

景顺长城国证 2000 交易型开放式指数证券  
投资基金  
2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：广发证券股份有限公司

送出日期：2024 年 3 月 29 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。

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

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

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

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，基金管理人本报告中对相关事项亦有详细说明，请投资者注意阅读。

本报告期自 2023 年 9 月 13 日（基金合同生效日）起至 2023 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>6</b>
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	9
3.4 过去三年基金的利润分配情况	9
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
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	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>15</b>
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	16
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>17</b>
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	19
7.3 净资产变动表	20
7.4 报表附注	21

<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>45</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	45
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	45
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 .....	47
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	70
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	71
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 .....	72
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 .....	72
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 .....	72
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 .....	72
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	72
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	72
8.12 投资组合报告附注 .....	73
<b>§ 9 基金份额持有人信息</b> .....	<b>74</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	74
9.2 期末上市基金前十名持有人 .....	74
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	74
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 .....	74
9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况 .....	75
<b>§ 10 开放式基金份额变动</b> .....	<b>75</b>
<b>§ 11 重大事件揭示</b> .....	<b>75</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	75
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 .....	75
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	75
11.4 基金投资策略的改变 .....	75
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	75
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	75
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	76
11.8 其他重大事件 .....	77
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>78</b>
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 .....	78
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	79
<b>§ 13 备查文件目录</b> .....	<b>79</b>
13.1 备查文件目录 .....	79
13.2 存放地点 .....	79
13.3 查阅方式 .....	79

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	景顺长城国证 2000ETF
场内简称	国证 2000ETF 景顺
基金主代码	159522
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023 年 9 月 13 日
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	广发证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	67,896,935.00 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 10 月 16 日

注：自 2024 年 3 月 18 日起，本基金场内简称由“2000ETF 基金”变更为“国证 2000ETF 景顺”。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，以期获得与标的指数收益相似的回报。
投资策略	<p>1、股票投资策略</p> <p>本基金以国证 2000 指数为标的指数，采用抽样复制法，即根据个股行业、市值等指标，在指数成份股中选取更有代表性的样本股，并通过长期稳定的风险模型采用“跟踪误差最小化”的优化方式设计样本股的组合比例。</p> <p>2、股指期货投资策略</p> <p>本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。</p> <p>3、股票期权投资策略</p> <p>本基金投资股票期权将按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的，结合投资目标、比例限制、风险收益特征以及法律法规的相关限定和要求，确定参与股票期权交易的投资时机和投资比例。基金投资股票期权符合基金合同约定的比例限制（如股票仓位、个股占比等）、投资目标和风险收益特征。</p> <p>4、存托凭证投资策略</p> <p>本基金的存托凭证投资将根据本基金的投资目标和上述股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，通过定性和定量分析相结合的方式，筛选具有比较优势的存托凭证作为投资标的，以更好地跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。</p> <p>5、债券投资策略</p> <p>出于对流动性、跟踪误差、有效利用基金资产的考量，本基金适时对债券进行投资。</p>

	<p>6、可转换债券投资策略和可交换债券投资策略</p> <p>基金管理人根据定期公布的宏观和金融数据以及对宏观经济、股市政策、市场趋势的综合分析，判断下一阶段的市场走势，分析可转换债券和可交换债券的股性和债性的相对价值。</p> <p>7、融资及转融通证券出借业务投资策略</p> <p>本基金在参与融资、转融通证券出借业务时将根据风险管理的原则，在法律法规允许的范围和比例内、风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与融资和转融通证券出借业务。</p>
业绩比较基准	国证 2000 指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金为指数型基金，被动跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	景顺长城基金管理有限公司	广发证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨皞阳
	联系电话	0755-82370388
	电子邮箱	investor@igwfm.com
客户服务电话	4008888606	95575
传真	0755-22381339	020-87553363-6847
注册地址	深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街 2 号 618 室
办公地址	深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	广州市天河区马场路 26 号广发证券大厦 34 楼
邮政编码	518048	510627
法定代表人	李进	林传辉

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.igwfm.com
基金年度报告备置地点	基金管理人的办公场所

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 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	2023 年 9 月 13 日（基金合同生效日）-2023 年 12 月 31 日
---------------	---

本期已实现收益	1,322,283.72
本期利润	475,393.42
加权平均基金份额本期利润	0.0032
本期加权平均净值利润率	0.32%
本期基金份额净值增长率	-0.65%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>2023 年末</b>
期末可供分配利润	-443,123.91
期末可供分配基金份额利润	-0.0065
期末基金资产净值	67,453,811.09
期末基金份额净值	0.9935
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>2023 年末</b>
基金份额累计净值增长率	-0.65%

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

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

3、基金份额净值的计算精确到小数点后四位，小数点后第五位四舍五入，由此产生的误差计入基金资产。

4、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。

5、本基金基金合同生效日为 2023 年 9 月 13 日。

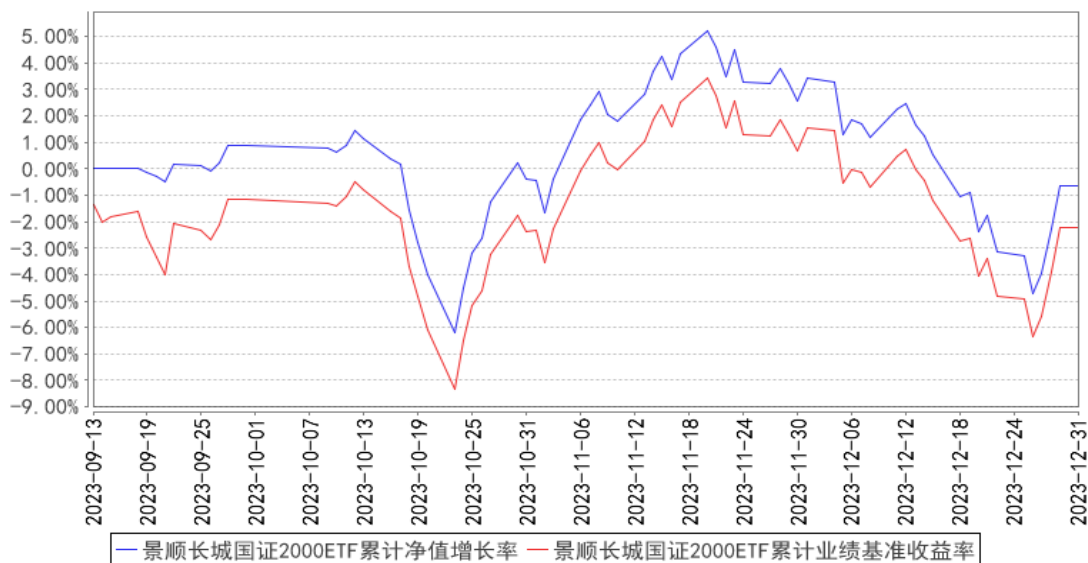
## 3.2 基金净值表现

### 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	-1.51%	1.04%	-1.11%	1.07%	-0.40%	-0.03%
自基金合同生效起至今	-0.65%	0.95%	-2.23%	1.04%	1.58%	-0.09%

### 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

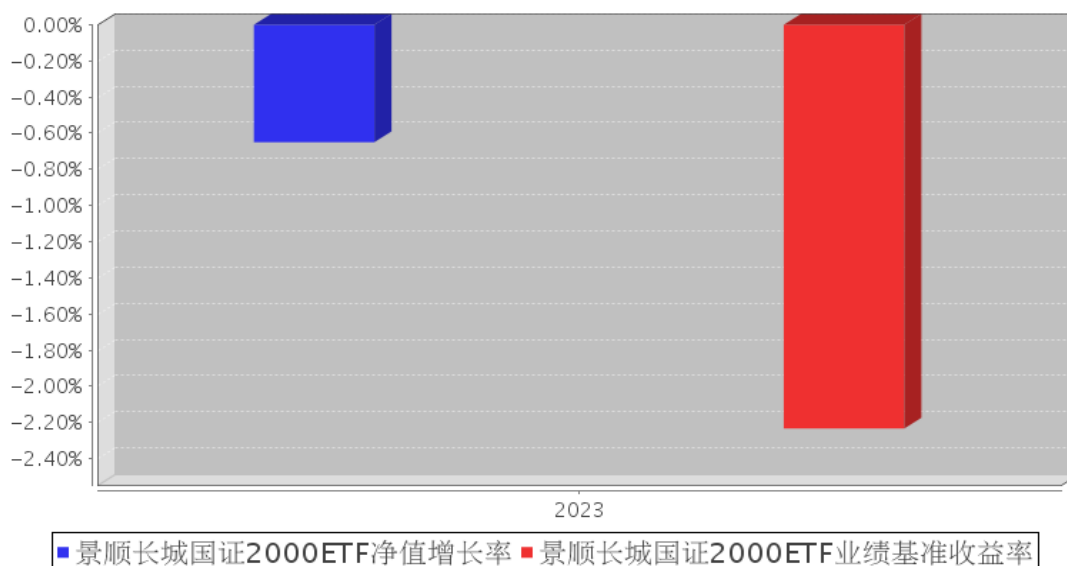
景顺长城国证2000ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金的投资组合比例为：基金投资于标的指数成份股及备选成份股的资产不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的建仓期为自 2023 年 9 月 13 日基金合同生效日起 6 个月。截至本报告期末，本基金仍处于建仓期。基金合同生效日（2023 年 9 月 13 日）起至本报告期末不满一年。

### 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

景顺长城国证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：2023 年净值增长率与业绩比较基准收益率的实际计算期间是 2023 年 9 月 13 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日。

### 3.3 其他指标

无。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

本基金自2023年9月13日（基金合同生效日）至本期期末未进行利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人景顺长城基金管理有限公司（以下简称“本公司”）是经中国证监会证监基金字[2003]76号文批准设立的证券投资基金管理公司，由长城证券股份有限公司、景顺资产管理有限公司、开滦（集团）有限责任公司、大连实德集团有限公司共同发起设立，并于2003年6月9日获得开业批文，注册资本1.3亿元人民币，目前，各家出资比例分别为49%、49%、1%、1%。总部设在深圳，在北京、上海、广州设有分公司，并设立全资子公司——景顺长城资产管理（深圳）有限公司。

本公司拥有公募、特定客户资产管理、QDII等业务资格，截至2023年12月31日，本公司旗下共管理179只开放式基金，在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、海外投资、资产配置等多个领域布局。

本公司采用团队投资方式，即通过整个投资部门全体人员的共同努力，争取良好投资业绩。

#### 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		
郑天行	本基金的基金经理	2023年9月13日	-	9年	理学硕士，CFA。曾任美国摩根斯坦利（纽约）对冲基金投资组合分析师，美国Aristeia基金（纽约）数据分析师，美国城堡基金（纽约）大数据研究员。2019年5月加入本公司，历任养老及资产配置部研究员、ETF投资部研究员、专户投资部投资经理，自2022年8月起担任ETF与创新投资部基金经理。具有9年证券、基金行业从业经验。
张晓南	本基金的基金经理	2023年9月15日	-	13年	经济学硕士，CFA，FRM。曾任鹏华基金管理有限公司产品规划部高级产品设计师，

	助理				兴银基金管理有限公司研究发展部研究员、权益投资部基金经理。2020 年 2 月加入本公司,自 2020 年 4 月起担任 ETF 与创新投资部基金经理。具有 13 年证券、基金行业从业经验。
金瓚	本基金的基金经理助理	2023 年 9 月 15 日	-	7 年	工学硕士, CFA。曾任美国 AltfestPersonalWealthManagement(艾福斯特个人财富管理)投资部量化研究员, Morgan Stanley(美国摩根士丹利)风险管理部信用风险分析员。2018 年 7 月加入本公司,历任风险管理部经理、ETF 与创新投资部研究员、ETF 与创新投资部基金经理助理,自 2023 年 9 月起担任 ETF 与创新投资部基金经理。具有 7 年证券、基金行业从业经验。

注: 1、对基金的首任基金经理,其“任职日期”按基金合同生效日填写,“离任日期”为根据公司决定的解聘日期(公告前一日);对此后的非首任基金经理,“任职日期”指根据公司决定聘任后的公告日期,“离任日期”指根据公司决定的解聘日期(公告前一日);

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

本报告期内,本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》和《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《景顺长城国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,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,为基金持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作整体合法合规,未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

为了进一步规范和完善本基金管理人(以下简称“本公司”)投资和交易管理,严格遵守法

律法规关于公平交易的相关规定，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011 年修订）》、《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》等法律法规，本公司制定了《景顺长城基金管理有限公司公平交易指引》，该《指引》涵盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时对授权、研究分析与投资决策、交易执行的内部控制、交易指令的分配执行、公平交易监控、报告措施及信息披露、利益冲突的防范和异常交易的监控等方面进行了全面规范。具体控制措施如下：

#### 1、授权、研究分析与投资决策的内部控制

建立投资授权制度，明确各投资决策主体的职责和权限划分；建立客观的研究方法，任何投资分析和建议均应有充分的事实和数据支持，避免主观臆断，严禁利用内幕信息作为投资依据；确保所有投资组合平等地享有研究成果；根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和投资限制等，建立不同投资组合的投资主题库和交易对手备选库，投资组合经理在此基础上根据投资授权构建具体的投资组合并独立进行投资决策。

#### 2、交易执行的内部控制

本公司实行集中交易制度，将投资管理职能和交易执行职能相隔离；建立公平的交易分配机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。同时严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。

