

# 平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

## 2023 年年度报告

2023 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：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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 03 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告除特别注明外，金额单位均为人民币元。

本报告期自 2023 年 08 月 25 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

§ 1 重要提示及目录 .....	2
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
§ 2 基金简介 .....	5
2.1 基金基本情况 .....	5
2.2 基金产品说明 .....	5
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	5
2.4 信息披露方式 .....	6
2.5 其他相关资料 .....	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 .....	6
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	6
3.2 基金净值表现 .....	7
3.3 其他指标 .....	8
3.4 过去三年基金的利润分配情况 .....	8
§ 4 管理人报告 .....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 .....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	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 .....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	11
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 .....	11
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	12
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 .....	12
§ 5 托管人报告 .....	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 .....	12
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 .....	12
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 .....	12
§ 6 审计报告 .....	13
6.1 审计报告基本信息 .....	13
6.2 审计报告的基本内容 .....	13
§ 7 年度财务报表 .....	15
7.1 资产负债表 .....	15
7.2 利润表 .....	16
7.3 净资产变动表 .....	17
7.4 报表附注 .....	18

<b>§ 8 投资组合报告 .....</b>	<b>44</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	44
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	44
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 .....	46
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	66
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	81
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 .....	81
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 .....	81
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 .....	81
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 .....	81
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	81
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	81
8.12 投资组合报告附注 .....	81
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>82</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	82
9.2 期末上市基金前十名持有人 .....	82
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	83
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 .....	83
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 .....	83
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>83</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>84</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	84
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 .....	84
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	84
11.4 基金投资策略的改变 .....	84
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	84
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 .....	84
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	84
11.8 其他重大事件 .....	86
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>87</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 .....	87
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	87
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>87</b>
13.1 备查文件目录 .....	87
13.2 存放地点 .....	88
13.3 查阅方式 .....	88

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	平安国证 2000ETF
场内简称	2000 指数 ETF
基金主代码	159521
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023 年 8 月 25 日
基金管理人	平安基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	111,274,435.00 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	陈特正	张姗
	联系电话	0755-22626828	400-61-95555
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		400-800-4800	400-61-95555
传真		0755-23997878	0755-83195201
注册地址		深圳市福田区福田街道益田路	深圳市深南大道 7088 号招商银

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

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网 址	<a href="http://www.fund.pingan.com">http://www.fund.pingan.com</a>
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	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 8 月 25 日（基金合同生效日）-2023 年 12 月 31 日
本期已实现收益	1,690,560.60
本期利润	-1,439,945.23
加权平均基金份额本期利润	-0.0050
本期加权平均净值利润率	-0.50%
本期基金份额净值增长率	-2.30%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末
期末可供分配利润	-2,556,047.11
期末可供分配基金份额利润	-0.0230
期末基金资产净值	108,718,387.89
期末基金份额净值	0.9770
3.1.3 累计期末指标	2023 年末
基金份额累计净值增长率	-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。

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

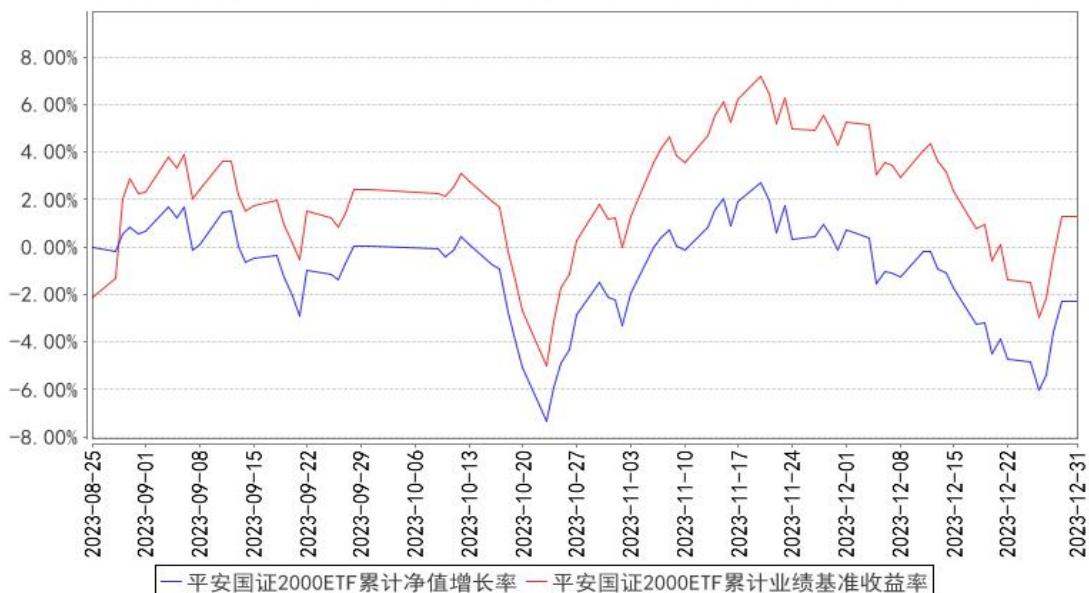
### 3.2 基金净值表现

#### 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	-2.36%	1.01%	-1.11%	1.07%	-1.25%	-0.06%
自基金合同生效起至今	-2.30%	0.95%	1.31%	1.10%	-3.61%	-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

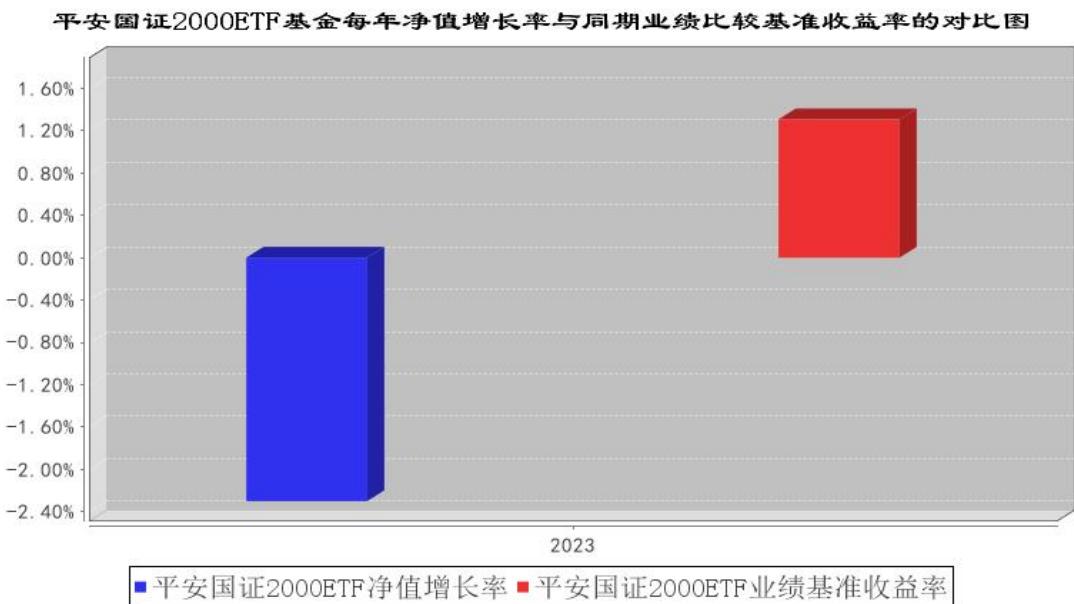
平安国证2000ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

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

### 3.2.3 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



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，平安基金总部位于深圳，注册资本金为13亿元人民币。作为中国平安集团旗下成员，平安基金“以专业承载信赖”，为海内外各类机构和个人投资者提供专业、全面的资产管理服务。依托中国平安集团综合金融优势，平安基金建立了以固收投资、权益投资、指数投资、资产配置、资产证券化、专户六大业务板块（其中资产证券化及非标专户业务通过旗下全资子公司深圳平安汇通投资管理有限公司开展）。截至2023年12月31日，平安基金共管理194只公募基金，公募资产管理总规模约为5668亿元人民币。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理)期限	证券从业年限	说明
----	----	---------------------	--------	----

		任职日期	离任日期		
钱晶	ETF 指数 中心投资 副总监， 平安国证 2000 交易 型开放式 指数证券 投资基金 基金经理	2023 年 8 月 25 日	-	12 年	钱晶先生，美国纽约大学理工学院硕士。曾先后担任国信证券股份有限公司量化分析师、华安基金管理有限公司基金经理。2017 年 10 月加入平安基金管理有限公司，曾任 ETF 指数投资中心投资经理。现任 ETF 指数中心投资副总监，同时担任平安 MSCI 中国 A 股低波动交易型开放式指数证券投资基金、平安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、平安中证医药及医疗器械创新指数组型发起式证券投资基金、平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金、平安中证港股通医药卫生综合交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

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。

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

本基金本报告期内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遵规守信情况的说明

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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、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

本基金于报告期内不存在异常交易行为。

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

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.9770 元，本报告期基金份额净值增长率为 -2.30%，业绩比较基准收益率为 1.31%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2024 年，中国经济仍将延续疫后恢复态势，有望实现 5% 左右的增速，值得我们抱有更高的期待。从经济增长动能看，需要更多关注的是服务业和基建投资，房地产在政策作用下预计将逐步筑底，但恢复力度还要看政策的进一步加码和市场反馈；政策端，2024 年相对于 2023 年政策支持、财政发力上会有更多的空间，近期为了投资环境的改善而进行的监管政策调整对于情绪有了明显的提振；从库存周期上来看，库存大概率已触底，从被动去库存进入到主动补库存对于市场是有很强的提振效果，但周期的顺利切换需要密切关注地产投资和出口反弹态势。

2023 年小盘股相对市场走出了较强的超额收益，但是在 2024 年年初经过了一轮流动性踩踏后小微盘风格出现了较大幅度的回撤。对于后市，在小盘的配置上要逐步提升关注，现在底部筹码的持续释放，盈利筹码的占比以及筹码峰的持续下移，对于后期反弹的压力会有所减小。需要注意的是，即使是小盘股，但是内部结构上还是有较为明显的差异，市值最小的一批股票在指数波动率上给出了更高的贡献。由于本产品为抽样复制，对于抽样股票的选取上更加注意指数整体成分股内部的波动差异，在控制跟踪误差的基础上力争获取超额收益。

作为基金管理人，我们将继续坚持紧密跟踪标的指数表现的投资目标，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

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

#### 4.8 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

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

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：

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

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

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

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

本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	普华永道中天审字(2024)第 20761 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>(一) 我们审计的内容 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”)的财务报表, 包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表, 2023 年 8 月 25 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) 我们的意見 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 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年 8 月 25 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, 我们独立于平安国证 2000ETF 基金, 并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	不适用
其他事项	不适用
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	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>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> <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。</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，就可能导致对平安国证 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>(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	曹翠丽 李崇
会计师事务所的地址	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
审计报告日期	2024 年 3 月 25 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：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	4, 536, 025. 31
结算备付金		272, 008. 18
存出保证金		293, 925. 36
交易性金融资产	7. 4. 7. 2	103, 892, 268. 79
其中：股票投资		103, 892, 268. 79
基金投资		—
债券投资		—
资产支持证券投资		—
贵金属投资		—
其他投资		—
衍生金融资产	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		219, 302. 78
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		109, 213, 530. 42
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日
<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		46,713.73
应付托管费		9,342.75
应付销售服务费		-
应付投资顾问费		-
应交税费		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.9	439,086.05
负债合计		495,142.53
<b>净资产:</b>		
实收基金	7.4.7.10	111,274,435.00
未分配利润	7.4.7.12	-2,556,047.11
净资产合计		108,718,387.89
负债和净资产总计		109,213,530.42

- 注：1. 报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.9770 元，基金份额总额 111,274,435.00 份。
2. 本财务报表的实际编制期间为的实际编制期间为 2023 年 8 月 25 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日。

## 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

本报告期：2023 年 8 月 25 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 8 月 25 日(基金合同 生效日)至 2023 年 12 月 31 日
<b>一、营业收入</b>		-703,324.28
1. 利息收入		208,555.03
其中：存款利息收入	7.4.7.13	119,689.20
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		88,865.83
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,232,164.77
其中：股票投资收益	7.4.7.14	1,111,754.28
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.15	-
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	120,410.49
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	-3,130,505.83
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	986,461.75
<b>减：二、营业总支出</b>		736,620.95
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	486,994.20
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	7.4.10.2.2	97,398.86
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	152,227.89
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-1,439,945.23
<b>减：所得税费用</b>		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-1,439,945.23
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-
<b>六、综合收益总额</b>		-1,439,945.23

