚制程	5,100	32,079.00	0.07

651	300976	达瑞电子	600	31,938.00	0.07
652	601566	九牧王	3,200	31,904.00	0.07
653	002734	利民股份	4,000	31,880.00	0.07
654	300561	汇金科技	2,700	31,860.00	0.07
655	000153	丰原药业	3,400	31,858.00	0.07
656	603330	天洋新材	4,200	31,836.00	0.07
657	688788	科思科技	823	31,833.64	0.07
658	605060	联德股份	1,700	31,790.00	0.07
659	688300	联瑞新材	600	31,770.00	0.07
660	688168	安博通	878	31,748.48	0.07
661	002678	珠江钢琴	5,500	31,735.00	0.07
662	002164	宁波东力	4,700	31,725.00	0.07
663	688132	邦彦技术	1,480	31,716.40	0.07
664	603681	永冠新材	2,100	31,710.00	0.07
665	603982	泉峰汽车	2,200	31,702.00	0.07
666	301248	杰创智能	1,800	31,698.00	0.07
667	002286	保龄宝	3,900	31,668.00	0.07
668	002878	元隆雅图	1,700	31,637.00	0.07
669	002141	贤丰控股	10,000	31,600.00	0.07
670	300733	西菱动力	2,620	31,544.80	0.07
671	300546	雄帝科技	2,000	31,540.00	0.07
672	688137	近岸蛋白	567	31,457.16	0.07
673	001201	东瑞股份	1,300	31,382.00	0.07
674	600533	栖霞建设	10,700	31,351.00	0.07
675	603727	博迈科	2,500	31,325.00	0.07
676	002663	普邦股份	17,300	31,313.00	0.07
677	603968	醋化股份	2,200	31,262.00	0.07
678	002566	益盛药业	3,500	31,185.00	0.07
679	002308	威创股份	9,600	31,104.00	0.07
680	603507	振江股份	1,200	31,092.00	0.07
681	688080	映翰通	766	31,084.28	0.07
682	300692	中环环保	5,000	31,000.00	0.07
683	605399	晨光新材	2,280	30,916.80	0.07
684	300483	首华燃气	2,600	30,862.00	0.07
685	000880	潍柴重机	2,900	30,827.00	0.07
686	600981	汇鸿集团	10,100	30,805.00	0.07
687	000701	厦门信达	5,000	30,750.00	0.07
688	002905	金逸影视	2,800	30,688.00	0.07
689	300739	明阳电路	2,000	30,620.00	0.07
690	688287	观典防务	3,097	30,567.39	0.07
691	002412	汉森制药	4,500	30,510.00	0.07
692	603823	百合花	3,100	30,504.00	0.07
693	301345	涛涛车业	500	30,450.00	0.07

694	301115	建科股份	1,700	30,430.00	0.07
695	002172	澳洋健康	8,000	30,320.00	0.07
696	688077	大地熊	1,271	30,313.35	0.07
697	300484	蓝海华腾	2,400	30,312.00	0.07
698	688353	华盛锂电	1,104	30,249.60	0.07
699	000779	甘咨询	2,800	30,184.00	0.07
700	300585	奥联电子	1,800	30,168.00	0.07
701	000505	京粮控股	4,400	30,096.00	0.07
702	301366	一博科技	900	30,033.00	0.07
703	300863	卡倍亿	600	30,024.00	0.07
704	301150	中一科技	900	29,934.00	0.07
705	002731	萃华珠宝	2,700	29,862.00	0.07
706	002687	乔治白	5,600	29,848.00	0.07
707	300818	耐普矿机	900	29,709.00	0.07
708	603776	永安行	2,100	29,568.00	0.07
709	301303	真兰仪表	1,500	29,535.00	0.07
710	300425	中建环能	6,300	29,484.00	0.07
711	603602	纵横通信	2,000	29,480.00	0.07
712	600638	新黄浦	5,700	29,469.00	0.07
713	600716	凤凰股份	8,000	29,440.00	0.07
714	000965	天保基建	9,400	29,422.00	0.07
715	603817	海峡环保	4,600	29,348.00	0.07
716	002593	日上集团	7,300	29,273.00	0.07
717	002644	佛慈制药	3,000	29,250.00	0.07
718	002823	凯中精密	2,300	29,210.00	0.07
719	600826	兰生股份	3,300	29,172.00	0.06
720	301369	联动科技	500	28,935.00	0.06
721	300940	南极光	1,500	28,920.00	0.06
722	600121	郑州煤电	7,100	28,826.00	0.06
723	603040	新坐标	1,100	28,765.00	0.06
724	002873	新天药业	2,300	28,658.00	0.06
724	300643	万通智控	2,300	28,658.00	0.06
725	002084	海鸥住工	7,200	28,656.00	0.06
726	300305	裕兴股份	2,900	28,652.00	0.06
727	603966	法兰泰克	3,500	28,630.00	0.06
728	301389	隆扬电子	1,500	28,620.00	0.06
729	300787	海能实业	1,700	28,594.00	0.06
730	002650	加加食品	7,000	28,560.00	0.06
731	002730	电光科技	3,000	28,440.00	0.06
732	003025	思进智能	2,100	28,371.00	0.06
733	603777	来伊份	2,100	28,182.00	0.06
734	688030	山石网科	1,400	28,028.00	0.06
735	300986	志特新材	2,200	28,006.00	0.06

