

易方达中证 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：易方达基金管理有限公司

基金托管人：国泰君安证券股份有限公司

送出日期：二〇二四年三月二十九日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人国泰君安证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料已经审计。安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2023 年 9 月 13 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作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	11
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	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 审计报告	15
6.1 审计意见	15
6.2 形成审计意见的基础	16
6.3 其他信息	16
6.4 管理层和治理层对财务报表的责任	16
6.5 注册会计师对财务报表审计的责任	16
§ 7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	19
7.3 净资产变动表	21
7.4 报表附注	22
§ 8 投资组合报告	48
8.1 期末基金资产组合情况	48
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	49
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	50

8.4	报告期内股票投资组合的重大变动	72
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	74
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	75
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	75
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	75
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	75
8.10	本基金投资股指期货的投资政策	75
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	75
8.12	投资组合报告附注	76
§ 9	基金份额持有人信息	77
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	77
9.2	期末上市基金前十名持有人	77
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	77
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	77
§ 10	开放式基金份额变动	78
§ 11	重大事件揭示	78
11.1	基金份额持有人大会决议	78
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	78
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	78
11.4	基金投资策略的改变	78
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	78
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	78
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	79
11.8	其他重大事件	80
§ 12	备查文件目录	81
12.1	备查文件目录	81
12.2	存放地点	82
12.3	查阅方式	82

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	易方达中证 2000ETF
场内简称	中证 2000 指数 ETF
基金主代码	159532
交易代码	159532
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023 年 9 月 13 日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	国泰君安证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	75,564,791.00 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 21 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	为了更好地实现跟踪标的指数的目的，基金管理人可根据基金运作及指数情况决定本基金采用抽样复制投资策略或完全复制投资策略。本基金目前采用抽样复制投资策略。本基金采用抽样复制投资策略时，基金管理人将依托指数投资平台，综合考虑指数成份股构成、代表性、相关性、流动性等因素，构建指数化投资组合，追求投资组合与标的指数的风险收益特征尽可能相近，以达到紧密跟踪标的指数的目的。本基金采用完全复制投资策略时，将完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情形导致基金无法完全投资于标的指数成份股时，基金管理人可采取包括成份股替代策略在内的其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到紧密跟踪标的指数的目的。本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 以内。此外，本基金将以降低跟踪误

	差和流动性管理为目的，综合考虑流动性和收益性，适当参与债券和货币市场工具的投资。为更好地实现投资目标，本基金可投资股指期货、国债期货、股票期权。在加强风险防范并遵守审慎原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要参与转融通证券出借业务，并可根据相关法律法规参与融资业务。
业绩比较基准	中证 2000 指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，紧密跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		易方达基金管理有限公司	国泰君安证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王玉	帅芳
	联系电话	020-85102688	021-38031815
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	tgrxp@tg.gtja.com
客户服务电话		400 881 8088	021-38917599-5
传真		020-38798812	021-38677819
注册地址		广东省珠海市横琴新区荣粤道 188号6层	中国（上海）自由贸易试验区商城 路618号
办公地址		广州市天河区珠江新城珠江东 路30号广州银行大厦40-43楼	上海市静安区新闻路669号博华广 场19楼
邮政编码		510620	200041
法定代表人		刘晓艳	朱健

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.efunds.com.cn
基金年度报告备置地点	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
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 13 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
本期已实现收益	6,051,589.11
本期利润	5,726,939.32
加权平均基金份额本期利润	0.0251
本期加权平均净值利润率	2.49%
本期基金份额净值增长率	3.85%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末
期末可供分配利润	2,910,450.66
期末可供分配基金份额利润	0.0385
期末基金资产净值	78,475,241.66
期末基金份额净值	1.0385
3.1.3 累计期末指标	2023 年末
基金份额累计净值增长率	3.85%

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

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

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

4.本基金合同于 2023 年 9 月 13 日生效，合同生效当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

3.2 基金净值表现

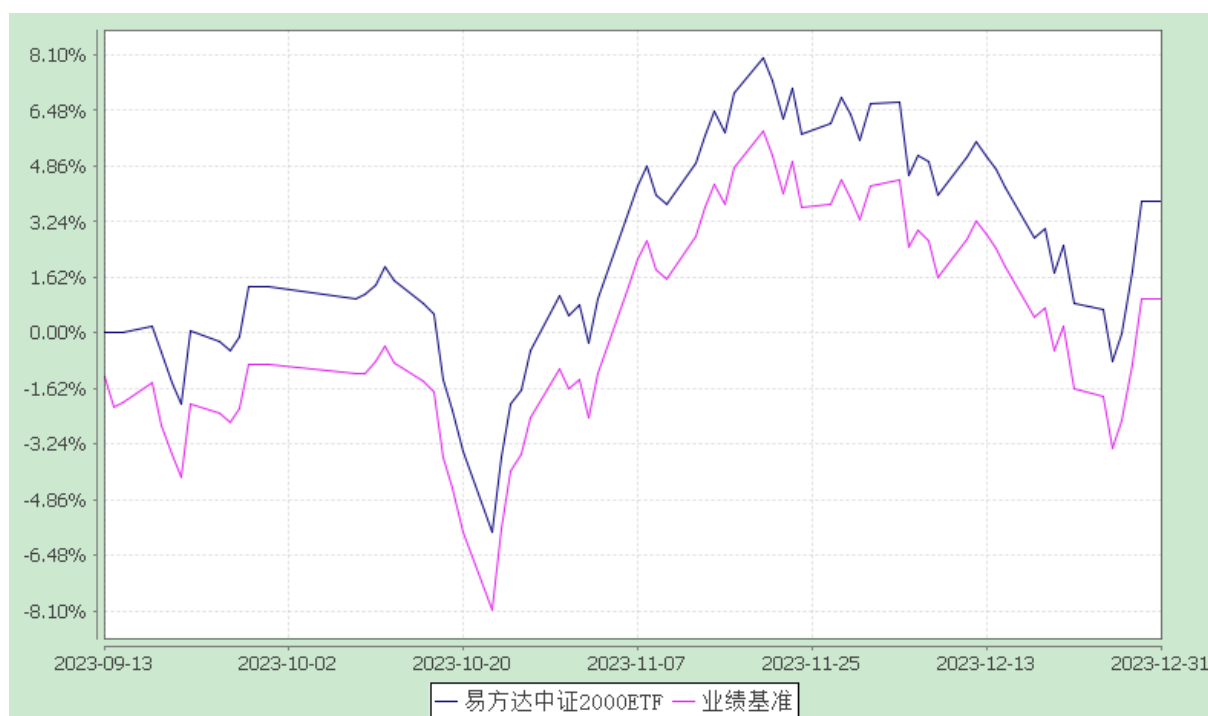
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	2.49%	1.09%	1.92%	1.10%	0.57%	-0.01%
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	3.85%	1.04%	1.00%	1.08%	2.85%	-0.04%

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

易方达中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 (2023 年 9 月 13 日至 2023 年 12 月 31 日)



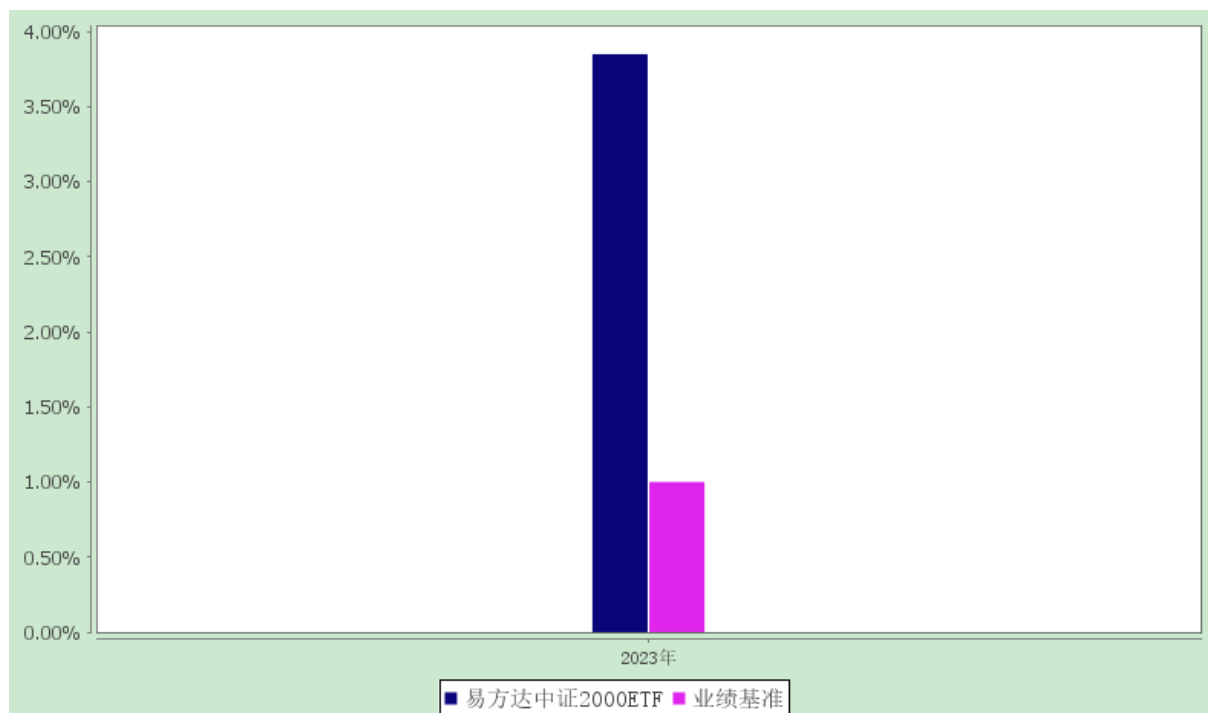
注：1.本基金合同于 2023 年 9 月 13 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2.按基金合同和招募说明书的约定，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本基金合同（第十四部分二、投资范围，三、投资策略和四、投资限制）的有关约定。本报告期本基金处于建仓期内，在上市交易前已完成拟合标的指数。

3.自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为 3.85%，同期业绩比较基准收益率为 1.00%。

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

易方达中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金
 自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图



注：本基金合同生效日为 2023 年 9 月 13 日，合同生效当年期间的相关数据和指标按实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效日（2023 年 9 月 13 日）至本报告期末未发生利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2001]4 号文批准，本基金管理人成立于 2001 年 4 月 17 日，注册资本 13,244.2 万元人民币。本基金管理人拥有公募、社保、年金、特定客户资产管理、QDII、基本养老保险基金投资等业务资格，在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、多资产投资、海外投资、FOF 投资、另类投资等领域全面布局，为境内外客户提供资产管理解决方案。

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		
李栩	本基金的基金经理，易方达中证物联网主题 ETF、易方达中证沪港深 500ETF、易方达中证港股通互联网 ETF、易方达中证生物科技主题 ETF 联接发起式、易方达国证信息技术创新主题 ETF、易方达中证港股通互联网 ETF 联接发起式、易方达中证物联网主题 ETF 联接发起式的基金经理，易方达中证军工 ETF、易方达中证红利 ETF 联接发起式、易方达 MSCI 中国 A50 互联互通 ETF 联接、易方达中证海外中国互联网 50 (QDII-ETF)、易方达中证红利 ETF、易方达 MSCI 中国 A50 互联互通 ETF、易方达中证军工指数 (LOF)、易方达中证全指证券公司指数 (LOF) 的基金经理助理	2023-09-13	-	6 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任国泰君安证券股份有限公司分析师，易方达基金管理有限公司研究员。
林伟斌	本基金的基金经理，易方达中证 800ETF、易方达中证 800ETF 联接发起式、易方达中证红利 ETF、易方达中证红利 ETF 联接发起式、易方达上证科创板 50ETF、易方达中证国有企业改革指数 (LOF) (自 2021 年 01 月 01 日至 2023 年 09 月 01 日)、易方达上证 50 指数 (LOF) (自 2021 年 01 月 01 日至 2023 年 09 月 01 日)、易方达上证科创 50 联接、易方达 MSCI 中国 A50 互联互通 ETF、易方达中证 500 质量成长 ETF (自 2021 年 12 月 17 日至 2023 年 09 月 01 日)、易方达 MSCI 中国 A50 互联互通 ETF 联接、易方达纳斯达克 100ETF (QDII)、易方达 MSCI 美国 50ETF (QDII)、易方达中证红利低波动 ETF 的基金经理，指数投资部总经理、指数投资决策委员会委员	2023-09-13	-	15 年	博士研究生，具有基金从业资格。曾任中国金融期货交易所股份有限公司研发部研究员，易方达基金管理有限公司指数与量化研究员、基金经理助理、量化基金组合部副总经理、量化策略部副总经理、指数投资部副总经理，易方达沪深 300ETF 发起式、易方达沪深 300ETF 发起式联接、易方达黄金 ETF、易方达中证 500ETF、易方达黄金 ETF 联接、易方达标普医疗保健指数 (QDII-LOF)、易方达标普 500 指数 (QDII-LOF)、易方达标普生物科技指数 (QDII-LOF)、易方达标普信息科技指数 (QDII-LOF)、易方达纳斯达克 100 指数 (QDII-LOF) 的基金经理。

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”为根据公司决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理/基金经理助理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2. 证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

3. 为加强基金流动性管理，本基金安排了相关人员协助基金经理进行现金头寸与流动性管理。

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《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，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

公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引(试行)》等法规和自律规则制定了《公平交易管理办法》等制度，明确公平交易的适用范围、原则和内容、管控措施、公平交易执行程序 and 分配原则、反向交易控制、公平交易效果评估及报告等。