### 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：2023 年 8 月 25 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 8 月 25 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	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,113,274,435.00	-	-	1,113,274,435.00
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-1,002,000,000.00	-	-2,556,047.11	-1,004,556,047.11
(一)、综合收益总额	-	-	-1,439,945.23	-1,439,945.23
(二)、本期基金份额交易产生的	-1,002,000,000	-	-1,116,101.88	-1,003,116,101.88

净资产变动数 (净资产减少以 “-”号填列)	.00			8
其中：1. 基金申 购款	69,000,000.00	-	-553,097.98	68,446,902.02
2. 基金赎 回款	-1,071,000,000 .00	-	-563,003.90	-1,071,563,003.9 0
(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	111,274,435.00	-	-2,556,047.11	108,718,387.89

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。

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管理合同》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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金管理合同》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。

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

本基金 2023 年 8 月 25 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日止期间的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 8 月 25 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 8 月 25 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、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业务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业务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认列。

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额。

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 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

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。

根据中国证监会于 2024 年颁布的修订后的《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>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

### 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

本基金在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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴

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

(4) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

#### 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		4,536,025.31
等于：本金		4,535,571.44
加：应计利息		453.87
减：坏账准备		-
定期存款		-
等于：本金		-
加：应计利息		-
减：坏账准备		-
其中：存款期限 1 个月以内		-
存款期限 1-3 个月		-
存款期限 3 个月以上		-
其他存款		-
等于：本金		-
加：应计利息		-
减：坏账准备		-
合计		4,536,025.31

##### 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	107,022,774.62	-	103,892,268.79	-3,130,505.83
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	107,022,774.62	-	103,892,268.79	-3,130,505.83

注：于 2023 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 0 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

注：本基金本报告期末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：本基金本报告期末无其他权益工具投资。

### 7.4.7.8 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

### 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	151,503.21
其中：交易所市场	151,503.21
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	86,356.16
应退退补款	125,961.50
可退替代款	592.00
现金差额	74,673.18
合计	439,086.05

注：1. 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。

2. 可退替代款指投资者采用可以现金替代方式申购(赎回)本基金时，替代价格与该替代证券市价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 2023年8月25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	1,113,274,435.00	1,113,274,435.00
本期申购	69,000,000.00	69,000,000.00
本期赎回(以“-”号填列)	-1,071,000,000.00	-1,071,000,000.00
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	111,274,435.00	111,274,435.00

注：1. 本基金自 2023 年 8 月 16 日至 2022 年 8 月 22 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币 1,113,220,000.00 元，折合为 1,113,220,000.00 份基金份额。根据《平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币 54,435.00 元在本基金成立后，折合为 54,435.00 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

2. 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
基金合同生效日	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	1,690,560.60	-3,130,505.83	-1,439,945.23
本期基金份额交易产生的变动数	-414,340.60	-701,761.28	-1,116,101.88
其中：基金申购款	19,782.52	-572,880.50	-553,097.98
基金赎回款	-434,123.12	-128,880.78	-563,003.90
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,276,220.00	-3,832,267.11	-2,556,047.11

#### 7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 8 月 25 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	78,923.43
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	36,755.87

其他	4,009.90
合计	119,689.20

#### 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8月25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	-417,184.30
股票投资收益——赎回差价收入	1,528,938.58
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	1,111,754.28

##### 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8月25日（基金合同生效日）至2023年12 月31日
卖出股票成交总额	559,862,087.77
减：卖出股票成本总额	558,565,067.94
减：交易费用	1,714,204.13
买卖股票差价收入	-417,184.30

##### 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8月25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	1,071,563,003.90
减：现金支付赎回款总额	464,945,139.90
减：赎回股票成本总额	605,088,925.42
减：交易费用	-
赎回差价收入	1,528,938.58

##### 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：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 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

注：本基金本报告期内无贵金属投资。

#### 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
	2023年8月25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	120,410.49
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	120,410.49

### 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8月25日（基金合同生效日）至2023年12月31日
1. 交易性金融资产	-3,130,505.83
股票投资	-3,130,505.83
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	-3,130,505.83

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。

### 7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年8月25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	986,461.75
合计	986,461.75

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 2023年8月25日(基金合同生效日)至2023年 12月31日
审计费用	30,000.00
信息披露费	50,000.00
证券出借违约金	-
银行费用	3,371.73
其他	68,856.16
合计	152,227.89

#### 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
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 2023年8月25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	486,994.20
其中：应支付销售机构的客户维护费	11,145.86
应支付基金管理人的净管理费	475,848.34

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 2023年8月25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	97,398.86

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

关联方名称	本期末 2023年12月31日		份额单位：份
	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	7,273,731.00	6.5367	

#### 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8月25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
招商银行-活期	4,536,025.31	78,923.43

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

本基金本报告期内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（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
001239	永达股份	2023年12月4日	6个月	新股锁定	12.05	19.92	108	1,301.40	2,151.36	-
001306	夏厦精密	2023年11月9日	6个月	新股锁定	53.63	75.36	28	1,501.64	2,110.08	-
001326	联域股份	2023年11月1日	6个月	新股锁定	41.18	48.64	57	2,347.26	2,772.48	-
001358	兴欣新材	2023年12月14日	6个月	新股锁定	41.00	44.16	34	1,394.00	1,501.44	-
301413	安培龙	2023年12月11日	6个月	新股锁定	33.25	58.19	92	3,059.00	5,353.48	-
301489	思泉新材	2023年10月16日	6个月	新股锁定	41.66	64.11	95	3,957.70	6,090.45	-
301508	中机认检	2023年11月23日	6个月	新股锁定	16.82	26.68	182	3,061.24	4,855.76	-
301516	中远通	2023年12月1日	6个月	新股锁定	6.87	15.51	371	2,548.77	5,754.21	-
301517	陕西华达	2023年10月9日	6个月	新股锁定	26.87	43.69	166	4,460.42	7,252.54	-
301526	国际复材	2023年12月19日	6个月	新股锁定	2.66	4.45	1,981	5,269.46	8,815.45	-
301555	惠柏新材	2023年10月24日	6个月	新股锁定	22.88	32.44	176	4,026.88	5,709.44	-
603062	麦加芯彩	2023年10月31日	6个月	新股锁定	58.08	57.81	301	1,742.40	1,734.30	-
603107	上海汽配	2023年10月25日	6个月	新股锁定	14.23	18.19	1021	1,451.46	1,855.38	-
603193	润本股	2023年	6个月	新股锁定	17.38	16.66	1592	2,763.42	2,648.94	-

	份	10月9日								
603273	天元智能	2023年10月16日	6个月	新股锁定	9.50	18.97	151	1,434.50	2,864.47	-
688652	京仪装备	2023年11月22日	6个月	新股锁定	31.95	52.25	105	3,354.75	5,486.25	-
688653	康希通信	2023年11月10日	6个月	新股锁定	10.50	15.99	357	3,748.50	5,708.43	-

注：1、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股中需要限售的部分或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

2、基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

3、基金作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

4、基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后 6 个月内不得转让。

#### 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01月10日	9.33	22,500	211,201.61	190,800.00	-

注：本基金截至 2023 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、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公司发行的证券，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。

### 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。

本基金管理人通过由风险管理人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，并按照合约规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年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	4,536,025.31	-	-	-	4,536,025.31
结算备付金	272,008.18	-	-	-	272,008.18
存出保证金	293,925.36	-	-	-	293,925.36
交易性金融资产	-	-	-	103,892,268.79	103,892,268.79
应收清算款	-	-	-	219,302.78	219,302.78
资产总计	5,101,958.85	-	-	104,111,571.57	109,213,530.42
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	46,713.73	46,713.73
应付托管费	-	-	-	9,342.75	9,342.75
其他负债	-	-	-	439,086.05	439,086.05
负债总计	-	-	-	495,142.53	495,142.53
利率敏感度缺口	5,101,958.85	-	-	103,616,429.04	108,718,387.89

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合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，本基金未持有交易性债券投资和交易性资产支持证券投资，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，所面临的最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 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	103,892,268.79	95.56
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
其他	-	-
合计	103,892,268.79	95.56

##### 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	
	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）		
分析	沪深 300 指数上升 5%	4,700,047.22

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

#### 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 2023年12月31日
第一层次	103,628,804.33
第二层次	190,800.00
第三层次	72,664.46
合计	103,892,268.79

##### 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 2023 年 8 月 25 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	0.00	0.00	0.00
当期购买	0.00	47,422.80	47,422.80
当期出售/结算	0.00	0.00	0.00
转入第三层次	0.00	0.00	0.00
转出第三层次	0.00	0.00	0.00
当期利得或损失总额	0.00	25,241.66	25,241.66
其中：计入损益的利得或损失	0.00	25,241.66	25,241.66
计入其他综合收益的利得或损失	0.00	0.00	0.00
期末余额	0.00	72,664.46	72,664.46
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	0.00	25,241.66	25,241.66

注：于 2023 年 12 月 31 日，本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。于 2023 年度，本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资。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

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
流通受限股票	72,664.46	平均价格 亚式期权 模型	预期年化波动率	51.41%-219.88%	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

于 2023 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。

#### 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 2023 年 8 月 25 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日止期间，本基金申购基金份额的对价总额为 68, 446, 902. 02 元，其中包括以股票支付的申购款 37, 218, 349. 00 元和以现金支付的申购款 31, 228, 553. 02 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	103, 892, 268. 79	95. 13
	其中：股票	103, 892, 268. 79	95. 13
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	4, 808, 033. 49	4. 40
8	其他各项资产	513, 228. 14	0. 47
9	合计	109, 213, 530. 42	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	522, 754. 00	0. 48
B	采矿业	2, 018, 047. 40	1. 86
C	制造业	72, 440, 602. 61	66. 63
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2, 172, 957. 00	2. 00
E	建筑业	1, 929, 554. 00	1. 77
F	批发和零售业	2, 875, 312. 80	2. 64
G	交通运输、仓储和邮政业	1, 907, 751. 00	1. 75
H	住宿和餐饮业	88, 276. 00	0. 08

I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,268,674.00	9.45
J	金融业	1,414,564.00	1.30
K	房地产业	1,659,922.00	1.53
L	租赁和商务服务业	1,450,771.00	1.33
M	科学研究和技术服务业	1,578,983.00	1.45
N	水利、环境和公共设施管理业	1,440,545.00	1.33
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	55,151.00	0.05
Q	卫生和社会工作	294,255.00	0.27
R	文化、体育和娱乐业	1,269,541.00	1.17
S	综合	360,016.00	0.33
	合计	103,747,676.81	95.43

### 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	139,736.22	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	-	-
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	4,855.76	0.00
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	144,591.98		0.13

### 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	688235	百济神州	3,500	486,640.00	0.45
2	300573	兴齐眼药	2,529	461,087.28	0.42
3	600363	联创光电	12,600	428,400.00	0.39
4	688213	思特威	7,600	422,256.00	0.39
5	603979	金诚信	11,000	415,360.00	0.38
6	300456	赛微电子	16,500	396,660.00	0.36
7	002318	久立特材	19,800	393,624.00	0.36
8	688019	安集科技	2,444	390,453.44	0.36
9	600771	广誉远	14,300	385,957.00	0.36
10	688333	铂力特	3,300	382,470.00	0.35
11	002675	东诚药业	20,700	379,431.00	0.35
12	300679	电连技术	8,800	365,200.00	0.34
13	688556	高测股份	9,300	362,607.00	0.33
14	002832	比音勒芬	10,700	339,190.00	0.31
15	600728	佳都科技	58,000	331,760.00	0.31
16	600422	昆药集团	15,600	325,416.00	0.30
17	300627	华测导航	10,300	319,506.00	0.29
18	300762	上海瀚讯	21,176	319,334.08	0.29
19	002851	麦格米特	12,600	309,960.00	0.29
20	600199	金种子酒	16,700	309,284.00	0.28
21	600123	兰花科创	27,500	303,600.00	0.28
22	688029	南微医学	3,100	300,080.00	0.28
23	600821	金开新能	48,100	294,372.00	0.27
24	603197	保隆科技	5,200	293,280.00	0.27
25	300083	创世纪	45,600	288,648.00	0.27
26	600850	电科数字	13,200	287,100.00	0.26
27	300168	万达信息	33,800	286,624.00	0.26
28	600761	安徽合力	15,700	285,897.00	0.26
29	603588	高能环境	43,700	285,798.00	0.26
30	002424	贵州百灵	35,200	285,472.00	0.26
31	600595	中孚实业	81,100	282,228.00	0.26