736	600665	天地源	7,400	27,972.00	0.06
737	300673	佩蒂股份	2,100	27,930.00	0.06
738	300414	中光防雷	2,900	27,927.00	0.06
739	603230	内蒙新华	1,800	27,900.00	0.06
740	600758	辽宁能源	7,700	27,874.00	0.06
741	603825	华扬联众	2,300	27,784.00	0.06
742	301439	泓淋电力	1,900	27,778.00	0.06
743	002628	成都路桥	8,400	27,720.00	0.06
744	300399	天利科技	2,000	27,680.00	0.06
745	603359	东珠生态	3,600	27,648.00	0.06
746	603086	先达股份	4,700	27,636.00	0.06
747	300240	飞力达	4,100	27,634.00	0.06
748	603096	新经典	1,400	27,552.00	0.06
749	000419	通程控股	4,900	27,538.00	0.06
750	002394	联发股份	3,300	27,423.00	0.06
751	600359	新农开发	3,700	27,417.00	0.06
752	600617	国新能源	7,100	27,406.00	0.06
753	603519	立霸股份	2,100	27,384.00	0.06
754	603217	元利科技	1,500	27,360.00	0.06
755	002956	西麦食品	1,900	27,227.00	0.06
756	600278	东方创业	3,900	27,222.00	0.06
757	300771	智莱科技	2,500	27,175.00	0.06
758	603102	百合股份	700	27,146.00	0.06
759	002187	广百股份	4,300	27,133.00	0.06
760	002758	浙农股份	2,600	27,066.00	0.06
761	002492	恒基达鑫	4,500	26,955.00	0.06
762	301166	优宁维	700	26,894.00	0.06
763	300616	尚品宅配	1,500	26,880.00	0.06
764	603843	正平股份	7,700	26,873.00	0.06
765	300265	通光线缆	2,900	26,854.00	0.06
766	301102	兆讯传媒	1,400	26,796.00	0.06
767	603757	大元泵业	1,100	26,664.00	0.06
768	301009	可靠股份	2,500	26,650.00	0.06
769	000833	粤桂股份	4,300	26,617.00	0.06
770	603399	吉翔股份	2,600	26,598.00	0.06
771	300875	捷强装备	900	26,271.00	0.06
772	688230	芯导科技	627	26,233.68	0.06
773	300785	值得买	1,200	26,232.00	0.06
774	603214	爱婴室	1,600	26,176.00	0.06
775	300651	金陵体育	1,300	25,974.00	0.06
776	001283	豪鹏科技	500	25,950.00	0.06
777	002900	哈三联	1,900	25,935.00	0.06
778	300756	金马游乐	1,600	25,920.00	0.06