#### 3、交易指令分配的控制

所有投资对象的投资指令必须经由交易管理部总监或其授权人审核后分配至交易员执行。

交易员对于接收到的交易指令依照时间优先、价格优先的顺序执行。在执行多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的投资指令时，需根据价格优先、比例分配的原则，经过公平性审核，公平对待多个不同投资组合的投资指令。

#### 4、公平交易监控

本公司建立异常交易行为日常监控和分析评估制度。交易管理部负责异常交易的日常实时监控，风险管理部于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗内（如 1 日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合的同向交易的交易价差进行分析，对不同投资组合临近交易日的反向交易的交易价差进行分析。相关投资组合经理应对异常交易情况进行合理性解释，由投资组合经理、督察长、总经理签署后，妥善保存分析报告备查。如果在上述分析期间内，公司管理的所有投资组合同向交易价差出现异常情况，应重新核查公司投资决策和交易执行环节的内部控制

制，针对潜在问题完善公平交易制度，并在监察稽核季度报告和年度报告中对此做专项说明。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011年修订）》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有投资组合。本报告期内本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011年修订）》及《景顺长城基金管理有限公司公平交易指引》对本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现不公平交易的情况。

##### 4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本报告期内，本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共有 31 次，为投资组合的投资策略需要而发生的同日反向交易，按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本年度，A 股权益市场整体情绪较为低迷，主要宽基指数均有一定程度回调，宽基指数涨跌幅及排序为：上证指数(-3.70%)>科创 50(-11.24%)>沪深 300(-11.38%)>中小 100(-17.98%)>创业板指(-19.41%)。市值维度，总体表现出小盘占优特征，规模指数涨跌幅及排序为：中证 1000(-6.28%)>中证 500(-7.42%)>沪深 300(-11.38%)。风格维度，中信风格指数涨跌幅及排序为：稳定(2.14%)>周期(-2.44%)>金融(-3.86%)>成长(-6.75%)>消费(-7.90%)。行业维度，涨跌幅排前五行业为：通信(25.75%)、传媒(16.80%)、计算机(8.97%)、电子(7.25%)、石油石化(4.32%)，排后五行业为：美容护理(-32.03%)、商贸零售(-31.30%)、房地产(-26.39%)、电力设备(-26.19%)、建筑材料(-22.64%)。

本基金采用复制标的指数的方法进行组合管理，通过控制跟踪误差和跟踪偏离度，力争基金收益和指数收益基本一致。在报告期内，本基金结合申购赎回情况、标的指数成分调整情况定期或不定期调整投资组合，保持对标的指数的紧密跟踪。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2023 年 9 月 13 日（基金合同生效日）至本报告期末，本基金份额净值增长率为-0.65%，业绩比较基准收益率为-2.23%。报告期内，本基金相对于业绩比较基准的日均跟踪偏离度的绝对值

控制在 0.20%以内，跟踪误差（年化）为 4.62%，超过 2.00%要求。本基金在建仓阶段跟踪误差较大，在当前建仓期结束后已将跟踪误差控制在合理水平。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观数据层面，主要经济活动指标：12 月工业增加值同比增长 6.8%，前值 6.6%，经季度调整后环比增长 0.52%；12 月 PMI49.0，10 月 49.4；12 月社会消费品零售总额同比增长 7.4%，前值 10.1%。通胀指标：12 月 PPI 同比-2.7%，前值-3.0%；12 月 CPI 当月同比-0.3%，前值-0.5%。货币金融指标 12 月 M2 同比增长 9.7%，前值 10.0%；12 月社会融资规模同比增长 9.5% 前值 9.4%。总体来看，增长斜率有所回升，继续保持良好的复苏态势，同时通胀仍处在低位区间运行。

权益市场的长期趋势反映上市公司总体盈利能力的逐步提升，背后的驱动力是经济长期增长动能以及科技升级、产业升级带来的生产力提升。目前主要宽基指数估值水平处在历史较低位，在经济复苏大背景下，权益市场配置价值凸显。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人继续完善内部控制体系和内部控制制度，健全管理制度和业务规章，依据国家相关法律法规、内部控制制度、内部管理制度和业务规章、基金合同以及基金招募说明书对本基金的投资、销售、运营等业务中的内部控制完善程度和执行情况进行持续的监察稽核，对监察稽核中发现的问题及时提示，督促改进并跟踪改进效果。定期编制监察稽核报告，及时报送上级监管部门（如需）。

为提高防范和化解经营风险的能力，确保经营业务稳健运行和受托资产安全完整，保障基金份额持有人利益，本基金管理人采取的主要措施包括：

1、进一步完善内部控制体系和内部控制制度。本公司已经建立了科学合理的层次分明的包括内控组织架构、控制程序和控制措施以及控制职责在内的运行高效、严密的内部控制体系。

2、进一步健全管理制度和业务规章。在已建立的基本管理制度、业务流程、规章等基础上，根据公司的业务发展和法律法规的颁布情况，对相关管理制度和业务流程规章进行全面修订及更新，从管理制度和业务流程上进行风险控制，进一步强化内部制度的执行力度。

3、坚持岗位分离、相互制衡的内控机制。在岗位设置上继续采取严格的分离制度，形成不同岗位之间的相互制衡机制，从岗位设置上减少和防范操作及操守风险。

4、持续地对基金经营业务的合法合规性进行监控。采取了实时监控、常规稽核、专项稽核和临时稽核等方式，对发现的问题及时提示并督促改进，防范各种违法违规行为的发生，切实保护基金份额持有人的合法权益。

5、执行以 KPI(Key Performance Indicator 主要绩效指标)为风险控制主要手段和评估标

准的风险评估、预警、报告、控制以及监督程序。并通过适当的控制流程，定期或实时对风险进行评估、预警和监督，从而确认、评估和预警与公司管理及基金运作有关的风险。通过顺畅的报告渠道，对风险问题进行层层监督、管理和控制，使部门和管理层及时把握风险状况并快速做出风险控制决策。

6、采用自动化监督控制系统。采用电子化投资交易系统，对投资比例进行限制，有效地防止合规性运作风险和操作风险。

7、按照法律法规的要求，认真做好旗下各只基金的信息披露工作，确保有关信息披露的真实、完整、准确、及时。

8、定期不定期地组织合规培训。通过结合外部律师培训、内部合规培训以及证券业协会的后续教育课程，进一步加强对员工的合规教育，健全公司合规文化。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人成立基金估值委员会对基金财产的估值方法及程序作决策，基金估值委员会在遵守法律法规的前提下，通过参考行业协会的估值指引及独立第三方估值服务机构的估值数据等方式，谨慎合理地制定高效可行的估值方法，及时准确地进行份额净值的计量，保护基金份额持有人的合法权益。

基金日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行。基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以双方认可的方式报送给基金托管人，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，无误后返回给基金管理人，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

当发生了影响估值方法和程序的有效性、适用性的情况时，通过会议方式启动估值委员会的运作。研究人员凭借其丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究，综合宏观经济、行业发展及个券状况等各方面因素，从价值投资的角度进行理论分析，并根据分析的结果向基金估值委员会提出有关估值方法或估值模型的建议。风险管理人员根据研究人员提出的估值方法或估值模型进行计算及验证，并根据计算和验证的结果与投资人员共同确定估值方法并提交估值委员会。基金事务部基金会计负责与基金托管人沟通，必要时应就所采用的估值技术、假设及输入值得适当性等咨询会计师事务所的专业意见。法律、监察稽核部相关人员负责监察执行估值政策及程序的合规性，控制执行中可能发生的风险。估值委员会共同讨论通过后，基金事务部基金会计

根据估值委员会确认的估值方法对各基金进行估值核算并与基金托管行核对，法律、监察稽核部负责对外进行信息披露。

截止本报告期末，本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司合作，由其提供相关债券品种、流通受限股票的估值参考数据。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

截至本报告期末，根据相关法律法规和基金合同的要求以及本基金的实际运作情况，本基金未满足收益分配条件，不进行利润分配。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## § 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，本基金托管人在对景顺长城国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金托管业务管理办法》等相关法律法规的规定和基金合同、托管协议的约定勤勉履行基金托管人职责，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告期内，景顺长城基金管理有限公司在本基金各重要方面的运作符合基金合同、托管协议的约定，本基金托管人未发现本基金在投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支及利润分配等方面存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

#### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本基金托管人依法对景顺长城基金管理有限公司编制和披露的景顺长城国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金 2023 年年度报告中的财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 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	普华永道中天审字(2024)第 25181 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	景顺长城国证 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	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了景顺长城国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“景顺长城国证 2000ETF”)的财务报表,包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表,2023 年 9 月 13 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日止期间的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>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在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了景顺长城国证 2000ETF2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年 9 月 13 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>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。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。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于景顺长城国证 2000ETF,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>景顺长城国证 2000ETF 的基金管理人景顺长城基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估景顺长城国证 2000ETF 的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算景顺长城国证 2000ETF、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督景顺长城国证 2000ETF 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>(一) 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>(二) 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>(三) 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>(四) 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，就可能对导致对景顺长城国证 2000ETF 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景顺长城国证 2000ETF 不能持续经营。</p> <p>(五) 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	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	朱宏宇	郭劲扬
会计师事务所的地址	中国上海市	
审计报告日期	2024 年 3 月 27 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：景顺长城国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
货币资金	7.4.7.1	3,368,914.16
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	7.4.7.2	64,641,292.75
其中：股票投资		64,609,291.17

基金投资		-
债券投资		32,001.58
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		15,445.52
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		68,025,652.43
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年12月31日</b>
<b>负债：</b>		
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		22,759.26
应付托管费		4,551.85
应付销售服务费		-
应付投资顾问费		-
应交税费		0.01
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.9	544,530.22
负债合计		571,841.34
<b>净资产：</b>		
实收基金	7.4.7.10	67,896,935.00
其他综合收益	7.4.7.11	-
未分配利润	7.4.7.12	-443,123.91
净资产合计		67,453,811.09
负债和净资产总计		68,025,652.43

注：1. 报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值人民币 0.9935 元，基金份额总额 67,896,935.00 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2023 年 9 月 13 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日止期间。

## 7.2 利润表

会计主体：景顺长城国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 9 月 13 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 9 月 13 日（基金合同 生效日）至 2023 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		899,350.97
1. 利息收入		181,042.27
其中：存款利息收入	7.4.7.13	181,042.27
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）		1,537,695.88
其中：股票投资收益	7.4.7.14	1,455,885.76
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.15	29,747.92
资产支持证券投资收益	7.4.7.16	-
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	52,062.20
以摊余成本计量的金融资产 终止确认产生的收益		-
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	-846,890.30
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	27,503.12
<b>减：二、营业总支出</b>		423,957.55
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	241,115.30
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	7.4.10.2.2	48,223.04
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-
4. 投资顾问费		-

5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-
7. 税金及附加		0.03
8. 其他费用	7.4.7.23	134,619.18
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		475,393.42
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		475,393.42
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-
<b>六、综合收益总额</b>		475,393.42

### 7.3 净资产变动表

会计主体：景顺长城国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 9 月 13 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 9 月 13 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	373,896,935.00	-	-	373,896,935.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-306,000,000.00	-	-443,123.91	-306,443,123.91
（一）、综合收益总额	-	-	475,393.42	475,393.42
（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）	-306,000,000.00	-	-918,517.33	-306,918,517.33
其中：1. 基金申购款	51,000,000.00	-	750,852.68	51,750,852.68
2. 基金赎回款	-357,000,000.00	-	-1,669,370.01	-358,669,370.01
（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）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	67,896,935.00	-	-443,123.91	67,453,811.09

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：

康乐

吴建军

邵媛媛

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

景顺长城国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2023]1486 号《关于核准景顺长城国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》注册,由景顺长城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《景顺长城国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式指数基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 373,882,000.00 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2023)第 0465 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《景顺长城国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2023 年 9 月 13 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 373,896,935.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 14,935.00 份基金份额。本基金的基金管理人为景顺长城基金管理有限公司,基金托管人为广发证券股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2023]938 号文审核同意,本基金 373,896,935.00 份基金份额于 2023 年 10 月 16 日在深交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数国证 2000 指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股(含存托凭证,下同),此外,为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于部分非成份股(包含主板、创业板及其他经中国

证监会核准或注册上市的股票及存托凭证)、衍生工具(股指期货、股票期权等)、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债、公开发行的次级债、可交换债券、可转换债券、分离交易可转债的纯债部分、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债券、政府支持债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金可以根据有关法律法规的规定进行融资及转融通证券出借业务交易。基金的投资组合比例为:基金投资于标的指数成份股及备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%,且不低于非现金基金资产的 80%。因法律法规的规定而受限制的情形除外。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、股票期权合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金力争使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%。本基金的业绩比较基准为国证 2000 指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司于 2024 年 3 月 27 日批准报出。

#### 7.4.2 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》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 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 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年 9 月 13 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 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。本期财务报表的实际编制期间为 2023 年 9 月 13 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金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

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

##### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类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。

##### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

##### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即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。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款和其他各类应收款项等。

##### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

##### 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

##### (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债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。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括其他各类应付款项等。

#### 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

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

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

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

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

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

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

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



融资产的账面余额。

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

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

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，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) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

#### 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

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

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扣除相关交易费用后的净额确认为投资收益，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。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。基金收益评价日核定的基金净值率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，本基金的基金管理人可进行收益分配；以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为原则确定收益分配。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 7.4.4.12 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。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

无。

#### 7.4.6 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[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[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]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39号《关于减半征收交易印花税的公告》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(如适用)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(如适用)产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

