

嘉实中证 2000 交易型开放式指数证券投资
基金
2025 年年度报告

2025 年 12 月 31 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中信证券股份有限公司

送出日期：2026 年 3 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。本年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中信证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 03 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2025 年 01 月 01 日起至 2025 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
3.4 过去三年基金的利润分配情况	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	14
4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 审计报告	14
6.1 审计报告基本信息	14
6.2 审计报告的基本内容	15
§ 7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	18
7.3 净资产变动表	19
7.4 报表附注	21

§ 8 投资组合报告	47
8.1 期末基金资产组合情况	47
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	48
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	49
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	72
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	73
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	74
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	74
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	74
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	74
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	74
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	74
8.12 投资组合报告附注	74
§ 9 基金份额持有人信息	75
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	75
9.2 期末上市基金前十名持有人	75
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	76
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	76
§ 10 开放式基金份额变动	76
§ 11 重大事件揭示	76
11.1 基金份额持有人大会决议	76
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	77
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	77
11.4 基金投资策略的改变	77
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	77
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	77
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	78
11.8 其他重大事件	80
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	80
12.1 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	80
§ 13 备查文件目录	82
13.1 备查文件目录	82
13.2 存放地点	82
13.3 查阅方式	82

§ 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 嘉实
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	10,981,088.00 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	郭松	杨军智

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

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）	中国上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2025 年	2024 年	2023 年 9 月 14 日（基金合同生效日）-2023 年 12 月 31 日
本期已实现收益	6,675,296.16	1,913,640.87	4,751,265.98
本期利润	7,109,583.04	2,232,185.16	4,508,395.20
加权平均基金份额本期利润	0.4325	0.0623	0.0318
本期加权平均净值利润率	35.98%	6.85%	3.16%
本期基金份额净值增长率	36.99%	2.32%	2.14%

3.1.2 期末数据和指标	2025 年末	2024 年末	2023 年末
期末可供分配利润	4,740,754.40	1,306,961.74	941,802.87
期末可供分配基金份额利润	0.4317	0.0451	0.0214
期末基金资产净值	15,721,842.40	30,288,049.74	44,922,890.87
期末基金份额净值	1.4317	1.0451	1.0214
3.1.3 累计期末指标	2025 年末	2024 年末	2023 年末
基金份额累计净值增长率	43.17%	4.51%	2.14%

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

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

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

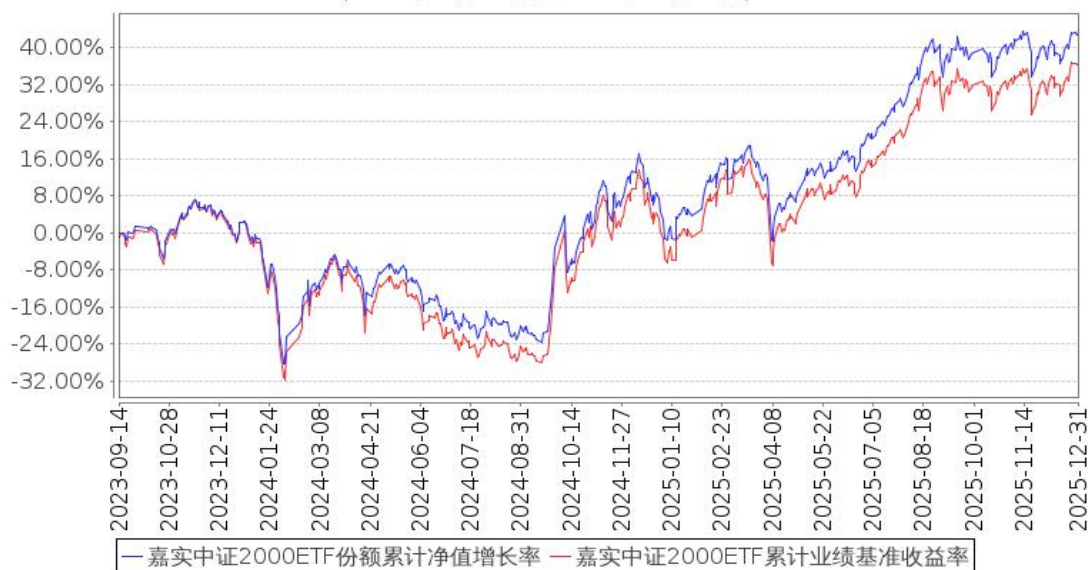
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.04%	1.10%	3.55%	1.19%	-0.51%	-0.09%
过去六个月	18.16%	1.06%	18.38%	1.14%	-0.22%	-0.08%
过去一年	36.99%	1.44%	36.42%	1.58%	0.57%	-0.14%
自基金合同生效起至今	43.17%	1.78%	36.59%	1.96%	6.58%	-0.18%

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

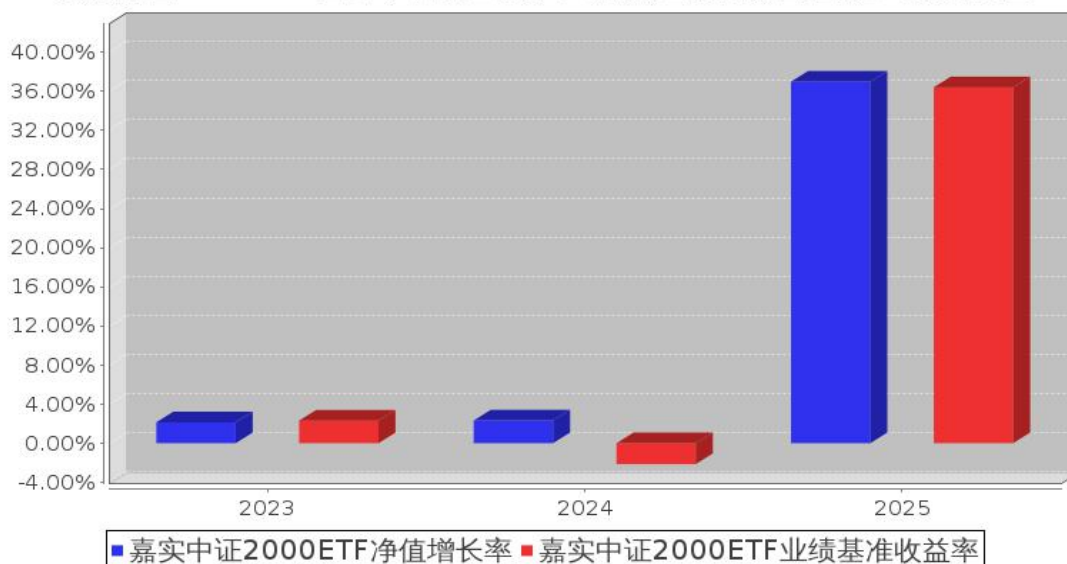
嘉实中证2000ETF份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2023年09月14日至2025年12月31日)



注：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。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

嘉实中证2000ETF基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：上述数据根据基金当年实际存续期计算。

3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

嘉实基金管理有限公司经中国证监会证监基字[1999]5号文批准，于1999年3月25日成立。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2025年12月31日，基金管理人共管理380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、不动产基金等不同类别。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、嘉实中证科创创业	2023年9月14日	-	11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、嘉实中证科创创业50ETF发起联接、嘉实中证光伏产业ETF发起联接、嘉实中证大农业ETF发起联接、嘉实中证A100ETF、嘉实中证A100ETF发起联接、嘉实中证港股通汽车产业主题指数发起式、嘉实中证光伏产业ETF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。

4.1.3 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

截至报告期末，李直没有管理私募资产管理计划。报告期内，李直管理的3只公募基金已分别于2025年2月22日、2025年5月17日、2025年12月6日离任，管理的1个私募资产管理计划已于2025年8月18日离任。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的，合计 8 次，其中 2 次为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易，另 6 次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地跟踪标的指数，实现基金投资目标。

2025 年国内宏观经济在“破立并举”中呈现出前低后稳、结构优化的运行特征。尽管上半年“抢出口”效应消退及房地产市场的深度调整使经济基本面承压，但随着下半年“反内卷”政策的全面深化与落实，供给侧恶性竞争得到有效遏制，物价水平逐步回升，企业盈利预期改善。外贸方面，尽管“关税战 2.0”带来了显著的外部扰动，但得益于对非美市场的成功拓展，出口展现出极强韧性。随着年底重要会议对“十五五”规划方向的定调以及中美元首会晤带来的外部环境阶段性缓和，经济基本面在政策托底与结构转型的双轮驱动下，确立了企稳向好的长期趋势。2025 年美国宏观经济在加息周期的尾声中展现出超预期的韧性，但整体增速呈现边际放缓态势，且内部结构性分化特征显著。制造业及房地产市场持续承压，但服务业消费在劳动力市场支撑下保持了相对稳健，避免了经济陷入深度衰退。然而，就业数据的反复波动以及市场对“软着陆”与“二次通胀”风险的博弈贯穿全年，导致美债收益率曲线经历了剧烈的形态调整。年末随着贸易政策不确定性的落地及降息路径的进一步明晰，市场对美国经济的预期逐渐从“衰退恐慌”转向“温和放缓”，但财政赤字与债务问题仍是制约其长期增长中枢的潜在隐忧。

作为 ETF 基金，本基金秉承指数化被动投资策略，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，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 1.4317 元；本报告期基金份额净值增长率为 36.99%，业绩比较基准收益率为 36.42%。

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 2026 年，国内权益市场在“十五五”开局之年有望在多重积极因素共振下延续结构性行情，核心驱动力将从估值修复转向盈利改善。宏观政策有望维持宽松，为市场提供支撑。全球货币政策趋向宽松、美元预期走弱，有望改善新兴市场流动性，吸引全球资金加大对中国资产的配置。同时，国内居民资产向权益市场迁移、险资等长期资金入市，将提供重要的增量流动性。

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

者提供一个标准化的中证 2000 指数的投资工具。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，基金管理人有关监察稽核工作情况如下：

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

(2) 全流程动态开展投资交易监督。一是事前防范，主要从事前研讨，合规风险识别、评估和分析，合规风控设置，建立禁限投库，合规培训，合规承诺书签署等方面开展；二是事中实时监控，如实时回答组合经理、交易员投资交易事项，盘中实时监控等；三是事后检查及改进，如检查投资交易合规情况，对异常行为进行提示、提供处理建议并督促改正。优化和升级合规风控系统，不断提高自动化 监控能力，保障各类组合合规运作，保护投资者利益。

(3) 按计划对销售、投资、后台和其它业务开展内部稽核，完成相应合规检查报告及其后续改进跟踪。同时聘请并配合外部审计机构完成公司及基金的审计、公司 GIPS 第三方验证、ISAE3402 国际鉴证等项目。

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

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

此外，积极配合监管，按时完成合规报告和各项统计报表以及专题报告。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金存在连续 60 个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，时间范围为 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 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。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的有关规定，本基金管理人已向中国证监会报告并提出解决方案。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
------------	---

审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	德师报(审)字(26)第 P00312 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	嘉实中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了嘉实中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金的财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表，2025 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了嘉实中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照《中国注册会计师独立性准则第 1 号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》和中国注册会计师职业道德守则，我们独立于嘉实中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们在审计中遵循了对公众利益实体审计的独立性要求。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	嘉实基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括嘉实中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。 在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估嘉实中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金的持续经营能力，披露

	<p>与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算嘉实中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督嘉实中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金的财务报告过程。</p>	
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对嘉实中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致嘉实中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	汪芳	姜金玲
会计师事务所的地址	中国上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼	
审计报告日期	2026 年 3 月 24 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：嘉实中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	599,676.67	1,047,349.11
结算备付金		18,356.12	105,952.90
存出保证金		16,499.63	12,927.11
交易性金融资产	7.4.7.2	15,094,198.36	29,154,792.47
其中：股票投资		15,089,058.17	29,149,792.27
基金投资		-	-
债券投资		5,140.19	5,000.20
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		15,728,730.78	30,321,021.59
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-