779	000042	中洲控股	4,500	25,830.00	0.06
780	300943	春晖智控	1,800	25,812.00	0.06
781	600774	汉商集团	2,600	25,636.00	0.06
782	300732	设研院	2,900	25,607.00	0.06
783	600858	银座股份	4,800	25,536.00	0.06
784	300517	海波重科	1,800	25,470.00	0.06
785	688682	霍莱沃	527	25,143.17	0.06
786	600408	安泰集团	10,300	25,029.00	0.06
787	603366	日出东方	4,000	24,920.00	0.06
788	603818	曲美家居	4,600	24,840.00	0.06
789	605299	舒华体育	2,500	24,750.00	0.06
790	688267	中触媒	1,287	24,736.14	0.06
791	000782	美达股份	4,500	24,705.00	0.05
792	605068	明新旭腾	1,100	24,684.00	0.05
793	002923	润都股份	2,000	24,680.00	0.05
794	600965	福成股份	3,900	24,609.00	0.05
795	300839	博汇股份	2,400	24,552.00	0.05
796	603630	拉芳家化	1,600	24,480.00	0.05
797	301195	北路智控	600	24,348.00	0.05
798	301310	鑫宏业	500	24,325.00	0.05
799	300710	万隆光电	1,000	24,320.00	0.05
800	301213	观想科技	600	24,276.00	0.05
801	603076	乐惠国际	900	24,120.00	0.05
802	600817	宇通重工	2,500	24,000.00	0.05
803	688509	正元地信	4,963	23,971.29	0.05
804	301129	瑞纳智能	900	23,967.00	0.05
805	600819	耀皮玻璃	4,700	23,923.00	0.05
806	605286	同力日升	800	23,888.00	0.05
807	300402	宝色股份	1,200	23,808.00	0.05
808	301199	迈赫股份	900	23,625.00	0.05
809	300963	中洲特材	1,800	23,616.00	0.05
810	000411	英特集团	2,100	23,541.00	0.05
811	603689	皖天然气	2,700	23,463.00	0.05
812	600969	郴电国际	3,600	23,400.00	0.05
813	603199	九华旅游	900	23,355.00	0.05
814	000635	英力特	2,600	23,322.00	0.05
814	002835	同为股份	1,300	23,322.00	0.05
815	300852	四会富仕	600	23,124.00	0.05
816	301086	鸿富瀚	500	23,110.00	0.05
817	688075	安旭生物	573	23,080.44	0.05
818	002732	燕塘乳业	1,200	23,040.00	0.05
819	300987	川网传媒	1,300	23,036.00	0.05
820	603109	神驰机电	1,400	22,988.00	0.05

821	300843	胜蓝股份	1,000	22,980.00	0.05
822	002996	顺博合金	2,100	22,932.00	0.05
823	688078	龙软科技	566	22,821.12	0.05
824	002817	黄山胶囊	2,600	22,776.00	0.05
825	301181	标榜股份	800	22,584.00	0.05
826	603180	金牌厨柜	900	22,581.00	0.05
827	002968	新大正	1,800	22,518.00	0.05
828	301135	瑞德智能	900	22,338.00	0.05
829	603711	香飘飘	1,300	22,282.00	0.05
830	001228	永泰运	700	22,274.00	0.05
831	603822	嘉澳环保	800	22,248.00	0.05
832	301323	新莱福	600	22,194.00	0.05
833	002040	南京港	3,100	22,103.00	0.05
834	688255	凯尔达	903	22,078.35	0.05
835	002616	长青集团	4,200	22,050.00	0.05
836	003028	振邦智能	500	22,030.00	0.05
837	688216	气派科技	796	22,025.32	0.05
838	688189	南新制药	2,329	21,962.47	0.05
839	600386	北巴传媒	4,900	21,952.00	0.05
840	301198	喜悦智行	1,800	21,852.00	0.05
841	603303	得邦照明	1,700	21,845.00	0.05
842	301223	中荣股份	1,200	21,744.00	0.05
843	301305	朗坤环境	1,200	21,660.00	0.05
844	688045	必易微	502	21,500.66	0.05
845	688282	理工导航	546	21,457.80	0.05
846	002495	佳隆股份	6,700	21,440.00	0.05
847	001212	中旗新材	900	21,384.00	0.05
848	688426	康为世纪	697	21,293.35	0.05
849	603324	盛剑环境	700	21,259.00	0.05
850	600693	东百集团	5,300	21,253.00	0.05
851	603017	中衡设计	2,100	21,021.00	0.05
852	603289	泰瑞机器	1,900	20,976.00	0.05
853	001380	华纬科技	600	20,904.00	0.05
854	603070	万控智造	1,300	20,878.00	0.05
855	300600	国瑞科技	1,800	20,808.00	0.05
856	603215	比依股份	1,200	20,760.00	0.05
857	603311	金海高科	2,000	20,680.00	0.05
858	301322	绿通科技	500	20,580.00	0.05
859	301280	珠城科技	500	20,540.00	0.05
860	301235	华康医疗	800	20,504.00	0.05
861	300021	大禹节水	4,300	20,468.00	0.05
862	301329	信音电子	900	20,430.00	0.05
863	600939	重庆建工	6,200	20,336.00	0.05