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

对基金通过沪港通或深港通(如有)投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

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

(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。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

## 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	261,818.62
等于：本金	261,700.82
加：应计利息	117.80
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 个月（含）-3 个月	-
其他存款	3,107,095.54
等于：本金	3,106,926.63
加：应计利息	168.91
减：坏账准备	-
合计	3,368,914.16

注：其他存款为存放在证券经纪商经纪专用证券账户的证券交易结算资金。

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	65,456,181.47	-	64,609,291.17	-846,890.30	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	32,000.00	1.58	32,001.58	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	32,000.00	1.58	32,001.58	-
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	65,488,181.47	1.58	64,641,292.75	-846,890.30	

注：于 2023 年 12 月 31 日，股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值 1,553.00 元。

## 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

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

**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**

本基金本报告期末的买入返售金融资产余额为零。

**7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

本基金本报告期末买断式逆回购交易中取得的债券余额为零。

**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**

本基金本报告期末债权投资余额为零。

**7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况**

本基金本报告期末债权投资余额为零。

**7.4.7.6 其他债权投资****7.4.7.6.1 其他债权投资情况**

本基金本报告期末其他债权投资余额为零。

**7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况**

本基金本报告期末其他债权投资余额为零。

**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**

本基金本报告期末其他权益工具投资余额为零。

**7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况**

本基金本报告期末其他权益工具投资余额为零。

**7.4.7.8 其他资产**

本基金本报告期末其他资产余额为零。

**7.4.7.9 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2023 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	134,219.18
应退替代款	408,042.04
可退替代款	2,269.00
合计	544,530.22

#### 7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 9 月 13 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	373,896,935.00	373,896,935.00
本期申购	51,000,000.00	51,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-357,000,000.00	-357,000,000.00
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	67,896,935.00	67,896,935.00

注：本基金合同于 2023 年 9 月 13 日生效。首次发售募集的有效认购资金扣除认购费后的净认购金额为人民币 373,882,000.00 元，折合 373,882,000.00 份基金份额，有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息为人民币 14,935.00 元，折合 14,935.00 份基金份额。以上收到的实收基金共计人民币 373,896,935.00 元，折合 373,896,935.00 份基金份额。

#### 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
基金合同生效日	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-

本期利润	1,322,283.72	-846,890.30	475,393.42
本期基金份额交易产生的变动数	1,296,411.37	-2,214,928.70	-918,517.33
其中：基金申购款	2,090,010.11	-1,339,157.43	750,852.68
基金赎回款	-793,598.74	-875,771.27	-1,669,370.01
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,618,695.09	-3,061,819.00	-443,123.91

#### 7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2023年9月13日（基金合同生效日）至2023年12月31日	
活期存款利息收入		160,905.85
定期存款利息收入		-
其他存款利息收入		17,855.41
结算备付金利息收入		-
其他		2,281.01
合计		181,042.27

#### 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	
	2023年9月13日（基金合同生效日）至2023年12月31日	
股票投资收益——买卖股票差价收入		-435,644.69
股票投资收益——赎回差价收入		1,891,530.45
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		1,455,885.76

##### 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	
	2023年9月13日（基金合同生效日）至2023年12月31日	
卖出股票成交总额		173,604,539.03
减：卖出股票成本总额		173,663,222.87
减：交易费用		376,960.85
买卖股票差价收入		-435,644.69

##### 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	
	2023年9月13日（基金合同生效日）至2023年12月31日	



赎回基金份额对价总额	358,669,370.01
减：现金支付赎回款总额	140,753,734.01
减：赎回股票成本总额	216,024,105.55
减：交易费用	-
赎回差价收入	1,891,530.45

#### 7.4.7.14.4 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 2023年9月13日（基金合同生效日）至2023年12月 31日
债券投资收益——利息收入	18.68
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	29,729.24
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	29,747.92

##### 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 2023年9月13日（基金合同生效日）至2023年12 月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	152,452.83
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	122,700.00
减：应计利息总额	17.33
减：交易费用	6.26
买卖债券差价收入	29,729.24

#### 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

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

##### 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

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 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

本基金本报告期无贵金属投资收益。

##### 7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 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

本基金本报告期无衍生工具收益。

##### 7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023年9月13日（基金合同生效日）至2023年12月31日
股票投资产生的股利收益	52,062.20
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	52,062.20

#### 7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023年9月13日（基金合同生效日）至2023年12月31日
1. 交易性金融资产	-846,890.30
股票投资	-846,890.30
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-846,890.30

注：本基金本会计期间公允价值变动损益—股票投资中包括可退替代款产生的公允价值变动损益

1,553.00 元。

#### 7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年9月13日（基金合同生效日）至2023 年12月31日
基金赎回费收入	-
替代损益	27,503.12
合计	27,503.12

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

#### 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 2023年9月13日（基金合同生效日）至2023年 12月31日
审计费用	45,000.00
信息披露费	40,000.00
证券出借违约金	-
其他	400.00
IOPV 数据费	4,219.18
注册登记费	45,000.00
合计	134,619.18

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
景顺长城基金管理有限公司	基金管理人
广发证券股份有限公司（“广发证券”）	基金托管人、基金销售机构
长城证券股份有限公司（“长城证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
景顺资产管理有限公司	基金管理人的股东

开滦(集团)有限责任公司	基金管理人的股东
大连实德集团有限公司	基金管理人的股东
景顺长城资产管理(深圳)有限公司	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年9月13日（基金合同生效日）至2023年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
广发证券	597,732,752.36	100.00

###### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年9月13日（基金合同生效日）至2023年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
广发证券	251,820.93	100.00	-	-

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

2、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。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年9月13日（基金合同生效日）至2023年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	241,115.30
其中：应支付销售机构的客户维护费	36,285.84
应支付基金管理人的净管理费	204,829.46

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.5%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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.5\% / \text{当年天数}。$$

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 9 月 13 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	48,223.04

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.1%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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.1\% / \text{当年天数}。$$

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期无支付给各关联方的销售服务费。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金于本报告期末与关联方发生转融通证券出借业务交易。

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

本基金于本报告期末与关联方发生转融通证券出借业务交易。

#### 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自有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人于本报告期末运用自有资金投资本基金。

##### 7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金的其他关联方于本报告期末未持有本基金份额。

#### 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
	2023 年 9 月 13 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日

	期末余额	当期利息收入
广发证券-证券资金账户	3,107,095.54	17,855.41

注：基金托管人广发证券受托作为本基金的证券经纪商。上述款项为本基金存放于广发证券基金专用证券账户中的证券交易结算资金，按协议约定利率计息。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配。

#### 7.4.12 期末（2023年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001306	夏厦精密	2023年11月9日	6个月	新股流通受限	53.63	75.36	21	1,126.23	1,582.56	-
688653	康希通信	2023年11月10日	6个月	新股流通受限	10.50	15.99	239	2,509.50	3,821.61	-
7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
111018	华康转债	2023年12月26日	1个月内（含）	新债未上市	100.00	100.00	120	12,000.00	12,000.37	-
113069	博23转债	2023年12月25日	1个月内（含）	新债未上市	100.00	100.01	70	7,000.00	7,000.46	-
118046	诺泰转债	2023年12月18日	1-6个月（含）	新债未上市	100.00	100.01	20	2,000.00	2,000.15	-
127100	神码转	2023年	1个月	新债	100.00	100.01	64	6,400.00	6,400.46	-

	债	12月21日	内(含)	未上市						
127102	浙建转债	2023年12月25日	1个月内(含)	新债未上市	100.00	100.00	46	4,600.00	4,600.14	-

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000657	中钨高新	2023年12月26日	重大事项停牌	8.48	2024年1月10日	9.33	6,700	60,919.77	56,816.00	-
000801	四川九洲	2023年12月21日	重大事项停牌	7.70	2024年1月5日	8.47	4,400	36,083.33	33,880.00	-

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金管理人秉承全面风险管理的理念，将风险管理融入业务中，建立了以风险管理委员会为核心，由风险管理委员会、督察长、法律监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

各业务部门负责人为其所在部门的风险管理第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控和及时报告的义务。员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。本基金管理人配备的风险管理人员对投资风险进行独立的监控并及时向管理层汇报。

#### 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的发行人出现违约、拒绝支付到期本息等导致基金资产损失和收益变化的风险。

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

本基金管理人还通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券，不得超过该证券余额的 10%。

于本报告期末，本基金持有除国债、央行票据、政策性金融债及地方政府债券之外的债券和资产支持证券的账面价值占基金净资产的比例为 0.05%。

#### 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。本基金的流动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难，另一方面来自于基金份额持有人可依据基金合同约定要求赎回其持有的基金份额。

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

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



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

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

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

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

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 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未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。

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

合久期等方法管理利率风险。

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

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	3,368,914.16	-	-	-	-	-	3,368,914.16
交易性金融资产	-	-	-	-7,000.46	25,001.12	64,609,291.17	64,641,292.75
应收清算款	-	-	-	-	-	15,445.52	15,445.52
资产总计	3,368,914.16	-	-	-7,000.46	25,001.12	64,624,736.69	68,025,652.43
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	22,759.26	22,759.26
应付托管费	-	-	-	-	-	4,551.85	4,551.85
应交税费	-	-	-	-	-	0.01	0.01
其他负债	-	-	-	-	-	544,530.22	544,530.22
负债总计	-	-	-	-	-	571,841.34	571,841.34
利率敏感度缺口	3,368,914.16	-	-	-7,000.46	25,001.12	-	-

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期末，本基金持有的债券资产的账面价值占资产净值比例为 0.05%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

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。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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

## 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	64,609,291.17	95.78
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	64,609,291.17	95.78

## 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额 (单位：人民币元)
		本期末 (2023 年 12 月 31 日)
	沪深 300 指数上升 5%	2,980,000.73
	沪深 300 指数下降 5%	-2,980,000.73

## 7.4.14 公允价值

## 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

## 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

## 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年12月31日
第一层次	64,513,191.00
第二层次	122,697.58
第三层次	5,404.17
合计	64,641,292.75

#### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

#### 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

项目	本期 2023年9月13日（基金合同生效日）至2023年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	3,635.73	3,635.73
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	1,768.44	1,768.44
其中：计入损益的利得或损失	-	1,768.44	1,768.44
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	5,404.17	5,404.17
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	1,768.44	1,768.44

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

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	5,404.17	平均价格亚式期权模型	预期波动率	1.2692-1.5554	负相关

##### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

## 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

## 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 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	64,609,291.17	94.98
	其中：股票	64,609,291.17	94.98
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	32,001.58	0.05
	其中：债券	32,001.58	0.05
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	3,368,914.16	4.95
8	其他各项资产	15,445.52	0.02
9	合计	68,025,652.43	100.00

注：本表权益投资股票项中，含可退替代款估值增值 1,553.00 元，而 8.2 中不含可退替代款估值增值，因此二者存在差异。

## 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	635,012.00	0.94
B	采矿业	965,550.00	1.43
C	制造业	43,481,981.53	64.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,294,389.00	1.92
E	建筑业	1,421,297.00	2.11
F	批发和零售业	2,200,049.00	3.26
G	交通运输、仓储和邮政业	1,213,928.00	1.80
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术	7,845,161.30	11.63

	服务业		
J	金融业	531,316.00	0.79
K	房地产业	1,072,987.00	1.59
L	租赁和商务服务业	802,699.20	1.19
M	科学研究和技术服务业	1,321,656.97	1.96
N	水利、环境和公共设施管理业	684,991.00	1.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	112,191.00	0.17
R	文化、体育和娱乐业	896,879.00	1.33
S	综合	122,246.00	0.18
	合计	64,602,334.00	95.77

### 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

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	5,404.17	0.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	5,404.17	0.01

### 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	000766	通化金马	7,100	141,574.00	0.21
2	002240	盛新锂能	6,200	141,050.00	0.21
3	002126	银轮股份	7,400	138,158.00	0.20
4	002261	拓维信息	9,000	135,360.00	0.20
5	300364	中文在线	5,100	131,223.00	0.19
6	300573	兴齐眼药	680	123,977.60	0.18
7	000034	神州数码	4,100	122,631.00	0.18
8	688213	思特威	2,196	122,009.76	0.18
9	688327	云从科技	7,127	120,161.22	0.18
10	300315	掌趣科技	23,100	118,965.00	0.18
11	002432	九安医疗	3,000	113,010.00	0.17
12	688639	华恒生物	883	111,169.70	0.16
13	603979	金诚信	2,900	109,504.00	0.16
14	600363	联创光电	3,200	108,800.00	0.16
15	300456	赛微电子	4,500	108,180.00	0.16
16	002675	东诚药业	5,900	108,147.00	0.16
17	002832	比音勒芬	3,400	107,780.00	0.16
18	002332	仙琚制药	8,200	104,714.00	0.16
19	688333	铂力特	903	104,657.70	0.16
20	300679	电连技术	2,500	103,750.00	0.15
21	002318	久立特材	5,200	103,376.00	0.15
22	600771	广誉远	3,800	102,562.00	0.15
23	300765	新诺威	2,800	102,536.00	0.15
24	600422	昆药集团	4,900	102,214.00	0.15
25	300045	华力创通	4,200	102,186.00	0.15
26	603588	高能环境	15,500	101,370.00	0.15
27	688116	天奈科技	3,480	101,059.20	0.15
28	300596	利安隆	3,400	100,504.00	0.15
29	600201	生物股份	9,300	100,161.00	0.15
30	688388	嘉元科技	4,922	99,818.16	0.15
31	002139	拓邦股份	10,100	98,576.00	0.15
32	002222	福晶科技	3,300	97,449.00	0.14
33	002036	联创电子	9,500	96,995.00	0.14
34	601975	招商南油	34,500	96,600.00	0.14
35	002015	协鑫能科	7,800	96,564.00	0.14
36	000690	宝新能源	21,600	95,688.00	0.14
37	000426	兴业银锡	10,500	95,340.00	0.14
38	603063	禾望电气	3,800	95,000.00	0.14
39	002317	众生药业	5,900	94,695.00	0.14

