

平安国证 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：平安基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2026 年 03 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 03 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。

本报告除特别注明外，金额单位均为人民币元。

本报告期自 2025 年 01 月 01 日起至 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	5
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	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	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	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 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
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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的真实、准确和完整发表意见	14
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>14</b>
6.1 审计报告基本信息	14
6.2 审计报告的基本内容	14
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>16</b>
7.1 资产负债表	16
7.2 利润表	18
7.3 净资产变动表	19
7.4 报表附注	20

<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>46</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	46
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	46
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 .....	48
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	68
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	70
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 .....	70
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 .....	70
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 .....	70
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 .....	70
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	70
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	70
8.12 投资组合报告附注 .....	70
<b>§ 9 基金份额持有人信息</b> .....	<b>71</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	71
9.2 期末上市基金前十名持有人 .....	71
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	72
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 .....	72
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 .....	72
<b>§ 10 开放式基金份额变动</b> .....	<b>72</b>
<b>§ 11 重大事件揭示</b> .....	<b>72</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	72
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 .....	73
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	73
11.4 基金投资策略的改变 .....	73
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	73
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 .....	73
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	73
11.8 其他重大事件 .....	74
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>76</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 .....	76
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	78
<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	平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	平安国证 2000ETF
场内简称	国证 2000ETF 指数基金
基金主代码	159521
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023 年 8 月 25 日
基金管理人	平安基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	15,274,435.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2023 年 9 月 7 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。在正常情况下，本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 以内。
投资策略	本基金的股票投资主要采用抽样复制标的指数。抽样复制法是在标的指数成份股权重的基础上依托量化投资方法进行股票筛选与风险控制，使用“跟踪误差最小化”的最优化方式创建目标组合，从而实现对标的指数的紧密跟踪。 在正常情况下，本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值小于 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪偏离度、跟踪误差的进一步扩大。
业绩比较基准	国证 2000 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为交易型开放式指数基金，主要采用抽样复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票相似的风险收益特征。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		平安基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李海波	张姗
	联系电话	0755-88622632	400-61-95555
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		400-800-4800	400-61-95555
传真		0755-23997878	0755-83195201
注册地址		深圳市福田区福田街道益田路	深圳市深南大道 7088 号招商银

	5033 号平安金融中心 34 层	行大厦
办公地址	深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	518048	518040
法定代表人	罗春风	缪建民

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	fund.pingan.com
基金年度报告备置地点	深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	容诚会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢 10 层 1001-1 至 1001-26
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 8 月 25 日（基金合同生效日）-2023 年 12 月 31 日
本期已实现收益	6,586,061.77	-10,029,239.77	1,690,560.60
本期利润	6,223,526.86	-4,840,261.19	-1,439,945.23
加权平均基金份额本期利润	0.3229	-0.0692	-0.0050
本期加权平均净值利润率	30.01%	-7.98%	-0.50%
本期基金份额净值增长率	33.12%	-1.84%	-2.30%
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	4,225,381.56	-2,242,753.72	-2,556,047.11
期末可供	0.2766	-0.0674	-0.0230

分配基金份额利润			
期末基金资产净值	19,499,816.56	31,910,628.55	108,718,387.89
期末基金份额净值	1.2766	0.9590	0.9770
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	27.66%	-4.10%	-2.30%

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

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	2.76%	1.16%	1.83%	1.17%	0.93%	-0.01%
过去六个月	21.89%	1.11%	19.38%	1.14%	2.51%	-0.03%
过去一年	33.12%	1.40%	32.16%	1.49%	0.96%	-0.09%
自基金合同生效起至今	27.66%	1.65%	32.91%	1.80%	-5.25%	-0.15%

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

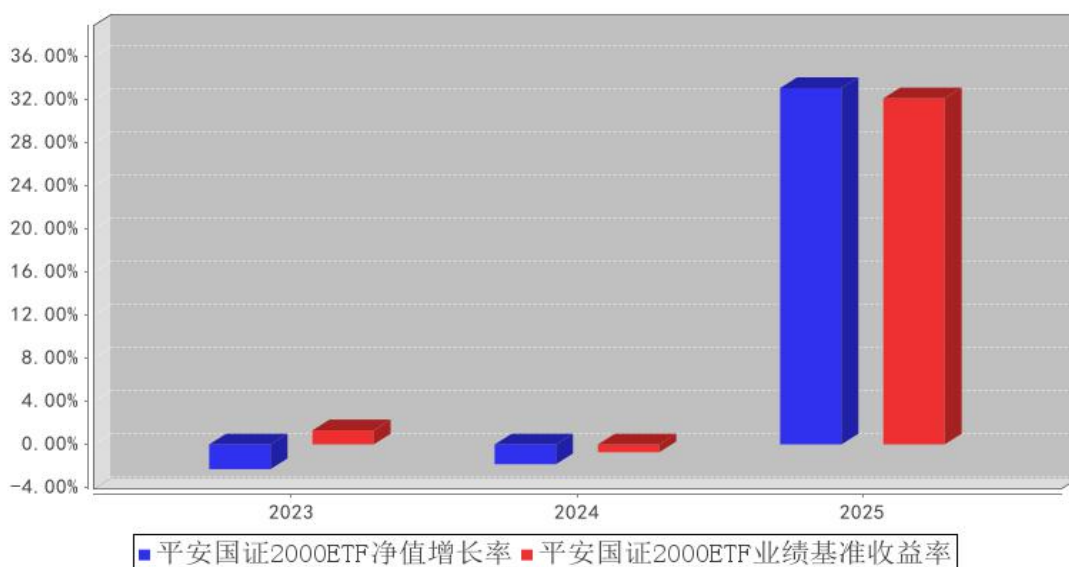
平安国证2000ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2023 年 08 月 25 日正式生效；  
 2、按照本基金的基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定，截至报告期末本基金已完成建仓，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

### 3.2.3 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

平安国证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：本基金基金合同于 2023 年 08 月 25 日正式生效，合同生效当年，按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 其他指标

注：本基金本报告期内无其他指标。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金基金合同于2023年08月25日成立，自合同生效日以来未进行利润分配。

## § 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

平安基金管理有限公司成立于 2011 年 1 月 7 日，总部位于深圳，是中国平安集团投资板块的重要成员。公司业务范围涵盖公募基金管理业务、资本市场专户管理业务，具有受托管理保险资金资产管理人资格、合格境内机构投资者（QDII）资格。截至 2025 年末，公司综合管理规模近 9000 亿元，公募管理规模 7176 亿元，累计服务客户数超 1.7 亿人，产品线涵盖货币、债券、混合、股票、指数、FOF、MOM、REITs 等各类产品。公司以“为持有人创造价值”为使命，打造了一支人才梯队完善、长期业绩优异的超 160 人投研团队，构建起“业绩可归因、策略可复制、人才可持续”的专业投研平台，为投资者创造长期稳健的投资回报，致力成为受投资者信赖、行业领先的综合型资产管理公司。

#### 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		
李严	平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金经理	2024 年 1 月 29 日	-	5 年	李严先生，复旦大学应用统计学专业硕士，曾担任东北证券股份有限公司上海证券研究咨询分公司证券分析师。2023 年 4 月加入平安基金管理有限公司，现任 ETF 指数投资中心高级研究员，同时担任平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安创业板交易型开放式指数证券投资基金、平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、平安创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金、平安中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、平安国证

				<p>2000 交易型开放式指数证券投资基金、平安中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金、平安中证沪深港黄金产业股票交易型开放式指数证券投资基金、平安中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金、平安上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金基金经理。同时担任平安中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、平安中证光伏产业指数型发起式证券投资基金、平安中证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、平安中证港股通医药卫生综合交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安中债-0-3 年国开行债券交易型开放式指数证券投资基金、平安中证港股通医药卫生综合交易型开放式指数证券投资基金、平安富时中国国企开放共赢交易型开放式指数证券投资基金、平安中证沪港深线上消费主题交易型开放式指数证券投资基金、平安港股通恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金、平安中证 5-10 年期国债活跃券交易型开放式指数证券投资基金、平安中债-中高等级公司债利差因子交易型开放式指数证券投资基金、平安 MSCI 中国 A 股低波动交易型开放式指数证券投资基金、平安中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金、平安中证粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金、平安中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金、平安中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、平安中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金、平安中证医药及医疗器械创新交易型开放式指数证券投资基金、平安中证新材料主题交易型开放式指数证券投资基金、平安中证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金、平安中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金、平安中证汽车零部件主题交易型开放式指数证券投资基金、平安上证 180 交易型开放式指数证券投资基金、平安中证 A500 红利低波动交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理。</p>
--	--	--	--	--

钱晶	ETF 指数投资部投资副总监，平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金经理	2023 年 8 月 25 日	2025 年 6 月 25 日	14 年	钱晶先生，美国纽约大学理工学院硕士。曾先后担任国信证券股份有限公司量化分析师、华安基金管理有限公司基金经理。2017 年 10 月加入平安基金管理有限公司，曾任 ETF 指数投资中心投资经理。现任 ETF 指数投资部投资副总监，同时担任平安中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金、平安中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、平安中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金、平安中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安中证汽车零部件主题交易型开放式指数证券投资基金、平安中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金、平安中证 A500 红利低波动交易型开放式指数证券投资基金、平安恒生港股通科技主题指数型发起式证券投资基金、平安上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金、平安恒生港股通中国央企红利交易型开放式指数证券投资基金基金经理。
----	---	-----------------	-----------------	------	---

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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

注：无。

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本报告期内，根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本基金管理人严格遵守《平安基金管理有限公司公平交易制度》、《平安基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》，严

格执行法律法规及制度要求，从以下五个方面对交易行为进行严格控制：一是搭建平等的投资信息平台，合理设置各类资产管理业务之间以及各类资产管理业务内部的组织结构，在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策等方面享有公平的机会。二是制定公平交易规则，建立科学的投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。三是加强对投资交易行为的监察稽核力度，建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估制度，通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。四是明确报告制度和路线，根据法规及公司内部要求，分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的投资业绩进行分析、评估，形成分析报告，由法律合规监察部、督察长、风控负责人、总经理签署后，妥善保存备查，如果发现涉嫌违背公平交易原则的行为，及时向公司管理层汇报并采取相关控制和改进措施。五是建立投资组合投资信息的管理及保密制度，不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离。

#### 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》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

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

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。

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

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.2766 元，本报告期基金份额净值增长率为 33.12%，业绩比较基准收益率为 32.16%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2025 年 A 股市场走出一轮可观的上涨行情。展望 2026 年，我们仍然看好中国资产延续强势表现，且投资机会可能多点开花。基本面方面，2026 年是“十五五”开局之年，内需政策有望积极，并且供给端优势下出口有望延续高景气，同时通胀水平在需求提振下逐步回暖，上市公司盈利有望迎来回升。流动性层面，海外仍处降息周期，国内降准降息有望落地，且人民币汇率强势下有望吸引外资重新回流中国资产。因此看好 A 股市场在基本面与流动性共振下的表现机会。方向上，科技板块受益 AI 产业持续加速，先进制造受益“反内卷”、出海等多重拉动，资源品受益流动性充裕，红利资产受益低利率环境下居民资产入市，投资机会可能呈现多点开花。