应付管理人报酬		1,995.40	10,188.62
应付托管费		665.15	2,244.90
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	4,227.83	20,538.33
负债合计		6,888.38	32,971.85
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	10,981,088.00	28,981,088.00
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	4,740,754.40	1,306,961.74
净资产合计		15,721,842.40	30,288,049.74
负债和净资产总计		15,728,730.78	30,321,021.59

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.4317 元，基金份额总额 10,981,088.00 份。

7.2 利润表

会计主体：嘉实中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
一、营业总收入		7,149,390.44	2,439,808.09
1. 利息收入		12,127.48	25,574.67
其中：存款利息收入	7.4.7.13	12,127.48	25,574.67
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）		6,647,601.46	1,807,186.96
其中：股票投资收益	7.4.7.14	6,465,906.09	1,452,211.34
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	5,290.37	11,384.30
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	176,405.00	343,591.32

其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.20	434,286.88	318,544.29
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	55,374.62	288,502.17
减：二、营业总支出		39,807.40	207,622.93
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	29,855.55	163,625.01
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	9,951.85	32,932.12
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	7.4.7.23	-	11,065.80
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		7,109,583.04	2,232,185.16
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		7,109,583.04	2,232,185.16
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		7,109,583.04	2,232,185.16

7.3 净资产变动表

会计主体：嘉实中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	28,981,088.00	-	1,306,961.74	30,288,049.74
二、本期期初净资产	28,981,088.00	-	1,306,961.74	30,288,049.74
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-18,000,000.00	-	3,433,792.66	-14,566,207.34
（一）、综合收益总额	-	-	7,109,583.04	7,109,583.04

(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	-	-3,675,790.38	-21,675,790.38
其中：1. 基金申购款	18,000,000.00	-	4,674,633.13	22,674,633.13
2. 基金赎回款	-36,000,000.00	-	-8,350,423.51	-44,350,423.51
(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	10,981,088.00	-	4,740,754.40	15,721,842.40
项目	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	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)	-15,000,000.00	-	365,158.87	-14,634,841.13
(一)、综合收益总额	-	-	2,232,185.16	2,232,185.16
(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)	-15,000,000.00	-	-1,867,026.29	-16,867,026.29
其中：1. 基金申购款	147,000,000.00	-	-19,088,082.37	127,911,917.63
2. 基金赎回款	-162,000,000.00	-	17,221,056.08	-144,778,943.92
(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	28,981,088.00	-	1,306,961.74	30,288,049.74

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

经雷	梁凯	李袁
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

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

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)、中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定,开放式基金在基金合同生效后,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 5,000 万元情形的,基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案,如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等,并召开基金份额持有人大会进行表决。于 2025 年 12 月 31 日,本基金出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5,000 万元的情形,本基金的基金管理人已向中国证监会报告并在评估后续处理方案,故本财务报表仍以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以

及本报告期的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产，暂无金融资产划分为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

金融资产的合同条款规定在特定日期产生的现金流量仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付，且本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标，则本基金将该金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产。此类金融资产主要包括货币资金、各类应收款项、买入返售金融资产等。

不符合分类为以摊余成本计量的金融资产以及公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产条件的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产计入“衍生金融资产”外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产计入“交易性金融资产”。

(2) 金融负债的分类

本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。对于以常规方式购买或出售金融资产的，在交易日确认将收到的资产和为此将承担的负债，或者在交易日终止确认已出售的资产。金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券或资产支持证券已到付息期但尚未领取的利息，单独确认为应收项目。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失以及与该金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，发生减值或终止确认产生的利得或损失，计入当期损益。

本基金对分类为以摊余成本计量的金融资产以预期信用损失为基础确认损失准备。除购买或源生的已发生信用减值的金融资产外，本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后的变动情况。若该金融工具的信用风险自初始确认后已显著增加，本基金按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备；若该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加，本基金按照相当于该金融工具未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备。信用损失准备的增加或转回金额，作为减值损失或利得计入当期损益。

本基金在前一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形的，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

本基金利用可获得的合理且有依据的前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止、该金融资产已转移且其所有权上几乎所有的风险和报酬已转移或虽然既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是未保留对该金融资产的控制，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。若本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有风险和报酬，且保留了对该金融资产控制的，则按照其继续涉入被转移金融资产的程度继续确认该被转移金融资产，并相应确认相关负债。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价（包括转出的非现金资产或承担的新金融负债）之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，将其公允价值划分为三个层次。第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二

层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值原则如下：

(1)对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市价不能真实反映公允价值的，应对市价进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2)当投资品种不存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

(3)经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整，确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占净资产比例计

算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

(2) 投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本与相关交易费用的差额确认。

债券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖债券价差收入。除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。买卖债券价差收入为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

资产支持证券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖资产支持证券价差收入。资产支持证券利息收入在持有期内，按资产支持证券的票面价值和预计收益率计算的利息逐日确认资产支持证券利息收入。在收到资产支持证券支付的款项时，其中属于证券投资收益的部分冲减应计利息(若有)后的差额，确认资产支持证券利息收入。买卖资产支持证券价差收入为卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本、相关交易费用与税费后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额确认，由上市公司代扣代缴的个人所得税于卖出交易日按实际代扣代缴金额确认。

(3) 公允价值变动收益

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

(4) 信用减值损失

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认信用损失准备。本基金所计提的信用减值损失计入当期损益。

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 每份基金份额享有同等分配权；

(2) 本基金收益评价日核定的基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，基金管理人可以进行收益分配；

(3) 在符合上述基金分红条件的前提下，由基金管理人根据本基金特点自行约定收益分配次数，每次基金收益分配数额的确定原则为：使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率；若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(4) 基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补亏损为前提，收益分配后有可能使基金份额净值低于面值，即基金收益分配基准日(即收益评价日)的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后可能低于面值；

(5) 本基金收益分配采取现金方式；

(6) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 外币交易

无。

7.4.4.13 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，基金确定以下类别股票投

资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

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

(2) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财税[2008]1号《财政部、国家税务总局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》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2021]33号《关于北京证券交易所税收政策适用问题的公告》、财税[2024]8号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、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》、财税[2025]4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 证券投资基金(封闭式证券投资基金, 开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税; 2018年1月1日起, 公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务, 以基金管理人为增值税纳税人, 暂适用简易计税方法, 按照3%的征收率缴纳增值税;

(2) 对证券投资基金取得的自2025年8月8日之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入, 恢复缴纳增值税; 取得的在2025年8月8日之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在2025年8月8日之后续发行的部分)的利息收入, 继续免征增值税直至债券到期;

(3) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入, 包括买卖股票、债券的差价收入, 股权的股息、红利收入, 债券的利息收入及其他收入, 暂不缴纳企业所得税;

(4) 对基金取得的股票股息、红利收入, 由上市公司代扣代缴个人所得税; 从公开发行和转让市场取得的上市公司股票, 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, 股息红利所得暂免征收个人所得税。其中, 对基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所挂牌交易的上市公司限售股, 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;

(5) 对于基金从事A股买卖, 出让方按0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税, 对受让方不再缴纳印花税; 对于基金通过深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票, 按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税; 自2023年8月28日起, 出让方减按0.05%的税率缴纳证券(股票)交易印花税;

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位: 人民币元

项目	本期末	上年度末
	2025 年 12 月 31 日	2024 年 12 月 31 日
活期存款	599,676.67	1,047,349.11
等于：本金	599,422.07	1,046,869.07
加：应计利息	254.60	480.04
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	599,676.67	1,047,349.11

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末				
	2025 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	14,579,637.78	-	15,089,058.17	509,420.39	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	4,600.00	0.19	5,140.19	540.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	4,600.00	0.19	5,140.19	540.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	14,584,237.78	0.19	15,094,198.36	509,960.39	
项目	上年度末				
	2024 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	29,074,118.76	-	29,149,792.27	75,673.51	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	5,000.00	0.20	5,000.20	0.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	5,000.00	0.20	5,000.20	0.00

资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	29,079,118.76	0.20	29,154,792.47	75,673.51

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

无。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

7.4.7.8 其他资产

无。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	4,227.83	9,472.53
其中：交易所市场	4,227.83	9,472.53
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	-	11,065.80
合计	4,227.83	20,538.33

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	28,981,088.00	28,981,088.00
本期申购	18,000,000.00	18,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-36,000,000.00	-36,000,000.00
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	10,981,088.00	10,981,088.00

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.11 其他综合收益

无。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	5,531,609.40	-4,224,647.66	1,306,961.74
本期期初	5,531,609.40	-4,224,647.66	1,306,961.74

本期利润	6,675,296.16	434,286.88	7,109,583.04
本期基金份额交易产生的变动数	-5,461,164.67	1,785,374.29	-3,675,790.38
其中：基金申购款	6,801,791.80	-2,127,158.67	4,674,633.13
基金赎回款	-12,262,956.47	3,912,532.96	-8,350,423.51
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,745,740.89	-2,004,986.49	4,740,754.40

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年1月1日至2024年12月31日
活期存款利息收入	11,878.38	21,530.02
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	152.00	1,916.93
其他	97.10	2,127.72
合计	12,127.48	25,574.67

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年1月1日至2024年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	4,785,200.48	1,864,230.24
股票投资收益——赎回差价收入	1,680,705.61	-412,018.90
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	6,465,906.09	1,452,211.34

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年1月1日至2024年12月31日
卖出股票成交总额	56,206,929.42	98,837,644.49
减：卖出股票成本总额	51,367,052.01	96,815,795.84

减：交易费用	54,676.93	157,618.41
买卖股票差价收入	4,785,200.48	1,864,230.24

7.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
赎回基金份额对价总额	44,350,423.51	144,778,943.92
减：现金支付赎回款总额	15,303,097.51	50,985,718.92
减：赎回股票成本总额	27,366,620.39	94,205,243.90
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	1,680,705.61	-412,018.90

7.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
债券投资收益——利息收入	1.81	7.77
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	5,288.56	11,376.53
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	5,290.37	11,384.30

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31 日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月 31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	22,691.26	70,888.09
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	17,400.00	59,500.00
减：应计利息总额	1.82	8.71
减：交易费用	0.88	2.85
买卖债券差价收入	5,288.56	11,376.53

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月 31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月 31日
股票投资产生的股利收益	176,405.00	343,591.32
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	176,405.00	343,591.32

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年1月1日至2025年 12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024 年12月31日
1. 交易性金融资产	434,286.88	318,544.29
股票投资	433,746.88	319,863.41
债券投资	540.00	-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	434,286.88	318,544.29

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月 31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024 年12月31日
基金赎回费收入	-	-

替代损益	55,374.62	288,502.17
合计	55,374.62	288,502.17

7.4.7.22 信用减值损失

无。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年1月1日至2024年12月31日
审计费用	-	11,065.80
信息披露费	-	-
证券出借违约金	-	-
合计	-	11,065.80

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

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

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年1月1日至2024年12月31日

	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例 (%)	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	4,914,394.92	4.63	173,049,077.41	88.84

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025 年12月31日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日	
	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 成交总额的比例 (%)
中信证券股份有限公 司	2,327.92	10.26	70,888.09	100.00

7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

7.4.10.1.4 权证交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
中信证券股份有 限公司	884.37	4.48	14.68	0.35
关联方名称	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
中信证券股份有 限公司	91,650.79	95.78	5,430.40	57.33

注：上述佣金按市场佣金率计算；根据证监会公告[2024]3号《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自2024年7月1日起，针对被动股票型基金，不再通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	29,855.55	163,625.01
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,920.33	16,836.75
应支付基金管理人的净管理费	27,935.22	146,788.26

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 0.15% 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 × 0.15% / 当年天数。

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

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	9,951.85	32,932.12

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.05% 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 × 0.05% / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 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	912,491.00	8.31	852,885.00	2.94

注：除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的费率标准与其他相同条件的投资者适用的费率标准相一致。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年12月 31日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信证券股份有限公司 _活期	599,676.67	11,878.38	1,047,349.11	21,530.02

