

平安国证 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：平安基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 30 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 08 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告除特别注明外，金额单位均为人民币元。

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	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	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	35
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	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	54

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	54
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	55
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	55
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	55
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55
7.12 投资组合报告附注	55
§ 8 基金份额持有人信息	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
8.2 期末上市基金前十名持有人	56
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	57
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	57
§ 9 开放式基金份额变动	57
§ 10 重大事件揭示	57
10.1 基金份额持有人大会决议	57
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	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	57
10.4 基金投资策略的改变	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	57
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	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	58
10.8 其他重大事件	59
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	60
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	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	60
§ 12 备查文件目录	60
12.1 备查文件目录	60
12.2 存放地点	60
12.3 查阅方式	60

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	平安国证 2000ETF
场内简称	2000 指数 ETF
基金主代码	159521
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023 年 8 月 25 日
基金管理人	平安基金管理有限公司
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	66,274,435.00 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 7 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。在正常情况下，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。
投资策略	本基金的股票投资主要采用抽样复制标的指数。抽样复制法是在标的指数成份股权重的基础上依托量化投资方法进行股票筛选与风险控制，使用“跟踪误差最小化”的最优化方式创建目标组合，从而实现对标指数的紧密跟踪。 在正常情况下，本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值小于 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪偏离度、跟踪误差的进一步扩大。
业绩比较基准	国证 2000 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为交易型开放式指数基金，主要采用抽样复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票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		平安基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	陈特正	张姗
	联系电话	0755-22626828	400-61-95555
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		400-800-4800	400-61-95555
传真		0755-23997878	0755-83195201
注册地址		深圳市福田区福田街道益田路	深圳市深南大道 7088 号招商银

	5033 号平安金融中心 34 层	行大厦
办公地址	深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	518048	518040
法定代表人	罗春风	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	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.fund.pingan.com
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人住所

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-13,282,145.33
本期利润	-13,451,432.01
加权平均基金份额本期利润	-0.1611
本期加权平均净值利润率	-18.27%
本期基金份额净值增长率	-16.28%
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	-12,066,140.24
期末可供分配基金份额利润	-0.1821
期末基金资产净值	54,208,294.76
期末基金份额净值	0.8179
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	-18.21%

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

2. 期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，而非当期发生数）；

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

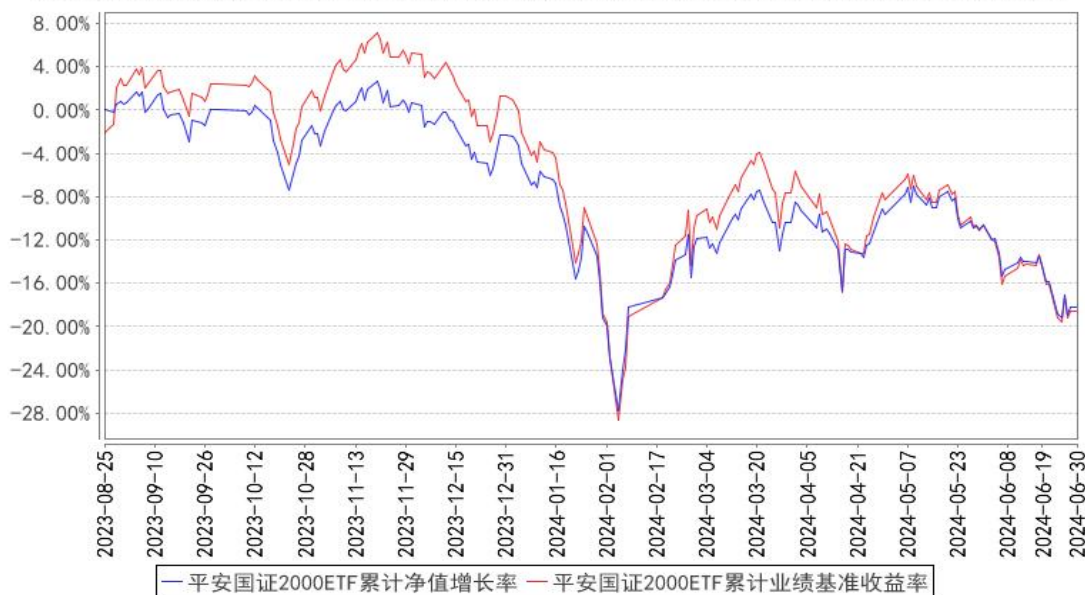
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-8.50%	1.43%	-8.98%	1.58%	0.48%	-0.15%
过去三个月	-8.68%	1.46%	-11.89%	1.68%	3.21%	-0.22%
过去六个月	-16.28%	1.85%	-19.67%	2.12%	3.39%	-0.27%
自基金合同生效起至今	-18.21%	1.54%	-18.62%	1.76%	0.41%	-0.22%

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

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



注：1、本基金基金合同于 2023 年 08 月 25 日正式生效，截至报告期末未满一年；

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

3.3 其他指标

注：本基金本报告期无其他指标。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
钱晶	ETF 指数中心投资副总监，平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金经理	2023 年 8 月 25 日	-	13 年	钱晶先生，美国纽约大学理工学院硕士。曾先后担任国信证券股份有限公司量化分析师、华安基金管理有限公司基金经理。2017 年 10 月加入平安基金管理有限公司，曾任 ETF 指数投资中心投资经理。现任 ETF 指数中心投资副总监，同时担任平安 MSCI 中国 A 股低波动交易型开放式指数证券投资基金、平安中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金、平安中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金、平安中证港股通医药卫生综合交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、平安中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金、平安中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安上证红利低波动指数型证券投资基金、平安中证汽车零部件主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

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

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

					式证券投资基金、平安中证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金、平安中证沪港深线上消费主题交易型开放式指数证券投资基金、平安中证港股通医药卫生综合交易型开放式指数证券投资基金、平安富时中国国企开放共赢交易型开放式指数证券投资基金、平安中证医药及医疗器械创新指数型发起式证券投资基金、平安中证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、平安中债-0-3 年国开行债券交易型开放式指数证券投资基金、平安中证港股通医药卫生综合交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理助理。
--	--	--	--	--	--

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金为指数基金，采用量化的方法在国证 2000 成分股内进行抽样选股构建组合，达到复制标的指数的目的。报告期内，本基金较好的完成了基金的投资目标。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.8179 元，本报告期基金份额净值增长率为-16.28%，业绩比较基准收益率为-19.67%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2024 年下半年，中国经济将继续在“稳中求进”的总基调下运行，经济增速有望保持在合理区间。从外部宏观上看，全球流动性有望宽松，一部分主要经济体央行已进入降息周期，全球经济或将持续复苏，分母端的压力减退有望提振权益资产的投资价值。从国内宏观来看，房地产产业的支持性政策刺激下，商品房销售面积数据出现了较为明显的改善，叠加地产开工增速放缓，地产下行最快的时候已经过去。出口端强劲，外贸持续保持顺差，我国的出口市场更加多元化，展现了更强的跨越周期波动的能力。投资端，在三中全会的定调下，对于财政端发力预期会更加清晰。

对于下半年股票投资上看，可以适当更积极乐观一些。对于市场掣肘的因素正在逐步消退，外部流动性随着降息的落地会有回流的诉求，国内基本面的维稳改善提振了投资预期，资产间性价比中股票市场的价值正在逐步突出，政策端对于股票市场机制的不断完善保障了长期的投资价值。

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人设有估值委员会，由研究中心及投资管理部门、运营部、风险管理室及法律合

规监察部相关人员组成。估值委员会负责公司基金估值政策、程序及方法的制定和修订，负责定期审议公司估值政策、程序及方法的科学合理性，保证基金估值的公平、合理。估值委员会的相关人员均具有一定年限的专业从业经验，具有良好的专业能力，并能在相关工作中保持独立性。

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

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配，符合基金合同的约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数低于 200 人、基金资产净值低于 5,000 万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

本年度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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：平安国证 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	1,179,411.41	4,536,025.31
结算备付金		20,849.53	272,008.18
存出保证金		13,294.61	293,925.36
交易性金融资产	6.4.7.2	53,109,207.08	103,892,268.79
其中：股票投资		53,109,207.08	103,892,268.79
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	219,302.78
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	75,409.12	-
资产总计		54,398,171.75	109,213,530.42
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		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		23,190.13	46,713.73
应付托管费		4,638.03	9,342.75
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	162,048.83	439,086.05
负债合计		189,876.99	495,142.53
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	66,274,435.00	111,274,435.00
未分配利润	6.4.7.12	-12,066,140.24	-2,556,047.11
净资产合计		54,208,294.76	108,718,387.89
负债和净资产总计		54,398,171.75	109,213,530.42