作为指数化产品管理者，积极做好组合管理，为投资者提供优质投资工具。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金份额持有人利益出发，严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，在进一步梳理完善内部控制制度和业务流程的同时，确保各项法规和管理制度的落实。公司法律合规监察部按照规定的权限和程序，通过合规评审、合规检视等各项合规管理措施以及实时监控、定期检查、专项检查等方法，对基金的投资运作、基金销售、基金运营、客户服务和信息披露等进行了重点监控与稽核，发现问题及时提出改进建议，并督促相关部门进行整改，同时定期向董事会和公司管理层出具监察稽核报告。公司重视对员工的合规培训，开展了多次培训活动，加强对员工行为的管理，增强员工合规意识。公司还通过网站等多种形式进行了投资者教育工作。报告期内，本基金管理人所管理的基金运作合法合规，基金合同得到严格履行，有效保障了基金份额持有人利益。本基金管理人将继续以风险控制为核心，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

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

本基金管理人设有估值委员会，由研究部及投资管理部门、运营部、风险管理部及法律合规监察部相关人员组成。估值委员会负责公司基金估值政策、程序及方法的制定和修订，负责定期审议公司估值政策、程序及方法的科学合理性，保证基金估值的公平、合理。估值委员会的相关人员均具有一定年限的专业从业经验，具有良好的专业能力，并能在相关工作中保持独立性。

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

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

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

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

报告期内本基金未进行利润分配，符合基金合同的约定。

#### 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

本基金本报告期内未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数低于 200 人的情形。本基金本报告期内出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5,000 万元的情形。截至报告期末，以上情况未消除。根据 2014 年 8 月 8 日生效的《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条的规定，予以披露，且基金管理人已经向证监会报告并提出了解决方案。

## § 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

托管人声明：

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

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

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

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

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

### 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

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

## § 6 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	容诚审字[2026]200Z0358 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	平安国证 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>我们审计了平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“平安国证 2000ETF 基金”）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。</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，公允反映了平安国证 2000ETF 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。</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。按照中国注册会计师职业道德守则和中国注册会计师独立性准则，我们独立于平安国证 2000ETF 基金，并遵守了独立性准则中适用于公众利益实体财务报表审计的规定，同时履行了职业道德方面的其他责任。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>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>平安国证 2000ETF 基金的基金管理人平安基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括平安国证 2000ETF 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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>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平安国证 2000ETF 基金的持续经营能力，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平安国证 2000ETF 基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p>

	基金管理人治理层负责监督平安国证 2000ETF 基金的财务报告过程。	
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，就可能对平安国证 2000ETF 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平安国证 2000ETF 基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报、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	容诚会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	沈兆杰	李崇
会计师事务所的地址	北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢 10 层 1001-1 至 1001-26	
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：平安国证 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
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	531,266.30	2,163,170.92
结算备付金		21,337.22	65,940.27
存出保证金		4,952.75	7,641.36
交易性金融资产	7.4.7.2	18,823,782.67	30,481,042.60
其中：股票投资		18,823,782.67	30,481,042.60
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
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	132,739.68	-
资产总计		19,514,078.62	32,717,795.15
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2025 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2024 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		-	546,335.52
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		8,048.58	17,533.12
应付托管费		1,609.71	3,506.63
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	4,603.77	239,791.33
负债合计		14,262.06	807,166.60
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.10	15,274,435.00	33,274,435.00

未分配利润	7.4.7.12	4,225,381.56	-1,363,806.45
净资产合计		19,499,816.56	31,910,628.55
负债和净资产总计		19,514,078.62	32,717,795.15

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.2766 元，基金份额总额 15,274,435.00 份。

## 7.2 利润表

会计主体：平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：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
<b>一、营业总收入</b>		6,371,642.36	-4,200,185.73
1. 利息收入		4,170.66	14,433.08
其中：存款利息收入	7.4.7.13	4,170.66	14,433.08
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）		6,676,530.41	-9,348,791.84
其中：股票投资收益	7.4.7.14	6,458,428.98	-10,227,886.50
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	-	-
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	218,101.43	879,094.66
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	-362,534.91	5,188,978.58
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	53,476.20	-54,805.55
<b>减：二、营业总支出</b>		148,115.50	640,075.46

1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	104,809.03	306,163.84
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	20,961.78	61,232.74
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		-	-
8. 其他费用	7.4.7.23	22,344.69	272,678.88
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>6,223,526.86</b>	<b>-4,840,261.19</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>6,223,526.86</b>	<b>-4,840,261.19</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>6,223,526.86</b>	<b>-4,840,261.19</b>

### 7.3 净资产变动表

会计主体：平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：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	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	33,274,435.00	-1,363,806.45	31,910,628.55
二、本期期初净资产	33,274,435.00	-1,363,806.45	31,910,628.55
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-18,000,000.00	5,589,188.01	-12,410,811.99
(一)、综合收益总额	-	6,223,526.86	6,223,526.86
(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	-634,338.85	-18,634,338.85
其中：1. 基金申购款	60,000,000.00	4,265,643.55	64,265,643.55
2. 基金赎回款	-78,000,000.00	-4,899,982.40	-82,899,982.40
(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	15,274,435.00	4,225,381.56	19,499,816.56
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	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	111,274,435.00	-2,556,047.11	108,718,387.89
二、本期期初净资产	111,274,435.00	-2,556,047.11	108,718,387.89
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-78,000,000.00	1,192,240.66	-76,807,759.34
（一）、综合收益总额	-	-4,840,261.19	-4,840,261.19
（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）	-78,000,000.00	6,032,501.85	-71,967,498.15
其中：1. 基金申购款	66,000,000.00	-9,776,645.45	56,223,354.55
2. 基金赎回款	-144,000,000.00	15,809,147.30	-128,190,852.70
（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	33,274,435.00	-1,363,806.45	31,910,628.55

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：

罗春风

林婉文

张南南

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

平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2023]1485 号《关于准予平安国证 2000 交易型开放式

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

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于国证 2000 指数的成份股及其备选成份股(包括存托凭证)。为更好地实现投资目标，本基金还可投资于非成份股(包括主板、创业板及其他经中国证监会允许投资的股票、存托凭证)、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债券、政府支持债券等)、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权、信用衍生品、银行存款(协议存款、通知存款以及定期存款等)、同业存单、资产支持证券、债券回购、现金以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金将根据法律法规的规定参与融资和转融通证券出借业务。本基金的投资组合比例为：本基金投资于国证 2000 指数的成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。本基金在每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：国证 2000 指数收益率。

#### 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>》、中国证券基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示

的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

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

本基金 2025 年度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 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

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、金融负债或权益工具。

##### (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、买入返售金融资产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和资产支持证券投资，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卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以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衍生金融资产/负债。

#### 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

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于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，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项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。

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损失准备。

本基金考虑在资产负债表日无须付出不必要的额外成本和努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期

信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且本基金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；或者(3)该金融资产已转移，虽然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，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具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确认。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征:(1)赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利,这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产;这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位,并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量;(2)该工具所属的类别次于其他所有工具类别,即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具,且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权;(3)该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别),所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征,并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同);(4)除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外,该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征;(5)该工具在存续期内的预计现金流量总额,应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具,是指根据合同约定,持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利,或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时,自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同:(1)现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响);(2)实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具,列报于净资产。

#### 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。债券投资和资产支持证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和资产支持证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在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

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

本基金的收益分配政策为：(1)基金收益评价日核定的基金份额净值增长率超过同期标的指数增长率达到 0.01%以上时，基金管理人可进行收益分配；(2)本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近同期标的指数增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值；(3)本基金的收益分配采取现金分红的方式；(4)《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；(5)每一基金份额享有同等分配权；(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

根据本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，本基金确定以下类别股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

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。

#### 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

本基金本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 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[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财政部、国家税务总局公告 2025 年

第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、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，免征增值税直至债券到期。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

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

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

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

#### 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 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
活期存款	531,266.30	2,163,170.92

等于：本金	531,209.57	2,162,983.08
加：应计利息	56.73	187.84
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
合计	531,266.30	2,163,170.92

## 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	17,127,844.83	-	18,823,782.67	1,695,937.84
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	17,127,844.83	-	18,823,782.67	1,695,937.84
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	28,422,569.85	-	30,481,042.60	2,058,472.75
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	28,422,569.85	-	30,481,042.60	2,058,472.75

注：于 2025 年 12 月 31 日，股票投资的公允价值和公允价值变动包含的可退替代款的估值增值为

零(2024年12月31日：同)。

#### 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

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

##### 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末未持有期货合约。

##### 7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

#### 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

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

##### 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

注：本基金本报告期末及上年度末均无债权投资。

##### 7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末及上年度末均无债权投资。

#### 7.4.7.6 其他债权投资

##### 7.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末均无其他债权投资。

##### 7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末及上年度末均无其他债权投资。

#### 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

注：本基金本报告期末及上年度末均无其他权益工具投资。

##### 7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末均无其他权益工具投资。

## 7.4.7.8 其他资产

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
应收利息	-	-
其他应收款	132,739.68	-
待摊费用	-	-
合计	132,739.68	-

## 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	1,727.19	4,543.06
其中：交易所市场	1,727.19	4,543.06
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	2,876.58	120,000.00
应退退补款	-	115,248.27
合计	4,603.77	239,791.33

注：应退退补款指投资者采用可以现金替代方式申购（赎回）本基金时，替代价格与实际买入成本（实际卖出金额）或强制退款成本之差乘以替代数量的金额。

## 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	33,274,435.00	33,274,435.00
本期申购	60,000,000.00	60,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-78,000,000.00	-78,000,000.00
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	15,274,435.00	15,274,435.00

注：投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购、赎回单位的整数倍。

## 7.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期末及上年度末均无其他综合收益。

## 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	-2,242,753.72	878,947.27	-1,363,806.45
本期期初	-2,242,753.72	878,947.27	-1,363,806.45
本期利润	6,586,061.77	-362,534.91	6,223,526.86
本期基金份额交易产生的变动数	-84,917.36	-549,421.49	-634,338.85
其中：基金申购款	5,356,044.87	-1,090,401.32	4,265,643.55
基金赎回款	-5,440,962.23	540,979.83	-4,899,982.40
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,258,390.69	-33,009.13	4,225,381.56

## 7.4.7.13 存款利息收入

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
活期存款利息收入	3,672.31	10,415.16
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	478.88	2,825.65
其他	19.47	1,192.27
合计	4,170.66	14,433.08

## 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 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
股票投资收益——买卖股票差价收入	3,230,416.04	-8,195,761.16
股票投资收益——赎回差价收入	3,228,012.94	-2,032,125.34
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	6,458,428.98	-10,227,886.50

## 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 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
卖出股票成交总额	46,527,641.30	95,329,657.04
减：卖出股票成本总额	43,251,705.01	103,361,611.13
减：交易费用	45,520.25	163,807.07
买卖股票差价收入	3,230,416.04	-8,195,761.16

#### 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	82,899,982.40	128,190,852.70
减：现金支付赎回款总额	40,132,739.40	61,302,876.70
减：赎回股票成本总额	39,539,230.06	68,920,101.34
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	3,228,012.94	-2,032,125.34

#### 7.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无股票申购差价收入。

#### 7.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无股票投资收益——证券出借差价收入。

#### 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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无债券投资收益。

##### 7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无债券买卖差价收入。

##### 7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无债券赎回差价收入。

##### 7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无债券申购差价收入。

**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**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均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**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无买卖资产支持证券差价收入。

**7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益——赎回差价收入。

**7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益——申购差价收入。

**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**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资。

**7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资。

**7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资。

**7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资。

**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**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

**7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具收益——其他投资收益。

**7.4.7.19 股利收益**

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
股票投资产生的股利收益	218,101.43	879,094.66
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	218,101.43	879,094.66

#### 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	-362,534.91	5,188,978.58
股票投资	-362,534.91	5,188,978.58
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	-362,534.91	5,188,978.58