注：本基金的上述存款，按银行同业利率或约定利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期末(2025年12月31日)投资于基金托管人关联方中信出版集团股份有限公司发行的股票：中信出版(代码300788)100股，期末公允价值为人民币2,740.00元，占本基金期末基金资产净值比例为0.02%(2024年12月31日：0股，公允价值为人民币0.00元，占基金资产净值的比例为0.00%)。

本报告期及上年度可比期间，基金管理人主动承担部分固定费用，如审计费用、信息披露费等。

7.4.11 利润分配情况

本期(2025年1月1日至2025年12月31日)，本基金未实施利润分配。

7.4.12 期末(2025年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
111024	澳弘	2025年12	1-6个月(含)	新债未上	100.00	100.01	10	1,000.00	1,000.09	-

	转债	月 12 日		市						
123264	双乐转债	2025 年 12 月 26 日	1 个月内 (含)	新债未上市	100.00	100.00	24	2,400.00	2,400.06	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务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 risk 管理制度，坚持审慎经营理念，保护投资者利益和公司合法权益。

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

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

7.4.13.2 信用风险

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

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

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

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	5,140.19	5,000.20
未评级	-	-
合计	5,140.19	5,000.20

注：评级取自第三方评级机构。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。

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

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

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

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的

久期等方法对上述利率风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 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	599,676.67	-	-	-	599,676.67
结算备付金	18,356.12	-	-	-	18,356.12
存出保证金	16,499.63	-	-	-	16,499.63
交易性金融资产	-	-	5,140.19	15,089,058.17	15,094,198.36
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	634,532.42	-	5,140.19	15,089,058.17	15,728,730.78
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	-	-	-	1,995.40	1,995.40
应付托管费	-	-	-	665.15	665.15
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	-	-	-	4,227.83	4,227.83
负债总计	-	-	-	6,888.38	6,888.38
利率敏感度缺口	634,532.42	-	5,140.19	15,082,169.79	15,721,842.40
上年度末 2024 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	1,047,349.11	-	-	-	1,047,349.11
结算备付金	105,952.90	-	-	-	105,952.90
存出保证金	12,927.11	-	-	-	12,927.11
交易性金融资产	-	-	5,000.20	29,149,792.27	29,154,792.47

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	1,166,229.12	-	5,000.20	29,149,792.27	30,321,021.59
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	-	-	-	10,188.62	10,188.62
应付托管费	-	-	-	2,244.90	2,244.90
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	-	-	-	20,538.33	20,538.33
负债总计	-	-	-	32,971.85	32,971.85
利率敏感度缺口	1,166,229.12	-	5,000.20	29,116,820.42	30,288,049.74

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2025年12月31日）	上年度末（2024年12月31日）
	市场利率上升25个基点	-75.17	-70.80
市场利率下降25个基点	76.48	72.00	

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

无。

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2025年12月31日）	上年度末（2024年12月31日）
	所有外币相对人民币升值5%	-	-
	所有外币相对人民币贬值5%	-	-

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日		上年度末 2024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	15,089,058.17	95.98	29,149,792.27	96.24
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	15,089,058.17	95.98	29,149,792.27	96.24

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2025年12月31日）	上年度末（2024年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	715,938.37	1,367,696.34
业绩比较基准下降5%	-715,938.37	-1,367,696.34	

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
第一层次	15,090,798.21	28,990,588.27
第二层次	3,400.15	164,204.20
第三层次	-	-

合计	15,094,198.36	29,154,792.47
----	---------------	---------------

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

无。

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

无。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	15,089,058.17	95.93
	其中：股票	15,089,058.17	95.93
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,140.19	0.03
	其中：债券	5,140.19	0.03
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-

6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	618,032.79	3.93
8	其他各项资产	16,499.63	0.10
9	合计	15,728,730.78	100.00

注：股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	99,057.00	0.63
B	采矿业	83,635.00	0.53
C	制造业	10,900,011.89	69.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	350,795.00	2.23
E	建筑业	207,401.00	1.32
F	批发和零售业	613,443.26	3.90
G	交通运输、仓储和邮政业	219,304.00	1.39
H	住宿和餐饮业	29,706.00	0.19
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,249,036.62	7.94
J	金融业	23,997.00	0.15
K	房地产业	216,358.00	1.38
L	租赁和商务服务业	312,921.40	1.99
M	科学研究和技术服务业	259,728.00	1.65
N	水利、环境和公共设施管理业	283,687.00	1.80
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	33,236.00	0.21
Q	卫生和社会工作	39,471.00	0.25
R	文化、体育和娱乐业	132,332.00	0.84
S	综合	34,938.00	0.22
	合计	15,089,058.17	95.98

8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

无。

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688167	炬光科技	521	91,211.47	0.58
2	002759	天际股份	1,500	69,645.00	0.44
3	002565	顺灏股份	3,500	64,155.00	0.41
4	000592	平潭发展	4,100	63,140.00	0.40
5	300680	隆盛科技	1,000	55,870.00	0.36
6	300469	信息发展	900	55,620.00	0.35
7	605196	华通线缆	1,600	55,584.00	0.35
8	603067	振华股份	1,920	55,315.20	0.35
9	688627	精智达	243	54,332.37	0.35
10	688195	腾景科技	311	52,730.05	0.34
11	688388	嘉元科技	1,271	52,085.58	0.33
12	300790	宇瞳光学	1,700	50,847.00	0.32
13	000973	佛塑科技	3,400	49,980.00	0.32
14	300322	硕贝德	1,800	49,122.00	0.31
15	002361	神剑股份	3,300	47,322.00	0.30
16	002792	通宇通讯	1,100	46,970.00	0.30
17	002549	凯美特气	2,200	46,684.00	0.30
18	603319	美湖股份	1,260	46,090.80	0.29
19	600226	亨通股份	8,500	45,305.00	0.29
20	603686	福龙马	1,500	44,535.00	0.28
21	000700	模塑科技	3,000	43,140.00	0.27
22	688102	斯瑞新材	1,085	42,032.90	0.27
23	300872	天阳科技	2,000	41,120.00	0.26
24	002121	科陆电子	5,300	40,810.00	0.26
25	301413	安培龙	300	40,440.00	0.26
26	300806	斯迪克	1,300	39,962.00	0.25
27	300499	高澜股份	1,300	39,884.00	0.25
28	301489	思泉新材	200	39,800.00	0.25
29	300342	天银机电	1,200	39,756.00	0.25
30	002527	新时达	2,200	39,028.00	0.25
31	300263	隆华科技	4,300	38,012.00	0.24
32	301486	致尚科技	300	37,215.00	0.24
33	002108	沧州明珠	7,700	36,729.00	0.23
34	002446	盛路通信	3,500	36,715.00	0.23
35	002250	联化科技	2,700	36,126.00	0.23
36	002510	天汽模	4,900	35,917.00	0.23

37	300258	精锻科技	2,500	35,800.00	0.23
38	300436	广生堂	400	35,660.00	0.23
39	603011	合锻智能	1,500	35,565.00	0.23
40	600592	龙溪股份	1,300	35,503.00	0.23
41	002298	中电鑫龙	3,400	35,496.00	0.23
42	688239	航宇科技	518	35,053.06	0.22
43	688049	炬芯科技	665	34,979.00	0.22
44	002167	东方锆业	2,800	34,580.00	0.22
45	603859	能科科技	816	34,312.80	0.22
46	300756	金马游乐	600	34,128.00	0.22
47	300145	南方泵业	7,200	33,984.00	0.22
48	002437	誉衡药业	10,800	33,156.00	0.21
49	000922	佳电股份	2,400	33,024.00	0.21
50	001267	汇绿生态	1,500	32,850.00	0.21
51	688305	科德数控	530	32,754.00	0.21
52	002334	英威腾	3,600	32,472.00	0.21
53	300053	航宇微	1,700	32,334.00	0.21
54	300278	华昌达	5,200	31,720.00	0.20
55	002467	二六三	5,200	31,668.00	0.20
56	002768	国恩股份	600	31,608.00	0.20
57	688401	路维光电	640	31,238.40	0.20
58	301183	东田微	200	31,018.00	0.20
59	300048	合康新能	5,200	30,940.00	0.20
60	002975	博杰股份	400	30,800.00	0.20
61	002922	伊戈尔	1,000	30,620.00	0.19
62	603936	博敏电子	2,400	30,480.00	0.19
63	002969	嘉美包装	2,400	30,384.00	0.19
64	002438	江苏神通	1,900	30,210.00	0.19
65	688499	利元亨	523	30,187.56	0.19
66	002515	金字火腿	4,900	29,841.00	0.19
67	300228	富瑞特装	3,000	29,670.00	0.19
68	002474	榕基软件	3,000	29,580.00	0.19
69	300382	斯莱克	1,900	29,564.00	0.19
70	002803	吉宏股份	1,800	29,448.00	0.19
71	002115	三维通信	2,300	29,302.00	0.19
72	002177	御银股份	3,100	29,171.00	0.19
73	300696	爱乐达	900	28,719.00	0.18
74	603929	亚翔集成	300	28,650.00	0.18
75	000534	万泽股份	1,300	28,600.00	0.18
76	600288	大恒科技	1,900	28,462.00	0.18
77	002448	中原内配	2,200	28,446.00	0.18
78	002392	北京利尔	3,800	28,424.00	0.18
79	688025	杰普特	200	28,314.00	0.18

80	603301	振德医疗	400	28,200.00	0.18
81	300465	高伟达	1,400	28,182.00	0.18
82	600203	福日电子	2,100	28,014.00	0.18
83	300520	科大国创	800	27,912.00	0.18
84	300213	佳讯飞鸿	2,900	27,608.00	0.18
85	002533	金杯电工	2,200	27,456.00	0.17
86	002106	莱宝高科	2,500	27,400.00	0.17
87	300005	探路者	2,500	27,075.00	0.17
88	688531	日联科技	408	26,940.24	0.17
89	002062	宏润建设	2,900	26,825.00	0.17
90	688518	联赢激光	1,103	26,791.87	0.17
91	600868	梅雁吉祥	8,000	26,720.00	0.17
92	002293	罗莱生活	2,600	26,702.00	0.17
93	002067	景兴纸业	4,700	26,555.00	0.17
94	300174	元力股份	1,700	26,350.00	0.17
95	002440	闰土股份	3,500	26,145.00	0.17
95	600496	精工钢构	6,300	26,145.00	0.17
96	300248	新开普	2,100	26,061.00	0.17
97	300708	聚灿光电	2,925	25,974.00	0.17
98	601929	吉视传媒	7,500	25,800.00	0.16
99	688319	欧林生物	1,016	25,765.76	0.16
100	000823	超声电子	1,900	25,764.00	0.16
101	600138	中青旅	2,600	25,688.00	0.16
102	300328	宜安科技	1,500	25,605.00	0.16
103	300061	旗天科技	2,400	25,248.00	0.16
104	002255	海陆重工	2,000	25,240.00	0.16
105	002210	飞马国际	7,000	25,200.00	0.16
106	600103	青山纸业	6,000	25,140.00	0.16
107	002297	博云新材	2,100	25,137.00	0.16
108	688353	华盛锂电	220	25,014.00	0.16
109	605305	中际联合	600	24,996.00	0.16
110	688668	鼎通科技	201	24,924.00	0.16
111	688691	灿芯股份	244	24,883.12	0.16
112	002526	山东矿机	6,900	24,840.00	0.16
113	688023	安恒信息	481	24,728.21	0.16
114	300684	中石科技	500	24,610.00	0.16
115	002579	中京电子	2,000	24,360.00	0.15
115	688508	芯朋微	400	24,360.00	0.15
116	002548	金新农	4,000	24,320.00	0.15
117	002512	达华智能	3,900	24,297.00	0.15
118	688562	航天软件	1,017	24,285.96	0.15
119	603969	银龙股份	2,400	24,264.00	0.15
120	600345	长江通信	700	24,262.00	0.15

