

嘉实中证 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：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中信证券股份有限公司

送出日期：2024 年 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。本中期报告已经由全部独立董事签字同意，并由代董事长签发。

基金托管人中信证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 08 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 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	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	11
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	11
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	14
6.4 报表附注	15
§ 7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况	34
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	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	60
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	61

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	61
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	61
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	61
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	61
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	61
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	61
7.12 投资组合报告附注	62
§ 8 基金份额持有人信息	63
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	63
8.2 期末上市基金前十名持有人	63
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	63
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	63
§ 9 开放式基金份额变动	64
§ 10 重大事件揭示	64
10.1 基金份额持有人大会决议	64
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	64
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	64
10.4 基金投资策略的改变	64
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	64
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	64
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	65
10.8 其他重大事件	65
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	66
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	66
§ 12 备查文件目录	66
12.1 备查文件目录	66
12.2 存放地点	67
12.3 查阅方式	67

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	嘉实中证 2000ETF
场内简称	中证 2000ETF 指数
基金主代码	159535
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023 年 9 月 14 日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中信证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	25,981,088.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2023 年 9 月 22 日

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		嘉实基金管理有限公司	中信证券股份有限公司
信息披露	姓名	胡勇钦	杨军智

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

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
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	-3,245,355.26
本期利润	-4,979,298.94
加权平均基金份额本期利润	-0.1149
本期加权平均净值利润率	-12.87%
本期基金份额净值增长率	-19.33%
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	-4,573,087.86
期末可供分配基金份额利润	-0.1760
期末基金资产净值	21,408,000.14
期末基金份额净值	0.8240
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	-17.60%

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

（2）上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低

于所列数字。

(3) 期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

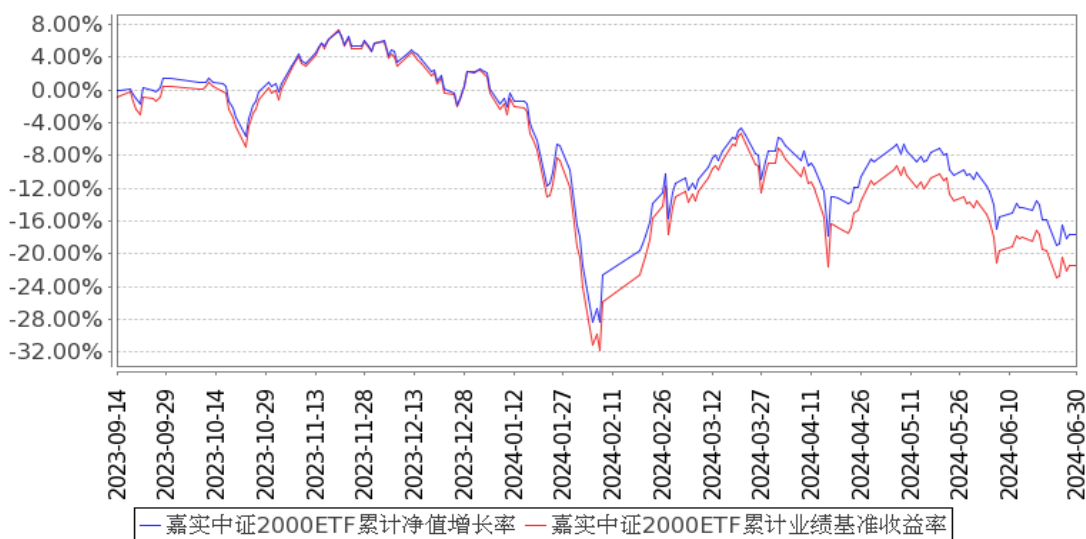
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-8.28%	1.67%	-9.15%	1.85%	0.87%	-0.18%
过去三个月	-10.93%	1.77%	-13.75%	2.01%	2.82%	-0.24%
过去六个月	-19.33%	2.26%	-23.28%	2.50%	3.95%	-0.24%
自基金合同生效起至今	-17.60%	1.87%	-21.51%	2.08%	3.91%	-0.21%

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

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

(2023年09月14日至2024年06月30日)



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

(2) 按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起 6 个月为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截止 2024 年 6 月 30 日，基金管理人共管理 351 只公募基金，覆盖主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、资产配置、海外投资、FOF、基础设施基金等不同类别。同时，还管理多个全国社保、基本养老保险、企业年金、职业年金和单一/集合资产管理计划。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李直	本基金、嘉实基本面 50 指数 (LOF)、嘉实深证基本面 120ETF、嘉实深证基本面 120ETF 联接、嘉实中证 500ETF、嘉实中证 500ETF 联接、嘉实基本面 50ETF、嘉实中证大农业 ETF、嘉实恒生科技 ETF (QDII)、嘉实中证科创创业	2023 年 9 月 14 日	-	9 年	2014 年 7 月加入嘉实基金管理有限公司，从事指数基金投资研究工作，现任基金经理。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。

	50ETF、嘉实中证新能源汽车指数、嘉实中证科创创业50ETF 发起联接、嘉实中证光伏产业指数发起式、嘉实中证大农业 ETF 发起联接、嘉实标普石油天然气勘探及生产精选行业 ETF (QDII)、嘉实中证100ETF 基金经理				
--	---	--	--	--	--

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

（2）证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、

严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现；通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控，公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的，合计 9 次，均为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，未发现不公平交易和利益输送行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪中证 2000 指数，中证 2000 指数从沪深市场中选取市值规模较小且流动性较好的 2000 只证券作为指数样本。中证 2000 与沪深 300、中证 500 和中证 1000 指数共同构成中证规模指数系列，反映沪深市场不同市值规模上市公司证券的整体表现。本基金主要采用抽样复制法及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。

回顾上半年，经济基本面呈现弱复苏态势。1-2 月信贷弱于预期，但制造业开始回暖；3-4 月制造业景气持续上升，出口改善拉动需求，经济超预期恢复；5、6 月制造业 PMI 稍有回落，至荣枯线以下，表明前期稳增长政策落地效果仍有待显现。市场走势方面，呈现为总体波动背景下的结构性行情：年初股市受到了较大的流动性冲击，但在大规模财政资金落地、出口持续改善、暂停新增转融通规模的影响下于春节后迅速恢复，超跌板块大都迎来反弹行情；近期制造业整体热度减退，但在消费电子需求提振、出口韧性及稳增长逻辑支持下，相关板块均有较好表现。回顾上半年海外经济，2 月美国 PCE 价格指数同比小幅反弹，但核心 PCE 同比延续降温趋势，符合市场预期。在 4 月数据不及预期后，5 月、6 月制造业 PMI 均低于预期，表明美国制造业活动持续疲软。与此同时，美国通胀数据呈现降温趋势，市场降息预期抬升，市场整体上行。

作为 ETF 基金，本基金秉承指数化投资策略，积极应对成份股调整、基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击，力争降低基金的跟踪误差。

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 0.8240 元；本报告期基金份额净值增长率为-19.33%，业绩比较基准收益率为-23.28%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

4.6 管理人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》及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基金资产估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求，履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，研究、指导基金估值业务。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，具备投研、风险管理、基金估值运作、法律合规等方面的专业胜任能力。

本基金管理人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，与估值相关的机构包括基金投资市场的证券交易场所以及境内相关机构等。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期，本基金未实施利润分配，符合法律法规和基金合同的相关约定。具体参见本报告“6.4.11 利润分配情况”。

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，本基金存在连续 20 个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，时间范围为 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 2 月 7 日，2024 年 2 月 28 日至 2024 年 5 月 6 日，2024 年 5 月 8 日至 2024 年 6 月 30 日；未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满两百人的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告期，由嘉实基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关嘉实中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内

容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：嘉实中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：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	888,578.41	1,211,531.67
结算备付金		191,862.48	261,856.81
存出保证金		41,311.58	378,709.58
交易性金融资产	6.4.7.2	20,373,068.93	43,388,083.47
其中：股票投资		20,373,068.93	43,364,363.21
基金投资		-	-
债券投资		-	23,720.26
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		21,494,821.40	45,240,181.53
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		-	92,519.60
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		9,415.57	22,811.55
应付托管费		1,883.13	4,562.32
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	75,522.56	197,397.19
负债合计		86,821.26	317,290.66
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	25,981,088.00	43,981,088.00
未分配利润	6.4.7.12	-4,573,087.86	941,802.87
净资产合计		21,408,000.14	44,922,890.87
负债和净资产总计		21,494,821.40	45,240,181.53

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.8240 元，基金份额总额 25,981,088.00 份。

6.2 利润表

会计主体：嘉实中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：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		-4,820,567.73
1. 利息收入		15,882.56
其中：存款利息收入	6.4.7.13	15,882.56
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）		-3,225,025.44
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-3,500,362.78
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	7,049.65
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	268,287.69
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	-1,733,943.68
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	122,518.83
减：二、营业总支出		158,731.21
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	100,309.14
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	6.4.10.2.2	20,061.82
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	6.4.7.22	-
7. 税金及附加		-
8. 其他费用	6.4.7.23	38,360.25
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-4,979,298.94
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-4,979,298.94
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-4,979,298.94

6.3 净资产变动表

会计主体：嘉实中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：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	43,981,088.00	-	941,802.87	44,922,890.87
二、本期期初净资产	43,981,088.00	-	941,802.87	44,922,890.87
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-18,000,000.00	-	-5,514,890.73	-23,514,890.73
（一）、综合收益总额	-	-	-4,979,298.94	-4,979,298.94
（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）	-18,000,000.00	-	-535,591.79	-18,535,591.79

其中：1. 基金申购款	111,000,000.00	-	-17,285,417.67	93,714,582.33
2. 基金赎回款	-129,000,000.00	-	16,749,825.88	-112,250,174.12
(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	25,981,088.00	-	-4,573,087.86	21,408,000.14

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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

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》、《嘉实中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示

的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

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

本基金本报告期未发生会计估计变更。

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》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府

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

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

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

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

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

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	888,578.41
等于：本金	888,186.66
加：应计利息	391.75
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	888,578.41

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	22,349,883.39	-	20,373,068.93	-1,976,814.46
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	22,349,883.39	-	20,373,068.93	-1,976,814.46

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

无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

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。

6.4.7.4.3 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

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

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

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

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	37,162.31
其中：交易所市场	37,162.31
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	38,360.25
合计	75,522.56