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.8179 元，基金份额总额 66,274,435.00 份。

6.2 利润表

会计主体：平安国证 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		-13,059,482.48
1. 利息收入		10,917.68
其中：存款利息收入	6.4.7.13	10,917.68
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）		-12,864,729.45
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-13,449,710.83
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-
股利收益	6.4.7.19	584,981.38
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-169,286.68
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	-36,384.03
减：二、营业总支出		391,949.53
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	184,276.18
其中：暂估管理人报酬		-

2. 托管费	6.4.10.2.2	36,855.25
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-
7. 税金及附加		-
8. 其他费用	6.4.7.23	170,818.10
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-13,451,432.01
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-13,451,432.01
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-13,451,432.01

6.3 净资产变动表

会计主体：平安国证 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	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	111,274,435.00	-	-2,556,047.11	108,718,387.89
二、本期期初净资产	111,274,435.00	-	-2,556,047.11	108,718,387.89
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-45,000,000.00	-	-9,510,093.13	-54,510,093.13
（一）、综合收益总额	-	-	-13,451,432.01	-13,451,432.01
（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）	-45,000,000.00	-	3,941,338.88	-41,058,661.12
其中：1. 基金申购款	51,000,000.00	-	-8,867,100.75	42,132,899.25
2. 基金赎回款	-96,000,000.00	-	12,808,439.63	-83,191,560.37
（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	66,274,435.00	-	-12,066,140.24	54,208,294.76

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：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2023]1485 号《关于准予平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》核准,由平安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,113,220,000.00 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2023)第 0403 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2023 年 8 月 25 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,113,274,435.00 份,其中认购资金利息折合 54,435.00 份基金份额。本基金的基金管理人为平安基金管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2023]814 号文审核同意,本基金 1,113,274,435.00 份基金份额于 2023 年 9 月 7 日在深交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金主要投资于国证 2000 指数的成份股及其备选成份股(包括存托凭证)。为更好地实现投资目标,本基金还可投资于非成份股(包括主板、创业板及其他经中国证监会允许投资的股票、存托凭证)、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债券、政府支持债券等)、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权、信用衍生品、银行存款(协议存款、通知存款以及定期存款等)、同业存单、资产支持证券、债券回购、现金以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关

规定)。本基金将根据法律法规的规定参与融资和转融通证券出借业务。本基金的投资组合比例为：本基金投资于国证 2000 指数的成份股及其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、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：国证 2000 指数收益率。

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于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金本报告期财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2024 年 06 月 30 日的财务状况以及 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 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。

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

本基金本报告期末未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市

公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

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	1,179,411.41
等于：本金	1,179,249.84
加：应计利息	161.57
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	1,179,411.41

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	56,408,999.59	-	53,109,207.08	-3,299,792.51
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	56,408,999.59	-	53,109,207.08	-3,299,792.51

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末未持有期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金于本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末无其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末无其他债权投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末无其他权益工具投资。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末无其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应收利息	-
其他应收款	-

待摊费用	75,409.12
合计	75,409.12

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	67,568.99
其中：交易所市场	67,568.99
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	94,479.84
合计	162,048.83

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	111,274,435.00	111,274,435.00
本期申购	51,000,000.00	51,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-96,000,000.00	-96,000,000.00
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	66,274,435.00	66,274,435.00

注：投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购、赎回单位的整数倍。

6.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,276,220.00	-3,832,267.11	-2,556,047.11
本期期初	1,276,220.00	-3,832,267.11	-2,556,047.11
本期利润	-13,282,145.33	-169,286.68	-13,451,432.01
本期基金份额交易产生的变动数	2,253,687.74	1,687,651.14	3,941,338.88

其中：基金申购款	-1,574,506.99	-7,292,593.76	-8,867,100.75
基金赎回款	3,828,194.73	8,980,244.90	12,808,439.63
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-9,752,237.59	-2,313,902.65	-12,066,140.24

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
活期存款利息收入		7,760.13
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		2,034.65
其他		1,122.90
合计		10,917.68

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
股票投资收益——买卖股票差价收入		-8,801,030.49
股票投资收益——赎回差价收入		-4,648,680.34
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		-13,449,710.83

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
卖出股票成交总额		74,712,873.70
减：卖出股票成本总额		83,367,394.24
减：交易费用		146,509.95
买卖股票差价收入		-8,801,030.49

6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
赎回基金份额对价总额		83,191,560.37
减：现金支付赎回款总额		42,242,124.37
减：赎回股票成本总额		45,598,116.34
减：交易费用		-

赎回差价收入	-4,648,680.34
--------	---------------

6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无股票申购差价收入。

6.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期无股票投资收益——证券出借差价收入。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期内无债券买卖差价收入。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无贵金属投资。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资。

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

注：本基金本报告期内无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期内无衍生工具收益——其他投资收益。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	584,981.38
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	584,981.38

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	-169,286.68
股票投资	-169,286.68
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-169,286.68

注：本基金上半年公允价值变动收益-股票投资中包含的可退替代款产生的公允价值变动收益为-36,384.03。

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日

基金赎回费收入	-
替代损益	-36,384.03
合计	-36,384.03

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申购(赎回)本基金时，补入(卖出)被替代成分证券的实际买入成本(实际卖出金额)与申购(赎回)确认日估值的差额或强制退款的被替代成分证券在强制退款计算日与申购(赎回)确认日估值的差额。

6.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	24,863.02
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行费用	1,347.38
其他	84,935.36
合计	170,818.10

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

	司控制的公司
中国平安保险(集团)股份有限公司(“平安集团”)	基金管理人的最终控股母公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	184,276.18
其中：应支付销售机构的客户维护费	9,279.45
应支付基金管理人的净管理费	174,996.73

注：支付基金管理人平安基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.50% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	36,855.25

注：支付基金托管行招商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至

每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：本基金本报告期内转融通证券出借业务未发生重大关联交易事项。

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

注：本基金本报告期内转融通证券出借业务未发生重大关联交易事项。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024年6月30日		上年度末 2023年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）
方正证券	5,549,981.00	8.3742	7,273,731.00	6.5367

注：投资相关费率符合基金合同和招募说明书等法律文件的约定

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行-活期	1,179,411.41	7,760.13

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业存款利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2024年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

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
002308	*ST 威创	2024年5月6日	重大事项停牌	0.00	2024年07月09日	1.87	11,000	43,266.11	0.00	-
002288	*ST 超华	2024年6月27日	重大事项停牌	0.00	-	-	12,600	47,537.53	0.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金管理人秉承全面风险管理的理念，将风险管理融入业务中，建立了由风险管理委员会、风险控制委员会、督察长、风险管理部门以及各个业务部门构成的风险管理架构体系。各部门负

责人为其所在部门风险管理的第一责任人，公司员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。本基金管理人设立风险管理部门，风险管理部门对公司的风险管理进行独立评估、监控、检查并及时向管理层汇报。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的投资范围及投资比例符合相关法律法规的要求、相关监管机构的相关规定及本基金的合同要求。本基金管理人通过建立和完善内部信用评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。本基金的活期银行存款存放在具有托管资格的银行；本基金存放定期存款前，均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在银行间同业市场仅与达到本基金管理人既定信用政策标准的交易对手进行交易，并对证券交割方式进行限制，以控制相应的信用风险。

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

于本报告期末，本基金未持有债券和资产支持证券投资（上年度末：同）。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中

度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人对其管理的所有开放式基金于开放期内，对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。

本基金管理人通过由风险管理人员定期监控组合中债券投资部分的利率风险，及时调整投资

组合久期等方法管理利率风险。

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,179,411.41	-	-	-	1,179,411.41
结算备付金	20,849.53	-	-	-	20,849.53
存出保证金	13,294.61	-	-	-	13,294.61
交易性金融资产	-	-	-	53,109,207.08	53,109,207.08
其他资产	-	-	-	75,409.12	75,409.12
资产总计	1,213,555.55	-	-	53,184,616.20	54,398,171.75
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	23,190.13	23,190.13
应付托管费	-	-	-	4,638.03	4,638.03
其他负债	-	-	-	162,048.83	162,048.83
负债总计	-	-	-	189,876.99	189,876.99
利率敏感度缺口	1,213,555.55	-	-	52,994,739.21	54,208,294.76
上年度末 2023年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	4,536,025.31	-	-	-	4,536,025.31
结算备付金	272,008.18	-	-	-	272,008.18
存出保证金	293,925.36	-	-	-	293,925.36
交易性金融资产	-	-	-	103,892,268.79	103,892,268.79
应收清算款	-	-	-	219,302.78	219,302.78
资产总计	5,101,958.85	-	-	104,111,571.57	109,213,530.42
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	46,713.73	46,713.73
应付托管费	-	-	-	9,342.75	9,342.75
其他负债	-	-	-	439,086.05	439,086.05
负债总计	-	-	-	495,142.53	495,142.53
利率敏感度缺口	5,101,958.85	-	-	-103,616,429.04	108,718,387.89