32	002698	博实股份	18,500	281,015.00	0.26
33	603063	禾望电气	11,205	280,125.00	0.26
34	300674	宇信科技	17,200	280,016.00	0.26
35	601208	东材科技	22,500	278,550.00	0.26
36	002063	远光软件	45,000	278,100.00	0.26
37	300638	广和通	14,600	277,838.00	0.26
38	300393	中来股份	26,600	275,044.00	0.25
39	002130	沃尔核材	36,300	274,065.00	0.25
40	603599	广信股份	18,900	274,050.00	0.25
41	600452	涪陵电力	20,720	273,504.00	0.25
42	600933	爱柯迪	12,400	272,056.00	0.25
43	000810	创维数字	17,200	270,212.00	0.25
44	688007	光峰科技	10,400	269,152.00	0.25
45	600908	无锡银行	52,400	264,620.00	0.24
46	603505	金石资源	9,636	261,617.40	0.24
47	002807	江阴银行	73,100	259,505.00	0.24
48	603997	继峰股份	19,200	258,624.00	0.24
49	002544	普天科技	12,700	258,064.00	0.24
50	300451	创业慧康	39,100	256,105.00	0.24
51	601678	滨化股份	60,800	255,968.00	0.24
52	688798	艾为电子	3,687	254,513.61	0.23
53	300166	东方国信	27,000	253,800.00	0.23
54	600645	中源协和	12,500	253,375.00	0.23
55	002326	永太科技	21,700	252,154.00	0.23
56	300130	新国都	10,200	246,840.00	0.23
57	688033	天宜上佳	14,600	246,740.00	0.23
58	002276	万马股份	24,000	245,280.00	0.23
59	301050	雷电微力	4,200	244,692.00	0.23
60	603279	景津装备	11,000	243,210.00	0.22
61	600446	金证股份	21,000	242,970.00	0.22
62	600206	有研新材	19,600	242,844.00	0.22
63	688409	富创精密	3,100	242,761.00	0.22
64	002099	海翔药业	33,700	242,303.00	0.22
65	688278	特宝生物	4,600	240,810.00	0.22
66	002079	苏州固锝	21,300	240,264.00	0.22
67	603690	至纯科技	9,300	239,010.00	0.22
68	688083	中望软件	2,400	238,896.00	0.22
69	002011	盾安环境	17,200	236,500.00	0.22
70	000422	湖北宜化	22,200	232,212.00	0.21
71	301095	广立微	3,100	231,663.00	0.21
72	688388	嘉元科技	11,400	231,192.00	0.21
73	688568	中科星图	4,700	230,582.00	0.21
74	300185	通裕重工	95,900	230,160.00	0.21

75	600055	万东医疗	13,400	228,872.00	0.21
76	688208	道通科技	9,600	228,000.00	0.21
77	600602	云赛智联	19,700	227,929.00	0.21
78	688366	昊海生科	2,100	227,409.00	0.21
79	601126	四方股份	16,000	226,560.00	0.21
80	600064	南京高科	37,500	226,500.00	0.21
81	300327	中颖电子	9,800	223,440.00	0.21
82	300323	华灿光电	30,400	222,528.00	0.20
83	600216	浙江医药	20,700	222,111.00	0.20
84	300077	国民技术	19,400	219,026.00	0.20
85	300463	迈克生物	14,500	218,515.00	0.20
86	002127	南极电商	56,100	218,229.00	0.20
87	300079	数码视讯	38,300	217,927.00	0.20
88	603308	应流股份	15,200	217,816.00	0.20
89	300685	艾德生物	9,900	217,602.00	0.20
90	002761	浙江建投	21,200	217,512.00	0.20
91	002539	云图控股	26,000	214,500.00	0.20
92	600577	精达股份	51,700	214,038.00	0.20
93	300113	顺网科技	15,200	212,800.00	0.20
94	600252	中恒集团	84,300	211,593.00	0.19
95	603306	华懋科技	7,800	211,458.00	0.19
96	300319	麦捷科技	21,800	210,152.00	0.19
97	601890	亚星锚链	21,200	209,880.00	0.19
98	300123	亚光科技	28,400	208,172.00	0.19
99	600305	恒顺醋业	22,400	206,304.00	0.19
100	688739	成大生物	6,300	204,813.00	0.19
101	600320	振华重工	61,600	204,512.00	0.19
102	000555	神州信息	18,100	204,349.00	0.19
103	300618	寒锐钴业	7,200	203,688.00	0.19
104	002003	伟星股份	18,700	202,895.00	0.19
105	300133	华策影视	34,500	202,515.00	0.19
106	688076	诺泰生物	4,500	202,275.00	0.19
107	600963	岳阳林纸	34,300	202,027.00	0.19
108	600478	科力远	41,000	201,720.00	0.19
109	000917	电广传媒	36,800	201,664.00	0.19
110	600266	城建发展	41,600	201,344.00	0.19
111	600138	中青旅	18,900	200,718.00	0.18
112	300470	中密控股	5,300	200,340.00	0.18
113	688789	宏华数科	2,000	199,820.00	0.18
114	600063	皖维高新	46,300	199,090.00	0.18
115	600420	国药现代	20,200	197,758.00	0.18
116	000758	中色股份	43,900	197,550.00	0.18
117	300850	新强联	6,200	197,346.00	0.18

118	688711	宏微科技	4,725	196,040.25	0.18
119	688321	微芯生物	8,903	195,420.85	0.18
120	688621	阳光诺和	2,800	195,300.00	0.18
121	002237	恒邦股份	18,100	195,118.00	0.18
122	300332	天壕能源	24,500	194,775.00	0.18
123	688676	金盘科技	5,400	193,482.00	0.18
124	600888	新疆众和	26,400	191,136.00	0.18
125	000657	中钨高新	22,500	190,800.00	0.18
126	600105	永鼎股份	34,400	190,576.00	0.18
127	600507	方大特钢	41,200	189,932.00	0.17
128	002948	青岛银行	62,200	189,710.00	0.17
129	600075	新疆天业	43,900	189,648.00	0.17
130	300687	赛意信息	8,700	189,486.00	0.17
131	300138	晨光生物	14,100	189,363.00	0.17
132	688212	澳华内镜	3,016	187,082.48	0.17
133	688408	中信博	2,600	186,550.00	0.17
134	600729	重庆百货	6,600	186,120.00	0.17
135	603766	隆鑫通用	35,700	184,212.00	0.17
136	002106	莱宝高科	17,300	184,072.00	0.17
137	301155	海力风电	3,100	183,365.00	0.17
138	002073	软控股份	27,900	183,303.00	0.17
139	000915	华特达因	6,300	182,448.00	0.17
140	600502	安徽建工	39,200	182,280.00	0.17
141	002421	达实智能	56,300	181,286.00	0.17
142	603035	常熟汽饰	9,600	181,152.00	0.17
143	002163	海南发展	19,900	180,692.00	0.17
144	603033	三维股份	11,400	180,234.00	0.17
145	300217	东方电热	33,500	180,230.00	0.17
146	002635	安洁科技	11,000	179,630.00	0.17
147	300224	正海磁材	15,300	179,316.00	0.16
148	600210	紫江企业	37,900	178,130.00	0.16
149	600537	亿晶光电	32,300	177,973.00	0.16
150	603100	川仪股份	6,400	177,408.00	0.16
151	000982	中银绒业	120,600	177,282.00	0.16
152	688318	财富趋势	1,400	176,820.00	0.16
153	300598	诚迈科技	4,100	176,013.00	0.16
154	688018	乐鑫科技	1,700	175,015.00	0.16
155	002023	海特高新	19,200	174,720.00	0.16
156	002108	沧州明珠	42,500	174,675.00	0.16
157	002960	青鸟消防	12,600	174,384.00	0.16
158	601702	华峰铝业	9,700	174,115.00	0.16
159	603619	中曼石油	9,400	174,088.00	0.16
160	600226	ST瀚叶	66,500	173,565.00	0.16

160	600675	中华企业	55,100	173,565.00	0.16
161	600158	中体产业	22,300	173,494.00	0.16
162	002214	大立科技	15,120	173,426.40	0.16
163	603368	柳药集团	9,140	172,928.80	0.16
164	002390	信邦制药	38,900	172,716.00	0.16
165	603612	索通发展	11,200	172,368.00	0.16
166	688239	航宇科技	3,600	171,972.00	0.16
167	002191	劲嘉股份	32,000	171,840.00	0.16
168	002233	塔牌集团	24,200	171,336.00	0.16
169	002006	精工科技	11,200	171,136.00	0.16
170	601369	陕鼓动力	21,400	170,772.00	0.16
171	002859	洁美科技	6,828	170,358.60	0.16
172	600720	中交设计	16,900	170,352.00	0.16
173	603566	普莱柯	7,500	169,875.00	0.16
174	688696	极米科技	1,500	169,470.00	0.16
175	600277	亿利洁能	64,400	169,372.00	0.16
176	688439	振华风光	1,900	169,309.00	0.16
177	300671	富满微	5,200	168,116.00	0.15
178	300602	飞荣达	9,300	168,051.00	0.15
179	603738	泰晶科技	10,200	166,770.00	0.15
180	600313	农发种业	22,300	166,135.00	0.15
181	000065	北方国际	14,800	166,056.00	0.15
182	300355	蒙草生态	44,100	165,375.00	0.15
183	002815	崇达技术	17,200	164,776.00	0.15
184	002115	三维通信	22,700	163,894.00	0.15
185	603187	海容冷链	10,800	163,728.00	0.15
186	002626	金达威	10,000	163,300.00	0.15
187	000848	承德露露	20,800	163,280.00	0.15
188	600269	赣粤高速	39,700	163,167.00	0.15
189	000901	航天科技	17,500	163,100.00	0.15
190	603383	顶点软件	3,300	162,690.00	0.15
191	000735	罗牛山	28,100	162,137.00	0.15
192	002386	天原股份	31,363	161,833.08	0.15
193	600389	江山股份	9,300	161,820.00	0.15
194	600477	杭萧钢构	49,100	161,539.00	0.15
195	002061	浙江交科	44,200	161,330.00	0.15
196	300613	富瀚微	3,800	161,272.00	0.15
197	300233	金城医药	9,643	160,652.38	0.15
198	002158	汉钟精机	7,200	160,272.00	0.15
199	002154	报喜鸟	28,200	160,176.00	0.15
200	300048	合康新能	31,600	159,896.00	0.15
201	300102	乾照光电	21,700	159,495.00	0.15
202	600776	东方通信	14,100	159,189.00	0.15

203	000059	华锦股份	28,900	158,661.00	0.15
204	300409	道氏技术	14,200	158,188.00	0.15
205	688559	海目星	4,400	157,080.00	0.14
206	300263	隆华科技	22,300	156,992.00	0.14
207	000990	诚志股份	19,100	156,811.00	0.14
208	603881	数据港	7,900	156,578.00	0.14
209	301096	百诚医药	2,400	156,240.00	0.14
210	688131	皓元医药	3,000	156,180.00	0.14
211	600664	哈药股份	46,600	156,110.00	0.14
212	603348	文灿股份	4,000	155,200.00	0.14
213	300723	一品红	5,200	155,116.00	0.14
214	000685	中山公用	21,200	154,972.00	0.14
215	300401	花园生物	13,000	153,530.00	0.14
216	002449	国星光电	16,200	153,414.00	0.14
217	688382	益方生物	10,100	152,914.00	0.14
218	600496	精工钢构	49,800	151,890.00	0.14
219	300443	金雷股份	5,500	151,745.00	0.14
220	603896	寿仙谷	4,700	151,528.00	0.14
221	603888	新华网	6,000	151,140.00	0.14
222	000078	海王生物	48,100	151,034.00	0.14
223	600868	梅雁吉祥	59,200	150,960.00	0.14
224	600603	广汇物流	19,400	150,932.00	0.14
225	603859	能科科技	4,000	150,920.00	0.14
226	300119	瑞普生物	9,200	150,788.00	0.14
227	300596	利安隆	5,100	150,756.00	0.14
228	001270	铖昌科技	2,400	150,504.00	0.14
229	300428	立中集团	7,100	149,952.00	0.14
230	600869	远东股份	34,100	149,699.00	0.14
231	603008	喜临门	8,800	149,688.00	0.14
232	688127	蓝特光学	6,400	149,056.00	0.14
233	300772	运达股份	14,000	148,960.00	0.14
234	300663	科蓝软件	10,500	148,470.00	0.14
235	601200	上海环境	16,500	148,335.00	0.14
236	300634	彩讯股份	7,200	147,384.00	0.14
237	600773	西藏城投	13,400	146,864.00	0.14
238	002434	万里扬	19,700	146,765.00	0.13
239	300326	凯利泰	23,100	146,223.00	0.13
240	603871	嘉友国际	9,200	145,912.00	0.13
241	601163	三角轮胎	10,100	145,541.00	0.13
242	688319	欧林生物	9,200	145,360.00	0.13
243	600966	博汇纸业	23,300	144,693.00	0.13
244	688677	海泰新光	2,700	143,721.00	0.13
245	603801	志邦家居	8,540	143,215.80	0.13

