

**华夏中证 2000 交易型开放式指数
证券投资基金
2024 年中期报告
2024 年 6 月 30 日**

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年八月三十日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
§2 基金简介.....	3
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	4
3.1 主要会计数据和财务指标.....	4
3.2 基金净值表现.....	4
§4 管理人报告.....	5
§5 托管人报告.....	10
§6 中期报告财务会计报告（未经审计）.....	10
6.1 资产负债表.....	10
6.2 利润表.....	12
6.3 净资产变动表.....	13
6.4 报表附注.....	13
§7 投资组合报告.....	31
7.1 期末基金资产组合情况.....	31
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	31
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	32
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	53
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	53
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	53
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	53
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	53
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	54
7.12 投资组合报告附注.....	54
§8 基金份额持有人信息.....	54
§9 开放式基金份额变动.....	56
§10 重大事件揭示.....	56
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	58
§12 备查文件目录.....	59

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华夏中证 2000ETF
场内简称	ZZ2000（扩位简称：中证 2000ETF 华夏）
基金主代码	562660
交易代码	562660
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023 年 9 月 6 日
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	96,874,000.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2023 年 9 月 14 日

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华夏基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李彬	张姗
	联系电话	400-818-6666	400-61-95555
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		400-818-6666	400-61-95555
传真		010-63136700	0755-83195201
注册地址		北京市顺义区安庆大街甲3号院	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址		北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码		100033	518040
法定代表人		张佑君	缪建民

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-3,620,275.55
本期利润	-7,343,613.83
加权平均基金份额本期利润	-0.0721
本期加权平均净值利润率	-7.94%
本期基金份额净值增长率	-18.49%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)
期末可供分配利润	-14,267,910.40
期末可供分配基金份额利润	-0.1473
期末基金资产净值	82,606,089.60
期末基金份额净值	0.8527
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-14.73%

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。

3.2 基金净值表现

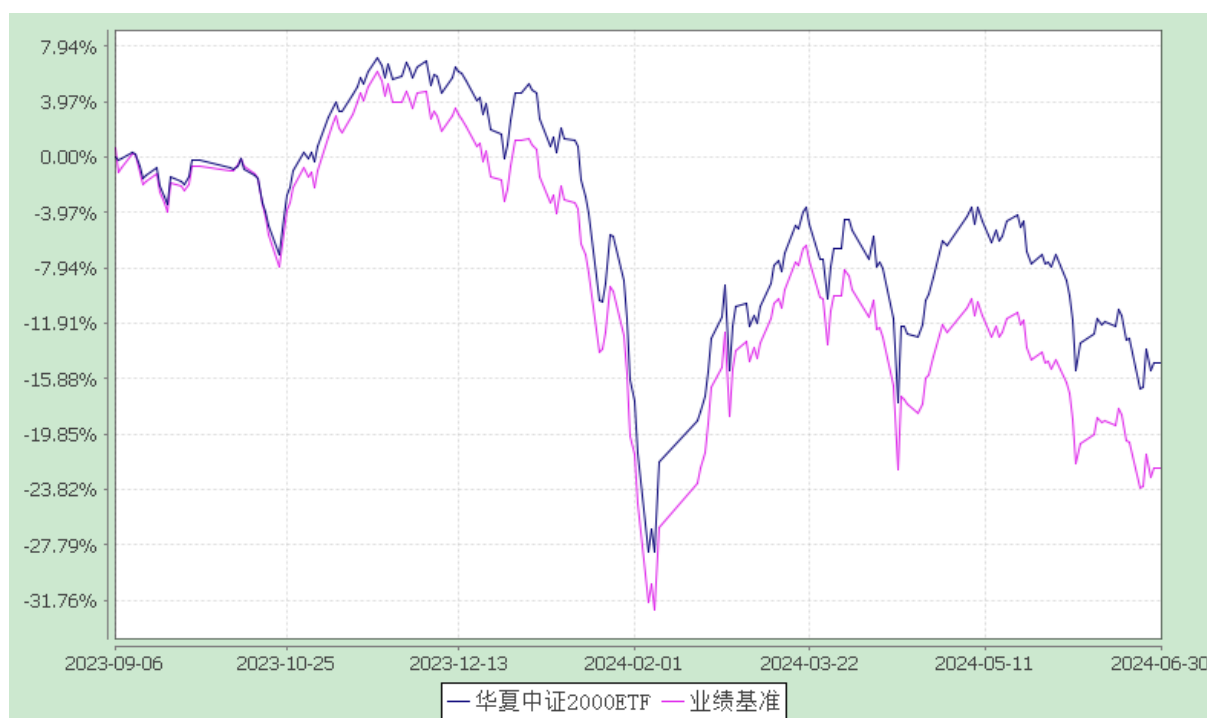
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个	-8.32%	1.87%	-9.15%	1.85%	0.83%	0.02%

月						
过去三个月	-8.78%	1.99%	-13.75%	2.01%	4.97%	-0.02%
过去六个月	-18.49%	2.44%	-23.28%	2.50%	4.79%	-0.06%
自基金合同生效起至今	-14.73%	1.99%	-22.32%	2.05%	7.59%	-0.06%

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

华夏中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 (2023 年 9 月 6 日至 2024 年 6 月 30 日)



注：①本基金合同于 2023 年 9 月 6 日生效。

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

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

华夏基金是境内 ETF 基金资产管理规模最大的基金管理公司之一,在 ETF 基金管理方面积累了丰富的经验,形成了覆盖大盘蓝筹、宽基指数、中小创指数、主题指数、行业指数、SmartBeta 策略、海外市场指数、信用债指数、商品指数等较为完整的产品线。

华夏基金以深入的投资研究为基础,尽力捕捉市场机会,为投资人谋求良好的回报。根据银河证券基金研究中心《中国基金业绩评价报告》,截至 2024 年 6 月 30 日,华夏基金旗下多只产品近 1 年同类排名领先(基金排名不作为产品未来表现的保证),其中:

主动权益产品:在北交所主题偏股型基金(A 类)中华夏北交所创新中小企业精选两年定开混合发起式排名第 1/10;在对冲策略绝对收益目标基金(A 类)华夏安泰对冲策略 3 个月定开混合排名第 1/22;在 QDII 混合基金(A 类)中华夏全球科技先锋混合(QDII)排名第 2/48;在汽车主题行业偏股型基金(A 类)中华夏新能源车龙头混合发起式(A 类)排名第 3/17;在消费行业偏股型基金(A 类)中华夏网购精选混合(A 类)排名第 3/78、华夏消费臻选混合发起式(A 类)排名第 7/78。

固收与固收+产品:在 QDII 债券型基金(A 类)中华夏收益债券(QDII)(A 类)排名第 1/24、华夏大中华信用债券(QDII)(A 类)排名第 2/24;在信用债指数债券型基金(A 类)中华夏亚债中国指数(A 类)排名第 2/18;在定开纯债债券型基金(A 类)中华夏鼎华一年定开债券排名第 5/616、华夏鼎成一年定开债券排名第 14/616;在普通债券型基金(可投转债)(A 类)中华夏稳定双利债券(A 类)排名第 12/241;在长期纯债债券型基金(A 类)中华夏鼎航债券(A 类)排名第 7/793、华夏鼎茂债券(A 类)排名第 19/793、华夏鼎英债券(A 类)排名第 25/793、华夏鼎隆债券(A 类)排名第 26/793、华夏鼎信债券(A 类)排名第

52/793；在普通债券型基金(二级)(A 类)中华夏稳享增利 6 个月债券(A 类)排名第 13/416、华夏鼎源债券(A 类)排名第 27/416、华夏希望债券(A 类)排名第 29/416。

在《中国证券报》第二十届中国基金业金牛奖评选中，华夏基金荣获“金牛奖 20 周年特别贡献公司”，连续 8 年荣获“被动投资金牛基金公司”，产品层面华夏创新前沿股票荣获“五年期开放式股票型持续优胜金牛基金”，华夏中证 5G 通信主题 ETF 荣获“开放式指数型金牛基金”。在证券时报主办的第十八届中国基金业明星基金奖评选活动上，华夏基金将两大奖项收入囊中：公司层面，华夏基金荣获“三年期海外投资明星基金公司”；产品层面，华夏沪深 300ETF 荣获“三年持续回报指数型明星基金奖”。在《上海证券报》主办的第二十届“金基金”奖评选活动上，华夏基金将三大金基金奖项收入囊中：公司层面，华夏基金荣获“金基金·被动投资基金管理公司奖”；产品层面，华夏创新前沿股票荣获“金基金·股票型基金五年期奖”，华夏行业景气混合荣获“金基金·偏股混合型基金五年期奖”。

在客户服务方面，2024 年上半年，华夏基金继续以客户需求为导向，努力提高客户使用的便利性和服务体验：（1）华夏基金直销渠道继续优化页面显示，升级搜索及查询等功能，给客户更方便直观的使用体验；（2）华夏基金管家客户端上线亲子账户，通过亲子账户客户可以为子女创建专属理财账户，管理和储备孩子的零花钱、教育资金，从客户投资需求出发，进一步提升操作体验；（3）与常熟农商银行等代销机构合作，拓展更加丰富的客户理财渠道；（4）开展“送你长期主义的花朵”、“领定制户口本”、“打工人又爱又怕的一天要来了”、“希望高考也这么简单”等活动，为客户提供了多样化的投资者教育和关怀服务。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 期限		证券从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
鲁亚运	本基金的 基金经理	2023-09-06	-	9 年	硕士。曾任国泰基金管理有限公司研究员、银华基金管理有限公司营销经理。2020 年 6 月加入华夏基金管理有限公司。历任数量投资部研究员、基金经理助理。
陈国峰	本基金的 基金经理	2023-09-26	-	9 年	硕士。曾任世坤投资咨询有限公司（WorldQuant）中国区研究总监等。2020 年加入华夏基金管理有限公司。历任数量投资部研究员、投资经理助理、华夏网购精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理（2022 年 9 月 26 日至 2023

					年 11 月 16 日期间)等。
--	--	--	--	--	------------------

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 119 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要发生的反向交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