40	688556	高测股份	2,418	94,277.82	0.14
41	300232	洲明科技	10,700	94,160.00	0.14
42	603300	华铁应急	14,500	92,800.00	0.14
43	600312	平高电气	7,300	92,637.00	0.14
44	600179	安通控股	37,000	92,500.00	0.14
45	688019	安集科技	576	92,021.76	0.14
46	300036	超图软件	4,400	91,960.00	0.14
47	300049	福瑞股份	2,100	91,539.00	0.14
48	002851	麦格米特	3,700	91,020.00	0.13
49	002212	天融信	9,300	90,954.00	0.13
50	300470	中密控股	2,400	90,720.00	0.13
51	600133	东湖高新	8,400	90,468.00	0.13
52	603197	保隆科技	1,600	90,240.00	0.13
53	603477	巨星农牧	2,400	89,928.00	0.13
54	600452	涪陵电力	6,800	89,760.00	0.13
55	601616	广电电气	24,700	89,661.00	0.13
56	600877	电科芯片	6,400	89,536.00	0.13
57	600123	兰花科创	8,100	89,424.00	0.13
58	300101	振芯科技	3,900	89,037.00	0.13
59	603279	景津装备	4,020	88,882.20	0.13
60	002221	东华能源	8,600	88,580.00	0.13
61	002335	科华数据	3,200	88,576.00	0.13
62	600114	东睦股份	5,700	88,293.00	0.13
63	002698	博实股份	5,800	88,102.00	0.13
64	688608	恒玄科技	570	87,933.90	0.13
65	600587	新华医疗	3,400	87,686.00	0.13
66	300229	拓尔思	5,200	87,672.00	0.13
67	300168	万达信息	10,300	87,344.00	0.13
68	300237	美晨生态	40,800	87,312.00	0.13
69	600186	莲花健康	14,400	87,120.00	0.13
70	688235	百济神州	626	87,039.04	0.13
71	300627	华测导航	2,800	86,856.00	0.13
72	688148	芳源股份	11,311	86,755.37	0.13
73	600728	佳都科技	15,100	86,372.00	0.13
74	002326	永太科技	7,400	85,988.00	0.13
75	603308	应流股份	6,000	85,980.00	0.13
76	600507	方大特钢	18,600	85,746.00	0.13
77	600761	安徽合力	4,700	85,587.00	0.13
78	600933	爱柯迪	3,900	85,566.00	0.13
79	688596	正帆科技	2,158	85,521.54	0.13
80	688110	东芯股份	2,482	85,455.26	0.13
81	002254	泰和新材	5,700	85,272.00	0.13
82	002837	英维克	3,100	85,188.00	0.13



83	300525	博思软件	5,700	85,044.00	0.13
84	002807	江阴银行	23,900	84,845.00	0.13
85	002354	天娱数科	15,300	84,456.00	0.13
86	002011	盾安环境	6,100	83,875.00	0.12
87	600285	羚锐制药	4,900	83,839.00	0.12
88	300393	中来股份	8,100	83,754.00	0.12
89	300693	盛弘股份	2,800	83,748.00	0.12
90	000422	湖北宜化	8,000	83,680.00	0.12
91	300130	新国都	3,454	83,586.80	0.12
92	300332	天壕能源	10,500	83,475.00	0.12
93	300040	九洲集团	14,900	83,440.00	0.12
94	600199	金种子酒	4,500	83,340.00	0.12
95	002100	天康生物	9,500	83,315.00	0.12
96	000810	创维数字	5,300	83,263.00	0.12
97	688088	虹软科技	2,027	83,188.08	0.12
98	600595	中孚实业	23,900	83,172.00	0.12
99	603083	剑桥科技	2,200	82,984.00	0.12
100	601208	东材科技	6,700	82,946.00	0.12
101	300867	圣元环保	5,200	82,940.00	0.12
102	300083	创世纪	13,100	82,923.00	0.12
103	300199	翰宇药业	6,100	82,838.00	0.12
104	600478	科力远	16,800	82,656.00	0.12
105	002182	宝武镁业	4,200	82,572.00	0.12
106	300132	青松股份	15,800	82,476.00	0.12
107	300725	药石科技	2,100	82,467.00	0.12
108	688066	航天宏图	1,949	82,325.76	0.12
109	688266	泽璟制药	1,554	82,268.76	0.12
110	002510	天汽模	16,900	82,134.00	0.12
111	300327	中颖电子	3,600	82,080.00	0.12
112	600255	鑫科材料	37,100	81,991.00	0.12
113	300696	爱乐达	4,700	81,827.00	0.12
114	600389	江山股份	4,700	81,780.00	0.12
115	002567	唐人神	10,900	81,750.00	0.12
116	688033	天宜上佳	4,830	81,627.00	0.12
117	300738	奥飞数据	7,700	81,543.00	0.12
118	002404	嘉欣丝绸	13,500	81,540.00	0.12
119	688166	博瑞医药	2,328	81,480.00	0.12
120	600750	江中药业	3,900	81,432.00	0.12
121	300674	宇信科技	5,000	81,400.00	0.12
122	300685	艾德生物	3,700	81,326.00	0.12
123	300664	鹏鹞环保	15,200	81,320.00	0.12
124	600552	凯盛科技	6,100	81,313.00	0.12
125	300077	国民技术	7,200	81,288.00	0.12

126	603599	广信股份	5,600	81,200.00	0.12
127	300642	透景生命	4,590	81,013.50	0.12
128	688391	钜泉科技	1,627	80,699.20	0.12
129	600850	电科数字	3,700	80,475.00	0.12
130	000503	国新健康	6,100	80,398.00	0.12
131	000676	智度股份	9,200	80,316.00	0.12
132	002661	克明食品	8,400	80,052.00	0.12
133	002288	超华科技	18,300	79,788.00	0.12
134	300170	汉得信息	9,600	79,776.00	0.12
135	600731	湖南海利	12,100	79,497.00	0.12
136	000628	高新发展	1,600	79,488.00	0.12
137	603393	新天然气	2,600	79,482.00	0.12
138	601965	中国汽研	3,600	79,416.00	0.12
139	601020	华钰矿业	7,700	79,310.00	0.12
140	300416	苏试试验	4,300	78,991.00	0.12
141	600729	重庆百货	2,800	78,960.00	0.12
142	605599	菜百股份	5,300	78,917.00	0.12
143	300827	上能电气	2,600	78,676.00	0.12
144	300855	图南股份	2,600	78,520.00	0.12
145	300233	金城医药	4,700	78,302.00	0.12
146	600976	健民集团	1,200	78,300.00	0.12
147	603987	康德莱	8,200	78,228.00	0.12
148	300638	广和通	4,100	78,023.00	0.12
149	688007	光峰科技	3,010	77,898.80	0.12
150	300181	佐力药业	7,300	77,818.00	0.12
151	300475	香农芯创	2,300	77,717.00	0.12
152	002448	中原内配	11,700	77,688.00	0.12
153	300735	光弘科技	3,300	77,682.00	0.12
154	688389	普门科技	3,448	77,614.48	0.12
155	300075	数字政通	4,400	77,440.00	0.11
156	002022	科华生物	6,800	77,384.00	0.11
156	300079	数码视讯	13,600	77,384.00	0.11
157	002649	博彦科技	6,300	77,301.00	0.11
158	603136	天目湖	4,200	77,154.00	0.11
159	300166	东方国信	8,200	77,080.00	0.11
160	002292	奥飞娱乐	8,800	77,000.00	0.11
161	300762	上海瀚讯	5,100	76,908.00	0.11
162	300188	国投智能	4,800	76,896.00	0.11
163	300536	农尚环境	3,400	76,840.00	0.11
164	300593	新雷能	5,200	76,804.00	0.11
165	300379	东方通	4,200	76,776.00	0.11
166	600908	无锡银行	15,200	76,760.00	0.11
167	688299	长阳科技	5,498	76,697.10	0.11

168	002006	精工科技	5,000	76,400.00	0.11
169	002286	保龄宝	9,400	76,328.00	0.11
170	002163	海南发展	8,400	76,272.00	0.11
171	600572	康恩贝	15,100	76,255.00	0.11
172	300120	经纬辉开	10,500	76,230.00	0.11
173	300853	申昊科技	2,800	76,160.00	0.11
174	600428	中远海特	14,200	76,112.00	0.11
175	600557	康缘药业	3,700	75,924.00	0.11
176	300655	晶瑞电材	7,800	75,894.00	0.11
177	301050	雷电微力	1,300	75,738.00	0.11
178	002214	大立科技	6,600	75,702.00	0.11
179	300624	万兴科技	800	75,680.00	0.11
180	002250	联化科技	10,600	75,578.00	0.11
181	000731	四川美丰	10,200	75,480.00	0.11
182	603859	能科科技	2,000	75,460.00	0.11
183	603997	继峰股份	5,600	75,432.00	0.11
184	688700	东威科技	1,236	75,420.72	0.11
185	002291	遥望科技	8,000	75,040.00	0.11
186	002455	百川股份	10,100	74,942.00	0.11
187	603098	森特股份	5,500	74,855.00	0.11
188	002270	华明装备	5,300	74,836.00	0.11
189	603496	恒为科技	2,400	74,784.00	0.11
190	300767	震安科技	4,300	74,734.00	0.11
191	688029	南微医学	772	74,729.60	0.11
192	603220	中贝通信	2,200	74,712.00	0.11
193	600218	全柴动力	7,800	74,646.00	0.11
194	300472	新元科技	7,900	74,576.00	0.11
195	688518	联赢激光	3,639	74,526.72	0.11
196	300369	绿盟科技	7,900	74,497.00	0.11
197	002759	天际股份	7,000	74,270.00	0.11
198	002606	大连电瓷	9,400	74,260.00	0.11
199	300477	合纵科技	19,800	74,250.00	0.11
200	300348	长亮科技	7,200	74,232.00	0.11
201	688381	帝奥微	2,930	74,187.60	0.11
202	300857	协创数据	1,400	74,186.00	0.11
203	002438	江苏神通	6,200	74,090.00	0.11
204	000682	东方电子	9,200	74,060.00	0.11
205	300900	广联航空	3,000	74,040.00	0.11
206	300236	上海新阳	2,100	73,962.00	0.11
207	000923	河钢资源	4,400	73,920.00	0.11
208	000543	皖能电力	11,800	73,868.00	0.11
209	300138	晨光生物	5,500	73,865.00	0.11
210	300647	超频三	11,500	73,830.00	0.11

211	002063	远光软件	11,900	73,542.00	0.11
212	300303	聚飞光电	12,400	73,532.00	0.11
213	603906	龙蟠科技	5,900	73,514.00	0.11
214	688278	特宝生物	1,404	73,499.40	0.11
215	688269	凯立新材	1,984	73,427.84	0.11
216	002293	罗莱生活	7,900	73,391.00	0.11
217	300133	华策影视	12,500	73,375.00	0.11
218	300451	创业慧康	11,200	73,360.00	0.11
219	603505	金石资源	2,700	73,305.00	0.11
220	000718	苏宁环球	28,300	73,297.00	0.11
221	002154	报喜鸟	12,900	73,272.00	0.11
222	300241	瑞丰光电	13,000	73,190.00	0.11
223	300046	台基股份	4,600	73,186.00	0.11
224	002544	普天科技	3,600	73,152.00	0.11
225	000821	京山轻机	4,600	73,094.00	0.11
226	000897	津滨发展	33,800	73,008.00	0.11
227	600601	方正科技	25,200	72,828.00	0.11
228	688270	臻镭科技	1,065	72,824.70	0.11
229	300116	保力新	49,200	72,816.00	0.11
230	002400	省广集团	13,100	72,705.00	0.11
231	600368	五洲交通	18,400	72,680.00	0.11
232	603283	赛腾股份	1,000	72,560.00	0.11
233	002196	方正电机	10,100	72,518.00	0.11
234	603566	普莱柯	3,200	72,480.00	0.11
235	300189	神农科技	22,000	72,380.00	0.11
236	002102	冠福股份	26,700	72,357.00	0.11
237	002446	盛路通信	8,700	72,210.00	0.11
238	603018	华设集团	9,500	72,200.00	0.11
239	002079	苏州固锝	6,400	72,192.00	0.11
240	688578	艾力斯	1,727	71,946.82	0.11
241	600609	金杯汽车	14,800	71,928.00	0.11
242	600633	浙数文化	6,500	71,890.00	0.11
243	002258	利尔化学	6,000	71,820.00	0.11
244	600197	伊力特	3,300	71,775.00	0.11
245	300657	弘信电子	3,700	71,743.00	0.11
246	600446	金证股份	6,200	71,734.00	0.11
247	603035	常熟汽饰	3,800	71,706.00	0.11
248	300035	中科电气	6,800	71,672.00	0.11
248	600512	腾达建设	28,900	71,672.00	0.11
249	300326	凯利泰	11,300	71,529.00	0.11
250	601388	怡球资源	27,300	71,526.00	0.11
251	002239	奥特佳	22,000	71,500.00	0.11
252	688798	艾为电子	1,034	71,377.02	0.11