公平交易制度所规范的范围涵盖旗下各类资产组合，围绕境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易（含银行间市场）、境外投资、衍生品等投资管理活动，贯穿投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节。

公平交易的管控措施和执行程序主要包括：通过建立规范的投资决策机制、共享研究资源和投资品种备选库为投资人员提供公平的投资机会；投资人员应公平对待其管理的不同投资组合，原则上应当做到“同时同价”，合理控制其所管理不同组合对同一证券的同向交易价差；建立并实行集中交易制度，交易系统具备公平交易功能，对于满足公平交易执行条件的同向指令，系统将自动启用公平交易功能，按照交易公平的原则合理分配各投资指令的执行；严格控制不同投资组合之间的同日反向交易；根据交易所场内竞价交易和非公开竞价交易的不同特点分别设定合理的交易执行程序和分配机制，通过系统与人工控制相结合的方式，力求确保所有投资组合在交易机会上得到公平、合理对待；建立事中和事后的同向交易、反向交易、异常交易监控分析机制，对发现的异常问题进行提示，并要求投资组合经理解释说明。

公司严格按照法律法规的要求禁止旗下管理的不同投资组合之间各种可能导致不公平交易和利益输送的反向交易行为。对于旗下投资组合之间（纯被动指数组合和量化投资组合除外）确因投资策略或流动性管理等需要而进行的反向交易，投资人员须提供充分的投资决策依据，并经审核确认方可执行。

公司通过定期或不定期的公平交易效果评估报告机制，使投资和交易人员能及时了解各组合的

公平交易执行状况,持续督促公平交易制度的落实执行,并不断在实践中检验和完善公平交易制度。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内,上述公平交易制度和控制方法总体执行情况良好,未发现旗下投资组合之间存在不公平交易现象。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内,本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 47 次,其中 40 次为旗下指数及量化组合因投资策略需要和其他组合发生反向交易,7 次为不同基金经理管理的基金因投资策略不同而发生的反向交易,有关基金经理按规定履行了审批程序。

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,该指数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,反映不同市值规模上市公司证券的整体表现。报告期内本基金主要采用抽样复制投资策略,基金管理人将依托指数投资平台,综合考虑指数成份股构成、代表性、相关性、流动性等因素,构建指数化投资组合,追求投资组合与标的指数的风险收益特征尽可能相近,以达到紧密跟踪标的指数的目的。

回顾 2023 年,随着一系列推动宏观经济回升向好政策效果不断显现,我国经济整体延续恢复态势,国内需求逐步恢复,工业生产稳步回升,全年 GDP 约 126 万亿,按不变价格计算,比上年增长 5.2%。但同时,经济回升过程中也面临着一些困难与挑战,例如有效需求仍显不足、部分行业存在产能过剩问题、社会预期偏弱、外部环境也更趋复杂严峻,这一系列因素影响我国经济恢复的进程,经济恢复向好的基础不够牢固。在这样的环境下,2023 年 A 股市场先上涨后下跌。受益于经济复苏初期较为宽松的信用环境和市场流动性,小市值公司的估值弹性较大。2023 年内,中证 2000 指数上涨 5.6%,收益率表现强于 A 股大盘。

本报告期内本基金仍处于建仓期,建仓期间内本基金采取相对灵活以及审慎的建仓策略,在严格按照基金合同要求以及尽量减少市场冲击的原则下进行建仓工作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为 1.0385 元,本报告期份额净值增长率为 3.85%,同期业绩比较基准收益率为 1.00%。受建仓期影响,年化跟踪误差 3.33%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2023 年 12 月中旬中央经济工作会议召开，会议指出，2024 年要多出有利于稳预期、稳增长、稳就业的政策，强化宏观政策逆周期和跨周期调节，巩固和增强经济回升向好态势，持续推动经济实现质的有效提升和量的合理增长。展望 2024 年，随着推动经济持续回升向好的一批政策措施逐步出台，国内经济动能将迎来持续改善。在经济持续向好预期的推动下，A 股上市企业盈利增速中枢有望得到抬升，投资者风险偏好也有望回暖，在未来较长的一段时期内，国内股票市场可能在盈利增速提升与估值修复的情形下，迎来较好的投资机会。

长期来看，在高质量发展目标的驱动下，处于细分行业隐形冠军地位的专精特新小市值企业，逐步走向科技含量更高的产业链、参与全球市场竞争，盈利能力与业务规模均有较好的提升，公司的业绩成长进入发展快车道。

作为被动型投资基金，本基金将坚持既定的指数化投资策略，以严格控制基金相对目标指数的跟踪偏离为投资目标，追求跟踪误差的最小化，为投资者提供质地优良的指数投资工具，为长期看好 A 股小微盘股投资前景的投资者提供方便、高效的工具。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期，基金管理人根据法律法规、监管要求的变化和业务发展的需要，继续围绕严守合规底线、履行合规义务、防控重大风险等完善公司内控，持续审视健全制度流程并强化对法规和制度执行情况的监督检查，有效保障了旗下基金及公司各项业务合法合规、稳健有序运作开展。

本报告期，基金管理人主要监察稽核工作及措施如下：

(1) 不断推进公司合规和廉洁从业文化建设，践行“合规、诚信、专业、稳健”的行业文化理念，坚持投资者利益至上，持续督促廉洁从业、执业操守和道德规范等规定贯彻落实，积极开展形式多样的文化宣导，引导员工树立正确的价值观、事业观、职业观，不断推动建设风清气正的公司及行业生态环境。

(2) 持续完善投资合规监控手段，协同投资、研究、交易等业务部门完善相应的内控机制，共同巩固投资合规内控防线。升级风控系统，提升投资合规监控工作效能，有效保障各类资产组合的合规运作。持续加强关联交易、公平交易、异常交易和内幕交易等监测管控机制，保护投资者利益。

(3) 持续督促优化基金募集申请材料质量内控机制和工具手段，提升产品合规审查质效；坚持以风险可测可控、投资者有效保护为前提，审慎评估论证各类新产品与新业务方案，全面充分揭示产品风险，切实保护投资者合法权益。

(4) 持续贯彻落实基金销售相关法规和监管要求，坚持以投资者视角审核基金宣传推介材料，持续加强对网络直播、自媒体账号、对外言论发布、投资者交流等重点领域的合规管理。深入落实

投资者适当性管理，妥善处理客户投诉纠纷，切实加大投资者教育和保护力度。

(5) 持续落实法律法规、自律规则、基金合同信息披露相关规定，完善信息披露管理工作机制流程，不断提高信息披露监测触发、制作、审核、报送的自动化水平和合规风险控制能力，做好公司及旗下各基金的信息披露工作，确保真实、准确、完整、及时、简明和易得。

(6) 贯彻落实风险为本的工作方法，持续完善洗钱风险管理体系，进一步健全内控制度流程，深入开展反洗钱系统建设与数据治理，探索优化风险评估识别方法，加强客户尽职调查，全面提高反洗钱工作的履职质效。

(7) 以法律法规、基金合同及公司规章制度为依据，有计划、有重点地对投研交易、基金销售、运营、人员规范、反洗钱等工作领域开展内审检查，同时聘请并配合外部审计机构开展 ISAE3402 内控鉴证、GIPS（全球投资业绩标准）鉴证项目，聘请律师事务所完成年度合规有效性评估工作，从不同视角更加全面审视公司合规内控机制和执行情况，督促改进内外部检查发现问题，进一步提升公司合规管理及内控水平。

本基金管理人将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，努力防范和控制重大风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 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，估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值

低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，国泰君安证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在易方达中证 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

本报告期内，本托管人根据《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规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况（如有）、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

安永华明（2024）审字第 70013033_G121 号

易方达中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

我们审计了易方达中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金的财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年 9 月 13 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相关财务报表附注。

我们认为，后附的易方达中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了易方达中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年 9 月 13 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于易方达中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

6.3 其他信息

易方达中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，管理层负责评估易方达中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。

治理层负责监督易方达中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金的财务报告过程。

6.5 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、

故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

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

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

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

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

赵雅 李飘飘

北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室

2024 年 3 月 26 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：易方达中证 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	2,099,721.75

结算备付金		933,131.33
存出保证金		1,414,875.94
交易性金融资产	7.4.7.2	74,429,551.44
其中：股票投资		74,409,550.70
基金投资		-
债券投资		20,000.74
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收清算款		95,397.85
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.5	-
资产总计		78,972,678.31
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		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		11,252.68
应付托管费		3,750.89
应付销售服务费		-

应付投资顾问费		-
应交税费		0.13
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.6	482,432.95
负债合计		497,436.65
净资产：		
实收基金	7.4.7.7	75,564,791.00
未分配利润	7.4.7.8	2,910,450.66
净资产合计		78,475,241.66
负债和净资产总计		78,972,678.31

注：1.本基金合同生效日为 2023 年 9 月 13 日，2023 年度实际报告期间为 2023 年 9 月 13 日至 2023 年 12 月 31 日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

2.报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0385 元，基金份额总额 75,564,791.00 份。

7.2 利润表

会计主体：易方达中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 9 月 13 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 13 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		6,192,173.45
1.利息收入		269,558.19
其中：存款利息收入	7.4.7.9	269,558.19
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）		5,845,101.80

其中：股票投资收益	7.4.7.10	5,688,365.16
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.11	51,945.50
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	7.4.7.13	55,903.45
股利收益	7.4.7.14	48,887.69
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	-324,649.79
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	402,163.25
减：二、营业总支出		465,234.13
1. 管理人报酬		292,722.29
2. 托管费		62,101.45
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	7.4.7.17	-
7. 税金及附加		321.35
8. 其他费用	7.4.7.18	110,089.04
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		5,726,939.32
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		5,726,939.32
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		5,726,939.32

注：本基金合同生效日为 2023 年 9 月 13 日，2023 年度实际报告期间为 2023 年 9 月 13 日至 2023 年 12 月 31 日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期

对比数据。

7.3 净资产变动表

会计主体：易方达中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 9 月 13 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 13 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-
二、本期期初净资产	811,564,791.00	-	811,564,791.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-736,000,000.00	2,910,450.66	-733,089,549.34
（一）、综合收益总额	-	5,726,939.32	5,726,939.32
（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）	-736,000,000.00	-2,816,488.66	-738,816,488.66
其中：1.基金申购款	138,000,000.00	1,988,562.40	139,988,562.40
2.基金赎回款	-874,000,000.00	-4,805,051.06	-878,805,051.06
（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	75,564,791.00	2,910,450.66	78,475,241.66

注：本基金合同生效日为 2023 年 9 月 13 日，2023 年度实际报告期间为 2023 年 9 月 13 日至 2023 年 12 月 31 日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：刘晓艳，主管会计工作负责人：陈荣，会计机构负责人：王永铿

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

易方达中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)根据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]1937 号《关于准予易方达中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》进行募集,由易方达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《易方达中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案,《易方达中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2023 年 9 月 13 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 811,564,791.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 51,791.00 份基金份额。本基金为交易型开放式基金,存续期限不定。本基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司,基金托管人为国泰君安证券股份有限公司。

本基金募集期间为 2023 年 9 月 1 日至 2023 年 9 月 8 日,募集金额总额为人民币 811,564,791.00 元,其中:有效净认购金额为人民币 811,513,000.00 元,有效认购资金在募集期内产生的银行利息共计人民币 51,791.00 元,经安永华明(2023)验字第 70013033_G03 号验资报告予以审验。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)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》《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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止,惟本会计年度期间为 2023 年 9 月 13 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。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

（1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据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分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产。

（2）金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

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

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

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

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

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

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和金融负债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，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，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) 不存在活跃市场的金融工具，应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。采用估值技术确定公允价值时，应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，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金同时满足下列条件时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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收益/(损失)占净资产比例计算的金额。未实现损益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利得/(损失)

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确认。未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，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

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(4) 转融通证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额，在转融通证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时扣除适用情况下的相关税费后的净额计入转融通证券出借业务利息收入；

(5) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(6) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(7) 公允价值变动收益系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、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(8) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致企业资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

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

(1)本基金收益分配方式采用现金分红；

(2)每一基金份额享有同等分配权；

(3)基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率达到 1%以上，基金管理人可进行收益分配；

(4)在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配无需以弥补亏损为前提，收益分配后基金份额净值有可能低于面值；

(5)法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。证券交易所或基金登记结算机构对收益分配另有规定的，从其规定。

基金管理人可在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，对上述原则进行修改或调整，而无需召开基金份额持有人大会审议。

7.4.4.12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。

7.4.5会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

7.4.6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。根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，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、城建税、教育费附加及地方教育费附加

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。金融商品转让，按照卖出价扣除买入价后的余额为销售额。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，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；

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，自 2018 年 1 月 1 日起，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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；

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，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，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；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、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股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、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。

本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3% 和 2% 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

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

个人所得税税率为 20%。

基金从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，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，减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，减按 25% 计入应纳税所得额；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。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末	
	2023 年 12 月 31 日	
活期存款	2,099,721.75	
等于：本金	2,098,748.56	
加：应计利息	973.19	
定期存款	-	
等于：本金	-	
加：应计利息	-	
其中：存款期限 1 个月以内	-	
存款期限 1-3 个月	-	
存款期限 3 个月以上	-	
其他存款	-	
等于：本金	-	
加：应计利息	-	
合计	2,099,721.75	

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	74,649,200.49	-	74,409,550.70	-239,649.79

贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	19,999.86	0.88	20,000.74	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	19,999.86	0.88	20,000.74	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		74,669,200.35	0.88	74,429,551.44	-239,649.79