注：本基金本年度公允价值变动收益-股票投资中包含的可退替代款产生的公允价值变动收益为零（2024年度：同）。

#### 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	53,476.20	-54,805.55
合计	53,476.20	-54,805.55

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

#### 7.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无信用减值损失。

#### 7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31

	月 31 日	日
审计费用	575.40	20,000.00
信息披露费	-	80,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	2,207.79	2,278.88
其他	19,561.50	170,400.00
合计	22,344.69	272,678.88

注：本报告期内本基金管理人主动承担了本基金部分基金费用，如审计费用等。

#### 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重大或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，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
平安基金管理有限公司（“平安基金”）	基金管理人
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人
大华资产管理有限公司	基金管理人的股东
三亚盈湾旅业有限公司	基金管理人的股东
平安信托有限责任公司	基金管理人的股东
深圳平安汇通投资管理有限公司（“平安汇通”）	基金管理人的子公司
平安证券股份有限公司（“平安证券”）	基金管理人的股东的子公司、基金销售机构
方正证券股份有限公司（“方正证券”）	基金销售机构、与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
中国平安保险(集团)股份有限公司（“平安集团”）	基金管理人的最终控股母公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 7.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的债券交易。

###### 7.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

#### 7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

### 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	104,809.03	306,163.84
其中：应支付销售机构的客户维护费	22,974.22	19,574.59
应支付基金管理人的净管理费	81,834.81	286,589.25

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

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.50\% / \text{当年天数}。$$

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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	20,961.78	61,232.74

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

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

### 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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均未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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间转融通证券出借业务均未发生重大关联交易事项。

**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**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间转融通证券出借业务均未发生重大关联交易事项。

**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**

注：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(%)
方正证券	394,631.00	2.5836	3,041,361.00	9.1402

注：投资相关费率符合基金合同和招募说明书等法律文件的约定

**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
招商银行-活期	531,266.30	3,672.31	2,163,170.92	10,415.16

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业存款利率计息。

**7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均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**

本基金本报告期及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

**7.4.11 利润分配情况**

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

**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**

注：本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

**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	停牌	停牌	期末	复牌	复牌	数量	期末	期末	备注
------	----	----	----	----	----	----	----	----	----	----

码	名称	日期	原因	估值 单价	日期	开盘单 价	(股)	成本总额	估值总 额	
603508	思维 列控	2025 年 12 月 29 日	重大事 项停牌	27.82	2026 年 1 月 7 日	27.83	700	21,351.49	19,474.00	

注：本基金截至 2025 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

### 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

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

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

## 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，建立了由风险管理委员会、风险控制委员会、风控负责人、督察长、风险管理部门以及各个业务部门构成的风险管理架构体系。各部门负责人为其所在部门风险管理的第一责任人，公司员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。本基金管理人设立风险管理部门，风险管理部门对公司的风险管理进行独立评估、监控、检查并及时向管理层汇报。

### 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，并对证券交割方式进行限制，以控制相应的信用风险。

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

于本报告期末，本基金未持有债券和资产支持证券投资（上年度末：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。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。

本基金管理人通过由风险管理人员定期监控组合中债券投资部分的利率风险，及时调整投资组合久期等方法管理利率风险。

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

##### 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	531,266.30	-	-	-	531,266.30
结算备付金	21,337.22	-	-	-	21,337.22
存出保证金	4,952.75	-	-	-	4,952.75
交易性金融资产	-	-	-	18,823,782.67	18,823,782.67
其他资产	-	-	-	132,739.68	132,739.68

资产总计	557,556.27	-	-	18,956,522.35	19,514,078.62
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	8,048.58	8,048.58
应付托管费	-	-	-	1,609.71	1,609.71
其他负债	-	-	-	4,603.77	4,603.77
负债总计	-	-	-	14,262.06	14,262.06
利率敏感度缺口	557,556.27	-	-	18,942,260.29	19,499,816.56
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	2,163,170.92	-	-	-	2,163,170.92
结算备付金	65,940.27	-	-	-	65,940.27
存出保证金	7,641.36	-	-	-	7,641.36
交易性金融资产	-	-	-	30,481,042.60	30,481,042.60
资产总计	2,236,752.55	-	-	30,481,042.60	32,717,795.15
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	17,533.12	17,533.12
应付托管费	-	-	-	3,506.63	3,506.63
应付清算款	-	-	-	546,335.52	546,335.52
其他负债	-	-	-	239,791.33	239,791.33
负债总计	-	-	-	807,166.60	807,166.60
利率敏感度缺口	2,236,752.55	-	-	29,673,876.00	31,910,628.55

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

注：于本报告期末，本基金未持有债券资产(上年度末：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(上年度末：同)。

#### 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。本基金持有的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无

##### 7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无

#### 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，

所面临的重大价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其它价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

经测算本基金面临的其他价格风险列示如下：

#### 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	18,823,782.67	96.53	30,481,042.60	95.52
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	18,823,782.67	96.53	30,481,042.60	95.52

#### 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（2025年12月31日）	上年度末（2024年12月31日）
	沪深 300 指数上升 5%	1,176,327.12	1,961,541.45
沪深 300 指数下降 5%	-1,176,327.12	-1,961,541.45	

#### 7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无

#### 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	18,804,308.67	30,481,042.60
第二层次	19,474.00	-
第三层次	-	-
合计	18,823,782.67	30,481,042.60

##### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生的当期期初为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，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；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的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

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日		合计
	交易性金融资产		
	债券投资	-	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-

转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
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	-	-	-
项目	上年度可比期间 2024年1月1日至2024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	-	72,664.46	72,664.46
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	9,263.00	9,263.00
转出第三层次	-	72,664.46	72,664.46
当期利得或损失总额	-	-9,263.00	-9,263.00
其中：计入损益的利得或损失	-	-9,263.00	-9,263.00
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
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	-	-9,263.00	-9,263.00

注：计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

#### 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

注：于本报告期末及上年度报告期末，本基金未使用不可观察输入值。

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2025 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（2024 年 12 月 31 日：同）。

#### 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

(1) 基金申购款于 2025 年度，本基金申购基金份额的对价总额为 64,265,643.55 元 (2024 年度: 56,223,345.55 元)，其中包括以股票支付的申购款 29,034,404.64 元和以现金支付的申购款 35,231,238.91 元 (2024 年度: 其中包括以股票支付的申购款 24,637,835.20 元和以现金支付的申购款 31,585,519.35 元)。(2) 除基金申购款外，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	18,823,782.67	96.46
	其中：股票	18,823,782.67	96.46
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	552,603.52	2.83
8	其他各项资产	137,692.43	0.71
9	合计	19,514,078.62	100.00

### 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	126,729.00	0.65
B	采矿业	290,974.00	1.49
C	制造业	12,706,733.07	65.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	375,613.00	1.93
E	建筑业	232,239.00	1.19
F	批发和零售业	721,817.13	3.70
G	交通运输、仓储和	368,871.00	1.89

	邮政业		
H	住宿和餐饮业	10,978.00	0.06
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,483,150.60	12.73
J	金融业	326,630.00	1.68
K	房地产业	177,540.00	0.91
L	租赁和商务服务业	303,631.44	1.56
M	科学研究和技术服务业	276,084.43	1.42
N	水利、环境和公共设施管理业	113,621.00	0.58
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	37,799.00	0.19
Q	卫生和社会工作	65,840.00	0.34
R	文化、体育和娱乐业	97,114.00	0.50
S	综合	38,936.00	0.20
	合计	18,754,300.67	96.18

### 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	25,092.00	0.13
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	40,214.00	0.21
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	4,176.00	0.02
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	69,482.00	0.36

### 8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票。

## 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	603083	剑桥科技	1,000	134,380.00	0.69
2	300456	赛微电子	2,400	134,304.00	0.69
3	600105	永鼎股份	4,700	117,970.00	0.60
4	601208	东材科技	3,400	92,106.00	0.47
5	688270	臻镭科技	700	85,449.00	0.44
6	600595	中孚实业	10,200	80,070.00	0.41
7	300620	光库科技	500	73,525.00	0.38
8	002428	云南锗业	2,200	69,850.00	0.36
9	300102	乾照光电	2,500	68,900.00	0.35
10	688343	云天励飞	900	68,472.00	0.35
11	002544	普天科技	1,900	65,531.00	0.34
12	300131	英唐智控	4,400	64,504.00	0.33
13	601126	四方股份	2,100	63,168.00	0.32
14	300655	晶瑞电材	3,900	62,907.00	0.32
15	688123	聚辰股份	500	62,790.00	0.32
16	600114	东睦股份	2,000	61,100.00	0.31
17	300007	汉威科技	1,100	58,960.00	0.30
18	300045	华力创通	2,000	57,820.00	0.30
19	301550	斯菱智驱	416	57,699.20	0.30
20	300236	上海新阳	900	57,384.00	0.29
21	600330	天通股份	4,300	56,459.00	0.29
22	300638	广和通	1,900	56,316.00	0.29
23	002565	顺灏股份	3,000	54,990.00	0.28
24	301219	腾远钴业	800	54,624.00	0.28
25	603067	振华股份	1,880	54,162.80	0.28
26	300593	新雷能	1,800	53,568.00	0.27
27	002048	宁波华翔	1,700	53,482.00	0.27
28	002400	省广集团	6,000	53,220.00	0.27
29	688409	富创精密	784	52,841.60	0.27

30	600877	电科芯片	3,000	52,650.00	0.27
31	000917	电广传媒	5,100	52,428.00	0.27
32	300229	拓尔思	2,600	51,740.00	0.27
33	001301	尚太科技	600	51,486.00	0.26
34	002895	川恒股份	1,400	51,324.00	0.26
35	301511	德福科技	1,400	50,106.00	0.26
36	000681	视觉中国	2,100	50,001.00	0.26
37	300738	奥飞数据	2,700	49,923.00	0.26
38	600635	大众公用	7,600	49,704.00	0.25
39	300850	新强联	1,200	49,644.00	0.25
40	000811	冰轮环境	2,670	49,448.40	0.25
41	300469	信息发展	800	49,440.00	0.25
42	688800	瑞可达	590	48,970.00	0.25
43	605196	华通线缆	1,400	48,636.00	0.25
44	300101	振芯科技	1,700	48,331.00	0.25
45	601606	长城军工	1,000	48,120.00	0.25
46	002046	国机精工	1,100	47,498.00	0.24
47	688327	云从科技	3,300	47,421.00	0.24
48	002237	恒邦股份	3,500	46,970.00	0.24
49	000969	安泰科技	2,200	46,222.00	0.24
50	688088	虹软科技	932	46,134.00	0.24
51	600728	佳都科技	6,900	46,092.00	0.24
52	600596	新安股份	4,000	45,880.00	0.24
53	605376	博迁新材	700	45,780.00	0.23
54	000680	山推股份	3,800	45,486.00	0.23
55	002779	中坚科技	400	45,424.00	0.23
56	002807	江阴银行	9,900	45,243.00	0.23
57	300008	天海防务	5,700	44,973.00	0.23
58	688239	航宇科技	660	44,662.20	0.23
59	002361	神剑股份	3,100	44,454.00	0.23
60	000973	佛塑科技	3,000	44,100.00	0.23
61	300827	上能电气	1,280	43,801.60	0.22
62	300053	航宇微	2,300	43,746.00	0.22
63	688548	广钢气体	3,000	43,620.00	0.22
64	688390	固德威	700	43,491.00	0.22
65	600629	华建集团	2,000	43,400.00	0.22
66	300342	天银机电	1,300	43,069.00	0.22
67	600986	浙文互联	5,500	43,010.00	0.22
68	600446	金证股份	2,700	42,984.00	0.22
69	600366	宁波韵升	3,100	42,749.00	0.22
70	688503	聚和材料	700	42,700.00	0.22
71	000422	湖北宜化	3,000	42,630.00	0.22
72	688400	凌云光	1,000	42,380.00	0.22