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	43,981,088.00	43,981,088.00
本期申购	111,000,000.00	111,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-129,000,000.00	-129,000,000.00
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	25,981,088.00	25,981,088.00

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

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	2,613,157.23	-1,671,354.36	941,802.87
本期期初	2,613,157.23	-1,671,354.36	941,802.87
本期利润	-3,245,355.26	-1,733,943.68	-4,979,298.94
本期基金份额交易产生的变动数	1,158,040.60	-1,693,632.39	-535,591.79
其中：基金申购款	2,595,104.93	-19,880,522.60	-17,285,417.67
基金赎回款	-1,437,064.33	18,186,890.21	16,749,825.88
本期已分配利润	-	-	-
本期末	525,842.57	-5,098,930.43	-4,573,087.86

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	12,494.76
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	1,452.46
其他	1,935.34
合计	15,882.56

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	-1,263,764.24
股票投资收益——赎回差价收入	-2,236,598.54
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	-3,500,362.78
----	---------------

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	66,623,514.19
减：卖出股票成本总额	67,762,151.40
减：交易费用	125,127.03
买卖股票差价收入	-1,263,764.24

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	112,250,174.12
减：现金支付赎回款总额	38,976,334.12
减：赎回股票成本总额	75,510,438.54
减：交易费用	-
赎回差价收入	-2,236,598.54

6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

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

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	5.35
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	7,044.30
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	7,049.65

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	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	53,152.91

额	
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	46,100.00
减：应计利息总额	6.49
减：交易费用	2.12
买卖债券差价收入	7,044.30

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

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

无。

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

无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

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

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

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

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

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	268,287.69
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	268,287.69

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	-1,733,943.68
股票投资	-1,732,624.56
债券投资	-1,319.12
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-1,733,943.68

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	122,518.83
合计	122,518.83

6.4.7.22 信用减值损失

无。

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	19,917.90
信息披露费	18,442.35
证券出借违约金	-
合计	38,360.25

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

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

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
嘉实基金管理有限公司（“嘉实基金”）	基金管理人
中信证券股份有限公司（“中信证券”）	基金托管人

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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（%）
中信证券股份有限公司	129,304,190.41	100.00

6.4.10.1.2 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（%）
中信证券股份有限公司	53,152.91	100.00

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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 (%)
中信证券股份有 限公司	83,516.56	100.00	37,162.31	100.00

注：上述佣金按市场佣金率计算。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

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	100,309.14
其中：应支付销售机构的客户维护 费	10,130.75
应支付基金管理人的净管理费	90,178.39

注：1. 支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.50%/当年天数。

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

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	20,061.82

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

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 (%)
中信证券	345,459.00	1.33	2,691,215.00	6.12

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
中信证券股份有限公司_活期	888,578.41	12,494.76

注：本基金的上述存款，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

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本期（2024年1月1日至2024年6月30日），本基金未实施利润分配。

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

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000040	东旭蓝天	2024年5月6日	重大事项停牌	2.41	2024年7月9日	2.29	5,400	16,854.30	13,014.00	-
002308	威创股份	2024年5月6日	重大事项停牌	1.97	2024年7月9日	1.87	3,500	10,186.37	6,895.00	-
000836	ST富通	2024年6月18日	重大事项停牌	0.37	-	-	13,200	25,968.18	4,884.00	-
002288	*ST超华	2024年6月27日	重大事项停牌	0.37	-	-	8,600	25,563.00	3,182.00	-

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

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

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

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

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

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

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同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	23,720.26
未评级	-	-

合计	-	23,720.26
----	---	-----------

注：评级取自第三方评级机构。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

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

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

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相关法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%。本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

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

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

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	888,578.41	-	-	-	888,578.41
结算备付金	191,862.48	-	-	-	191,862.48
存出保证金	41,311.58	-	-	-	41,311.58
交易性金融资产	-	-	-	20,373,068.93	20,373,068.93
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,121,752.47	-	-	20,373,068.93	21,494,821.40
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	9,415.57	9,415.57
应付托管费	-	-	-	1,883.13	1,883.13

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	-	-	-	75,522.56	75,522.56
负债总计	-	-	-	86,821.26	86,821.26
利率敏感度缺口	1,121,752.47	-	-	20,286,247.67	21,408,000.14
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	1,211,531.67	-	-	-	1,211,531.67
结算备付金	261,856.81	-	-	-	261,856.81
存出保证金	378,709.58	-	-	-	378,709.58
交易性金融资产	-	-	23,720.26	43,364,363.21	43,388,083.47
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,852,098.06	-	23,720.26	43,364,363.21	45,240,181.53
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	92,519.60	92,519.60
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	22,811.55	22,811.55
应付托管费	-	-	-	4,562.32	4,562.32
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	197,397.19	197,397.19
负债总计	-	-	-	317,290.66	317,290.66
利率敏感度缺口	1,852,098.06	-	23,720.26	43,047,072.55	44,922,890.87

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	市场利率上升 25 个基点	-	-339.69
市场利率下降 25 个基点	-	345.51	

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 外汇风险敞口

无。

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	所有外币相对人民币升值 5%	-	-
所有外币相对人民币贬值 5%	-	-	

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票、债券及基金，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降

低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

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	20,373,068.93	95.17	43,364,363.21	96.53
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	20,373,068.93	95.17	43,364,363.21	96.53

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	963,452.03	2,002,635.85
	业绩比较基准下降5%	-963,452.03	-2,002,635.85

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	20,345,093.93	43,370,082.74
第二层次	27,975.00	18,000.73
第三层次	-	-
合计	20,373,068.93	43,388,083.47

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产或金融负债（上年度末：无）。

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以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

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	20,373,068.93	94.78
	其中：股票	20,373,068.93	94.78
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	1,080,440.89	5.03
8	其他各项资产	41,311.58	0.19
9	合计	21,494,821.40	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

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	116,774.00	0.55
B	采矿业	200,027.00	0.93
C	制造业	14,205,427.95	66.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	461,137.00	2.15
E	建筑业	294,995.00	1.38
F	批发和零售业	866,506.20	4.05
G	交通运输、仓储和邮政业	401,987.60	1.88
H	住宿和餐饮业	73,018.00	0.34
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,766,887.38	8.25
J	金融业	45,606.00	0.21
K	房地产业	423,541.00	1.98
L	租赁和商务服务业	411,707.40	1.92
M	科学研究和技术服务业	439,699.55	2.05
N	水利、环境和公共设施管理业	296,354.05	1.38
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	86,985.00	0.41

Q	卫生和社会工作	17,168.00	0.08
R	文化、体育和娱乐业	234,698.80	1.10
S	综合	-	-
	合计	20,342,519.93	95.02

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	17,535.00	0.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,014.00	0.06
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	30,549.00	0.14

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300181	佐力药业	6,200	93,744.00	0.44

2	600133	东湖高新	8,300	86,652.00	0.40
3	300098	高新兴	17,300	76,639.00	0.36
4	002073	软控股份	10,200	75,378.00	0.35
5	601020	华钰矿业	5,400	69,120.00	0.32
6	600114	东睦股份	4,600	66,194.00	0.31
7	000589	贵州轮胎	12,300	62,361.00	0.29
8	300779	惠城环保	1,280	61,952.00	0.29
9	600094	大名城	15,300	59,211.00	0.28
10	688766	普冉股份	608	59,079.36	0.28
11	002654	万润科技	5,400	58,590.00	0.27
12	603859	能科科技	2,716	57,090.32	0.27
13	000680	山推股份	6,100	56,547.00	0.26
14	300360	炬华科技	3,300	56,100.00	0.26
15	002106	莱宝高科	5,100	55,590.00	0.26
16	000526	学大教育	900	55,440.00	0.26
17	000099	中信海直	3,400	55,216.00	0.26
18	300255	常山药业	5,500	55,110.00	0.26
19	600200	江苏吴中	6,100	54,656.00	0.26
20	603496	恒为科技	2,200	53,790.00	0.25
21	300401	花园生物	3,700	53,058.00	0.25
22	603018	华设集团	5,600	50,904.00	0.24
23	300025	华星创业	4,800	50,496.00	0.24
24	601500	通用股份	9,400	50,196.00	0.23
25	002031	巨轮智能	22,100	50,167.00	0.23
26	603619	中曼石油	2,100	49,182.00	0.23
27	300053	航宇微	5,300	48,283.00	0.23
28	002922	伊戈尔	2,200	48,092.00	0.22
29	002533	金杯电工	4,800	47,760.00	0.22
30	300048	合康新能	10,300	47,689.00	0.22
31	002039	黔源电力	2,700	47,520.00	0.22
32	600894	广日股份	4,100	47,150.00	0.22
33	301096	百诚医药	800	46,464.00	0.22
34	002045	国光电器	3,400	46,342.00	0.22
35	002338	奥普光电	1,400	46,228.00	0.22
36	000612	焦作万方	7,100	46,150.00	0.22
37	002947	恒铭达	1,300	45,760.00	0.21
38	300353	东土科技	6,200	45,322.00	0.21
39	600866	星湖科技	8,200	45,264.00	0.21
40	002379	宏创控股	7,700	45,122.00	0.21
41	002334	英威腾	7,500	44,850.00	0.21
42	300548	博创科技	2,300	44,827.00	0.21
43	300290	荣科科技	4,800	44,688.00	0.21
44	002611	东方精工	8,500	44,625.00	0.21