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	3,609,520.00	-	-	-
IM2401	2,411,840.00	-	-	-
IM2403	1,197,680.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	3,609,520.00	-	-	-

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IM2401	IM2401	2	2,355,200.00	-56,640.00
IM2403	IM2403	1	1,169,320.00	-28,360.00
合计	-	-	-	-85,000.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	-85,000.00

净额	-	-	-	-
----	---	---	---	---

注：1. 衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

2. 买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

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

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	34,555.54
其中：交易所市场	34,555.54
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	59,689.04
应付替代款	388,188.37
合计	482,432.95

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 9 月 13 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	811,564,791.00	811,564,791.00
本期申购	138,000,000.00	138,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-874,000,000.00	-874,000,000.00
本期末	75,564,791.00	75,564,791.00

注：本基金合同于 2023 年 9 月 13 日生效，基金合同生效日的基金份额总额为 811,564,791.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 51,791.00 份基金份额。

7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	6,051,589.11	-324,649.79	5,726,939.32
本期基金份额交易产生的变动数	-1,270,454.25	-1,546,034.41	-2,816,488.66
其中：基金申购款	777,336.70	1,211,225.70	1,988,562.40
基金赎回款	-2,047,790.95	-2,757,260.11	-4,805,051.06
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,781,134.86	-1,870,684.20	2,910,450.66

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 9 月 13 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	253,637.97
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	12,637.48
其他	3,282.74
合计	269,558.19

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 9 月 13 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	2,810,706.59
股票投资收益——赎回差价收入	2,877,658.57
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	5,688,365.16

7.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 9 月 13 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	407,238,038.17
减：卖出股票成本总额	403,731,004.71
减：交易费用	696,326.87
买卖股票差价收入	2,810,706.59

7.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 9 月 13 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	878,805,051.06
减：现金支付赎回款总额	293,385,340.06
减：赎回股票成本总额	582,542,052.43
减：交易费用	-
赎回差价收入	2,877,658.57

7.4.7.11 债券投资收益**7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 9 月 13 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	25.05
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	51,920.45
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	51,945.50

7.4.7.11.2 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13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	250,155.46
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	198,200.00
减：应计利息总额	24.99
减：交易费用	10.02
买卖债券差价收入	51,920.45

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

7.4.7.13 衍生工具收益**7.4.7.13.1 衍生工具收益——其他投资收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2023年9月13日（基金合同生效日）至2023年12月31日
股指期货投资收益	55,903.45

7.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023年9月13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	48,887.69
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	48,887.69

7.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023年9月13日（基金合同生效日）至2023年12月31日
1.交易性金融资产	-239,649.79

——股票投资	-239,649.79
——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	-85,000.00
——权证投资	-
——期货投资	-85,000.00
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-324,649.79

7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年9月13日（基金合同生效日）至2023年12月31日
基金赎回费收入	-
其他	3,023.74
替代损益收入	399,139.51
合计	402,163.25

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。

7.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023年9月13日（基金合同生效日）至2023年12月31日
审计费用	54,100.00

信息披露费	-
证券出借违约金	-
其他	55,989.04
合计	110,089.04

7.4.8或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

7.4.8.2资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
易方达基金管理有限公司	基金管理人
国泰君安证券股份有限公司	基金托管人、申购赎回代办证券公司
广发证券股份有限公司	基金管理人股东、申购赎回代办证券公司
广东粤财信托有限公司	基金管理人股东
广东省广晟控股集团有限公司	基金管理人股东
广州市广永国有资产经营有限公司	基金管理人股东
盈峰集团有限公司	基金管理人股东
珠海祺荣宝投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海祺泰宝投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海祺丰宝投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海聚宁康投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海聚弘康投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海聚莱康投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
易方达资产管理有限公司	基金管理人的子公司
易方达国际控股有限公司	基金管理人的子公司
易方达资产管理（香港）有限公司	基金管理人子公司控制的公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期
	2023年9月13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
国泰君安证券	390,409,029.63	28.39%

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年9月13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
国泰君安证券	72,152.71	17.84%	8,341.40	24.14%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

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13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
其中：应支付销售机构的客户维护费	32,750.07
应支付基金管理人的净管理费	259,972.22

注：1.本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.15%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对

一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

2.自 2023 年 10 月 30 日起本基金管理费年费率由 0.50%调整为 0.15%。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2023年9月13日（基金合同生效日）至2023年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	62,101.45

注：1.本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.05%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

2.自 2023 年 10 月 30 日起本基金托管费年费率由 0.10%调整为 0.05%。

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

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期末未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本基金本报告期末未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 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
广发证券股份有	9,342,605.00	12.3637%

限公司		
-----	--	--

注：本基金合同生效日为 2023 年 09 月 13 日。除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用按基金合同等相关法律文件有关规定支付。

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

无。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2023 年 9 月 13 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
国泰君安证券股份有限公司	001239	永达股份	新股网下发行	943	11,363.15
国泰君安证券股份有限公司	123225	翔丰转债	老股东配债	874	87,400.00

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未发生利润分配。

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：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
001239	永达股份	2023-12-04	6 个月	新股流通受限	12.05	19.92	95	1,144.75	1,892.40	-

001358	兴欣新材	2023-12-14	6 个月	新股 流通 受限	41.00	44.16	31	1,271.00	1,368.96	-
301413	安培龙	2023-12-11	6 个月	新股 流通 受限	33.25	58.19	78	2,593.50	4,538.82	-
301459	丰茂股份	2023-12-06	6 个月	新股 流通 受限	31.90	39.84	80	2,552.00	3,187.20	-
301508	中机认检	2023-11-23	6 个月	新股 流通 受限	16.82	26.68	151	2,539.82	4,028.68	-
301516	中远通	2023-12-01	6 个月	新股 流通 受限	6.87	15.51	316	2,170.92	4,901.16	-
301526	国际复材	2023-12-19	6 个月	新股 流通 受限	2.66	4.45	1,658	4,410.28	7,378.10	-
301566	达利凯普	2023-12-22	6 个月	新股 流通 受限	8.90	22.14	257	2,287.30	5,689.98	-
301568	思泰克	2023-11-21	6 个月	新股 流通 受限	23.23	35.58	99	2,299.77	3,522.42	-
301578	辰奕智能	2023-12-21	6 个月	新股 流通 受限	48.94	68.32	46	2,251.24	3,142.72	-
688653	康希通信	2023-11-10	6 个月	新股 流通 受限	10.50	15.99	392	4,116.00	6,268.08	-

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
111018	华康转债	2023-12-26	1 个月内（含）	新发流通受限	100.00	100.00	140	14,000.00	14,000.37	-
118046	诺泰转债	2023-12-18	1-6 个月（含）	新发流通受限	100.00	100.01	60	6,000.00	6,000.37	-

注：基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，则此新增股票的流通受限期和估值价格与相应原股票一致。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300096	易联众	2023-12-29	重大事项停牌	6.82	2024-01-02	5.46	20,300	130,069.54	138,446.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 日止，本基金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为 0，无抵押债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

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**

本基金管理人按照“自上而下与自下而上相结合，全面管理、专业分工”的思路，将风险控制嵌入到全公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。从投资决策的层次看，投资决策委员会、投资总监、基金投资部门总经理和基金经理对投资行为及相关风险进行管理、监控，并根据其不同权限实施风险控制；从岗位职能的分工上看，基金经理、监察合规管理部门、集中交易部门、核算部以及投资风险管理部从不同角度、不同环节对投资的全过程实行风险监控和管理；从投资管理的流程看，已经形成了一套贯穿“事前的风险定位、事中的风险管理和事后的风险评估”的健全的风险监控体系。

本基金为股票型基金，预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，紧密跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指包括债券发行人出现拒绝支付利息或到期时拒绝支付本息的违约风险，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下跌的风险，及因交易对手违约而产生的交割风险。本基金管理人建立了内部信用评级制度，通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险。本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场

主要通过交易对手库制度防范交易对手风险。

于 2023 年 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.03%。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023年12月31日
A-1	0.00
A-1 以下	0.00
未评级	0.00
合计	0.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限在一年以内的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的短期融资券。

3. 债券投资以全价列示。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023年12月31日
A-1	0.00
A-1 以下	0.00
未评级	0.00
合计	0.00

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023年12月31日
A-1	0.00
A-1 以下	0.00
未评级	0.00
合计	0.00

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	0.00
AAA 以下	20,000.74
未评级	0.00
合计	20,000.74

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债和央票。

3. 债券投资以全价列示。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023年12月31日
AAA	0.00
AAA 以下	0.00
未评级	0.00
合计	0.00

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023年12月31日
AAA	0.00
AAA 以下	0.00
未评级	0.00
合计	0.00

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指包括因市场交易量不足，导致基金管理人不能以合理价格及时进行证券交易的风险，或投资组合无法应付客户赎回要求所引起的违约风险。本基金采用分散投资、控制流通受限

证券比例等方式防范流动性风险，同时公司已经建立全覆盖、多维度以压力测试为核心的开放式基金流动性风险监测与预警制度，投资风险管理部独立于投资部门负责流动性压力测试的实施与评估。

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。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。于 2023 年 12 月 31 日，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，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额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按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金组合的流动性指标进行持续的监测和分析。

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。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在流动性良好的证券交易所或者银行间同业市场交易，除本报告期末本基金持有的流通受限证券章节中所列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，其余均能及时变现。评估结果显示组合高流动性资产比重较高，组合变现比例能力较好。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指因受各种因素影响而引起的基金所持证券及其衍生品市场价格不利波动，使基金资产面临损失的风险，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

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。投资管理人通过久期、凸度、VAR 等方法评估组合面临的利率风险敞口，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	2,099,721.75	-	-	-	2,099,721.75
结算备付金	933,131.33	-	-	-	933,131.33
存出保证金	1,414,875.94	-	-	-	1,414,875.94
交易性金融资产	-	-	20,000.74	74,409,550.70	74,429,551.44
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	95,397.85	95,397.85
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	4,447,729.02	-	20,000.74	74,504,948.55	78,972,678.31
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	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	11,252.68	11,252.68
应付托管费	-	-	-	3,750.89	3,750.89
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	0.13	0.13
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	482,432.95	482,432.95
负债总计	-	-	-	497,436.65	497,436.65
利率敏感度缺口	4,447,729.02	-	20,000.74	74,007,511.90	78,475,241.66

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本期末本基金未持有交易性债券投资(不包括可转债)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金的基金管理人采用 Barra 风险管理系统，通过标准差、跟踪误差、beta 值、VAR 等指标，监控投资组合面临的市场价格波动风险。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	74,409,550.70	94.82
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	74,409,550.70	94.82

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)
		本期末 2023 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	3,730,862.90
	2.业绩比较基准下降 5%	-3,730,862.90

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	74,225,186.18
第二层次	158,446.74
第三层次	45,918.52
合计	74,429,551.44

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的金融工具，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关金融工具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，确定相关金融工具的公允价值应属第二层次或第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 9 月 13 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	27,636.58	27,636.58
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	18,281.94	18,281.94
其中：计入损益的利得或损失	-	18,281.94	18,281.94
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	45,918.52	45,918.52

期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	18,281.94	18,281.94
--	---	-----------	-----------

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

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流动性折扣估值处于限售期的股票投资	45,918.52	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	0.5141—2.1752	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

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	74,409,550.70	94.22
	其中：股票	74,409,550.70	94.22
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	20,000.74	0.03
	其中：债券	20,000.74	0.03
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-

	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	3,032,853.08	3.84
8	其他各项资产	1,510,273.79	1.91
9	合计	78,972,678.31	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	698,680.00	0.89
B	采矿业	571,327.00	0.73
C	制造业	50,431,197.42	64.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,402,912.60	1.79
E	建筑业	1,475,105.00	1.88
F	批发和零售业	2,584,075.40	3.29
G	交通运输、仓储和邮政业	1,353,536.00	1.72
H	住宿和餐饮业	324,397.00	0.41
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,099,091.27	10.32
J	金融业	89,154.00	0.11
K	房地产业	1,817,208.00	2.32
L	租赁和商务服务业	1,122,282.00	1.43
M	科学研究和技术服务业	1,664,918.35	2.12
N	水利、环境和公共设施管理业	1,104,631.66	1.41
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	123,374.00	0.16
Q	卫生和社会工作	56,962.00	0.07
R	文化、体育和娱乐业	1,247,732.00	1.59
S	综合	242,967.00	0.31
	合计	74,409,550.70	94.82