73	603360	百傲化学	1,300	41,886.00	0.21
74	300348	长亮科技	2,700	41,796.00	0.21
75	301377	鼎泰高科	300	41,730.00	0.21
76	002174	游族网络	3,400	41,616.00	0.21
77	000099	中信海直	2,000	41,500.00	0.21
78	002192	融捷股份	800	41,400.00	0.21
79	301510	固高科技	1,100	41,195.00	0.21
80	300322	硕贝德	1,500	40,935.00	0.21
81	002212	天融信	4,500	40,815.00	0.21
82	601137	博威合金	1,900	40,603.00	0.21
83	002545	东方铁塔	2,200	40,590.00	0.21
84	300113	顺网科技	2,000	40,480.00	0.21
85	000682	东方电子	3,400	40,324.00	0.21
86	002020	京新药业	2,100	39,858.00	0.20
87	300602	飞荣达	1,200	39,792.00	0.20
88	002182	宝武镁业	2,600	39,780.00	0.20
89	688063	派能科技	700	39,774.00	0.20
90	002075	沙钢股份	6,900	39,675.00	0.20
91	600320	振华重工	7,700	39,655.00	0.20
92	300769	德方纳米	900	39,609.00	0.20
93	300684	中石科技	800	39,376.00	0.20
94	688158	优刻得	1,400	39,326.00	0.20
95	600835	上海机电	1,300	39,013.00	0.20
96	300790	宇瞳光学	1,300	38,883.00	0.20
97	601609	金田股份	3,600	38,880.00	0.20
98	300130	新国都	1,400	38,822.00	0.20
99	002698	博实股份	2,300	38,663.00	0.20
100	688559	海目星	800	38,448.00	0.20
101	002839	张家港行	8,300	37,931.00	0.19
102	002706	良信股份	3,500	37,730.00	0.19
103	688660	电气风电	2,200	37,422.00	0.19
104	301078	孩子王	3,600	37,332.00	0.19
105	000801	四川九洲	2,200	37,312.00	0.19
106	603319	美湖股份	1,020	37,311.60	0.19
107	002006	精工科技	1,600	37,056.00	0.19
108	300185	通裕重工	13,000	36,920.00	0.19
109	002815	崇达技术	2,700	36,882.00	0.19
110	002123	梦网科技	3,000	36,480.00	0.19
111	600531	豫光金铅	3,100	36,425.00	0.19
112	002947	恒铭达	700	36,414.00	0.19
113	000923	河钢资源	1,700	35,989.00	0.18
114	300324	旋极信息	6,000	35,880.00	0.18
115	300328	宜安科技	2,100	35,847.00	0.18

116	002948	青岛银行	8,000	35,840.00	0.18
117	301316	慧博云通	800	35,744.00	0.18
118	300181	佐力药业	2,200	35,552.00	0.18
119	300624	万兴科技	500	35,325.00	0.18
120	000735	罗牛山	3,900	35,256.00	0.18
121	600285	羚锐制药	1,700	35,207.00	0.18
122	603809	豪能股份	2,450	35,157.50	0.18
123	600478	科力远	5,100	35,139.00	0.18
124	001267	汇绿生态	1,600	35,040.00	0.18
125	300303	聚飞光电	5,100	34,884.00	0.18
126	688787	海天瑞声	300	34,797.00	0.18
127	600428	中远海特	4,900	34,790.00	0.18
128	600063	皖维高新	5,900	34,751.00	0.18
129	603619	中曼石油	1,500	34,575.00	0.18
130	000420	吉林化纤	7,600	34,428.00	0.18
131	300772	运达股份	1,800	34,308.00	0.18
132	301217	铜冠铜箔	1,000	34,280.00	0.18
133	002416	爱施德	2,700	33,966.00	0.17
134	600908	无锡银行	5,700	33,801.00	0.17
135	300166	东方国信	3,300	33,726.00	0.17
136	301205	联特科技	200	33,702.00	0.17
137	688535	华海诚科	300	33,624.00	0.17
138	300953	震裕科技	200	33,604.00	0.17
139	002537	海联金汇	3,700	33,522.00	0.17
139	300680	隆盛科技	600	33,522.00	0.17
140	002928	华夏航空	3,000	33,150.00	0.17
141	300421	力星股份	900	33,102.00	0.17
142	002643	万润股份	2,200	32,978.00	0.17
143	603267	鸿远电子	600	32,658.00	0.17
144	002023	海特高新	2,400	32,496.00	0.17
145	600750	华润江中	1,400	32,438.00	0.17
146	600509	天富能源	3,900	32,214.00	0.17
147	300493	润欣科技	1,600	32,144.00	0.16
148	002315	焦点科技	700	32,032.00	0.16
149	600216	浙江医药	2,300	31,878.00	0.16
150	002292	奥飞娱乐	3,600	31,860.00	0.16
151	600480	凌云股份	2,590	31,831.10	0.16
152	600864	哈投股份	4,800	31,824.00	0.16
153	600507	方大特钢	5,400	31,806.00	0.16
154	001287	中电港	1,400	31,724.00	0.16
155	002011	盾安环境	2,500	31,700.00	0.16
156	600550	保变电气	3,000	31,650.00	0.16
157	000700	模塑科技	2,200	31,636.00	0.16

158	300576	容大感光	820	31,611.00	0.16
159	002675	东诚药业	2,300	31,602.00	0.16
160	002221	东华能源	3,900	31,590.00	0.16
161	300319	麦捷科技	2,700	31,563.00	0.16
162	000685	中山公用	2,700	31,455.00	0.16
163	601963	重庆银行	2,900	31,407.00	0.16
164	301421	波长光电	300	31,245.00	0.16
165	002017	东信和平	1,400	31,220.00	0.16
166	000833	粤桂股份	1,600	31,136.00	0.16
167	002067	景兴纸业	5,500	31,075.00	0.16
168	002100	天康生物	4,200	30,954.00	0.16
169	000837	秦川机床	2,400	30,912.00	0.16
170	300327	中颖电子	1,100	30,833.00	0.16
171	603505	金石资源	1,650	30,822.00	0.16
172	600993	马应龙	1,100	30,800.00	0.16
173	688127	蓝特光学	800	30,792.00	0.16
174	688656	浩欧博	200	30,760.00	0.16
175	002003	伟星股份	2,900	30,740.00	0.16
176	300252	金信诺	2,100	30,702.00	0.16
177	301488	豪恩汽电	200	30,610.00	0.16
178	600273	嘉化能源	3,500	30,590.00	0.16
179	000829	天音控股	2,800	30,548.00	0.16
180	688160	步科股份	200	30,500.00	0.16
181	603583	捷昌驱动	800	30,456.00	0.16
182	002467	二六三	5,000	30,450.00	0.16
183	300129	泰胜风能	2,900	30,334.00	0.16
184	603337	杰克科技	700	30,331.00	0.16
185	688776	国光电气	300	30,222.00	0.15
186	002987	京北方	1,400	30,142.00	0.15
187	688507	索辰科技	300	30,087.00	0.15
188	300123	亚光科技	3,700	29,970.00	0.15
189	002083	孚日股份	2,500	29,750.00	0.15
190	600409	三友化工	4,800	29,712.00	0.15
191	300842	帝科股份	500	29,635.00	0.15
192	301293	三博脑科	500	29,490.00	0.15
193	603283	赛腾股份	680	29,457.60	0.15
194	002979	雷赛智能	700	29,449.00	0.15
195	603859	能科科技	700	29,435.00	0.15
196	688518	联赢激光	1,210	29,390.90	0.15
197	002004	华邦健康	6,100	29,158.00	0.15
198	300075	数字政通	1,900	29,146.00	0.15
199	301291	明阳电气	700	29,127.00	0.15
200	300855	图南股份	900	29,070.00	0.15

201	300872	天阳科技	1,400	28,784.00	0.15
202	600771	广誉远	1,600	28,768.00	0.15
203	002345	潮宏基	2,300	28,750.00	0.15
204	301095	广立微	400	28,684.00	0.15
205	002062	宏润建设	3,100	28,675.00	0.15
206	002239	奥特佳	9,600	28,608.00	0.15
207	300079	数码视讯	5,300	28,567.00	0.15
208	600556	天下秀	4,700	28,529.00	0.15
209	300222	科大智能	2,600	28,444.00	0.15
210	300168	万达信息	4,400	28,424.00	0.15
211	002204	大连重工	3,700	28,305.00	0.15
212	603663	三祥新材	800	28,280.00	0.15
213	300525	博思软件	2,000	28,200.00	0.14
214	600328	中盐化工	3,400	28,016.00	0.14
215	300382	斯莱克	1,800	28,008.00	0.14
216	300520	科大国创	800	27,912.00	0.14
217	688319	欧林生物	1,100	27,896.00	0.14
218	600888	新疆众和	3,400	27,846.00	0.14
219	600461	洪城环境	3,000	27,810.00	0.14
220	002255	海陆重工	2,200	27,764.00	0.14
221	002392	北京利尔	3,700	27,676.00	0.14
222	300547	川环科技	700	27,580.00	0.14
223	601311	骆驼股份	3,000	27,510.00	0.14
224	000065	北方国际	2,200	27,412.00	0.14
225	002043	兔宝宝	1,900	27,379.00	0.14
226	688083	中望软件	400	27,244.00	0.14
227	002332	仙琚制药	3,000	27,030.00	0.14
228	600787	中储股份	4,800	26,976.00	0.14
229	300244	迪安诊断	1,700	26,945.00	0.14
230	300109	新开源	1,600	26,864.00	0.14
231	002965	祥鑫科技	660	26,848.80	0.14
232	603039	泛微网络	500	26,770.00	0.14
233	300416	苏试试验	1,500	26,760.00	0.14
234	000061	农产品	2,600	26,754.00	0.14
235	002881	美格智能	600	26,736.00	0.14
236	600255	鑫科材料	6,900	26,565.00	0.14
237	300145	南方泵业	5,600	26,432.00	0.14
238	000589	贵州轮胎	5,100	26,418.00	0.14
239	603599	广信股份	2,300	26,404.00	0.14
240	000860	顺鑫农业	1,800	26,370.00	0.14
241	688006	杭可科技	900	26,361.00	0.14
242	300047	天源迪科	2,100	26,355.00	0.14
243	300278	华昌达	4,300	26,230.00	0.13