121	002146	荣盛发展	14,700	24,108.00	0.15
122	688678	福立旺	990	23,938.20	0.15
123	300739	明阳电路	1,300	23,894.00	0.15
124	000551	创元科技	1,620	23,814.00	0.15
125	002083	孚日股份	2,000	23,800.00	0.15
126	002283	天润工业	3,800	23,712.00	0.15
127	300842	帝科股份	400	23,708.00	0.15
128	301216	万凯新材	1,400	23,604.00	0.15
129	300420	五洋自控	5,900	23,541.00	0.15
130	300067	安诺其	4,700	23,500.00	0.15
131	300292	吴通控股	5,200	23,452.00	0.15
132	688176	亚虹医药	2,037	23,445.87	0.15
133	300349	金卡智能	1,500	23,445.00	0.15
134	300252	金信诺	1,600	23,392.00	0.15
135	688787	海天瑞声	200	23,198.00	0.15
136	000078	海王生物	6,700	23,182.00	0.15
137	000915	华特达因	700	23,128.00	0.15
138	688117	圣诺生物	609	23,014.11	0.15
139	000090	天健集团	6,200	22,940.00	0.15
140	300793	佳禾智能	1,400	22,834.00	0.15
141	002540	亚太科技	3,200	22,656.00	0.14
142	002026	山东威达	1,500	22,575.00	0.14
143	002860	星帅尔	1,600	22,560.00	0.14
144	000900	现代投资	5,500	22,495.00	0.14
145	600300	维维股份	6,400	22,464.00	0.14
146	002997	瑞鹄模具	600	22,440.00	0.14
146	688392	骄成超声	200	22,440.00	0.14
147	000888	峨眉山 A	1,700	22,304.00	0.14
148	002406	远东传动	2,800	22,232.00	0.14
149	002117	东港股份	1,600	22,096.00	0.14
150	002741	光华科技	1,100	22,066.00	0.14
151	000882	华联股份	10,600	21,836.00	0.14
152	688590	新致软件	1,170	21,832.20	0.14
153	002039	黔源电力	1,200	21,804.00	0.14
154	000404	长虹华意	3,200	21,664.00	0.14
155	600590	泰豪科技	2,300	21,643.00	0.14
156	600736	苏州高新	3,200	21,632.00	0.14
157	000948	南天信息	1,200	21,540.00	0.14
158	603368	柳药集团	1,200	21,384.00	0.14
159	603018	华设集团	2,800	21,308.00	0.14
160	000501	武商集团	2,100	21,252.00	0.14
161	300120	经纬辉开	2,500	21,250.00	0.14
162	300217	东方电热	4,100	21,238.00	0.14

163	002154	报喜鸟	5,500	21,175.00	0.13
164	002225	濮耐股份	3,700	21,090.00	0.13
165	001283	豪鹏科技	300	21,000.00	0.13
165	600742	富维股份	2,100	21,000.00	0.13
166	688636	智明达	490	20,991.60	0.13
167	600510	黑牡丹	2,500	20,975.00	0.13
168	688381	帝奥微	914	20,848.34	0.13
169	300473	德尔股份	700	20,846.00	0.13
170	300533	冰川网络	600	20,838.00	0.13
171	300046	台基股份	600	20,820.00	0.13
171	601177	杭齿前进	1,200	20,820.00	0.13
172	000652	泰达股份	5,000	20,800.00	0.13
173	600108	亚盛集团	6,600	20,790.00	0.13
173	600255	鑫科材料	5,400	20,790.00	0.13
174	000560	我爱我家	7,100	20,732.00	0.13
175	002483	润邦股份	2,900	20,706.00	0.13
176	003040	楚天龙	1,000	20,680.00	0.13
177	002655	共达电声	1,600	20,672.00	0.13
178	300733	西菱动力	1,100	20,669.00	0.13
179	300221	银禧科技	2,000	20,640.00	0.13
180	300648	星云股份	400	20,632.00	0.13
181	600708	光明地产	5,300	20,617.00	0.13
182	688258	卓易信息	269	20,597.33	0.13
183	002523	天桥起重	4,800	20,592.00	0.13
184	000936	华西股份	2,500	20,575.00	0.13
185	603008	喜临门	1,000	20,480.00	0.13
186	002206	海利得	3,500	20,475.00	0.13
187	601388	怡球资源	6,800	20,468.00	0.13
188	603187	海容冷链	1,300	20,397.00	0.13
189	300161	华中数控	700	20,328.00	0.13
190	688085	三友医疗	1,127	20,308.54	0.13
191	002166	莱茵生物	2,400	20,280.00	0.13
191	002445	中南文化	7,800	20,280.00	0.13
192	300662	科锐国际	800	20,264.00	0.13
193	600880	博瑞传播	4,100	20,254.00	0.13
194	002296	辉煌科技	1,800	20,160.00	0.13
195	002783	凯龙股份	2,100	20,097.00	0.13
196	300310	宜通世纪	3,400	20,094.00	0.13
197	000409	云鼎科技	1,800	20,052.00	0.13
198	600313	农发种业	3,100	19,964.00	0.13
199	300129	泰胜风能	1,900	19,874.00	0.13
200	688556	高测股份	1,740	19,870.80	0.13
201	600230	沧州大化	1,300	19,838.00	0.13

202	002669	康达新材	1,300	19,760.00	0.13
203	002191	劲嘉股份	4,700	19,693.00	0.13
204	300835	龙磁科技	300	19,674.00	0.13
205	600477	杭萧钢构	6,600	19,602.00	0.12
206	300320	海达股份	2,100	19,593.00	0.12
207	002132	恒星科技	5,500	19,525.00	0.12
208	600067	冠城新材	4,700	19,505.00	0.12
209	300291	百纳千成	2,600	19,474.00	0.12
210	600351	亚宝药业	3,000	19,470.00	0.12
211	300267	尔康制药	5,700	19,437.00	0.12
212	600694	大商股份	1,082	19,400.26	0.12
213	601010	文峰股份	7,100	19,383.00	0.12
214	688238	和元生物	2,905	19,347.30	0.12
215	300245	天玑科技	1,600	19,344.00	0.12
216	605168	三人行	500	19,290.00	0.12
217	300430	诚益通	1,000	19,220.00	0.12
218	000989	九芝堂	2,200	19,206.00	0.12
219	002560	通达股份	1,900	19,152.00	0.12
220	300852	四会富仕	500	19,090.00	0.12
221	300194	福安药业	4,300	19,049.00	0.12
222	688510	航亚科技	708	19,045.20	0.12
223	002386	天原股份	3,500	19,005.00	0.12
224	688588	凌志软件	1,328	19,003.68	0.12
225	300231	银信科技	1,800	18,954.00	0.12
226	300121	阳谷华泰	1,500	18,930.00	0.12
227	002124	天邦食品	6,900	18,906.00	0.12
228	300063	天龙集团	2,200	18,854.00	0.12
229	002829	星网宇达	600	18,852.00	0.12
230	300532	今天国际	1,600	18,848.00	0.12
231	300099	尤洛卡	2,500	18,825.00	0.12
232	300143	盈康生命	1,900	18,772.00	0.12
233	300265	通光线缆	1,400	18,760.00	0.12
233	300664	鹏鹞环保	3,500	18,760.00	0.12
234	600035	楚天高速	4,800	18,624.00	0.12
235	002449	国星光电	2,200	18,612.00	0.12
236	603035	常熟汽饰	1,200	18,564.00	0.12
237	002367	康力电梯	2,300	18,538.00	0.12
238	688653	康希通信	1,520	18,468.00	0.12
239	300440	运达科技	1,500	18,465.00	0.12
240	600251	冠农股份	2,000	18,460.00	0.12
241	300201	海伦哲	2,700	18,441.00	0.12
242	600368	五洲交通	4,700	18,424.00	0.12
243	300227	光韵达	2,000	18,420.00	0.12

244	688389	普门科技	1,417	18,392.66	0.12
245	600790	轻纺城	4,800	18,384.00	0.12
246	600558	大西洋	3,000	18,300.00	0.12
247	002161	远望谷	2,500	18,275.00	0.12
248	688311	盟升电子	400	18,240.00	0.12
249	300139	晓程科技	600	18,216.00	0.12
250	601686	友发集团	2,900	18,212.00	0.12
251	002055	得润电子	2,700	18,198.00	0.12
252	688663	新风光	469	18,183.13	0.12
253	002349	精华制药	2,500	18,150.00	0.12
254	002452	长高电新	2,200	18,106.00	0.12
255	300531	优博讯	1,000	18,040.00	0.11
256	300976	达瑞电子	300	18,021.00	0.11
257	002590	万安科技	1,200	18,000.00	0.11
258	301305	朗坤科技	800	17,976.00	0.11
259	000925	众合科技	2,000	17,960.00	0.11
260	002443	金洲管道	2,200	17,952.00	0.11
261	300193	佳士科技	2,000	17,900.00	0.11
262	300890	翔丰华	600	17,880.00	0.11
263	601956	东贝集团	2,500	17,825.00	0.11
264	688707	振华新材	1,287	17,824.95	0.11
265	002627	三峡旅游	2,400	17,808.00	0.11
266	605088	冠盛股份	500	17,800.00	0.11
267	688046	药康生物	1,158	17,786.88	0.11
268	300435	中泰股份	800	17,776.00	0.11
269	300758	七彩化学	1,400	17,766.00	0.11
270	002376	新北洋	2,300	17,756.00	0.11
271	002884	凌霄泵业	1,000	17,690.00	0.11
272	002662	峰璟股份	4,400	17,688.00	0.11
273	002301	齐心集团	2,300	17,664.00	0.11
274	301366	一博科技	500	17,635.00	0.11
275	600794	保税科技	4,500	17,550.00	0.11
276	002469	三维化学	2,100	17,535.00	0.11
277	300603	立昂技术	1,800	17,496.00	0.11
278	002580	圣阳股份	1,400	17,416.00	0.11
279	002358	森源电气	3,200	17,344.00	0.11
280	603348	文灿股份	900	17,334.00	0.11
281	600523	贵航股份	1,100	17,281.00	0.11
282	300467	迅游科技	600	17,220.00	0.11
283	000812	陕西金叶	3,600	17,208.00	0.11
284	002328	新朋股份	2,600	17,186.00	0.11
285	603611	诺力股份	700	17,115.00	0.11
286	300189	神农种业	2,300	17,112.00	0.11

287	600966	博汇纸业	2,500	17,075.00	0.11
288	300494	盛天网络	1,400	17,052.00	0.11
289	000521	长虹美菱	2,600	17,030.00	0.11
290	603158	腾龙股份	1,600	16,960.00	0.11
291	000718	苏宁环球	7,400	16,946.00	0.11
292	002303	美盈森	4,200	16,926.00	0.11
293	301221	光庭信息	300	16,872.00	0.11
294	603081	大丰实业	1,200	16,836.00	0.11
295	600976	健民集团	500	16,785.00	0.11
296	003043	华亚智能	360	16,693.20	0.11
297	600073	光明肉业	2,600	16,640.00	0.11
298	600195	中牧股份	2,100	16,527.00	0.11
299	688512	慧智微	1,480	16,516.80	0.11
300	300566	激智科技	900	16,515.00	0.11
301	300590	移为通信	1,300	16,484.00	0.10
302	688356	键凯科技	200	16,440.00	0.10
303	002899	英派斯	600	16,422.00	0.10
304	002833	弘亚数控	1,000	16,370.00	0.10
305	002810	山东赫达	1,100	16,313.00	0.10
306	300375	鹏翎股份	3,100	16,306.00	0.10
307	300055	万邦达	2,000	16,300.00	0.10
308	300307	慈星股份	2,300	16,261.00	0.10
309	605077	华康股份	1,100	16,258.00	0.10
310	300386	飞天诚信	900	16,254.00	0.10
311	000670	盈方微	2,200	16,236.00	0.10
312	000541	佛山照明	2,700	16,227.00	0.10
313	300288	朗玛信息	1,200	16,152.00	0.10
314	688598	金博股份	549	16,118.64	0.10
315	688207	格灵深瞳	1,058	16,081.60	0.10
316	603167	渤海轮渡	1,700	16,031.00	0.10
317	688410	山外山	1,069	16,002.93	0.10
318	000957	中通客车	1,400	15,988.00	0.10
319	603520	司太立	1,700	15,980.00	0.10
320	300617	安靠智电	500	15,950.00	0.10
321	002401	中远海科	1,000	15,930.00	0.10
322	300016	北陆药业	2,000	15,880.00	0.10
323	688191	智洋创新	493	15,864.74	0.10
324	300203	聚光科技	1,000	15,860.00	0.10
325	600824	益民集团	3,500	15,855.00	0.10
326	688298	东方生物	673	15,768.39	0.10
327	002454	松芝股份	1,800	15,678.00	0.10
328	688219	会通股份	1,261	15,661.62	0.10
329	300022	吉峰科技	2,000	15,640.00	0.10