253	603960	克来机电	4,800	71,376.00	0.11
254	600971	恒源煤电	6,400	71,360.00	0.11
255	600293	三峡新材	19,600	71,344.00	0.11
256	300317	珈伟新能	14,000	71,260.00	0.11
257	603187	海容冷链	4,700	71,252.00	0.11
258	002020	京新药业	5,600	71,232.00	0.11
259	300226	上海钢联	2,500	71,225.00	0.11
259	603108	润达医疗	3,500	71,225.00	0.11
260	300671	富满微	2,200	71,126.00	0.11
261	300129	泰胜风能	6,600	71,082.00	0.11
261	605305	中际联合	2,200	71,082.00	0.11
262	600821	金开新能	11,600	70,992.00	0.11
263	688711	宏微科技	1,711	70,989.39	0.11
264	002539	云图控股	8,600	70,950.00	0.11
265	688621	阳光诺和	1,016	70,866.00	0.11
266	600797	浙大网新	10,800	70,848.00	0.11
267	600106	重庆路桥	10,600	70,808.00	0.10
268	300095	华伍股份	8,600	70,778.00	0.10
269	688262	国芯科技	2,412	70,768.08	0.10
270	002149	西部材料	4,500	70,740.00	0.10
271	600708	光明地产	32,900	70,735.00	0.10
272	300618	寒锐钴业	2,500	70,725.00	0.10
273	688409	富创精密	903	70,713.93	0.10
274	002327	富安娜	7,900	70,705.00	0.10
275	002351	漫步者	4,000	70,680.00	0.10
275	600963	岳阳林纸	12,000	70,680.00	0.10
276	000407	胜利股份	19,500	70,590.00	0.10
277	688208	道通科技	2,970	70,537.50	0.10
278	603306	华懋科技	2,600	70,486.00	0.10
279	000910	大亚圣象	8,800	70,400.00	0.10
280	300441	鲍斯股份	10,200	70,278.00	0.10
281	688062	迈威生物	2,148	70,218.12	0.10
282	300409	道氏技术	6,300	70,182.00	0.10
283	300065	海兰信	6,900	70,173.00	0.10
284	600993	马应龙	2,900	70,122.00	0.10
285	002398	垒知集团	14,700	70,119.00	0.10
286	688676	金盘科技	1,956	70,083.48	0.10
287	300113	顺网科技	5,000	70,000.00	0.10
288	603936	博敏电子	6,700	69,948.00	0.10
289	300831	派瑞股份	5,700	69,882.00	0.10
290	002876	三利谱	1,900	69,863.00	0.10
291	300617	安靠智电	2,300	69,828.00	0.10
292	300062	中能电气	11,200	69,776.00	0.10

293	002099	海翔药业	9,700	69,743.00	0.10
294	002324	普利特	5,300	69,695.00	0.10
295	002479	富春环保	14,600	69,642.00	0.10
296	002127	南极电商	17,900	69,631.00	0.10
297	300191	潜能恒信	4,500	69,615.00	0.10
298	601918	新集能源	13,200	69,564.00	0.10
299	300382	斯莱克	7,000	69,510.00	0.10
300	000915	华特达因	2,400	69,504.00	0.10
301	601686	友发集团	11,300	69,495.00	0.10
302	002130	沃尔核材	9,200	69,460.00	0.10
302	002538	司尔特	11,500	69,460.00	0.10
303	600269	赣粤高速	16,900	69,459.00	0.10
304	002003	伟星股份	6,400	69,440.00	0.10
305	600226	瀚叶股份	26,600	69,426.00	0.10
306	300048	合康新能	13,700	69,322.00	0.10
306	300463	迈克生物	4,600	69,322.00	0.10
307	600645	中源协和	3,400	68,918.00	0.10
308	300910	瑞丰新材	1,500	68,910.00	0.10
309	002458	益生股份	6,400	68,864.00	0.10
310	605183	确成股份	4,700	68,761.00	0.10
311	300355	蒙草生态	18,300	68,625.00	0.10
312	000589	贵州轮胎	11,200	68,544.00	0.10
313	300053	航宇微	5,600	68,488.00	0.10
314	300590	移为通信	5,700	68,457.00	0.10
315	300222	科大智能	9,300	68,448.00	0.10
316	688106	金宏气体	2,840	68,415.60	0.10
317	002783	凯龙股份	5,900	68,381.00	0.10
318	688083	中望软件	686	68,284.44	0.10
319	600602	云赛智联	5,900	68,263.00	0.10
320	300397	天和防务	6,600	68,112.00	0.10
321	000420	吉林化纤	23,400	68,094.00	0.10
321	002334	英威腾	7,800	68,094.00	0.10
322	000036	华联控股	17,500	68,075.00	0.10
323	300481	濮阳惠成	3,900	68,055.00	0.10
324	688027	国盾量子	532	68,042.80	0.10
325	002083	孚日股份	13,500	68,040.00	0.10
326	300613	富瀚微	1,600	67,904.00	0.10
327	300087	荃银高科	8,100	67,878.00	0.10
328	603855	华荣股份	3,400	67,864.00	0.10
329	000811	冰轮环境	5,000	67,850.00	0.10
330	603901	永创智能	5,700	67,830.00	0.10
331	300420	五洋停车	22,300	67,792.00	0.10
332	600537	亿晶光电	12,300	67,773.00	0.10

333	603181	皇马科技	6,200	67,766.00	0.10
334	300492	华图山鼎	800	67,736.00	0.10
335	603896	寿仙谷	2,100	67,704.00	0.10
336	002048	宁波华翔	5,200	67,652.00	0.10
337	002110	三钢闽光	16,700	67,635.00	0.10
338	001696	宗申动力	10,200	67,626.00	0.10
339	000681	视觉中国	4,600	67,620.00	0.10
340	300193	佳士科技	8,700	67,599.00	0.10
340	600366	宁波韵升	8,700	67,599.00	0.10
341	600033	福建高速	21,800	67,580.00	0.10
342	300687	赛意信息	3,100	67,518.00	0.10
343	002839	张家港行	17,400	67,512.00	0.10
344	002276	万马股份	6,600	67,452.00	0.10
345	600480	凌云股份	7,400	67,414.00	0.10
346	000917	电广传媒	12,300	67,404.00	0.10
347	002424	贵州百灵	8,300	67,313.00	0.10
348	000049	德赛电池	2,480	67,257.60	0.10
349	300055	万邦达	10,900	67,253.00	0.10
350	002082	万邦德	10,500	67,200.00	0.10
351	002707	众信旅游	9,400	67,116.00	0.10
352	688046	药康生物	3,330	67,099.50	0.10
353	600675	中华企业	21,300	67,095.00	0.10
354	000551	创元科技	6,400	67,008.00	0.10
355	601678	滨化股份	15,900	66,939.00	0.10
356	300737	科顺股份	10,900	66,926.00	0.10
357	603690	至纯科技	2,600	66,820.00	0.10
358	603811	诚意药业	6,440	66,782.80	0.10
359	600067	冠城大通	26,600	66,766.00	0.10
360	301030	仕净科技	1,600	66,720.00	0.10
361	600331	宏达股份	13,000	66,690.00	0.10
362	603619	中曼石油	3,600	66,672.00	0.10
363	300098	高新兴	16,400	66,584.00	0.10
363	300894	火星人	4,100	66,584.00	0.10
364	300203	聚光科技	4,200	66,570.00	0.10
365	603128	华贸物流	9,000	66,510.00	0.10
366	300352	北信源	14,000	66,500.00	0.10
367	688158	优刻得	4,042	66,490.90	0.10
368	300705	九典制药	2,000	66,460.00	0.10
369	300570	太辰光	1,700	66,385.00	0.10
370	002132	恒星科技	21,200	66,356.00	0.10
371	300255	常山药业	5,100	66,351.00	0.10
372	603008	喜临门	3,900	66,339.00	0.10
373	601860	紫金银行	26,200	66,286.00	0.10

374	000159	国际实业	10,200	66,198.00	0.10
374	002121	科陆电子	11,800	66,198.00	0.10
375	300401	花园生物	5,600	66,136.00	0.10
376	002452	长高电新	9,300	66,030.00	0.10
377	002361	神剑股份	16,800	66,024.00	0.10
378	600882	妙可蓝多	4,100	65,887.00	0.10
379	000417	合肥百货	13,200	65,868.00	0.10
380	300227	光韵达	8,400	65,856.00	0.10
381	300081	恒信东方	5,700	65,835.00	0.10
382	600461	洪城环境	7,200	65,808.00	0.10
383	300770	新媒股份	1,700	65,756.00	0.10
384	603323	苏农银行	15,800	65,728.00	0.10
385	000982	中银绒业	44,700	65,709.00	0.10
386	300890	翔丰华	1,900	65,702.00	0.10
387	600419	天润乳业	5,600	65,688.00	0.10
388	603867	新化股份	2,000	65,680.00	0.10
389	002761	浙江建投	6,400	65,664.00	0.10
390	000777	中核科技	4,500	65,430.00	0.10
391	002741	光华科技	4,400	65,428.00	0.10
392	301031	中熔电气	500	65,380.00	0.10
393	002449	国星光电	6,900	65,343.00	0.10
394	002413	雷科防务	12,100	65,340.00	0.10
395	002646	天佑德酒	4,800	65,328.00	0.10
396	000751	锌业股份	20,100	65,325.00	0.10
397	300304	云意电气	9,600	65,184.00	0.10
398	300490	华自科技	5,600	65,016.00	0.10
399	688239	航宇科技	1,361	65,014.97	0.10
400	300109	新开源	3,600	64,944.00	0.10
401	300406	九强生物	3,400	64,940.00	0.10
402	300772	运达股份	6,100	64,904.00	0.10
402	600055	万东医疗	3,800	64,904.00	0.10
403	300031	宝通科技	3,500	64,890.00	0.10
404	605376	博迁新材	2,300	64,860.00	0.10
405	603507	振江股份	2,500	64,775.00	0.10
406	002437	誉衡药业	25,800	64,758.00	0.10
407	600773	西藏城投	5,900	64,664.00	0.10
408	300319	麦捷科技	6,700	64,588.00	0.10
409	300349	金卡智能	5,200	64,584.00	0.10
410	002075	沙钢股份	16,900	64,558.00	0.10
411	300007	汉威科技	3,100	64,418.00	0.10
412	002323	雅博股份	26,500	64,395.00	0.10
413	603815	交建股份	7,700	64,372.00	0.10
414	300006	莱美药业	17,300	64,356.00	0.10



415	300091	金通灵	24,100	64,347.00	0.10
416	603368	柳药集团	3,400	64,328.00	0.10
417	300287	飞利信	16,000	64,320.00	0.10
418	688568	中科星图	1,311	64,317.66	0.10
419	300366	创意信息	4,900	64,288.00	0.10
420	688127	蓝特光学	2,756	64,187.24	0.10
421	300041	回天新材	6,400	64,128.00	0.10
421	600586	金晶科技	9,600	64,128.00	0.10
422	300381	溢多利	8,700	64,119.00	0.10
423	002428	云南锗业	5,200	64,116.00	0.10
424	688173	希荻微	3,639	64,010.01	0.09
425	002930	宏川智慧	3,300	63,987.00	0.09
426	002386	天原股份	12,400	63,984.00	0.09
427	300384	三联虹普	4,000	63,840.00	0.09
428	300123	亚光科技	8,700	63,771.00	0.09
429	000557	西部创业	13,200	63,756.00	0.09
430	600502	安徽建工	13,700	63,705.00	0.09
431	603301	振德医疗	2,600	63,700.00	0.09
432	000672	上峰水泥	7,900	63,674.00	0.09
433	601137	博威合金	4,100	63,673.00	0.09
434	002583	海能达	10,700	63,665.00	0.09
435	300850	新强联	2,000	63,660.00	0.09
436	300566	激智科技	3,400	63,512.00	0.09
437	002263	大东南	25,200	63,504.00	0.09
437	002556	辉隆股份	10,800	63,504.00	0.09
438	000735	罗牛山	11,000	63,470.00	0.09
439	300630	普利制药	2,800	63,336.00	0.09
440	002045	国光电器	3,800	63,270.00	0.09
441	300825	阿尔特	4,600	63,250.00	0.09
442	000727	冠捷科技	23,600	63,248.00	0.09
443	300494	盛天网络	4,000	63,240.00	0.09
444	603612	索通发展	4,100	63,099.00	0.09
445	603339	四方科技	5,300	63,017.00	0.09
446	002688	金河生物	13,100	63,011.00	0.09
447	000829	天音控股	6,600	62,964.00	0.09
448	002788	鹭燕医药	7,000	62,930.00	0.09
449	002476	宝莫股份	9,800	62,916.00	0.09
450	300483	首华燃气	5,300	62,911.00	0.09
451	300137	先河环保	11,300	62,828.00	0.09
452	600748	上实发展	18,000	62,820.00	0.09
453	600986	浙文互联	11,500	62,790.00	0.09
454	002777	久远银海	2,500	62,775.00	0.09
455	688630	芯碁微装	735	62,746.95	0.09