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.2.1 外汇风险的敏感性分析

注：无

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因除外汇风险和利率风险以外的市场价格变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的重大价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其它价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

经测算本基金面临的其他价格风险列示如下：

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日		上年度末 2023年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	53,109,207.08	97.97	103,892,268.79	95.56
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	53,109,207.08	97.97	103,892,268.79	95.56

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除“沪深300指数”以外的其他市场变量保持不变		
	沪深300指数上升5%		
相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）		
	本期末（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）	
分析	沪深300指数上升	3,791,365.43	4,700,047.22

	5%		
	沪深 300 指数下降		
	5%	-3,791,365.43	-4,700,047.22

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	53,109,207.08	103,628,804.33
第二层次	-	190,800.00
第三层次	-	72,664.46
合计	53,109,207.08	103,892,268.79

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃、非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期末无需要说明有助于理解和分析会计报表的其他事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	53,109,207.08	97.63
	其中：股票	53,109,207.08	97.63
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	1,200,260.94	2.21
8	其他各项资产	88,703.73	0.16
9	合计	54,398,171.75	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	372,206.00	0.69
B	采矿业	1,122,976.48	2.07
C	制造业	35,854,580.84	66.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,666,300.40	3.07
E	建筑业	896,071.00	1.65
F	批发和零售业	1,683,351.10	3.11
G	交通运输、仓储和邮政业	1,418,290.20	2.62
H	住宿和餐饮业	95,892.00	0.18
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,807,036.11	10.71
J	金融业	556,804.35	1.03
K	房地产业	758,161.00	1.40
L	租赁和商务服务业	532,190.40	0.98

M	科学研究和技术服务业	1,031,610.62	1.90
N	水利、环境和公共设施管理业	559,668.85	1.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	38,358.00	0.07
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	665,697.00	1.23
S	综合	43,416.00	0.08
	合计	53,102,610.35	97.96

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	6,596.73	0.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	6,596.73	0.01

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600064	南京高科	94,900	576,043.00	1.06
2	002839	张家港行	122,200	491,244.00	0.91
3	300075	数字政通	21,920	323,320.00	0.60
4	600850	电科数字	17,000	307,700.00	0.57
5	688088	虹软科技	10,432	301,067.52	0.56
6	300674	宇信科技	26,200	290,296.00	0.54
7	300525	博思软件	22,000	279,400.00	0.52
8	600648	外高桥	31,500	279,090.00	0.51
9	002063	远光软件	49,300	258,332.00	0.48
10	002126	银轮股份	14,300	248,963.00	0.46
11	688568	中科星图	5,152	245,750.40	0.45
12	601918	新集能源	24,600	239,850.00	0.44
13	301171	易点天下	16,200	238,140.00	0.44
14	600363	联创光电	8,600	236,672.00	0.44
15	688639	华恒生物	3,073	234,746.47	0.43
16	300627	华测导航	7,800	232,830.00	0.43
17	002315	焦点科技	8,500	229,160.00	0.42
18	600158	中体产业	29,500	226,855.00	0.42
19	002139	拓邦股份	21,300	226,206.00	0.42
20	600459	贵研铂业	16,100	217,511.00	0.40
21	002222	福晶科技	9,570	215,612.10	0.40
22	300638	广和通	12,600	215,460.00	0.40
23	300679	电连技术	5,300	213,219.00	0.39
24	603039	泛微网络	6,700	212,792.00	0.39
25	300811	铂科新材	4,800	210,720.00	0.39
26	300770	新媒股份	6,200	206,956.00	0.38
27	002432	九安医疗	5,100	206,754.00	0.38
28	600312	平高电气	10,300	200,335.00	0.37
29	601137	博威合金	13,000	198,120.00	0.37
30	600971	恒源煤电	16,400	195,816.00	0.36
31	688018	乐鑫科技	1,980	195,386.40	0.36
32	600201	生物股份	26,900	193,949.00	0.36
33	300687	赛意信息	13,700	190,704.00	0.35
34	600888	新疆众和	26,700	188,769.00	0.35
35	002015	协鑫能科	22,900	182,284.00	0.34
36	601512	中新集团	23,900	182,118.00	0.34
37	601208	东材科技	24,600	178,596.00	0.33
38	600757	长江传媒	21,800	175,708.00	0.32
39	603267	鸿远电子	5,000	170,500.00	0.31

40	301050	雷电微力	3,500	168,560.00	0.31
41	300224	正海磁材	18,200	168,532.00	0.31
42	002351	漫步者	12,800	168,320.00	0.31
43	605168	三人行	6,380	167,985.40	0.31
44	002057	中钢天源	23,900	167,300.00	0.31
45	002130	沃尔核材	11,800	166,616.00	0.31
46	600821	金开新能	31,400	161,396.00	0.30
47	300634	彩讯股份	9,500	159,885.00	0.29
48	300857	协创数据	2,800	159,600.00	0.29
49	002675	东诚药业	13,000	159,380.00	0.29
50	603599	广信股份	13,100	158,903.00	0.29
51	688166	博瑞医药	4,504	157,640.00	0.29
52	002332	仙琚制药	13,800	157,458.00	0.29
53	688007	光峰科技	9,700	156,170.00	0.29
54	688596	正帆科技	4,724	155,892.00	0.29
55	601702	华峰铝业	8,500	155,210.00	0.29
56	688116	天奈科技	6,700	154,636.00	0.29
57	300655	晶瑞电材	21,400	154,080.00	0.28
58	601028	玉龙股份	12,300	153,750.00	0.28
59	000612	焦作万方	23,400	152,100.00	0.28
60	000810	创维数字	17,700	151,866.00	0.28
61	300319	麦捷科技	16,100	150,213.00	0.28
62	603383	顶点软件	4,660	149,446.20	0.28
63	002605	姚记科技	7,200	147,024.00	0.27
64	603505	金石资源	5,236	146,241.48	0.27
65	603393	新天然气	4,100	142,434.00	0.26
66	600452	涪陵电力	11,220	142,157.40	0.26
67	002004	华邦健康	37,300	141,740.00	0.26
68	002245	蔚蓝锂芯	18,100	140,275.00	0.26
69	300303	聚飞光电	28,800	139,968.00	0.26
70	688409	富创精密	3,784	139,780.96	0.26
71	002837	英维克	6,500	139,035.00	0.26
72	688700	东威科技	5,273	138,205.33	0.25
73	603283	赛腾股份	1,800	137,520.00	0.25
74	002851	麦格米特	5,300	136,952.00	0.25
75	300049	福瑞股份	2,700	135,918.00	0.25
76	300327	中颖电子	6,900	135,792.00	0.25
77	300428	立中集团	7,300	135,707.00	0.25
78	002270	华明装备	6,100	135,664.00	0.25
79	688106	金宏气体	7,683	134,606.16	0.25
80	300570	太辰光	4,100	133,906.00	0.25
81	688123	聚辰股份	2,200	133,826.00	0.25
82	600587	新华医疗	8,500	133,790.00	0.25