330	002757	南兴股份	800	15,576.00	0.10
331	603325	博隆技术	200	15,554.00	0.10
332	300643	万通智控	800	15,552.00	0.10
333	002587	奥拓电子	2,300	15,548.00	0.10
334	600512	腾达建设	6,400	15,488.00	0.10
335	002419	天虹股份	2,800	15,484.00	0.10
336	603855	华荣股份	800	15,480.00	0.10
337	603528	多伦科技	1,600	15,472.00	0.10
338	603966	法兰泰克	1,300	15,470.00	0.10
339	003026	中晶科技	500	15,440.00	0.10
340	603538	美诺华	800	15,392.00	0.10
341	001205	盛航股份	900	15,390.00	0.10
342	002546	新联电子	2,200	15,378.00	0.10
343	002637	赞宇科技	1,500	15,375.00	0.10
344	600979	广安爱众	3,500	15,365.00	0.10
345	688317	之江生物	761	15,349.37	0.10
346	002052	同洲电子	1,200	15,300.00	0.10
347	600279	重庆港	2,800	15,288.00	0.10
348	300388	节能国祯	1,900	15,276.00	0.10
349	600184	光电股份	800	15,248.00	0.10
350	600479	千金药业	1,500	15,240.00	0.10
351	002659	凯文教育	2,600	15,236.00	0.10
352	002886	沃特股份	700	15,204.00	0.10
352	600805	悦达投资	2,800	15,204.00	0.10
353	688268	华特气体	264	15,150.96	0.10
354	002955	鸿合科技	500	15,135.00	0.10
355	300441	鲍斯股份	2,000	15,100.00	0.10
355	603012	创力集团	2,500	15,100.00	0.10
356	300858	科拓生物	900	15,093.00	0.10
357	300411	金盾股份	1,300	15,067.00	0.10
358	600960	渤海汽车	2,700	15,066.00	0.10
359	920418	苏轴股份	500	15,005.00	0.10
360	688505	复旦张江	1,805	14,981.50	0.10
361	601113	华鼎股份	3,200	14,976.00	0.10
362	000716	黑芝麻	2,400	14,952.00	0.10
363	300355	蒙草生态	3,700	14,948.00	0.10
364	300829	金丹科技	900	14,931.00	0.09
365	002035	华帝股份	2,400	14,880.00	0.09
366	688299	长阳科技	878	14,855.76	0.09
367	002314	南山控股	5,200	14,820.00	0.09
368	600127	金健米业	2,200	14,784.00	0.09
369	002538	司尔特	2,300	14,766.00	0.09
370	002908	德生科技	1,400	14,742.00	0.09

371	002111	威海广泰	1,400	14,728.00	0.09
372	002917	金奥博	1,100	14,718.00	0.09
373	300429	强力新材	1,100	14,663.00	0.09
374	603861	白云电器	1,200	14,604.00	0.09
375	300688	创业黑马	500	14,595.00	0.09
376	002103	广博股份	1,600	14,592.00	0.09
377	300011	鼎汉技术	1,700	14,586.00	0.09
378	002094	青岛金王	1,900	14,535.00	0.09
379	002782	可立克	800	14,528.00	0.09
380	002599	盛通股份	1,700	14,518.00	0.09
381	300719	安达维尔	800	14,488.00	0.09
382	601789	宁波建工	2,900	14,471.00	0.09
383	600987	航民股份	2,100	14,469.00	0.09
384	300578	会畅科技	700	14,420.00	0.09
385	002322	理工能科	1,200	14,412.00	0.09
386	600218	全柴动力	1,400	14,392.00	0.09
386	601002	晋亿实业	2,800	14,392.00	0.09
387	002876	三利谱	600	14,364.00	0.09
388	300569	天能重工	2,500	14,350.00	0.09
389	688418	震有科技	330	14,348.40	0.09
390	600851	海欣股份	2,100	14,343.00	0.09
391	688579	山大地纬	1,329	14,326.62	0.09
392	000919	金陵药业	1,800	14,310.00	0.09
393	300629	新劲刚	600	14,268.00	0.09
394	002037	保利联合	1,500	14,250.00	0.09
395	000726	鲁泰A	2,000	14,240.00	0.09
396	300513	恒实科技	1,500	14,235.00	0.09
396	605136	丽人丽妆	1,300	14,235.00	0.09
397	600638	新黄浦	2,200	14,234.00	0.09
398	002344	海宁皮城	3,000	14,220.00	0.09
399	600713	南京医药	2,600	14,196.00	0.09
400	603333	尚纬股份	1,700	14,195.00	0.09
401	600628	新世界	1,800	14,148.00	0.09
402	300667	必创科技	800	14,144.00	0.09
403	000601	韶能股份	3,000	14,100.00	0.09
404	300933	中辰股份	1,700	14,093.00	0.09
405	002845	同兴达	1,000	14,070.00	0.09
406	600178	东安动力	1,100	14,069.00	0.09
407	603002	宏昌电子	1,900	14,041.00	0.09
408	002986	宇新股份	1,300	13,988.00	0.09
409	920599	同力股份	670	13,889.10	0.09
410	002614	奥佳华	1,900	13,889.00	0.09
411	600101	明星电力	1,500	13,875.00	0.09

412	601886	江河集团	1,700	13,872.00	0.09
413	002189	中光学	600	13,854.00	0.09
414	300286	安科瑞	600	13,848.00	0.09
415	300691	联合光电	800	13,816.00	0.09
416	601188	龙江交通	3,900	13,806.00	0.09
417	688369	致远互联	542	13,783.06	0.09
418	688133	泰坦科技	621	13,748.94	0.09
419	000731	四川美丰	2,100	13,734.00	0.09
420	002033	丽江股份	1,500	13,725.00	0.09
421	603985	恒润股份	900	13,716.00	0.09
422	603111	康尼机电	2,000	13,700.00	0.09
423	300219	鸿利智汇	1,900	13,699.00	0.09
424	002819	东方中科	500	13,655.00	0.09
425	603278	大业股份	800	13,632.00	0.09
426	000906	浙商中拓	2,300	13,616.00	0.09
427	688020	方邦股份	200	13,604.00	0.09
428	002380	科远智慧	500	13,600.00	0.09
429	605208	永茂泰	1,000	13,580.00	0.09
430	600545	卓郎智能	5,300	13,568.00	0.09
431	000507	珠海港	2,600	13,546.00	0.09
432	300798	锦鸡股份	1,900	13,509.00	0.09
433	600653	中华控股	7,100	13,490.00	0.09
434	600318	新力金融	1,500	13,470.00	0.09
435	000926	福星股份	5,980	13,455.00	0.09
435	300414	中光防雷	900	13,455.00	0.09
436	603396	金辰股份	400	13,420.00	0.09
437	300241	瑞丰光电	2,400	13,416.00	0.09
438	601588	北辰实业	7,700	13,398.00	0.09
439	300479	神思电子	700	13,384.00	0.09
440	002331	皖通科技	1,500	13,380.00	0.09
441	300425	中建环能	2,700	13,365.00	0.09
442	000096	广聚能源	1,300	13,351.00	0.08
443	603687	大胜达	1,400	13,342.00	0.08
444	301580	爱迪特	300	13,260.00	0.08
445	002057	中钢天源	1,300	13,247.00	0.08
446	000713	国投丰乐	2,000	13,240.00	0.08
447	688550	瑞联新材	292	13,230.52	0.08
448	002282	博深股份	1,800	13,230.00	0.08
449	688253	英诺特	438	13,218.84	0.08
450	000717	中南股份	5,100	13,209.00	0.08
451	002692	远程股份	2,600	13,208.00	0.08
452	603633	徕木股份	1,300	13,169.00	0.08
453	301239	普瑞眼科	400	13,156.00	0.08

454	301058	中粮科工	1,200	13,152.00	0.08
455	301206	三元生物	500	13,145.00	0.08
456	600668	尖峰集团	1,160	13,108.00	0.08
457	000026	飞亚达	800	13,104.00	0.08
458	300546	雄帝科技	500	13,095.00	0.08
459	600874	创业环保	2,200	13,068.00	0.08
460	600780	通宝能源	2,300	13,064.00	0.08
461	300404	博济医药	1,400	13,062.00	0.08
462	688687	凯因科技	524	13,058.08	0.08
463	688697	纽威数控	848	13,042.24	0.08
464	603223	恒通股份	1,400	13,020.00	0.08
465	002609	捷顺科技	1,400	13,006.00	0.08
466	688259	创耀科技	311	12,999.80	0.08
467	688181	八亿时空	401	12,960.32	0.08
468	603258	电魂网络	700	12,957.00	0.08
469	600088	中视传媒	800	12,944.00	0.08
470	002398	垒知集团	2,300	12,926.00	0.08
471	002462	嘉事堂	900	12,924.00	0.08
472	688620	安凯微	1,073	12,918.92	0.08
473	688151	华强科技	626	12,908.12	0.08
474	600425	青松建化	3,100	12,896.00	0.08
475	002584	西陇科学	1,400	12,894.00	0.08
476	300239	东宝生物	2,200	12,892.00	0.08
477	301310	鑫宏业	300	12,885.00	0.08
478	603912	佳力图	1,500	12,855.00	0.08
479	002996	顺博合金	1,700	12,852.00	0.08
480	000862	银星能源	2,200	12,848.00	0.08
481	688315	诺禾致源	966	12,828.48	0.08
482	000531	穗恒运 A	2,000	12,820.00	0.08
483	300510	金冠股份	3,100	12,803.00	0.08
484	301149	隆华新材	1,200	12,768.00	0.08
485	300148	天舟文化	2,900	12,731.00	0.08
486	002849	威星智能	800	12,720.00	0.08
487	603051	鹿山新材	600	12,714.00	0.08
488	300176	鸿特科技	1,900	12,673.00	0.08
489	300991	创益通	300	12,654.00	0.08
490	301179	泽宇智能	800	12,648.00	0.08
491	603518	锦泓集团	1,300	12,623.00	0.08
492	002404	嘉欣丝绸	1,800	12,618.00	0.08
493	002866	传艺科技	700	12,607.00	0.08
494	600293	三峡新材	4,000	12,600.00	0.08
494	603980	吉华集团	2,500	12,600.00	0.08
495	600784	鲁银投资	1,800	12,564.00	0.08