456	600237	铜峰电子	8,100	62,694.00	0.09
457	600138	中青旅	5,900	62,658.00	0.09
458	603889	新澳股份	8,800	62,656.00	0.09
459	002345	潮宏基	9,200	62,652.00	0.09
460	600035	楚天高速	16,400	62,648.00	0.09
461	300272	开能健康	10,100	62,620.00	0.09
462	002929	润建股份	1,500	62,595.00	0.09
463	600328	中盐化工	8,000	62,560.00	0.09
464	688311	盟升电子	1,225	62,487.25	0.09
465	000099	中信海直	7,100	62,480.00	0.09
466	600756	浪潮软件	4,500	62,415.00	0.09
467	002737	葵花药业	2,400	62,352.00	0.09
468	002526	山东矿机	21,500	62,350.00	0.09
468	603601	再升科技	14,500	62,350.00	0.09
469	002443	金洲管道	9,100	62,335.00	0.09
470	300219	鸿利智汇	7,400	62,308.00	0.09
471	605338	巴比食品	2,900	62,292.00	0.09
472	002960	青鸟消防	4,500	62,280.00	0.09
473	002655	共达电声	4,600	62,238.00	0.09
474	002829	星网宇达	2,300	62,192.00	0.09
475	688553	汇宇制药	4,105	62,108.65	0.09
476	000973	佛塑科技	12,700	62,103.00	0.09
477	600351	亚宝药业	9,000	62,100.00	0.09
478	603348	文灿股份	1,600	62,080.00	0.09
479	002108	沧州明珠	15,100	62,061.00	0.09
480	603012	创力集团	10,500	62,055.00	0.09
481	688176	亚虹医药	5,756	62,049.68	0.09
482	300841	康华生物	800	62,032.00	0.09
483	600503	华丽家族	24,300	61,965.00	0.09
484	603520	司太立	4,400	61,952.00	0.09
485	603313	梦百合	5,900	61,950.00	0.09
486	301175	中科环保	12,400	61,876.00	0.09
487	002301	齐心集团	8,700	61,857.00	0.09
488	300177	中海达	8,600	61,834.00	0.09
489	688559	海目星	1,729	61,725.30	0.09
490	300766	每日互动	4,000	61,720.00	0.09
491	002106	莱宝高科	5,800	61,712.00	0.09
492	600868	梅雁吉祥	24,200	61,710.00	0.09
493	300008	天海防务	15,500	61,690.00	0.09
494	603809	豪能股份	5,200	61,620.00	0.09
495	000816	智慧农业	20,400	61,608.00	0.09
496	688575	亚辉龙	2,690	61,520.30	0.09
497	688366	昊海生科	568	61,508.72	0.09

498	300398	飞凯材料	3,900	61,464.00	0.09
499	605090	九丰能源	2,200	61,446.00	0.09
500	000906	浙商中拓	8,400	61,404.00	0.09
501	300160	秀强股份	10,400	61,360.00	0.09
502	300131	英唐智控	10,200	61,302.00	0.09
503	300184	力源信息	10,300	61,285.00	0.09
504	300121	阳谷华泰	6,900	61,272.00	0.09
505	000823	超声电子	6,400	61,248.00	0.09
506	688023	安恒信息	552	61,211.28	0.09
507	688225	亚信安全	3,334	61,145.56	0.09
508	002038	双鹭药业	6,000	61,140.00	0.09
508	603067	振华股份	6,000	61,140.00	0.09
509	300161	华中数控	1,700	61,030.00	0.09
510	300358	楚天科技	5,700	60,990.00	0.09
511	603100	川仪股份	2,200	60,984.00	0.09
512	603556	海兴电力	2,100	60,963.00	0.09
513	600308	华泰股份	17,600	60,896.00	0.09
514	002627	三峡旅游	11,400	60,876.00	0.09
515	300260	新莱应材	2,000	60,860.00	0.09
516	600694	大商股份	3,600	60,804.00	0.09
517	300663	科蓝软件	4,300	60,802.00	0.09
518	300662	科锐国际	2,200	60,764.00	0.09
519	300587	天铁股份	10,400	60,736.00	0.09
520	300578	会畅通讯	3,400	60,724.00	0.09
521	300443	金雷股份	2,200	60,698.00	0.09
522	600643	爱建集团	11,900	60,690.00	0.09
523	300119	瑞普生物	3,700	60,643.00	0.09
524	301087	可孚医疗	1,600	60,640.00	0.09
525	300143	盈康生命	5,700	60,591.00	0.09
526	002338	奥普光电	1,800	60,570.00	0.09
527	603668	天马科技	3,300	60,522.00	0.09
528	603387	基蛋生物	5,500	60,500.00	0.09
529	002170	芭田股份	10,900	60,495.00	0.09
530	300057	万顺新材	9,800	60,466.00	0.09
531	300493	润欣科技	7,100	60,421.00	0.09
532	601528	瑞丰银行	12,200	60,390.00	0.09
532	601890	亚星锚链	6,100	60,390.00	0.09
533	000612	焦作万方	10,500	60,375.00	0.09
534	603801	志邦家居	3,600	60,372.00	0.09
535	300183	东软载波	4,000	60,360.00	0.09
536	600020	中原高速	16,400	60,352.00	0.09
537	002979	雷赛智能	2,800	60,340.00	0.09
538	600353	旭光电子	6,600	60,324.00	0.09

539	600479	千金药业	5,600	60,312.00	0.09
540	002057	中钢天源	7,500	60,300.00	0.09
541	300102	乾照光电	8,200	60,270.00	0.09
542	688277	天智航	4,565	60,166.70	0.09
543	002733	雄韬股份	4,000	60,160.00	0.09
544	300598	诚迈科技	1,400	60,102.00	0.09
545	603033	三维股份	3,800	60,078.00	0.09
546	002224	三力士	11,800	60,062.00	0.09
547	300072	海新能科	17,100	60,021.00	0.09
548	002611	东方精工	12,100	60,016.00	0.09
549	600103	青山纸业	25,100	59,989.00	0.09
550	000507	珠海港	11,400	59,964.00	0.09
551	300678	中科信息	2,000	59,960.00	0.09
552	300284	苏交科	11,000	59,950.00	0.09
553	300415	伊之密	3,400	59,942.00	0.09
554	688677	海泰新光	1,125	59,883.75	0.09
555	002125	湘潭电化	5,600	59,864.00	0.09
556	600105	永鼎股份	10,800	59,832.00	0.09
557	300280	紫天科技	1,400	59,822.00	0.09
558	000650	仁和药业	9,000	59,670.00	0.09
559	300286	安科瑞	2,300	59,639.00	0.09
560	002315	焦点科技	1,800	59,634.00	0.09
561	002669	康达新材	5,000	59,600.00	0.09
562	002488	金固股份	8,300	59,594.00	0.09
563	300005	探路者	9,000	59,580.00	0.09
564	600987	航民股份	6,800	59,568.00	0.09
565	000922	佳电股份	5,800	59,566.00	0.09
566	600477	杭萧钢构	18,100	59,549.00	0.09
567	601126	四方股份	4,200	59,472.00	0.09
568	605266	健之佳	1,000	59,400.00	0.09
569	300548	博创科技	2,200	59,334.00	0.09
570	600360	华微电子	8,200	59,286.00	0.09
571	000926	福星股份	14,200	59,214.00	0.09
572	600577	精达股份	14,300	59,202.00	0.09
573	600635	大众公用	19,600	59,192.00	0.09
574	600496	精工钢构	19,400	59,170.00	0.09
575	603383	顶点软件	1,200	59,160.00	0.09
576	601015	陕西黑猫	13,200	59,136.00	0.09
577	002328	新朋股份	9,900	59,103.00	0.09
578	002033	丽江股份	7,300	59,057.00	0.09
578	300586	美联新材	7,300	59,057.00	0.09
579	301219	腾远钴业	1,500	59,055.00	0.09
580	688321	微芯生物	2,690	59,045.50	0.09

581	688133	泰坦科技	1,273	59,003.55	0.09
582	688212	澳华内镜	951	58,990.53	0.09
583	603466	风语筑	4,100	58,958.00	0.09
584	301080	百普赛斯	1,000	58,940.00	0.09
585	600277	亿利洁能	22,400	58,912.00	0.09
586	300620	光库科技	1,300	58,890.00	0.09
587	600525	长园集团	11,000	58,850.00	0.09
588	688322	奥比中光	1,564	58,775.12	0.09
589	688382	益方生物	3,876	58,682.64	0.09
590	688377	迪威尔	2,186	58,628.52	0.09
591	600284	浦东建设	9,300	58,590.00	0.09
592	600266	城建发展	12,100	58,564.00	0.09
593	600211	西藏药业	1,200	58,560.00	0.09
594	600961	株冶集团	7,000	58,520.00	0.09
595	688317	之江生物	2,788	58,492.24	0.09
596	688025	杰普特	632	58,491.60	0.09
597	688018	乐鑫科技	568	58,475.60	0.09
598	000859	国风新材	11,000	58,410.00	0.09
599	000900	现代投资	14,900	58,408.00	0.09
600	600790	轻纺城	14,700	58,359.00	0.09
601	002662	京威股份	16,600	58,266.00	0.09
602	002462	嘉事堂	4,100	58,261.00	0.09
603	002023	海特高新	6,400	58,240.00	0.09
604	600206	有研新材	4,700	58,233.00	0.09
605	002840	华统股份	2,800	58,212.00	0.09
606	300811	铂科新材	1,100	58,157.00	0.09
607	300252	金信诺	6,300	58,149.00	0.09
608	301071	力量钻石	1,800	58,140.00	0.09
609	600825	新华传媒	13,000	58,110.00	0.09
610	001215	千味央厨	1,100	58,091.00	0.09
611	002234	民和股份	4,800	58,080.00	0.09
611	300353	东土科技	6,000	58,080.00	0.09
612	300066	三川智慧	11,500	58,075.00	0.09
613	300292	吴通控股	15,600	58,032.00	0.09
614	000925	众合科技	6,700	58,022.00	0.09
615	002067	景兴纸业	17,100	57,969.00	0.09
616	603730	岱美股份	4,000	57,960.00	0.09
617	603888	新华网	2,300	57,937.00	0.09
618	300639	凯普生物	6,200	57,908.00	0.09
619	688403	汇成股份	5,482	57,835.10	0.09
620	600966	博汇纸业	9,300	57,753.00	0.09
621	002206	海利得	11,500	57,730.00	0.09
622	603995	甬金股份	3,000	57,690.00	0.09

623	688380	中微半导	2,416	57,645.76	0.09
624	300174	元力股份	3,600	57,636.00	0.09
625	002416	爱施德	6,200	57,598.00	0.09
626	603662	柯力传感	1,600	57,584.00	0.09
627	300320	海达股份	7,400	57,572.00	0.09
627	600158	中体产业	7,400	57,572.00	0.09
628	688289	圣湘生物	2,938	57,437.90	0.09
629	000913	钱江摩托	4,600	57,362.00	0.09
630	300185	通裕重工	23,900	57,360.00	0.09
631	301171	易点天下	2,900	57,333.00	0.08
632	002117	东港股份	6,700	57,285.00	0.08
633	605377	华旺科技	3,000	57,270.00	0.08
634	603738	泰晶科技	3,500	57,225.00	0.08
635	002810	山东赫达	2,700	57,213.00	0.08
636	002073	软控股份	8,700	57,159.00	0.08
637	002122	汇洲智能	13,700	57,129.00	0.08
638	603590	康辰药业	1,500	57,120.00	0.08
639	002111	威海广泰	6,300	57,078.00	0.08
640	002467	二六三	12,300	57,072.00	0.08
641	600869	远东股份	13,000	57,070.00	0.08
642	000090	天健集团	12,400	57,040.00	0.08
643	002088	鲁阳节能	4,000	57,000.00	0.08
643	002895	川恒股份	3,000	57,000.00	0.08
644	300099	尤洛卡	9,200	56,948.00	0.08
645	600125	铁龙物流	9,400	56,870.00	0.08
646	300806	斯迪克	4,040	56,842.80	0.08
647	688091	上海谊众	888	56,832.00	0.08
648	000657	中钨高新	6,700	56,816.00	0.08
649	300032	金龙机电	9,000	56,790.00	0.08
649	603611	诺力股份	3,000	56,790.00	0.08
650	600433	冠豪高新	16,400	56,744.00	0.08
651	002210	飞马国际	31,700	56,743.00	0.08
652	300147	香雪制药	11,000	56,650.00	0.08
653	000717	中南股份	22,300	56,642.00	0.08
654	300149	睿智医药	7,400	56,610.00	0.08
655	300471	厚普股份	4,100	56,539.00	0.08
656	300793	佳禾智能	2,600	56,446.00	0.08
657	300020	银江技术	6,800	56,440.00	0.08
658	000592	平潭发展	22,300	56,419.00	0.08
659	603421	鼎信通讯	6,000	56,400.00	0.08
660	600063	皖维高新	13,100	56,330.00	0.08
661	688408	中信博	785	56,323.75	0.08
662	601789	宁波建工	13,600	56,304.00	0.08