上半年国内生产总值同比增长 5.0%，其中全国规模以上工业增加值同比增长 6.0%，社会消费品零售总额同比增长 3.7%，货物进出口总额同比增长 6.1%，全国居民消费价格（CPI）同比上涨 0.1%，

宏观经济运行总体平稳，稳中有进。但也需要关注到国内外环境复杂多变，特别是外部环境复杂性严峻性不确定性有所上升，市场风险偏好难以持续提升，对股市形成一定扰动。

具体来看，上半年小盘风格有所回撤，大盘、红利风格相对稳健。板块方面，上半年银行、煤炭、公用事业等高分红高股息的行业表现靠前，综合、计算机、商贸零售、社会服务等行业跌幅较大。港股方面，价值重估带来市场整体企稳回升，尤其是港股高分红风格配置价值凸显。

基金投资运作方面，报告期内，本基金在做好跟踪标的指数的基础上，认真应对投资者日常申购、赎回和成份股调整等工作。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2024 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 0.8527 元，本报告期份额净值增长率为-18.49%，同期业绩比较基准增长率-23.28%。本基金本报告期跟踪偏离度为+4.79%，与业绩比较基准产生偏离的主要原因为成份股分红、日常运作费用、指数结构调整、申购赎回等产生的差异。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，指数存在均值回归现象，当指数估值过高时，市场参与者可能会认为当前的价格已经超过了其合理估值水平，业绩增速无法支撑起高估值的时候，就会有“杀估值”的压力，反之，当指数估值过低时，出现估值修复的可能性也会加大，从而出现指数补涨的情形。当前无论 A 股还是港股，其整体估值都处在近 5 年、10 年较低水平，叠加下半年美联储降息预期的升温，以及国内稳增长、稳市场相关政策加码信号的明确，有望助力市场回暖，带动指数修复。

珍惜基金份额持有人的每一分投资和每一份信任，本基金将继续奉行华夏基金管理有限公司“为信任奉献回报”的经营理念，规范运作，审慎投资，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求长期、稳定的回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 中期报告财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华夏中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
----	-----	------------------------	--------------------------

资产：			
货币资金	6.4.7.1	2,953,728.98	2,771,148.80
结算备付金		893,036.77	953,121.59
存出保证金		394,753.95	656,667.64
交易性金融资产	6.4.7.2	78,942,858.52	89,045,581.31
其中：股票投资		78,942,858.52	89,040,580.94
基金投资		-	-
债券投资		-	5,000.37
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	698.68
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		83,184,378.22	93,427,218.02
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		11,516.67	15,864.03
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		32,218.99	40,719.23
应付托管费		6,443.82	8,143.82
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	528,109.14	392,147.91
负债合计		578,288.62	456,874.99
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	96,874,000.00	88,874,000.00
未分配利润	6.4.7.8	-14,267,910.40	4,096,343.03
净资产合计		82,606,089.60	92,970,343.03
负债和净资产总计		83,184,378.22	93,427,218.02

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.8527 元，基金份额总额 96,874,000.00 份。

6.2 利润表

会计主体：华夏中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-7,000,479.12
1.利息收入		18,264.28
其中：存款利息收入	6.4.7.9	18,264.28
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）		-3,137,808.79
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-3,495,085.25
基金投资收益	6.4.7.11	-
债券投资收益	6.4.7.12	11,193.04
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-377,346.05
股利收益	6.4.7.16	723,429.47
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-3,723,338.28
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-157,596.33
减：二、营业总支出		343,134.71
1.管理人报酬		233,962.12
2.托管费		46,792.40
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	6.4.7.20	-
7.税金及附加		-
8.其他费用	6.4.7.21	62,380.19
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-7,343,613.83
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-7,343,613.83
五、其他综合收益的税后净额		-

六、综合收益总额		-7,343,613.83
-----------------	--	---------------

6.3 净资产变动表

会计主体：华夏中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	88,874,000.00	4,096,343.03	92,970,343.03
二、本期期初净资产	88,874,000.00	4,096,343.03	92,970,343.03
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	8,000,000.00	-18,364,253.43	-10,364,253.43
（一）、综合收益总额	-	-7,343,613.83	-7,343,613.83
（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）	8,000,000.00	-11,020,639.60	-3,020,639.60
其中：1.基金申购款	160,000,000.00	-29,190,010.30	130,809,989.70
2.基金赎回款	-152,000,000.00	18,169,370.70	-133,830,629.30
（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	96,874,000.00	-14,267,910.40	82,606,089.60

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：张佑君，主管会计工作负责人：朱威，会计机构负责人：朱威

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和本基金基金合同的有关规定，本基金的标的指数为中证 2000 指数。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，基金还可投资于非成份股（含存托凭证、创业板及其他中国证监会注册或核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、金融衍生品（包括股指期货、股票期权、国债期货）、资产支持证券、货币市场工具（含同业存单、债券回购等）、银行存款以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金可根据法律法规的规定参与融资、转融通证券出借业务。

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

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布和修订的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则(以下合称“企业会计准则”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会发布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》和中国证监会、中国基金业协会允许的如财务报表附注 6.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 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。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

根据财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103 号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]125 号《财政部、国家税务总局、证监会关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《财政部、国家税务总局关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《财政部、国家税务总局关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于增值税征收范围，不征收增值税。

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

增值税。

(3) 基金买卖股票、债券的差价收入免征增值税，暂不征收企业所得税。

(4) 存款利息收入不征收增值税。

(5) 国债、地方政府债利息收入，金融同业往来利息收入免征增值税。

(6) 对基金取得的债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

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

(8) 对基金在境内取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利收入时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。基金在境内从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，全额计入应纳税所得额，持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，减按 50% 计入应纳税所得额，持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。对香港市场投资者取得的股息、红利收入按照 10% 的税率代扣所得税。

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	2,953,728.98
等于：本金	2,953,402.25
加：应计利息	326.73

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	2,953,728.98

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	81,838,407.36	-	78,942,858.52	-2,895,548.84
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	81,838,407.36	-	78,942,858.52	-2,895,548.84

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款的估值增值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 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	3,053,520.00	-	-	-
其中：股指期货	3,053,520.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-

合计	3,053,520.00	-	-	-
----	--------------	---	---	---

6.4.7.3.2 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
IM2409	中证 1000 期货 IM2409 合约	3	2,868,120.00	-185,400.00
合计	-	-	-	-185,400.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	-185,400.00
净额	-	-	-	-

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

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	251,323.56
其中：交易所市场	251,323.56
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	59,672.34
应退替代款	217,109.04
可退替代款	4.20

合计	528,109.14
----	------------

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	88,874,000.00	88,874,000.00
本期申购	160,000,000.00	160,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-152,000,000.00	-152,000,000.00
本期末	96,874,000.00	96,874,000.00

6.4.7.8 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
上年度末	3,824,797.16	271,545.87	4,096,343.03
本期期初	3,824,797.16	271,545.87	4,096,343.03
本期利润	-3,620,275.55	-3,723,338.28	-7,343,613.83
本期基金份额交易产生的变动数	1,475,155.81	-12,495,795.41	-11,020,639.60
其中：基金申购款	2,316,703.67	-31,506,713.97	-29,190,010.30
基金赎回款	-841,547.86	19,010,918.56	18,169,370.70
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,679,677.42	-15,947,587.82	-14,267,910.40

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
	活期存款利息收入
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	9,470.95
其他	1,349.37
合计	18,264.28

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
	股票投资收益——买卖股票差价收入
股票投资收益——赎回差价收入	-675,431.47

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	-3,495,085.25

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	288,585,918.60
减：卖出股票成本总额	290,978,969.92
减：交易费用	426,602.46
买卖股票差价收入	-2,819,653.78

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	133,830,629.30
减：现金支付赎回款总额	83,313,028.26
减：赎回股票成本总额	51,193,032.51
减：交易费用	-
赎回差价收入	-675,431.47

6.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.10.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.11 基金投资收益

无。

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	10.59
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	11,182.45
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	11,193.04

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	81,096.65
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	69,900.00
减：应计利息总额	10.96
减：交易费用	3.24
买卖债券差价收入	11,182.45

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

无。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股指期货投资收益	-377,346.05

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	723,429.47
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	723,429.47

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
1.交易性金融资产	-3,630,298.28
——股票投资	-3,630,298.28
——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	-93,040.00
——权证投资	-
——期货投资	-93,040.00
4.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	-3,723,338.28

6.4.7.18 其他收入

单位: 人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	-157,596.33
合计	-157,596.33

6.4.7.19 持有基金产生的费用

无。

6.4.7.20 信用减值损失

无。

6.4.7.21 其他费用

单位: 人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	19,890.78
信息披露费	39,781.56
证券出借违约金	-
银行费用	2,707.85
合计	62,380.19

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中信证券	175,261,052.15	30.28%

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
中信证券	30,461.72	37.56%

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.4.10.1.5 基金交易

无。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30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	77,333.34	31.54%	51,059.99	20.32%

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	233,962.12
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	233,962.12

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

②基金管理人报酬计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×0.50%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	46,792.40

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

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

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
华夏中证 2000ETF 发起式联接	49,870,000.00	51.48%	17,330,000.00	19.50%
中信证券	541,000.00	0.56%	4,617,898.00	5.20%

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行活期存款	2,953,728.98	7,443.96

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 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：）	总金额

				股/张)	
中信证券	001359	平安电工	新股发行	803	13,964.17

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
603350	安乃达	2024-06-27	1 个月内(含)	新发流通受限	20.56	20.56	500	10,280.00	10,280.00	-
301538	骏鼎达	2024-03-13	6 个月	新发流通受限	55.82	91.24	95	3,795.76	8,667.80	含证券送配
301536	星辰科技	2024-03-20	6 个月	新发流通受限	16.16	32.27	209	3,377.44	6,744.43	-
301539	宏鑫科技	2024-04-03	6 个月	新发流通受限	10.64	19.82	289	3,074.96	5,727.98	-
301587	中瑞股份	2024-03-27	6 个月	新发流通受限	21.73	25.26	141	3,063.93	3,561.66	-
001389	广合科技	2024-03-26	6 个月	新发流通受限	17.43	34.56	96	1,673.28	3,317.76	-
001359	平安电工	2024-03-19	6 个月	新发流通受限	17.39	20.60	81	1,408.59	1,668.60	-