496	603776	永安行	700	12,516.00	0.08
497	603313	梦百合	1,400	12,460.00	0.08
498	600054	黄山旅游	1,100	12,452.00	0.08
499	002274	华昌化工	2,200	12,430.00	0.08
499	603566	普莱柯	1,000	12,430.00	0.08
500	688710	益诺思	281	12,406.15	0.08
501	600135	乐凯胶片	1,200	12,384.00	0.08
502	600616	金枫酒业	2,300	12,328.00	0.08
503	301188	力诺药包	700	12,320.00	0.08
504	000554	泰山石油	1,900	12,312.00	0.08
505	603916	苏博特	1,300	12,298.00	0.08
506	600992	贵绳股份	900	12,213.00	0.08
507	002576	通达动力	700	12,180.00	0.08
508	000931	中关村	2,500	12,175.00	0.08
509	603466	风语筑	1,300	12,168.00	0.08
510	002393	力生制药	560	12,157.60	0.08
511	000159	国际实业	2,100	12,138.00	0.08
512	002363	隆基机械	1,200	12,120.00	0.08
512	603209	兴通股份	800	12,120.00	0.08
513	688103	国力电子	200	12,118.00	0.08
514	001338	永顺泰	1,000	12,110.00	0.08
515	300215	电科院	1,900	12,084.00	0.08
516	600212	绿能慧充	1,500	12,075.00	0.08
517	300039	上海凯宝	2,000	12,060.00	0.08
518	002730	电光科技	800	12,032.00	0.08
519	688533	上声电子	411	12,017.64	0.08
520	300365	恒华科技	1,900	12,008.00	0.08
521	603648	畅联股份	1,100	11,990.00	0.08
522	601616	广电电气	3,100	11,966.00	0.08
523	301121	紫建电子	300	11,952.00	0.08
524	600495	晋西车轴	2,500	11,950.00	0.08
525	300592	华凯易佰	1,100	11,946.00	0.08
526	300740	水羊股份	500	11,920.00	0.08
527	301208	中亦科技	300	11,904.00	0.08
528	600419	天润乳业	1,200	11,880.00	0.08
529	688589	力合微	522	11,875.50	0.08
530	603107	上海汽配	800	11,864.00	0.08
531	300439	美康生物	1,200	11,820.00	0.08
532	002135	东南网架	2,600	11,804.00	0.08
533	603310	巍华新材	700	11,767.00	0.07
534	002479	富春环保	2,400	11,760.00	0.07
534	301051	信濠光电	600	11,760.00	0.07
535	603989	艾华集团	700	11,746.00	0.07

536	002863	今飞凯达	2,000	11,740.00	0.07
537	300381	溢多利	1,800	11,736.00	0.07
538	301370	国科恒泰	1,000	11,680.00	0.07
539	300485	赛升药业	1,100	11,638.00	0.07
540	002869	金溢科技	500	11,630.00	0.07
541	301282	金禄电子	400	11,624.00	0.07
542	002286	保龄宝	1,300	11,622.00	0.07
543	600981	苏豪汇鸿	3,700	11,618.00	0.07
544	000576	甘化科工	1,100	11,583.00	0.07
545	605368	蓝天燃气	1,500	11,580.00	0.07
546	002666	德联集团	2,100	11,571.00	0.07
547	688376	美埃科技	200	11,564.00	0.07
548	688179	阿拉丁	925	11,553.25	0.07
549	603339	四方科技	900	11,547.00	0.07
550	300707	威唐工业	700	11,515.00	0.07
551	600731	湖南海利	1,700	11,509.00	0.07
552	605167	利柏特	700	11,501.00	0.07
553	300802	矩子科技	600	11,484.00	0.07
554	002343	慈文传媒	1,600	11,456.00	0.07
555	600215	派斯林	1,600	11,440.00	0.07
556	000548	湖南投资	2,100	11,424.00	0.07
556	300160	秀强股份	2,100	11,424.00	0.07
557	002561	徐家汇	1,300	11,414.00	0.07
558	603357	设计总院	1,400	11,410.00	0.07
559	603380	易德龙	300	11,400.00	0.07
560	003000	劲仔食品	1,000	11,390.00	0.07
561	603681	永冠新材	600	11,388.00	0.07
562	300057	万顺新材	2,000	11,380.00	0.07
563	600551	时代出版	1,400	11,368.00	0.07
564	002606	大连电瓷	1,300	11,362.00	0.07
565	301220	亚香股份	300	11,325.00	0.07
566	300407	凯发电气	1,000	11,320.00	0.07
567	688186	广大特材	499	11,317.32	0.07
568	002116	中国海诚	1,100	11,308.00	0.07
569	300639	凯普生物	2,100	11,298.00	0.07
570	300796	贝斯美	1,300	11,297.00	0.07
571	000710	贝瑞基因	1,000	11,290.00	0.07
572	000532	华金资本	700	11,284.00	0.07
573	002441	众业达	1,200	11,280.00	0.07
574	301330	熵基科技	340	11,237.00	0.07
575	301332	德尔玛	1,200	11,208.00	0.07
575	603344	星德胜	300	11,208.00	0.07
576	000607	华媒控股	2,700	11,205.00	0.07

577	603727	博迈科	800	11,184.00	0.07
578	600594	益佰制药	2,800	11,144.00	0.07
579	002034	旺能环境	700	11,130.00	0.07
580	301387	光大同创	200	11,080.00	0.07
581	003038	鑫铂股份	700	11,060.00	0.07
582	688039	当虹科技	247	11,053.25	0.07
583	600310	广西能源	2,900	11,049.00	0.07
584	603199	九华旅游	300	11,028.00	0.07
585	000822	山东海化	2,100	11,025.00	0.07
586	300656	民德电子	500	11,010.00	0.07
587	601339	百隆东方	1,900	11,001.00	0.07
588	300230	永利股份	2,300	10,994.00	0.07
589	300332	天壕能源	2,100	10,962.00	0.07
590	300752	隆利科技	600	10,950.00	0.07
590	301535	浙江华远	500	10,950.00	0.07
590	603375	盛景微	300	10,950.00	0.07
591	688458	美芯晟	276	10,940.64	0.07
592	002457	青龙管业	1,000	10,930.00	0.07
593	301516	中远通	700	10,927.00	0.07
594	600467	好当家	4,200	10,920.00	0.07
595	300107	建新股份	1,600	10,912.00	0.07
596	300795	米奥会展	800	10,896.00	0.07
597	603897	长城科技	400	10,880.00	0.07
598	301299	卓创资讯	200	10,876.00	0.07
599	300694	蠡湖股份	900	10,872.00	0.07
600	002933	新兴装备	300	10,860.00	0.07
601	300771	智莱科技	700	10,850.00	0.07
602	300447	全信股份	600	10,848.00	0.07
603	600433	冠豪高新	3,300	10,824.00	0.07
604	603270	金帝股份	400	10,812.00	0.07
605	603507	振江股份	410	10,787.10	0.07
606	688246	嘉和美康	463	10,764.75	0.07
607	601700	风范股份	1,900	10,754.00	0.07
608	300562	乐心医疗	800	10,664.00	0.07
609	300825	阿尔特	1,100	10,648.00	0.07
610	600278	东方创业	1,400	10,640.00	0.07
611	300817	双飞集团	500	10,605.00	0.07
611	301190	善水科技	500	10,605.00	0.07
612	301558	三态股份	1,300	10,595.00	0.07
613	000965	天保基建	2,700	10,584.00	0.07
614	300162	雷曼光电	1,300	10,569.00	0.07
615	301085	亚康股份	200	10,548.00	0.07
616	002224	三力士	2,400	10,536.00	0.07

617	600814	杭州解百	1,300	10,530.00	0.07
618	600830	香溢融通	1,100	10,527.00	0.07
619	301141	中科磁业	200	10,444.00	0.07
620	300715	凯伦股份	1,000	10,440.00	0.07
620	920249	利尔达	800	10,440.00	0.07
621	600121	郑州煤电	2,500	10,425.00	0.07
622	002613	北玻股份	2,800	10,416.00	0.07
623	300195	长荣股份	1,300	10,413.00	0.07
624	301157	华塑科技	200	10,404.00	0.07
625	000850	华茂股份	1,900	10,393.00	0.07
626	600853	龙建股份	2,400	10,392.00	0.07
627	002962	五方光电	700	10,374.00	0.07
628	600724	宁波富达	1,800	10,368.00	0.07
629	300853	申昊科技	500	10,360.00	0.07
630	300939	秋田微	300	10,344.00	0.07
631	301613	新铝时代	200	10,340.00	0.07
632	300112	万讯自控	1,200	10,332.00	0.07
632	601121	宝地矿业	1,400	10,332.00	0.07
633	301036	双乐股份	300	10,320.00	0.07
634	002746	仙坛股份	1,700	10,319.00	0.07
635	603058	永吉股份	1,100	10,307.00	0.07
636	300951	博硕科技	300	10,305.00	0.07
637	301011	华立科技	400	10,276.00	0.07
638	300040	九洲集团	1,700	10,234.00	0.07
639	301260	格力博	600	10,230.00	0.07
640	600152	维科技术	1,400	10,220.00	0.07
641	003005	竞业达	500	10,195.00	0.06
642	600758	辽宁能源	2,800	10,192.00	0.06
643	301060	兰卫医学	1,100	10,175.00	0.06
644	300881	盛德鑫泰	300	10,158.00	0.06
645	301393	昊帆生物	200	10,138.00	0.06
646	301509	金凯生科	300	10,134.00	0.06
647	688080	映翰通	200	10,100.00	0.06
648	002022	科华生物	1,700	10,098.00	0.06
649	002391	长青股份	1,700	10,081.00	0.06
650	300987	川网传媒	600	10,080.00	0.06
650	603126	中材节能	1,500	10,080.00	0.06
651	300986	志特新材	900	10,062.00	0.06
651	301428	世纪恒通	300	10,062.00	0.06
652	301586	佳力奇	200	10,032.00	0.06
653	300540	蜀道装备	500	10,000.00	0.06
654	301132	满坤科技	300	9,990.00	0.06
655	603527	众源新材	900	9,981.00	0.06

656	920368	连城数控	400	9,964.00	0.06
657	603381	永臻股份	500	9,930.00	0.06
658	300138	晨光生物	800	9,928.00	0.06
659	688308	欧科亿	313	9,903.32	0.06
660	600449	宁夏建材	800	9,888.00	0.06
661	002628	成都路桥	2,400	9,864.00	0.06
662	300916	朗特智能	300	9,834.00	0.06
663	688035	德邦科技	203	9,794.75	0.06
664	300488	恒锋工具	300	9,792.00	0.06
665	600261	阳光照明	2,900	9,773.00	0.06
666	300636	同和药业	1,300	9,763.00	0.06
667	601798	蓝科高新	1,100	9,757.00	0.06
668	300218	安利股份	600	9,750.00	0.06
668	300384	三联虹普	600	9,750.00	0.06
669	300962	中金辐照	600	9,738.00	0.06
670	301186	超达装备	200	9,712.00	0.06
671	300891	惠云钛业	1,100	9,680.00	0.06
671	688580	伟思医疗	200	9,680.00	0.06
672	000421	南京公用	1,400	9,674.00	0.06
673	300359	全通教育	1,800	9,648.00	0.06
673	605158	华达新材	1,200	9,648.00	0.06
674	300306	远方信息	700	9,625.00	0.06
675	002598	山东章鼓	900	9,621.00	0.06
676	603967	中创物流	700	9,611.00	0.06
677	300932	三友联众	800	9,592.00	0.06
678	000419	通程控股	1,500	9,585.00	0.06
679	600727	鲁北化工	1,400	9,576.00	0.06
680	600982	宁波能源	2,200	9,548.00	0.06
681	688799	华纳药厂	200	9,540.00	0.06
682	301328	维峰电子	200	9,514.00	0.06
683	605337	李子园	800	9,512.00	0.06
684	000655	金岭矿业	1,000	9,500.00	0.06
685	002852	道道全	900	9,495.00	0.06
686	301581	黄山谷捷	200	9,490.00	0.06
686	605066	天正电气	1,300	9,490.00	0.06
687	003025	思进智能	660	9,484.20	0.06
688	600081	东风科技	800	9,464.00	0.06
689	002186	全聚德	800	9,424.00	0.06
690	601330	绿色动力	1,400	9,422.00	0.06
691	688595	芯海科技	287	9,413.60	0.06
692	000153	丰原药业	1,500	9,405.00	0.06
693	301349	信德新材	200	9,382.00	0.06
694	688609	九联科技	918	9,372.78	0.06