83	688518	联赢激光	7,910	132,097.00	0.24
84	688556	高测股份	11,080	131,741.20	0.24
85	000543	皖能电力	14,800	130,980.00	0.24
86	000923	河钢资源	7,600	130,872.00	0.24
87	002338	奥普光电	3,900	128,778.00	0.24
88	600125	铁龙物流	21,500	128,355.00	0.24
89	002832	比音勒芬	5,300	128,101.00	0.24
90	600586	金晶科技	21,900	127,020.00	0.23
91	002401	中远海科	8,500	126,990.00	0.23
92	300855	图南股份	4,800	126,912.00	0.23
93	600572	康恩贝	28,200	126,054.00	0.23
94	000552	甘肃能化	36,300	125,961.00	0.23
95	688100	威胜信息	3,300	125,895.00	0.23
96	300872	天阳科技	9,500	125,875.00	0.23
97	600761	安徽合力	5,800	125,512.00	0.23
98	002698	博实股份	10,200	125,154.00	0.23
99	002539	云图控股	17,500	124,775.00	0.23
100	605090	九丰能源	4,300	124,700.00	0.23
101	002335	科华数据	5,900	124,667.00	0.23
102	000090	天健集团	31,000	124,620.00	0.23
103	603279	景津装备	5,700	123,633.00	0.23
104	600428	中远海特	20,200	123,624.00	0.23
105	603306	华懋科技	6,800	122,876.00	0.23
106	688690	纳微科技	6,924	120,269.88	0.22
107	002215	诺普信	16,100	119,945.00	0.22
108	002106	莱宝高科	11,000	119,900.00	0.22
109	600269	赣粤高速	23,100	119,427.00	0.22
110	688239	航宇科技	3,400	118,320.00	0.22
111	688076	诺泰生物	1,500	117,420.00	0.22
112	603018	华设集团	12,900	117,261.00	0.22
113	603619	中曼石油	5,000	117,100.00	0.22
114	600776	东方通信	11,900	116,977.00	0.22
115	688029	南微医学	1,900	116,964.00	0.22
116	600750	江中药业	5,000	115,550.00	0.21
117	002458	益生股份	13,300	115,178.00	0.21
118	600285	羚锐制药	4,700	113,787.00	0.21
119	002706	良信股份	16,500	113,190.00	0.21
120	688439	振华风光	1,700	112,965.00	0.21
121	605123	派克新材	2,000	112,360.00	0.21
122	002020	京新药业	10,700	112,029.00	0.21
123	600502	安徽建工	26,000	111,800.00	0.21
124	603258	电魂网络	6,900	111,435.00	0.21
125	002233	塔牌集团	15,200	111,112.00	0.20

126	002276	万马股份	15,200	108,984.00	0.20
127	688016	心脉医疗	1,100	107,855.00	0.20
128	601126	四方股份	5,600	107,632.00	0.20
129	002519	银河电子	21,900	107,529.00	0.20
130	301039	中集车辆	12,500	107,500.00	0.20
131	002061	浙江交科	29,400	107,310.00	0.20
132	301031	中熔电气	1,300	106,860.00	0.20
133	688630	芯碁微装	1,700	106,369.00	0.20
134	600976	健民集团	2,100	106,050.00	0.20
135	603063	禾望电气	6,905	105,853.65	0.20
136	300416	苏试试验	8,200	105,452.00	0.19
137	000811	冰轮环境	10,900	105,185.00	0.19
138	603801	志邦家居	8,040	105,163.20	0.19
139	300705	九典制药	3,900	104,286.00	0.19
140	600195	中牧股份	13,900	104,111.00	0.19
141	300217	东方电热	27,600	104,052.00	0.19
142	600993	马应龙	3,900	104,013.00	0.19
143	603128	华贸物流	18,000	103,860.00	0.19
144	000682	东方电子	9,400	103,776.00	0.19
145	002815	崇达技术	11,000	103,180.00	0.19
146	605577	龙版传媒	6,600	102,498.00	0.19
147	300576	容大感光	2,800	102,284.00	0.19
148	002947	恒铭达	2,900	102,080.00	0.19
149	002859	洁美科技	5,028	100,962.24	0.19
150	002117	东港股份	14,200	100,536.00	0.19
151	002334	英威腾	16,800	100,464.00	0.19
152	300181	佐力药业	6,600	99,792.00	0.18
153	000650	仁和药业	16,900	99,710.00	0.18
154	603738	泰晶科技	7,300	99,572.00	0.18
155	300613	富瀚微	3,000	98,730.00	0.18
156	300693	盛弘股份	4,700	98,418.00	0.18
157	300087	荃银高科	15,900	98,262.00	0.18
158	000928	中钢国际	17,700	98,235.00	0.18
159	300470	中密控股	2,900	98,049.00	0.18
160	300768	迪普科技	8,200	97,170.00	0.18
161	300793	佳禾智能	7,000	97,020.00	0.18
162	603859	能科科技	4,600	96,692.00	0.18
163	601890	亚星锚链	13,700	96,585.00	0.18
164	002093	国脉科技	15,900	96,513.00	0.18
165	300827	上能电气	4,300	96,148.00	0.18
166	300463	迈克生物	8,400	95,592.00	0.18
167	300129	泰胜风能	14,000	95,480.00	0.18
168	300041	回天新材	11,900	94,486.00	0.17

169	688676	金盘科技	1,800	93,870.00	0.17
170	600055	万东医疗	7,600	93,860.00	0.17
171	600229	城市传媒	13,600	93,704.00	0.17
172	000429	粤高速 A	9,000	93,690.00	0.17
173	002737	葵花药业	4,000	93,520.00	0.17
174	300360	炬华科技	5,500	93,500.00	0.17
175	301339	通行宝	4,700	93,483.00	0.17
176	688025	杰普特	2,302	92,977.78	0.17
177	600420	国药现代	8,600	91,848.00	0.17
178	300415	伊之密	4,400	91,432.00	0.17
179	002283	天润工业	21,300	91,377.00	0.17
180	300138	晨光生物	10,800	91,044.00	0.17
181	300725	药石科技	3,400	91,018.00	0.17
182	688389	普门科技	5,596	90,990.96	0.17
183	603566	普莱柯	6,700	90,986.00	0.17
184	300532	今天国际	7,400	90,946.00	0.17
185	300260	新莱应材	4,300	90,042.00	0.17
186	300685	艾德生物	5,100	89,964.00	0.17
187	300900	广联航空	4,760	89,154.80	0.16
188	002274	华昌化工	12,000	89,040.00	0.16
189	603662	柯力传感	3,800	88,692.00	0.16
190	603867	新化股份	3,800	88,654.00	0.16
191	600284	浦东建设	16,600	88,644.00	0.16
192	002006	精工科技	6,600	88,572.00	0.16
193	601163	三角轮胎	5,800	88,276.00	0.16
194	601369	陕鼓动力	11,000	88,220.00	0.16
195	000915	华特达因	2,900	87,464.00	0.16
196	688508	芯朋微	2,400	87,288.00	0.16
197	688739	成大生物	3,600	87,264.00	0.16
198	000685	中山公用	12,000	86,520.00	0.16
199	300841	康华生物	1,700	86,088.00	0.16
200	603713	密尔克卫	1,600	85,632.00	0.16
201	002965	祥鑫科技	2,800	85,596.00	0.16
202	002993	奥海科技	2,300	85,560.00	0.16
203	600197	伊力特	4,800	85,488.00	0.16
204	002017	东信和平	10,200	84,966.00	0.16
205	603227	雪峰科技	13,700	84,940.00	0.16
206	002041	登海种业	10,500	84,840.00	0.16
207	000088	盐田港	18,700	84,711.00	0.16
208	600211	西藏药业	2,600	84,708.00	0.16
209	688127	蓝特光学	4,600	84,594.00	0.16
210	002990	盛视科技	4,200	84,546.00	0.16
211	300835	龙磁科技	2,900	84,245.00	0.16

212	600059	古越龙山	10,600	84,164.00	0.16
213	300662	科锐国际	5,200	83,876.00	0.15
214	688586	江航装备	9,000	83,700.00	0.15
215	600480	凌云股份	8,500	83,555.00	0.15
216	300174	元力股份	6,100	83,265.00	0.15
217	300401	花园生物	5,800	83,172.00	0.15
218	688289	圣湘生物	4,724	83,047.92	0.15
219	688408	中信博	900	82,872.00	0.15
220	002003	伟星股份	6,600	82,830.00	0.15
221	601200	上海环境	9,700	82,450.00	0.15
222	002895	川恒股份	4,500	82,395.00	0.15
223	300779	惠城环保	1,700	82,280.00	0.15
224	688403	汇成股份	9,700	82,256.00	0.15
225	688190	云路股份	1,100	82,181.00	0.15
226	002960	青鸟消防	6,500	82,160.00	0.15
227	002588	史丹利	10,900	82,077.00	0.15
228	688300	联瑞新材	1,700	81,770.00	0.15
229	688800	瑞可达	2,854	80,140.32	0.15
230	603556	海兴电力	1,700	79,611.00	0.15
231	300850	新强联	5,300	79,606.00	0.15
232	300507	苏奥传感	13,800	79,350.00	0.15
233	002226	江南化工	17,700	79,296.00	0.15
234	688091	上海谊众	3,510	79,290.90	0.15
235	603187	海容冷链	6,800	79,288.00	0.15
236	300480	光力科技	5,000	79,150.00	0.15
237	603078	江化微	5,900	79,001.00	0.15
238	605377	华旺科技	5,960	78,970.00	0.15
239	603920	世运电路	4,000	78,960.00	0.15
240	688559	海目星	2,400	78,936.00	0.15
241	605599	菜百股份	6,200	78,926.00	0.15
242	000731	四川美丰	11,900	78,897.00	0.15
243	300592	华凯易佰	6,900	78,867.00	0.15
244	301391	卡莱特	1,800	78,804.00	0.15
245	002206	海利得	20,600	78,692.00	0.15
246	300596	利安隆	2,900	78,677.00	0.15
247	688601	力芯微	1,800	78,642.00	0.15
248	000828	东莞控股	8,700	78,387.00	0.14
249	000822	山东海化	13,400	78,122.00	0.14
250	300119	瑞普生物	5,700	77,634.00	0.14
251	688279	峰昭科技	700	77,630.00	0.14
252	002135	东南网架	19,600	77,616.00	0.14
253	600351	亚宝药业	13,800	77,418.00	0.14
254	688378	奥来德	3,296	77,324.16	0.14