45	000777	中核科技	2,900	44,312.00	0.21
46	603516	淳中科技	1,400	44,198.00	0.21
47	002716	湖南白银	14,100	43,851.00	0.20
48	300041	回天新材	5,500	43,670.00	0.20
49	300825	阿尔特	4,500	43,605.00	0.20
50	300184	力源信息	9,400	43,522.00	0.20
51	600789	鲁抗医药	6,200	43,400.00	0.20
52	002455	百川股份	4,700	43,146.00	0.20
53	600105	永鼎股份	11,500	42,780.00	0.20
54	002102	能特科技	18,200	42,406.00	0.20
55	600525	长园集团	9,800	41,748.00	0.20
56	002322	理工能科	2,600	41,652.00	0.19
57	300131	英唐智控	9,300	41,385.00	0.19
58	603050	科林电气	1,700	41,242.00	0.19
59	002327	富安娜	4,000	40,200.00	0.19
59	300494	盛天网络	4,000	40,200.00	0.19
60	002559	亚威股份	5,200	39,832.00	0.19
61	300008	天海防务	10,100	39,794.00	0.19
62	300429	强力新材	3,500	39,760.00	0.19
63	603227	雪峰科技	6,400	39,680.00	0.19
64	002512	达华智能	11,500	39,675.00	0.19
65	300174	元力股份	2,900	39,585.00	0.18
66	603738	泰晶科技	2,900	39,556.00	0.18
67	600410	华胜天成	10,200	39,474.00	0.18
68	000922	佳电股份	3,300	39,369.00	0.18
69	600186	莲花控股	11,400	39,102.00	0.18
70	002149	西部材料	2,800	39,088.00	0.18
71	300708	聚灿光电	4,300	38,700.00	0.18
72	600226	亨通股份	19,500	38,415.00	0.18
73	002833	弘亚数控	2,100	38,304.00	0.18
74	600640	国脉文化	3,700	38,295.00	0.18
75	002452	长高电新	4,600	38,088.00	0.18
76	603009	北特科技	2,100	37,653.00	0.18
77	002588	史丹利	5,000	37,650.00	0.18
78	600686	金龙汽车	5,100	37,536.00	0.18
79	000912	泸天化	10,800	37,476.00	0.18
80	002115	三维通信	7,700	37,422.00	0.17
81	002146	荣盛发展	25,100	37,399.00	0.17
82	002386	天原股份	9,700	37,054.00	0.17
83	000036	华联控股	11,400	36,936.00	0.17
84	002965	祥鑫科技	1,200	36,684.00	0.17
85	002170	芭田股份	6,100	36,661.00	0.17
86	300342	天银机电	2,500	36,575.00	0.17

87	300468	四方精创	4,200	36,372.00	0.17
88	600609	金杯汽车	10,400	36,088.00	0.17
89	002510	天汽模	9,200	35,788.00	0.17
90	002438	江苏神通	3,300	35,673.00	0.17
91	600694	大商股份	2,120	35,637.20	0.17
92	600351	亚宝药业	6,300	35,343.00	0.17
93	600987	航民股份	5,000	35,300.00	0.16
94	300790	宇瞳光学	2,600	35,100.00	0.16
95	000521	长虹美菱	4,600	34,868.00	0.16
96	002785	万里石	1,400	34,790.00	0.16
97	300796	贝斯美	2,400	34,728.00	0.16
98	600664	哈药股份	13,100	34,584.00	0.16
99	300872	天阳科技	2,600	34,450.00	0.16
100	600106	重庆路桥	8,000	34,400.00	0.16
101	000949	新乡化纤	10,100	34,340.00	0.16
102	300213	佳讯飞鸿	6,000	34,200.00	0.16
103	300378	鼎捷软件	2,100	34,167.00	0.16
104	600108	亚盛集团	14,400	34,128.00	0.16
105	002521	齐峰新材	2,900	34,075.00	0.16
106	688299	长阳科技	2,654	33,944.66	0.16
107	300304	云意电气	5,200	33,852.00	0.16
108	002035	华帝股份	5,400	33,642.00	0.16
109	300629	新劲刚	1,900	33,554.00	0.16
110	002515	金字火腿	8,800	33,352.00	0.16
111	000948	南天信息	2,700	33,345.00	0.16
112	002437	誉衡药业	19,600	33,320.00	0.16
112	002664	信质集团	2,800	33,320.00	0.16
113	000822	山东海化	5,700	33,231.00	0.16
114	300217	东方电热	8,800	33,176.00	0.15
115	000700	模塑科技	6,300	33,075.00	0.15
116	603035	常熟汽饰	2,600	32,968.00	0.15
117	300007	汉威科技	2,400	32,928.00	0.15
118	300709	精研科技	1,300	32,864.00	0.15
119	603667	五洲新春	2,000	32,800.00	0.15
120	600742	一汽富维	4,400	32,780.00	0.15
121	300047	天源迪科	5,000	32,700.00	0.15
122	002937	兴瑞科技	1,400	32,634.00	0.15
123	603889	新澳股份	4,200	32,508.00	0.15
124	600973	宝胜股份	9,000	32,490.00	0.15
125	000731	四川美丰	4,900	32,487.00	0.15
126	002293	罗莱生活	4,000	32,320.00	0.15
127	002298	中电兴发	7,300	32,266.00	0.15
128	300349	金卡智能	2,700	32,184.00	0.15

129	002449	国星光电	4,500	32,040.00	0.15
130	603111	康尼机电	5,500	32,010.00	0.15
131	301030	仕净科技	1,300	32,006.00	0.15
132	600101	明星电力	2,600	31,980.00	0.15
133	300793	佳禾智能	2,300	31,878.00	0.15
134	300145	中金环境	12,700	31,750.00	0.15
135	002668	TCL 智家	3,500	31,710.00	0.15
136	000888	峨眉山 A	2,900	31,581.00	0.15
137	002707	众信旅游	5,500	31,570.00	0.15
138	688510	航亚科技	1,714	31,554.74	0.15
139	603977	国泰集团	3,100	31,527.00	0.15
140	300607	拓斯达	2,300	31,326.00	0.15
141	688332	中科蓝讯	531	31,323.69	0.15
142	002111	威海广泰	3,000	31,260.00	0.15
143	600425	青松建化	9,500	31,160.00	0.15
144	000925	众合科技	4,700	30,926.00	0.14
145	002255	海陆重工	6,300	30,807.00	0.14
146	300194	福安药业	8,200	30,668.00	0.14
147	000409	云鼎科技	3,800	30,666.00	0.14
148	603590	康辰药业	1,200	30,648.00	0.14
149	688212	澳华内镜	766	30,647.66	0.14
150	002022	科华生物	5,400	30,510.00	0.14
150	600479	千金药业	3,000	30,510.00	0.14
151	300248	新开普	4,700	30,503.00	0.14
152	002935	天奥电子	2,520	30,441.60	0.14
153	603662	柯力传感	1,300	30,342.00	0.14
154	600756	浪潮软件	3,000	30,300.00	0.14
155	600790	轻纺城	9,400	30,268.00	0.14
156	300842	帝科股份	780	30,264.00	0.14
157	688150	莱特光电	1,558	30,225.20	0.14
158	000670	盈方微	6,900	30,153.00	0.14
159	600255	鑫科材料	17,400	30,102.00	0.14
160	002057	中钢天源	4,300	30,100.00	0.14
161	002104	恒宝股份	5,700	30,096.00	0.14
162	002263	大东南	14,500	30,015.00	0.14
163	300377	赢时胜	5,900	29,972.00	0.14
164	002401	中远海科	2,000	29,880.00	0.14
165	002445	中南文化	18,100	29,865.00	0.14
166	000823	超声电子	3,500	29,785.00	0.14
167	000936	华西股份	5,200	29,744.00	0.14
167	002284	亚太股份	4,400	29,744.00	0.14
167	002491	通鼎互联	8,800	29,744.00	0.14
168	002279	久其软件	6,900	29,739.00	0.14

169	002819	东方中科	1,400	29,512.00	0.14
170	300138	晨光生物	3,500	29,505.00	0.14
171	300228	富瑞特装	5,400	29,484.00	0.14
172	603078	江化微	2,200	29,458.00	0.14
173	300239	东宝生物	6,200	29,202.00	0.14
174	002579	中京电子	4,000	29,200.00	0.14
175	002017	东信和平	3,500	29,155.00	0.14
176	002093	国脉科技	4,800	29,136.00	0.14
177	002469	三维化学	5,100	29,070.00	0.14
178	002639	雪人股份	5,800	29,058.00	0.14
179	002876	三利谱	1,200	28,944.00	0.14
180	300541	先进数通	3,220	28,915.60	0.14
181	000501	武商集团	4,300	28,681.00	0.13
182	002406	远东传动	5,800	28,594.00	0.13
183	300326	凯利泰	7,500	28,500.00	0.13
184	300696	爱乐达	1,600	28,400.00	0.13
185	600284	浦东建设	5,300	28,302.00	0.13
186	300435	中泰股份	2,400	28,248.00	0.13
187	002540	亚太科技	5,300	28,037.00	0.13
188	688601	力芯微	641	28,005.29	0.13
189	002733	雄韬股份	2,600	28,002.00	0.13
190	603867	新化股份	1,200	27,996.00	0.13
191	002483	润邦股份	6,200	27,962.00	0.13
192	688305	科德数控	433	27,911.18	0.13
193	600088	中视传媒	1,700	27,829.00	0.13
194	002803	吉宏股份	2,500	27,825.00	0.13
195	300061	旗天科技	6,200	27,776.00	0.13
196	002367	康力电梯	4,800	27,696.00	0.13
197	688049	炬芯科技	1,250	27,650.00	0.13
198	000812	陕西金叶	7,700	27,643.00	0.13
199	600300	维维股份	11,500	27,600.00	0.13
200	002122	汇洲智能	13,200	27,588.00	0.13
201	301263	泰恩康	2,200	27,566.00	0.13
202	600251	冠农股份	3,800	27,512.00	0.13
203	600736	苏州高新	6,600	27,456.00	0.13
204	300193	佳士科技	3,700	27,454.00	0.13
205	300862	蓝盾光电	1,200	27,312.00	0.13
206	000973	佛塑科技	7,400	27,306.00	0.13
207	603611	诺力股份	1,600	27,264.00	0.13
208	603890	春秋电子	3,000	27,180.00	0.13
209	002792	通宇通讯	2,600	27,144.00	0.13
210	002662	京威股份	8,900	27,056.00	0.13
211	600713	南京医药	6,400	27,008.00	0.13