864	301100	风光股份	1,000	20,280.00	0.05
865	688767	博拓生物	667	20,190.09	0.04
866	003027	同兴环保	1,100	20,086.00	0.04
867	301326	捷邦科技	500	20,055.00	0.04
868	688051	佳华科技	600	20,010.00	0.04
869	603856	东宏股份	1,700	19,839.00	0.04
870	301283	聚胶股份	600	19,728.00	0.04
871	688329	艾隆科技	786	19,539.96	0.04
872	301130	西点药业	700	19,516.00	0.04
873	002972	科安达	1,500	19,395.00	0.04
874	688125	安达智能	487	19,212.15	0.04
875	003011	海象新材	900	19,107.00	0.04
876	002858	力盛体育	1,000	19,000.00	0.04
877	301197	工大科雅	1,000	18,790.00	0.04
878	300500	启迪设计	1,300	18,629.00	0.04
879	301332	德尔玛	1,500	18,330.00	0.04
880	301468	博盈特焊	600	18,294.00	0.04
881	301088	戎美股份	1,200	18,276.00	0.04
882	002887	绿茵生态	2,100	18,228.00	0.04
883	603948	建业股份	800	18,192.00	0.04
884	301356	天振股份	1,000	18,190.00	0.04
885	000663	永安林业	2,200	17,776.00	0.04
886	688227	品高股份	923	17,601.61	0.04
887	603190	亚通精工	600	17,568.00	0.04
888	301319	唯特偶	300	17,523.00	0.04
889	300916	朗特智能	700	17,108.00	0.04
890	301118	恒光股份	700	17,101.00	0.04
891	002982	湘佳股份	800	17,048.00	0.04
892	301396	宏景科技	500	16,825.00	0.04
893	002871	伟隆股份	1,500	16,770.00	0.04
894	301320	豪江智能	900	16,623.00	0.04
895	301331	恩威医药	400	16,604.00	0.04
896	603937	丽岛新材	1,300	16,471.00	0.04
897	001332	锡装股份	500	16,425.00	0.04
898	301265	华新环保	1,600	16,400.00	0.04
899	002989	中天精装	1,000	16,320.00	0.04
900	001222	源飞宠物	1,100	16,170.00	0.04
901	300998	宁波方正	700	16,156.00	0.04
902	301258	富士莱	500	16,140.00	0.04
903	301110	青木股份	400	16,084.00	0.04
904	301187	欧圣电气	800	15,928.00	0.04
905	301317	鑫磊股份	800	15,728.00	0.04
906	003037	三和管桩	1,400	15,652.00	0.03