244	600158	中体产业	3,000	26,190.00	0.13
245	688418	震有科技	600	26,088.00	0.13
246	002243	力合科创	2,600	25,870.00	0.13
247	301392	汇成真空	200	25,808.00	0.13
248	600866	星湖科技	3,700	25,715.00	0.13
249	600106	重庆路桥	4,100	25,666.00	0.13
250	002515	金字火腿	4,200	25,578.00	0.13
251	002045	国光电器	1,800	25,506.00	0.13
252	300925	法本信息	1,200	25,488.00	0.13
253	300443	金雷股份	900	25,317.00	0.13
254	301216	万凯新材	1,500	25,290.00	0.13
255	300687	赛意信息	1,100	25,267.00	0.13
256	002233	塔牌集团	2,800	25,228.00	0.13
257	002550	千红制药	3,200	25,152.00	0.13
258	301345	涛涛车业	100	25,132.00	0.13
259	000036	华联控股	3,800	25,080.00	0.13
260	688639	华恒生物	766	24,956.28	0.13
261	002127	南极电商	7,400	24,938.00	0.13
262	000795	英洛华	2,500	24,925.00	0.13
263	600496	精工钢构	6,000	24,900.00	0.13
264	301486	致尚科技	200	24,810.00	0.13
265	605507	国邦医药	1,000	24,800.00	0.13
266	000949	新乡化纤	4,500	24,750.00	0.13
266	600776	东方通信	1,500	24,750.00	0.13
267	600783	鲁信创投	1,000	24,730.00	0.13
268	300708	聚灿光电	2,775	24,642.00	0.13
269	300685	艾德生物	1,200	24,552.00	0.13
270	688146	中船特气	600	24,240.00	0.12
271	688155	先惠技术	400	24,180.00	0.12
272	688091	上海谊众	510	23,970.00	0.12
273	002929	润建股份	600	23,886.00	0.12
273	600458	时代新材	1,800	23,886.00	0.12
274	002668	TCL 智家	2,300	23,874.00	0.12
274	600269	赣粤高速	4,600	23,874.00	0.12
275	600710	苏美达	2,200	23,782.00	0.12
276	300397	天和防务	1,600	23,712.00	0.12
276	600138	中青旅	2,400	23,712.00	0.12
277	600475	华光环能	1,300	23,621.00	0.12
278	603279	景津装备	1,400	23,618.00	0.12
279	600789	鲁抗医药	2,600	23,504.00	0.12
280	002458	益生股份	2,800	23,464.00	0.12
281	300232	洲明科技	3,300	23,397.00	0.12
282	600055	万东医疗	1,500	23,370.00	0.12

283	600973	宝胜股份	3,200	23,360.00	0.12
284	300587	天铁科技	3,800	23,294.00	0.12
285	002448	中原内配	1,800	23,274.00	0.12
286	300061	旗天科技	2,200	23,144.00	0.12
287	300444	双杰电气	2,400	23,112.00	0.12
288	688108	赛诺医疗	1,200	23,088.00	0.12
289	600586	金晶科技	4,100	23,083.00	0.12
290	002254	泰和新材	2,300	23,046.00	0.12
291	600587	新华医疗	1,600	23,040.00	0.12
292	002093	国脉科技	2,000	23,000.00	0.12
293	002434	万里扬	2,400	22,872.00	0.12
294	002859	洁美科技	828	22,852.80	0.12
295	301127	武汉天源	1,500	22,785.00	0.12
296	688408	中信博	541	22,781.51	0.12
297	002297	博云新材	1,900	22,743.00	0.12
298	002765	蓝黛科技	1,700	22,729.00	0.12
299	300177	中海达	2,200	22,726.00	0.12
300	002125	湘潭电化	1,600	22,656.00	0.12
301	300226	上海钢联	900	22,608.00	0.12
302	300541	先进数通	1,500	22,590.00	0.12
303	002158	汉钟精机	900	22,527.00	0.12
304	600502	安徽建工	4,800	22,512.00	0.12
305	300257	开山股份	1,600	22,480.00	0.12
306	002057	中钢天源	2,200	22,418.00	0.11
307	600266	城建发展	4,400	22,308.00	0.11
307	603713	密尔克卫	400	22,308.00	0.11
308	688696	极米科技	200	22,296.00	0.11
309	002761	浙江建投	2,600	22,282.00	0.11
310	688139	海尔生物	700	22,246.00	0.11
311	600571	信雅达	1,400	22,232.00	0.11
312	601528	瑞丰银行	3,900	22,230.00	0.11
313	300355	蒙草生态	5,500	22,220.00	0.11
313	300435	中泰股份	1,000	22,220.00	0.11
314	000990	诚志股份	2,800	22,176.00	0.11
315	000672	上峰水泥	1,700	22,083.00	0.11
316	603018	华设集团	2,900	22,069.00	0.11
317	300284	苏交科	2,800	22,064.00	0.11
318	688510	航亚科技	820	22,058.00	0.11
319	002570	贝因美	3,600	22,032.00	0.11
320	000029	深深房A	1,000	22,020.00	0.11
321	000922	佳电股份	1,600	22,016.00	0.11
322	301039	中集车辆	2,400	21,960.00	0.11
323	301487	盟固利	1,000	21,930.00	0.11

324	600017	日照港	7,300	21,900.00	0.11
325	300213	佳讯飞鸿	2,300	21,896.00	0.11
326	600284	浦东建设	2,600	21,840.00	0.11
327	300302	同有科技	1,200	21,768.00	0.11
328	300217	东方电热	4,200	21,756.00	0.11
329	002626	金达威	1,100	21,681.00	0.11
330	688150	莱特光电	800	21,624.00	0.11
331	002526	山东矿机	6,000	21,600.00	0.11
332	301071	力量钻石	600	21,504.00	0.11
333	002061	浙江交科	5,400	21,492.00	0.11
334	000650	仁和药业	3,800	21,470.00	0.11
335	300740	水羊股份	900	21,456.00	0.11
336	688289	圣湘生物	1,124	21,254.84	0.11
337	300770	新媒股份	500	21,205.00	0.11
338	300401	花园生物	1,400	21,168.00	0.11
339	300041	回天新材	1,900	21,052.00	0.11
340	300428	立中集团	900	21,015.00	0.11
341	002605	姚记科技	900	20,970.00	0.11
342	600268	国电南自	2,000	20,960.00	0.11
343	002832	比音勒芬	1,400	20,944.00	0.11
344	300533	冰川网络	600	20,838.00	0.11
345	300783	三只松鼠	900	20,835.00	0.11
346	600729	重庆百货	800	20,800.00	0.11
347	688707	振华新材	1,500	20,775.00	0.11
348	002438	江苏神通	1,300	20,670.00	0.11
349	002351	漫步者	1,700	20,502.00	0.11
350	300201	海伦哲	3,000	20,490.00	0.11
351	300918	南山智尚	1,100	20,449.00	0.10
352	600059	古越龙山	2,200	20,372.00	0.10
353	688658	悦康药业	900	20,349.00	0.10
354	301285	鸿日达	300	20,334.00	0.10
355	603368	柳药集团	1,140	20,314.80	0.10
356	300292	吴通控股	4,500	20,295.00	0.10
357	002559	亚威股份	2,000	20,240.00	0.10
358	688593	新相微	1,000	20,180.00	0.10
359	300505	川金诺	900	20,151.00	0.10
360	002534	西子洁能	1,200	20,124.00	0.10
361	600123	兰花科创	3,400	20,094.00	0.10
362	300258	精锻科技	1,400	20,048.00	0.10
363	600395	盘江股份	4,300	20,038.00	0.10
364	600649	城投控股	4,500	20,025.00	0.10
365	002225	濮耐股份	3,500	19,950.00	0.10
366	300043	星辉娱乐	3,500	19,775.00	0.10

367	603328	依顿电子	1,800	19,728.00	0.10
368	300835	龙磁科技	300	19,674.00	0.10
369	605599	菜百股份	1,200	19,644.00	0.10
370	002733	雄韬股份	1,000	19,630.00	0.10
371	001337	四川黄金	700	19,502.00	0.10
372	002081	金螳螂	5,700	19,494.00	0.10
373	300494	盛天网络	1,600	19,488.00	0.10
374	688190	云路股份	200	19,480.00	0.10
375	603508	思维列控	700	19,474.00	0.10
376	002707	众信旅游	2,700	19,413.00	0.10
377	002840	华统股份	2,000	19,240.00	0.10
378	002664	信质集团	800	19,168.00	0.10
379	300696	爱乐达	600	19,146.00	0.10
380	300671	富满微	600	19,134.00	0.10
381	300192	科德教育	900	19,017.00	0.10
382	300256	星星科技	4,700	18,941.00	0.10
383	603477	巨星农牧	1,100	18,931.00	0.10
384	600108	亚盛集团	6,000	18,900.00	0.10
385	002421	达实智能	6,600	18,810.00	0.10
386	600643	爱建集团	3,400	18,802.00	0.10
387	601900	南方传媒	1,400	18,774.00	0.10
388	002029	七匹狼	1,700	18,751.00	0.10
389	002206	海利得	3,200	18,720.00	0.10
390	000848	承德露露	2,200	18,700.00	0.10
390	002997	瑞鹄模具	500	18,700.00	0.10
391	000560	我爱我家	6,400	18,688.00	0.10
392	002925	盈趣科技	1,100	18,634.00	0.10
393	300174	元力股份	1,200	18,600.00	0.10
394	002708	光洋股份	1,400	18,592.00	0.10
395	688378	奥来德	675	18,427.50	0.09
396	002697	红旗连锁	3,100	18,414.00	0.09
396	600477	杭萧钢构	6,200	18,414.00	0.09
397	603915	国茂股份	1,000	18,410.00	0.09
398	002540	亚太科技	2,600	18,408.00	0.09
399	688609	九联科技	1,800	18,378.00	0.09
400	600557	康缘药业	1,300	18,343.00	0.09
401	603128	华贸物流	3,000	18,300.00	0.09
402	688381	帝奥微	800	18,248.00	0.09
403	300815	玉禾田	800	18,224.00	0.09
404	300179	四方达	1,200	18,144.00	0.09
405	002026	山东威达	1,200	18,060.00	0.09
406	600313	农发种业	2,800	18,032.00	0.09
406	688739	成大生物	700	18,032.00	0.09

407	002635	安洁科技	1,300	18,018.00	0.09
408	002803	吉宏股份	1,100	17,996.00	0.09
409	000948	南天信息	1,000	17,950.00	0.09
410	300793	佳禾智能	1,100	17,941.00	0.09
411	600664	哈药股份	5,200	17,940.00	0.09
412	600237	铜峰电子	2,000	17,920.00	0.09
413	300463	迈克生物	1,600	17,904.00	0.09
414	002483	润邦股份	2,500	17,850.00	0.09
414	300120	经纬辉开	2,100	17,850.00	0.09
415	002449	国星光电	2,100	17,766.00	0.09
416	000090	天健集团	4,800	17,760.00	0.09
417	300310	宜通世纪	3,000	17,730.00	0.09
418	002038	双鹭药业	2,400	17,688.00	0.09
419	000521	长虹美菱	2,700	17,685.00	0.09
420	600740	山西焦化	4,700	17,672.00	0.09
421	000048	京基智农	1,000	17,600.00	0.09
422	002469	三维化学	2,100	17,535.00	0.09
423	688222	成都先导	747	17,517.15	0.09
424	300261	雅本化学	2,600	17,498.00	0.09
425	000652	泰达股份	4,200	17,472.00	0.09
426	300161	华中数控	600	17,424.00	0.09
427	002957	科瑞技术	800	17,320.00	0.09
428	603033	三维股份	1,600	17,296.00	0.09
429	002452	长高电新	2,100	17,283.00	0.09
430	688176	亚虹医药	1,500	17,265.00	0.09
431	300369	绿盟科技	2,300	17,204.00	0.09
432	300349	金卡智能	1,100	17,193.00	0.09
433	605488	福莱新材	500	17,175.00	0.09
434	301367	瑞迈特	200	17,142.00	0.09
435	000957	中通客车	1,500	17,130.00	0.09
436	688653	康希通信	1,400	17,010.00	0.09
437	000913	钱江摩托	1,100	16,962.00	0.09
438	688586	江航装备	1,300	16,952.00	0.09
439	688299	长阳科技	1,000	16,920.00	0.09
440	601860	紫金银行	6,100	16,836.00	0.09
441	300579	数字认证	500	16,805.00	0.09
442	002562	兄弟科技	2,600	16,796.00	0.09
443	002035	华帝股份	2,700	16,740.00	0.09
444	300271	华宇软件	2,300	16,698.00	0.09
445	688788	科思科技	247	16,632.98	0.09
446	600251	冠农股份	1,800	16,614.00	0.09
447	603383	顶点软件	460	16,610.60	0.09
448	600812	华北制药	3,000	16,590.00	0.09