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300049	福瑞股份	4,400	191,796.00	0.24
2	600186	莲花健康	29,300	177,265.00	0.23
3	300181	佐力药业	14,700	156,702.00	0.20
4	002654	万润科技	11,700	145,314.00	0.19
5	601020	华钰矿业	13,900	143,170.00	0.18
6	600106	重庆路桥	21,300	142,284.00	0.18
7	300355	蒙草生态	37,300	139,875.00	0.18
8	300705	九典制药	4,200	139,566.00	0.18
9	600114	东睦股份	9,000	139,410.00	0.18
10	300096	易联众	20,300	138,446.00	0.18
11	603283	赛腾股份	1,900	137,864.00	0.18
12	600756	浪潮软件	9,700	134,539.00	0.17
13	300129	泰胜风能	12,400	133,548.00	0.17
14	300468	四方精创	12,300	133,455.00	0.17
15	000592	平潭发展	51,300	129,789.00	0.17
16	002437	誉衡药业	51,700	129,767.00	0.17
17	300857	协创数据	2,400	127,176.00	0.16
18	300020	银江技术	15,300	126,990.00	0.16
19	002270	华明装备	8,900	125,668.00	0.16
20	002075	沙钢股份	32,800	125,296.00	0.16
21	600425	青松建化	31,700	125,215.00	0.16
22	600742	一汽富维	13,000	124,150.00	0.16
23	002334	英威腾	14,200	123,966.00	0.16
24	002045	国光电器	7,400	123,210.00	0.16
25	688621	阳光诺和	1,757	122,550.75	0.16
26	300217	东方电热	22,700	122,126.00	0.16
27	002398	垒知集团	25,600	122,112.00	0.16
28	300556	丝路视觉	3,300	121,605.00	0.15
29	002106	莱宝高科	11,400	121,296.00	0.15
30	300041	回天新材	12,100	121,242.00	0.15
31	688076	诺泰生物	2,669	119,971.55	0.15
32	600789	鲁抗医药	16,800	119,952.00	0.15
33	002315	焦点科技	3,600	119,268.00	0.15
34	601588	北辰实业	62,700	119,130.00	0.15
35	300008	天海防务	29,500	117,410.00	0.15
36	002197	证通电子	11,300	117,407.00	0.15
37	300570	太辰光	3,000	117,150.00	0.15
38	300678	中科信息	3,900	116,922.00	0.15

39	600105	永鼎股份	20,900	115,786.00	0.15
40	300494	盛天网络	7,300	115,413.00	0.15
41	002298	中电兴发	19,900	114,624.00	0.15
42	600509	天富能源	17,600	114,576.00	0.15
43	600351	亚宝药业	16,600	114,540.00	0.15
44	002681	奋达科技	23,100	114,345.00	0.15
45	300757	罗博特科	1,400	113,946.00	0.15
46	002716	金贵银业	40,400	113,928.00	0.15
47	600226	瀚叶股份	43,500	113,535.00	0.14
48	002149	西部材料	7,200	113,184.00	0.14
49	300793	佳禾智能	5,200	112,892.00	0.14
50	002285	世联行	46,600	112,306.00	0.14
51	002707	众信旅游	15,700	112,098.00	0.14
52	300189	神农科技	33,900	111,531.00	0.14
53	600293	三峡新材	30,600	111,384.00	0.14
54	600525	长园集团	20,800	111,280.00	0.14
55	300415	伊之密	6,300	111,069.00	0.14
56	002655	共达电声	8,200	110,946.00	0.14
57	600103	青山纸业	46,400	110,896.00	0.14
58	301096	百诚医药	1,700	110,670.00	0.14
59	002122	汇洲智能	26,500	110,505.00	0.14
60	002876	三利谱	3,000	110,310.00	0.14
61	002526	山东矿机	38,000	110,200.00	0.14
62	002154	报喜鸟	19,400	110,192.00	0.14
63	688279	峰昭科技	873	110,102.76	0.14
64	300057	万顺新材	17,800	109,826.00	0.14
65	600255	鑫科材料	49,600	109,616.00	0.14
66	600461	洪城环境	11,900	108,766.00	0.14
67	688378	奥来德	2,297	108,739.98	0.14
68	002279	久其软件	16,700	108,717.00	0.14
69	300378	鼎捷软件	5,100	108,681.00	0.14
70	002102	冠福股份	40,000	108,400.00	0.14
71	300708	聚灿光电	9,600	108,288.00	0.14
72	002284	亚太股份	12,300	107,871.00	0.14
73	688212	澳华内镜	1,739	107,870.17	0.14
74	688677	海泰新光	2,025	107,790.75	0.14
75	300138	晨光生物	8,000	107,440.00	0.14
76	600336	澳柯玛	17,800	107,334.00	0.14
77	300194	福安药业	24,500	107,310.00	0.14
78	000790	华神科技	21,200	107,272.00	0.14
79	600744	华银电力	33,000	106,920.00	0.14
80	600708	光明地产	49,600	106,640.00	0.14
81	300448	浩云科技	19,800	106,524.00	0.14
82	002495	佳隆股份	33,200	106,240.00	0.14

83	002397	梦洁股份	25,600	105,984.00	0.14
84	603987	康德莱	11,100	105,894.00	0.13
85	300842	帝科股份	1,500	105,825.00	0.13
86	300490	华自科技	9,100	105,651.00	0.13
87	603859	能科科技	2,800	105,644.00	0.13
88	300149	睿智医药	13,800	105,570.00	0.13
89	600237	铜峰电子	13,600	105,264.00	0.13
90	600269	赣粤高速	25,600	105,216.00	0.13
91	002196	方正电机	14,600	104,828.00	0.13
92	000589	贵州轮胎	17,100	104,652.00	0.13
93	688305	科德数控	1,368	104,583.60	0.13
94	300590	移为通信	8,700	104,487.00	0.13
95	300691	联合光电	4,500	104,355.00	0.13
96	002012	凯恩股份	18,600	104,160.00	0.13
97	603018	华设集团	13,700	104,120.00	0.13
98	002073	软控股份	15,800	103,806.00	0.13
99	688766	普冉股份	1,055	103,368.90	0.13
100	300195	长荣股份	15,200	103,360.00	0.13
101	300221	银禧科技	17,200	103,200.00	0.13
102	002664	信质集团	6,200	103,106.00	0.13
103	603738	泰晶科技	6,300	103,005.00	0.13
104	600979	广安爱众	29,700	102,762.00	0.13
105	002529	海源复材	8,100	102,708.00	0.13
106	300005	探路者	15,500	102,610.00	0.13
107	002915	中欣氟材	5,600	102,256.00	0.13
108	300513	恒实科技	8,600	102,168.00	0.13
109	301248	杰创智能	5,800	102,138.00	0.13
110	002783	凯龙股份	8,800	101,992.00	0.13
111	002035	华帝股份	16,400	101,844.00	0.13
112	688025	杰普特	1,094	101,249.70	0.13
113	002455	百川股份	13,600	100,912.00	0.13
114	603668	天马科技	5,500	100,870.00	0.13
115	300161	华中数控	2,800	100,520.00	0.13
116	300493	润欣科技	11,800	100,418.00	0.13
117	300480	光力科技	4,700	100,345.00	0.13
118	300317	珈伟新能	19,700	100,273.00	0.13
119	600503	华丽家族	39,300	100,215.00	0.13
120	000705	浙江震元	9,200	100,188.00	0.13
121	002536	飞龙股份	7,200	100,152.00	0.13
122	300396	迪瑞医疗	3,400	100,130.00	0.13
123	688233	神工股份	2,832	99,941.28	0.13
124	300420	五洋停车	32,800	99,712.00	0.13
125	002785	万里石	3,700	99,567.00	0.13
126	300547	川环科技	5,900	99,415.00	0.13

127	300566	激智科技	5,300	99,004.00	0.13
128	300292	吴通控股	26,600	98,952.00	0.13
129	300162	雷曼光电	12,200	98,820.00	0.13
130	002965	祥鑫科技	2,400	98,808.00	0.13
131	603383	顶点软件	2,000	98,600.00	0.13
132	603686	福龙马	9,600	98,208.00	0.13
133	603035	常熟汽饰	5,200	98,124.00	0.13
134	600537	亿晶光电	17,800	98,078.00	0.12
135	600622	光大嘉宝	38,000	98,040.00	0.12
136	600353	旭光电子	10,700	97,798.00	0.12
137	300304	云意电气	14,400	97,776.00	0.12
138	300174	元力股份	6,100	97,661.00	0.12
139	002338	奥普光电	2,900	97,585.00	0.12
140	600127	金健米业	13,400	97,552.00	0.12
141	002277	友阿股份	24,200	97,526.00	0.12
142	688369	致远互联	2,814	97,392.54	0.12
143	300272	开能健康	15,700	97,340.00	0.12
144	300605	恒锋信息	6,500	97,305.00	0.12
145	300680	隆盛科技	5,200	97,240.00	0.12
146	603662	柯力传感	2,700	97,173.00	0.12
147	300589	江龙船艇	7,000	97,160.00	0.12
148	300872	天阳科技	7,100	97,128.00	0.12
149	603722	阿科力	1,800	97,020.00	0.12
150	300890	翔丰华	2,800	96,824.00	0.12
151	000910	大亚圣象	12,100	96,800.00	0.12
152	002803	吉宏股份	4,700	96,632.00	0.12
153	002765	蓝黛科技	14,400	96,624.00	0.12
154	000948	南天信息	6,400	96,448.00	0.12
155	600640	国脉文化	8,400	96,348.00	0.12
156	688550	瑞联新材	2,428	96,343.04	0.12
157	002519	银河电子	15,600	96,252.00	0.12
158	002401	中远海科	5,300	96,036.00	0.12
159	002628	成都路桥	29,100	96,030.00	0.12
160	002345	潮宏基	14,100	96,021.00	0.12
161	300219	鸿利智汇	11,400	95,988.00	0.12
162	002323	雅博股份	39,500	95,985.00	0.12
163	300481	濮阳惠成	5,500	95,975.00	0.12
164	603358	华达科技	4,100	95,858.00	0.12
165	688095	福昕软件	1,372	95,834.20	0.12
166	002117	东港股份	11,200	95,760.00	0.12
167	300531	优博讯	6,200	95,046.00	0.12
168	000099	中信海直	10,800	95,040.00	0.12
169	600620	天宸股份	10,100	94,940.00	0.12
170	688299	长阳科技	6,804	94,915.80	0.12

171	002935	天奥电子	5,200	94,848.00	0.12
172	002733	雄韬股份	6,300	94,752.00	0.12
173	000510	新金路	16,700	94,689.00	0.12
174	603619	中曼石油	5,100	94,452.00	0.12
175	002438	江苏神通	7,900	94,405.00	0.12
176	603629	利通电子	3,000	94,380.00	0.12
177	000926	福星股份	22,600	94,242.00	0.12
178	002829	星网宇达	3,480	94,099.20	0.12
179	300137	先河环保	16,900	93,964.00	0.12
180	300095	华伍股份	11,400	93,822.00	0.12
181	000521	长虹美菱	16,600	93,458.00	0.12
182	300504	天邑股份	5,100	93,279.00	0.12
183	002491	通鼎互联	17,800	93,272.00	0.12
184	603960	克来机电	6,267	93,190.29	0.12
185	300112	万讯自控	8,100	93,150.00	0.12
186	688277	天智航	7,066	93,129.88	0.12
187	002476	宝莫股份	14,500	93,090.00	0.12
188	300228	富瑞特装	13,100	93,010.00	0.12
189	002639	雪人股份	12,400	93,000.00	0.12
190	002448	中原内配	14,000	92,960.00	0.12
191	002897	意华股份	2,500	92,900.00	0.12
192	300790	宇瞳光学	5,700	92,739.00	0.12
193	300227	光韵达	11,800	92,512.00	0.12
194	300444	双杰电气	13,700	92,338.00	0.12
195	001219	青岛食品	4,000	92,200.00	0.12
196	603867	新化股份	2,800	91,952.00	0.12
197	300200	高盟新材	10,400	91,832.00	0.12
198	600664	哈药股份	27,400	91,790.00	0.12
199	603330	天洋新材	12,100	91,718.00	0.12
200	000040	东旭蓝天	24,900	91,632.00	0.12
201	000777	中核科技	6,300	91,602.00	0.12
202	002663	普邦股份	50,600	91,586.00	0.12
203	300120	经纬辉开	12,600	91,476.00	0.12
204	605555	德昌股份	4,000	91,400.00	0.12
205	688658	悦康药业	4,364	91,033.04	0.12
206	000659	珠海中富	37,700	90,857.00	0.12
207	002057	中钢天源	11,300	90,852.00	0.12
208	300100	双林股份	8,700	90,741.00	0.12
209	002922	伊戈尔	6,100	90,585.00	0.12
210	300231	银信科技	8,800	90,552.00	0.12
211	600467	好当家	38,000	90,440.00	0.12
212	600973	宝胜股份	19,200	90,432.00	0.12
213	300958	建工修复	5,200	90,428.00	0.12
214	000922	佳电股份	8,800	90,376.00	0.12

215	600573	惠泉啤酒	8,700	90,306.00	0.12
216	300576	容大感光	2,300	90,298.00	0.12
217	002957	科瑞技术	4,700	90,287.00	0.12
218	300684	中石科技	4,200	90,258.00	0.12
219	603518	锦泓集团	9,000	90,180.00	0.11
220	300796	贝斯美	5,600	90,160.00	0.11
221	603520	司太立	6,400	90,112.00	0.11
222	002210	飞马国际	50,200	89,858.00	0.11
223	688135	利扬芯片	4,027	89,842.37	0.11
224	300545	联得装备	2,600	89,830.00	0.11
225	300853	申昊科技	3,300	89,760.00	0.11
226	600616	金枫酒业	14,300	89,518.00	0.11
227	002169	智光电气	13,000	89,440.00	0.11
228	300354	东华测试	1,800	89,406.00	0.11
229	002374	中锐股份	23,900	89,386.00	0.11
230	002580	圣阳股份	10,300	89,301.00	0.11
231	002339	积成电子	12,300	89,298.00	0.11
232	002606	大连电瓷	11,300	89,270.00	0.11
233	300437	清水源	7,100	89,247.00	0.11
234	688168	安博通	2,467	89,206.72	0.11
235	002962	五方光电	3,800	89,186.00	0.11
236	600318	新力金融	12,700	89,154.00	0.11
237	301051	信濠光电	1,400	89,138.00	0.11
238	300046	台基股份	5,600	89,096.00	0.11
239	300145	中金环境	29,500	89,090.00	0.11
240	000652	泰达股份	22,900	89,081.00	0.11
241	688022	瀚川智能	4,053	88,922.82	0.11
242	000700	模塑科技	12,700	88,900.00	0.11
243	000554	泰山石油	15,400	88,858.00	0.11
244	688286	敏芯股份	1,239	88,836.30	0.11
245	688049	炬芯科技	2,333	88,817.31	0.11
246	600249	两面针	15,200	88,768.00	0.11
247	300246	宝莱特	8,600	88,580.00	0.11
248	300903	科翔股份	8,800	88,528.00	0.11
249	600769	祥龙电业	8,400	88,368.00	0.11
250	002026	山东威达	8,700	88,305.00	0.11
251	002669	康达新材	7,400	88,208.00	0.11
252	000713	丰乐种业	11,500	88,205.00	0.11
253	603890	春秋电子	7,700	88,165.00	0.11
254	300925	法本信息	7,500	88,125.00	0.11
255	603507	振江股份	3,400	88,094.00	0.11
256	002533	金杯电工	10,900	88,072.00	0.11
257	002609	捷顺科技	7,700	87,934.00	0.11
258	688589	力合微	2,198	87,722.18	0.11