212	300120	经纬辉开	5,200	26,988.00	0.13
213	600979	广安爱众	8,000	26,880.00	0.13
214	300099	尤洛卡	5,900	26,786.00	0.13
215	002392	北京利尔	8,500	26,775.00	0.13
216	600268	国电南自	4,680	26,722.80	0.12
217	600880	博瑞传播	7,100	26,696.00	0.12
218	000707	双环科技	3,900	26,676.00	0.12
219	603686	福龙马	3,500	26,670.00	0.12
220	603191	望变电气	1,800	26,640.00	0.12
221	300566	激智科技	1,900	26,581.00	0.12
222	600628	新世界	4,900	26,558.00	0.12
223	603367	辰欣药业	1,900	26,486.00	0.12
224	002448	中原内配	4,600	26,404.00	0.12
224	300278	华昌达	9,200	26,404.00	0.12
225	000906	浙商中拓	3,900	26,286.00	0.12
226	603507	振江股份	800	26,256.00	0.12
227	002169	智光电气	5,900	26,019.00	0.12
228	002573	清新环境	6,700	25,929.00	0.12
229	002881	美格智能	1,300	25,792.00	0.12
230	605305	中际联合	1,000	25,790.00	0.12
231	002527	新时达	4,300	25,757.00	0.12
232	002570	贝因美	11,000	25,740.00	0.12
232	600035	楚天高速	6,000	25,740.00	0.12
233	000852	石化机械	4,800	25,728.00	0.12
234	002536	飞龙股份	2,700	25,704.00	0.12
235	000507	珠海港	5,800	25,694.00	0.12
236	000096	广聚能源	2,700	25,650.00	0.12
237	001283	豪鹏科技	600	25,620.00	0.12
238	605377	华旺科技	1,920	25,440.00	0.12
239	002046	国机精工	2,500	25,425.00	0.12
240	000717	中南股份	15,000	25,350.00	0.12
241	000652	泰达股份	8,500	25,330.00	0.12
242	002474	榕基软件	5,800	25,288.00	0.12
243	002587	奥拓电子	4,700	25,286.00	0.12
244	300617	安靠智电	900	25,245.00	0.12
245	002880	卫光生物	900	25,218.00	0.12
246	002116	中国海诚	2,700	25,137.00	0.12
247	000523	红棉股份	9,700	25,123.00	0.12
248	002301	齐心集团	5,200	25,116.00	0.12
249	600868	梅雁吉祥	15,500	25,110.00	0.12
250	605016	百龙创园	1,230	25,055.10	0.12
251	300057	万顺新材	6,200	25,048.00	0.12
252	002232	启明信息	1,900	25,042.00	0.12

253	002519	银河电子	5,100	25,041.00	0.12
254	000900	现代投资	6,800	24,888.00	0.12
255	603387	基蛋生物	3,200	24,832.00	0.12
256	600308	华泰股份	7,900	24,806.00	0.12
257	002328	新朋股份	5,300	24,804.00	0.12
258	600318	新力金融	3,900	24,726.00	0.12
258	600794	保税科技	7,800	24,726.00	0.12
259	600353	旭光电子	4,000	24,680.00	0.12
260	603313	梦百合	3,300	24,651.00	0.12
261	600130	波导股份	7,700	24,563.00	0.11
262	002177	御银股份	7,600	24,548.00	0.11
263	600237	铜峰电子	4,700	24,534.00	0.11
264	002523	天桥起重	11,400	24,510.00	0.11
265	300513	恒实科技	3,000	24,450.00	0.11
266	000713	丰乐种业	4,500	24,435.00	0.11
267	600230	沧州大化	2,400	24,312.00	0.11
268	002768	国恩股份	1,300	24,310.00	0.11
269	300453	三鑫医疗	3,800	24,282.00	0.11
270	002376	新北洋	4,500	24,255.00	0.11
271	002067	景兴纸业	8,900	24,208.00	0.11
272	605555	德昌股份	1,300	24,193.00	0.11
273	605086	龙高股份	1,400	24,164.00	0.11
274	300691	联合光电	1,600	24,080.00	0.11
275	002026	山东威达	2,900	24,070.00	0.11
276	002462	嘉事堂	2,200	24,068.00	0.11
277	300531	优博讯	2,300	23,966.00	0.11
278	603668	天马科技	2,110	23,948.50	0.11
279	600846	同济科技	3,500	23,905.00	0.11
280	002543	万和电气	2,400	23,904.00	0.11
281	002870	香山股份	800	23,864.00	0.11
282	000862	银星能源	5,000	23,850.00	0.11
283	002845	同兴达	1,800	23,796.00	0.11
284	600020	中原高速	6,700	23,718.00	0.11
285	601010	文峰股份	13,900	23,630.00	0.11
286	603687	大胜达	3,300	23,628.00	0.11
287	601113	华鼎股份	7,200	23,616.00	0.11
288	002481	双塔食品	6,100	23,607.00	0.11
289	000859	国风新材	6,900	23,598.00	0.11
289	002358	森源电气	6,900	23,598.00	0.11
289	600103	青山纸业	13,800	23,598.00	0.11
290	601579	会稽山	2,300	23,552.00	0.11
291	605108	同庆楼	1,100	23,496.00	0.11
292	600939	重庆建工	10,100	23,432.00	0.11

293	002955	鸿合科技	1,000	23,380.00	0.11
294	000910	大亚圣象	3,800	23,332.00	0.11
295	600345	长江通信	1,300	23,283.00	0.11
296	601700	风范股份	5,300	23,267.00	0.11
297	002083	孚日股份	5,500	23,265.00	0.11
298	603012	创力集团	5,200	23,192.00	0.11
299	300664	鹏鹞环保	5,200	23,140.00	0.11
300	600495	晋西车轴	7,200	23,112.00	0.11
301	300420	五洋自控	10,500	22,995.00	0.11
302	603633	徕木股份	2,900	22,939.00	0.11
303	000541	佛山照明	4,700	22,889.00	0.11
304	600611	大众交通	8,200	22,878.00	0.11
305	603416	信捷电气	800	22,864.00	0.11
306	002538	司尔特	5,100	22,848.00	0.11
307	002297	博云新材	3,800	22,800.00	0.11
308	300231	银信科技	3,100	22,785.00	0.11
309	002033	丽江股份	2,600	22,776.00	0.11
310	300258	精锻科技	2,800	22,764.00	0.11
311	002014	永新股份	2,400	22,752.00	0.11
312	002589	瑞康医药	10,300	22,660.00	0.11
313	688698	伟创电气	839	22,627.83	0.11
314	300121	阳谷华泰	2,900	22,620.00	0.11
315	600592	龙溪股份	2,600	22,542.00	0.11
316	601226	华电重工	4,600	22,540.00	0.11
317	688399	硕世生物	333	22,517.46	0.11
318	600590	泰豪科技	5,900	22,479.00	0.11
319	002132	恒星科技	10,600	22,472.00	0.10
320	600054	黄山旅游	2,000	22,440.00	0.10
321	300404	博济医药	2,800	22,428.00	0.10
322	002478	常宝股份	4,500	22,410.00	0.10
323	601339	百隆东方	4,300	22,403.00	0.10
324	600551	时代出版	3,160	22,372.80	0.10
325	002971	和远气体	900	22,302.00	0.10
326	300490	华自科技	3,100	22,196.00	0.10
327	002161	远望谷	4,800	22,176.00	0.10
328	002580	圣阳股份	3,600	22,140.00	0.10
329	300858	科拓生物	1,500	22,080.00	0.10
330	002919	名臣健康	1,900	22,059.00	0.10
331	688519	南亚新材	862	22,041.34	0.10
332	301345	涛涛车业	400	22,040.00	0.10
333	300355	蒙草生态	10,000	22,000.00	0.10
334	603987	康德莱	3,600	21,996.00	0.10
335	300439	美康生物	2,400	21,984.00	0.10

336	600468	百利电气	5,100	21,981.00	0.10
337	300110	华仁药业	7,100	21,939.00	0.10
338	002584	西陇科学	3,900	21,918.00	0.10
339	300173	福能东方	5,800	21,866.00	0.10
340	000404	长虹华意	4,100	21,853.00	0.10
341	000561	烽火电子	3,400	21,794.00	0.10
342	002282	博深股份	3,400	21,726.00	0.10
343	002140	东华科技	2,800	21,700.00	0.10
344	002224	三力士	5,600	21,560.00	0.10
345	002560	通达股份	3,900	21,450.00	0.10
346	000962	东方钨业	2,100	21,441.00	0.10
347	601199	江南水务	4,400	21,428.00	0.10
348	688205	德科立	743	21,405.83	0.10
349	002218	拓日新能	7,500	21,375.00	0.10
350	600229	城市传媒	3,100	21,359.00	0.10
351	600368	五洲交通	5,980	21,348.60	0.10
352	300441	鲍斯股份	3,600	21,348.00	0.10
353	000544	中原环保	2,700	21,249.00	0.10
354	300219	鸿利智汇	3,800	21,242.00	0.10
355	600558	大西洋	5,900	21,240.00	0.10
356	002783	凯龙股份	2,900	21,228.00	0.10
357	603203	快克智能	900	21,222.00	0.10
358	300569	天能重工	5,100	21,216.00	0.10
359	000417	合肥百货	5,100	21,165.00	0.10
360	300683	海特生物	1,000	21,160.00	0.10
361	603626	科森科技	3,800	21,128.00	0.10
362	600616	金枫酒业	4,400	21,120.00	0.10
363	688003	天准科技	644	21,097.44	0.10
364	601968	宝钢包装	4,500	21,060.00	0.10
365	600658	电子城	6,400	21,056.00	0.10
366	002606	大连电瓷	2,800	21,028.00	0.10
367	600469	风神股份	3,600	21,024.00	0.10
368	688550	瑞联新材	906	21,010.14	0.10
369	301191	菲菱科思	300	20,991.00	0.10
370	601008	连云港	6,100	20,984.00	0.10
371	000551	创元科技	2,400	20,952.00	0.10
372	002189	中光学	1,500	20,910.00	0.10
373	603990	麦迪科技	2,400	20,904.00	0.10
374	300532	今天国际	1,700	20,893.00	0.10
375	600830	香溢融通	3,000	20,880.00	0.10
376	300291	百纳千成	4,900	20,874.00	0.10
377	688320	禾川科技	849	20,834.46	0.10
378	601588	北辰实业	15,400	20,790.00	0.10