246	300377	赢时胜	18,400	142,784.00	0.13
247	688508	芯朋微	2,900	142,709.00	0.13
248	002110	三钢闽光	35,200	142,560.00	0.13
249	002104	恒宝股份	18,500	142,080.00	0.13
250	600620	天宸股份	15,100	141,940.00	0.13
251	300342	天银机电	9,200	141,404.00	0.13
252	600307	酒钢宏兴	94,600	140,954.00	0.13
253	301153	中科江南	1,800	140,886.00	0.13
254	002101	广东鸿图	9,200	140,116.00	0.13
255	000552	甘肃能化	45,800	139,690.00	0.13
256	300497	富祥药业	14,800	138,528.00	0.13
257	605599	菜百股份	9,300	138,477.00	0.13
258	600108	亚盛集团	49,700	138,166.00	0.13
259	002930	宏川智慧	7,100	137,669.00	0.13
260	600391	航发科技	7,200	137,664.00	0.13
261	002440	闰土股份	22,400	136,640.00	0.13
262	300806	斯迪克	9,700	136,479.00	0.13
263	600458	时代新材	14,800	136,308.00	0.13
264	603595	东尼电子	3,700	136,123.00	0.13
265	601609	金田股份	20,100	136,077.00	0.13
266	600643	爱建集团	26,600	135,660.00	0.12
267	603212	赛伍技术	7,800	135,486.00	0.12
268	300770	新媒股份	3,500	135,380.00	0.12
269	600882	妙可蓝多	8,400	134,988.00	0.12
270	600861	北京人力	7,200	134,928.00	0.12
271	300468	四方精创	12,400	134,540.00	0.12
272	000429	粤高速 A	15,900	134,514.00	0.12
273	301268	铭利达	4,500	134,235.00	0.12
274	600787	中储股份	26,300	134,130.00	0.12
275	002125	湘潭电化	12,500	133,625.00	0.12
276	600169	太原重工	56,600	133,576.00	0.12
277	002993	奥海科技	3,500	133,350.00	0.12
278	603227	雪峰科技	19,300	133,170.00	0.12
279	000950	重药控股	26,700	132,699.00	0.12
280	300358	楚天科技	12,400	132,680.00	0.12
281	688176	亚虹医药	12,300	132,594.00	0.12
282	300662	科锐国际	4,800	132,576.00	0.12
283	601900	南方传媒	10,200	132,498.00	0.12
284	600459	贵研铂业	9,200	132,112.00	0.12
285	000061	农 产 品	20,400	131,988.00	0.12
286	300143	盈康生命	12,400	131,812.00	0.12
287	688277	天智航	10,000	131,800.00	0.12
288	300353	东土科技	13,600	131,648.00	0.12

289	002194	武汉凡谷	13,300	131,138.00	0.12
290	000777	中核科技	9,000	130,860.00	0.12
291	688403	汇成股份	12,400	130,820.00	0.12
292	002206	海利得	26,000	130,520.00	0.12
293	688100	威胜信息	4,500	130,140.00	0.12
294	300382	斯莱克	13,100	130,083.00	0.12
295	600033	福建高速	41,900	129,890.00	0.12
296	688275	万润新能	2,100	129,507.00	0.12
297	600835	上海机电	10,900	129,383.00	0.12
298	601827	三峰环境	17,200	129,172.00	0.12
299	002967	广电计量	8,600	129,086.00	0.12
300	603730	岱美股份	8,900	128,961.00	0.12
301	002612	朗姿股份	6,700	128,841.00	0.12
302	688298	东方生物	3,600	128,736.00	0.12
303	601019	山东出版	13,700	128,506.00	0.12
304	600691	阳煤化工	40,000	128,400.00	0.12
305	300900	广联航空	5,200	128,336.00	0.12
306	603229	奥翔药业	9,700	128,137.00	0.12
307	002646	天佑德酒	9,400	127,934.00	0.12
308	600007	中国国贸	6,600	127,908.00	0.12
309	000652	泰达股份	32,800	127,592.00	0.12
310	300708	聚灿光电	11,300	127,464.00	0.12
311	603105	芯能科技	11,000	127,380.00	0.12
312	300128	锦富技术	27,500	126,775.00	0.12
313	600757	长江传媒	17,000	126,650.00	0.12
314	002997	瑞鹄模具	3,800	126,616.00	0.12
315	300455	航天智装	10,600	126,564.00	0.12
316	605507	国邦医药	7,200	126,432.00	0.12
317	002833	弘亚数控	7,100	125,954.00	0.12
318	688601	力芯微	2,400	125,736.00	0.12
319	600955	维远股份	7,000	125,650.00	0.12
320	600846	同济科技	13,500	125,550.00	0.12
321	002135	东南网架	21,600	124,848.00	0.11
322	600058	五矿发展	13,300	124,754.00	0.11
323	002516	旷达科技	25,300	124,729.00	0.11
324	603169	兰石重装	20,200	124,432.00	0.11
325	002226	江南化工	28,400	124,392.00	0.11
326	000731	四川美丰	16,800	124,320.00	0.11
327	000957	中通客车	13,800	123,924.00	0.11
328	300134	大富科技	12,000	123,840.00	0.11
329	002051	中工国际	15,200	123,424.00	0.11
330	603337	杰克股份	5,700	123,120.00	0.11
331	002545	东方铁塔	17,200	122,980.00	0.11

332	301216	万凯新材	8,700	122,931.00	0.11
333	003012	东鹏控股	14,900	122,925.00	0.11
334	002277	友阿股份	30,500	122,915.00	0.11
335	002039	黔源电力	8,900	122,731.00	0.11
336	603181	皇马科技	11,200	122,416.00	0.11
337	002491	通鼎互联	23,300	122,092.00	0.11
338	603699	纽威股份	8,800	121,968.00	0.11
339	300477	合纵科技	32,500	121,875.00	0.11
340	601606	长城军工	10,000	121,800.00	0.11
341	000823	超声电子	12,700	121,539.00	0.11
342	600973	宝胜股份	25,800	121,518.00	0.11
343	000541	佛山照明	18,200	121,030.00	0.11
344	301316	慧博云通	5,200	120,848.00	0.11
345	002452	长高电新	17,000	120,700.00	0.11
346	600756	浪潮软件	8,700	120,669.00	0.11
347	000948	南天信息	8,000	120,560.00	0.11
348	605168	三人行	1,900	120,384.00	0.11
349	300055	万邦达	19,500	120,315.00	0.11
350	000501	武商集团	14,100	120,132.00	0.11
351	600790	轻纺城	30,000	119,100.00	0.11
352	002556	辉隆股份	20,200	118,776.00	0.11
353	600710	苏美达	16,700	118,403.00	0.11
354	002538	司尔特	19,600	118,384.00	0.11
355	601963	重庆银行	17,000	118,320.00	0.11
356	000922	佳电股份	11,500	118,105.00	0.11
356	002570	贝因美	29,900	118,105.00	0.11
357	000751	锌业股份	36,200	117,650.00	0.11
358	600433	冠豪高新	34,000	117,640.00	0.11
359	601686	友发集团	19,100	117,465.00	0.11
360	000913	钱江摩托	9,400	117,218.00	0.11
361	688356	键凯科技	1,100	117,040.00	0.11
362	000567	海德股份	11,000	116,930.00	0.11
363	000881	中广核技	16,100	116,725.00	0.11
364	600575	淮河能源	48,300	116,403.00	0.11
365	300219	鸿利智汇	13,800	116,196.00	0.11
366	002293	罗莱生活	12,500	116,125.00	0.11
367	688299	长阳科技	8,300	115,785.00	0.11
368	603328	依顿电子	14,200	115,730.00	0.11
369	000819	岳阳兴长	6,400	115,712.00	0.11
370	300052	中青宝	6,800	115,396.00	0.11
371	300872	天阳科技	8,400	114,912.00	0.11
372	002132	恒星科技	36,700	114,871.00	0.11
373	603113	金能科技	14,200	114,594.00	0.11

374	002190	成飞集成	6,000	113,820.00	0.10
375	002204	大连重工	24,900	113,793.00	0.10
376	603915	国茂股份	6,900	113,712.00	0.10
377	300569	天能重工	15,900	113,685.00	0.10
378	002891	中宠股份	4,300	113,305.00	0.10
379	300120	经纬辉开	15,600	113,256.00	0.10
380	688586	江航装备	10,200	113,118.00	0.10
381	300349	金卡智能	9,100	113,022.00	0.10
382	000672	上峰水泥	14,000	112,840.00	0.10
383	300304	云意电气	16,600	112,714.00	0.10
384	605377	华旺科技	5,900	112,631.00	0.10
385	601882	海天精工	4,300	112,445.00	0.10
386	600648	外高桥	11,400	112,404.00	0.10
387	002746	仙坛股份	15,900	111,936.00	0.10
388	600590	泰豪科技	16,700	111,556.00	0.10
389	002017	东信和平	10,700	111,387.00	0.10
390	600576	祥源文旅	14,800	110,112.00	0.10
391	000498	山东路桥	19,500	109,980.00	0.10
392	002170	芭田股份	19,800	109,890.00	0.10
393	300066	三川智慧	21,700	109,585.00	0.10
394	002242	九阳股份	8,600	109,306.00	0.10
395	603396	金辰股份	2,000	109,300.00	0.10
396	002367	康力电梯	14,500	109,040.00	0.10
397	603067	振华股份	10,700	109,033.00	0.10
398	688103	国力股份	2,200	108,636.00	0.10
399	300080	易成新能	22,400	108,416.00	0.10
400	600668	尖峰集团	9,800	108,290.00	0.10
401	688579	山大地纬	8,500	107,950.00	0.10
402	603989	艾华集团	5,000	107,600.00	0.10
403	603186	华正新材	3,100	107,570.00	0.10
404	601949	中国出版	13,300	107,464.00	0.10
405	603398	沐邦高科	6,000	107,460.00	0.10
406	600308	华泰股份	30,900	106,914.00	0.10
407	002662	京威股份	30,400	106,704.00	0.10
408	603387	基蛋生物	9,700	106,700.00	0.10
409	300680	隆盛科技	5,700	106,590.00	0.10
410	002483	润邦股份	20,400	106,488.00	0.10
411	688381	帝奥微	4,200	106,344.00	0.10
412	002302	西部建设	16,400	106,272.00	0.10
413	600300	维维股份	34,100	106,051.00	0.10
414	603611	诺力股份	5,600	106,008.00	0.10
415	603055	台华新材	8,800	105,952.00	0.10
416	000968	蓝焰控股	14,900	105,939.00	0.10

417	002668	奥马电器	16,000	105,760.00	0.10
418	601326	秦港股份	37,000	105,450.00	0.10
419	600217	中再资环	24,000	105,120.00	0.10
420	603718	海利生物	9,800	104,958.00	0.10
421	603990	麦迪科技	8,100	104,652.00	0.10
422	600810	神马股份	14,000	104,160.00	0.10
423	601388	怡球资源	39,700	104,014.00	0.10
424	603609	禾丰股份	12,100	103,576.00	0.10
425	300579	数字认证	4,000	103,440.00	0.10
426	300513	恒实科技	8,700	103,356.00	0.10
427	600929	雪天盐业	16,000	103,200.00	0.09
428	600639	浦东金桥	10,200	103,122.00	0.09
429	600694	大商股份	6,100	103,029.00	0.09
430	688553	汇宇制药	6,800	102,884.00	0.09
431	300527	中船应急	13,500	102,870.00	0.09
432	600662	外服控股	21,400	102,720.00	0.09
433	688380	中微半导	4,300	102,598.00	0.09
434	601069	西部黄金	8,500	102,510.00	0.09
435	002915	中欣氟材	5,600	102,256.00	0.09
436	002987	京北方	5,500	102,190.00	0.09
437	002034	旺能环境	6,700	102,175.00	0.09
438	000931	中关村	17,300	101,551.00	0.09
439	002376	新北洋	13,300	101,346.00	0.09
440	300286	安科瑞	3,900	101,127.00	0.09
441	300586	美联新材	12,500	101,125.00	0.09
442	600230	沧州大化	7,500	101,025.00	0.09
443	603567	珍宝岛	8,300	100,928.00	0.09
444	000888	峨眉山 A	11,300	100,909.00	0.09
445	002462	嘉事堂	7,100	100,891.00	0.09
446	603081	大丰实业	7,400	100,788.00	0.09
447	002342	巨力索具	23,300	100,423.00	0.09
448	300619	金银河	1,800	100,170.00	0.09
449	002573	清新环境	20,200	99,990.00	0.09
450	603520	司太立	7,100	99,968.00	0.09
451	603012	创力集团	16,900	99,879.00	0.09
452	603809	豪能股份	8,400	99,540.00	0.09
453	000962	东方钽业	8,000	99,120.00	0.09
454	000717	中南股份	39,000	99,060.00	0.09
455	300465	高伟达	9,800	97,902.00	0.09
456	001338	永顺泰	8,100	97,686.00	0.09
457	600874	创业环保	17,600	97,680.00	0.09
458	002759	天际股份	9,200	97,612.00	0.09
459	603901	永创智能	8,200	97,580.00	0.09