695	301311	昆船智能	500	9,360.00	0.06
695	301587	中瑞股份	400	9,360.00	0.06
696	603587	地素时尚	700	9,352.00	0.06
697	300928	华安鑫创	300	9,345.00	0.06
698	605166	聚合顺	900	9,333.00	0.06
699	300105	龙源技术	1,300	9,308.00	0.06
700	300481	濮阳惠成	600	9,300.00	0.06
701	300711	广哈通信	400	9,288.00	0.06
702	002879	长缆科技	500	9,285.00	0.06
703	002616	长青集团	1,700	9,282.00	0.06
704	301408	华人健康	500	9,280.00	0.06
705	601133	柏诚股份	600	9,240.00	0.06
706	300247	融捷健康	1,800	9,234.00	0.06
707	605058	澳弘电子	300	9,156.00	0.06
708	600283	钱江水利	1,000	9,150.00	0.06
708	603801	志邦家居	1,000	9,150.00	0.06
709	605577	龙版传媒	700	9,149.00	0.06
710	300922	天秦装备	400	9,148.00	0.06
711	688489	三未信安	200	9,142.00	0.06
712	603275	众辰科技	200	9,116.00	0.06
713	600817	宇通重工	800	9,096.00	0.06
714	300412	迦南科技	1,700	9,095.00	0.06
715	301062	上海艾录	1,100	9,064.00	0.06
716	002556	辉隆股份	1,500	9,060.00	0.06
717	000779	甘咨询	1,100	9,031.00	0.06
718	300396	迪瑞医疗	700	9,030.00	0.06
719	002722	物产金轮	600	9,006.00	0.06
720	301173	毓恬冠佳	200	9,000.00	0.06
721	920491	奥迪威	300	8,973.00	0.06
722	001314	亿道信息	200	8,962.00	0.06
723	301439	泓淋电力	600	8,946.00	0.06
724	300504	天邑股份	600	8,934.00	0.06
725	300787	海能实业	760	8,930.00	0.06
726	002577	雷柏科技	500	8,905.00	0.06
727	000570	苏常柴 A	1,600	8,896.00	0.06
728	301459	丰茂股份	200	8,876.00	0.06
728	600229	城市传媒	1,400	8,876.00	0.06
729	603917	合力科技	600	8,874.00	0.06
730	300154	瑞凌股份	900	8,865.00	0.06
731	688719	爱科赛博	200	8,830.00	0.06
732	688768	容知日新	203	8,818.32	0.06
733	688651	盛邦安全	200	8,804.00	0.06
734	300880	迦南智能	500	8,790.00	0.06

735	300873	海晨股份	400	8,788.00	0.06
736	600858	银座股份	1,400	8,750.00	0.06
737	301028	东亚机械	600	8,748.00	0.06
738	300575	中旗股份	1,500	8,745.00	0.06
739	301501	恒鑫生活	200	8,732.00	0.06
740	600187	国中水务	3,500	8,715.00	0.06
741	300550	和仁科技	600	8,706.00	0.06
742	301479	弘景光电	100	8,702.00	0.06
743	002016	世荣兆业	1,500	8,670.00	0.06
744	301023	奕帆传动	200	8,660.00	0.06
745	301335	天元宠物	300	8,652.00	0.06
746	300713	英可瑞	500	8,650.00	0.06
747	002641	公元股份	2,000	8,640.00	0.05
748	300973	立高食品	200	8,600.00	0.05
748	603066	音飞储存	800	8,600.00	0.05
748	603987	康德莱	1,000	8,600.00	0.05
749	001388	信通电子	200	8,588.00	0.05
750	300847	中船汉光	500	8,570.00	0.05
751	688138	清溢光电	304	8,560.64	0.05
752	688716	中研股份	202	8,554.70	0.05
753	300577	开润股份	400	8,548.00	0.05
754	002918	蒙娜丽莎	600	8,538.00	0.05
755	920077	吉林碳谷	500	8,510.00	0.05
756	000517	荣安地产	4,700	8,507.00	0.05
757	600613	神奇制药	1,400	8,498.00	0.05
758	600620	天宸股份	1,300	8,450.00	0.05
759	002959	小熊电器	200	8,446.00	0.05
760	300805	电声股份	800	8,440.00	0.05
761	002615	哈尔斯	1,100	8,437.00	0.05
762	600826	兰生股份	800	8,432.00	0.05
763	300828	锐新科技	500	8,415.00	0.05
764	605098	行动教育	200	8,352.00	0.05
765	300956	英力股份	500	8,320.00	0.05
766	600439	瑞贝卡	3,000	8,310.00	0.05
767	603617	君禾股份	1,100	8,294.00	0.05
768	002660	茂硕电源	900	8,289.00	0.05
769	301030	仕净科技	700	8,281.00	0.05
770	301322	绿通科技	300	8,244.00	0.05
771	001319	铭科精技	300	8,241.00	0.05
772	603777	来伊份	600	8,238.00	0.05
773	603095	越剑智能	460	8,206.40	0.05
774	600865	百大集团	500	8,200.00	0.05
775	603788	宁波高发	500	8,170.00	0.05

776	300729	乐歌股份	600	8,166.00	0.05
777	300833	浩洋股份	200	8,136.00	0.05
778	688320	禾川科技	218	8,135.76	0.05
779	600785	新华百货	600	8,130.00	0.05
780	605300	佳禾食品	700	8,120.00	0.05
781	301591	肯特股份	200	8,108.00	0.05
782	300875	捷强装备	200	8,098.00	0.05
783	301202	朗威股份	200	8,080.00	0.05
784	300898	熊猫乳品	300	8,079.00	0.05
785	301348	蓝箭电子	400	8,076.00	0.05
786	688152	麒麟信安	200	8,070.00	0.05
787	600180	瑞茂通	2,300	8,050.00	0.05
787	600249	两面针	1,400	8,050.00	0.05
788	301520	万邦医药	200	7,946.00	0.05
789	688089	嘉必优	341	7,938.48	0.05
790	300514	友讯达	600	7,926.00	0.05
791	300824	北鼎股份	700	7,917.00	0.05
792	600386	北巴传媒	1,800	7,902.00	0.05
793	001328	登康口腔	200	7,896.00	0.05
794	001296	长江材料	300	7,881.00	0.05
795	000707	双环科技	1,300	7,865.00	0.05
796	603390	通达电气	600	7,842.00	0.05
797	601007	金陵饭店	1,000	7,810.00	0.05
798	300936	中英科技	200	7,800.00	0.05
799	603210	泰鸿万立	400	7,784.00	0.05
800	002644	佛慈制药	900	7,776.00	0.05
801	300791	仙乐健康	300	7,758.00	0.05
802	300608	思特奇	700	7,749.00	0.05
803	603120	肯特催化	200	7,700.00	0.05
803	688033	天宜新材	1,000	7,700.00	0.05
804	003028	振邦智能	260	7,693.40	0.05
805	600533	栖霞建设	3,000	7,680.00	0.05
806	002159	三特索道	500	7,665.00	0.05
807	600983	惠而浦	800	7,648.00	0.05
808	301185	鸥玛软件	400	7,640.00	0.05
809	603586	金麒麟	400	7,632.00	0.05
810	603350	安乃达	200	7,618.00	0.05
811	603150	万朗磁塑	200	7,596.00	0.05
812	688255	凯尔达	207	7,582.41	0.05
813	301161	唯万密封	200	7,572.00	0.05
814	301380	挖金客	200	7,560.00	0.05
815	301176	逸豪新材	300	7,551.00	0.05
816	300314	戴维医疗	600	7,548.00	0.05

817	002172	澳洋健康	1,900	7,543.00	0.05
818	300967	晓鸣股份	400	7,532.00	0.05
819	920261	一诺威	500	7,515.00	0.05
820	301552	科力装备	200	7,498.00	0.05
821	688112	鼎阳科技	200	7,490.00	0.05
822	688693	锆威特	200	7,488.00	0.05
823	603065	宿迁联盛	900	7,479.00	0.05
824	300094	国联水产	2,100	7,476.00	0.05
825	003007	直真科技	200	7,458.00	0.05
826	603409	汇通控股	200	7,446.00	0.05
827	300918	南山智尚	400	7,436.00	0.05
828	300859	西域旅游	200	7,394.00	0.05
829	920946	森萱医药	700	7,385.00	0.05
830	603082	北自科技	200	7,380.00	0.05
831	688529	豪森智能	400	7,376.00	0.05
832	603318	水发燃气	1,100	7,370.00	0.05
832	688093	世华科技	200	7,370.00	0.05
833	300021	大禹节水	1,600	7,360.00	0.05
833	603168	莎普爱思	1,000	7,360.00	0.05
834	603116	红蜻蜓	1,200	7,356.00	0.05
835	002661	克明食品	800	7,312.00	0.05
836	920593	鼎智科技	200	7,304.00	0.05
837	002551	尚荣医疗	2,000	7,300.00	0.05
837	605006	山东玻纤	1,000	7,300.00	0.05
838	301210	金杨精密	200	7,280.00	0.05
839	603399	永杉锂业	700	7,273.00	0.05
840	301266	宇邦新材	200	7,270.00	0.05
841	000428	华天酒店	2,200	7,260.00	0.05
841	002330	得利斯	1,500	7,260.00	0.05
842	300589	江龙船艇	400	7,220.00	0.05
843	920174	五新隧装	149	7,202.66	0.05
844	300164	通源石油	1,300	7,176.00	0.05
845	600168	武汉控股	1,400	7,126.00	0.05
846	001219	青岛食品	500	7,125.00	0.05
847	603600	永艺股份	600	7,122.00	0.05
848	300722	新余国科	200	7,104.00	0.05
849	603779	威龙股份	1,100	7,084.00	0.05
850	603739	蔚蓝生物	500	7,075.00	0.05
851	603136	天目湖	600	7,068.00	0.04
852	301329	信音电子	300	7,062.00	0.04
853	300989	蕾奥规划	400	7,060.00	0.04
854	300927	江天化学	300	6,993.00	0.04
855	301633	港迪技术	100	6,992.00	0.04

856	605018	长华集团	600	6,948.00	0.04
857	300778	新城市	500	6,940.00	0.04
858	300335	迪森股份	1,200	6,912.00	0.04
859	301195	北路智控	200	6,906.00	0.04
860	605080	浙江自然	300	6,900.00	0.04
861	603569	长久物流	900	6,885.00	0.04
862	301302	华如科技	300	6,861.00	0.04
863	001279	强邦新材	200	6,848.00	0.04
864	300583	赛托生物	500	6,845.00	0.04
865	301048	金鹰重工	600	6,840.00	0.04
866	002442	龙星科技	1,100	6,831.00	0.04
867	300988	津荣天宇	300	6,825.00	0.04
868	301560	众捷汽车	200	6,812.00	0.04
869	002732	燕塘乳业	400	6,808.00	0.04
870	301026	浩通科技	240	6,801.60	0.04
871	300240	飞力达	900	6,786.00	0.04
872	301419	阿莱德	200	6,776.00	0.04
873	600679	上海凤凰	500	6,715.00	0.04
874	002395	双象股份	400	6,692.00	0.04
875	603237	五芳斋	400	6,672.00	0.04
876	300911	亿田智能	200	6,660.00	0.04
877	688071	华依科技	200	6,634.00	0.04
878	300831	派瑞股份	600	6,612.00	0.04
879	000968	蓝焰控股	1,000	6,610.00	0.04
880	002995	天地在线	400	6,608.00	0.04
881	688566	吉贝尔	221	6,596.85	0.04
882	603213	镇洋发展	500	6,565.00	0.04
883	002835	同为股份	400	6,552.00	0.04
884	001239	永达股份	400	6,528.00	0.04
885	301258	富士莱	200	6,500.00	0.04
885	920239	长虹能源	200	6,500.00	0.04
886	603070	万控智造	500	6,480.00	0.04
887	300905	宝丽迪	200	6,446.00	0.04
888	600359	新农开发	900	6,435.00	0.04
889	301559	中集环科	400	6,356.00	0.04
890	603577	汇金通	600	6,312.00	0.04
891	920510	丰光精密	300	6,303.00	0.04
892	301456	盘古智能	200	6,300.00	0.04
893	605258	协和电子	200	6,254.00	0.04
894	301598	博科测试	100	6,248.00	0.04
895	301585	蓝宇股份	200	6,184.00	0.04
896	688162	巨一科技	200	6,160.00	0.04
897	300892	品渥食品	200	6,074.00	0.04