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

②基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

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

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000836	ST 富通	2024-06-18	停牌退市	-	-	-	43,900	69,721.41	-	该股票于 2024 年 8 月 12 日摘牌退市。
002288	*ST 超华	2024-06-27	停牌退市	-	-	-	6,700	15,679.75	-	该股票于 2024 年 8 月 19 日摘牌退市。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金管理人主要通过定性分析和定量分析的方法，估测各种金融工具风险可能产生的损失。本基金管理人从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重性；从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用的金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型和日常的量化报告，参考压力测试结果，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时对各种风险进行监督、检查和评估，并制定相应决策，将风险控制在预期可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

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

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

6.4.13.3 流动性风险

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

除在“6.4.12 期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制的情况外，本基金所投资的证券均能及时变现。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

在负债端，基金管理人持续监测本基金投资者历史申赎、投资者类型和结构变化等数据，审慎

评估不同市场环境可能带来的投资者潜在赎回需求，当市场环境或投资者结构发生变化时，及时调整组合资产结构，预留充足现金头寸，保持基金资产可变现规模和期限与负债赎回规模和期限的匹配。

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日		上年度末 2023年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	78,942,858.52	95.57	89,040,580.94	95.77
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	5,000.37	0.01
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
合计	78,942,858.52	95.57	89,045,581.31	95.78

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

②由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证 2000 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	-5%	-4,044,083.75	-4,298,761.25
	+5%	4,044,083.75	4,298,761.25

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 6 月 30 日
第一层次	78,902,890.29
第二层次	10,280.00
第三层次	29,688.23
合计	78,942,858.52

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

截至 2024 年 6 月 30 日止，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 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。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	78,942,858.52	94.90
	其中：股票	78,942,858.52	94.90
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	3,846,765.75	4.62
8	其他各项资产	394,753.95	0.47
9	合计	83,184,378.22	100.00

注：股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	341,113.00	0.41
B	采矿业	368,949.00	0.45
C	制造业	57,124,886.28	69.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,330,375.00	2.82
E	建筑业	743,548.00	0.90

F	批发和零售业	2,955,178.60	3.58
G	交通运输、仓储和邮政业	1,561,455.30	1.89
H	住宿和餐饮业	279,679.00	0.34
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,266,851.48	7.59
J	金融业	234,403.00	0.28
K	房地产业	1,621,512.00	1.96
L	租赁和商务服务业	1,837,251.20	2.22
M	科学研究和技术服务业	642,717.46	0.78
N	水利、环境和公共设施管理业	1,267,219.00	1.53
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	294,991.00	0.36
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	842,361.20	1.02
S	综合	229,752.00	0.28
	合计	78,942,242.52	95.56

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	002947	恒铭达	15,700	552,640.00	0.67
2	002106	莱宝高科	36,700	400,030.00	0.48
3	002039	黔源电力	21,900	385,440.00	0.47
4	002379	宏创控股	65,000	380,900.00	0.46
5	000900	现代投资	95,500	349,530.00	0.42
6	002833	弘亚数控	19,000	346,560.00	0.42
7	002707	众信旅游	57,900	332,346.00	0.40
8	002971	和远气体	13,400	332,052.00	0.40
9	600851	海欣股份	71,800	328,126.00	0.40
10	000531	穗恒运 A	60,800	325,280.00	0.39
11	600429	三元股份	85,700	319,661.00	0.39
12	002845	同兴达	23,900	315,958.00	0.38
13	603239	浙江仙通	22,800	312,588.00	0.38
14	002937	兴瑞科技	13,200	307,692.00	0.37
15	603681	永冠新材	24,100	307,275.00	0.37
16	002935	天奥电子	25,420	307,073.60	0.37
17	000631	顺发恒业	130,000	304,200.00	0.37
18	300048	合康新能	65,500	303,265.00	0.37
19	300441	鲍斯股份	50,200	297,686.00	0.36
20	300708	聚灿光电	32,700	294,300.00	0.36
21	002540	亚太科技	55,400	293,066.00	0.35
22	603949	雪龙集团	25,400	286,004.00	0.35
23	002093	国脉科技	46,600	282,862.00	0.34

24	002449	国星光电	39,700	282,664.00	0.34
25	603867	新化股份	11,800	275,294.00	0.33
26	603158	腾龙股份	38,900	273,856.00	0.33
27	002376	新北洋	50,800	273,812.00	0.33
28	300522	世名科技	24,500	270,725.00	0.33
29	603367	辰欣药业	19,400	270,436.00	0.33
30	603590	康辰药业	10,400	265,616.00	0.32
31	002666	德联集团	72,900	263,898.00	0.32
32	002880	卫光生物	9,400	263,388.00	0.32
33	688510	航亚科技	14,202	261,458.82	0.32
34	000973	佛塑科技	70,700	260,883.00	0.32
35	002140	东华科技	33,500	259,625.00	0.31
36	601500	通用股份	48,600	259,524.00	0.31
37	000551	创元科技	29,700	259,281.00	0.31
38	002787	华源控股	38,300	258,908.00	0.31
39	688519	南亚新材	10,091	258,026.87	0.31
40	600300	维维股份	106,600	255,840.00	0.31
41	002282	博深股份	39,600	253,044.00	0.31
42	002543	万和电气	25,400	252,984.00	0.31
43	002161	远望谷	54,700	252,714.00	0.31
44	003028	振邦智能	7,000	252,420.00	0.31
45	300872	天阳科技	19,000	251,750.00	0.30
46	300439	美康生物	27,100	248,236.00	0.30
47	601700	风范股份	56,400	247,596.00	0.30
48	300488	恒锋工具	12,100	246,235.00	0.30
49	300802	矩子科技	15,600	246,012.00	0.30
50	300559	佳发教育	25,500	244,035.00	0.30
51	002988	豪美新材	15,700	240,995.00	0.29
52	002380	科远智慧	13,100	239,730.00	0.29
53	603738	泰晶科技	17,400	237,336.00	0.29
54	300571	平治信息	11,300	236,622.00	0.29
55	002017	东信和平	28,200	234,906.00	0.28
56	600053	九鼎投资	16,900	234,403.00	0.28
57	603855	华荣股份	10,600	234,366.00	0.28
58	603969	银龙股份	47,100	233,616.00	0.28
59	000523	红棉股份	89,100	230,769.00	0.28
60	300011	鼎汉技术	46,000	229,540.00	0.28
61	000576	甘化科工	38,200	229,200.00	0.28
62	002111	威海广泰	21,800	227,156.00	0.27
63	600081	东风科技	25,600	224,000.00	0.27
64	000920	沃顿科技	30,500	223,565.00	0.27
65	002082	万邦德	53,000	223,130.00	0.27
66	688300	联瑞新材	4,624	222,414.40	0.27

67	300797	钢研纳克	24,000	222,240.00	0.27
68	603727	博迈科	16,800	221,088.00	0.27
69	000045	深纺织 A	27,500	220,550.00	0.27
70	002358	森源电气	63,800	218,196.00	0.26
71	300566	激智科技	15,400	215,446.00	0.26
72	300453	三鑫医疗	33,700	215,343.00	0.26
73	600237	铜峰电子	41,200	215,064.00	0.26
74	002441	众业达	28,200	213,756.00	0.26
75	002664	信质集团	17,900	213,010.00	0.26
76	300870	欧陆通	4,900	212,562.00	0.26
77	002322	理工能科	13,200	211,464.00	0.26
78	002189	中光学	15,100	210,494.00	0.25
79	002876	三利谱	8,700	209,844.00	0.25
80	002722	物产金轮	18,400	207,920.00	0.25
81	002026	山东威达	25,000	207,500.00	0.25
82	002398	垒知集团	54,600	203,112.00	0.25
83	300504	天邑股份	16,600	202,354.00	0.24
84	300174	元力股份	14,800	202,020.00	0.24
85	002515	金字火腿	52,700	199,733.00	0.24
86	300193	佳士科技	26,700	198,114.00	0.24
87	300707	威唐工业	16,000	198,080.00	0.24
88	002344	海宁皮城	64,300	196,758.00	0.24
89	002522	浙江众成	62,200	196,552.00	0.24
90	603399	吉翔股份	31,500	194,985.00	0.24
91	603520	司太立	20,400	194,616.00	0.24
92	600020	中原高速	54,500	192,930.00	0.23
93	002462	嘉事堂	17,400	190,356.00	0.23
94	600184	光电股份	22,200	188,922.00	0.23
95	000782	恒申新材	42,900	187,044.00	0.23
96	603516	淳中科技	5,900	186,263.00	0.23
97	603633	徕木股份	23,500	185,885.00	0.23
98	600525	长园集团	43,600	185,736.00	0.22
99	600327	大东方	58,000	185,600.00	0.22
100	000036	华联控股	57,200	185,328.00	0.22
101	688003	天准科技	5,647	184,995.72	0.22
102	603856	东宏股份	18,000	183,240.00	0.22
103	002480	新筑股份	58,700	183,144.00	0.22
104	603380	易德龙	9,100	182,728.00	0.22
105	605068	明新旭腾	13,700	180,566.00	0.22
106	300279	和晶科技	42,900	178,893.00	0.22
107	300493	润欣科技	22,100	178,789.00	0.22
108	600980	北矿科技	13,700	178,511.00	0.22
109	002686	亿利达	42,400	177,656.00	0.22