379	688733	壹石通	1,388	20,750.60	0.10
380	002342	巨力索具	7,200	20,736.00	0.10
381	002454	松芝股份	3,700	20,683.00	0.10
382	600619	海立股份	4,000	20,680.00	0.10
383	600293	三峡新材	8,300	20,667.00	0.10
384	002369	卓翼科技	5,600	20,664.00	0.10
385	002759	天际股份	3,000	20,640.00	0.10
386	000926	福星股份	6,500	20,605.00	0.10
387	002350	北京科锐	3,500	20,580.00	0.10
388	300996	普联软件	1,400	20,538.00	0.10
389	300802	矩子科技	1,300	20,501.00	0.10
390	300241	瑞丰光电	5,000	20,500.00	0.10
391	002788	鹭燕医药	2,600	20,488.00	0.10
392	002757	南兴股份	1,700	20,485.00	0.10
393	301051	信濠光电	780	20,459.40	0.10
394	688589	力合微	810	20,420.10	0.10
395	603158	腾龙股份	2,900	20,416.00	0.10
396	000905	厦门港务	3,600	20,340.00	0.10
397	300835	龙磁科技	700	20,335.00	0.09
398	000531	穗恒运 A	3,800	20,330.00	0.09
399	002565	顺灏股份	8,500	20,315.00	0.09
400	000554	泰山石油	4,000	20,280.00	0.09
401	603518	锦泓集团	2,300	20,240.00	0.09
402	688085	三友医疗	1,194	20,178.60	0.09
403	002029	七匹狼	4,000	20,160.00	0.09
404	002380	科远智慧	1,100	20,130.00	0.09
404	600218	全柴动力	3,000	20,130.00	0.09
405	002829	星网宇达	1,500	20,085.00	0.09
406	300893	松原股份	700	19,999.00	0.09
407	002471	中超控股	10,200	19,890.00	0.09
408	002277	友阿股份	9,200	19,872.00	0.09
409	000159	国际实业	3,800	19,836.00	0.09
409	603600	永艺股份	1,900	19,836.00	0.09
410	600523	贵航股份	2,000	19,800.00	0.09
411	603408	建霖家居	1,500	19,785.00	0.09
412	603610	麒盛科技	2,000	19,760.00	0.09
413	002669	康达新材	2,400	19,752.00	0.09
414	002765	蓝黛科技	4,200	19,740.00	0.09
415	002752	昇兴股份	3,900	19,734.00	0.09
415	600052	东望时代	4,600	19,734.00	0.09
416	300384	三联虹普	1,500	19,680.00	0.09
417	688391	钜泉科技	672	19,602.24	0.09
418	300066	三川智慧	6,800	19,448.00	0.09

419	301018	申菱环境	1,000	19,440.00	0.09
420	688401	路维光电	740	19,388.00	0.09
421	603258	电魂网络	1,200	19,380.00	0.09
422	002479	富春环保	5,500	19,360.00	0.09
423	002345	潮宏基	4,100	19,352.00	0.09
424	301270	汉仪股份	800	19,304.00	0.09
425	603061	金海通	300	19,284.00	0.09
426	002522	浙江众成	6,100	19,276.00	0.09
427	688025	杰普特	477	19,266.03	0.09
428	600798	宁波海运	7,100	19,241.00	0.09
429	603698	航天工程	1,600	19,152.00	0.09
430	002165	红宝丽	5,800	19,140.00	0.09
430	600721	百花医药	3,300	19,140.00	0.09
431	603520	司太立	2,000	19,080.00	0.09
432	300485	赛升药业	3,100	19,034.00	0.09
433	002398	垒知集团	5,100	18,972.00	0.09
434	002441	众业达	2,500	18,950.00	0.09
435	603223	恒通股份	2,900	18,908.00	0.09
436	300510	金冠股份	5,400	18,900.00	0.09
436	600512	腾达建设	10,000	18,900.00	0.09
437	600576	祥源文旅	4,300	18,877.00	0.09
438	300571	平治信息	900	18,846.00	0.09
439	002614	奥佳华	3,400	18,802.00	0.09
440	300094	国联水产	7,400	18,796.00	0.09
441	002562	兄弟科技	6,300	18,774.00	0.09
442	600405	动力源	5,200	18,772.00	0.09
443	600708	光明地产	10,700	18,725.00	0.09
444	603386	骏亚科技	1,500	18,720.00	0.09
445	688181	八亿时空	987	18,703.65	0.09
446	688133	泰坦科技	1,182	18,651.96	0.09
447	688628	优利德	569	18,646.13	0.09
448	601616	广电电气	6,400	18,624.00	0.09
449	688306	均普智能	4,576	18,578.56	0.09
450	300833	浩洋股份	400	18,560.00	0.09
451	000607	华媒控股	6,000	18,540.00	0.09
452	600784	鲁银投资	3,900	18,486.00	0.09
453	300230	永利股份	5,500	18,480.00	0.09
454	688135	利扬芯片	1,152	18,455.04	0.09
455	603119	浙江荣泰	1,040	18,428.80	0.09
456	300639	凯普生物	4,000	18,400.00	0.09
457	600537	亿晶光电	7,300	18,396.00	0.09
458	301391	卡莱特	420	18,387.60	0.09
459	000705	浙江震元	2,600	18,382.00	0.09

459	601929	吉视传媒	20,200	18,382.00	0.09
460	688259	创耀科技	460	18,381.60	0.09
461	002095	生意宝	1,500	18,360.00	0.09
461	002344	海宁皮城	6,000	18,360.00	0.09
462	300976	达瑞电子	400	18,340.00	0.09
463	002303	美盈森	7,600	18,316.00	0.09
464	688377	迪威尔	1,396	18,287.60	0.09
465	300160	秀强股份	3,900	18,252.00	0.09
466	600288	大恒科技	2,800	18,228.00	0.09
467	600982	宁波能源	5,100	18,207.00	0.09
468	300095	华伍股份	3,300	18,183.00	0.08
469	000789	万年青	4,000	18,160.00	0.08
470	002866	传艺科技	1,400	18,018.00	0.08
471	000510	新金路	6,500	18,005.00	0.08
472	600636	国新文化	2,400	18,000.00	0.08
472	603912	佳力图	3,000	18,000.00	0.08
473	301330	熵基科技	800	17,984.00	0.08
474	002285	世联行	11,300	17,967.00	0.08
475	002685	华东重机	7,600	17,860.00	0.08
476	300662	科锐国际	1,100	17,743.00	0.08
477	002912	中新赛克	1,000	17,720.00	0.08
478	603887	城地香江	3,400	17,714.00	0.08
479	688176	亚虹医药	3,458	17,670.38	0.08
480	002364	中恒电气	3,200	17,600.00	0.08
481	600731	湖南海利	3,800	17,556.00	0.08
482	600419	天润乳业	2,200	17,534.00	0.08
483	603189	网达软件	1,600	17,504.00	0.08
484	000797	中国武夷	7,500	17,475.00	0.08
485	002480	新筑股份	5,600	17,472.00	0.08
486	300815	玉禾田	1,500	17,460.00	0.08
487	002181	粤传媒	5,400	17,442.00	0.08
488	300572	安车检测	1,500	17,430.00	0.08
489	002300	太阳电缆	3,300	17,424.00	0.08
490	600560	金自天正	1,300	17,420.00	0.08
491	600851	海欣股份	3,800	17,366.00	0.08
492	300870	欧陆通	400	17,352.00	0.08
493	601065	江盐集团	2,000	17,340.00	0.08
494	002641	公元股份	4,400	17,292.00	0.08
495	600152	维科技术	3,600	17,280.00	0.08
496	300516	久之洋	600	17,226.00	0.08
497	000153	丰原药业	3,200	17,216.00	0.08
498	002918	蒙娜丽莎	1,900	17,214.00	0.08
499	002442	龙星化工	4,000	17,200.00	0.08

500	301103	何氏眼科	800	17,168.00	0.08
501	600429	三元股份	4,600	17,158.00	0.08
502	600730	中国高科	4,300	17,157.00	0.08
503	002636	金安国纪	2,700	17,145.00	0.08
504	002186	全聚德	2,000	17,140.00	0.08
505	002184	海得控制	1,900	17,062.00	0.08
505	300608	思特奇	1,900	17,062.00	0.08
506	600629	华建集团	3,900	17,004.00	0.08
507	000816	智慧农业	11,400	16,986.00	0.08
508	000919	金陵药业	2,700	16,902.00	0.08
509	301525	儒竞科技	300	16,884.00	0.08
509	600292	远达环保	3,600	16,884.00	0.08
510	002695	煌上煌	2,600	16,874.00	0.08
511	300425	中建环能	4,000	16,840.00	0.08
512	000882	华联股份	18,100	16,833.00	0.08
513	000055	方大集团	4,800	16,800.00	0.08
513	600222	太龙药业	4,000	16,800.00	0.08
513	600594	益佰制药	5,600	16,800.00	0.08
514	002381	双箭股份	2,500	16,775.00	0.08
515	603138	海量数据	1,600	16,768.00	0.08
516	688699	明微电子	528	16,764.00	0.08
517	002393	力生制药	1,060	16,758.60	0.08
518	605128	上海沿浦	600	16,734.00	0.08
519	300259	新天科技	6,600	16,698.00	0.08
519	600279	重庆港	4,600	16,698.00	0.08
520	600526	菲达环保	4,500	16,695.00	0.08
521	301282	金禄电子	700	16,646.00	0.08
522	601089	福元医药	1,200	16,620.00	0.08
523	600187	国中水务	12,100	16,577.00	0.08
524	601368	绿城水务	4,100	16,564.00	0.08
525	300018	中元股份	3,600	16,560.00	0.08
526	300792	壹网壹创	1,100	16,555.00	0.08
527	601007	金陵饭店	2,600	16,536.00	0.08
528	603309	维力医疗	1,500	16,515.00	0.08
529	600067	冠城大通	9,400	16,450.00	0.08
530	000407	胜利股份	6,300	16,443.00	0.08
531	600283	钱江水利	1,300	16,432.00	0.08
532	002758	浙农股份	2,100	16,422.00	0.08
533	000850	华茂股份	5,400	16,416.00	0.08
534	002208	合肥城建	3,800	16,378.00	0.08
535	002196	方正电机	3,900	16,341.00	0.08
536	002953	日丰股份	2,080	16,307.20	0.08
536	300852	四会富仕	560	16,307.20	0.08