259	300779	惠城环保	1,700	87,720.00	0.11
260	000407	胜利股份	24,200	87,604.00	0.11
261	301030	仕净科技	2,100	87,570.00	0.11
262	603359	东珠生态	11,400	87,552.00	0.11
263	300360	炬华科技	6,400	87,424.00	0.11
264	688078	龙软科技	2,168	87,413.76	0.11
265	601789	宁波建工	21,100	87,354.00	0.11
266	300025	华星创业	9,100	87,269.00	0.11
267	600757	长江传媒	11,700	87,165.00	0.11
268	600071	凤凰光学	3,800	87,058.00	0.11
269	688588	凌志软件	7,315	87,048.50	0.11
270	600609	金杯汽车	17,900	86,994.00	0.11
271	002908	德生科技	6,100	86,986.00	0.11
272	002833	弘亚数控	4,900	86,926.00	0.11
273	600212	绿能慧充	12,100	86,878.00	0.11
274	300987	川网传媒	4,900	86,828.00	0.11
275	688590	新致软件	3,831	86,657.22	0.11
276	300247	融捷健康	24,300	86,508.00	0.11
276	603078	江化微	5,400	86,508.00	0.11
278	002094	青岛金王	22,800	86,412.00	0.11
279	605599	菜百股份	5,800	86,362.00	0.11
280	000055	方大集团	19,100	86,332.00	0.11
281	000417	合肥百货	17,300	86,327.00	0.11
282	688003	天准科技	2,300	86,296.00	0.11
283	002255	海陆重工	16,300	86,227.00	0.11
284	301263	泰恩康	5,280	86,222.40	0.11
285	002329	皇氏集团	13,300	86,184.00	0.11
286	300729	乐歌股份	4,800	85,968.00	0.11
287	300507	苏奥传感	12,700	85,852.00	0.11
288	600987	航民股份	9,800	85,848.00	0.11
289	600513	联环药业	7,700	85,778.00	0.11
290	600892	大晟文化	14,100	85,728.00	0.11
291	002046	国机精工	7,400	85,470.00	0.11
292	300326	凯利泰	13,500	85,455.00	0.11
293	300238	冠昊生物	6,300	85,428.00	0.11
294	000677	恒天海龙	25,500	85,425.00	0.11
295	300719	安达维尔	6,400	85,312.00	0.11
296	601595	上海电影	3,300	85,239.00	0.11
297	300278	华昌达	22,300	85,186.00	0.11
298	300467	迅游科技	4,900	85,162.00	0.11
299	300542	新晨科技	6,500	85,150.00	0.11
300	600479	千金药业	7,900	85,083.00	0.11
300	605368	蓝天燃气	7,900	85,083.00	0.11
302	002093	国脉科技	11,300	84,976.00	0.11

303	300328	宜安科技	12,200	84,912.00	0.11
304	002479	富春环保	17,800	84,906.00	0.11
305	600590	泰豪科技	12,700	84,836.00	0.11
306	000421	南京公用	12,100	84,579.00	0.11
307	600419	天润乳业	7,200	84,456.00	0.11
308	688225	亚信安全	4,604	84,437.36	0.11
309	002728	特一药业	4,700	84,224.00	0.11
310	603538	美诺华	4,400	84,128.00	0.11
311	300279	和晶科技	13,000	84,110.00	0.11
312	300933	中辰股份	8,900	84,105.00	0.11
313	605305	中际联合	2,600	84,006.00	0.11
314	000978	桂林旅游	11,100	83,916.00	0.11
315	002892	科力尔	5,200	83,668.00	0.11
315	002947	恒铭达	2,600	83,668.00	0.11
317	000501	武商集团	9,800	83,496.00	0.11
318	000812	陕西金叶	16,500	83,490.00	0.11
319	600501	航天晨光	6,100	83,448.00	0.11
320	300435	中泰股份	5,800	83,404.00	0.11
321	002150	通润装备	4,700	83,378.00	0.11
322	300523	辰安科技	4,100	83,230.00	0.11
323	002722	物产金轮	5,400	83,214.00	0.11
324	002322	理工能科	6,500	83,200.00	0.11
325	300533	冰川网络	3,000	83,100.00	0.11
326	301168	通灵股份	1,800	83,088.00	0.11
327	300712	永福股份	3,100	83,080.00	0.11
327	600468	百利电气	12,400	83,080.00	0.11
329	301266	宇邦新材	1,500	83,055.00	0.11
330	300806	斯迪克	5,900	83,013.00	0.11
331	000680	山推股份	16,800	82,992.00	0.11
331	000882	华联股份	49,400	82,992.00	0.11
333	002132	恒星科技	26,500	82,945.00	0.11
334	002575	群兴玩具	14,700	82,908.00	0.11
335	300681	英搏尔	4,300	82,861.00	0.11
336	000859	国风新材	15,600	82,836.00	0.11
337	600067	冠城大通	33,000	82,830.00	0.11
338	000612	焦作万方	14,400	82,800.00	0.11
339	688401	路维光电	2,692	82,698.24	0.11
340	000957	中通客车	9,200	82,616.00	0.11
341	688601	力芯微	1,575	82,514.25	0.11
342	002161	远望谷	15,000	82,500.00	0.11
343	300320	海达股份	10,600	82,468.00	0.11
344	603633	徕木股份	8,600	82,388.00	0.10
345	600187	国中水务	31,200	82,368.00	0.10
346	002133	广宇集团	23,600	82,364.00	0.10

347	002198	嘉应制药	11,300	82,264.00	0.10
348	002017	东信和平	7,900	82,239.00	0.10
349	600354	敦煌种业	13,700	82,200.00	0.10
350	300578	会畅通讯	4,600	82,156.00	0.10
351	002480	新筑股份	16,200	81,972.00	0.10
352	002039	黔源电力	5,940	81,912.60	0.10
353	600838	上海九百	10,400	81,848.00	0.10
354	603399	吉翔股份	8,000	81,840.00	0.10
355	002903	宇环数控	3,200	81,760.00	0.10
356	300580	贝斯特	2,700	81,756.00	0.10
357	002364	中恒电气	10,600	81,620.00	0.10
358	300105	龙源技术	12,000	81,480.00	0.10
359	000558	莱茵体育	27,800	81,454.00	0.10
360	300400	劲拓股份	5,000	81,450.00	0.10
361	300403	汉宇集团	9,200	81,420.00	0.10
362	002631	德尔未来	13,300	81,263.00	0.10
363	300424	航新科技	6,200	81,220.00	0.10
364	300240	飞力达	12,000	80,880.00	0.10
365	000861	海印股份	40,400	80,800.00	0.10
366	301126	达嘉维康	6,200	80,786.00	0.10
367	603191	望变电气	5,200	80,756.00	0.10
368	301093	华兰股份	2,500	80,750.00	0.10
369	002863	今飞凯达	13,000	80,730.00	0.10
370	002248	华东数控	9,900	80,685.00	0.10
371	603319	湘油泵	4,600	80,684.00	0.10
372	000548	湖南投资	14,800	80,660.00	0.10
373	300667	必创科技	4,700	80,652.00	0.10
374	000816	智慧农业	26,700	80,634.00	0.10
375	300288	朗玛信息	4,900	80,605.00	0.10
376	600470	六国化工	13,800	80,592.00	0.10
377	002327	富安娜	9,000	80,550.00	0.10
378	000962	东方钨业	6,500	80,535.00	0.10
379	688259	创耀科技	1,185	80,497.05	0.10
380	300205	天喻信息	7,400	80,364.00	0.10
381	300802	矩子科技	4,200	80,304.00	0.10
382	300164	通源石油	16,800	80,136.00	0.10
383	300740	水羊股份	4,800	80,016.00	0.10
384	002386	天原股份	15,500	79,980.00	0.10
385	002630	华西能源	32,200	79,856.00	0.10
385	600830	香溢融通	11,200	79,856.00	0.10
387	300664	鹏鹞环保	14,900	79,715.00	0.10
388	600594	益佰制药	14,000	79,660.00	0.10
389	300840	酷特智能	4,000	79,640.00	0.10
390	000409	云鼎科技	8,600	79,636.00	0.10

391	600495	晋西车轴	18,600	79,608.00	0.10
392	603843	正平股份	22,800	79,572.00	0.10
393	688313	仕佳光子	6,260	79,564.60	0.10
394	002184	海得控制	5,200	79,560.00	0.10
395	603611	诺力股份	4,200	79,506.00	0.10
396	600961	株冶集团	9,500	79,420.00	0.10
397	688300	联瑞新材	1,498	79,319.10	0.10
398	300592	华凯易佰	3,200	79,264.00	0.10
399	001215	千味央厨	1,500	79,215.00	0.10
400	001314	亿道信息	1,100	79,123.00	0.10
401	002300	太阳电缆	9,300	79,050.00	0.10
402	002565	顺灏股份	23,300	78,987.00	0.10
403	603998	方盛制药	7,200	78,912.00	0.10
404	002119	康强电子	5,900	78,883.00	0.10
405	300690	双一科技	4,200	78,792.00	0.10
406	688108	赛诺医疗	6,277	78,776.35	0.10
407	300660	江苏雷利	2,600	78,676.00	0.10
408	300248	新开普	8,200	78,638.00	0.10
409	002361	神剑股份	20,000	78,600.00	0.10
410	300722	新余国科	3,000	78,570.00	0.10
411	603681	永冠新材	5,200	78,520.00	0.10
412	688103	国力股份	1,590	78,514.20	0.10
413	300884	狄耐克	6,000	78,480.00	0.10
414	002033	丽江股份	9,700	78,473.00	0.10
415	002566	益盛药业	8,800	78,408.00	0.10
416	300485	赛升药业	7,400	78,366.00	0.10
417	300446	航天智造	5,000	78,350.00	0.10
418	002104	恒宝股份	10,200	78,336.00	0.10
419	300307	慈星股份	12,200	78,324.00	0.10
420	688332	中科蓝讯	1,037	78,210.54	0.10
421	003000	劲仔食品	6,400	78,208.00	0.10
422	600880	博瑞传播	15,600	78,156.00	0.10
422	688085	三友医疗	4,008	78,156.00	0.10
424	300111	向日葵	25,700	78,128.00	0.10
425	000042	中洲控股	13,600	78,064.00	0.10
426	301383	天键股份	1,200	78,000.00	0.10
427	600794	保税科技	19,100	77,928.00	0.10
428	603855	华荣股份	3,900	77,844.00	0.10
429	002418	康盛股份	27,900	77,841.00	0.10
430	301162	国能日新	1,500	77,820.00	0.10
431	300286	安科瑞	3,000	77,790.00	0.10
432	600292	远达环保	12,800	77,696.00	0.10
433	688246	嘉和美康	2,322	77,601.24	0.10
434	002930	宏川智慧	4,000	77,560.00	0.10

435	300258	精锻科技	6,000	77,520.00	0.10
436	688179	阿拉丁	4,034	77,291.44	0.10
437	605266	健之佳	1,300	77,220.00	0.10
438	688699	明微电子	1,913	77,189.55	0.10
439	002170	芭田股份	13,900	77,145.00	0.10
440	603110	东方材料	3,200	77,120.00	0.10
441	688359	三孚新科	1,118	77,019.02	0.10
442	603878	武进不锈	10,200	77,010.00	0.10
443	000888	峨眉山 A	8,600	76,798.00	0.10
444	002337	赛象科技	13,500	76,680.00	0.10
445	603232	格尔软件	5,600	76,664.00	0.10
446	002997	瑞鹤模具	2,300	76,636.00	0.10
447	000036	华联控股	19,700	76,633.00	0.10
448	000523	红棉股份	24,400	76,616.00	0.10
449	002272	川润股份	11,200	76,608.00	0.10
450	300900	广联航空	3,100	76,508.00	0.10
451	600094	大名城	25,400	76,200.00	0.10
452	300399	天利科技	5,500	76,120.00	0.10
453	603222	济民医疗	9,500	76,095.00	0.10
454	300404	博济医药	8,500	76,075.00	0.10
455	600162	香江控股	43,700	76,038.00	0.10
456	300831	派瑞股份	6,200	76,012.00	0.10
457	300572	安车检测	4,200	75,894.00	0.10
458	600545	卓郎智能	28,200	75,858.00	0.10
459	300471	厚普股份	5,500	75,845.00	0.10
460	603809	豪能股份	6,400	75,840.00	0.10
461	603028	赛福天	6,800	75,820.00	0.10
462	002886	沃特股份	3,700	75,813.00	0.10
463	002577	雷柏科技	4,300	75,809.00	0.10
464	002269	美邦服饰	44,300	75,753.00	0.10
465	301062	上海艾录	7,000	75,740.00	0.10
466	300179	四方达	8,500	75,735.00	0.10
467	002394	联发股份	9,100	75,621.00	0.10
468	600218	全柴动力	7,900	75,603.00	0.10
469	002912	中新赛克	2,700	75,573.00	0.10
470	300996	普联软件	3,300	75,570.00	0.10
471	688579	山大地纬	5,948	75,539.60	0.10
472	603869	新智认知	8,000	75,520.00	0.10
473	002660	茂硕电源	6,100	75,518.00	0.10
474	002148	北纬科技	12,500	75,500.00	0.10
475	002570	贝因美	19,100	75,445.00	0.10
476	002611	东方精工	15,200	75,392.00	0.10
477	002676	顺威股份	15,900	75,366.00	0.10
478	301349	信德新材	1,600	75,328.00	0.10