449	688416	恒烁股份	300	16,539.00	0.08
450	600861	北京人力	900	16,506.00	0.08
451	002489	浙江永强	4,300	16,469.00	0.08
452	601101	昊华能源	2,300	16,468.00	0.08
453	300825	阿尔特	1,700	16,456.00	0.08
454	300121	阳谷华泰	1,300	16,406.00	0.08
455	300926	博俊科技	500	16,390.00	0.08
456	002522	浙江众成	2,900	16,356.00	0.08
457	002612	朗姿股份	800	16,352.00	0.08
458	300586	美联新材	1,500	16,335.00	0.08
459	002132	恒星科技	4,600	16,330.00	0.08
460	688107	安路科技	600	16,308.00	0.08
461	000819	岳阳兴长	1,000	16,230.00	0.08
462	000541	佛山照明	2,700	16,227.00	0.08
463	601579	会稽山	800	16,216.00	0.08
464	002376	新北洋	2,100	16,212.00	0.08
465	688219	会通股份	1,300	16,146.00	0.08
466	301196	唯科科技	200	16,114.00	0.08
467	002919	名臣健康	700	16,093.00	0.08
467	300249	依米康	1,100	16,093.00	0.08
468	002150	正泰电源	800	16,080.00	0.08
469	603078	江化微	900	16,065.00	0.08
470	002218	拓日新能	3,700	16,058.00	0.08
471	002148	北纬科技	1,800	16,020.00	0.08
472	002101	广东鸿图	1,300	16,016.00	0.08
473	600742	富维股份	1,600	16,000.00	0.08
474	300057	万顺新材	2,800	15,932.00	0.08
475	603355	莱克电气	500	15,865.00	0.08
476	300320	海达股份	1,700	15,861.00	0.08
477	301000	肇民科技	400	15,748.00	0.08
478	600367	红星发展	900	15,723.00	0.08
479	003009	中天火箭	200	15,708.00	0.08
480	300158	振东制药	2,700	15,687.00	0.08
481	002296	辉煌科技	1,400	15,680.00	0.08
482	300490	华自科技	1,300	15,587.00	0.08
483	301566	达利凯普	800	15,544.00	0.08
484	603507	振江股份	590	15,522.90	0.08
485	301613	新铝时代	300	15,510.00	0.08
486	300194	福安药业	3,500	15,505.00	0.08
487	300843	胜蓝股份	300	15,468.00	0.08
488	600694	大商股份	861	15,437.73	0.08
489	002727	一心堂	1,200	15,432.00	0.08
489	605168	三人行	400	15,432.00	0.08

490	300042	朗科科技	600	15,420.00	0.08
491	300430	诚益通	800	15,376.00	0.08
492	688432	有研硅	1,239	15,375.99	0.08
493	003006	百亚股份	700	15,288.00	0.08
494	301517	陕西华达	220	15,285.60	0.08
495	600318	新力金融	1,700	15,266.00	0.08
496	300662	科锐国际	600	15,198.00	0.08
497	002651	利君股份	1,300	15,197.00	0.08
498	001376	百通能源	900	15,156.00	0.08
499	300332	天壕能源	2,900	15,138.00	0.08
500	002955	鸿合科技	500	15,135.00	0.08
501	300863	卡倍亿	300	15,120.00	0.08
502	002556	辉隆股份	2,500	15,100.00	0.08
503	300480	光力科技	900	15,039.00	0.08
504	002154	报喜鸟	3,900	15,015.00	0.08
505	301246	宏源药业	600	15,000.00	0.08
506	688603	天承科技	200	14,992.00	0.08
507	300705	九典制药	1,000	14,980.00	0.08
508	300299	富春股份	2,100	14,910.00	0.08
509	300492	华图山鼎	200	14,860.00	0.08
510	002627	三峡旅游	2,000	14,840.00	0.08
511	300183	东软载波	1,000	14,830.00	0.08
512	600012	皖通高速	1,000	14,820.00	0.08
512	600880	博瑞传播	3,000	14,820.00	0.08
513	600101	明星电力	1,600	14,800.00	0.08
514	300293	蓝英装备	700	14,784.00	0.08
514	600127	金健米业	2,200	14,784.00	0.08
515	688182	灿勤科技	500	14,760.00	0.08
516	000026	飞亚达	900	14,742.00	0.08
517	002833	弘亚数控	900	14,733.00	0.08
518	002111	威海广泰	1,400	14,728.00	0.08
519	002988	豪美新材	400	14,720.00	0.08
519	600223	福瑞达	2,000	14,720.00	0.08
520	300739	明阳电路	800	14,704.00	0.08
521	600929	雪天盐业	2,600	14,690.00	0.08
522	603229	奥翔药业	1,480	14,681.60	0.08
523	603611	诺力股份	600	14,670.00	0.08
524	603203	快克智能	400	14,644.00	0.08
525	300603	立昂技术	1,500	14,580.00	0.07
526	002367	康力电梯	1,800	14,508.00	0.07
526	688512	慧智微	1,300	14,508.00	0.07
527	300386	飞天诚信	800	14,448.00	0.07
528	300589	江龙船艇	800	14,440.00	0.07

529	300531	优博讯	800	14,432.00	0.07
530	300909	汇创达	300	14,430.00	0.07
531	300351	永贵电器	800	14,424.00	0.07
532	002166	莱茵生物	1,700	14,365.00	0.07
533	002783	凯龙股份	1,500	14,355.00	0.07
534	600971	恒源煤电	2,300	14,352.00	0.07
535	300840	酷特智能	700	14,315.00	0.07
536	300940	南极光	500	14,230.00	0.07
537	300702	天宇股份	600	14,160.00	0.07
538	300792	壹网壹创	500	14,155.00	0.07
539	600508	上海能源	1,200	14,124.00	0.07
540	601226	华电科工	1,800	14,112.00	0.07
541	000507	珠海港	2,700	14,067.00	0.07
542	600662	外服控股	2,800	14,056.00	0.07
543	603061	金海通	100	14,040.00	0.07
544	000828	东莞控股	1,300	13,988.00	0.07
545	300267	尔康制药	4,100	13,981.00	0.07
546	000025	特力A	800	13,968.00	0.07
547	000523	红棉股份	3,700	13,949.00	0.07
548	300411	金盾股份	1,200	13,908.00	0.07
549	603112	华翔股份	800	13,896.00	0.07
550	600894	广日股份	1,500	13,875.00	0.07
551	300471	厚普股份	1,100	13,860.00	0.07
552	300286	安科瑞	600	13,848.00	0.07
553	600197	伊力特	1,000	13,840.00	0.07
554	002301	齐心集团	1,800	13,824.00	0.07
555	600987	航民股份	2,000	13,780.00	0.07
556	300011	鼎汉技术	1,600	13,728.00	0.07
556	300862	蓝盾光电	600	13,728.00	0.07
557	688399	硕世生物	200	13,700.00	0.07
558	002632	道明光学	1,100	13,695.00	0.07
559	002757	南兴股份	700	13,629.00	0.07
560	002274	华昌化工	2,400	13,560.00	0.07
561	300440	运达科技	1,100	13,541.00	0.07
562	002160	常铝股份	2,600	13,520.00	0.07
562	002587	奥拓电子	2,000	13,520.00	0.07
563	600433	冠豪高新	4,100	13,448.00	0.07
564	600976	健民集团	400	13,428.00	0.07
565	300193	佳士科技	1,500	13,425.00	0.07
566	600510	黑牡丹	1,600	13,424.00	0.07
567	300265	通光线缆	1,000	13,400.00	0.07
568	603567	珍宝岛	1,500	13,395.00	0.07
569	300210	森远股份	1,500	13,335.00	0.07

570	603012	创力集团	2,200	13,288.00	0.07
571	002481	双塔食品	2,600	13,286.00	0.07
572	002662	峰璟股份	3,300	13,266.00	0.07
573	300895	铜牛信息	300	13,245.00	0.07
574	600020	中原高速	3,100	13,206.00	0.07
575	300737	科顺股份	2,400	13,200.00	0.07
575	605277	新亚电子	600	13,200.00	0.07
576	600962	国投中鲁	600	13,158.00	0.07
577	003012	东鹏控股	2,000	13,100.00	0.07
578	002758	浙农股份	1,300	13,091.00	0.07
579	603966	法兰泰克	1,100	13,090.00	0.07
580	300341	麦克奥迪	800	13,072.00	0.07
581	688590	新致软件	700	13,062.00	0.07
582	601886	江河集团	1,600	13,056.00	0.07
583	002946	新乳业	700	12,971.00	0.07
584	600368	五洲交通	3,300	12,936.00	0.07
585	688389	普门科技	996	12,928.08	0.07
586	002398	垒知集团	2,300	12,926.00	0.07
587	000812	陕西金叶	2,700	12,906.00	0.07
588	300905	宝丽迪	400	12,892.00	0.07
589	002390	信邦制药	4,000	12,880.00	0.07
590	600794	保税科技	3,300	12,870.00	0.07
591	300241	瑞丰光电	2,300	12,857.00	0.07
592	002823	凯中精密	800	12,848.00	0.07
593	300206	理邦仪器	1,000	12,790.00	0.07
594	001288	运机集团	400	12,780.00	0.07
595	300582	英飞特	800	12,776.00	0.07
596	002791	坚朗五金	600	12,726.00	0.07
597	001236	弘业期货	1,200	12,720.00	0.07
597	002034	旺能环境	800	12,720.00	0.07
598	301061	匠心家居	134	12,703.20	0.07
599	002860	星帅尔	900	12,690.00	0.07
600	002845	同兴达	900	12,663.00	0.06
601	688238	和元生物	1,900	12,654.00	0.06
602	000576	甘化科工	1,200	12,636.00	0.06
603	000713	国投丰乐	1,900	12,578.00	0.06
604	600523	贵航股份	800	12,568.00	0.06
605	600640	国脉文化	1,000	12,560.00	0.06
606	002328	新朋股份	1,900	12,559.00	0.06
607	603299	苏盐井神	1,200	12,504.00	0.06
608	603566	普莱柯	1,000	12,430.00	0.06
609	300969	恒帅股份	100	12,370.00	0.06
610	300578	会畅科技	600	12,360.00	0.06

610	600449	宁夏建材	1,000	12,360.00	0.06
611	002344	海宁皮城	2,600	12,324.00	0.06
612	002637	赞宇科技	1,200	12,300.00	0.06
612	600520	三佳科技	500	12,300.00	0.06
613	300542	新晨科技	600	12,294.00	0.06
614	300545	联得装备	400	12,276.00	0.06
615	301592	六九一二	100	12,220.00	0.06
616	688073	毕得医药	200	12,210.00	0.06
617	002454	松芝股份	1,400	12,194.00	0.06
618	600604	市北高新	2,200	12,188.00	0.06
619	000531	穗恒运A	1,900	12,179.00	0.06
620	002746	仙坛股份	2,000	12,140.00	0.06
621	300288	朗玛信息	900	12,114.00	0.06
621	301348	蓝箭电子	600	12,114.00	0.06
622	603866	桃李面包	2,300	12,098.00	0.06
623	300245	天玑科技	1,000	12,090.00	0.06
624	300691	联合光电	700	12,089.00	0.06
625	600626	申达股份	2,500	12,075.00	0.06
625	600997	开滦股份	2,100	12,075.00	0.06
626	301058	中粮科工	1,100	12,056.00	0.06
627	601500	通用股份	2,500	12,050.00	0.06
628	002843	泰嘉股份	600	12,024.00	0.06
629	000597	东北制药	2,300	12,006.00	0.06
630	600605	汇通能源	400	12,000.00	0.06
631	300272	开能健康	1,600	11,968.00	0.06
632	603105	芯能科技	1,300	11,947.00	0.06
633	605333	沪光股份	400	11,932.00	0.06
634	603590	康辰药业	300	11,925.00	0.06
635	300890	翔丰华	400	11,920.00	0.06
636	300968	格林精密	800	11,912.00	0.06
637	000968	蓝焰控股	1,800	11,898.00	0.06
638	002033	丽江股份	1,300	11,895.00	0.06
639	688046	药康生物	773	11,873.28	0.06
640	601801	皖新传媒	1,800	11,844.00	0.06
641	002986	宇新股份	1,100	11,836.00	0.06
642	605077	华康股份	800	11,824.00	0.06
643	688365	光云科技	700	11,809.00	0.06
644	000722	湖南发展	1,000	11,800.00	0.06
645	002870	香山股份	300	11,796.00	0.06
646	600628	新世界	1,500	11,790.00	0.06
647	300406	九强生物	900	11,763.00	0.06
648	301522	上大股份	300	11,751.00	0.06
649	301606	绿联科技	200	11,748.00	0.06