537	000530	冰山冷热	4,500	16,290.00	0.08
538	603396	金辰股份	500	16,235.00	0.08
539	300560	中富通	1,500	16,230.00	0.08
540	688609	九联科技	1,839	16,219.98	0.08
541	002360	同德化工	3,200	16,192.00	0.08
542	301150	中一科技	900	16,173.00	0.08
543	002885	京泉华	1,500	16,170.00	0.08
544	600184	光电股份	1,900	16,169.00	0.08
545	600892	大晟文化	4,000	16,160.00	0.08
546	000920	沃顿科技	2,200	16,126.00	0.08
547	300445	康斯特	1,000	16,100.00	0.08
548	600876	凯盛新能	1,700	16,048.00	0.07
549	000045	深纺织 A	2,000	16,040.00	0.07
550	002933	新兴装备	700	16,037.00	0.07
551	600327	大东方	5,000	16,000.00	0.07
552	002375	亚厦股份	4,900	15,925.00	0.07
553	300632	光莆股份	1,600	15,920.00	0.07
554	600622	光大嘉宝	8,600	15,910.00	0.07
555	300938	信测标准	800	15,904.00	0.07
556	603107	上海汽配	1,000	15,890.00	0.07
557	688035	德邦科技	493	15,884.46	0.07
558	688068	热景生物	614	15,859.62	0.07
559	605050	福然德	1,800	15,858.00	0.07
560	300504	天邑股份	1,300	15,847.00	0.07
561	000428	华天酒店	5,700	15,846.00	0.07
562	002554	惠博普	7,300	15,841.00	0.07
563	603648	畅联股份	2,000	15,840.00	0.07
564	300491	通合科技	1,100	15,796.00	0.07
565	603897	长城科技	900	15,795.00	0.07
566	600488	津药药业	4,600	15,778.00	0.07
567	603630	拉芳家化	1,500	15,765.00	0.07
568	603825	华扬联众	1,700	15,759.00	0.07
569	600617	国新能源	6,300	15,750.00	0.07
570	688233	神工股份	816	15,724.32	0.07
571	688678	福立旺	1,448	15,681.84	0.07
572	688579	山大地纬	1,997	15,676.45	0.07
573	603365	水星家纺	1,000	15,650.00	0.07
574	301101	明月镜片	700	15,638.00	0.07
574	603538	美诺华	1,400	15,638.00	0.07
575	601218	吉鑫科技	5,600	15,624.00	0.07
576	600135	乐凯胶片	3,200	15,616.00	0.07
577	603999	读者传媒	3,300	15,609.00	0.07
578	688207	格灵深瞳	1,360	15,599.20	0.07

579	605066	天正电气	2,800	15,596.00	0.07
580	002660	茂硕电源	2,100	15,582.00	0.07
581	002337	赛象科技	4,100	15,580.00	0.07
582	300951	博硕科技	500	15,575.00	0.07
583	300245	天玑科技	2,900	15,573.00	0.07
584	002864	盘龙药业	600	15,528.00	0.07
585	301302	华如科技	900	15,525.00	0.07
586	000698	沈阳化工	5,100	15,504.00	0.07
587	301379	天山电子	840	15,489.60	0.07
588	002443	金洲管道	2,900	15,486.00	0.07
589	000655	金岭矿业	2,800	15,484.00	0.07
590	603339	四方科技	1,700	15,419.00	0.07
591	301093	华兰股份	800	15,408.00	0.07
592	002838	道恩股份	1,700	15,402.00	0.07
593	300998	宁波方正	700	15,393.00	0.07
594	001219	青岛食品	1,300	15,301.00	0.07
595	000529	广弘控股	2,600	15,288.00	0.07
596	301132	满坤科技	400	15,276.00	0.07
597	002546	新联电子	4,700	15,275.00	0.07
598	003043	华亚智能	400	15,264.00	0.07
599	000782	恒申新材	3,500	15,260.00	0.07
599	603126	中材节能	2,800	15,260.00	0.07
600	688121	卓然股份	1,269	15,253.38	0.07
601	600180	瑞茂通	4,000	15,240.00	0.07
602	300440	运达科技	2,900	15,225.00	0.07
603	000592	平潭发展	11,700	15,210.00	0.07
603	603096	新经典	900	15,210.00	0.07
604	688165	埃夫特	1,944	15,202.08	0.07
605	688246	嘉和美康	746	15,188.56	0.07
606	001208	华菱线缆	2,000	15,160.00	0.07
607	301058	中粮科工	1,600	15,152.00	0.07
608	002878	元隆雅图	1,200	15,084.00	0.07
609	301139	元道通信	700	15,057.00	0.07
610	001313	粤海饲料	2,000	15,040.00	0.07
611	600278	东方创业	2,800	15,036.00	0.07
612	000026	飞亚达	1,700	14,977.00	0.07
613	002772	众兴菌业	2,500	14,975.00	0.07
614	002623	亚玛顿	900	14,967.00	0.07
615	002062	宏润建设	4,300	14,964.00	0.07
616	603081	大丰实业	1,600	14,912.00	0.07
617	600960	渤海汽车	5,600	14,896.00	0.07
618	600510	黑牡丹	4,000	14,880.00	0.07
619	600081	东风科技	1,700	14,875.00	0.07

620	301195	北路智控	500	14,870.00	0.07
621	603237	五芳斋	600	14,796.00	0.07
622	002137	实益达	3,100	14,756.00	0.07
623	000570	苏常柴 A	3,300	14,751.00	0.07
624	600684	珠江股份	5,600	14,728.00	0.07
625	000505	京粮控股	2,700	14,688.00	0.07
626	300884	狄耐克	1,700	14,654.00	0.07
627	301383	天键股份	560	14,627.20	0.07
628	002613	北玻股份	4,200	14,616.00	0.07
629	688606	奥泰生物	310	14,610.30	0.07
630	300873	海晨股份	1,000	14,580.00	0.07
631	301201	诚达药业	800	14,560.00	0.07
632	301509	金凯生科	400	14,552.00	0.07
633	603053	成都燃气	1,500	14,490.00	0.07
634	688143	长盈通	676	14,479.92	0.07
635	002363	隆基机械	2,500	14,475.00	0.07
636	600545	卓郎智能	10,800	14,472.00	0.07
637	002551	尚荣医疗	6,200	14,446.00	0.07
638	000411	英特集团	1,500	14,445.00	0.07
639	002365	永安药业	2,000	14,440.00	0.07
640	002457	青龙管业	1,800	14,436.00	0.07
641	603966	法兰泰克	2,100	14,427.00	0.07
642	003028	振邦智能	400	14,424.00	0.07
643	300543	朗科智能	1,800	14,400.00	0.07
644	002659	凯文教育	4,400	14,388.00	0.07
645	300616	尚品宅配	1,300	14,378.00	0.07
646	688080	映翰通	474	14,376.42	0.07
647	002674	兴业科技	1,400	14,308.00	0.07
648	300195	长荣股份	3,400	14,246.00	0.07
649	002863	今飞凯达	3,500	14,245.00	0.07
649	301313	凡拓数创	700	14,245.00	0.07
650	688507	索辰科技	292	14,191.20	0.07
651	003013	地铁设计	1,000	14,180.00	0.07
652	300279	和晶科技	3,400	14,178.00	0.07
653	002160	常铝股份	5,200	14,092.00	0.07
654	603916	苏博特	2,100	14,091.00	0.07
655	603777	来伊份	1,500	14,055.00	0.07
656	603681	永冠新材	1,100	14,025.00	0.07
657	603618	杭电股份	3,200	14,016.00	0.07
658	605366	宏柏新材	2,400	13,944.00	0.07
659	601518	吉林高速	5,700	13,908.00	0.06
660	603776	永安行	1,400	13,888.00	0.06
661	002638	勤上股份	9,300	13,857.00	0.06

662	002658	雪迪龙	2,700	13,851.00	0.06
663	603230	内蒙新华	1,200	13,848.00	0.06
664	688061	灿瑞科技	502	13,794.96	0.06
665	600513	联环药业	1,700	13,787.00	0.06
666	000753	漳州发展	4,900	13,769.00	0.06
667	603325	博隆技术	200	13,756.00	0.06
668	601956	东贝集团	3,000	13,740.00	0.06
669	603239	浙江仙通	1,000	13,710.00	0.06
670	000861	海印股份	19,000	13,680.00	0.06
671	688588	凌志软件	1,997	13,679.45	0.06
672	300473	德尔股份	1,000	13,610.00	0.06
673	603015	弘讯科技	1,800	13,608.00	0.06
674	603318	水发燃气	2,400	13,584.00	0.06
675	601996	丰林集团	8,000	13,520.00	0.06
676	301322	绿通科技	720	13,514.40	0.06
677	603788	宁波高发	1,100	13,508.00	0.06
678	301166	优宁维	500	13,500.00	0.06
679	601566	九牧王	1,600	13,472.00	0.06
680	002412	汉森制药	2,600	13,442.00	0.06
681	002686	亿利达	3,200	13,408.00	0.06
682	002666	德联集团	3,700	13,394.00	0.06
683	603861	白云电器	1,600	13,392.00	0.06
684	603639	海利尔	1,100	13,387.00	0.06
685	603180	金牌家居	700	13,377.00	0.06
686	600121	郑州煤电	4,100	13,366.00	0.06
687	600439	瑞贝卡	6,200	13,330.00	0.06
688	603586	金麒麟	900	13,284.00	0.06
689	002094	青岛金王	7,400	13,246.00	0.06
690	002286	保龄宝	2,400	13,224.00	0.06
691	300414	中光防雷	2,000	13,220.00	0.06
692	000978	桂林旅游	2,200	13,200.00	0.06
692	002995	天地在线	1,000	13,200.00	0.06
693	300335	迪森股份	3,400	13,158.00	0.06
694	688468	科美诊断	2,077	13,147.41	0.06
695	600262	北方股份	800	13,144.00	0.06
696	300112	万讯自控	1,900	13,110.00	0.06
697	600807	济南高新	4,400	13,068.00	0.06
698	300686	智动力	1,800	13,050.00	0.06
698	601999	出版传媒	2,500	13,050.00	0.06
699	600980	北矿科技	1,000	13,030.00	0.06
700	603173	福斯达	600	13,026.00	0.06
701	688369	致远互联	827	13,008.71	0.06
702	000892	欢瑞世纪	5,200	13,000.00	0.06