255	300263	隆华科技	13,800	77,280.00	0.14
256	002158	汉钟精机	4,600	76,912.00	0.14
257	603730	岱美股份	7,720	76,736.80	0.14
258	000507	珠海港	17,300	76,639.00	0.14
259	603368	柳药集团	4,340	75,950.00	0.14
260	603328	依顿电子	9,600	75,456.00	0.14
261	301363	美好医疗	2,600	75,400.00	0.14
262	300406	九强生物	4,900	75,362.00	0.14
263	002296	辉煌科技	7,300	75,263.00	0.14
264	603100	川仪股份	3,200	75,232.00	0.14
265	000501	武商集团	11,200	74,704.00	0.14
266	002937	兴瑞科技	3,200	74,592.00	0.14
267	000973	佛塑科技	20,200	74,538.00	0.14
268	000900	现代投资	20,300	74,298.00	0.14
269	300019	硅宝科技	5,600	74,200.00	0.14
270	301162	国能日新	1,700	74,052.00	0.14
271	000048	京基智农	5,400	73,926.00	0.14
272	300856	科思股份	2,300	73,623.00	0.14
273	300580	贝斯特	5,000	73,500.00	0.14
274	603067	振华股份	6,300	73,458.00	0.14
275	000498	山东路桥	14,000	73,220.00	0.14
276	002697	红旗连锁	15,800	73,154.00	0.13
277	002545	东方铁塔	10,700	72,867.00	0.13
278	002349	精华制药	11,100	72,816.00	0.13
279	002550	千红制药	13,500	72,765.00	0.13
280	000968	蓝焰控股	11,400	72,504.00	0.13
281	002536	飞龙股份	7,600	72,352.00	0.13
282	300233	金城医药	4,843	72,257.56	0.13
283	002897	意华股份	1,900	71,554.00	0.13
284	002043	兔宝宝	6,900	71,553.00	0.13
285	300566	激智科技	5,100	71,349.00	0.13
286	601827	三峰环境	8,400	71,316.00	0.13
287	003006	百亚股份	3,000	71,100.00	0.13
288	688198	佰仁医疗	700	71,043.00	0.13
289	002035	华帝股份	11,400	71,022.00	0.13
290	300590	移为通信	6,200	70,804.00	0.13
291	688348	昱能科技	1,200	70,800.00	0.13
292	000061	农产品	14,500	70,470.00	0.13
293	300740	水羊股份	4,800	70,464.00	0.13
294	300941	创识科技	3,900	70,434.00	0.13
295	300440	运达科技	13,400	70,350.00	0.13
296	002997	瑞鹤模具	2,200	70,334.00	0.13
297	688366	昊海生科	1,140	70,315.20	0.13

298	603989	艾华集团	5,000	70,300.00	0.13
299	002516	旷达科技	19,300	70,252.00	0.13
300	000848	承德露露	8,900	69,954.00	0.13
301	300729	乐歌股份	4,500	69,705.00	0.13
302	300039	上海凯宝	13,000	69,550.00	0.13
303	003021	兆威机电	1,500	69,225.00	0.13
304	000541	佛山照明	14,200	69,154.00	0.13
305	003012	东鹏控股	11,300	69,043.00	0.13
306	000521	长虹美菱	9,100	68,978.00	0.13
307	603855	华荣股份	3,100	68,541.00	0.13
308	002170	芭田股份	11,400	68,514.00	0.13
309	688621	阳光诺和	1,600	68,320.00	0.13
310	688383	新益昌	1,300	67,743.00	0.12
311	603230	内蒙新华	5,800	66,932.00	0.12
312	300258	精锻科技	8,200	66,666.00	0.12
313	688510	航亚科技	3,620	66,644.20	0.12
314	002345	潮宏基	14,100	66,552.00	0.12
315	603297	永新光学	1,100	66,539.00	0.12
316	300219	鸿利智汇	11,900	66,521.00	0.12
317	003038	鑫铂股份	4,500	66,465.00	0.12
318	000888	峨眉山 A	6,100	66,429.00	0.12
319	300545	联得装备	2,700	66,285.00	0.12
320	001323	慕思股份	2,300	66,171.00	0.12
321	300443	金雷股份	4,300	65,919.00	0.12
322	603031	安孚科技	2,900	65,482.00	0.12
323	002891	中宠股份	3,100	64,697.00	0.12
324	688305	科德数控	1,000	64,460.00	0.12
325	002469	三维化学	11,300	64,410.00	0.12
326	002847	盐津铺子	1,500	64,155.00	0.12
327	600929	雪天盐业	12,100	64,130.00	0.12
328	301096	百诚医药	1,100	63,888.00	0.12
329	002438	江苏神通	5,900	63,779.00	0.12
330	002979	雷赛智能	3,500	63,700.00	0.12
331	300629	新劲刚	3,600	63,576.00	0.12
332	603871	嘉友国际	3,580	63,330.20	0.12
333	002478	常宝股份	12,700	63,246.00	0.12
334	300130	新国都	3,800	63,232.00	0.12
335	603337	杰克股份	2,400	63,168.00	0.12
336	000913	钱江摩托	4,000	63,040.00	0.12
337	300194	福安药业	16,800	62,832.00	0.12
337	300320	海达股份	7,700	62,832.00	0.12
338	688677	海泰新光	1,600	62,768.00	0.12
339	002448	中原内配	10,900	62,566.00	0.12

340	002154	报喜鸟	11,500	62,560.00	0.12
341	600694	大商股份	3,710	62,365.10	0.12
342	002452	长高电新	7,500	62,100.00	0.11
343	300304	云意电气	9,500	61,845.00	0.11
344	002913	奥士康	2,300	61,663.00	0.11
345	002033	丽江股份	7,000	61,320.00	0.11
346	301215	中汽股份	10,400	60,944.00	0.11
347	300481	濮阳惠成	4,400	60,720.00	0.11
348	300384	三联虹普	4,600	60,352.00	0.11
349	001337	四川黄金	2,600	60,346.00	0.11
350	301263	泰恩康	4,800	60,144.00	0.11
351	605507	国邦医药	3,600	59,940.00	0.11
351	688259	创耀科技	1,500	59,940.00	0.11
352	000922	佳电股份	5,000	59,650.00	0.11
353	301080	百普赛斯	1,700	59,500.00	0.11
354	002443	金洲管道	11,100	59,274.00	0.11
355	301175	中科环保	13,500	59,265.00	0.11
356	300382	斯莱克	10,000	59,100.00	0.11
357	301030	仕净科技	2,400	59,088.00	0.11
358	300820	英杰电气	1,500	59,010.00	0.11
359	300792	壹网壹创	3,900	58,695.00	0.11
360	603896	寿仙谷	2,500	58,675.00	0.11
361	000906	浙商中拓	8,700	58,638.00	0.11
362	002833	弘亚数控	3,200	58,368.00	0.11
363	603699	纽威股份	3,400	58,208.00	0.11
364	000707	双环科技	8,500	58,140.00	0.11
365	300403	汉宇集团	8,500	58,055.00	0.11
366	603167	渤海轮渡	7,100	58,007.00	0.11
367	603611	诺力股份	3,400	57,936.00	0.11
368	603357	设计总院	6,300	57,897.00	0.11
369	300795	米奥会展	3,300	57,849.00	0.11
370	605108	同庆楼	2,700	57,672.00	0.11
371	000534	万泽股份	5,800	57,594.00	0.11
372	300349	金卡智能	4,800	57,216.00	0.11
373	002515	金字火腿	15,000	56,850.00	0.10
374	688268	华特气体	1,100	56,771.00	0.10
375	605305	中际联合	2,200	56,738.00	0.10
376	301102	兆讯传媒	4,800	56,592.00	0.10
377	603809	豪能股份	6,992	56,495.36	0.10
378	603058	永吉股份	7,100	56,445.00	0.10
379	600548	深高速	5,300	56,339.00	0.10
380	300664	鹏鹞环保	12,600	56,070.00	0.10
381	301191	菲菱科思	800	55,976.00	0.10