110	000544	中原环保	22,400	176,288.00	0.21
111	002164	宁波东力	45,400	174,336.00	0.21
112	603558	健盛集团	17,500	174,125.00	0.21
113	000419	通程控股	42,400	173,416.00	0.21
114	600152	维科技术	35,800	171,840.00	0.21
115	300095	华伍股份	31,100	171,361.00	0.21
116	603015	弘讯科技	22,300	168,588.00	0.20
117	002662	京威股份	55,400	168,416.00	0.20
118	002083	孚日股份	39,500	167,085.00	0.20
119	002577	雷柏科技	13,500	166,995.00	0.20
120	002107	沃华医药	42,400	166,632.00	0.20
121	002765	蓝黛科技	35,430	166,521.00	0.20
122	600794	保税科技	52,500	166,425.00	0.20
123	000880	潍柴重机	20,800	166,192.00	0.20
124	603686	福龙马	21,800	166,116.00	0.20
125	600694	大商股份	9,860	165,746.60	0.20
126	300625	三雄极光	15,800	165,742.00	0.20
127	002659	凯文教育	50,500	165,135.00	0.20
128	688550	瑞联新材	7,111	164,904.09	0.20
129	688233	神工股份	8,544	164,642.88	0.20
130	300485	赛升药业	26,800	164,552.00	0.20
131	688138	清溢光电	7,624	163,916.00	0.20
132	000926	福星股份	51,500	163,255.00	0.20
133	002369	卓翼科技	44,200	163,098.00	0.20
134	002538	司尔特	36,400	163,072.00	0.20
135	603266	天龙股份	9,500	160,740.00	0.19
136	300245	天玑科技	29,600	158,952.00	0.19
137	603676	卫信康	19,800	158,598.00	0.19
138	600308	华泰股份	50,500	158,570.00	0.19
139	300435	中泰股份	13,400	157,718.00	0.19
140	300791	仙乐健康	6,230	156,996.00	0.19
141	603917	合力科技	14,500	156,890.00	0.19
142	603630	拉芳家化	14,900	156,599.00	0.19
143	300396	迪瑞医疗	7,700	156,387.00	0.19
144	688566	吉贝尔	6,945	156,262.50	0.19
145	603618	杭电股份	35,500	155,490.00	0.19
146	300565	科信技术	15,400	154,770.00	0.19
147	300211	亿通科技	29,200	154,468.00	0.19
148	603387	基蛋生物	19,900	154,424.00	0.19
149	300440	运达科技	29,400	154,350.00	0.19
150	600292	远达环保	32,900	154,301.00	0.19
151	002860	星帅尔	18,700	153,153.00	0.19
152	002406	远东传动	31,000	152,830.00	0.19

153	002953	日丰股份	19,490	152,801.60	0.18
154	600897	厦门空港	12,100	152,581.00	0.18
155	300025	华星创业	14,500	152,540.00	0.18
156	002823	凯中精密	12,500	152,500.00	0.18
157	002788	鹭燕医药	19,300	152,084.00	0.18
158	300688	创业黑马	6,100	151,280.00	0.18
159	002933	新兴装备	6,600	151,206.00	0.18
160	000570	苏常柴 A	33,800	151,086.00	0.18
161	000530	冰山冷热	41,700	150,954.00	0.18
162	600105	永鼎股份	40,300	149,916.00	0.18
163	002491	通鼎互联	44,300	149,734.00	0.18
164	603897	长城科技	8,500	149,175.00	0.18
165	600590	泰豪科技	39,100	148,971.00	0.18
166	002917	金奥博	16,700	148,296.00	0.18
167	300472	新元科技	33,400	147,962.00	0.18
168	603977	国泰集团	14,500	147,465.00	0.18
169	002790	瑞尔特	16,300	147,189.00	0.18
170	002730	电光科技	20,900	147,136.00	0.18
171	002878	元隆雅图	11,700	147,069.00	0.18
172	688699	明微电子	4,622	146,748.50	0.18
173	002469	三维化学	25,600	145,920.00	0.18
174	000558	莱茵体育	68,100	145,734.00	0.18
175	002095	生意宝	11,900	145,656.00	0.18
176	300112	万讯自控	21,100	145,590.00	0.18
177	600987	航民股份	20,600	145,436.00	0.18
178	603703	盛洋科技	14,500	145,435.00	0.18
179	000501	武商集团	21,800	145,406.00	0.18
180	603258	电魂网络	9,000	145,350.00	0.18
181	002571	德力股份	29,700	144,639.00	0.18
182	000042	中洲控股	36,600	144,570.00	0.18
183	000633	合金投资	36,500	143,810.00	0.17
184	601616	广电电气	49,400	143,754.00	0.17
185	300248	新开普	22,100	143,429.00	0.17
186	300331	苏大维格	8,900	143,112.00	0.17
187	600278	东方创业	26,600	142,842.00	0.17
188	603701	德宏股份	13,500	142,830.00	0.17
189	300414	中光防雷	21,600	142,776.00	0.17
190	603817	海峡环保	29,900	142,324.00	0.17
191	002527	新时达	23,700	141,963.00	0.17
192	600526	菲达环保	38,200	141,722.00	0.17
193	605299	舒华体育	17,400	141,288.00	0.17
194	688369	致远互联	8,963	140,987.99	0.17
195	002286	保龄宝	25,500	140,505.00	0.17

196	688365	光云科技	23,281	140,151.62	0.17
197	600379	宝光股份	16,900	140,101.00	0.17
198	000532	华金资本	11,600	139,896.00	0.17
199	002186	全聚德	16,300	139,691.00	0.17
200	688579	山大地纬	17,683	138,811.55	0.17
201	688588	凌志软件	20,230	138,575.50	0.17
202	000055	方大集团	39,500	138,250.00	0.17
203	000548	湖南投资	34,300	137,886.00	0.17
204	300631	久吾高科	7,200	137,880.00	0.17
205	603199	九华旅游	4,600	137,080.00	0.17
206	603318	水发燃气	24,200	136,972.00	0.17
207	300519	新光药业	12,600	136,710.00	0.17
208	002333	罗普斯金	25,400	136,398.00	0.17
209	002040	南京港	24,900	135,954.00	0.16
210	300005	探路者	27,100	135,771.00	0.16
211	002955	鸿合科技	5,800	135,604.00	0.16
212	603315	福鞍股份	14,200	135,468.00	0.16
213	300681	英搏尔	10,350	134,964.00	0.16
214	002073	软控股份	18,200	134,498.00	0.16
215	300589	江龙船艇	11,277	133,970.76	0.16
216	601566	九牧王	15,900	133,878.00	0.16
217	600513	联环药业	16,500	133,815.00	0.16
218	002137	实益达	28,000	133,280.00	0.16
219	605066	天正电气	23,925	133,262.25	0.16
220	600226	亨通股份	67,600	133,172.00	0.16
221	600846	同济科技	19,400	132,502.00	0.16
222	300259	新天科技	52,300	132,319.00	0.16
223	300622	博士眼镜	10,800	131,436.00	0.16
224	002132	恒星科技	61,800	131,016.00	0.16
225	300176	派生科技	29,700	130,977.00	0.16
226	300225	金力泰	26,600	130,606.00	0.16
227	300532	今天国际	10,600	130,274.00	0.16
228	002623	亚玛顿	7,800	129,714.00	0.16
229	000541	佛山照明	26,500	129,055.00	0.16
230	603178	圣龙股份	6,000	128,580.00	0.16
231	002362	汉王科技	7,700	128,205.00	0.16
232	600693	东百集团	45,500	127,855.00	0.15
233	688080	映翰通	4,210	127,689.30	0.15
234	300340	科恒股份	18,500	127,650.00	0.15
235	002393	力生制药	8,060	127,428.60	0.15
236	002940	昂利康	8,800	127,424.00	0.15
237	300241	瑞丰光电	31,000	127,100.00	0.15
238	600819	耀皮玻璃	30,100	127,022.00	0.15

239	002760	凤形股份	9,600	126,720.00	0.15
240	300561	汇金科技	15,700	126,542.00	0.15
241	002290	禾盛新材	9,500	126,540.00	0.15
242	688058	宝兰德	6,050	126,021.50	0.15
243	600558	大西洋	35,000	126,000.00	0.15
244	002852	道道全	17,400	125,280.00	0.15
245	603138	海量数据	11,900	124,712.00	0.15
246	002695	煌上煌	18,900	122,661.00	0.15
247	002451	摩恩电气	22,800	122,436.00	0.15
248	300399	天利科技	13,900	122,181.00	0.15
249	002454	松芝股份	21,800	121,862.00	0.15
250	002887	绿茵生态	18,700	121,737.00	0.15
251	688077	大地熊	7,686	121,669.38	0.15
252	300508	维宏股份	6,200	120,466.00	0.15
253	002386	天原股份	31,500	120,330.00	0.15
254	603330	天洋新材	25,100	120,229.00	0.15
255	300320	海达股份	14,700	119,952.00	0.15
256	000698	沈阳化工	39,400	119,776.00	0.14
257	600613	神奇制药	22,300	119,305.00	0.14
258	000533	顺钠股份	36,200	119,098.00	0.14
259	002825	纳尔股份	19,100	118,993.00	0.14
260	002644	佛慈制药	18,500	118,770.00	0.14
261	603189	网达软件	10,800	118,152.00	0.14
261	603507	振江股份	3,600	118,152.00	0.14
263	002923	润都股份	12,700	117,602.00	0.14
264	688678	福立旺	10,853	117,537.99	0.14
265	002255	海陆重工	23,900	116,871.00	0.14
266	603186	华正新材	4,900	116,522.00	0.14
267	300173	福能东方	30,900	116,493.00	0.14
268	300515	三德科技	11,800	116,466.00	0.14
269	300375	鹏翎股份	30,000	116,100.00	0.14
270	002478	常宝股份	23,200	115,536.00	0.14
271	600114	东睦股份	8,000	115,120.00	0.14
272	300842	帝科股份	2,960	114,848.00	0.14
273	600551	时代出版	16,140	114,271.20	0.14
274	688313	仕佳光子	12,003	114,268.56	0.14
275	000505	京粮控股	21,000	114,240.00	0.14
276	002628	成都路桥	59,000	113,870.00	0.14
277	002066	瑞泰科技	14,300	113,685.00	0.14
278	603040	新坐标	5,700	113,601.00	0.14
279	300569	天能重工	27,300	113,568.00	0.14
280	603309	维力医疗	10,300	113,403.00	0.14
281	603012	创力集团	25,400	113,284.00	0.14