650	600335	国机汽车	1,800	11,718.00	0.06
651	002614	奥佳华	1,600	11,696.00	0.06
652	688697	纽威数控	760	11,688.80	0.06
653	002869	金溢科技	500	11,630.00	0.06
654	300933	中辰股份	1,400	11,606.00	0.06
655	688351	微电生理	500	11,575.00	0.06
656	002053	云南能投	1,000	11,520.00	0.06
657	300479	神思电子	600	11,472.00	0.06
658	300384	三联虹普	700	11,375.00	0.06
659	002606	大连电瓷	1,300	11,362.00	0.06
660	600780	通宝能源	2,000	11,360.00	0.06
661	300559	佳发教育	900	11,349.00	0.06
662	301026	浩通科技	400	11,336.00	0.06
663	600088	中视传媒	700	11,326.00	0.06
664	600218	全柴动力	1,100	11,308.00	0.06
665	002688	金河生物	1,900	11,305.00	0.06
666	300733	西菱动力	600	11,274.00	0.06
667	002140	东华科技	1,000	11,260.00	0.06
668	002956	西麦食品	400	11,248.00	0.06
668	301221	光庭信息	200	11,248.00	0.06
669	600903	贵州燃气	1,700	11,237.00	0.06
670	300370	安控科技	4,300	11,223.00	0.06
671	300830	金现代	1,100	11,198.00	0.06
672	000550	江铃汽车	600	11,160.00	0.06
673	002609	捷顺科技	1,200	11,148.00	0.06
674	300946	恒而达	200	11,144.00	0.06
675	301408	华人健康	600	11,136.00	0.06
676	603098	森特股份	800	11,128.00	0.06
677	601121	宝地矿业	1,500	11,070.00	0.06
677	688133	泰坦科技	500	11,070.00	0.06
678	301099	雅创电子	260	11,065.60	0.06
679	601116	三江购物	800	11,016.00	0.06
680	301596	瑞迪智驱	140	11,006.80	0.06
681	301326	捷邦科技	100	10,916.00	0.06
682	300172	中电环保	2,000	10,900.00	0.06
683	002380	科远智慧	400	10,880.00	0.06
683	300160	秀强股份	2,000	10,880.00	0.06
684	002933	新兴装备	300	10,860.00	0.06
685	000524	岭南控股	900	10,791.00	0.06
686	000993	闽东电力	900	10,782.00	0.06
687	301191	菲菱科思	100	10,752.00	0.06
688	600618	氯碱化工	900	10,692.00	0.05
689	301280	珠城科技	200	10,652.00	0.05

690	600278	东方创业	1,400	10,640.00	0.05
691	000797	中国武夷	2,700	10,611.00	0.05
692	300791	仙乐健康	408	10,550.88	0.05
693	002908	德生科技	1,000	10,530.00	0.05
694	300856	科思股份	780	10,514.40	0.05
695	300869	康泰医学	700	10,500.00	0.05
696	300997	欢乐家	400	10,460.00	0.05
697	301251	威尔高	200	10,456.00	0.05
698	000655	金岭矿业	1,100	10,450.00	0.05
699	002393	力生制药	480	10,420.80	0.05
700	300781	因赛集团	298	10,364.44	0.05
701	600657	信达地产	3,000	10,350.00	0.05
702	000030	富奥股份	1,800	10,332.00	0.05
702	002953	日丰股份	900	10,332.00	0.05
703	301215	中汽股份	1,500	10,275.00	0.05
704	000096	广聚能源	1,000	10,270.00	0.05
705	301261	恒工精密	100	10,258.00	0.05
706	002543	万和电气	1,000	10,210.00	0.05
707	600758	辽宁能源	2,800	10,192.00	0.05
708	600479	千金药业	1,000	10,160.00	0.05
709	301393	昊帆生物	200	10,138.00	0.05
710	300423	昇辉科技	1,200	10,056.00	0.05
711	300266	兴源环境	3,900	10,023.00	0.05
712	002658	雪迪龙	1,100	9,933.00	0.05
713	000862	银星能源	1,700	9,928.00	0.05
713	688232	新点软件	400	9,928.00	0.05
714	601188	龙江交通	2,800	9,912.00	0.05
715	301062	上海艾录	1,200	9,888.00	0.05
716	603013	亚普股份	400	9,868.00	0.05
717	002187	广百股份	1,300	9,841.00	0.05
718	002996	顺博合金	1,300	9,828.00	0.05
718	600279	重庆港	1,800	9,828.00	0.05
719	300592	华凯易佰	900	9,774.00	0.05
720	002824	和胜股份	500	9,700.00	0.05
721	002911	佛燃能源	800	9,696.00	0.05
722	301149	隆华新材	900	9,576.00	0.05
723	300523	辰安科技	400	9,572.00	0.05
724	300729	乐歌股份	700	9,527.00	0.05
725	002646	天佑德酒	1,100	9,515.00	0.05
726	300345	华民股份	1,500	9,405.00	0.05
726	600327	大东方	1,900	9,405.00	0.05
727	605338	巴比食品	300	9,396.00	0.05
728	603439	三力制药	800	9,360.00	0.05

729	301168	通灵股份	200	9,340.00	0.05
730	300404	博济医药	1,000	9,330.00	0.05
731	002478	常宝股份	1,100	9,317.00	0.05
732	301207	华兰疫苗	500	9,315.00	0.05
733	300711	广哈通信	400	9,288.00	0.05
734	003026	中晶科技	300	9,264.00	0.05
735	603258	电魂网络	500	9,255.00	0.05
736	300659	中孚信息	600	9,216.00	0.05
737	605222	起帆电缆	500	9,195.00	0.05
738	600283	钱江水利	1,000	9,150.00	0.05
739	300673	佩蒂股份	500	8,965.00	0.05
740	600551	时代出版	1,100	8,932.00	0.05
741	601083	锦江航运	800	8,928.00	0.05
742	600814	杭州解百	1,100	8,910.00	0.05
743	301628	强达电路	100	8,875.00	0.05
744	002666	德联集团	1,600	8,816.00	0.05
745	300656	民德电子	400	8,808.00	0.05
746	300522	世名科技	700	8,806.00	0.05
747	300873	海晨股份	400	8,788.00	0.05
748	300785	值得买	200	8,764.00	0.04
749	002641	公元股份	2,000	8,640.00	0.04
749	300887	谱尼测试	900	8,640.00	0.04
750	001311	多利科技	268	8,597.44	0.04
751	300847	中船汉光	500	8,570.00	0.04
752	300577	开润股份	400	8,548.00	0.04
753	002918	蒙娜丽莎	600	8,538.00	0.04
754	002990	盛视科技	300	8,493.00	0.04
755	300485	赛升药业	800	8,464.00	0.04
756	002275	桂林三金	600	8,460.00	0.04
757	603058	永吉股份	900	8,433.00	0.04
758	000019	深粮控股	1,200	8,340.00	0.04
759	301004	嘉益股份	160	8,328.00	0.04
760	300215	电科院	1,300	8,268.00	0.04
761	600738	丽尚国潮	1,600	8,256.00	0.04
762	300894	火星人	700	8,253.00	0.04
763	605056	咸亨国际	500	8,250.00	0.04
764	300434	金石亚药	800	8,224.00	0.04
765	603239	浙江仙通	400	8,204.00	0.04
766	300107	建新股份	1,200	8,184.00	0.04
767	003005	竞业达	400	8,156.00	0.04
768	300389	艾比森	500	8,115.00	0.04
768	300962	中金辐照	500	8,115.00	0.04
769	600724	宁波富达	1,400	8,064.00	0.04

770	301179	泽宇智能	500	7,905.00	0.04
771	600620	天宸股份	1,200	7,800.00	0.04
772	300608	思特奇	700	7,749.00	0.04
773	603630	拉芳家化	400	7,744.00	0.04
774	601133	柏诚股份	500	7,700.00	0.04
775	002889	东方嘉盛	500	7,680.00	0.04
776	002615	哈尔斯	1,000	7,670.00	0.04
777	300978	东箭科技	600	7,524.00	0.04
778	300795	米奥会展	550	7,491.00	0.04
779	301311	昆船智能	400	7,488.00	0.04
780	301439	泓淋电力	500	7,455.00	0.04
781	300859	西域旅游	200	7,394.00	0.04
782	301558	三态股份	900	7,335.00	0.04
783	301266	宇邦新材	200	7,270.00	0.04
784	605008	长鸿高科	500	7,135.00	0.04
785	603693	江苏新能	600	7,116.00	0.04
786	300941	创识科技	300	7,083.00	0.04
787	300787	海能实业	600	7,050.00	0.04
788	002016	世荣兆业	1,200	6,936.00	0.04
789	301195	北路智控	200	6,906.00	0.04
790	002983	芯瑞达	300	6,885.00	0.04
791	301048	金鹰重工	600	6,840.00	0.04
792	301509	金凯生科	200	6,756.00	0.03
793	300911	亿田智能	200	6,660.00	0.03
794	301110	青木科技	100	6,618.00	0.03
795	003037	三和管桩	800	6,480.00	0.03
796	300396	迪瑞医疗	500	6,450.00	0.03
797	300822	贝仕达克	400	6,424.00	0.03
798	301383	天键股份	180	6,415.20	0.03
799	300904	威力传动	100	6,261.00	0.03
800	300902	国安达	300	6,249.00	0.03
801	605009	豪悦护理	200	6,180.00	0.03
802	301507	民生健康	400	6,144.00	0.03
803	300833	浩洋股份	150	6,102.00	0.03
804	301333	诺思格	100	5,955.00	0.03
805	301571	国科天成	100	5,768.00	0.03
806	605108	同庆楼	300	5,766.00	0.03
807	002991	甘源食品	100	5,691.00	0.03
808	603997	继峰股份	400	5,560.00	0.03
809	300571	平治信息	200	5,530.00	0.03
810	603588	高能环境	700	5,404.00	0.03
811	605577	龙版传媒	400	5,228.00	0.03
812	301073	君亭酒店	200	5,212.00	0.03