382	002367	康力电梯	9,700	55,969.00	0.10
383	603708	家家悦	6,900	55,959.00	0.10
384	300354	东华测试	1,800	55,926.00	0.10
385	002783	凯龙股份	7,600	55,632.00	0.10
386	300547	川环科技	3,400	55,590.00	0.10
387	600523	贵航股份	5,600	55,440.00	0.10
388	300680	隆盛科技	2,900	55,303.00	0.10
389	603229	奥翔药业	5,500	55,275.00	0.10
390	605016	百龙创园	2,700	54,999.00	0.10
391	300396	迪瑞医疗	2,700	54,837.00	0.10
392	688035	德邦科技	1,700	54,774.00	0.10
393	002922	伊戈尔	2,500	54,650.00	0.10
394	600629	华建集团	12,500	54,500.00	0.10
395	300447	全信股份	4,400	54,472.00	0.10
396	603508	思维列控	2,900	54,375.00	0.10
397	002646	天佑德酒	5,300	54,219.00	0.10
398	688205	德科立	1,880	54,162.80	0.10
399	301262	海看股份	2,400	54,120.00	0.10
400	002970	锐明技术	1,500	54,045.00	0.10
401	002026	山东威达	6,500	53,950.00	0.10
402	002884	凌霄泵业	2,800	53,760.00	0.10
403	002870	香山股份	1,800	53,694.00	0.10
404	603105	芯能科技	6,100	53,680.00	0.10
405	300660	江苏雷利	2,100	53,592.00	0.10
406	603158	腾龙股份	7,600	53,504.00	0.10
407	600163	中闽能源	11,100	53,502.00	0.10
408	300160	秀强股份	11,400	53,352.00	0.10
409	688377	迪威尔	4,061	53,199.10	0.10
410	300435	中泰股份	4,500	52,965.00	0.10
411	300400	劲拓股份	4,600	52,624.00	0.10
412	600874	创业环保	9,400	52,546.00	0.10
413	300873	海晨股份	3,600	52,488.00	0.10
414	603318	水发燃气	9,200	52,072.00	0.10
415	002843	泰嘉股份	3,400	52,054.00	0.10
416	605266	健之佳	2,000	51,900.00	0.10
417	603203	快克智能	2,200	51,876.00	0.10
418	000417	合肥百货	12,500	51,875.00	0.10
419	600479	千金药业	5,100	51,867.00	0.10
420	605368	蓝天燃气	3,800	51,832.00	0.10
421	603633	徕木股份	6,500	51,415.00	0.09
422	603299	苏盐井神	5,400	51,300.00	0.09
423	605009	豪悦护理	1,300	51,272.00	0.09
424	601886	江河集团	10,500	51,240.00	0.09

425	688252	天德钰	3,518	51,116.54	0.09
426	603590	康辰药业	2,000	51,080.00	0.09
427	688553	汇宇制药	4,100	50,922.00	0.09
428	300179	四方达	7,700	50,897.00	0.09
429	688146	中船特气	1,700	50,745.00	0.09
430	002034	旺能环境	3,900	50,739.00	0.09
431	300121	阳谷华泰	6,500	50,700.00	0.09
432	301382	蜂助手	2,800	50,652.00	0.09
433	002752	昇兴股份	10,000	50,600.00	0.09
434	601882	海天精工	2,200	50,402.00	0.09
435	603012	创力集团	11,300	50,398.00	0.09
436	688352	硕中科技	4,397	50,169.77	0.09
437	002300	太阳电缆	9,500	50,160.00	0.09
437	688636	智明达	2,200	50,160.00	0.09
438	300569	天能重工	12,000	49,920.00	0.09
439	688059	华锐精密	1,100	49,918.00	0.09
440	301367	怡和嘉业	800	49,760.00	0.09
441	300193	佳士科技	6,700	49,714.00	0.09
442	002053	云南能投	4,100	49,569.00	0.09
443	603098	森特股份	6,300	49,518.00	0.09
444	002096	易普力	4,100	48,790.00	0.09
445	300616	尚品宅配	4,400	48,664.00	0.09
446	001208	华菱线缆	6,400	48,512.00	0.09
447	002612	朗姿股份	3,500	48,370.00	0.09
448	603915	国茂股份	4,700	48,363.00	0.09
449	688391	钜泉科技	1,655	48,276.35	0.09
450	300430	诚益通	3,200	48,256.00	0.09
451	300783	三只松鼠	2,200	48,114.00	0.09
452	688432	有研硅	4,939	47,858.91	0.09
453	301195	北路智控	1,600	47,584.00	0.09
454	605116	奥锐特	1,900	47,557.00	0.09
455	001301	尚太科技	1,100	47,542.00	0.09
456	002088	鲁阳节能	3,900	47,151.00	0.09
457	603281	江瀚新材	2,100	47,145.00	0.09
458	300858	科拓生物	3,200	47,104.00	0.09
459	001338	永顺泰	4,800	47,040.00	0.09
460	688356	键凯科技	800	47,024.00	0.09
461	600738	丽尚国潮	12,800	46,976.00	0.09
462	000791	甘肃能源	7,600	46,892.00	0.09
463	300951	博硕科技	1,500	46,725.00	0.09
464	301018	申菱环境	2,400	46,656.00	0.09
465	603387	基蛋生物	6,000	46,560.00	0.09
466	603071	物产环能	3,700	46,361.00	0.09

467	300341	麦克奥迪	5,400	46,332.00	0.09
468	000551	创元科技	5,300	46,269.00	0.09
469	002677	浙江美大	5,700	46,227.00	0.09
470	002580	圣阳股份	7,500	46,125.00	0.09
471	001322	箭牌家居	6,300	46,053.00	0.08
472	300926	博俊科技	2,300	46,046.00	0.08
473	603439	贵州三力	3,600	45,936.00	0.08
474	000026	飞亚达	5,200	45,812.00	0.08
475	600468	百利电气	10,600	45,686.00	0.08
476	688357	建龙微纳	1,960	45,668.00	0.08
477	603916	苏博特	6,800	45,628.00	0.08
478	300286	安科瑞	2,100	45,444.00	0.08
479	688219	会通股份	5,818	45,205.86	0.08
480	300973	立高食品	1,600	44,944.00	0.08
481	300653	正海生物	2,200	44,770.00	0.08
482	301149	隆华新材	4,800	44,352.00	0.08
483	002632	道明光学	5,500	44,330.00	0.08
484	605598	上海港湾	2,000	44,180.00	0.08
485	600628	新世界	8,100	43,902.00	0.08
486	688222	成都先导	3,847	43,663.45	0.08
487	001258	立新能源	6,300	43,659.00	0.08
488	300272	开能健康	8,900	43,610.00	0.08
489	603165	荣晟环保	4,100	43,542.00	0.08
490	001311	多利科技	1,800	43,524.00	0.08
491	000532	华金资本	3,600	43,416.00	0.08
492	301069	凯盛新材	3,300	43,263.00	0.08
493	605196	华通线缆	4,100	43,132.00	0.08
494	603136	天目湖	3,945	43,118.85	0.08
495	603416	信捷电气	1,500	42,870.00	0.08
496	300632	光莆股份	4,300	42,785.00	0.08
497	600292	远达环保	9,100	42,679.00	0.08
498	603507	振江股份	1,300	42,666.00	0.08
499	301297	富乐德	2,100	42,651.00	0.08
500	688046	药康生物	4,173	42,648.06	0.08
501	300802	矩子科技	2,700	42,579.00	0.08
502	688179	阿拉丁	4,393	42,480.31	0.08
503	300441	鲍斯股份	7,100	42,103.00	0.08
504	300617	安靠智电	1,500	42,075.00	0.08
505	603367	辰欣药业	3,000	41,820.00	0.08
506	600368	五洲交通	11,700	41,769.00	0.08
507	000899	赣能股份	4,300	41,581.00	0.08
508	603209	兴通股份	3,000	41,520.00	0.08
509	002943	宇晶股份	2,000	41,340.00	0.08