282	000593	德龙汇能	24,300	113,238.00	0.14
283	002479	富春环保	31,900	112,288.00	0.14
284	605377	华旺科技	8,420	111,565.00	0.14
285	000509	华塑控股	43,400	111,538.00	0.14
286	300664	鹏鹞环保	25,000	111,250.00	0.13
287	002570	贝因美	47,500	111,150.00	0.13
288	300380	安硕信息	7,200	110,592.00	0.13
289	002150	通润装备	9,000	110,070.00	0.13
290	002885	京泉华	10,200	109,956.00	0.13
291	603096	新经典	6,500	109,850.00	0.13
292	605199	葫芦娃	11,200	109,200.00	0.13
293	000931	中关村	30,900	109,077.00	0.13
294	002877	智能自控	14,500	107,155.00	0.13
295	688228	开普云	2,808	107,153.28	0.13
296	002858	力盛体育	10,300	107,120.00	0.13
297	300448	浩云科技	25,500	106,845.00	0.13
298	002863	今飞凯达	26,100	106,227.00	0.13
299	688168	安博通	3,923	105,528.70	0.13
300	002510	天汽模	27,100	105,419.00	0.13
301	603648	畅联股份	13,300	105,336.00	0.13
302	000607	华媒控股	34,000	105,060.00	0.13
303	002975	博杰股份	3,500	104,580.00	0.13
304	002169	智光电气	23,700	104,517.00	0.13
305	000534	万泽股份	10,500	104,265.00	0.13
306	603538	美诺华	9,318	104,082.06	0.13
307	300195	长荣股份	24,600	103,074.00	0.12
308	002300	太阳电缆	19,500	102,960.00	0.12
309	603053	成都燃气	10,600	102,396.00	0.12
310	002905	金逸影视	16,500	102,300.00	0.12
311	002817	黄山胶囊	19,100	101,994.00	0.12
312	603987	康德莱	16,600	101,426.00	0.12
313	600880	博瑞传播	26,900	101,144.00	0.12
314	002301	齐心集团	20,600	99,498.00	0.12
315	603050	科林电气	4,100	99,466.00	0.12
316	603777	来伊份	10,600	99,322.00	0.12
317	300378	鼎捷软件	6,100	99,247.00	0.12
318	300250	初灵信息	9,100	99,190.00	0.12
319	002980	华盛昌	4,500	98,505.00	0.12
320	300426	唐德影视	14,500	98,310.00	0.12
321	000635	英力特	16,800	98,280.00	0.12
322	603578	三星新材	8,100	98,010.00	0.12
323	600468	百利电气	22,700	97,837.00	0.12
324	603200	上海洗霸	4,700	97,666.00	0.12

325	002342	巨力索具	33,900	97,632.00	0.12
326	002729	好利科技	10,500	97,440.00	0.12
327	600829	人民同泰	17,300	97,053.00	0.12
328	300131	英唐智控	21,800	97,010.00	0.12
329	300835	龙磁科技	3,300	95,865.00	0.12
330	600730	中国高科	24,000	95,760.00	0.12
331	002915	中欣氟材	9,600	95,520.00	0.12
332	002786	银宝山新	11,900	95,438.00	0.12
333	688179	阿拉丁	9,853	95,278.51	0.12
334	002546	新联电子	29,200	94,900.00	0.11
335	002598	山东章鼓	12,700	94,234.00	0.11
336	605366	宏柏新材	16,200	94,122.00	0.11
337	600713	南京医药	22,300	94,106.00	0.11
338	000655	金岭矿业	17,000	94,010.00	0.11
339	000011	深物业 A	12,000	92,880.00	0.11
340	300608	思特奇	10,300	92,494.00	0.11
341	002187	广百股份	22,100	91,273.00	0.11
342	002133	广宇集团	40,900	91,207.00	0.11
343	605005	合兴股份	5,700	90,972.00	0.11
344	300286	安科瑞	4,200	90,888.00	0.11
345	002284	亚太股份	13,400	90,584.00	0.11
346	300790	宇瞳光学	6,700	90,450.00	0.11
347	000833	粤桂股份	19,200	89,856.00	0.11
348	002922	伊戈尔	4,100	89,626.00	0.11
349	603859	能科科技	4,220	88,704.40	0.11
350	002907	华森制药	7,000	88,340.00	0.11
351	601007	金陵饭店	13,800	87,768.00	0.11
352	300391	长药控股	37,800	87,318.00	0.11
353	300909	汇创达	3,900	87,126.00	0.11
354	300318	博晖创新	17,800	86,864.00	0.11
355	300179	四方达	13,100	86,591.00	0.10
356	300531	优博讯	8,300	86,486.00	0.10
357	603639	海利尔	7,100	86,407.00	0.10
358	600790	轻纺城	26,800	86,296.00	0.10
359	301028	东亚机械	9,800	85,946.00	0.10
360	002969	嘉美包装	30,100	85,785.00	0.10
361	300328	宜安科技	20,000	85,600.00	0.10
362	603496	恒为科技	3,500	85,575.00	0.10
363	600359	新农开发	15,300	85,527.00	0.10
364	002553	南方精工	9,200	85,284.00	0.10
365	000755	山西高速	20,400	85,272.00	0.10
366	688488	艾迪药业	8,258	84,396.76	0.10
367	002117	东港股份	11,900	84,252.00	0.10

368	605208	永茂泰	13,500	84,105.00	0.10
369	688595	芯海科技	2,787	83,610.00	0.10
370	601999	出版传媒	15,900	82,998.00	0.10
371	002084	海鸥住工	33,810	82,834.50	0.10
372	002630	华西能源	38,900	82,468.00	0.10
373	000753	漳州发展	29,300	82,333.00	0.10
374	600619	海立股份	15,900	82,203.00	0.10
375	603028	赛福天	14,500	81,635.00	0.10
376	603912	佳力图	13,600	81,600.00	0.10
377	002536	飞龙股份	8,500	80,920.00	0.10
378	600982	宁波能源	22,500	80,325.00	0.10
379	000812	陕西金叶	22,300	80,057.00	0.10
380	300686	智动力	11,000	79,750.00	0.10
381	600605	汇通能源	3,200	79,616.00	0.10
382	002364	中恒电气	14,440	79,420.00	0.10
383	603329	上海雅仕	7,200	79,344.00	0.10
384	603982	泉峰汽车	9,900	79,200.00	0.10
385	600638	新黄浦	21,000	79,170.00	0.10
386	300326	凯利泰	20,700	78,660.00	0.10
387	688377	迪威尔	5,980	78,338.00	0.09
388	002483	润邦股份	17,300	78,023.00	0.09
389	000068	华控赛格	28,600	77,220.00	0.09
390	300615	欣天科技	8,000	76,560.00	0.09
391	002303	美盈森	31,700	76,397.00	0.09
392	002448	中原内配	13,300	76,342.00	0.09
393	688589	力合微	2,976	75,024.96	0.09
394	300800	力合科技	7,200	74,592.00	0.09
395	003016	欣贺股份	11,900	74,494.00	0.09
396	600488	津药药业	21,700	74,431.00	0.09
397	605018	长华集团	8,200	74,292.00	0.09
398	688010	福光股份	4,733	73,692.81	0.09
399	688025	杰普特	1,806	72,944.34	0.09
400	300864	南大环境	3,700	72,520.00	0.09
401	002412	汉森制药	14,000	72,380.00	0.09
402	600476	湘邮科技	6,000	72,000.00	0.09
403	600892	大晟文化	17,800	71,912.00	0.09
404	000892	欢瑞世纪	28,600	71,500.00	0.09
405	300771	智莱科技	8,100	71,199.00	0.09
406	603617	君禾股份	12,000	70,800.00	0.09
407	600716	凤凰股份	27,000	70,740.00	0.09
408	000919	金陵药业	11,300	70,738.00	0.09
409	002749	国光股份	4,700	70,688.00	0.09
410	605050	福然德	8,000	70,480.00	0.09

411	002181	粤传媒	21,800	70,414.00	0.09
412	600658	电子城	21,400	70,406.00	0.09
413	300698	万马科技	2,000	70,260.00	0.09
414	603508	思维列控	3,700	69,375.00	0.08
415	002658	雪迪龙	13,500	69,255.00	0.08
416	002835	同为股份	4,100	69,249.00	0.08
417	688258	卓易信息	2,065	68,971.00	0.08
418	603668	天马科技	6,060	68,781.00	0.08
419	300061	旗天科技	15,300	68,544.00	0.08
420	300018	中元股份	14,900	68,540.00	0.08
421	603081	大丰实业	7,300	68,036.00	0.08
422	002671	龙泉股份	18,900	67,851.00	0.08
423	300149	睿智医药	17,100	67,716.00	0.08
424	600540	新赛股份	19,700	67,177.00	0.08
425	002388	新亚制程	21,300	67,095.00	0.08
426	300247	融捷健康	27,600	67,068.00	0.08
427	688078	龙软科技	2,909	66,994.27	0.08
428	688135	利扬芯片	4,180	66,963.60	0.08
429	002908	德生科技	8,700	66,729.00	0.08
430	002824	和胜股份	5,200	66,352.00	0.08
431	603217	元利科技	4,700	66,270.00	0.08
432	300437	清水源	8,200	66,092.00	0.08
433	603800	道森股份	3,300	66,000.00	0.08
434	001208	华菱线缆	8,700	65,946.00	0.08
435	300345	华民股份	10,700	65,591.00	0.08
436	300978	东箭科技	7,100	65,533.00	0.08
437	603758	秦安股份	8,600	65,360.00	0.08
438	001207	联科科技	4,500	65,340.00	0.08
439	300230	永利股份	19,400	65,184.00	0.08
440	603213	镇洋发展	8,700	65,076.00	0.08
441	300997	欢乐家	5,500	65,010.00	0.08
442	002616	长青集团	15,000	64,800.00	0.08
443	300231	银信科技	8,800	64,680.00	0.08
444	603421	鼎信通讯	14,500	64,670.00	0.08
445	002062	宏润建设	18,500	64,380.00	0.08
446	600894	广日股份	5,500	63,250.00	0.08
447	688095	福昕软件	1,375	62,988.75	0.08
448	600035	楚天高速	14,600	62,634.00	0.08
449	300389	艾比森	5,100	62,628.00	0.08
450	688378	奥来德	2,665	62,520.90	0.08
451	000612	焦作万方	9,600	62,400.00	0.08
452	603256	宏和科技	8,800	62,128.00	0.08
453	000589	贵州轮胎	12,200	61,854.00	0.07