703	301257	普蕊斯	460	12,995.00	0.06
704	002084	海鸥住工	5,300	12,985.00	0.06
705	603617	君禾股份	2,200	12,980.00	0.06
706	688168	安博通	481	12,938.90	0.06
707	603758	秦安股份	1,700	12,920.00	0.06
708	600758	辽宁能源	4,500	12,870.00	0.06
709	603429	集友股份	3,100	12,865.00	0.06
710	605133	嵘泰股份	700	12,831.00	0.06
711	600826	兰生股份	2,380	12,804.40	0.06
712	000880	潍柴重机	1,600	12,784.00	0.06
713	002330	得利斯	3,500	12,775.00	0.06
714	300434	金石亚药	1,700	12,750.00	0.06
715	300805	电声股份	2,000	12,720.00	0.06
716	002730	电光科技	1,800	12,672.00	0.06
716	301303	真兰仪表	1,100	12,672.00	0.06
717	688697	纽威数控	805	12,630.45	0.06
718	688539	高华科技	469	12,620.79	0.06
719	002598	山东章鼓	1,700	12,614.00	0.06
720	600831	广电网络	4,700	12,596.00	0.06
721	688357	建龙微纳	539	12,558.70	0.06
722	002593	日上集团	3,900	12,480.00	0.06
723	601177	杭齿前进	1,800	12,456.00	0.06
724	603519	立霸股份	1,100	12,441.00	0.06
725	002722	物产金轮	1,100	12,430.00	0.06
726	688073	毕得医药	413	12,299.14	0.06
727	002860	星帅尔	1,500	12,285.00	0.06
728	000419	通程控股	3,000	12,270.00	0.06
729	603166	福达股份	2,500	12,250.00	0.06
730	002566	益盛药业	2,000	12,240.00	0.06
730	002852	道道全	1,700	12,240.00	0.06
731	605299	舒华体育	1,500	12,180.00	0.06
732	301378	通达海	560	12,152.00	0.06
733	300987	川网传媒	1,000	12,140.00	0.06
734	688028	沃尔德	738	12,125.34	0.06
735	301187	欧圣电气	500	12,125.00	0.06
736	003038	鑫铂股份	820	12,111.40	0.06
737	600638	新黄浦	3,200	12,064.00	0.06
738	603380	易德龙	600	12,048.00	0.06
739	603275	众辰科技	400	12,000.00	0.06
740	600981	汇鸿集团	7,100	11,999.00	0.06
741	603330	天洋新材	2,500	11,975.00	0.06
742	603040	新坐标	600	11,958.00	0.06
743	600467	好当家	8,400	11,928.00	0.06

744	603817	海峡环保	2,500	11,900.00	0.06
745	603811	诚意药业	1,900	11,875.00	0.06
746	603136	天目湖	1,085	11,859.05	0.06
747	300501	海顺新材	1,100	11,858.00	0.06
748	002825	纳尔股份	1,900	11,837.00	0.06
749	002877	智能自控	1,600	11,824.00	0.06
750	301102	兆讯传媒	1,000	11,790.00	0.06
750	600716	凤凰股份	4,500	11,790.00	0.06
751	600533	栖霞建设	6,000	11,760.00	0.05
752	301307	美利信	600	11,748.00	0.05
753	600359	新农开发	2,100	11,739.00	0.05
754	688371	菲沃泰	1,162	11,666.48	0.05
755	002616	长青集团	2,700	11,664.00	0.05
756	002663	普邦股份	9,800	11,662.00	0.05
757	301280	珠城科技	300	11,640.00	0.05
758	688613	奥精医疗	912	11,609.76	0.05
759	002133	广宇集团	5,200	11,596.00	0.05
759	603421	鼎信通讯	2,600	11,596.00	0.05
760	688478	晶升股份	398	11,589.76	0.05
761	002732	燕塘乳业	800	11,576.00	0.05
762	002644	佛慈制药	1,800	11,556.00	0.05
763	002164	宁波东力	3,000	11,520.00	0.05
764	600792	云煤能源	3,500	11,515.00	0.05
765	301185	鸥玛软件	800	11,464.00	0.05
766	603757	大元泵业	600	11,460.00	0.05
767	000042	中洲控股	2,900	11,455.00	0.05
768	000576	甘化科工	1,900	11,400.00	0.05
769	600858	银座股份	2,900	11,397.00	0.05
770	002082	万邦德	2,700	11,367.00	0.05
770	300645	正元智慧	900	11,367.00	0.05
771	688636	智明达	498	11,354.40	0.05
772	002576	通达动力	1,000	11,350.00	0.05
773	301181	标榜股份	500	11,340.00	0.05
774	603214	爱婴室	1,000	11,290.00	0.05
775	603217	元利科技	800	11,280.00	0.05
776	603135	中重科技	900	11,277.00	0.05
777	300959	线上线下	400	11,244.00	0.05
778	603818	曲美家居	4,000	11,160.00	0.05
779	301158	德石股份	900	11,133.00	0.05
780	001201	东瑞股份	600	11,124.00	0.05
781	002394	联发股份	1,800	11,088.00	0.05
782	603106	恒银科技	2,600	11,076.00	0.05
783	605080	浙江自然	700	11,074.00	0.05

784	301349	信德新材	400	11,056.00	0.05
785	605177	东亚药业	500	11,035.00	0.05
786	301318	维海德	400	10,988.00	0.05
787	603569	长久物流	1,600	10,976.00	0.05
788	600819	耀皮玻璃	2,600	10,972.00	0.05
789	688112	鼎阳科技	406	10,957.94	0.05
790	300583	赛托生物	900	10,935.00	0.05
791	603051	鹿山新材	500	10,915.00	0.05
792	603333	尚纬股份	3,500	10,885.00	0.05
793	002969	嘉美包装	3,800	10,830.00	0.05
794	603579	荣泰健康	700	10,822.00	0.05
795	603917	合力科技	1,000	10,820.00	0.05
796	603808	歌力思	1,700	10,761.00	0.05
797	002187	广百股份	2,600	10,738.00	0.05
798	600613	神奇制药	2,000	10,700.00	0.05
799	301305	朗坤环境	700	10,647.00	0.05
800	600249	两面针	2,900	10,643.00	0.05
801	300240	飞力达	2,000	10,640.00	0.05
802	603165	荣晟环保	1,000	10,620.00	0.05
803	300710	万隆光电	700	10,619.00	0.05
804	000779	甘咨询	1,500	10,515.00	0.05
805	600573	惠泉啤酒	1,200	10,512.00	0.05
806	688186	广大特材	1,079	10,498.67	0.05
807	301382	蜂助手	580	10,492.20	0.05
808	603109	神驰机电	800	10,488.00	0.05
809	688509	正元地信	3,615	10,447.35	0.05
810	603982	泉峰汽车	1,300	10,400.00	0.05
811	601798	蓝科高新	2,100	10,395.00	0.05
812	002040	南京港	1,900	10,374.00	0.05
813	688010	福光股份	662	10,307.34	0.05
814	301211	亨迪药业	700	10,227.00	0.05
815	688325	赛微微电	326	10,226.62	0.05
816	301362	民爆光电	300	10,218.00	0.05
817	688560	明冠新材	958	10,202.70	0.05
818	300488	恒锋工具	500	10,175.00	0.05
819	002688	金河生物	2,800	10,164.00	0.05
820	603153	上海建科	600	10,146.00	0.05
821	002492	恒基达鑫	2,200	10,120.00	0.05
822	688569	铁科轨道	489	10,107.63	0.05
823	603206	嘉环科技	800	10,104.00	0.05
824	600386	北巴传媒	3,600	10,044.00	0.05
825	003016	欣贺股份	1,600	10,016.00	0.05
826	002983	芯瑞达	600	9,990.00	0.05

827	003007	直真科技	400	9,980.00	0.05
828	605208	永茂泰	1,600	9,968.00	0.05
829	002763	汇洁股份	1,500	9,945.00	0.05
830	603278	大业股份	1,600	9,936.00	0.05
831	605136	丽人丽妆	1,800	9,918.00	0.05
832	603399	吉翔股份	1,600	9,904.00	0.05
833	603116	红蜻蜓	2,200	9,900.00	0.05
834	003002	壶化股份	900	9,873.00	0.05
835	603689	皖天然气	1,200	9,864.00	0.05
836	605058	澳弘电子	500	9,840.00	0.05
837	301116	益客食品	1,100	9,823.00	0.05
838	001319	铭科精技	600	9,780.00	0.05
839	001380	华纬科技	500	9,720.00	0.05
840	300508	维宏股份	500	9,715.00	0.05
841	688580	伟思医疗	363	9,713.88	0.05
842	001378	德冠新材	400	9,544.00	0.04
843	600829	人民同泰	1,700	9,537.00	0.04
844	300086	康芝药业	2,700	9,477.00	0.04
845	301323	新莱福	300	9,474.00	0.04
846	300512	中亚股份	1,600	9,472.00	0.04
847	002909	集泰股份	2,300	9,430.00	0.04
848	301397	溯联股份	300	9,420.00	0.04
849	301122	采纳股份	500	9,415.00	0.04
850	688077	大地熊	593	9,387.19	0.04
851	003011	海象新材	700	9,387.00	0.04
852	301130	西点药业	400	9,372.00	0.04
853	000635	英力特	1,600	9,360.00	0.04
853	688435	英方软件	375	9,360.00	0.04
854	688287	观典防务	1,778	9,352.28	0.04
855	603336	宏辉果蔬	3,100	9,331.00	0.04
856	603255	鼎际得	400	9,320.00	0.04
857	003033	征和工业	400	9,268.00	0.04
858	301468	博盈特焊	400	9,252.00	0.04
859	301256	华融化学	1,500	9,210.00	0.04
860	301197	工大科雅	700	9,184.00	0.04
861	603856	东宏股份	900	9,162.00	0.04
862	301310	鑫宏业	380	9,158.00	0.04
863	002388	新亚制程	2,900	9,135.00	0.04
864	002628	成都路桥	4,700	9,071.00	0.04
865	300154	瑞凌股份	1,700	9,061.00	0.04
865	603276	恒兴新材	650	9,061.00	0.04
866	603102	百合股份	300	9,033.00	0.04
867	301210	金杨股份	300	9,003.00	0.04