510	002140	东华科技	5,300	41,075.00	0.08
511	603355	莱克电气	1,900	41,040.00	0.08
512	300894	火星人	3,200	41,024.00	0.08
513	600475	华光环能	4,700	40,937.00	0.08
514	600618	氯碱化工	4,600	40,388.00	0.07
515	605183	确成股份	2,600	40,196.00	0.07
516	601065	江盐集团	4,600	39,882.00	0.07
517	002029	七匹狼	7,900	39,816.00	0.07
518	300439	美康生物	4,300	39,388.00	0.07
519	600279	重庆港	10,800	39,204.00	0.07
520	300127	银河磁体	2,600	39,130.00	0.07
521	002918	蒙娜丽莎	4,300	38,958.00	0.07
522	688308	欧科亿	2,000	38,840.00	0.07
523	002790	瑞尔特	4,300	38,829.00	0.07
524	688138	清溢光电	1,800	38,700.00	0.07
525	300239	东宝生物	8,200	38,622.00	0.07
526	603983	丸美股份	1,400	38,542.00	0.07
527	002959	小熊电器	800	38,488.00	0.07
528	601133	柏诚股份	3,600	38,484.00	0.07
529	688315	诺禾致源	3,515	38,383.80	0.07
530	605098	行动教育	900	38,358.00	0.07
531	603408	建霖家居	2,900	38,251.00	0.07
532	603929	亚翔集成	1,600	38,240.00	0.07
533	301073	君亭酒店	2,100	38,220.00	0.07
534	301172	君逸数码	1,300	38,194.00	0.07
535	603515	欧普照明	2,200	38,148.00	0.07
536	603811	诚意药业	6,100	38,125.00	0.07
537	300389	艾比森	3,100	38,068.00	0.07
538	603013	亚普股份	2,800	37,716.00	0.07
539	300453	三鑫医疗	5,900	37,701.00	0.07
540	603360	百傲化学	3,200	37,600.00	0.07
541	300718	长盛轴承	2,700	37,314.00	0.07
542	688531	日联科技	800	36,928.00	0.07
543	002818	富森美	3,000	36,780.00	0.07
544	688526	科前生物	2,500	36,725.00	0.07
545	301061	匠心家居	780	36,628.80	0.07
546	300809	华辰装备	1,800	36,468.00	0.07
547	002880	卫光生物	1,300	36,426.00	0.07
548	301004	嘉益股份	400	36,400.00	0.07
549	002991	甘源食品	600	36,390.00	0.07
550	002083	孚日股份	8,600	36,378.00	0.07
551	600488	津药药业	10,600	36,358.00	0.07
552	600643	爱建集团	9,600	36,192.00	0.07

553	300815	玉禾田	3,100	36,084.00	0.07
554	603277	银都股份	1,200	36,048.00	0.07
555	002393	力生制药	2,280	36,046.80	0.07
556	603970	中农立华	2,100	35,868.00	0.07
557	603758	秦安股份	4,700	35,720.00	0.07
558	603396	金辰股份	1,100	35,717.00	0.07
559	002651	利君股份	6,500	35,685.00	0.07
560	300636	同和药业	3,500	35,595.00	0.07
561	600814	杭州解百	6,000	35,400.00	0.07
562	603339	四方科技	3,900	35,373.00	0.07
563	600897	厦门空港	2,800	35,308.00	0.07
564	301558	三态股份	4,200	35,238.00	0.07
565	003039	顺控发展	2,800	35,084.00	0.06
566	300833	浩洋股份	750	34,800.00	0.06
567	603053	成都燃气	3,600	34,776.00	0.06
568	002940	昂利康	2,400	34,752.00	0.06
569	300870	欧陆通	800	34,704.00	0.06
570	601089	福元医药	2,500	34,625.00	0.06
571	301421	波长光电	800	34,584.00	0.06
572	300969	恒帅股份	500	34,565.00	0.06
573	688376	美埃科技	1,100	34,496.00	0.06
574	000655	金岭矿业	6,200	34,286.00	0.06
575	300062	中能电气	7,000	34,090.00	0.06
576	301325	曼恩斯特	800	33,936.00	0.06
577	300863	卡倍亿	1,000	33,810.00	0.06
578	300722	新余国科	1,678	33,526.44	0.06
579	605050	福然德	3,800	33,478.00	0.06
580	605337	李子园	3,400	33,388.00	0.06
581	002788	鹭燕医药	4,200	33,096.00	0.06
582	603309	维力医疗	3,000	33,030.00	0.06
583	300105	龙源技术	5,100	32,946.00	0.06
584	002615	哈尔斯	5,300	32,860.00	0.06
585	601579	会稽山	3,200	32,768.00	0.06
586	003013	地铁设计	2,300	32,614.00	0.06
587	688663	新风光	1,400	32,578.00	0.06
588	605299	舒华体育	4,000	32,480.00	0.06
589	002275	桂林三金	2,600	32,266.00	0.06
590	603170	宝立食品	2,700	32,076.00	0.06
591	688478	晶升股份	1,100	32,032.00	0.06
592	300452	山河药辅	2,800	31,808.00	0.06
593	002950	奥美医疗	4,800	31,680.00	0.06
594	600283	钱江水利	2,500	31,600.00	0.06
595	002749	国光股份	2,100	31,584.00	0.06

596	300852	四会富仕	1,080	31,449.60	0.06
597	603693	江苏新能	2,700	31,374.00	0.06
598	002404	嘉欣丝绸	5,900	31,211.00	0.06
599	001215	千味央厨	1,100	31,097.00	0.06
600	003020	立方制药	1,700	31,076.00	0.06
601	688533	上声电子	1,200	31,044.00	0.06
602	002412	汉森制药	6,000	31,020.00	0.06
603	000544	中原环保	3,900	30,693.00	0.06
604	001269	欧晶科技	1,100	30,580.00	0.06
605	603931	格林达	1,500	30,495.00	0.06
606	603630	拉芳家化	2,900	30,479.00	0.06
607	301439	泓淋电力	2,400	30,408.00	0.06
608	001328	登康口腔	1,200	30,360.00	0.06
609	301291	明阳电气	1,000	30,050.00	0.06
610	688799	华纳药厂	700	29,701.00	0.05
611	688112	鼎阳科技	1,100	29,689.00	0.05
612	688698	伟创电气	1,100	29,667.00	0.05
613	301328	维峰电子	800	29,528.00	0.05
614	301046	能辉科技	1,500	29,505.00	0.05
615	603519	立霸股份	2,600	29,406.00	0.05
616	000567	海德股份	5,235	29,368.35	0.05
617	603125	常青科技	1,700	29,257.00	0.05
618	003000	劲仔食品	2,400	28,920.00	0.05
619	301488	豪恩汽电	600	28,860.00	0.05
620	603558	健盛集团	2,900	28,855.00	0.05
621	603239	浙江仙通	2,100	28,791.00	0.05
622	300962	中金辐照	2,100	28,644.00	0.05
623	300978	东箭科技	3,100	28,613.00	0.05
624	300727	润禾材料	1,300	28,548.00	0.05
625	605319	无锡振华	1,600	28,320.00	0.05
626	002983	芯瑞达	1,700	28,305.00	0.05
627	688697	纽威数控	1,800	28,242.00	0.05
628	601022	宁波远洋	3,200	28,224.00	0.05
629	301525	儒竞科技	500	28,140.00	0.05
630	605388	均瑶健康	5,100	27,948.00	0.05
631	301345	涛涛车业	500	27,550.00	0.05
632	688128	中国电研	1,600	27,536.00	0.05
633	301179	泽宇智能	1,400	27,244.00	0.05
634	600429	三元股份	7,300	27,229.00	0.05
635	301333	诺思格	800	26,888.00	0.05
636	603119	浙江荣泰	1,500	26,580.00	0.05
637	600724	宁波富达	7,300	26,499.00	0.05
638	603992	松霖科技	1,400	25,746.00	0.05