479	688035	德邦科技	1,407	75,077.52	0.10
480	600135	乐凯胶片	9,300	75,051.00	0.10
481	300011	鼎汉技术	9,400	75,012.00	0.10
482	000561	烽火电子	8,900	74,760.00	0.10
483	002431	棕榈股份	29,400	74,676.00	0.10
484	603811	诚意药业	7,200	74,664.00	0.10
485	002301	齐心集团	10,500	74,655.00	0.10
486	600190	锦州港	25,900	74,592.00	0.10
487	603836	海程邦达	4,200	74,466.00	0.09
488	002165	红宝丽	17,600	74,448.00	0.09
489	300381	溢多利	10,100	74,437.00	0.09
490	600375	汉马科技	12,300	74,415.00	0.09
491	002112	三变科技	7,100	74,408.00	0.09
492	300692	中环环保	12,000	74,400.00	0.09
492	600846	同济科技	8,000	74,400.00	0.09
494	300560	中富通	4,200	74,382.00	0.09
495	002919	名臣健康	2,900	74,356.00	0.09
496	601007	金陵饭店	9,200	74,336.00	0.09
497	002955	鸿合科技	2,300	74,313.00	0.09
498	603703	盛洋科技	5,800	74,298.00	0.09
499	600825	新华传媒	16,600	74,202.00	0.09
500	603336	宏辉果蔬	14,500	74,095.00	0.09
501	002824	和胜股份	3,600	74,052.00	0.09
502	603309	维力医疗	5,200	73,996.00	0.09
503	300345	华民股份	9,600	73,920.00	0.09
504	688377	迪威尔	2,756	73,915.92	0.09
505	600084	中信尼雅	9,400	73,884.00	0.09
506	002166	莱茵生物	9,500	73,815.00	0.09
507	301191	菲菱科思	800	73,760.00	0.09
508	301018	申菱环境	2,800	73,752.00	0.09
509	301201	诚达药业	2,900	73,747.00	0.09
510	601008	连云港	18,200	73,710.00	0.09
511	688080	映翰通	1,815	73,652.70	0.09
512	603398	沐邦高科	4,100	73,431.00	0.09
513	600327	大东方	14,600	73,292.00	0.09
514	301118	恒光股份	3,000	73,290.00	0.09
515	603237	五芳斋	2,500	73,250.00	0.09
516	002445	中南文化	30,900	73,233.00	0.09
517	603969	银龙股份	12,200	73,200.00	0.09
518	000610	西安旅游	5,300	73,193.00	0.09
519	003020	立方制药	2,600	73,190.00	0.09
520	688201	信安世纪	3,718	73,170.24	0.09
521	605567	春雪食品	5,800	73,138.00	0.09
522	300809	华辰装备	2,500	73,125.00	0.09

523	600367	红星发展	5,700	73,074.00	0.09
524	688222	成都先导	4,860	72,851.40	0.09
525	603778	国晟科技	13,100	72,836.00	0.09
526	605199	葫芦娃	4,800	72,768.00	0.09
527	688199	久日新材	2,692	72,764.76	0.09
528	002515	金字火腿	12,900	72,756.00	0.09
529	300615	欣天科技	4,600	72,726.00	0.09
530	002943	宇晶股份	2,600	72,722.00	0.09
531	688308	欧科亿	2,606	72,707.40	0.09
532	600686	金龙汽车	9,600	72,672.00	0.09
533	300061	旗天科技	12,400	72,664.00	0.09
534	300835	龙磁科技	2,500	72,525.00	0.09
535	300706	阿石创	2,800	72,464.00	0.09
536	600992	贵绳股份	4,500	72,450.00	0.09
537	603590	康辰药业	1,900	72,352.00	0.09
537	603990	麦迪科技	5,600	72,352.00	0.09
539	603067	振华股份	7,100	72,349.00	0.09
540	003019	宸展光电	3,200	72,320.00	0.09
541	688186	广大特材	4,012	72,296.24	0.09
542	300643	万通智控	5,800	72,268.00	0.09
543	300532	今天国际	4,400	72,248.00	0.09
544	000716	黑芝麻	12,000	72,240.00	0.09
545	002623	亚玛顿	2,700	72,225.00	0.09
545	300511	雪榕生物	13,500	72,225.00	0.09
547	002858	力盛体育	3,800	72,200.00	0.09
548	603999	读者传媒	10,500	72,135.00	0.09
549	688553	汇宇制药	4,767	72,124.71	0.09
550	002632	道明光学	7,300	72,124.00	0.09
551	002540	亚太科技	10,900	72,049.00	0.09
552	300349	金卡智能	5,800	72,036.00	0.09
553	300586	美联新材	8,900	72,001.00	0.09
554	600982	宁波能源	17,600	71,984.00	0.09
555	300391	长药控股	9,300	71,982.00	0.09
556	605337	李子园	5,100	71,859.00	0.09
557	002090	金智科技	7,200	71,856.00	0.09
558	600310	广西能源	19,200	71,808.00	0.09
558	603776	永安行	5,100	71,808.00	0.09
560	002296	辉煌科技	8,700	71,775.00	0.09
561	002870	香山股份	2,000	71,740.00	0.09
562	002819	东方中科	2,800	71,708.00	0.09
563	002940	昂利康	3,300	71,643.00	0.09
564	003026	中晶科技	2,000	71,600.00	0.09
565	688636	智明达	1,098	71,589.60	0.09
566	300522	世名科技	5,300	71,550.00	0.09

566	301270	汉仪股份	1,800	71,550.00	0.09
568	002735	王子新材	5,500	71,500.00	0.09
569	688519	南亚新材	2,772	71,406.72	0.09
570	688195	腾景科技	1,983	71,368.17	0.09
571	688306	均普智能	12,812	71,362.84	0.09
572	002358	森源电气	16,400	71,340.00	0.09
573	002162	悦心健康	16,600	71,214.00	0.09
574	000822	山东海化	10,400	71,136.00	0.09
575	688053	思科瑞	1,421	70,964.74	0.09
576	002849	威星智能	3,800	70,908.00	0.09
577	300582	英飞特	5,900	70,859.00	0.09
578	688533	上声电子	1,857	70,788.84	0.09
579	688165	埃夫特	6,176	70,776.96	0.09
580	688319	欧林生物	4,477	70,736.60	0.09
581	000534	万泽股份	5,400	70,686.00	0.09
582	300125	聆达股份	5,600	70,616.00	0.09
582	300928	华安鑫创	1,400	70,616.00	0.09
584	000819	岳阳兴长	3,900	70,512.00	0.09
585	300718	长盛轴承	3,800	70,490.00	0.09
586	688258	卓易信息	1,424	70,488.00	0.09
587	002029	七匹狼	12,300	70,479.00	0.09
588	002388	新亚制程	11,200	70,448.00	0.09
589	000973	佛塑科技	14,400	70,416.00	0.09
590	002757	南兴股份	4,500	70,380.00	0.09
590	603085	天成自控	6,900	70,380.00	0.09
590	603386	骏亚科技	5,100	70,380.00	0.09
593	002937	兴瑞科技	2,700	70,362.00	0.09
594	300414	中光防雷	7,300	70,299.00	0.09
595	000153	丰原药业	7,500	70,275.00	0.09
596	603158	腾龙股份	7,200	70,128.00	0.09
597	300514	友讯达	4,300	70,090.00	0.09
598	603687	大胜达	6,100	70,089.00	0.09
599	300483	首华燃气	5,900	70,033.00	0.09
600	300922	天秦装备	4,100	69,987.00	0.09
601	600576	祥源文旅	9,400	69,936.00	0.09
602	300758	七彩化学	6,900	69,759.00	0.09
603	601226	华电重工	10,600	69,748.00	0.09
604	688320	禾川科技	1,701	69,741.00	0.09
605	002293	罗莱生活	7,500	69,675.00	0.09
606	605128	上海沿浦	1,200	69,660.00	0.09
607	603516	淳中科技	3,100	69,657.00	0.09
608	002330	得利斯	12,500	69,500.00	0.09
609	603186	华正新材	2,000	69,400.00	0.09
610	603203	快克智能	2,400	69,384.00	0.09

611	000838	财信发展	18,900	69,363.00	0.09
612	000428	华天酒店	17,000	69,360.00	0.09
613	002864	盘龙药业	1,800	69,282.00	0.09
614	301185	鸥玛软件	3,400	69,224.00	0.09
615	000965	天保基建	22,100	69,173.00	0.09
616	002896	中大力德	1,900	69,065.00	0.09
617	600736	苏州高新	14,500	69,020.00	0.09
618	603889	新澳股份	9,692	69,007.04	0.09
619	605289	罗曼股份	1,200	69,000.00	0.09
620	300982	苏文电能	2,100	68,964.00	0.09
621	603258	电魂网络	3,000	68,940.00	0.09
622	002095	生意宝	3,400	68,918.00	0.09
623	000530	冰山冷热	12,900	68,886.00	0.09
624	603096	新经典	3,500	68,880.00	0.09
625	603367	辰欣药业	4,700	68,808.00	0.09
626	001339	智微智能	2,000	68,760.00	0.09
627	601500	通用股份	16,600	68,724.00	0.09
628	301391	卡莱特	600	68,688.00	0.09
629	300021	大禹节水	14,400	68,544.00	0.09
630	601038	一拖股份	4,700	68,479.00	0.09
631	002395	双象股份	3,400	68,476.00	0.09
631	300697	电工合金	5,300	68,476.00	0.09
633	300909	汇创达	2,200	68,420.00	0.09
634	300959	线上线下	1,900	68,400.00	0.09
635	603050	科林电气	3,800	68,210.00	0.09
636	002462	嘉事堂	4,800	68,208.00	0.09
637	300559	佳发教育	4,400	68,200.00	0.09
638	300656	民德电子	2,780	68,193.40	0.09
639	300939	秋田微	1,800	68,184.00	0.09
640	603200	上海洗霸	3,200	68,128.00	0.09
641	603223	恒通股份	6,900	68,103.00	0.09
642	300275	梅安森	5,900	68,027.00	0.09
643	002419	天虹股份	12,300	68,019.00	0.09
644	301188	力诺特玻	3,800	67,982.00	0.09
645	300538	同益股份	3,400	67,966.00	0.09
646	603708	家家悦	5,200	67,964.00	0.09
647	300110	华仁药业	16,100	67,942.00	0.09
648	300700	岱勒新材	4,000	67,880.00	0.09
649	603815	交建股份	8,100	67,716.00	0.09
650	603416	信捷电气	1,800	67,608.00	0.09
651	000797	中国武夷	22,600	67,574.00	0.09
652	300972	万辰集团	1,800	67,572.00	0.09
653	300127	银河磁体	3,900	67,509.00	0.09
654	301282	金禄电子	2,700	67,473.00	0.09

655	000419	通程控股	12,000	67,440.00	0.09
656	002483	润邦股份	12,900	67,338.00	0.09
657	000607	华媒控股	14,700	67,326.00	0.09
658	002823	凯中精密	5,300	67,310.00	0.09
659	300430	诚益通	4,700	67,163.00	0.09
660	002659	凯文教育	15,500	67,115.00	0.09
661	002538	司尔特	11,100	67,044.00	0.09
662	002478	常宝股份	12,300	67,035.00	0.09
663	688566	吉贝尔	2,135	67,017.65	0.09
664	301101	明月镜片	1,600	66,976.00	0.09
665	605108	同庆楼	2,200	66,968.00	0.09
666	605377	华旺科技	3,500	66,815.00	0.09
667	301389	隆扬电子	3,500	66,780.00	0.09
668	300447	全信股份	4,600	66,700.00	0.08
669	300873	海晨股份	2,800	66,668.00	0.08
670	301116	益客食品	5,200	66,664.00	0.08
671	600605	汇通能源	2,400	66,648.00	0.08
672	300314	戴维医疗	4,400	66,616.00	0.08
673	600853	龙建股份	15,600	66,612.00	0.08
674	002766	索菱股份	12,200	66,490.00	0.08
675	600653	申华控股	35,900	66,415.00	0.08
676	002172	澳洋健康	17,500	66,325.00	0.08
677	688150	莱特光电	3,071	66,302.89	0.08
678	002376	新北洋	8,700	66,294.00	0.08
679	300318	博晖创新	10,600	66,144.00	0.08
680	688663	新风光	2,358	66,118.32	0.08
681	301099	雅创电子	1,300	66,105.00	0.08
682	002454	松芝股份	8,800	66,088.00	0.08
683	002614	奥佳华	8,800	66,000.00	0.08
683	002999	天禾股份	8,800	66,000.00	0.08
685	300978	东箭科技	4,800	65,904.00	0.08
686	003015	日久光电	5,600	65,856.00	0.08
687	300791	仙乐健康	1,900	65,854.00	0.08
688	605089	味知香	1,800	65,772.00	0.08
689	002560	通达股份	9,100	65,702.00	0.08
690	300698	万马科技	1,800	65,700.00	0.08
691	301052	果麦文化	1,500	65,670.00	0.08
692	300632	光莆股份	5,200	65,624.00	0.08
693	002933	新兴装备	1,800	65,610.00	0.08
694	000707	双环科技	8,200	65,600.00	0.08
695	600080	金花股份	8,800	65,560.00	0.08
696	301215	中汽股份	10,600	65,402.00	0.08
697	000717	中南股份	25,700	65,278.00	0.08
698	003043	华亚智能	1,300	65,273.00	0.08