898	300654	世纪天鸿	600	5,946.00	0.04
899	300930	屹通新材	200	5,940.00	0.04
900	301017	漱玉平民	400	5,900.00	0.04
901	605186	健麾信息	300	5,895.00	0.04
902	301499	维科精密	200	5,886.00	0.04
903	301281	科源制药	200	5,860.00	0.04
904	301399	英特科技	300	5,856.00	0.04
905	301255	通力科技	200	5,850.00	0.04
906	300196	长海股份	400	5,824.00	0.04
907	603706	东方环宇	300	5,820.00	0.04
908	603768	常青股份	500	5,800.00	0.04
909	605266	健之佳	300	5,766.00	0.04
910	300534	陇神戎发	600	5,688.00	0.04
911	301378	通达海	200	5,680.00	0.04
912	301151	冠龙节能	300	5,640.00	0.04
913	002574	明牌珠宝	1,000	5,620.00	0.04
913	301135	瑞德智能	200	5,620.00	0.04
914	300616	尚品宅配	400	5,572.00	0.04
915	301601	惠通科技	200	5,558.00	0.04
916	300908	仲景食品	200	5,540.00	0.04
917	605218	伟时电子	300	5,535.00	0.04
918	301318	维海德	200	5,528.00	0.04
919	301337	亚华电子	200	5,502.00	0.03
920	603677	奇精机械	300	5,454.00	0.03
921	920247	华密新材	200	5,448.00	0.03
922	300673	佩蒂股份	300	5,379.00	0.03
923	603711	香飘飘	400	5,372.00	0.03
924	603096	新经典	300	5,226.00	0.03
925	301073	君亭酒店	200	5,212.00	0.03
926	002646	天佑德酒	600	5,190.00	0.03
927	603206	嘉环科技	300	5,187.00	0.03
928	301616	浙江华业	100	5,108.00	0.03
929	603153	上海建科	300	5,100.00	0.03
930	301320	豪江智能	300	5,091.00	0.03
931	603289	泰瑞机器	500	5,060.00	0.03
932	300784	利安科技	100	5,022.00	0.03
933	920208	青矩技术	200	4,942.00	0.03
934	301636	泽润新能	100	4,890.00	0.03
935	688722	同益中	249	4,867.95	0.03
936	001223	欧克科技	100	4,858.00	0.03
937	300945	曼卡龙	300	4,848.00	0.03
938	301102	兆讯传媒	460	4,825.40	0.03
939	301129	瑞纳智能	200	4,770.00	0.03

940	301199	迈赫股份	200	4,664.00	0.03
941	603511	爱慕股份	300	4,647.00	0.03
942	001256	炜冈科技	200	4,468.00	0.03
943	301578	辰奕智能	130	4,391.40	0.03
944	001395	亚联机械	100	4,341.00	0.03
945	603787	新日股份	300	4,218.00	0.03
946	603273	天元智能	200	4,198.00	0.03
947	002982	湘佳股份	300	4,122.00	0.03
948	920394	民士达	100	4,092.00	0.03
949	300947	德必集团	200	4,028.00	0.03
950	603006	联明股份	300	3,936.00	0.03
950	920571	国航远洋	400	3,936.00	0.03
951	920720	吉冈精密	280	3,934.00	0.03
952	600792	云煤能源	1,000	3,880.00	0.02
953	920819	颖泰生物	1,000	3,870.00	0.02
954	001324	长青科技	200	3,608.00	0.02
955	920953	国子软件	100	3,575.00	0.02
956	920122	中纺标	100	3,351.00	0.02
957	605268	王力安防	300	3,201.00	0.02
958	605336	帅丰电器	200	3,148.00	0.02
959	920971	天马新材	100	3,070.00	0.02
960	300788	中信出版	100	2,740.00	0.02
961	301009	可靠股份	200	2,536.00	0.02

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

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	688313	仕佳光子	176,527.06	0.58
2	600410	华胜天成	160,564.00	0.53
3	300382	斯莱克	144,044.00	0.48
4	603809	豪能股份	143,745.00	0.47
5	603319	美湖股份	142,757.00	0.47
6	603067	振华股份	134,331.00	0.44
7	688239	航宇科技	128,247.32	0.42
8	688382	益方生物	126,666.78	0.42
9	688049	炬芯科技	126,191.32	0.42
10	688205	德科立	122,155.48	0.40
11	300806	斯迪克	119,231.00	0.39
12	605196	华通线缆	116,079.00	0.38
13	300718	长盛轴承	115,435.00	0.38

14	300708	聚灿光电	115,190.00	0.38
15	300953	震裕科技	114,738.00	0.38
16	301550	斯菱智驱	114,686.00	0.38
17	688158	优刻得	112,887.63	0.37
18	688800	瑞可达	112,645.27	0.37
19	600619	海立股份	112,613.00	0.37
20	600629	华建集团	112,522.00	0.37

8.4.2 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	600410	华胜天成	305,744.00	1.01
2	688313	仕佳光子	278,449.37	0.92
3	600105	永鼎股份	236,186.00	0.78
4	688158	优刻得	227,299.88	0.75
5	600619	海立股份	201,433.00	0.67
6	603887	城地香江	172,223.00	0.57
7	603009	北特科技	166,035.00	0.55
8	688591	泰凌微	162,906.96	0.54
9	603067	振华股份	153,489.00	0.51
10	002031	巨轮智能	152,679.38	0.50
11	688382	益方生物	149,940.35	0.50
12	603809	豪能股份	147,136.80	0.49
13	603686	福龙马	143,267.00	0.47
14	600973	宝胜股份	139,289.00	0.46
15	605196	华通线缆	139,142.00	0.46
16	600609	金杯汽车	135,004.00	0.45
17	603738	泰晶科技	134,790.00	0.45
18	600113	浙江东日	132,036.00	0.44
19	600106	重庆路桥	130,498.00	0.43
20	600843	上工申贝	129,382.00	0.43

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	50,033,113.08
卖出股票收入（成交）总额	56,206,929.42

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-

3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	5,140.19	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	5,140.19	0.03

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	123264	双乐转债	24	2,400.06	0.02
2	123263	鼎捷转债	12	1,740.04	0.01
3	111024	澳弘转债	10	1,000.09	0.01

注：报告期末，本基金仅持有上述 3 只债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

无。

8.11.2 本期国债期货投资评价

无。

8.12 投资组合报告附注

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

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

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	16,499.63
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	16,499.63

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
488	22,502.23	7,565,612.00	68.90	3,415,476.00	31.10

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例(%)
1	招商证券股份有限公司	2,038,998.00	18.57

2	华泰证券股份有限公司	1,811,227.00	16.49
3	国泰海通证券股份有限公司	972,740.00	8.86
4	中信证券股份有限公司	912,491.00	8.31
5	中信建投证券股份有限公司	823,433.00	7.50
6	日照市安达爆破工程有限公司	464,721.00	4.23
7	BARCLAYS BANK PLC	341,901.00	3.11
8	周爱凤	280,000.00	2.55
9	李军	205,400.00	1.87
10	东方证券股份有限公司	200,000.00	1.82

注：上述基金持有人份额均为场内基金份额。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2023年9月14日） 基金份额总额	490,981,088.00
本报告期期初基金份额总额	28,981,088.00
本报告期基金总申购份额	18,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	36,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	10,981,088.00

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 基金管理人的重大人事变动情况

2025 年 5 月 22 日本基金管理人发布公告，刘伟先生任公司首席信息官、杨竞霜先生离任公司副总经理、首席信息官。

2025 年 7 月 5 日本基金管理人发布公告，李明先生离任财务负责人，经雷先生任财务负责人（兼）。

(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。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、本基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所。德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）已连续 2 年为本基金提供审计服务。

11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

管理人受调查或处罚等情况 1	内容
受到调查或处罚等措施的主体	管理人
受到调查或处罚等措施的时间	2025 年 11 月 3 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证监会北京证监局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施
受到的具体措施类型	责令改正并暂停受理固定收益类公募基金产品注册 3 个月
受到调查或处罚等措施的原因	合规内控、投资运作、公司治理
受到处罚的依据	《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货投资者适当性管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《基金管理公司子公司管理规定》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	截至报告期末，公司已从加强制度建设、完善流程机制、优化系统功能、加强人员培训等方面完成整改，并向北京证监局提交了整改完成情况报告。
其他	-

11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期，基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门无受调查或处罚等情况。

11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人分管公募基金托管业务的高级管理人员无受调查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
广发证券股份有限公司	2	41,416,004.91	38.98	7,700.12	39.04	-
中信建投证券股份有限公司	2	28,454,968.24	26.78	5,291.23	26.83	-
国泰海通证券股份有限公司	2	18,064,473.25	17.00	3,358.24	17.03	-
国信证券股份有限公司	2	13,390,201.18	12.60	2,490.12	12.62	-
中信证券股份有限公司	6	4,914,394.92	4.63	884.37	4.48	-
方正证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-

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) 合规风控能力较强；
- (4) 交易等服务能力较强。

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。

3. 国泰君安证券股份有限公司于 2025 年 3 月 14 日完成吸收合并海通证券股份有限公司，并自 2025 年 4 月 3 日起更名为国泰海通证券股份有限公司。上表中列示的国泰海通证券股份有限公司相关数据包含了被合并后的海通证券股份有限公司相关数据。

4. 报告期内，本基金新增以下交易单元：方正证券股份有限公司新增交易单元 2 个，光大证券股份有限公司新增交易单元 2 个，国泰海通证券股份有限公司新增交易单元 2 个，国信证券股份有限公司新增交易单元 2 个，平安证券股份有限公司新增交易单元 2 个，中国银河证券股份有限公司新增交易单元 2 个。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
广发证券股份有限公司	20,363.34	89.74	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

中信证券股份有限公司	2,327.92	10.26	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	嘉实基金管理有限公司关于嘉实中证2000 交易型开放式指数证券投资基金关联交易的公告	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	2025 年 5 月 13 日
2	嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告	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	2025 年 5 月 22 日
3	嘉实基金管理有限公司关于旗下部分深交所 ETF 变更场内简称的公告	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	2025 年 6 月 16 日
4	嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告	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	2025 年 7 月 5 日
5	嘉实基金管理有限公司关于旗下部分基金新增东方证券股份有限公司为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	2025 年 12 月 29 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	期初	申购	赎回	持有份额

		比例达到或者超过 20%的时间区间	份额	份额	份额		占比 (%)
机构	1	2025-03-25 至 2025-03-25, 2 2025-04-14 至 2025-04-16, 2 2025-04-18 至 2025-04-20, 2 2025-05-06 至 2025-05-06, 2 2025-05-22 至 2025-05-25, 2 2025-06-19 至 2025-07-13, 2 2025-07-17 至 2025-08-17, 2 2025-09-04 至 2025-09-08, 2 2025-09-23 至 2025-09-24, 2 2025-10-10 至 2025-10-12, 2 2025-10-14 至 2025-10-14, 2 2025-10-28 至 2025-10-28, 2 2025-11-04 至 2025-11-04, 2 2025-12-19 至 2025-12-21	3, 379, 223 .00	23, 611, 3 24.00	24, 951, 54 9.00	2, 038, 998.00	18.57
	2	2025-01-01 至 2025-01-09, 2 2025-01-13 至 2025-02-19, 2 2025-02-21 至 2025-02-23, 2 2025-05-29 至 2025-06-17, 2 2025-07-15 至 2025-07-16, 2 2025-08-25 至 2025-08-26, 2 2025-11-19 至 2025-11-19, 2	6, 817, 113 .00	53, 143, 4 19.00	59, 137, 09 9.00	823, 433.00	7.50

		025-11-24 至 2025-11-24					
	3	2025-07-14 至 2025-07-14	-	5,220,000.00	5,220,000.00	-	-
产品特有风险							
<p>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。</p> <p>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。</p>							

注：申购份额包括申购、转换转入、红利再投或份额拆分等导致增加的份额，赎回份额包括赎回、转换转出或份额合并等导致减少的份额。

§ 13 备查文件目录

13.1 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。

13.2 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

13.3 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

2026 年 3 月 30 日