454	002634	棒杰股份	17,200	61,748.00	0.07
455	603076	乐惠国际	2,900	61,741.00	0.07
456	300605	恒锋信息	6,800	61,608.00	0.07
457	605555	德昌股份	3,300	61,413.00	0.07
458	300774	倍杰特	9,400	61,382.00	0.07
459	300553	集智股份	2,500	61,225.00	0.07
460	603088	宁波精达	8,100	60,993.00	0.07
461	002365	永安药业	8,400	60,648.00	0.07
462	002866	传艺科技	4,700	60,489.00	0.07
463	600769	祥龙电业	9,600	60,384.00	0.07
464	002679	福建金森	8,700	60,291.00	0.07
465	600198	大唐电信	11,700	60,255.00	0.07
466	603908	牧高笛	3,000	60,180.00	0.07
467	300612	宣亚国际	4,600	59,892.00	0.07
468	300805	电声股份	9,400	59,784.00	0.07
469	600860	京城股份	7,400	59,718.00	0.07
470	603933	睿能科技	4,600	59,156.00	0.07
471	600510	黑牡丹	15,900	59,148.00	0.07
472	301149	隆华新材	6,400	59,136.00	0.07
473	600354	敦煌种业	12,300	58,671.00	0.07
474	002035	华帝股份	9,400	58,562.00	0.07
475	600222	太龙药业	13,900	58,380.00	0.07
476	300436	广生堂	3,700	58,127.00	0.07
477	002573	清新环境	15,000	58,050.00	0.07
478	300490	华自科技	8,100	57,996.00	0.07
479	300349	金卡智能	4,800	57,216.00	0.07
480	003015	日久光电	6,300	57,204.00	0.07
481	002758	浙农股份	7,300	57,086.00	0.07
482	000788	北大医药	11,400	56,886.00	0.07
483	300403	汉宇集团	8,300	56,689.00	0.07
484	301102	兆讯传媒	4,800	56,592.00	0.07
485	002381	双箭股份	8,400	56,364.00	0.07
486	300940	南极光	4,400	56,056.00	0.07
487	301116	益客食品	6,200	55,366.00	0.07
488	002375	亚厦股份	17,000	55,250.00	0.07
489	002660	茂硕电源	7,400	54,908.00	0.07
490	002148	北纬科技	11,800	54,870.00	0.07
491	603999	读者传媒	11,600	54,868.00	0.07
492	002392	北京利尔	17,400	54,810.00	0.07
493	000707	双环科技	8,000	54,720.00	0.07
494	600866	星湖科技	9,900	54,648.00	0.07
495	300465	高伟达	7,500	54,525.00	0.07
496	301280	珠城科技	1,400	54,320.00	0.07

497	603206	嘉环科技	4,300	54,309.00	0.07
498	300560	中富通	5,000	54,100.00	0.07
499	601956	东贝集团	11,800	54,044.00	0.07
500	605136	丽人丽妆	9,800	53,998.00	0.07
501	002593	日上集团	16,800	53,760.00	0.07
502	603095	越剑智能	4,100	53,751.00	0.07
503	603811	诚意药业	8,600	53,750.00	0.07
504	605118	力鼎光电	3,600	53,604.00	0.06
505	002952	亚世光电	2,600	53,430.00	0.06
506	605016	百龙创园	2,600	52,962.00	0.06
506	300752	隆利科技	3,900	52,962.00	0.06
508	300501	海顺新材	4,900	52,822.00	0.06
509	605198	安德利	2,000	52,800.00	0.06
510	600796	钱江生化	12,100	52,756.00	0.06
511	002360	同德化工	10,400	52,624.00	0.06
512	601339	百隆东方	10,100	52,621.00	0.06
513	300795	米奥会展	3,000	52,590.00	0.06
514	002768	国恩股份	2,800	52,360.00	0.06
515	600284	浦东建设	9,800	52,332.00	0.06
516	603708	家家悦	6,400	51,904.00	0.06
517	002580	圣阳股份	8,400	51,660.00	0.06
518	002983	芯瑞达	3,059	50,932.35	0.06
519	688560	明冠新材	4,780	50,907.00	0.06
520	300275	梅安森	5,100	50,847.00	0.06
521	600665	天地源	22,900	50,838.00	0.06
522	002694	顾地科技	13,200	50,820.00	0.06
523	688299	长阳科技	3,960	50,648.40	0.06
524	000026	飞亚达	5,700	50,217.00	0.06
525	002636	金安国纪	7,900	50,165.00	0.06
526	300219	鸿利智汇	8,900	49,751.00	0.06
527	300354	东华测试	1,600	49,712.00	0.06
528	600664	哈药股份	18,800	49,632.00	0.06
529	301330	熵基科技	2,200	49,456.00	0.06
530	002766	索菱股份	10,200	49,368.00	0.06
531	603698	航天工程	4,100	49,077.00	0.06
532	603948	建业股份	3,000	48,840.00	0.06
533	688357	建龙微纳	2,060	47,998.00	0.06
534	300512	中亚股份	8,100	47,952.00	0.06
535	603689	皖天然气	5,800	47,676.00	0.06
535	605388	均瑶健康	8,700	47,676.00	0.06
537	002981	朝阳科技	2,600	47,606.00	0.06
538	301020	密封科技	3,000	47,460.00	0.06
539	300227	光韵达	8,600	47,042.00	0.06

540	603110	东方材料	4,200	46,746.00	0.06
541	600784	鲁银投资	9,800	46,452.00	0.06
542	688496	清越科技	5,015	46,338.60	0.06
543	301279	金道科技	1,900	46,322.00	0.06
544	688150	莱特光电	2,384	46,249.60	0.06
545	300377	赢时胜	9,100	46,228.00	0.06
546	002838	道恩股份	5,100	46,206.00	0.06
547	603629	利通电子	2,500	46,150.00	0.06
548	000407	胜利股份	17,600	45,936.00	0.06
549	603359	东珠生态	12,600	45,738.00	0.06
550	603711	香飘飘	3,300	45,705.00	0.06
551	300996	普联软件	3,100	45,477.00	0.06
552	000912	泸天化	13,100	45,457.00	0.06
553	301256	华融化学	7,400	45,436.00	0.06
554	300968	格林精密	4,900	45,374.00	0.05
555	002642	荣联科技	8,700	44,892.00	0.05
556	603579	荣泰健康	2,900	44,834.00	0.05
557	300120	经纬辉开	8,600	44,634.00	0.05
558	301185	鸥玛软件	3,100	44,423.00	0.05
559	600609	金杯汽车	12,700	44,069.00	0.05
560	002519	银河电子	8,800	43,208.00	0.05
561	300543	朗科智能	5,400	43,200.00	0.05
562	002160	常铝股份	15,900	43,089.00	0.05
563	000524	岭南控股	5,300	42,718.00	0.05
564	300546	雄帝科技	3,700	42,624.00	0.05
565	000153	丰原药业	7,800	41,964.00	0.05
566	600617	国新能源	16,780	41,950.00	0.05
567	002225	濮耐股份	10,100	41,309.00	0.05
568	300154	瑞凌股份	7,600	40,508.00	0.05
569	300709	精研科技	1,600	40,448.00	0.05
570	301062	上海艾录	3,900	39,819.00	0.05
571	000949	新乡化纤	11,700	39,780.00	0.05
572	002104	恒宝股份	7,500	39,600.00	0.05
573	603967	中创物流	4,200	39,060.00	0.05
574	002224	三力士	10,100	38,885.00	0.05
575	601089	福元医药	2,800	38,780.00	0.05
576	002238	天威视讯	4,900	38,465.00	0.05
577	002752	昇兴股份	7,600	38,456.00	0.05
578	301380	挖金客	1,200	38,448.00	0.05
579	600727	鲁北化工	6,100	38,430.00	0.05
580	603697	有友食品	6,600	38,280.00	0.05
581	300280	紫天科技	2,500	38,100.00	0.05
582	002615	哈尔斯	6,100	37,820.00	0.05

582	601518	吉林高速	15,500	37,820.00	0.05
584	000561	烽火电子	5,900	37,819.00	0.05
585	600262	北方股份	2,300	37,789.00	0.05
586	002069	獐子岛	15,600	37,752.00	0.05
587	600636	国新文化	5,000	37,500.00	0.05
588	300153	科泰电源	6,300	37,485.00	0.05
589	301169	零点有数	1,300	37,440.00	0.05
590	002688	金河生物	10,300	37,389.00	0.05
591	605218	伟时电子	2,300	37,145.00	0.04
592	603861	白云电器	4,400	36,828.00	0.04
593	300384	三联虹普	2,800	36,736.00	0.04
594	603706	东方环宇	2,500	36,625.00	0.04
595	603878	武进不锈	5,600	36,624.00	0.04
596	002578	闽发铝业	13,900	36,557.00	0.04
597	605179	一鸣食品	4,000	36,520.00	0.04
598	300194	福安药业	9,700	36,278.00	0.04
599	300145	中金环境	14,400	36,000.00	0.04
600	601020	华钰矿业	2,800	35,840.00	0.04
601	603408	建霖家居	2,700	35,613.00	0.04
602	300740	水羊股份	2,400	35,232.00	0.04
603	301391	卡莱特	800	35,024.00	0.04
604	603214	爱婴室	3,100	34,999.00	0.04
605	300381	溢多利	5,700	34,998.00	0.04
606	300878	维康药业	2,400	34,896.00	0.04
607	002873	新天药业	4,200	34,860.00	0.04
608	002059	云南旅游	7,400	34,854.00	0.04
609	603527	众源新材	4,900	34,790.00	0.04
610	300879	大叶股份	2,600	34,788.00	0.04
611	300969	恒帅股份	500	34,565.00	0.04
612	603017	中衡设计	3,900	34,554.00	0.04
613	600288	大恒科技	5,300	34,503.00	0.04
614	000897	津滨发展	16,800	34,440.00	0.04
615	300165	天瑞仪器	16,200	34,344.00	0.04
616	688226	威腾电气	1,956	34,190.88	0.04
617	605098	行动教育	800	34,096.00	0.04
618	002279	久其软件	7,800	33,618.00	0.04
619	603569	长久物流	4,900	33,614.00	0.04
620	301299	卓创资讯	800	33,600.00	0.04
621	600742	一汽富维	4,500	33,525.00	0.04
621	301160	翔楼新材	900	33,525.00	0.04
623	603101	汇嘉时代	6,800	33,524.00	0.04
624	600386	北巴传媒	12,000	33,480.00	0.04
625	002264	新华都	6,500	33,215.00	0.04