663	605077	华康股份	2,600	56,264.00	0.08
664	688279	峰昭科技	446	56,249.52	0.08
665	300345	华民股份	7,300	56,210.00	0.08
666	002283	天润工业	9,600	56,160.00	0.08
666	300318	博晖创新	9,000	56,160.00	0.08
666	603337	杰克股份	2,600	56,160.00	0.08
667	300208	青岛中程	8,400	56,112.00	0.08
667	603358	华达科技	2,400	56,112.00	0.08
668	003012	东鹏控股	6,800	56,100.00	0.08
668	603918	金桥信息	3,000	56,100.00	0.08
669	000822	山东海化	8,200	56,088.00	0.08
670	300602	飞荣达	3,100	56,017.00	0.08
671	300042	朗科科技	1,600	56,000.00	0.08
672	002537	海联金汇	8,400	55,944.00	0.08
673	600990	四创电子	2,800	55,916.00	0.08
674	002035	华帝股份	9,000	55,890.00	0.08
675	002550	千红制药	9,500	55,860.00	0.08
676	002009	天奇股份	3,700	55,833.00	0.08
677	002026	山东威达	5,500	55,825.00	0.08
678	688800	瑞可达	1,388	55,769.84	0.08
679	600979	广安爱众	16,100	55,706.00	0.08
680	002158	汉钟精机	2,500	55,650.00	0.08
681	000882	华联股份	33,100	55,608.00	0.08
682	300311	任子行	9,100	55,601.00	0.08
683	603212	赛伍技术	3,200	55,584.00	0.08
684	002967	广电计量	3,700	55,537.00	0.08
685	002626	金达威	3,400	55,522.00	0.08
686	002580	圣阳股份	6,400	55,488.00	0.08
687	000607	华媒控股	12,100	55,418.00	0.08
688	300378	鼎捷软件	2,600	55,406.00	0.08
689	300228	富瑞特装	7,800	55,380.00	0.08
690	688305	科德数控	724	55,349.80	0.08
691	601019	山东出版	5,900	55,342.00	0.08
692	300903	科翔股份	5,500	55,330.00	0.08
693	300180	华峰超纤	12,500	55,250.00	0.08
694	600603	广汇物流	7,100	55,238.00	0.08
695	002039	黔源电力	4,000	55,160.00	0.08
696	300151	昌红科技	3,000	55,140.00	0.08
697	300792	壹网壹创	2,300	55,131.00	0.08
698	002349	精华制药	6,200	54,994.00	0.08
699	000901	航天科技	5,900	54,988.00	0.08
700	300331	苏大维格	2,200	54,956.00	0.08
701	605337	李子园	3,900	54,951.00	0.08

702	000758	中色股份	12,200	54,900.00	0.08
702	600094	大名城	18,300	54,900.00	0.08
703	002367	康力电梯	7,300	54,896.00	0.08
704	600846	同济科技	5,900	54,870.00	0.08
705	002421	达实智能	17,000	54,740.00	0.08
706	002935	天奥电子	3,000	54,720.00	0.08
706	605123	派克新材	600	54,720.00	0.08
707	603766	隆鑫通用	10,600	54,696.00	0.08
708	002815	崇达技术	5,700	54,606.00	0.08
709	600127	金健米业	7,500	54,600.00	0.08
710	688048	长光华芯	869	54,460.23	0.08
711	300261	雅本化学	7,300	54,458.00	0.08
712	600531	豫光金铅	9,000	54,450.00	0.08
713	688123	聚辰股份	889	54,433.47	0.08
714	603105	芯能科技	4,700	54,426.00	0.08
715	300085	银之杰	3,800	54,416.00	0.08
716	301039	中集车辆	5,800	54,404.00	0.08
717	002284	亚太股份	6,200	54,374.00	0.08
718	000601	韶能股份	12,700	54,356.00	0.08
719	300520	科大国创	2,500	54,350.00	0.08
720	300205	ST 天喻	5,000	54,300.00	0.08
721	300702	天宇股份	2,500	54,275.00	0.08
722	300047	天源迪科	6,200	54,250.00	0.08
723	688400	凌云光	2,009	54,243.00	0.08
724	688192	迪哲医药	1,133	54,214.05	0.08
725	688131	皓元医药	1,037	53,986.22	0.08
726	002491	通鼎互联	10,300	53,972.00	0.08
727	002171	楚江新材	7,200	53,856.00	0.08
728	300217	东方电热	10,000	53,800.00	0.08
729	000837	秦川机床	5,000	53,750.00	0.08
729	002042	华孚时尚	12,500	53,750.00	0.08
730	688508	芯朋微	1,092	53,737.32	0.08
731	300248	新开普	5,600	53,704.00	0.08
732	300723	一品红	1,800	53,694.00	0.08
732	301268	铭利达	1,800	53,694.00	0.08
733	300790	宇瞳光学	3,300	53,691.00	0.08
734	002215	诺普信	6,500	53,690.00	0.08
735	600229	城市传媒	7,100	53,605.00	0.08
736	000888	峨眉山 A	6,000	53,580.00	0.08
737	002965	祥鑫科技	1,300	53,521.00	0.08
738	603881	数据港	2,700	53,514.00	0.08
739	000852	石化机械	8,700	53,505.00	0.08
740	600594	益佰制药	9,400	53,486.00	0.08



741	603629	利通电子	1,700	53,482.00	0.08
742	688348	昱能科技	437	53,480.06	0.08
743	600742	一汽富维	5,600	53,480.00	0.08
744	002803	吉宏股份	2,600	53,456.00	0.08
745	000931	中关村	9,100	53,417.00	0.08
746	688369	致远互联	1,543	53,403.23	0.08
747	688326	经纬恒润	460	53,383.00	0.08
748	300497	富祥药业	5,700	53,352.00	0.08
749	002533	金杯电工	6,600	53,328.00	0.08
749	002605	姚记科技	2,400	53,328.00	0.08
750	300360	炬华科技	3,900	53,274.00	0.08
751	301155	海力风电	900	53,235.00	0.08
752	300634	彩讯股份	2,600	53,222.00	0.08
753	688100	威胜信息	1,840	53,212.80	0.08
754	002642	荣联科技	6,200	53,196.00	0.08
755	688031	星环科技	817	53,162.19	0.08
756	000969	安泰科技	5,900	53,041.00	0.08
756	300755	华致酒行	2,900	53,041.00	0.08
757	002559	亚威股份	4,600	53,038.00	0.08
758	300396	迪瑞医疗	1,800	53,010.00	0.08
759	688238	和元生物	5,896	53,005.04	0.08
760	600775	南京熊猫	4,000	53,000.00	0.08
761	300469	信息发展	3,600	52,992.00	0.08
762	603916	苏博特	5,200	52,988.00	0.08
763	002681	奋达科技	10,700	52,965.00	0.08
764	601619	嘉泽新能	15,000	52,950.00	0.08
765	000713	丰乐种业	6,900	52,923.00	0.08
766	002041	登海种业	4,000	52,920.00	0.08
767	300846	首都在线	3,700	52,873.00	0.08
768	603118	共进股份	5,900	52,864.00	0.08
769	000501	武商集团	6,200	52,824.00	0.08
769	600576	祥源文旅	7,100	52,824.00	0.08
770	300428	立中集团	2,500	52,800.00	0.08
771	000523	红棉股份	16,800	52,752.00	0.08
772	002115	三维通信	7,300	52,706.00	0.08
773	688339	亿华通	1,152	52,692.48	0.08
774	002726	龙大美食	6,500	52,650.00	0.08
774	300158	振东制药	7,800	52,650.00	0.08
775	600200	江苏吴中	6,400	52,608.00	0.08
776	002307	北新路桥	12,400	52,576.00	0.08
777	605020	永和股份	2,100	52,521.00	0.08
778	002639	雪人股份	7,000	52,500.00	0.08
778	601011	宝泰隆	15,000	52,500.00	0.08

779	600861	北京人力	2,800	52,472.00	0.08
780	002859	洁美科技	2,100	52,395.00	0.08
781	002233	塔牌集团	7,400	52,392.00	0.08
782	603871	嘉友国际	3,300	52,338.00	0.08
783	300278	华昌达	13,700	52,334.00	0.08
784	002478	常宝股份	9,600	52,320.00	0.08
785	000028	国药一致	1,800	52,182.00	0.08
786	603686	福龙马	5,100	52,173.00	0.08
787	600313	农发种业	7,000	52,150.00	0.08
788	300858	科拓生物	2,700	52,110.00	0.08
789	002746	仙坛股份	7,400	52,096.00	0.08
790	000576	甘化科工	5,600	52,080.00	0.08
790	301096	百诚医药	800	52,080.00	0.08
790	600059	古越龙山	5,600	52,080.00	0.08
790	600509	天富能源	8,000	52,080.00	0.08
791	603583	捷昌驱动	2,600	52,078.00	0.08
792	603203	快克智能	1,800	52,038.00	0.08
793	601900	南方传媒	4,000	51,960.00	0.08
794	000555	神州信息	4,600	51,934.00	0.08
795	688186	广大特材	2,882	51,933.64	0.08
796	688313	仕佳光子	4,086	51,933.06	0.08
797	688190	云路股份	725	51,931.75	0.08
798	002519	银河电子	8,400	51,828.00	0.08
799	601827	三峰环境	6,900	51,819.00	0.08
800	000700	模塑科技	7,400	51,800.00	0.08
801	688202	美迪西	757	51,763.66	0.08
802	301078	孩子王	6,300	51,723.00	0.08
803	300194	福安药业	11,800	51,684.00	0.08
804	000065	北方国际	4,600	51,612.00	0.08
804	000989	九芝堂	5,100	51,612.00	0.08
805	300779	惠城环保	1,000	51,600.00	0.08
805	301239	普瑞眼科	600	51,600.00	0.08
806	688275	万润新能	836	51,556.12	0.08
807	603595	东尼电子	1,400	51,506.00	0.08
808	300328	宜安科技	7,400	51,504.00	0.08
809	002947	恒铭达	1,600	51,488.00	0.08
810	300580	贝斯特	1,700	51,476.00	0.08
811	600757	长江传媒	6,900	51,405.00	0.08
812	003000	劲仔食品	4,200	51,324.00	0.08
813	002697	红旗连锁	10,300	51,294.00	0.08
814	603699	纽威股份	3,700	51,282.00	0.08
815	688378	奥来德	1,082	51,221.88	0.08
816	002329	皇氏集团	7,900	51,192.00	0.08

817	002785	万里石	1,900	51,129.00	0.08
818	688550	瑞联新材	1,288	51,107.84	0.08
819	300513	恒实科技	4,300	51,084.00	0.08
820	300276	三丰智能	12,700	51,054.00	0.08
821	000534	万泽股份	3,900	51,051.00	0.08
822	600223	福瑞达	5,300	51,039.00	0.08
823	300576	容大感光	1,300	51,038.00	0.08
824	002527	新时达	5,200	51,012.00	0.08
825	300468	四方精创	4,700	50,995.00	0.08
826	688232	新点软件	1,408	50,969.60	0.08
827	002570	贝因美	12,900	50,955.00	0.08
828	000756	新华制药	2,500	50,950.00	0.08
829	301051	信濠光电	800	50,936.00	0.08
830	002540	亚太科技	7,700	50,897.00	0.08
831	600571	信雅达	3,700	50,875.00	0.08
832	688076	诺泰生物	1,131	50,838.45	0.08
833	600491	龙元建设	12,900	50,826.00	0.08
834	000928	中钢国际	8,700	50,721.00	0.08
835	300263	隆华科技	7,200	50,688.00	0.08
836	002237	恒邦股份	4,700	50,666.00	0.08
837	002191	劲嘉股份	9,400	50,478.00	0.07
838	603222	济民医疗	6,300	50,463.00	0.07
839	600007	中国国贸	2,600	50,388.00	0.07
840	002277	友阿股份	12,500	50,375.00	0.07
841	601028	玉龙股份	4,700	50,337.00	0.07
842	600210	紫江企业	10,700	50,290.00	0.07
843	603666	亿嘉和	1,600	50,224.00	0.07
844	600189	泉阳泉	4,800	50,208.00	0.07
845	000652	泰达股份	12,900	50,181.00	0.07
846	002279	久其软件	7,700	50,127.00	0.07
847	000639	西王食品	11,300	49,946.00	0.07
848	002322	理工能科	3,900	49,920.00	0.07
849	688332	中科蓝讯	661	49,852.62	0.07
850	600751	海航科技	19,000	49,780.00	0.07
851	300629	新劲刚	2,300	49,749.00	0.07
852	000603	盛达资源	4,500	49,725.00	0.07
853	688766	普冉股份	507	49,675.86	0.07
854	002833	弘亚数控	2,800	49,672.00	0.07
855	300377	赢时胜	6,400	49,664.00	0.07
856	600710	苏美达	7,000	49,630.00	0.07
857	000812	陕西金叶	9,800	49,588.00	0.07
858	002668	奥马电器	7,500	49,575.00	0.07
859	000006	深振业 A	10,800	49,572.00	0.07