460	002307	北新路桥	23,000	97,520.00	0.09
461	688225	亚信安全	5,300	97,202.00	0.09
462	688157	松井股份	1,800	97,092.00	0.09
463	002111	威海广泰	10,700	96,942.00	0.09
464	002614	奥佳华	12,900	96,750.00	0.09
465	000789	万年青	14,100	96,726.00	0.09
466	688488	艾迪药业	7,700	96,327.00	0.09
467	002288	超华科技	22,000	95,920.00	0.09
468	000726	鲁泰 A	14,800	95,904.00	0.09
469	600163	中闽能源	21,900	95,703.00	0.09
470	300046	台基股份	6,000	95,460.00	0.09
471	600713	南京医药	19,700	95,348.00	0.09
472	300532	今天国际	5,800	95,236.00	0.09
473	600581	八一钢铁	26,500	95,135.00	0.09
474	002913	奥士康	3,100	95,015.00	0.09
475	300729	乐歌股份	5,300	94,923.00	0.09
476	600984	建设机械	25,300	94,875.00	0.09
477	000852	石化机械	15,400	94,710.00	0.09
478	601700	风范股份	18,900	94,689.00	0.09
479	600731	湖南海利	14,400	94,608.00	0.09
480	300205	天喻信息	8,700	94,482.00	0.09
481	688391	钜泉科技	1,900	94,240.00	0.09
482	300266	兴源环境	34,900	94,230.00	0.09
483	601226	华电重工	14,300	94,094.00	0.09
484	600894	广日股份	12,800	94,080.00	0.09
485	688205	德科立	1,900	94,012.00	0.09
486	002301	齐心集团	13,200	93,852.00	0.09
487	603222	济民医疗	11,700	93,717.00	0.09
488	301217	铜冠铜箔	7,900	93,694.00	0.09
489	600866	星湖科技	20,100	93,666.00	0.09
490	002623	亚玛顿	3,500	93,625.00	0.09
491	603507	振江股份	3,600	93,276.00	0.09
492	603889	新澳股份	13,100	93,272.00	0.09
493	600855	航天长峰	8,700	93,264.00	0.09
494	002296	辉煌科技	11,300	93,225.00	0.09
495	603301	振德医疗	3,800	93,100.00	0.09
496	605077	华康股份	4,300	93,052.00	0.09
497	688357	建龙微纳	1,800	93,042.00	0.09
498	000906	浙商中拓	12,700	92,837.00	0.09
499	603098	森特股份	6,800	92,548.00	0.09
500	300590	移为通信	7,700	92,477.00	0.09
501	000561	烽火电子	11,000	92,400.00	0.08
502	603367	辰欣药业	6,300	92,232.00	0.08

503	688660	电气风电	17,900	92,006.00	0.08
504	300460	惠伦晶体	7,500	91,950.00	0.08
505	300768	迪普科技	6,200	91,636.00	0.08
506	688173	希荻微	5,200	91,468.00	0.08
507	600748	上实发展	26,200	91,438.00	0.08
508	600268	国电南自	13,100	91,307.00	0.08
509	300191	潜能恒信	5,900	91,273.00	0.08
510	300617	安靠智电	3,000	91,080.00	0.08
511	600657	信达地产	25,300	90,827.00	0.08
512	688148	芳源股份	11,800	90,506.00	0.08
513	605116	奥锐特	3,500	90,370.00	0.08
514	301069	凯盛新材	4,200	89,964.00	0.08
515	000949	新乡化纤	27,800	89,794.00	0.08
516	002391	长青股份	14,200	89,460.00	0.08
517	600336	澳柯玛	14,800	89,244.00	0.08
518	688283	坤恒顺维	1,300	89,219.00	0.08
519	000025	特力 A	5,600	89,096.00	0.08
520	300149	睿智医药	11,600	88,740.00	0.08
521	603987	康德莱	9,300	88,722.00	0.08
522	688505	复旦张江	9,600	88,608.00	0.08
523	002088	鲁阳节能	6,200	88,350.00	0.08
524	600020	中原高速	24,000	88,320.00	0.08
525	002378	章源钨业	15,600	88,296.00	0.08
526	605108	同庆楼	2,900	88,276.00	0.08
527	603313	梦百合	8,400	88,200.00	0.08
528	603811	诚意药业	8,500	88,145.00	0.08
529	002096	易普力	8,500	88,060.00	0.08
530	300239	东宝生物	14,100	87,843.00	0.08
531	002768	国恩股份	4,100	87,822.00	0.08
532	688526	科前生物	4,300	87,634.00	0.08
533	688206	概伦电子	4,000	87,200.00	0.08
534	300696	爱乐达	5,000	87,050.00	0.08
535	300853	申昊科技	3,200	87,040.00	0.08
536	300125	聆达股份	6,900	87,009.00	0.08
537	688121	卓然股份	4,300	86,989.00	0.08
538	600783	鲁信创投	7,500	86,850.00	0.08
539	002912	中新赛克	3,100	86,769.00	0.08
540	688059	华锐精密	1,100	86,581.00	0.08
541	601886	江河集团	13,000	86,580.00	0.08
542	688308	欧科亿	3,100	86,490.00	0.08
543	603508	思维列控	5,500	86,350.00	0.08
544	603719	良品铺子	4,000	86,240.00	0.08
544	603722	阿科力	1,600	86,240.00	0.08

545	600012	皖通高速	7,800	85,956.00	0.08
546	300365	恒华科技	12,700	85,852.00	0.08
547	002991	甘源食品	1,200	85,752.00	0.08
548	601002	晋亿实业	17,700	85,668.00	0.08
549	300249	依米康	9,900	85,338.00	0.08
550	600218	全柴动力	8,900	85,173.00	0.08
551	003006	百亚股份	5,600	84,896.00	0.08
552	300381	溢多利	11,500	84,755.00	0.08
553	002053	云南能投	8,800	84,656.00	0.08
554	002160	常铝股份	20,200	84,638.00	0.08
555	600184	光电股份	7,400	84,582.00	0.08
556	300368	汇金股份	12,400	84,568.00	0.08
557	002524	光正眼科	13,100	84,495.00	0.08
558	603281	江瀚新材	3,200	84,128.00	0.08
559	000885	城发环境	7,400	83,916.00	0.08
560	603399	吉翔股份	8,200	83,886.00	0.08
561	300505	川金诺	5,000	83,750.00	0.08
562	600548	深高速	9,300	83,607.00	0.08
563	300091	金通灵	31,300	83,571.00	0.08
564	002225	濮耐股份	22,000	83,160.00	0.08
565	002095	生意宝	4,100	83,107.00	0.08
566	002959	小熊电器	1,600	83,088.00	0.08
567	301162	国能日新	1,600	83,008.00	0.08
568	003009	中天火箭	1,800	82,998.00	0.08
569	002265	建设工业	7,300	82,928.00	0.08
570	603223	恒通股份	8,400	82,908.00	0.08
571	002990	盛视科技	2,400	82,872.00	0.08
572	300953	震裕科技	1,500	82,770.00	0.08
573	600054	黄山旅游	7,600	82,688.00	0.08
574	002314	南山控股	28,400	82,360.00	0.08
575	300578	会畅通讯	4,600	82,156.00	0.08
576	300061	旗天科技	14,000	82,040.00	0.08
577	000055	方大集团	18,100	81,812.00	0.08
578	600180	瑞茂通	13,400	81,606.00	0.08
579	600207	安彩高科	17,100	81,567.00	0.08
580	301090	华润材料	7,500	81,450.00	0.07
581	300894	火星人	5,000	81,200.00	0.07
582	000159	国际实业	12,500	81,125.00	0.07
583	300833	浩洋股份	900	81,090.00	0.07
584	605222	起帆电缆	4,200	80,976.00	0.07
585	000576	甘化科工	8,700	80,910.00	0.07
585	002393	力生制药	3,100	80,910.00	0.07
586	001301	尚太科技	2,200	80,564.00	0.07

587	300582	英飞特	6,700	80,467.00	0.07
588	300712	永福股份	3,000	80,400.00	0.07
589	603355	莱克电气	3,600	80,280.00	0.07
590	300636	同和药业	7,600	80,104.00	0.07
591	600318	新力金融	11,400	80,028.00	0.07
592	688499	利元亨	2,100	79,968.00	0.07
593	300259	新天科技	22,000	79,860.00	0.07
594	600903	贵州燃气	10,100	79,689.00	0.07
595	600278	东方创业	11,400	79,572.00	0.07
596	300040	九洲集团	14,200	79,520.00	0.07
597	600367	红星发展	6,200	79,484.00	0.07
598	603170	宝立食品	4,700	79,477.00	0.07
599	600488	津药药业	16,200	79,380.00	0.07
600	603299	苏盐井神	9,300	79,236.00	0.07
601	001215	千味央厨	1,500	79,215.00	0.07
602	000910	大亚圣象	9,900	79,200.00	0.07
602	688258	卓易信息	1,600	79,200.00	0.07
603	600368	五洲交通	20,000	79,000.00	0.07
604	002641	公元股份	15,700	78,971.00	0.07
605	688190	云路股份	1,100	78,793.00	0.07
606	002562	兄弟科技	19,500	78,780.00	0.07
607	300755	华致酒行	4,300	78,647.00	0.07
608	603138	海量数据	4,400	78,320.00	0.07
609	000531	穗恒运 A	11,700	78,273.00	0.07
610	301103	何氏眼科	2,600	77,948.00	0.07
611	600818	中路股份	6,500	77,935.00	0.07
612	002246	北化股份	9,500	77,805.00	0.07
613	002534	西子洁能	6,200	77,438.00	0.07
614	300430	诚益通	5,400	77,166.00	0.07
615	002688	金河生物	16,000	76,960.00	0.07
616	300436	广生堂	3,000	76,890.00	0.07
617	603800	道森股份	2,900	76,560.00	0.07
618	002933	新兴装备	2,100	76,545.00	0.07
619	300208	青岛中程	11,400	76,152.00	0.07
620	688085	三友医疗	3,900	76,050.00	0.07
621	601089	福元医药	4,400	75,856.00	0.07
622	603258	电魂网络	3,300	75,834.00	0.07
623	688663	新风光	2,700	75,708.00	0.07
624	002838	道恩股份	5,900	75,579.00	0.07
625	603938	三孚股份	4,200	75,516.00	0.07
626	600758	辽宁能源	20,800	75,296.00	0.07
627	300523	辰安科技	3,700	75,110.00	0.07
628	603277	银都股份	2,800	75,096.00	0.07