699	603727	博迈科	5,200	65,156.00	0.08
700	002917	金奥博	6,600	65,142.00	0.08
701	301312	智立方	600	65,004.00	0.08
702	300683	海特生物	1,800	64,998.00	0.08
703	002695	煌上煌	6,200	64,914.00	0.08
704	002638	勤上股份	23,900	64,769.00	0.08
705	688357	建龙微纳	1,252	64,715.88	0.08
706	002246	北化股份	7,900	64,701.00	0.08
707	600230	沧州大化	4,800	64,656.00	0.08
708	600753	庚星股份	6,200	64,604.00	0.08
709	002037	保利联合	7,500	64,575.00	0.08
710	301218	华是科技	2,000	64,540.00	0.08
711	301333	诺思格	1,000	64,480.00	0.08
711	603977	国泰集团	6,200	64,480.00	0.08
713	603069	海汽集团	3,500	64,400.00	0.08
714	603168	莎普爱思	4,800	64,368.00	0.08
715	300817	双飞集团	3,800	64,334.00	0.08
716	603076	乐惠国际	2,400	64,320.00	0.08
717	300540	蜀道装备	2,600	64,090.00	0.08
718	603357	设计总院	7,200	64,080.00	0.08
719	601116	三江购物	5,900	64,074.00	0.08
720	002083	孚日股份	12,700	64,008.00	0.08
721	300426	唐德影视	5,800	63,974.00	0.08
722	301285	鸿日达	4,000	63,920.00	0.08
723	002348	高乐股份	16,600	63,910.00	0.08
724	000633	合金投资	9,000	63,900.00	0.08
725	002971	和远气体	2,300	63,756.00	0.08
725	002977	火箭科技	1,800	63,756.00	0.08
727	300341	麦克奥迪	5,400	63,720.00	0.08
728	688205	德科立	1,287	63,680.76	0.08
729	300645	正元智慧	3,500	63,665.00	0.08
730	300569	天能重工	8,900	63,635.00	0.08
731	000863	三湘印象	16,100	63,595.00	0.08
732	002553	南方精工	5,200	63,440.00	0.08
733	300785	值得买	2,900	63,394.00	0.08
734	688698	伟创电气	1,744	63,359.52	0.08
735	600523	贵航股份	4,600	63,342.00	0.08
736	002551	尚荣医疗	15,600	63,336.00	0.08
737	688138	清溢光电	2,794	63,200.28	0.08
738	000788	北大医药	9,400	63,074.00	0.08
739	603558	健盛集团	6,500	62,985.00	0.08
740	300506	名家汇	12,800	62,976.00	0.08
741	688058	宝兰德	1,333	62,930.93	0.08
742	300937	药易购	2,000	62,900.00	0.08

743	002650	加加食品	15,400	62,832.00	0.08
744	002900	哈三联	4,600	62,790.00	0.08
745	300721	怡达股份	4,200	62,706.00	0.08
746	603239	浙江仙通	4,100	62,607.00	0.08
747	688236	春立医疗	2,377	62,515.10	0.08
748	688682	霍莱沃	1,309	62,452.39	0.08
749	300990	同飞股份	1,400	62,314.00	0.08
750	301486	致尚科技	1,300	62,309.00	0.08
751	600706	曲江文旅	4,200	62,244.00	0.08
751	600858	银座股份	11,700	62,244.00	0.08
753	001205	盛航股份	3,800	62,206.00	0.08
754	002379	宏创控股	13,700	62,198.00	0.08
755	300945	曼卡龙	4,400	62,172.00	0.08
756	002297	博云新材	7,800	62,166.00	0.08
757	002342	巨力索具	14,400	62,064.00	0.08
758	300539	横河精密	5,000	62,050.00	0.08
759	002827	高争民爆	3,700	61,975.00	0.08
760	300771	智莱科技	5,700	61,959.00	0.08
761	600035	楚天高速	16,200	61,884.00	0.08
762	300858	科拓生物	3,200	61,760.00	0.08
763	000912	泸天化	13,300	61,712.00	0.08
764	600251	冠农股份	7,100	61,699.00	0.08
765	002443	金洲管道	9,000	61,650.00	0.08
766	603825	华扬联众	5,100	61,608.00	0.08
767	300797	钢研纳克	4,800	61,584.00	0.08
768	002615	哈尔斯	8,400	61,572.00	0.08
769	002441	众业达	6,500	61,555.00	0.08
770	600758	辽宁能源	17,000	61,540.00	0.08
771	300546	雄帝科技	3,900	61,503.00	0.08
772	603190	亚通精工	2,100	61,488.00	0.08
773	300733	西菱动力	5,100	61,404.00	0.08
774	000026	飞亚达	5,600	61,376.00	0.08
775	300786	国林科技	3,400	61,370.00	0.08
776	301073	君亭酒店	2,700	61,263.00	0.08
777	002970	锐明技术	2,000	61,220.00	0.08
778	300534	陇神戎发	6,200	61,194.00	0.08
779	000532	华金资本	5,100	61,149.00	0.08
780	002762	金发拉比	6,800	61,064.00	0.08
781	301123	奕东电子	2,600	60,996.00	0.08
782	002843	泰嘉股份	2,300	60,950.00	0.08
783	600629	华建集团	11,800	60,888.00	0.08
784	605133	嵘泰股份	2,200	60,874.00	0.08
785	688293	奥浦迈	1,102	60,797.34	0.08
786	600658	电子城	13,600	60,792.00	0.08

787	688102	斯瑞新材	4,608	60,779.52	0.08
788	300917	特发服务	2,400	60,768.00	0.08
789	600785	新华百货	4,100	60,680.00	0.08
790	301133	金钟股份	2,200	60,654.00	0.08
791	600738	丽尚国潮	11,400	60,648.00	0.08
792	301339	通行宝	3,000	60,540.00	0.08
793	688117	圣诺生物	2,144	60,460.80	0.08
794	600033	福建高速	19,500	60,450.00	0.08
795	300898	熊猫乳品	2,500	60,400.00	0.08
796	002062	宏润建设	13,600	60,248.00	0.08
797	300516	久之洋	1,800	60,228.00	0.08
798	300491	通合科技	2,700	60,156.00	0.08
799	300711	广哈通信	4,500	60,075.00	0.08
800	301366	一博科技	1,800	60,066.00	0.08
801	002435	长江健康	14,400	60,048.00	0.08
802	002393	力生制药	2,300	60,030.00	0.08
803	688183	生益电子	5,276	59,988.12	0.08
804	605319	无锡振华	2,600	59,852.00	0.08
805	000919	金陵药业	7,600	59,812.00	0.08
806	000663	永安林业	7,400	59,792.00	0.08
807	002636	金安国纪	6,700	59,697.00	0.08
808	000753	漳州发展	14,200	59,640.00	0.08
809	000514	渝开发	14,300	59,631.00	0.08
810	002689	远大智能	13,400	59,630.00	0.08
811	600721	百花医药	7,700	59,598.00	0.08
812	301330	熵基科技	1,800	59,580.00	0.08
813	600981	汇鸿集团	19,500	59,475.00	0.08
814	002658	雪迪龙	7,400	59,422.00	0.08
815	301297	富乐德	2,200	59,312.00	0.08
816	002103	广博股份	7,400	59,274.00	0.08
817	603421	鼎信通讯	6,300	59,220.00	0.08
818	603051	鹿山新材	1,700	59,041.00	0.08
819	603380	易德龙	2,300	58,903.00	0.08
820	003007	直真科技	1,800	58,860.00	0.08
821	300926	博俊科技	2,000	58,660.00	0.07
822	300434	金石亚药	5,300	58,618.00	0.07
823	000920	沃顿科技	5,900	58,587.00	0.07
824	688468	科美诊断	5,428	58,568.12	0.07
825	300902	国安达	1,660	58,515.00	0.07
826	300781	因赛集团	1,300	58,500.00	0.07
827	002852	道道全	5,400	58,428.00	0.07
828	600851	海欣股份	8,500	58,395.00	0.07
829	300875	捷强装备	2,000	58,380.00	0.07
830	300951	博硕科技	900	58,302.00	0.07

831	603663	三祥新材	5,300	58,247.00	0.07
832	300788	中信出版	2,000	58,200.00	0.07
833	000045	深纺织 A	4,900	57,820.00	0.07
834	002694	顾地科技	9,400	57,528.00	0.07
835	603327	福蓉科技	4,300	57,319.00	0.07
836	301257	普蕊斯	900	57,150.00	0.07
837	300913	兆龙互连	1,900	57,057.00	0.07
838	603617	君禾股份	6,200	57,040.00	0.07
839	603209	兴通股份	3,500	57,015.00	0.07
840	603569	长久物流	4,600	56,994.00	0.07
841	301103	何氏眼科	1,900	56,962.00	0.07
842	002787	华源控股	6,200	56,854.00	0.07
843	600121	郑州煤电	14,000	56,840.00	0.07
844	605016	百龙创园	2,000	56,780.00	0.07
845	000631	顺发恒业	17,100	56,772.00	0.07
845	605277	新亚电子	3,800	56,772.00	0.07
847	002679	福建金森	4,600	56,718.00	0.07
848	002116	中国海诚	5,500	56,595.00	0.07
849	002877	智能自控	5,400	56,538.00	0.07
850	600088	中视传媒	4,400	56,496.00	0.07
851	688182	灿勤科技	3,173	56,415.94	0.07
852	300071	福石控股	16,300	56,398.00	0.07
853	600215	派斯林	6,600	56,364.00	0.07
854	300192	科德教育	5,700	56,259.00	0.07
855	000593	德龙汇能	7,600	56,240.00	0.07
856	002616	长青集团	10,700	56,175.00	0.07
857	688156	路德环境	2,333	56,038.66	0.07
858	300584	海辰药业	2,400	55,872.00	0.07
859	688121	卓然股份	2,759	55,814.57	0.07
860	301128	强瑞技术	1,200	55,812.00	0.07
861	300880	迦南智能	2,800	55,776.00	0.07
862	301488	豪恩汽电	800	55,712.00	0.07
863	003005	竞业达	1,800	55,710.00	0.07
864	300847	中船汉光	3,200	55,616.00	0.07
865	002546	新联电子	11,100	55,500.00	0.07
865	002882	金龙羽	3,700	55,500.00	0.07
867	300389	艾比森	3,200	55,488.00	0.07
867	300600	国瑞科技	4,800	55,488.00	0.07
869	688626	翔宇医疗	1,041	55,474.89	0.07
870	603800	道森股份	2,100	55,440.00	0.07
871	300795	米奥会展	1,500	55,305.00	0.07
872	301021	英诺激光	2,100	55,251.00	0.07
873	002375	亚厦股份	12,100	54,813.00	0.07
874	600636	国新文化	5,200	54,808.00	0.07

875	000852	石化机械	8,900	54,735.00	0.07
876	603886	元祖股份	3,000	54,690.00	0.07
877	688661	和林微纳	1,193	54,663.26	0.07
878	301208	中亦科技	1,400	54,656.00	0.07
879	300140	节能环境	7,400	54,538.00	0.07
880	301211	亨迪药业	2,500	54,375.00	0.07
881	688089	嘉必优	3,035	54,326.50	0.07
882	601999	出版传媒	7,300	54,312.00	0.07
883	688606	奥泰生物	791	54,262.60	0.07
884	605116	奥锐特	2,100	54,222.00	0.07
885	301397	溯联股份	1,200	54,216.00	0.07
886	300654	世纪天鸿	4,800	54,144.00	0.07
887	600613	神奇制药	7,100	54,031.00	0.07
888	301393	昊帆生物	900	54,009.00	0.07
889	300969	恒帅股份	600	53,922.00	0.07
890	600081	东风科技	4,800	53,904.00	0.07
891	301328	维峰电子	1,100	53,856.00	0.07
891	605068	明新旭腾	2,400	53,856.00	0.07
893	002976	瑞玛精密	1,500	53,820.00	0.07
894	688020	方邦股份	1,109	53,764.32	0.07
895	600229	城市传媒	7,100	53,605.00	0.07
896	603058	永吉股份	5,900	53,513.00	0.07
897	688510	航亚科技	3,028	53,353.36	0.07
898	600560	金自天正	3,600	53,280.00	0.07
899	601188	龙江交通	13,200	53,196.00	0.07
900	300870	欧陆通	1,200	53,124.00	0.07
901	300374	中铁装配	4,300	52,589.00	0.07
902	002186	全聚德	4,500	52,470.00	0.07
903	002983	芯瑞达	1,700	52,462.00	0.07
904	688371	菲沃泰	2,971	52,319.31	0.07
905	002878	元隆雅图	2,800	52,108.00	0.07
906	301380	挖金客	1,100	52,096.00	0.07
907	301307	美利信	1,500	52,035.00	0.07
908	301277	新天地	2,500	52,025.00	0.07
909	605077	华康股份	2,400	51,936.00	0.07
910	000900	现代投资	13,200	51,744.00	0.07
911	603266	天龙股份	1,800	51,732.00	0.07
912	301132	满坤科技	1,800	51,678.00	0.07
913	301261	恒工精密	1,000	51,620.00	0.07
914	300921	南凌科技	2,100	51,618.00	0.07
915	301041	金百泽	1,900	51,338.00	0.07
916	688416	恒烁股份	859	50,328.81	0.06
917	605398	新炬网络	1,700	50,218.00	0.06
918	300553	集智股份	1,400	50,120.00	0.06