626	300908	仲景食品	1,172	32,558.16	0.04
627	688663	新风光	1,381	32,135.87	0.04
628	300950	德固特	2,100	32,004.00	0.04
628	301159	三维天地	1,200	32,004.00	0.04
630	301127	天源环保	2,700	31,914.00	0.04
631	300424	航新科技	2,600	31,798.00	0.04
632	600368	五洲交通	8,890	31,737.30	0.04
633	300972	万辰集团	1,500	31,695.00	0.04
634	001223	欧克科技	900	31,671.00	0.04
635	002196	方正电机	7,500	31,425.00	0.04
636	600054	黄山旅游	2,800	31,416.00	0.04
636	000701	厦门信达	8,400	31,416.00	0.04
638	002474	榕基软件	7,200	31,392.00	0.04
639	603551	奥普科技	3,200	31,360.00	0.04
640	002919	名臣健康	2,700	31,347.00	0.04
641	600130	波导股份	9,800	31,262.00	0.04
642	003013	地铁设计	2,200	31,196.00	0.04
643	300758	七彩化学	2,900	31,175.00	0.04
643	605399	晨光新材	2,900	31,175.00	0.04
645	002909	集泰股份	7,600	31,160.00	0.04
646	601177	杭齿前进	4,500	31,140.00	0.04
647	688509	正元地信	10,755	31,081.95	0.04
648	600640	国脉文化	3,000	31,050.00	0.04
649	301073	君亭酒店	1,700	30,940.00	0.04
650	301011	华立科技	2,000	30,820.00	0.04
651	002677	浙江美大	3,800	30,818.00	0.04
652	600135	乐凯胶片	6,300	30,744.00	0.04
653	605268	王力安防	4,300	30,659.00	0.04
654	300662	科锐国际	1,900	30,647.00	0.04
655	000852	石化机械	5,700	30,552.00	0.04
656	002298	中电兴发	6,800	30,056.00	0.04
657	301213	观想科技	1,100	30,041.00	0.04
658	002045	国光电器	2,200	29,986.00	0.04
659	301303	真兰仪表	2,600	29,952.00	0.04
660	002552	宝鼎科技	2,300	29,946.00	0.04
661	601226	华电重工	6,100	29,890.00	0.04
662	300032	金龙机电	9,600	29,856.00	0.04
663	300213	佳讯飞鸿	5,200	29,640.00	0.04
664	002689	远大智能	13,800	29,532.00	0.04
665	002547	春兴精工	12,200	29,524.00	0.04
666	603223	恒通股份	4,500	29,340.00	0.04
667	600876	凯盛新能	3,100	29,264.00	0.04
668	002667	威领股份	6,200	29,202.00	0.04

669	300307	慈星股份	4,900	29,155.00	0.04
670	600731	湖南海利	6,300	29,106.00	0.04
671	603106	恒银科技	6,800	28,968.00	0.04
672	001234	泰慕士	1,700	28,883.00	0.03
673	002296	辉煌科技	2,800	28,868.00	0.03
674	300181	佐力药业	1,900	28,728.00	0.03
675	002587	奥拓电子	5,300	28,514.00	0.03
676	603808	歌力思	4,500	28,485.00	0.03
677	600698	湖南天雁	8,400	28,476.00	0.03
677	600479	千金药业	2,800	28,476.00	0.03
679	301133	金钟股份	1,300	28,327.00	0.03
680	600736	苏州高新	6,800	28,288.00	0.03
681	600410	华胜天成	7,300	28,251.00	0.03
682	603173	福斯达	1,300	28,223.00	0.03
683	603365	水星家纺	1,800	28,170.00	0.03
684	300959	线上线下	1,000	28,110.00	0.03
685	002668	TCL 智家	3,100	28,086.00	0.03
686	002512	达华智能	8,100	27,945.00	0.03
687	300272	开能健康	5,700	27,930.00	0.03
688	001318	阳光乳业	2,700	27,783.00	0.03
689	601199	江南水务	5,700	27,759.00	0.03
690	000078	海王生物	13,000	27,560.00	0.03
691	300976	达瑞电子	600	27,510.00	0.03
692	000922	佳电股份	2,300	27,439.00	0.03
693	603336	宏辉果蔬	9,100	27,391.00	0.03
694	300016	北陆药业	6,200	27,342.00	0.03
695	002957	科瑞技术	2,000	27,120.00	0.03
696	002588	史丹利	3,600	27,108.00	0.03
697	003005	竞业达	1,300	27,092.00	0.03
698	688768	容知日新	1,157	27,085.37	0.03
699	002566	益盛药业	4,400	26,928.00	0.03
700	688468	科美诊断	4,238	26,826.54	0.03
701	301195	北路智控	900	26,766.00	0.03
702	300288	朗玛信息	2,500	26,425.00	0.03
703	301138	华研精机	1,100	26,279.00	0.03
704	000899	赣能股份	2,700	26,109.00	0.03
705	002184	海得控制	2,900	26,042.00	0.03
706	603166	福达股份	5,300	25,970.00	0.03
707	603601	再升科技	9,400	25,944.00	0.03
708	002330	得利斯	7,100	25,915.00	0.03
709	001205	盛航股份	1,600	25,856.00	0.03
710	003025	思进智能	2,100	25,851.00	0.03
711	002521	齐峰新材	2,200	25,850.00	0.03

712	688533	上声电子	999	25,844.13	0.03
713	688020	方邦股份	773	25,787.28	0.03
714	688210	统联精密	1,164	25,782.60	0.03
715	301130	西点药业	1,100	25,773.00	0.03
716	300893	松原股份	900	25,713.00	0.03
717	001283	豪鹏科技	600	25,620.00	0.03
717	001217	华尔泰	2,800	25,620.00	0.03
719	688435	英方软件	1,026	25,608.96	0.03
720	003019	宸展光电	1,000	25,330.00	0.03
721	603661	恒林股份	600	25,326.00	0.03
722	688070	纵横股份	894	25,264.44	0.03
723	605389	长龄液压	1,200	25,188.00	0.03
724	301186	超达装备	800	25,040.00	0.03
725	000411	英特集团	2,600	25,038.00	0.03
726	600738	丽尚国潮	6,800	24,956.00	0.03
727	000906	浙商中拓	3,700	24,938.00	0.03
728	301197	工大科雅	1,900	24,928.00	0.03
729	300798	锦鸡股份	4,000	24,840.00	0.03
730	603116	红蜻蜓	5,500	24,750.00	0.03
731	603211	晋拓股份	1,800	24,678.00	0.03
732	600594	益佰制药	8,200	24,600.00	0.03
733	600979	广安爱众	7,300	24,528.00	0.03
734	600071	凤凰光学	1,500	24,495.00	0.03
735	300513	恒实科技	3,000	24,450.00	0.03
736	688551	科威尔	775	24,412.50	0.03
737	605286	同力日升	1,000	24,330.00	0.03
737	301398	星源卓镁	600	24,330.00	0.03
739	301066	万事利	3,000	24,300.00	0.03
740	688292	浩瀚深度	1,569	24,256.74	0.03
741	003000	劲仔食品	2,000	24,100.00	0.03
742	000803	山高环能	6,900	24,081.00	0.03
743	600353	旭光电子	3,900	24,063.00	0.03
744	605369	拱东医疗	600	23,940.00	0.03
745	603929	亚翔集成	1,000	23,900.00	0.03
746	002972	科安达	2,600	23,816.00	0.03
747	300110	华仁药业	7,700	23,793.00	0.03
748	300578	会畅通讯	1,600	23,680.00	0.03
749	002979	雷赛智能	1,300	23,660.00	0.03
750	301051	信濠光电	900	23,607.00	0.03
751	002090	金智科技	2,700	23,328.00	0.03
752	300815	玉禾田	2,000	23,280.00	0.03
753	300962	中金辐照	1,700	23,188.00	0.03
754	300341	麦克奥迪	2,700	23,166.00	0.03

755	300840	酷特智能	2,500	23,125.00	0.03
756	601368	绿城水务	5,700	23,028.00	0.03
757	002523	天桥起重	10,700	23,005.00	0.03
758	688636	智明达	1,007	22,959.60	0.03
759	300547	川环科技	1,400	22,890.00	0.03
760	002533	金杯电工	2,300	22,885.00	0.03
761	600228	返利科技	4,700	22,842.00	0.03
762	603848	好太太	1,800	22,662.00	0.03
763	002136	安纳达	2,500	22,650.00	0.03
764	002613	北玻股份	6,500	22,620.00	0.03
765	002897	意华股份	600	22,596.00	0.03
766	301126	达嘉维康	2,500	22,575.00	0.03
767	000510	新金路	8,100	22,437.00	0.03
768	600973	宝胜股份	6,200	22,382.00	0.03
769	605228	神通科技	2,600	22,308.00	0.03
770	001268	联合精密	1,300	22,009.00	0.03
771	603966	法兰泰克	3,200	21,984.00	0.03
772	301318	维海德	800	21,976.00	0.03
773	600939	重庆建工	9,400	21,808.00	0.03
774	002014	永新股份	2,300	21,804.00	0.03
775	600173	卧龙地产	5,800	21,692.00	0.03
776	301198	喜悦智行	2,700	21,627.00	0.03
777	603998	方盛制药	2,100	21,567.00	0.03
778	600495	晋西车轴	6,700	21,507.00	0.03
779	003011	海象新材	1,600	21,456.00	0.03
780	300066	三川智慧	7,500	21,450.00	0.03
781	002420	毅昌科技	4,700	21,432.00	0.03
782	000670	盈方微	4,900	21,413.00	0.03
783	002306	中科云网	8,000	21,280.00	0.03
784	002912	中新赛克	1,200	21,264.00	0.03
785	300710	万隆光电	1,400	21,238.00	0.03
786	603203	快克智能	900	21,222.00	0.03
787	688259	创耀科技	531	21,218.76	0.03
788	600756	浪潮软件	2,100	21,210.00	0.03
789	002404	嘉欣丝绸	4,000	21,160.00	0.03
790	300365	恒华科技	4,300	21,113.00	0.03
791	600367	红星发展	2,100	20,811.00	0.03
792	603916	苏博特	3,100	20,801.00	0.03
793	002345	潮宏基	4,400	20,768.00	0.03
794	605266	健之佳	800	20,760.00	0.03
795	002177	御银股份	6,400	20,672.00	0.03
796	002029	七匹狼	4,100	20,664.00	0.03
797	601218	吉鑫科技	7,400	20,646.00	0.02