629	002950	奥美医疗	7,900	74,892.00	0.07
630	002435	长江健康	17,900	74,643.00	0.07
631	603085	天成自控	7,300	74,460.00	0.07
632	688221	前沿生物	7,500	74,400.00	0.07
633	603916	苏博特	7,300	74,387.00	0.07
634	002636	金安国纪	8,300	73,953.00	0.07
635	688001	华兴源创	2,100	73,395.00	0.07
636	601512	中新集团	9,500	73,245.00	0.07
637	688209	英集芯	4,100	73,226.00	0.07
638	300647	超频三	11,400	73,188.00	0.07
639	300504	天邑股份	4,000	73,160.00	0.07
640	603665	康隆达	2,400	73,104.00	0.07
641	000838	财信发展	19,900	73,033.00	0.07
642	601579	会稽山	6,800	73,032.00	0.07
643	600876	凯盛新能	5,200	72,956.00	0.07
644	600628	新世界	10,400	72,904.00	0.07
645	002788	鹭燕医药	8,100	72,819.00	0.07
645	301302	华如科技	2,900	72,819.00	0.07
646	000993	闽东电力	7,100	72,420.00	0.07
647	002365	永安药业	7,400	72,372.00	0.07
648	600400	红豆股份	25,900	72,261.00	0.07
649	603327	福蓉科技	5,400	71,982.00	0.07
650	002651	利君股份	10,300	71,276.00	0.07
651	300452	山河药辅	5,000	71,200.00	0.07
652	001258	立新能源	8,800	71,104.00	0.07
653	300389	艾比森	4,100	71,094.00	0.07
654	688330	宏力达	2,500	71,025.00	0.07
655	300860	锋尚文化	1,300	71,019.00	0.07
656	301333	诺思格	1,100	70,928.00	0.07
657	300560	中富通	4,000	70,840.00	0.07
658	300722	新余国科	2,700	70,713.00	0.07
659	300902	国安达	2,000	70,500.00	0.06
660	601330	绿色动力	10,600	70,384.00	0.06
661	002578	闽发铝业	15,700	70,336.00	0.06
662	603339	四方科技	5,900	70,151.00	0.06
663	002082	万邦德	10,900	69,760.00	0.06
664	002543	万和电气	7,800	69,576.00	0.06
665	601008	连云港	17,100	69,255.00	0.06
666	603032	德新科技	3,400	69,020.00	0.06
667	603698	航天工程	4,800	68,976.00	0.06
668	002116	中国海诚	6,700	68,943.00	0.06
669	605183	确成股份	4,700	68,761.00	0.06
670	600696	岩石股份	3,800	68,362.00	0.06

671	603208	江山欧派	2,300	68,287.00	0.06
672	603983	丸美股份	2,700	68,229.00	0.06
673	000633	合金投资	9,600	68,160.00	0.06
674	603515	欧普照明	3,900	67,782.00	0.06
675	605333	沪光股份	3,400	67,660.00	0.06
676	000722	湖南发展	7,000	67,270.00	0.06
677	000532	华金资本	5,600	67,144.00	0.06
678	300140	节能环保	9,100	67,067.00	0.06
679	300516	久之洋	2,000	66,920.00	0.06
680	002724	海洋王	8,100	66,582.00	0.06
681	300344	立方数科	11,700	66,573.00	0.06
682	688768	容知日新	1,800	66,258.00	0.06
683	603136	天目湖	3,600	66,132.00	0.06
684	601199	江南水务	13,300	65,968.00	0.06
685	603618	杭电股份	10,300	65,920.00	0.06
686	300698	万马科技	1,800	65,700.00	0.06
687	300437	清水源	5,200	65,364.00	0.06
688	300848	美瑞新材	3,400	65,042.00	0.06
689	000505	京粮控股	9,500	64,980.00	0.06
690	300518	新迅达	3,800	64,904.00	0.06
691	605009	豪悦护理	1,700	64,889.00	0.06
692	002661	克明食品	6,800	64,804.00	0.06
693	002818	富森美	5,200	64,792.00	0.06
694	600618	氯碱化工	7,100	64,610.00	0.06
695	002140	东华科技	7,600	64,600.00	0.06
696	300686	智动力	6,100	64,538.00	0.06
697	603639	海利尔	4,100	64,370.00	0.06
698	601811	新华文轩	4,700	64,202.00	0.06
699	688112	鼎阳科技	1,600	64,064.00	0.06
700	002308	威创股份	19,700	63,828.00	0.06
701	300642	透景生命	3,600	63,540.00	0.06
702	603877	太平鸟	3,700	63,196.00	0.06
703	600551	时代出版	5,800	63,162.00	0.06
704	002667	威领股份	5,600	63,112.00	0.06
705	600622	光大嘉宝	24,300	62,694.00	0.06
706	603869	新智认知	6,600	62,304.00	0.06
707	605338	巴比食品	2,900	62,292.00	0.06
708	601339	百隆东方	12,700	61,849.00	0.06
709	605369	拱东医疗	1,100	61,402.00	0.06
710	001208	华菱线缆	6,600	61,314.00	0.06
711	301058	中粮科工	5,600	61,208.00	0.06
712	605366	宏柏新材	7,400	61,198.00	0.06
713	688201	信安世纪	3,100	61,008.00	0.06

714	300127	银河磁体	3,500	60,585.00	0.06
715	001228	永泰运	1,900	60,458.00	0.06
716	688182	灿勤科技	3,400	60,452.00	0.06
717	600162	香江控股	34,700	60,378.00	0.06
718	000655	金岭矿业	8,400	60,228.00	0.06
719	600279	重庆港	13,500	60,075.00	0.06
720	603093	南华期货	5,000	60,000.00	0.06
721	301150	中一科技	1,800	59,868.00	0.06
722	301061	匠心家居	1,200	59,700.00	0.05
723	002946	新乳业	5,200	59,696.00	0.05
724	603239	浙江仙通	3,900	59,553.00	0.05
725	688128	中国电研	2,900	59,508.00	0.05
726	603897	长城科技	2,900	59,392.00	0.05
727	000517	荣安地产	24,100	59,045.00	0.05
728	000544	中原环保	8,500	58,990.00	0.05
729	600429	三元股份	13,200	58,872.00	0.05
730	002615	哈尔斯	8,000	58,640.00	0.05
731	601968	宝钢包装	11,400	58,482.00	0.05
732	300715	凯伦股份	5,000	58,300.00	0.05
733	002107	沃华医药	9,600	58,272.00	0.05
734	300739	明阳电路	3,800	58,178.00	0.05
735	600229	城市传媒	7,700	58,135.00	0.05
736	300870	欧陆通	1,300	57,551.00	0.05
737	603165	荣晟环保	4,800	57,504.00	0.05
738	600826	兰生股份	6,500	57,460.00	0.05
739	688667	菱电电控	700	57,428.00	0.05
740	300265	通光线缆	6,200	57,412.00	0.05
741	300673	佩蒂股份	4,300	57,190.00	0.05
742	688533	上声电子	1,500	57,180.00	0.05
743	000524	岭南控股	6,400	57,024.00	0.05
744	300771	智莱科技	5,200	56,524.00	0.05
745	300645	正元智慧	3,100	56,389.00	0.05
746	600359	新农开发	7,600	56,316.00	0.05
747	603931	格林达	2,200	56,298.00	0.05
748	603076	乐惠国际	2,100	56,280.00	0.05
749	600897	厦门空港	4,500	56,205.00	0.05
750	300215	电科院	10,600	56,074.00	0.05
751	603693	江苏新能	5,000	56,050.00	0.05
752	600681	百川能源	14,200	55,806.00	0.05
753	688077	大地熊	2,332	55,618.20	0.05
754	300893	松原股份	1,900	55,537.00	0.05
755	002923	润都股份	4,500	55,530.00	0.05
756	688089	嘉必优	3,100	55,490.00	0.05

757	300561	汇金科技	4,700	55,460.00	0.05
758	003043	华亚智能	1,100	55,231.00	0.05
759	603377	东方时尚	13,100	55,151.00	0.05
760	301345	涛涛车业	900	54,810.00	0.05
761	600283	钱江水利	4,300	54,137.00	0.05
762	688236	春立医疗	2,000	52,600.00	0.05
763	688569	铁科轨道	1,900	52,459.00	0.05
764	600053	九鼎投资	3,700	52,281.00	0.05
765	600939	重庆建工	15,800	51,824.00	0.05
766	688665	四方光电	700	51,632.00	0.05
767	000411	英特集团	4,600	51,566.00	0.05
768	603966	法兰泰克	6,300	51,534.00	0.05
769	605399	晨光新材	3,800	51,528.00	0.05
770	300962	中金辐照	3,300	51,216.00	0.05
771	300187	永清环保	9,500	51,110.00	0.05
772	603519	立霸股份	3,900	50,856.00	0.05
773	002961	瑞达期货	3,400	50,660.00	0.05
774	300787	海能实业	3,000	50,460.00	0.05
775	300732	设研院	5,700	50,331.00	0.05
776	688566	吉贝尔	1,600	50,224.00	0.05
777	002287	奇正藏药	2,200	49,478.00	0.05
778	301303	真兰仪表	2,500	49,225.00	0.05
779	301195	北路智控	1,200	48,696.00	0.04
780	000755	山西路桥	10,600	48,654.00	0.04
781	301439	泓淋电力	3,300	48,246.00	0.04
782	601003	柳钢股份	15,000	47,550.00	0.04
783	003013	地铁设计	2,900	47,531.00	0.04
784	603112	华翔股份	3,900	47,385.00	0.04
785	603587	地素时尚	3,600	47,196.00	0.04
786	600403	大有能源	12,400	47,120.00	0.04
787	002911	佛燃能源	4,100	46,986.00	0.04
788	301246	宏源药业	1,800	46,764.00	0.04
789	300852	四会富仕	1,200	46,248.00	0.04
790	300774	倍杰特	4,300	44,247.00	0.04
791	000042	中洲控股	7,700	44,198.00	0.04
792	603132	金徽股份	3,200	43,776.00	0.04
793	600228	返利科技	5,600	43,680.00	0.04
794	002016	世荣兆业	6,900	43,401.00	0.04
795	301102	兆讯传媒	2,200	42,108.00	0.04
796	300402	宝色股份	2,100	41,664.00	0.04
797	301322	绿通科技	1,000	41,160.00	0.04
798	603711	香飘飘	2,400	41,136.00	0.04
799	605068	明新旭腾	1,800	40,392.00	0.04

800	603180	金牌厨柜	1,600	40,144.00	0.04
801	603256	宏和科技	4,800	39,936.00	0.04
802	603109	神驰机电	2,400	39,408.00	0.04
803	002980	华盛昌	1,400	38,360.00	0.04
804	603235	天新药业	1,500	36,060.00	0.03
805	300994	久祺股份	2,400	35,280.00	0.03
806	300871	回盛生物	2,400	34,704.00	0.03
807	603755	日辰股份	1,300	34,554.00	0.03
808	603676	卫信康	3,300	34,419.00	0.03
809	688290	景业智能	708	33,821.16	0.03
810	603949	雪龙集团	1,800	33,714.00	0.03
811	603908	牧高笛	900	33,489.00	0.03
812	688247	宣泰医药	3,000	32,940.00	0.03
813	603680	今创集团	3,400	32,130.00	0.03
814	002905	金逸影视	2,900	31,784.00	0.03
815	600828	茂业商业	7,800	28,470.00	0.03
816	605099	共创草坪	1,300	26,234.00	0.02
817	300881	盛德鑫泰	1,000	25,580.00	0.02
818	605198	安德利	700	16,310.00	0.02
819	002677	浙江美大	1,000	10,110.00	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	301413	安培龙	920	66,791.08	0.06
2	603062	麦加芯彩	198	12,224.22	0.01
3	301526	国际复材	1,981	8,815.45	0.01
4	301517	陕西华达	166	7,252.54	0.01
5	301489	思泉新材	95	6,090.45	0.01
6	301516	中远通	371	5,754.21	0.01
7	301555	惠柏新材	176	5,709.44	0.01
8	688653	康希通信	357	5,708.43	0.01
9	688652	京仪装备	105	5,486.25	0.01
10	301508	中机认检	182	4,855.76	0.00
11	603273	天元智能	151	2,864.47	0.00
12	001326	联域股份	57	2,772.48	0.00
13	603193	润本股份	159	2,648.94	0.00
14	001239	永达股份	108	2,151.36	0.00
15	001306	夏厦精密	28	2,110.08	0.00
16	603107	上海汽配	102	1,855.38	0.00
17	001358	兴欣新材	34	1,501.44	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	300573	兴齐眼药	3,668,071.93	3.37
2	688568	中科星图	3,603,870.12	3.31
3	003031	中瓷电子	3,529,719.00	3.25
4	688408	中信博	3,522,884.18	3.24
5	688185	康希诺	3,385,786.77	3.11
6	688123	聚辰股份	3,333,321.62	3.07
7	688559	海目星	3,269,032.06	3.01
8	688266	泽璟制药	3,254,192.48	2.99
9	688798	艾为电子	3,246,476.51	2.99
10	688700	东威科技	3,236,674.71	2.98
11	688091	上海谊众	3,182,644.36	2.93
12	688133	泰坦科技	3,164,653.90	2.91
13	688339	亿华通	3,156,583.11	2.90
14	603896	寿仙谷	3,147,347.00	2.89
15	688711	宏微科技	3,132,512.56	2.88
16	603859	能科科技	3,093,417.00	2.85
17	300620	光库科技	3,086,012.97	2.84
18	688212	澳华内镜	3,081,145.24	2.83
19	001270	铖昌科技	3,062,668.10	2.82
20	603979	金诚信	3,051,128.00	2.81
21	688066	航天宏图	3,045,715.78	2.80
22	300624	万兴科技	3,042,354.00	2.80
23	603348	文灿股份	2,974,367.00	2.74
24	688239	航宇科技	2,964,746.44	2.73
25	605123	派克新材	2,954,026.00	2.72
26	688106	金宏气体	2,943,736.37	2.71
27	688556	高测股份	2,938,212.89	2.70
28	002222	福晶科技	2,931,930.00	2.70
29	600186	莲花健康	2,906,097.00	2.67
30	603801	志邦家居	2,897,531.80	2.67
31	300394	天孚通信	2,873,280.00	2.64
32	600587	新华医疗	2,870,680.00	2.64
33	600055	万东医疗	2,867,722.00	2.64
34	688088	虹软科技	2,855,941.16	2.63
35	601137	博威合金	2,852,221.00	2.62
36	002965	祥鑫科技	2,849,655.00	2.62
37	600933	爱柯迪	2,848,623.00	2.62
38	601126	四方股份	2,839,637.00	2.61