639	301048	金鹰重工	3,100	25,730.00	0.05
640	603061	金海通	400	25,712.00	0.05
641	301383	天键股份	980	25,597.60	0.05
642	301393	昊帆生物	600	25,482.00	0.05
643	301509	金凯生科	700	25,466.00	0.05
644	301507	民生健康	2,000	25,240.00	0.05
645	605338	巴比食品	1,900	25,175.00	0.05
646	301168	通灵股份	900	25,002.00	0.05
647	301211	亨迪药业	1,700	24,837.00	0.05
648	603966	法兰泰克	3,600	24,732.00	0.05
649	301266	宇邦新材	800	24,512.00	0.05
650	605286	同力日升	1,000	24,330.00	0.04
651	603112	华翔股份	2,300	24,173.00	0.04
652	688236	春立医疗	1,700	24,106.00	0.04
653	000411	英特集团	2,500	24,075.00	0.04
654	603324	盛剑环境	900	24,039.00	0.04
655	300946	恒而达	900	23,976.00	0.04
656	301550	斯菱股份	500	23,955.00	0.04
657	601566	九牧王	2,800	23,576.00	0.04
658	301456	盘古智能	900	23,481.00	0.04
659	688410	山外山	1,100	23,430.00	0.04
660	603808	歌力思	3,700	23,421.00	0.04
661	300797	钢研纳克	2,500	23,150.00	0.04
662	301377	鼎泰高科	1,300	22,815.00	0.04
663	002946	新乳业	2,600	22,776.00	0.04
664	300908	仲景食品	800	22,224.00	0.04
665	002956	西麦食品	1,600	21,984.00	0.04
666	603877	太平鸟	1,600	21,968.00	0.04
667	600796	钱江生化	5,000	21,800.00	0.04
668	605018	长华集团	2,400	21,744.00	0.04
669	300314	戴维医疗	2,100	21,714.00	0.04
670	300791	仙乐健康	860	21,672.00	0.04
671	603057	紫燕食品	1,400	21,448.00	0.04
672	605089	味知香	1,000	21,340.00	0.04
673	603193	润本股份	1,159	21,314.01	0.04
674	301376	致欧科技	1,000	21,170.00	0.04
675	300488	恒锋工具	1,000	20,350.00	0.04
676	688566	吉贝尔	900	20,250.00	0.04
677	603213	镇洋发展	2,700	20,196.00	0.04
678	300402	宝色股份	1,500	19,470.00	0.04
679	605005	合兴股份	1,200	19,152.00	0.04
680	300997	欢乐家	1,600	18,912.00	0.03
681	603848	好太太	1,500	18,885.00	0.03

682	301122	采纳股份	1,000	18,830.00	0.03
683	301322	绿通科技	1,000	18,770.00	0.03
684	603881	数据港	1,470	18,683.70	0.03
685	301381	赛维时代	800	18,184.00	0.03
686	688358	祥生医疗	700	18,179.00	0.03
687	603949	雪龙集团	1,600	18,016.00	0.03
688	603075	热威股份	1,000	17,650.00	0.03
689	001223	欧克科技	500	17,595.00	0.03
690	301278	快可电子	500	16,260.00	0.03
691	300881	盛德鑫泰	600	15,414.00	0.03
692	301408	华人健康	1,500	15,345.00	0.03
693	605300	佳禾食品	1,200	13,128.00	0.02
694	603291	联合水务	900	11,034.00	0.02

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	301526	国际复材	1,981	6,596.73	0.01
2	002288	*ST 超华	12,600	0.00	0.00
2	002308	*ST 威创	11,000	0.00	0.00
2	002435	ST 长康	10,700	0.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600064	南京高科	584,348.00	0.54
2	002839	张家港行	482,586.00	0.44
3	688235	百济神州	371,000.67	0.34
4	688029	南微医学	358,568.63	0.33
5	688409	富创精密	338,659.02	0.31
6	300075	数字政通	334,795.40	0.31
7	688568	中科星图	323,799.08	0.30
8	688088	虹软科技	313,856.19	0.29
9	600850	电科数字	313,007.00	0.29
10	600648	外高桥	279,391.00	0.26
11	300525	博思软件	269,525.80	0.25
12	605168	三人行	258,182.70	0.24
13	688639	华恒生物	257,546.14	0.24
14	002126	银轮股份	256,280.00	0.24
15	601918	新集能源	248,904.00	0.23
16	688333	铂力特	236,524.00	0.22
17	600363	联创光电	235,134.00	0.22

18	301171	易点天下	234,706.00	0.22
19	600459	贵研铂业	233,628.00	0.21
20	002315	焦点科技	232,083.00	0.21

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

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	688235	百济神州	828,645.24	0.76
2	603979	金诚信	760,380.00	0.70
3	300573	兴齐眼药	599,925.92	0.55
4	688213	思特威	520,338.58	0.48
5	688333	铂力特	517,234.63	0.48
6	600771	广誉远	502,654.00	0.46
7	688029	南微医学	469,428.53	0.43
8	688278	特宝生物	467,649.63	0.43
9	600422	昆药集团	435,258.00	0.40
10	600123	兰花科创	424,809.00	0.39
11	688019	安集科技	416,214.80	0.38
12	600908	无锡银行	397,377.00	0.37
13	603588	高能环境	389,460.00	0.36
14	600728	佳都科技	379,702.00	0.35
15	688409	富创精密	373,656.08	0.34
16	600595	中孚实业	372,944.00	0.34
17	600363	联创光电	364,226.00	0.34
18	600761	安徽合力	358,369.00	0.33
19	600199	金种子酒	354,704.00	0.33
20	603690	至纯科技	351,923.40	0.32

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	61,720,235.35
卖出股票收入（成交）总额	74,712,873.70

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期无股指期货投资。

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

本基金本报告期无国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期无国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注**7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形**

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选库以外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	13,294.61
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	75,409.12
8	其他	-
9	合计	88,703.73

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中无流通受限的股票。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002288	*ST 超华	0.00	0.00	重大事项停牌
2	002308	威创股份	0.00	0.00	重大事项停牌

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
847	78,246.09	29,615,331.00	44.69	36,659,104.00	55.31

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	信泰人寿保险股份有限公司—传统产品	9,934,600.00	14.99
2	方正证券股份有限公司	5,549,981.00	8.37
3	招商证券股份有限公司	4,851,855.00	7.32
4	国泰君安证券股份有限公司	4,214,921.00	6.36
5	李春艳	2,062,200.00	3.11
6	常利芳	2,000,077.00	3.02
7	杨丹彤	2,000,038.00	3.02
8	广发证券股份有限公司	1,944,428.00	2.93
9	中国银河证券股份有限公司	1,315,940.00	1.99
10	丁王云心	1,020,039.00	1.54

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	15,000.00	0.0226

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2023年8月25日） 基金份额总额	1,113,274,435.00
本报告期期初基金份额总额	111,274,435.00
本报告期基金总申购份额	51,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	96,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	66,274,435.00

§ 10 重大事件揭示**10.1 基金份额持有人大会决议**

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人无重大人事变动。

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产的诉讼事项。

本报告期内，无涉及基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘用普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，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 (%)	
中信证券	2	96,116,481.83	70.45	70,730.32	70.45	-
国投证券	1	32,328,934.74	23.70	23,790.92	23.70	-
信达证券	1	7,325,276.17	5.37	5,390.74	5.37	-
东吴证券	1	662,416.31	0.49	487.54	0.49	-
银河证券	3	-	-	-	-	-

注：1 基金交易单元的选择标准如下：

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

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
中信证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-

信达证 券	-	-	-	-	-	-
东吴证 券	-	-	-	-	-	-
银河证 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	关于指定证券投资基金主流动性服务商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024年01月03日
2	平安基金管理有限公司关于提醒投资者及时完善、更新身份信息资料以免影响业务办理的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024年01月15日
3	平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2024年01月22日
4	平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2024年01月30日
5	平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书更新	中国证监会规定报刊及网站	2024年01月31日
6	平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定报刊及网站	2024年01月31日
7	平安基金管理有限公司关于旗下基金新增长江证券股份有限公司为申购赎回代办机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024年02月08日
8	平安基金管理有限公司关于旗下基金新增国金证券股份有限公司为申购赎回代办机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024年03月21日
9	平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金 2023 年年度报告	中国证监会规定报刊及网站	2024年03月29日
10	关于平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商终止的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024年04月12日
11	关于平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商终止的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024年04月16日
12	平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2024年04月22日
13	平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定报刊及网站	2024年05月31日
14	平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会规定报刊及网站	2024年05月31日
15	关于调整平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金主流动性服务商	中国证监会规定报刊及网站	2024年06月25日

	的公告		
16	平安基金管理有限公司关于旗下基金估值调整情况的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 06 月 28 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金募集注册的文件
- (2) 平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同
- (3) 平安国证 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、营业执照和公司章程

12.2 存放地点

深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层

12.3 查阅方式

- (1) 投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件
- (2) 投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人平安基金管理有限公司，客户服务电话：400-800-4800（免长途话费）

平安基金管理有限公司

2024 年 8 月 30 日