798	002589	瑞康医药	9,300	20,460.00	0.02
799	300873	海晨股份	1,400	20,412.00	0.02
800	301263	泰恩康	1,600	20,048.00	0.02
801	002803	吉宏股份	1,800	20,034.00	0.02
802	605598	上海港湾	900	19,881.00	0.02
803	002881	美格智能	1,000	19,840.00	0.02
804	301030	仕净科技	800	19,696.00	0.02
805	605058	澳弘电子	1,000	19,680.00	0.02
806	603051	鹿山新材	900	19,647.00	0.02
807	603366	日出东方	5,500	19,635.00	0.02
808	600826	兰生股份	3,640	19,583.20	0.02
809	300691	联合光电	1,300	19,565.00	0.02
810	001319	铭科精技	1,200	19,560.00	0.02
811	600628	新世界	3,600	19,512.00	0.02
812	603429	集友股份	4,700	19,505.00	0.02
813	603006	联明股份	2,000	19,460.00	0.02
814	002401	中远海科	1,300	19,422.00	0.02
815	002293	罗莱生活	2,400	19,392.00	0.02
816	601008	连云港	5,600	19,264.00	0.02
817	603890	春秋电子	2,100	19,026.00	0.02
818	002218	拓日新能	6,500	18,525.00	0.02
819	600249	两面针	5,000	18,350.00	0.02
820	002206	海利得	4,800	18,336.00	0.02
821	002551	尚荣医疗	7,800	18,174.00	0.02
822	002576	通达动力	1,600	18,160.00	0.02
823	300471	厚普股份	2,300	18,124.00	0.02
824	688371	菲沃泰	1,804	18,112.16	0.02
825	603031	安孚科技	800	18,064.00	0.02
826	300127	银河磁体	1,200	18,060.00	0.02
827	002554	惠博普	8,300	18,011.00	0.02
828	603122	合富中国	3,500	17,815.00	0.02
829	301389	隆扬电子	1,100	17,380.00	0.02
830	002022	科华生物	3,000	16,950.00	0.02
831	605580	恒盛能源	1,900	16,929.00	0.02
832	000822	山东海化	2,900	16,907.00	0.02
833	301333	诺思格	500	16,805.00	0.02
834	300875	捷强装备	900	16,623.00	0.02
835	688079	美迪凯	2,234	16,576.28	0.02
836	300053	航宇微	1,700	15,487.00	0.02
837	301150	中一科技	800	14,376.00	0.02
838	603350	安乃达	500	10,280.00	0.01
839	301538	骏鼎达	95	8,667.80	0.01
840	301536	星宸科技	209	6,744.43	0.01

841	301539	宏鑫科技	289	5,727.98	0.01
842	301587	中瑞股份	141	3,561.66	0.00
843	001389	广合科技	96	3,317.76	0.00
844	001359	平安电工	81	1,668.60	0.00
845	000836	ST 富通	43,900	-	-
845	002288	*ST 超华	6,700	-	-

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002880	卫光生物	1,331,939.00	1.43
2	002937	兴瑞科技	1,073,094.00	1.15
3	002833	弘亚数控	1,062,954.00	1.14
4	002845	同兴达	1,008,530.00	1.08
5	000531	穗恒运 A	921,493.00	0.99
6	002039	黔源电力	907,930.00	0.98
7	300708	聚灿光电	894,960.00	0.96
8	002623	亚玛顿	879,170.00	0.95
9	300857	协创数据	873,625.00	0.94
10	688699	明微电子	864,960.45	0.93
11	002947	恒铭达	864,573.00	0.93
12	300872	天阳科技	838,335.00	0.90
13	002106	莱宝高科	817,086.00	0.88
14	002393	力生制药	796,704.00	0.86
15	300617	安靠智电	751,704.00	0.81
16	002284	亚太股份	747,304.00	0.80
17	300908	仲景食品	742,577.00	0.80
18	002707	众信旅游	724,145.00	0.78
19	002462	嘉事堂	722,656.00	0.78
20	600020	中原高速	719,081.00	0.77

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002393	力生制药	1,112,908.20	1.20
2	300857	协创数据	1,111,204.00	1.20
3	002880	卫光生物	1,090,396.00	1.17
4	300708	聚灿光电	1,012,939.00	1.09

5	002327	富安娜	976,465.00	1.05
6	300617	安靠智电	966,434.00	1.04
7	002937	兴瑞科技	961,373.00	1.03
8	300908	仲景食品	941,065.08	1.01
9	002588	史丹利	923,083.00	0.99
10	300872	天阳科技	914,602.40	0.98
11	002818	富森美	900,896.00	0.97
12	000531	穗恒运 A	887,426.00	0.95
13	002533	金杯电工	882,467.00	0.95
14	000589	贵州轮胎	879,932.80	0.95
15	300161	华中数控	879,093.00	0.95
16	603878	武进不锈	859,927.00	0.92
17	002623	亚玛顿	857,044.00	0.92
18	300867	圣元环保	856,115.00	0.92
19	300566	激智科技	840,713.00	0.90
20	002039	黔源电力	829,550.00	0.89

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	290,430,943.76
卖出股票收入（成交）总额	288,585,918.60

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金为指数型基金，主要投资标的为指数成份股和备选成份股。基金留存的现金头寸根据基

金合同规定，投资于以标的指数或与标的指数相关性较高的其他指数为基础资产的股指期货，旨在配合基金日常投资管理需要，更有效地进行流动性管理，以更好地跟踪标的指数，实现投资目标。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期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。

7.12.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	394,753.95
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	394,753.95

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		华夏中证 2000ETF 发起式联接	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
1,278	75,801.25	12,415,488.00	12.82%	34,588,512.00	35.70%	49,870,000.00	51.48%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例
1	招商证券股份有限公司	4,797,286.00	4.95%
2	王少云	2,600,000.00	2.68%
3	方正证券股份有限公司	1,923,500.00	1.99%
4	海通证券股份有限公司	1,503,900.00	1.55%
5	广发证券股份有限公司	1,343,102.00	1.39%
6	国信证券股份有限公司	1,277,800.00	1.32%
7	封立勇	1,135,900.00	1.17%
8	胡瀚文	876,800.00	0.91%
9	杨雯婷	809,500.00	0.84%
10	黄珊	709,400.00	0.73%
11	招商银行股份有限公司—华夏中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	49,870,000.00	51.48%

8.3 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	-	-

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2023 年 9 月 6 日）基金份额总额	310,874,000.00
本报告期期初基金份额总额	88,874,000.00
本报告期基金总申购份额	160,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	152,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	96,874,000.00

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人及其高级管理人员在本报告期内无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中金公司	4	185,558,026.84	32.06%	75,240.57	30.68%	-
中信证券	11	175,261,052.15	30.28%	77,333.34	31.54%	-
中信建投证券	3	159,905,154.76	27.62%	66,738.15	27.21%	-
兴业证券	1	39,808,649.02	6.88%	17,751.66	7.24%	-
西部证券	1	18,310,284.00	3.16%	8,165.07	3.33%	-

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

i 经营行为规范。

ii 公司财务状况良好。

iii有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。

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

v 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

②券商专用交易单元选择程序：

i 本基金管理人根据上述标准进行评估并确定选用的券商。

ii 本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议/证券经纪服务协议。

③除本表列示外，本基金还选择了财通证券、长江证券、第一创业证券、东北证券、东吴证券、方正证券、光大证券、广发证券、国金证券、国联证券、国泰君安证券、国信证券、华泰证券、华西证券、江海证券、金元证券、联储证券、平安证券、上海证券、申万宏源证券、招商证券、中泰证券、中银国际证券的交易单元作为本基金交易单元，本报告期无股票交易及应付佣金。

④在上述租用的券商交易单元中，财通证券、方正证券、招商证券的部分交易单元、广发证券、国金证券、国信证券的交易单元为本基金本期新增的交易单元。本期没有剔除的券商交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例

中金公司	16,504.21	20.35%	-	-	-	-	-	-
中信证券	30,461.72	37.56%	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	34,130.72	42.09%	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024-03-21
2	华夏中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金新增东吴证券股份有限公司为申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024-04-16
3	华夏基金管理有限公司关于华夏中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金所持停牌股票估值调整情况的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024-06-19
4	华夏基金管理有限公司关于华夏中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金所持停牌股票估值调整情况的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024-06-28

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2024-01-01 至 2024-02-06	20,000,000.00	-	20,000,000.00	-	-
华夏中证 2000ET	1	2024-01-03 至 2024-01-01	17,330,000.00	107,204,700.00	74,664,700.00	49,870,000.00	51.48%

F 发起式 联接		7,2024-01 -24 至 2024-01-3 0,2024-02 -19 至 2024-06-3 0					
产品特有风险							
<p>本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额20%的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产，有可能对基金净值产生一定的影响，甚至可能引发基金的流动性风险。</p> <p>在特定情况下，若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平，面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p>							

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

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

华夏基金管理有限公司
二〇二四年八月三十日