860	300592	华凯易佰	2,000	49,540.00	0.07
861	002993	奥海科技	1,300	49,530.00	0.07
862	601369	陕鼓动力	6,200	49,476.00	0.07
863	300842	帝科股份	700	49,385.00	0.07
864	600216	浙江医药	4,600	49,358.00	0.07
865	002516	旷达科技	10,000	49,300.00	0.07
866	300052	中青宝	2,900	49,213.00	0.07
867	300579	数字认证	1,900	49,134.00	0.07
868	002948	青岛银行	16,100	49,105.00	0.07
868	300480	光力科技	2,300	49,105.00	0.07
869	688003	天准科技	1,306	49,001.12	0.07
870	301263	泰恩康	3,000	48,990.00	0.07
871	002004	华邦健康	10,500	48,930.00	0.07
872	300429	强力新材	3,800	48,868.00	0.07
873	300128	锦富技术	10,600	48,866.00	0.07
874	300757	罗博特科	600	48,834.00	0.07
875	600459	贵研铂业	3,400	48,824.00	0.07
876	000819	岳阳兴长	2,700	48,816.00	0.07
877	002146	荣盛发展	28,500	48,735.00	0.07
878	603636	南威软件	3,800	48,716.00	0.07
879	688221	前沿生物	4,910	48,707.20	0.07
880	000848	承德露露	6,200	48,670.00	0.07
881	002847	盐津铺子	700	48,636.00	0.07
882	000936	华西股份	6,000	48,600.00	0.07
883	600776	东方通信	4,300	48,547.00	0.07
884	300039	上海凯宝	7,300	48,545.00	0.07
885	300134	大富科技	4,700	48,504.00	0.07
886	688298	东方生物	1,355	48,454.80	0.07
887	000059	华锦股份	8,800	48,312.00	0.07
888	688439	振华风光	542	48,297.62	0.07
889	300213	佳讯飞鸿	6,700	48,240.00	0.07
890	600789	鲁抗医药	6,700	47,838.00	0.07
891	603915	国茂股份	2,900	47,792.00	0.07
892	688789	宏华数科	478	47,756.98	0.07
893	603533	掌阅科技	2,400	47,712.00	0.07
894	300541	先进数通	3,100	47,709.00	0.07
895	001309	德明利	500	47,445.00	0.07
896	300302	同有科技	3,500	47,390.00	0.07
897	300507	苏奥传感	7,000	47,320.00	0.07
898	002077	大港股份	3,100	47,275.00	0.07
899	300266	兴源环境	17,500	47,250.00	0.07
900	603985	恒润股份	1,900	47,215.00	0.07
901	605168	三人行	745	47,203.20	0.07

902	603357	设计总院	5,300	47,170.00	0.07
903	688658	悦康药业	2,261	47,164.46	0.07
904	300607	拓斯达	3,000	47,010.00	0.07
905	003021	兆威机电	500	46,995.00	0.07
906	301153	中科江南	600	46,962.00	0.07
907	000680	山推股份	9,500	46,930.00	0.07
908	300145	中金环境	15,500	46,810.00	0.07
909	002197	证通电子	4,500	46,755.00	0.07
910	301015	百洋医药	1,300	46,618.00	0.07
911	000061	农产品	7,200	46,584.00	0.07
912	002664	信质集团	2,800	46,564.00	0.07
913	600649	城投控股	12,500	46,250.00	0.07
914	603229	奥翔药业	3,500	46,235.00	0.07
915	688372	伟测科技	589	46,177.60	0.07
916	002919	名臣健康	1,800	46,152.00	0.07
917	600305	恒顺醋业	5,000	46,050.00	0.07
918	300025	华星创业	4,800	46,032.00	0.07
919	600780	通宝能源	5,600	45,920.00	0.07
920	000560	我爱我家	20,400	45,900.00	0.07
921	002166	莱茵生物	5,900	45,843.00	0.07
922	300322	硕贝德	4,100	45,756.00	0.07
923	002101	广东鸿图	3,000	45,690.00	0.07
924	002515	金字火腿	8,100	45,684.00	0.07
925	600880	博瑞传播	9,100	45,591.00	0.07
926	002434	万里扬	6,100	45,445.00	0.07
927	002194	武汉凡谷	4,600	45,356.00	0.07
928	603719	良品铺子	2,100	45,276.00	0.07
929	300551	古鳌科技	2,600	45,240.00	0.07
930	000948	南天信息	3,000	45,210.00	0.07
931	600251	冠农股份	5,200	45,188.00	0.07
932	301095	广立微	600	44,838.00	0.07
933	600449	宁夏建材	2,500	44,825.00	0.07
934	300506	名家汇	9,100	44,772.00	0.07
935	300342	天银机电	2,900	44,573.00	0.07
936	002609	捷顺科技	3,900	44,538.00	0.07
937	002530	金财互联	5,100	44,421.00	0.07
938	300533	冰川网络	1,600	44,320.00	0.07
939	600172	黄河旋风	11,800	44,132.00	0.07
940	600420	国药现代	4,500	44,055.00	0.07
941	688733	壹石通	1,502	43,963.54	0.07
942	001270	铖昌科技	700	43,897.00	0.07
943	600335	国机汽车	4,900	43,610.00	0.06
944	300856	科思股份	700	43,561.00	0.06

945	300351	永贵电器	2,100	43,512.00	0.06
946	688319	欧林生物	2,744	43,355.20	0.06
947	688356	键凯科技	405	43,092.00	0.06
948	688696	极米科技	377	42,593.46	0.06
949	688095	福昕软件	609	42,538.65	0.06
950	688686	奥普特	376	42,112.00	0.06
951	601949	中国出版	5,200	42,016.00	0.06
952	300291	百纳千成	6,500	41,860.00	0.06
953	600288	大恒科技	3,600	40,968.00	0.06
954	688016	心脉医疗	200	38,926.00	0.06
955	688300	联瑞新材	698	36,959.10	0.05
956	688261	东微半导	416	34,773.44	0.05
957	000801	四川九洲	4,400	33,880.00	0.05
958	301205	联特科技	300	31,425.00	0.05
959	688318	财富趋势	200	25,260.00	0.04

### 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

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	688653	康希通信	239	3,821.61	0.01
2	001306	夏厦精密	21	1,582.56	0.00

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	600129	太极集团	1,161,758.00	1.72
2	002517	恺英网络	1,080,171.00	1.60
3	300394	天孚通信	1,018,283.00	1.51
4	300255	常山药业	992,579.00	1.47
5	300002	神州泰岳	959,551.00	1.42
6	002261	拓维信息	926,074.22	1.37
7	002229	鸿博股份	915,343.00	1.36
8	002432	九安医疗	915,044.00	1.36
9	600363	联创光电	909,205.44	1.35
10	603728	鸣志电器	891,365.00	1.32
11	600976	健民集团	886,929.00	1.31
12	603197	保隆科技	864,566.00	1.28
13	301080	百普赛斯	858,031.50	1.27
14	600771	广誉远	848,943.00	1.26
15	002240	盛新锂能	839,026.00	1.24
16	300212	易华录	829,679.00	1.23
17	002832	比音勒芬	810,311.00	1.20

18	688166	博瑞医药	787,750.05	1.17
19	603179	新泉股份	775,293.00	1.15
20	688235	百济神州	759,988.03	1.13

注：买入金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	600129	太极集团	1,122,996.00	1.66
2	688166	博瑞医药	1,009,937.56	1.50
3	603728	鸣志电器	888,932.00	1.32
4	688037	芯源微	802,972.28	1.19
5	600363	联创光电	801,352.02	1.19
6	600976	健民集团	798,608.00	1.18
7	603197	保隆科技	778,892.00	1.15
8	603179	新泉股份	758,074.00	1.12
9	600186	莲花健康	734,058.00	1.09
10	600771	广誉远	733,405.99	1.09
11	688007	光峰科技	718,237.72	1.06
12	688235	百济神州	674,040.66	1.00
13	688116	天奈科技	667,373.40	0.99
14	603283	赛腾股份	661,451.00	0.98
15	300573	兴齐眼药	658,360.20	0.98
16	688019	安集科技	647,251.39	0.96
17	603496	恒为科技	646,710.00	0.96
18	600211	西藏药业	636,712.00	0.94
19	603158	腾龙股份	615,110.00	0.91
20	601975	招商南油	604,428.00	0.90

注：卖出金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	424,174,245.89
卖出股票收入（成交）总额	173,604,539.03

注：买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额均为买卖股票成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

#### 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）	32,001.58	0.05
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	32,001.58	0.05

## 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	111018	华康转债	120	12,000.37	0.02
2	113069	博 23 转债	70	7,000.46	0.01
3	127100	神码转债	64	6,400.46	0.01
4	127102	浙建转债	46	4,600.14	0.01
5	118046	诺泰转债	20	2,000.15	0.00

## 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位调整的频率、交易成本和带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

### 8.11.2 本期国债期货投资评价

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。



## 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

神州数码集团股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到深圳市交通运输局的处罚。

本基金基金经理依据基金合同及公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对上述主体所发行证券进行了投资。

本基金投资前十名证券的其余发行主体本报告期内没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

### 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未超出基金合同规定的备选股票库。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	15,445.52
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	15,445.52

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 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

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 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

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	688653	康希通信	3,821.61	0.01	新股流通受限
2	001306	夏厦精密	1,582.56	0.00	新股流通受限

### 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 (%)
1,952	34,783.27	54,621,561.00	80.45	13,275,374.00	19.55

### 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	深圳纽富斯投资管理有限公司—纽富斯雪宝 15 号私募证券投资基金	22,364,600.00	32.94
2	中国平安财产保险股份有限公司—传统—普通保险产品	18,684,897.00	27.52
3	深圳市领丰资本管理有限公司—领丰投资长量 2 号私募证券投资基金	5,682,010.00	8.37
4	中信证券股份有限公司	2,942,513.00	4.33
5	方正证券股份有限公司	2,664,402.00	3.92
6	国信证券股份有限公司	2,282,139.00	3.36
7	姚潇瀛	800,077.00	1.18
8	陈虹岸	610,011.00	0.90
9	蔡亦天	589,900.00	0.87
10	朱新爱	500,038.00	0.74

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本期末基金管理人的所有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

1. 本期末基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。
2. 本期末本基金的基金经理未持有本基金。

## 9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

无。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2023年9月13日）基金份额总额	373,896,935.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	51,000,000.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	357,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	67,896,935.00

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

在本报告期内，本基金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

基金管理人重大人事变动：

报告期内本基金管理人未发生重大人事变动。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

报告期内本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

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

在本报告期内，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

本基金聘请的普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）已经连续1年为本基金提供审计服务，本年度应支付给会计师事务所的报酬为人民币45,000.00元。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金的管理人及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

#### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 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	6	597,732,752.36	100.00	251,820.93	100.00	-

注：1、基金专用交易单元的选择标准和程序如下：

#### 1) 选择标准

- a、资金实力雄厚，信誉良好；
- b、财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- c、经营行为规范，最近三年未因重大违规行为受到监管机关的处罚；
- d、内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求；
- e、该证券经营机构具有较强的研究能力，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析报告、个股分析报告及其他专门报告以及全面的信息服务。并能根据基金管理人的特定要求，提供专门研究报告。

#### 2) 选择程序

基金管理人根据以上标准进行考察后，确定证券经营机构的选择。基金管理人与被选择的证券经营机构签订协议。

2、本基金本期交易单元均为新增。

### 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	152,452.83	100.00	-	-	-	-

## 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	景顺长城国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 8 月 16 日
2	景顺长城国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 8 月 16 日
3	景顺长城国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 8 月 16 日
4	景顺长城国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 8 月 16 日
5	景顺长城国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金托管协议	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 8 月 16 日
6	景顺长城国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 8 月 16 日
7	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 9 月 2 日
8	关于景顺长城国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金新增长江证券为发售代理机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 9 月 4 日
9	关于景顺长城国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 9 月 14 日
10	景顺长城基金管理有限公司关于聘任基金经理助理的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 9 月 15 日
11	景顺长城基金管理有限公司关于旗下被动型指数基金投资关联方证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 9 月 16 日
12	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 9 月 22 日
13	关于景顺长城国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金关于开放日常申购和赎回业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 10 月 11 日
14	景顺长城国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 10 月 11 日
15	景顺长城基金管理有限公司关于调整景顺长城国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金最小申购、赎回单位的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 10 月 11 日
16	景顺长城国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 10 月 11 日
17	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 10 月 14 日

18	景顺长城国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金上市交易提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 10 月 16 日
19	关于景顺长城国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金新增流动性服务商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 10 月 16 日
20	关于景顺长城国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金新增流动性服务商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 10 月 31 日
21	景顺长城基金管理有限公司关于持续完善客户身份信息的提示	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 11 月 2 日
22	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 11 月 25 日
23	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华金证券为一级交易商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 12 月 4 日
24	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 12 月 9 日
25	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 12 月 16 日
26	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 12 月 23 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	20231128-20231231	0.00	22,364,600.00	0.00	22,364,600.00	32.94
	2	20231120-20231126; 20231228-20231231	0.00	25,128,797.00	6,443,900.00	18,684,897.00	27.52
产品特有风险							
<p>本基金由于存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%的情况，可能会出现如下风险：</p> <p>1、大额申购风险 在出现投资者大额申购时，如本基金所投资的标的资产未及时准备，则可能降低基金净值涨幅。</p> <p>2、如面临大额赎回的情况，可能导致以下风险：</p> <p>(1) 基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；</p> <p>(2) 如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20%的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，基</p>							

金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回，如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；

（3）基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；

（4）因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，导致基金净值出现较大波动；

（5）基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略；

（6）大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。

本基金管理人将建立完善的风险管理机制，以有效防止和化解上述风险，最大限度地保护基金份额持有人的合法权益。投资者在投资本基金前，请认真阅读本风险提示及基金合同等信息披露文件，全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，获得基金投资收益，亦自行承担基金投资中出现的各类风险。

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

景顺长城国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金 2023 年 10 月 16 日开始在深圳证券交易所上市交易。本基金场内简称：2000ETF 基金，基金代码：159522。详情请参阅本基金管理人于 2023 年 10 月 11 日、2023 年 10 月 16 日发布的基金上市相关公告。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予景顺长城国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 5、景顺长城基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程；
- 6、其他在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、定期报告及临时公告。

### 13.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

### 13.3 查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅。

景顺长城基金管理有限公司

2024 年 3 月 29 日