907	301399	英特科技	400	15,308.00	0.03
908	301337	亚华电子	500	15,305.00	0.03
909	301170	锡南科技	500	15,215.00	0.03
910	301112	信邦智能	500	14,985.00	0.03
911	301379	天山电子	500	14,795.00	0.03
912	301276	嘉曼服饰	600	14,628.00	0.03
913	300950	德固特	900	14,517.00	0.03
914	001229	魅视科技	400	14,240.00	0.03
915	301318	维海德	400	14,164.00	0.03
916	001316	润贝航科	400	13,924.00	0.03
917	301292	海科新源	700	13,650.00	0.03
918	301227	森鹰窗业	500	13,535.00	0.03
919	301212	联盛化学	500	13,500.00	0.03
920	301296	新巨丰	1,300	13,390.00	0.03
921	605389	长龄液压	500	13,380.00	0.03
922	001333	光华股份	600	13,284.00	0.03
923	688459	哈铁科技	1,400	13,104.00	0.03
924	301119	正强股份	500	12,940.00	0.03
925	603787	新日股份	1,000	12,510.00	0.03
926	605138	盛泰集团	1,600	12,400.00	0.03
927	301361	众智科技	500	11,920.00	0.03
928	001256	炜冈科技	600	11,106.00	0.02
929	301290	东星医疗	400	11,036.00	0.02
930	301365	矩阵股份	700	10,584.00	0.02
931	603151	邦基科技	700	10,563.00	0.02
932	300892	品渥食品	400	9,892.00	0.02
933	300871	回盛生物	600	8,676.00	0.02
934	301273	瑞晨环保	300	8,277.00	0.02
935	301279	金道科技	300	7,437.00	0.02

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

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	002229	鸿博股份	2,999,543.00	6.68
2	000766	通化金马	1,624,181.50	3.62
3	603083	剑桥科技	1,618,075.00	3.60
4	002654	万润科技	1,611,137.00	3.59
5	601020	华钰矿业	1,498,698.20	3.34
6	300364	中文在线	1,498,459.00	3.34

7	600410	华胜天成	1,496,816.00	3.33
8	002354	天娱数科	1,443,141.00	3.21
9	601858	中国科传	1,423,379.00	3.17
10	688596	正帆科技	1,416,922.05	3.15
11	300049	福瑞股份	1,398,533.00	3.11
12	300825	阿尔特	1,398,249.00	3.11
13	300161	华中数控	1,397,491.00	3.11
14	600976	健民集团	1,379,499.00	3.07
15	603918	金桥信息	1,366,881.00	3.04
16	000837	秦川机床	1,345,834.77	3.00
17	002334	英威腾	1,344,524.00	2.99
18	002031	巨轮智能	1,327,768.00	2.96
19	002073	软控股份	1,324,194.00	2.95
20	300624	万兴科技	1,322,892.00	2.94
21	300331	苏大维格	1,306,442.00	2.91
22	600138	中青旅	1,304,743.00	2.90
23	300551	古鳌科技	1,273,966.00	2.84
24	002154	报喜鸟	1,252,658.00	2.79
25	300415	伊之密	1,248,839.00	2.78
26	002077	大港股份	1,206,109.00	2.68
27	300678	中科信息	1,203,690.00	2.68
28	600105	永鼎股份	1,195,184.00	2.66
29	600620	天宸股份	1,186,300.00	2.64
30	000589	贵州轮胎	1,185,706.00	2.64
31	688062	迈威生物	1,176,442.46	2.62
32	300360	炬华科技	1,168,857.00	2.60
33	600351	亚宝药业	1,164,423.00	2.59
34	600461	洪城环境	1,154,393.00	2.57
35	300098	高新兴	1,145,384.22	2.55
36	600094	大名城	1,144,862.00	2.55
37	300548	博创科技	1,137,089.00	2.53
38	300355	蒙草生态	1,128,096.00	2.51
39	600084	中信尼雅	1,116,039.00	2.48
40	603035	常熟汽饰	1,112,154.00	2.48
41	002338	奥普光电	1,103,009.00	2.46
42	002703	浙江世宝	1,100,415.00	2.45
43	002527	新时达	1,097,034.00	2.44
44	600186	莲花健康	1,095,341.00	2.44
45	300048	合康新能	1,084,925.00	2.42
46	000912	泸天化	1,075,391.00	2.39
47	601163	三角轮胎	1,073,580.00	2.39
48	002386	天原股份	1,068,854.00	2.38
49	300217	东方电热	1,066,285.00	2.37