868	603933	睿能科技	700	9,002.00	0.04
868	605158	华达新材	1,400	9,002.00	0.04
869	600693	东百集团	3,200	8,992.00	0.04
870	603065	宿迁联盛	1,200	8,964.00	0.04
871	603215	比依股份	700	8,953.00	0.04
872	603366	日出东方	2,500	8,925.00	0.04
873	002968	新大正	1,000	8,910.00	0.04
874	002227	奥特迅	1,100	8,844.00	0.04
875	301151	冠龙节能	600	8,832.00	0.04
876	688058	宝兰德	421	8,769.43	0.04
877	688053	思科瑞	355	8,740.10	0.04
878	603697	有友食品	1,500	8,700.00	0.04
879	001266	宏英智能	400	8,688.00	0.04
880	003027	同兴环保	700	8,610.00	0.04
881	300021	大禹节水	2,600	8,580.00	0.04
882	301225	恒勃股份	300	8,520.00	0.04
883	301203	国泰环保	300	8,493.00	0.04
884	000798	中水渔业	1,500	8,445.00	0.04
885	603282	亚光股份	500	8,430.00	0.04
886	300625	三雄极光	800	8,392.00	0.04
887	301276	嘉曼服饰	400	8,384.00	0.04
888	002574	明牌珠宝	2,000	8,360.00	0.04
889	300898	熊猫乳品	500	8,355.00	0.04
890	003005	竞业达	400	8,336.00	0.04
891	300797	钢研纳克	900	8,334.00	0.04
891	603029	天鹅股份	600	8,334.00	0.04
892	000757	浩物股份	3,300	8,283.00	0.04
893	301520	万邦医药	200	8,276.00	0.04
894	001379	腾达科技	600	8,244.00	0.04
895	001318	阳光乳业	800	8,232.00	0.04
896	688489	三未信安	309	8,231.76	0.04
897	605018	长华集团	900	8,154.00	0.04
898	603948	建业股份	500	8,140.00	0.04
899	688189	南新制药	1,433	8,067.79	0.04
900	603768	常青股份	700	7,938.00	0.04
901	001238	浙江正特	400	7,928.00	0.04
902	002760	凤形股份	600	7,920.00	0.04
903	605068	明新旭腾	600	7,908.00	0.04
904	603095	越剑智能	600	7,866.00	0.04
905	300165	天瑞仪器	3,700	7,844.00	0.04
906	603070	万控智造	700	7,833.00	0.04
907	603163	圣晖集成	300	7,740.00	0.04
908	002989	中天精装	500	7,605.00	0.04

909	688078	龙软科技	327	7,530.81	0.04
910	002949	华阳国际	800	7,528.00	0.04
911	301227	森鹰窗业	400	7,524.00	0.04
912	301331	恩威医药	344	7,523.28	0.04
913	301320	豪江智能	500	7,510.00	0.04
914	600802	福建水泥	2,700	7,506.00	0.04
915	002853	皮阿诺	1,000	7,430.00	0.03
916	301292	海科新源	600	7,422.00	0.03
917	301137	哈焊华通	500	7,285.00	0.03
918	603359	东珠生态	2,000	7,260.00	0.03
919	301063	海锅股份	500	7,170.00	0.03
920	002887	绿茵生态	1,100	7,161.00	0.03
921	301332	德尔玛	800	7,072.00	0.03
922	603130	云中马	400	7,056.00	0.03
923	001223	欧克科技	200	7,038.00	0.03
924	003042	中农联合	600	7,026.00	0.03
925	688227	品高股份	573	6,939.03	0.03
926	603949	雪龙集团	600	6,756.00	0.03
927	688551	科威尔	214	6,741.00	0.03
928	605300	佳禾食品	600	6,564.00	0.03
929	301112	信邦智能	300	6,507.00	0.03
930	603353	和顺石油	500	6,480.00	0.03
931	605389	长龄液压	300	6,297.00	0.03
932	603307	扬州金泉	200	6,288.00	0.03
933	002858	力盛体育	600	6,240.00	0.03
934	605398	新炬网络	300	6,147.00	0.03
935	603280	南方路机	300	5,952.00	0.03
936	000663	永安林业	1,400	5,866.00	0.03
937	605151	西上海	400	5,860.00	0.03
938	300878	维康药业	400	5,816.00	0.03
939	301355	南王科技	600	5,754.00	0.03
940	002495	佳隆股份	4,100	5,658.00	0.03
941	688285	高铁电气	873	5,613.39	0.03
942	603937	丽岛新材	700	5,432.00	0.03
943	688670	金迪克	439	5,171.42	0.02
944	301279	金道科技	200	4,876.00	0.02
945	301365	矩阵股份	400	4,396.00	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	000040	东旭蓝天	5,400	13,014.00	0.06
2	002308	威创股份	3,500	6,895.00	0.03
3	000836	ST 富通	13,200	4,884.00	0.02

4	002288	*ST 超华	8,600	3,182.00	0.01
5	002435	ST 长康	6,600	2,574.00	0.01

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	600133	东湖高新	391,929.00	0.87
2	688076	诺泰生物	365,913.50	0.81
3	600114	东睦股份	316,708.00	0.71
4	603283	赛腾股份	278,584.00	0.62
5	600200	江苏吴中	265,378.00	0.59
6	600461	洪城环境	254,756.00	0.57
7	600410	华胜天成	249,237.00	0.55
8	600094	大名城	248,017.00	0.55
9	688062	迈威生物	245,354.74	0.55
10	603619	中曼石油	242,784.00	0.54
11	600226	亨通股份	241,270.00	0.54
12	601020	华钰矿业	238,391.00	0.53
13	601500	通用股份	231,421.00	0.52
14	603496	恒为科技	226,511.00	0.50
15	600742	一汽富维	223,623.00	0.50
16	600088	中视传媒	222,468.00	0.50
17	603220	中贝通信	222,103.00	0.49
18	600269	赣粤高速	218,452.00	0.49
19	600186	莲花控股	213,072.00	0.47
20	603018	华设集团	212,987.92	0.47

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	688076	诺泰生物	491,724.18	1.09
2	600133	东湖高新	481,549.49	1.07
3	603283	赛腾股份	445,728.00	0.99
4	600114	东睦股份	386,103.00	0.86
5	600461	洪城环境	364,520.00	0.81
6	688062	迈威生物	362,360.35	0.81
7	603220	中贝通信	331,579.00	0.74
8	600269	赣粤高速	310,580.00	0.69
9	600200	江苏吴中	309,584.00	0.69
10	603619	中曼石油	298,163.00	0.66
11	600094	大名城	297,117.00	0.66

12	601020	华钰矿业	294,847.00	0.66
13	600410	华胜天成	292,643.00	0.65
14	601500	通用股份	284,325.00	0.63
15	600088	中视传媒	281,659.11	0.63
16	600757	长江传媒	279,752.00	0.62
17	600226	亨通股份	278,423.00	0.62
18	600742	一汽富维	277,474.00	0.62
19	603496	恒为科技	275,550.00	0.61
20	603018	华设集团	257,086.00	0.57

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	62,680,676.22
卖出股票收入（成交）总额	66,623,514.19

注：7.4.1 项“买入金额”、7.4.2 项“卖出金额”及 7.4.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

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

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

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

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

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

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

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	41,311.58
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	41,311.58

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

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

无。

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	000040	东旭蓝天	13,014.00	0.06	重大事项停牌
2	002308	威创股份	6,895.00	0.03	重大事项停牌
3	000836	ST 富通	4,884.00	0.02	重大事项停牌
4	002288	*ST 超华	3,182.00	0.01	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

无。

§ 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 (%)
547	47,497.42	12,915,069.00	49.71	13,066,019.00	50.29

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	方正证券股份有限公司	2,283,799.00	8.79
2	国泰君安证券股份有限公司	2,271,239.00	8.74
3	左焰	2,177,424.00	8.38
4	招商证券股份有限公司	2,127,961.00	8.19
5	福州数为私募基金管理有限公司—数为城盈套利 1 号私募证券投资基金	1,730,700.00	6.66
6	中信建投证券股份有限公司	1,188,289.00	4.57
7	华泰证券股份有限公司	1,057,288.00	4.07
8	海通证券股份有限公司	956,546.00	3.68
9	财通证券股份有限公司	703,667.00	2.71
10	赵建齐	570,700.00	2.20

注：上述基金持有人份额均为场内基金份额。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2023 年 9 月 14 日） 基金份额总额	490,981,088.00
本报告期期初基金份额总额	43,981,088.00
本报告期基金总申购份额	111,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	129,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	25,981,088.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

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

（1）基金管理人的重大人事变动情况

本报告期内，基金管理人无重大人事变动情况。

（2）基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所，会计师事务所为普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)。

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

本报告期内，基金管理人及其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

本报告期内本基金管理人、托管人及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

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 (%)	
中信证券股份有限公司	5	129,304,190.41	100.00	83,516.56	100.00	-

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

2. 交易单元的选择标准和程序

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

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

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 (%)
中信证券股份有限公司	53,152.91	100.00	-	-	-	-

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	嘉实基金管理有限公司关于指定旗下部分证券投资基金主流动性服务商公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024年1月8日
2	嘉实基金管理有限公司关于指定旗下部分证券投资基金主流动性服务商的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024年1月29日
3	关于嘉实中证 2000 交易型开放式指	上海证券报、基金管理	2024年4月15日

	数证券投资基金基金资产净值连续低于 5000 万元的提示性公告	人网站及中国证监会基金电子披露网站	
4	关于嘉实中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金资产净值连续低于 5000 万元的提示性公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 4 月 29 日
5	关于嘉实中证 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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 5 月 20 日
6	关于嘉实中证 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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 5 月 29 日
7	关于嘉实中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金资产净值连续低于 5000 万元的提示性公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 6 月 21 日
8	嘉实基金管理有限公司关于指定旗下部分证券投资基金主流动性服务商的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 6 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

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	2024-05-15 至 2024-05-15, 2024-05-20 至 2024-05-30	2,037,924.00	24,321,977.00	24,231,940.00	2,127,961.00	8.19

产品特有风险

报告期内本基金出现了单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况。

未来本基金如果出现巨额赎回甚至集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产，可能对基金份额净值产生一定的影响；极端情况下可能引发基金的流动性风险，发生暂停赎回或延缓支付赎回款项；若个别投资者巨额赎回后本基金连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元，还可能面临转换运作方式或者与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

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

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

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

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

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

嘉实基金管理有限公司

2024 年 8 月 30 日