919	600668	尖峰集团	4,500	49,725.00	0.06
920	301289	国缆检测	900	49,689.00	0.06
921	301179	泽宇智能	1,900	49,305.00	0.06
922	002880	卫光生物	1,400	49,182.00	0.06
923	688292	浩瀚深度	1,786	49,150.72	0.06
924	603378	亚士创能	5,800	49,068.00	0.06
925	300985	致远新能	1,300	49,023.00	0.06
926	600213	亚星客车	5,300	48,972.00	0.06
927	300727	润禾材料	1,700	48,943.00	0.06
928	001380	华纬科技	1,400	48,776.00	0.06
929	603931	格林达	1,900	48,621.00	0.06
930	001319	铭科精技	1,900	48,583.00	0.06
931	300561	汇金科技	4,100	48,380.00	0.06
932	688191	智洋创新	2,613	48,340.50	0.06
933	603929	亚翔集成	2,000	47,840.00	0.06
934	301315	威士顿	900	47,574.00	0.06
935	601133	柏诚股份	3,600	47,412.00	0.06
936	600551	时代出版	4,300	46,827.00	0.06
937	688244	永信至诚	839	46,807.81	0.06
938	688160	步科股份	802	46,660.36	0.06
939	002907	华森制药	3,000	46,350.00	0.06
940	301255	通力科技	1,100	46,211.00	0.06
941	603767	中马传动	3,000	46,170.00	0.06
942	600855	航天长峰	4,300	46,096.00	0.06
943	002905	金逸影视	4,200	46,032.00	0.06
944	603602	纵横通信	3,100	45,694.00	0.06
945	600790	轻纺城	11,500	45,655.00	0.06
946	002988	豪美新材	1,900	45,353.00	0.06
947	600829	人民同泰	5,700	44,574.00	0.06
948	301111	粤万年青	1,800	44,208.00	0.06
949	301299	卓创资讯	700	41,384.00	0.05
950	301526	国际复材	1,658	7,378.10	0.01
951	688653	康希通信	392	6,268.08	0.01
952	301566	达利凯普	257	5,689.98	0.01
953	301516	中远通	316	4,901.16	0.01
954	301413	安培龙	78	4,538.82	0.01
955	301508	中机认检	151	4,028.68	0.01
956	301568	思泰克	99	3,522.42	0.00
957	301459	丰茂股份	80	3,187.20	0.00
958	301578	辰奕智能	46	3,142.72	0.00
959	001239	永达股份	95	1,892.40	0.00
960	001358	兴欣新材	31	1,368.96	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	688596	正帆科技	3,288,085.86	4.19
2	002229	鸿博股份	2,986,020.67	3.81
3	600976	健民集团	2,946,227.00	3.75
4	688181	八亿时空	2,454,361.17	3.13
5	605266	健之佳	2,332,509.00	2.97
6	688062	迈威生物	2,304,795.18	2.94
7	688087	英科再生	2,240,764.15	2.86
8	603283	赛腾股份	2,144,358.20	2.73
9	688317	之江生物	2,101,201.43	2.68
10	688135	利扬芯片	2,089,934.95	2.66
11	603722	阿科力	2,085,920.00	2.66
12	300825	阿尔特	2,049,703.00	2.61
13	600410	华胜天成	1,939,555.00	2.47
14	688199	久日新材	1,933,952.65	2.46
15	603496	恒为科技	1,914,179.40	2.44
16	688186	广大特材	1,889,634.74	2.41
17	688377	迪威尔	1,886,047.47	2.40
18	600186	莲花健康	1,880,151.00	2.40
19	688595	芯海科技	1,852,495.89	2.36
20	603859	能科科技	1,841,684.00	2.35
21	002154	报喜鸟	1,828,375.00	2.33
22	601020	华钰矿业	1,810,956.40	2.31
23	605089	味知香	1,799,342.32	2.29
24	600138	中青旅	1,793,847.67	2.29
25	603035	常熟汽饰	1,793,018.00	2.28
26	300161	华中数控	1,777,678.00	2.27
27	688179	阿拉丁	1,762,135.42	2.25
28	300138	晨光生物	1,759,799.00	2.24
29	301030	仕净科技	1,751,508.00	2.23
30	600749	西藏旅游	1,747,326.00	2.23
31	600105	永鼎股份	1,747,252.00	2.23
32	605186	健麾信息	1,724,621.00	2.20
33	600794	保税科技	1,720,520.00	2.19
34	603590	康辰药业	1,701,018.00	2.17
35	600425	青松建化	1,699,456.00	2.17

36	600855	航天长峰	1,699,212.00	2.17
37	002354	天娱数科	1,691,470.00	2.16
38	600255	鑫科材料	1,675,611.00	2.14
39	000099	中信海直	1,666,310.00	2.12
40	600461	洪城环境	1,661,913.00	2.12
41	688319	欧林生物	1,660,482.70	2.12
42	603313	梦百合	1,655,218.00	2.11
43	600620	天宸股份	1,638,639.00	2.09
44	688590	新致软件	1,638,324.08	2.09
45	600351	亚宝药业	1,637,051.00	2.09
46	688658	悦康药业	1,624,162.34	2.07
47	600103	青山纸业	1,613,209.00	2.06
48	300364	中文在线	1,610,199.00	2.05
49	300908	仲景食品	1,598,859.00	2.04
50	300350	华鹏飞	1,597,955.00	2.04
51	300025	华星创业	1,597,642.00	2.04
52	002965	祥鑫科技	1,596,161.00	2.03
53	301168	通灵股份	1,594,349.00	2.03
54	600012	皖通高速	1,589,005.00	2.02
55	688121	卓然股份	1,584,646.64	2.02
56	601858	中国科传	1,581,209.00	2.01
57	600114	东睦股份	1,579,233.00	2.01

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。

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	688596	正帆科技	3,336,057.51	4.25
2	600976	健民集团	2,936,933.00	3.74
3	688181	八亿时空	2,463,771.55	3.14
4	603496	恒为科技	2,448,963.00	3.12
5	688062	迈威生物	2,362,641.93	3.01
6	605266	健之佳	2,264,933.90	2.89
7	688087	英科再生	2,218,914.84	2.83
8	603283	赛腾股份	2,148,291.00	2.74
9	688317	之江生物	2,080,514.14	2.65
10	600186	莲花健康	2,030,885.00	2.59
11	603722	阿科力	2,026,729.00	2.58
12	688135	利扬芯片	1,993,673.19	2.54
13	600410	华胜天成	1,977,813.00	2.52

14	688595	芯海科技	1,948,254.18	2.48
15	688377	迪威尔	1,841,116.11	2.35
16	688199	久日新材	1,828,803.16	2.33
17	605186	健麾信息	1,797,241.00	2.29
18	603859	能科科技	1,789,932.36	2.28
19	688186	广大特材	1,787,460.38	2.28
20	603035	常熟汽饰	1,713,031.00	2.18
21	300624	万兴科技	1,705,611.00	2.17
22	605089	味知香	1,699,884.36	2.17
23	688179	阿拉丁	1,682,995.54	2.14
24	600138	中青旅	1,656,303.00	2.11
25	600794	保税科技	1,654,060.00	2.11
26	603590	康辰药业	1,648,315.00	2.10
27	600114	东睦股份	1,646,001.92	2.10
28	600749	西藏旅游	1,640,376.80	2.09
29	688319	欧林生物	1,620,747.23	2.07
30	600855	航天长峰	1,614,904.00	2.06
31	600105	永鼎股份	1,612,795.65	2.06
32	601858	中国科传	1,609,794.00	2.05
33	603313	梦百合	1,597,200.71	2.04
34	688658	悦康药业	1,596,836.56	2.03
35	688590	新致软件	1,594,610.99	2.03
36	601020	华钰矿业	1,585,103.00	2.02
37	600012	皖通高速	1,572,021.00	2.00

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。

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	968,096,172.23
卖出股票收入（成交）总额	407,238,038.17

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。

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）	20,000.74	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	20,000.74	0.03

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	14,000.37	0.02
2	118046	诺泰转债	60	6,000.37	0.01

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，按照相关法律法规的有关规定，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约来进行投资。为更有效地进行流动性管理，本基金在出现需要及时调整组合市场暴露情况时，通过股指期货套保交易满足基金的投资替代需求和风险管理需求。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。本报告期内，本基金投资股指期货符合既定的投资政策和投资目的。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,414,875.94
2	应收清算款	95,397.85
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	1,510,273.79

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	300096	易联众	138,446.00	0.18	重大事项停牌

§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
1,287	58,713.90	34,922,300.00	46.22%	40,642,491.00	53.78%

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	广发证券股份有限公司	9,342,605.00	12.36%
2	招商证券股份有限公司	4,342,370.00	5.75%
3	中信证券股份有限公司	3,067,502.00	4.06%
4	东方证券股份有限公司	2,992,319.00	3.96%
5	财通证券股份有限公司	2,830,367.00	3.75%
6	方正证券股份有限公司	2,373,721.00	3.14%
7	海南盛冠达私募基金管理有限公司— 盛冠达试金石 5 号私募证券投资基金	2,000,000.00	2.65%
8	彭晓莲	1,648,000.00	2.18%
9	海通证券股份有限公司	1,301,555.00	1.72%
10	中国国际金融股份有限公司	1,296,635.00	1.72%

注：本表统计的上市基金前十名持有人均为场内持有人。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有 本基金	0.00	0.0000%

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2023 年 9 月 13 日)基金份额总额	811,564,791.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	138,000,000.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	874,000,000.00
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	75,564,791.00

注：本基金合同生效日为 2023 年 9 月 13 日。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 2023 年 4 月 22 日发布公告，自 2023 年 4 月 22 日起王骏先生担任公司副总经理级高级管理人员（首席市场官）。本基金管理人于 2023 年 8 月 23 日发布公告，自 2023 年 8 月 21 日起刘晓艳女士担任公司董事长（联席），并仍担任公司总经理，原任公司副董事长职务自行免去；自 2023 年 8 月 21 日起吴欣荣先生担任公司执行总经理（总经理级），原任公司副总经理职务自行免去。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、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

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效以来聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务，本报告年度的审计费用为 54,100.00 元。

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

措施 1	内容
------	----

受到稽查或处罚等措施的主体	易方达基金管理有限公司
受到稽查或处罚等措施的时间	2023-03-24
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会广东监管局
受到的具体措施类型	出具警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	个别规定及制度未严格执行
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	已整改完成
其他	/

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，基金托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到稽查或处罚。

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	
长江证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	390,409,029.63	28.39%	72,152.71	17.84%	-
国信证券	2	984,649,451.95	71.61%	332,257.51	82.16%	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内新增交易单元的证券公司为长江证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、中信证券股份有限公司。

b) 本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。基金交易单元的选择标准如下：

- 1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- 2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- 3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面

的信息服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

c) 基金交易单元的选择程序如下：

- 1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。
- 2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

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
长江证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	250,155.46	100.00%	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	易方达中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-09-14
2	易方达中证 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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-09-18
3	易方达中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-09-18
4	易方达中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书提示性公告	证券时报	2023-09-18
5	易方达基金管理有限公司关于易方达中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-09-21
6	易方达中证 2000 交易型开放式指数证券投资	证券时报、基金管理人	2023-09-21

	基金上市交易提示性公告	网站及中国证监会基金 电子披露网站	
7	易方达基金管理有限公司关于易方达中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告	证券时报、基金管理人 网站及中国证监会基金 电子披露网站	2023-09-27
8	易方达基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告	证券时报、基金管理人 网站及中国证监会基金 电子披露网站	2023-10-12
9	易方达基金管理有限公司关于易方达中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告	证券时报、基金管理人 网站及中国证监会基金 电子披露网站	2023-10-23
10	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加甬兴证券为一级交易商的公告	证券时报、基金管理人 网站及中国证监会基金 电子披露网站	2023-10-26
11	易方达基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告	证券时报、基金管理人 网站及中国证监会基金 电子披露网站	2023-10-28
12	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加上海证券为一级交易商的公告	证券时报、基金管理人 网站及中国证监会基金 电子披露网站	2023-11-13
13	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加华金证券为一级交易商的公告	证券时报、基金管理人 网站及中国证监会基金 电子披露网站	2023-11-21
14	易方达基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告	证券时报、基金管理人 网站及中国证监会基金 电子披露网站	2023-12-05
15	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加金元证券为一级交易商的公告	证券时报、基金管理人 网站及中国证监会基金 电子披露网站	2023-12-18
16	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加信达证券为一级交易商的公告	证券时报、基金管理人 网站及中国证监会基金 电子披露网站	2023-12-20

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1. 中国证监会准予易方达中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金注册的文件；
2. 《易方达中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
3. 《易方达中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
4. 基金管理人业务资格批件、营业执照。

12.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇二四年三月二十九日