50	603383	顶点软件	1,062,778.00	2.37
51	300025	华星创业	1,060,947.00	2.36
52	600200	江苏吴中	1,051,423.00	2.34
53	002315	焦点科技	1,049,233.00	2.34
54	300480	光力科技	1,046,481.00	2.33
55	301096	百诚医药	1,045,924.00	2.33
56	002707	众信旅游	1,039,826.00	2.31
57	603283	赛腾股份	1,036,261.29	2.31
58	300766	每日互动	1,035,034.00	2.30
59	688095	福昕软件	1,023,983.43	2.28
60	002057	中钢天源	1,023,678.00	2.28
61	002681	奋达科技	1,012,872.00	2.25
62	002270	华明装备	1,012,371.00	2.25
63	300008	天海防务	1,011,350.00	2.25
64	000713	丰乐种业	1,008,393.00	2.24
65	603668	天马科技	1,000,586.00	2.23
66	002149	西部材料	997,313.95	2.22
67	600537	亿晶光电	995,096.00	2.22
68	300705	九典制药	994,581.80	2.21
69	300032	金龙机电	992,264.00	2.21
70	600133	东湖高新	987,461.00	2.20
71	603220	中贝通信	987,221.00	2.20
72	600269	赣粤高速	985,362.00	2.19
73	600973	宝胜股份	976,776.00	2.17
74	600756	浪潮软件	976,284.00	2.17
75	688212	澳华内镜	974,401.00	2.17
76	603590	康辰药业	973,711.00	2.17
77	300576	容大感光	965,715.00	2.15
78	300138	晨光生物	964,303.00	2.15
79	002642	荣联科技	962,106.00	2.14
80	002197	证通电子	961,009.00	2.14
81	002445	中南文化	956,804.00	2.13
82	600664	哈药股份	956,270.00	2.13
83	688049	炬芯科技	952,126.16	2.12
84	000700	模塑科技	941,419.00	2.10
85	600757	长江传媒	939,171.00	2.09
86	300378	鼎捷软件	938,740.00	2.09
87	300041	回天新材	933,838.00	2.08
88	688550	瑞联新材	928,667.59	2.07
89	600106	重庆路桥	927,407.00	2.06
90	603556	海兴电力	926,563.00	2.06
91	601388	怡球资源	921,291.00	2.05
92	300113	顺网科技	917,680.00	2.04

93	000922	佳电股份	914,580.00	2.04
94	300620	光库科技	914,352.00	2.04
95	603227	雪峰科技	912,218.00	2.03
96	002570	贝因美	906,308.00	2.02
97	600509	天富能源	899,317.00	2.00

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	603083	剑桥科技	1,783,097.00	3.97
2	601858	中国科传	1,513,380.24	3.37
3	688596	正帆科技	1,482,892.77	3.30
4	600410	华胜天成	1,410,331.00	3.14
5	600976	健民集团	1,388,036.00	3.09
6	601020	华钰矿业	1,307,315.00	2.91
7	603220	中贝通信	1,208,530.92	2.69
8	600138	中青旅	1,202,681.00	2.68
9	603918	金桥信息	1,192,891.00	2.66
10	600186	莲花健康	1,148,825.81	2.56
11	688062	迈威生物	1,112,549.74	2.48
12	600105	永鼎股份	1,107,813.00	2.47
13	600620	天宸股份	1,084,263.00	2.41
14	600351	亚宝药业	1,071,198.51	2.38
15	601163	三角轮胎	1,059,270.00	2.36
16	600461	洪城环境	1,058,493.00	2.36
17	603035	常熟汽饰	1,039,090.00	2.31
18	600084	中信尼雅	1,038,120.00	2.31
19	600094	大名城	1,027,821.00	2.29
20	603283	赛腾股份	1,022,537.00	2.28
21	600200	江苏吴中	986,532.00	2.20
22	688212	澳华内镜	986,437.98	2.20
23	688095	福昕软件	979,823.41	2.18
24	688049	炬芯科技	969,619.54	2.16
25	603383	顶点软件	958,572.00	2.13
26	603668	天马科技	951,290.00	2.12
27	600269	赣粤高速	945,931.00	2.11
28	603556	海兴电力	942,058.00	2.10
29	600133	东湖高新	941,471.00	2.10
30	603590	康辰药业	912,905.00	2.03
31	600756	浪潮软件	910,233.00	2.03
32	600106	重庆路桥	899,926.00	2.00

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	535,912,845.13
卖出股票收入（成交）总额	206,851,527.96