39	600363	联创光电	2,835,031.00	2.61
40	300470	中密控股	2,821,499.00	2.60
41	300770	新媒股份	2,821,078.00	2.59
42	605168	三人行	2,815,008.80	2.59
43	688596	正帆科技	2,806,179.49	2.58
44	688518	联贏激光	2,802,339.98	2.58
45	300762	上海瀚讯	2,800,405.60	2.58
46	002229	鸿博股份	2,782,484.00	2.56
47	603728	鸣志电器	2,780,997.00	2.56
48	300161	华中数控	2,776,019.00	2.55
49	002847	盐津铺子	2,772,353.00	2.55
50	600197	伊力特	2,768,327.04	2.55
51	300378	鼎捷软件	2,766,640.00	2.54
52	300415	伊之密	2,758,762.00	2.54
53	002318	久立特材	2,756,259.00	2.54
54	600557	康缘药业	2,743,653.00	2.52
55	600645	中源协和	2,737,563.00	2.52
56	600821	金开新能	2,733,805.00	2.51
57	603108	润达医疗	2,731,539.00	2.51
58	605090	九丰能源	2,724,628.80	2.51
59	688033	天宜上佳	2,723,756.49	2.51
60	603308	应流股份	2,720,920.00	2.50
61	002158	汉钟精机	2,711,278.00	2.49
62	300678	中科信息	2,705,824.00	2.49
63	300551	古鳌科技	2,702,624.10	2.49
64	603187	海容冷链	2,702,601.95	2.49
65	002675	东诚药业	2,689,098.00	2.47
66	688007	光峰科技	2,685,649.12	2.47
67	300674	宇信科技	2,683,423.00	2.47
68	300406	九强生物	2,682,634.00	2.47
69	600850	电科数字	2,682,119.00	2.47
70	600776	东方通信	2,677,156.00	2.46
71	300130	新国都	2,676,852.00	2.46
72	603612	索通发展	2,671,355.91	2.46
73	300456	赛微电子	2,664,375.00	2.45
74	600452	涪陵电力	2,662,849.60	2.45
75	300168	万达信息	2,660,792.00	2.45
76	688578	艾力斯	2,656,747.07	2.44
77	600771	广誉远	2,652,336.00	2.44
78	002832	比音勒芬	2,648,417.00	2.44
79	603888	新华网	2,643,021.00	2.43
80	300236	上海新阳	2,635,370.58	2.42
81	002126	银轮股份	2,635,329.00	2.42

82	002432	九安医疗	2,634,497.00	2.42
83	300679	电连技术	2,625,157.00	2.41
84	300655	晶瑞电材	2,609,090.75	2.40
85	000921	海信家电	2,606,162.00	2.40
86	600877	电科芯片	2,604,948.00	2.40
87	600720	中交设计	2,604,814.00	2.40
88	688278	特宝生物	2,600,508.78	2.39
89	603881	数据港	2,600,416.00	2.39
90	300825	阿尔特	2,598,881.50	2.39
91	600729	重庆百货	2,597,607.00	2.39
92	300685	艾德生物	2,592,817.00	2.38
93	688110	东芯股份	2,591,305.05	2.38
94	600331	宏达股份	2,591,193.00	2.38
95	688321	微芯生物	2,590,176.62	2.38
96	600360	华微电子	2,590,012.00	2.38
97	600422	昆药集团	2,589,770.00	2.38
98	688289	圣湘生物	2,589,608.91	2.38
99	300379	东方通	2,586,505.00	2.38
100	603533	掌阅科技	2,583,657.00	2.38
101	601858	中国科传	2,582,299.00	2.38
102	688235	百济神州	2,581,130.93	2.37
103	300166	东方国信	2,574,651.61	2.37
104	600158	中体产业	2,573,989.73	2.37
105	300319	麦捷科技	2,572,037.00	2.37
106	002214	大立科技	2,568,189.60	2.36
107	600586	金晶科技	2,567,562.00	2.36
108	600993	马应龙	2,563,864.00	2.36
109	300184	力源信息	2,562,198.00	2.36
110	688739	成大生物	2,559,134.32	2.35
111	603118	共进股份	2,558,168.00	2.35
112	300766	每日互动	2,557,719.00	2.35
113	603300	华铁应急	2,556,764.00	2.35
114	600389	江山股份	2,555,993.50	2.35
115	002006	精工科技	2,553,924.97	2.35
116	600797	浙大网新	2,553,902.00	2.35
117	600201	生物股份	2,551,929.00	2.35
118	600633	浙数文化	2,549,873.08	2.35
119	002240	盛新锂能	2,548,128.00	2.34
120	603599	广信股份	2,548,021.40	2.34
121	000821	京山轻机	2,547,800.00	2.34
122	002101	广东鸿图	2,547,066.00	2.34
123	002737	葵花药业	2,542,783.00	2.34
124	600986	浙文互联	2,542,403.00	2.34

125	603566	普莱柯	2,541,726.00	2.34
126	603867	新化股份	2,539,871.10	2.34
127	002446	盛路通信	2,538,197.00	2.33
128	300596	利安隆	2,537,985.00	2.33
129	000422	湖北宜化	2,533,554.00	2.33
130	300393	中来股份	2,532,411.00	2.33
131	000810	创维数字	2,530,883.68	2.33
132	688019	安集科技	2,530,183.50	2.33
133	601369	陕鼓动力	2,529,570.00	2.33
134	300497	富祥药业	2,525,639.00	2.32
135	002334	英威腾	2,524,195.00	2.32
136	300260	新莱应材	2,524,091.80	2.32
137	688676	金盘科技	2,523,903.00	2.32
138	600963	岳阳林纸	2,523,586.20	2.32
139	600252	中恒集团	2,522,299.00	2.32
140	600552	凯盛科技	2,520,649.40	2.32
141	600210	紫江企业	2,520,130.00	2.32
142	002453	华软科技	2,519,819.00	2.32
143	600602	云赛智联	2,514,489.00	2.31
144	603008	喜临门	2,511,681.00	2.31
145	300738	奥飞数据	2,510,732.60	2.31
146	603197	保隆科技	2,510,615.00	2.31
147	300212	易华录	2,509,430.20	2.31
148	688208	道通科技	2,509,323.42	2.31
149	002527	新时达	2,508,902.80	2.31
150	300657	弘信电子	2,508,668.00	2.31
151	600976	健民集团	2,506,602.00	2.31
152	300416	苏试试验	2,504,964.79	2.30
153	300855	图南股份	2,503,926.90	2.30
154	600151	航天机电	2,503,261.00	2.30
155	600888	新疆众和	2,503,227.00	2.30
156	003012	东鹏控股	2,501,540.00	2.30
157	600199	金种子酒	2,500,754.00	2.30
158	600123	兰花科创	2,498,944.40	2.30
159	600577	精达股份	2,498,189.00	2.30
160	000682	东方电子	2,497,224.00	2.30
161	300570	太辰光	2,496,821.58	2.30
162	600478	科力远	2,495,512.00	2.30
163	603100	川仪股份	2,495,464.00	2.30
164	002698	博实股份	2,495,107.94	2.30
165	600531	豫光金铅	2,494,739.00	2.29
166	688262	国芯科技	2,494,688.90	2.29
167	600305	恒顺醋业	2,493,058.00	2.29

168	600480	凌云股份	2,490,547.00	2.29
169	002960	青鸟消防	2,489,244.10	2.29
170	300475	香农芯创	2,489,106.00	2.29
171	000901	航天科技	2,487,951.00	2.29
172	601208	东材科技	2,487,816.00	2.29
173	600312	平高电气	2,485,831.00	2.29
174	300772	运达股份	2,484,164.76	2.28
175	002036	联创电子	2,482,186.00	2.28
176	600869	远东股份	2,482,157.00	2.28
177	300123	亚光科技	2,480,934.00	2.28
178	600761	安徽合力	2,479,066.00	2.28
179	600391	航发科技	2,478,588.00	2.28
180	600285	羚锐制药	2,477,034.96	2.28
181	600206	有研新材	2,476,401.00	2.28
182	688333	铂力特	2,475,331.95	2.28
183	000829	天音控股	2,474,147.27	2.28
184	300593	新雷能	2,473,379.50	2.28
185	002332	仙琚制药	2,473,046.00	2.27
186	600525	长园集团	2,471,585.00	2.27
187	300428	立中集团	2,471,324.00	2.27
188	002851	麦格米特	2,470,360.00	2.27
189	600223	福瑞达	2,467,832.56	2.27
190	688166	博瑞医药	2,467,691.13	2.27
191	002020	京新药业	2,466,315.00	2.27
192	002351	漫步者	2,464,470.00	2.27
193	000657	中钨高新	2,463,544.00	2.27
194	000503	国新健康	2,461,596.00	2.26
195	002326	永太科技	2,459,163.00	2.26
196	600328	中盐化工	2,456,476.30	2.26
197	300002	神州泰岳	2,455,769.00	2.26
198	603997	继峰股份	2,455,668.00	2.26
199	603279	景津装备	2,455,112.90	2.26
200	603306	华懋科技	2,453,716.00	2.26
201	601965	中国汽研	2,453,504.00	2.26
202	600138	中青旅	2,452,593.00	2.26
203	603383	顶点软件	2,452,548.00	2.26
204	603505	金石资源	2,449,662.10	2.25
205	600105	永鼎股份	2,448,290.00	2.25
206	300409	道氏技术	2,447,826.00	2.25
207	688037	芯源微	2,445,429.83	2.25
208	600908	无锡银行	2,444,587.00	2.25
209	002283	天润工业	2,443,530.00	2.25
210	000936	华西股份	2,440,734.00	2.25

211	300451	创业慧康	2,439,725.00	2.24
212	601918	新集能源	2,439,525.00	2.24
213	002349	精华制药	2,438,696.00	2.24
214	605376	博迁新材	2,437,671.00	2.24
215	002324	普利特	2,436,448.00	2.24
216	300627	华测导航	2,436,217.00	2.24
217	002031	巨轮智能	2,434,641.00	2.24
218	600063	皖维高新	2,432,361.00	2.24
219	002654	万润科技	2,430,589.00	2.24
220	002428	云南锗业	2,428,880.00	2.23
221	002063	远光软件	2,428,484.00	2.23
222	600106	重庆路桥	2,427,985.00	2.23
223	601678	滨化股份	2,427,086.00	2.23
224	600996	贵广网络	2,426,707.00	2.23
225	603368	柳药集团	2,426,252.00	2.23
226	300687	赛意信息	2,425,753.00	2.23
227	600572	康恩贝	2,421,427.00	2.23
228	002043	兔宝宝	2,421,379.00	2.23
229	600502	安徽建工	2,419,528.89	2.23
230	600835	上海机电	2,419,360.00	2.23
231	300129	泰胜风能	2,418,696.00	2.22
232	600006	东风汽车	2,418,599.00	2.22
233	603063	禾望电气	2,418,357.50	2.22
234	603588	高能环境	2,417,051.00	2.22
235	603169	兰石重装	2,417,006.00	2.22
236	600477	杭萧钢构	2,416,777.00	2.22
237	603323	苏农银行	2,415,752.00	2.22
238	600072	中船科技	2,414,547.00	2.22
239	300638	广和通	2,414,183.70	2.22
240	603690	至纯科技	2,413,285.20	2.22
241	600248	陕建股份	2,412,041.00	2.22
242	688389	普门科技	2,411,909.61	2.22
243	601900	南方传媒	2,411,317.57	2.22
244	600610	中毅达	2,411,259.00	2.22
245	002390	信邦制药	2,407,049.00	2.21
246	002258	利尔化学	2,406,805.51	2.21
247	601975	招商南油	2,406,629.00	2.21
248	601890	亚星锚链	2,406,147.00	2.21
249	300131	英唐智控	2,405,469.00	2.21
250	002212	天融信	2,404,851.00	2.21
251	000989	九芝堂	2,404,507.00	2.21
252	000589	贵州轮胎	2,403,145.00	2.21
253	600773	西藏城投	2,401,903.00	2.21