813	003043	华亚智能	100	4,637.00	0.02
814	603169	兰石重装	400	4,264.00	0.02
815	002959	小熊电器	100	4,223.00	0.02
816	301101	明月镜片	100	4,143.00	0.02
817	605286	同力天启	100	4,061.00	0.02
818	300875	捷强装备	100	4,049.00	0.02
819	601619	嘉泽新能	900	3,996.00	0.02
820	000526	学大教育	100	3,922.00	0.02
821	300917	特发服务	100	3,910.00	0.02
822	605198	安德利	100	3,762.00	0.02
823	300881	盛德鑫泰	100	3,386.00	0.02
824	003028	振邦智能	100	2,959.00	0.02
825	301177	迪阿股份	100	2,887.00	0.01
826	603324	盛剑科技	80	1,981.60	0.01
827	603193	润本股份	59	1,429.57	0.01
828	601008	连云港	200	1,064.00	0.01

### 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	300972	万辰集团	200	40,214.00	0.21
2	300062	中能电气	1,100	9,163.00	0.05
3	001215	千味央厨	200	7,700.00	0.04
4	603766	隆鑫通用	300	4,833.00	0.02
5	605098	行动教育	100	4,176.00	0.02
6	601700	风范股份	600	3,396.00	0.02
7	002288	*ST 超华	12,600	0.00	0.00
7	002435	ST 长康	10,700	0.00	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	688088	虹软科技	345,372.61	1.08
2	603083	剑桥科技	266,327.00	0.83
3	688409	富创精密	256,904.52	0.81
4	603039	泛微网络	251,209.00	0.79
5	600446	金证股份	247,806.00	0.78
6	688800	瑞可达	247,635.68	0.78
7	688091	上海谊众	234,988.00	0.74
8	600595	中孚实业	233,256.00	0.73
9	601208	东材科技	230,343.82	0.72
10	603119	浙江荣泰	219,143.70	0.69
11	600728	佳都科技	213,729.00	0.67

12	688313	仕佳光子	203,363.00	0.64
13	600064	南京高科	200,784.00	0.63
14	601137	博威合金	193,014.00	0.60
15	600105	永鼎股份	186,543.00	0.58
16	600158	中体产业	186,404.00	0.58
17	688239	航宇科技	175,544.34	0.55
18	300738	奥飞数据	172,522.00	0.54
19	688327	云从科技	166,865.00	0.52
20	600285	羚锐制药	163,950.00	0.51

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

#### 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	600064	南京高科	583,313.00	1.83
2	688088	虹软科技	557,614.27	1.75
3	688568	中科星图	433,062.57	1.36
4	603039	泛微网络	426,401.00	1.34
5	600363	联创光电	393,506.00	1.23
6	600850	电科数字	334,290.00	1.05
7	601208	东材科技	308,790.00	0.97
8	688800	瑞可达	300,574.15	0.94
9	688409	富创精密	293,507.61	0.92
10	688313	仕佳光子	279,819.81	0.88
11	601137	博威合金	279,011.00	0.87
12	600648	外高桥	277,043.00	0.87
13	600158	中体产业	276,424.00	0.87
14	603119	浙江荣泰	268,653.00	0.84
15	688091	上海谊众	260,076.98	0.82
16	603267	鸿远电子	259,848.00	0.81
17	688110	东芯股份	238,197.29	0.75
18	300475	香农芯创	230,693.00	0.72
19	002839	张家港行	228,133.00	0.71
20	688116	天奈科技	227,263.18	0.71

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

#### 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	42,461,805.41
卖出股票收入（成交）总额	46,527,641.30

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

## 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

## 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

注：本基金本报告期末未持有债券。

## 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

注：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

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

## 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

注：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

本基金本报告期无股指期货投资。

## 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

本基金本报告期无国债期货投资。

### 8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期无国债期货投资。

## 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

根据发布的相关公告，本基金投资的前十名证券的发行主体中，浙江臻镞科技股份有限公司在本报告期内被监管部门立案调查。

本基金投资上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

### 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

基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选库以外的股票。

### 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	4,952.75
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	132,739.68
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	137,692.43

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 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

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中无流通受限的股票。

##### 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

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的股票。

#### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## § 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 (%)
317	48,184.34	10,368,033.00	67.88	4,906,402.00	32.12

### 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	3,259,537.00	21.34
2	华泰证券股份有限公司	1,647,106.00	10.78
3	法巴农银理财有限责任公司—法巴农银理财珐琅金固收增强 180 天最短持有期 1 号	1,338,600.00	8.76
4	中国银河证券股份有限公司	1,028,241.00	6.73
5	丁王云心	1,020,039.00	6.68
6	中信证券股份有限公司	794,918.00	5.20

7	法巴农银理财有限责 任公司—法巴农银理 财珐琅金固收增强 90 天最短持有期 1 号	769,600.00	5.04
8	东方证券股份有限公 司	497,400.00	3.26
9	法巴农银理财有限责 任公司—法巴农银理 财珐琅金固收增强 120 天最短持有期 1 号	426,800.00	2.79
10	劳啟珍	408,720.00	2.68

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

注：无。

### 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 究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

### 9.5 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

注：本基金基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2023 年 8 月 25 日） 基金份额总额	1,113,274,435.00
本报告期期初基金份额总额	33,274,435.00
本报告期基金总申购份额	60,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	78,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	15,274,435.00

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

## 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

管理人：本报告期内，李海波先生新任公司督察长，原督察长陈特正先生转任风控负责人；游自强先生新任公司信息技术负责人，副总经理林婉文女士不再兼任信息技术负责人。公司根据《中华人民共和国公司法》以及中国证监会《关于新〈公司法〉配套制度规则实施相关过渡期安排》等有关法律法规、监管规定完成了监事会改革工作，取消了监事会。

托管人：本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

## 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，无涉及基金财产、基金管理业务的诉讼或仲裁。

本报告期内，无涉及基金托管业务的诉讼。

## 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

## 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未更换会计师事务所，容诚会计师事务所（特殊普通合伙）已为本基金提供审计服务 2 年。报告期内应支付给该事务所的报酬为 5,000.00 元。

## 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

注：本报告期内，基金管理人无受稽查或处罚等情况。

### 11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内，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

注：本报告期内，基金托管人没有受到监管部门调查或处罚。

### 11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内，基金托管人相关从业人员没有受到监管部门调查或处罚。

## 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 (%)	
中信证券	2	68,388,127.58	76.85	12,716.50	76.85	

国投证券	1	20,601,319.13	23.15	3,830.03	23.15	
东吴证券	1	-	-	-	-	
信达证券	1	-	-	-	-	
银河证券	3	-	-	-	-	

注：1、基金交易单元的选择标准如下：

- (1) 财务状况良好
- (2) 经营行为规范
- (3) 合规风控能力较高

2、基金管理人根据上述标准，考察后与确定选用交易单元的券商签订交易单元租用协议。

3、本报告期内本基金租用证券公司交易单元无变更情况。

### 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 (%)
中信证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

### 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	平安基金管理有限公司关于旗下基金新增大同证券有限责任公司为申购赎回代办机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025年01月08日
2	平安基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值调整的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025年01月15日
3	平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年第 4 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2025年01月22日
4	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华鑫证券有限责任公司为申购赎回代办机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025年01月24日
5	平安基金管理有限公司关于旗下基金估值调整情况的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025年02月08日
6	平安基金管理有限公司关于新增东吴	中国证监会规定报刊及	2025年02月13日

	证券股份有限公司为平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金申购赎回代办机构的公告	网站	
7	平安基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 02 月 28 日
8	平安基金管理有限公司关于旗下基金新增东方证券股份有限公司为申购赎回代办机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 03 月 05 日
9	平安基金管理有限公司关于旗下基金新增东莞证券股份有限公司为申购赎回代办机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 03 月 05 日
10	平安基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 03 月 11 日
11	关于平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金场内简称变更的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 03 月 25 日
12	平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 03 月 26 日
13	平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年年度报告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 03 月 28 日
14	平安基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司交易及佣金支付情况	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 03 月 31 日
15	平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 04 月 22 日
16	平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金（更新）基金产品资料概要更新	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 05 月 30 日
17	平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 05 月 30 日
18	平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 06 月 26 日
19	平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 06 月 27 日
20	平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金（更新）基金产品资料概要更新	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 06 月 27 日
21	平安基金管理有限公司关于旗下基金新增光大证券股份有限公司为申购赎回代办机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 06 月 27 日
22	平安基金管理有限公司关于旗下基金新增国海证券股份有限公司为申购赎回代办机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 06 月 27 日
23	平安基金管理有限公司关于提醒投资者及时完善、更新身份信息资料以免影响业务办理的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 06 月 30 日

24	平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第 2 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 07 月 21 日
25	平安基金管理有限公司关于旗下基金新增华宝证券股份有限公司为申购赎回代办机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 07 月 23 日
26	关于“平安基金”APP 业务迁移的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 07 月 26 日
27	平安基金管理有限公司关于召开平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会（通讯方式）的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 08 月 08 日
28	平安基金管理有限公司关于召开平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会（通讯方式）的第一次提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 08 月 11 日
29	平安基金管理有限公司关于召开平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会（通讯方式）的第二次提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 08 月 12 日
30	平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年中期报告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 08 月 29 日
31	关于平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会计票日停牌的提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 09 月 16 日
32	关于平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会会议情况的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 09 月 17 日
33	平安基金管理有限公司关于旗下基金估值调整情况的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 10 月 01 日
34	平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第 3 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 10 月 28 日
35	关于新增东方证券股份有限公司为平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 12 月 09 日
36	平安基金管理有限公司旗下开放式基金转换业务规则说明的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 12 月 27 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	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)

		间区间					
机构	1	2025年03月13日-2025年03月13日; 2025年03月18日-2025年03月18日; 2025年03月20日-2025年03月20日; 2025年03月24日-2025年03月25日; 2025年03月27日-2025年03月27日; 2025年04月15日-2025年04月15日; 2025年04月18日-2025年04月20日; 2025年04月22日-2025年04月22日; 2025年04月24日-2025年04月24日; 2025年05月08日-2025年05月12日; 2025年05月14日-2025年05月14日; 2025年05月21日-2025年05月25日; 2025年05月28日-2025年05月28日; 2025年06月10日-2025年06月15日; 2025年06月17日-2025年	6,010,111.00	92,795,533.00	95,546,107.00	3,259,537.00	21.34

		06月17日； 2025年06月19日-2025年06月22日； 2025年07月31日-2025年07月31日； 2025年09月02日-2025年09月09日； 2025年10月17日-2025年10月19日； 2025年11月07日-2025年11月09日； 2025年11月14日-2025年11月26日； 2025年12月01日-2025年12月17日； 2025年12月19日-2025年12月21日； 2025年12月23日-2025年12月31日					
	2	2025年09月10日-2025年09月10日	3,041,361.00	55,306,813.00	57,953,543.00	394,631.00	2.58
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额 20% 的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产。在特定情况下，若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5,000 万元，基金面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。</p>							

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

平安基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）以通讯方式召开了本基金基金份额持有人大会，权益登记日为 2025 年 8 月 13 日，大会投票表决时间为自：2025 年 8 月 13 日起，

至 2025 年 9 月 15 日 17:00 止（以基金管理人收到表决票的时间为准）。2025 年 9 月 16 日，在本基金基金托管人授权代表的监督下，基金管理人授权的监督员对本次基金份额持有人大会表决进行了计票，上海源泰律师事务所对计票过程进行了见证，深圳市深圳公证处对计票过程及结果进行了公证。根据计票结果，本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所持有的本基金基金份额总数小于在权益登记日本基金基金份额总数的二分之一，未达到法定的基金份额持有人大会召开条件。详细内容请阅读本基金管理人于 2025 年 9 月 17 日发布的《关于平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会会议情况的公告》。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金募集注册的文件
- (2) 平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同
- (3) 平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金托管协议
- (4) 法律意见书
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

### 13.2 存放地点

深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层

### 13.3 查阅方式

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

平安基金管理有限公司

2026 年 03 月 30 日