注：8.4.1 项“买入金额”、8.4.2 项“卖出金额”及 8.4.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用

8.5 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）	23,720.26	0.05
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	23,720.26	0.05

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	111018	华康转债	140	14,000.43	0.03
2	123234	中能转债	44	5,719.53	0.01
3	118046	诺泰转债	40	4,000.30	0.01

注：报告期末，本基金仅持有上述 3 只债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

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

无。

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

无。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

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

无。

8.11.2 本期国债期货投资评价

无。

8.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，其中，北京华胜天成科技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或/及处罚的情况。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资管理制度的相关规定。

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

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	378,709.58
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	378,709.58

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 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	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
585	75,181.35	27,625,127.00	62.81	16,355,961.00	37.19

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	中信建投证券股份有 限公司	4,285,781.00	9.74
2	兴业证券股份有限公 司	4,070,119.00	9.25
3	方正证券股份有限公 司	3,026,668.00	6.88
4	华泰证券股份有限公 司	3,000,173.00	6.82
5	中信证券股份有限公 司	2,691,215.00	6.12
6	广发证券股份有限公 司	2,493,117.00	5.67
7	海通证券股份有限公 司	2,130,000.00	4.84
8	招商证券股份有限公 司	2,037,924.00	4.63
9	东海证券股份有限公 司	1,499,966.00	3.41
10	吕芸	1,000,058.00	2.27

注：上述基金持有人份额均为场内基金份额。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

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

9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

无。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2023 年 9 月 14 日） 基金份额总额	490,981,088.00
基金合同生效日起至报告期期末基金 总申购份额	33,000,000.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基 金总赎回份额	480,000,000.00
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	43,981,088.00

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 基金管理人的重大人事变动情况

2023 年 4 月 29 日，本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，张峰先生任公司副总经理。

2023 年 4 月 29 日，本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，程剑先生任公司副总经理。

2023 年 4 月 29 日，本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，李明先生任公司财务总监。

2023 年 6 月 20 日，本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，姚志鹏先生任公司副总经理。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

自 2023 年 12 月 28 日起，孙沛涛先生任托管部行政负责人，吴俊文女士不再担任托管部行政负责人。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金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

本基金基金合同生效日为 2023 年 9 月 14 日。报告年度应支付普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)的审计费 54,000.00 元, 该审计机构第 1 年提供审计服务。

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

本报告期, 基金管理人及其高级管理人员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

本报告期内本基金管理人、托管人及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位: 人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中信证券股份有限公司	5	742,764,373.09	100.00	479,737.44	100.00	新增

注: 1. 本表“佣金”指本基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该等券商的佣金合计。

2. 交易单元的选择标准和程序

- (1) 经营行为规范;
- (2) 财务状况良好;
- (3) 研究能力较强;

基金管理人根据以上标准进行考察后确定租用券商的交易单元。基金管理人与被选择的券商签订协议, 并通知基金托管人。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位: 人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
中信证券股份有限公司	158,973.71	100.00	-	-	-	-

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	关于增加中信证券等为嘉实中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金网下认购销售机构的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 9 月 1 日
2	关于增加国元证券为嘉实中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金网下认购销售机构的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 9 月 8 日
3	嘉实中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 9 月 15 日
4	嘉实中证 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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 9 月 19 日
5	嘉实中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 9 月 19 日
6	关于嘉实中证 2000 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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 9 月 22 日
7	关于嘉实中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金上市交易提示性公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 9 月 22 日
8	关于嘉实中证 2000 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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 10 月 20 日
9	关于嘉实中证 2000 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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 11 月 8 日

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予嘉实中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复文件。

- (2) 《嘉实中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- (4) 《嘉实中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 报告期内嘉实中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金公告的各项原稿。

12.2 存放地点

北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层嘉实基金管理有限公司

12.3 查阅方式

(1) 书面查询：查阅时间为每工作日 8:30-11:30, 13:00-17:30。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件。

(2) 网站查询：基金管理人网址：<http://www.jsfund.cn>

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人嘉实基金管理有限公司，咨询电话 400-600-8800，或发 E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司

2024 年 3 月 28 日