254	600320	振华重工	2,401,603.00	2.21
255	300079	数码视讯	2,401,204.00	2.21
256	603918	金桥信息	2,401,173.00	2.21
257	000923	河钢资源	2,401,122.00	2.21
258	600313	农发种业	2,399,291.00	2.21
259	002416	爱施德	2,399,182.00	2.21
260	603619	中曼石油	2,399,054.00	2.21
261	603393	新天然气	2,398,809.94	2.21
262	600537	亿晶光电	2,397,244.54	2.21
263	002163	海南发展	2,396,976.00	2.20
264	300101	振芯科技	2,393,630.84	2.20
265	002467	二六三	2,393,345.00	2.20
266	600459	贵研铂业	2,392,803.60	2.20
267	601011	宝泰隆	2,391,879.00	2.20
268	600059	古越龙山	2,390,671.00	2.20
269	603766	隆鑫通用	2,387,968.00	2.20
270	600108	亚盛集团	2,387,383.00	2.20
271	688326	经纬恒润	2,386,818.91	2.20
272	300261	雅本化学	2,384,743.81	2.19
273	002073	软控股份	2,384,389.00	2.19
274	000426	兴业银锡	2,383,232.00	2.19
275	002544	普天科技	2,381,279.00	2.19
276	002139	拓邦股份	2,381,209.00	2.19
277	002649	博彦科技	2,379,748.00	2.19
278	300083	创世纪	2,379,319.00	2.19
279	000049	德赛电池	2,379,121.55	2.19
280	300323	华灿光电	2,378,821.00	2.19
281	600307	酒钢宏兴	2,378,004.00	2.19
282	300662	科锐国际	2,376,797.00	2.19
283	002707	众信旅游	2,376,563.00	2.19
284	301050	雷电微力	2,373,873.00	2.18
285	300203	聚光科技	2,371,291.00	2.18
286	300525	博思软件	2,370,993.60	2.18
287	002315	焦点科技	2,370,926.00	2.18
288	600490	鹏欣资源	2,370,771.00	2.18
289	600420	国药现代	2,370,505.00	2.18
290	603105	芯能科技	2,370,320.00	2.18
291	600496	精工钢构	2,369,934.00	2.18
292	002079	苏州固锝	2,369,500.00	2.18
293	002421	达实智能	2,369,019.00	2.18
294	002386	天原股份	2,366,741.58	2.18
295	002060	广东建工	2,366,407.00	2.18
296	600269	赣粤高速	2,365,952.00	2.18

297	688116	天奈科技	2,362,566.14	2.17
298	002424	贵州百灵	2,360,211.00	2.17
299	000758	中色股份	2,359,183.74	2.17
300	600787	中储股份	2,358,669.00	2.17
301	603179	新泉股份	2,358,111.70	2.17
302	000034	神州数码	2,358,065.00	2.17
303	688366	昊海生科	2,357,630.84	2.17
304	300041	回天新材	2,357,313.50	2.17
305	600125	铁龙物流	2,356,895.40	2.17
306	000680	山推股份	2,355,939.00	2.17
307	002130	沃尔核材	2,355,579.00	2.17
308	300398	飞凯材料	2,355,249.00	2.17
309	601619	嘉泽新能	2,355,219.00	2.17
310	300360	炬华科技	2,353,813.15	2.17
311	600064	南京高科	2,353,096.00	2.16
312	300199	翰宇药业	2,352,552.07	2.16
313	300217	东方电热	2,352,145.00	2.16
314	300533	冰川网络	2,352,005.00	2.16
315	300075	数字政通	2,351,649.00	2.16
316	300820	英杰电气	2,351,643.00	2.16
317	600266	城建发展	2,351,049.00	2.16
318	002413	雷科防务	2,350,293.00	2.16
319	002276	万马股份	2,349,506.00	2.16
320	300693	盛弘股份	2,348,639.00	2.16
321	000915	华特达因	2,347,621.00	2.16
322	002335	科华数据	2,346,650.00	2.16
323	600366	宁波韵升	2,345,858.00	2.16
324	002121	科陆电子	2,345,763.09	2.16
325	300315	掌趣科技	2,345,759.00	2.16
326	688029	南微医学	2,345,226.46	2.16
327	603018	华设集团	2,343,812.00	2.16
328	000811	冰轮环境	2,343,446.00	2.16
329	300348	长亮科技	2,343,159.00	2.16
330	688083	中望软件	2,342,505.04	2.15
331	000028	国药一致	2,341,737.60	2.15
332	002108	沧州明珠	2,339,920.00	2.15
333	603035	常熟汽饰	2,339,750.00	2.15
334	000837	秦川机床	2,337,584.89	2.15
335	000539	粤电力 A	2,336,398.00	2.15
336	601860	紫金银行	2,335,826.00	2.15
337	300910	瑞丰新材	2,335,245.76	2.15
338	300035	中科电气	2,334,810.00	2.15
339	300005	探路者	2,334,551.00	2.15

340	300494	盛天网络	2,334,035.80	2.15
341	300303	聚飞光电	2,333,235.00	2.15
342	601200	上海环境	2,331,721.52	2.14
343	002171	楚江新材	2,331,479.00	2.14
344	600750	江中药业	2,331,279.00	2.14
345	301039	中集车辆	2,331,267.00	2.14
346	600017	日照港	2,329,865.00	2.14
347	002057	中钢天源	2,329,628.00	2.14
348	002099	海翔药业	2,327,419.00	2.14
349	300170	汉得信息	2,327,397.00	2.14
350	002154	报喜鸟	2,327,383.00	2.14
351	300109	新开源	2,325,102.00	2.14
352	300048	合康新能	2,325,024.00	2.14
353	000982	中银绒业	2,324,802.00	2.14
354	002400	省广集团	2,323,866.00	2.14
355	002270	华明装备	2,323,020.00	2.14
356	300229	拓尔思	2,321,992.00	2.14
357	002023	海特高新	2,320,391.00	2.13
358	002859	洁美科技	2,317,902.52	2.13
359	000957	中通客车	2,315,781.19	2.13
360	688608	恒玄科技	2,315,763.16	2.13
361	002038	双鹭药业	2,313,760.00	2.13
362	000681	视觉中国	2,313,294.00	2.13
363	002182	宝武镁业	2,313,054.98	2.13
364	002291	遥望科技	2,313,038.00	2.13
365	002807	江阴银行	2,312,881.00	2.13
366	002434	万里扬	2,310,847.05	2.13
367	300138	晨光生物	2,310,332.00	2.13
368	300587	天铁股份	2,309,774.00	2.12
369	000572	海马汽车	2,309,331.00	2.12
370	002221	东华能源	2,308,849.67	2.12
371	300232	洲明科技	2,308,072.00	2.12
372	600094	大名城	2,308,007.00	2.12
373	002254	泰和新材	2,307,547.00	2.12
374	300358	楚天科技	2,307,483.00	2.12
375	000555	神州信息	2,306,970.00	2.12
376	300224	正海磁材	2,306,283.80	2.12
377	301268	铭利达	2,306,115.59	2.12
378	600649	城投控股	2,305,303.22	2.12
379	002639	雪人股份	2,302,602.00	2.12
380	603083	剑桥科技	2,302,562.00	2.12
381	002292	奥飞娱乐	2,297,730.00	2.11
382	300827	上能电气	2,297,148.00	2.11

383	300613	富瀚微	2,296,984.00	2.11
384	300630	普利制药	2,296,875.00	2.11
385	600675	中华企业	2,296,396.00	2.11
386	600428	中远海特	2,296,238.00	2.11
387	603477	巨星农牧	2,295,710.00	2.11
388	300087	荃银高科	2,295,258.50	2.11
389	002051	中工国际	2,295,159.00	2.11
390	300077	国民技术	2,294,254.00	2.11
391	300151	昌红科技	2,294,245.00	2.11
392	300181	佐力药业	2,294,074.00	2.11
393	688027	国盾量子	2,293,975.40	2.11
394	000065	北方国际	2,293,680.00	2.11
395	000917	电广传媒	2,293,491.84	2.11
396	002149	西部材料	2,291,043.00	2.11
397	300020	银江技术	2,290,725.00	2.11
398	000650	仁和药业	2,290,210.00	2.11
399	300327	中颖电子	2,290,150.00	2.11
400	002048	宁波华翔	2,289,235.54	2.11
401	600861	北京人力	2,288,344.00	2.10
402	002237	恒邦股份	2,286,453.00	2.10
403	000922	佳电股份	2,285,259.00	2.10
404	002104	恒宝股份	2,285,052.00	2.10
405	300443	金雷股份	2,284,830.00	2.10
406	002382	蓝帆医疗	2,280,241.00	2.10
407	002011	盾安环境	2,279,456.00	2.10
408	600211	西藏药业	2,279,224.00	2.10
409	002837	英维克	2,278,670.20	2.10
410	002068	黑猫股份	2,278,650.00	2.10
411	002061	浙江交科	2,278,499.39	2.10
412	000735	罗牛山	2,276,851.00	2.09
413	000543	皖能电力	2,275,988.00	2.09
414	002488	金固股份	2,274,746.00	2.09
415	300263	隆华科技	2,271,409.00	2.09
416	300065	海兰信	2,271,098.00	2.09
417	002605	姚记科技	2,270,762.00	2.09
418	603906	龙蟠科技	2,270,253.00	2.09
419	002243	力合科创	2,268,812.47	2.09
420	000950	重药控股	2,268,605.00	2.09
421	688018	乐鑫科技	2,267,435.88	2.09
422	300008	天海防务	2,267,391.18	2.09
423	002015	协鑫能科	2,264,847.00	2.08
424	002317	众生药业	2,264,642.00	2.08
425	000848	承德露露	2,264,156.00	2.08

426	300114	中航电测	2,263,939.00	2.08
427	002539	云图控股	2,263,542.02	2.08
428	002075	沙钢股份	2,263,376.00	2.08
429	001696	宗申动力	2,263,078.00	2.08
430	000756	新华制药	2,262,990.07	2.08
431	002458	益生股份	2,262,025.00	2.08
432	301155	海力风电	2,261,981.00	2.08
433	300072	海新能科	2,261,359.00	2.08
434	300463	迈克生物	2,257,620.99	2.08
435	000913	钱江摩托	2,256,487.00	2.08
436	688016	心脉医疗	2,255,365.07	2.07
437	002041	登海种业	2,253,231.00	2.07
438	002239	奥特佳	2,252,812.00	2.07
439	000685	中山公用	2,252,340.00	2.07
440	002517	恺英网络	2,249,286.00	2.07
441	000718	苏宁环球	2,248,941.00	2.07
442	688639	华恒生物	2,247,631.48	2.07
443	000928	中钢国际	2,247,470.00	2.07
444	000767	晋控电力	2,246,632.00	2.07
445	600811	东方集团	2,244,441.00	2.06
446	000420	吉林化纤	2,238,194.00	2.06
447	300119	瑞普生物	2,236,760.00	2.06
448	000488	晨鸣纸业	2,232,088.00	2.05
449	300233	金城医药	2,228,884.87	2.05
450	300332	天壕能源	2,227,883.00	2.05
451	002948	青岛银行	2,227,711.00	2.05
452	002537	海联金汇	2,226,761.00	2.05
453	000059	华锦股份	2,226,746.00	2.05
454	000090	天健集团	2,221,808.00	2.04
455	002726	龙大美食	2,221,454.00	2.04
456	000969	安泰科技	2,219,731.00	2.04
457	002100	天康生物	2,219,126.00	2.04
458	002004	华邦健康	2,217,842.00	2.04
459	688696	极米科技	2,217,131.33	2.04
460	002003	伟星股份	2,210,100.21	2.03
461	002567	唐人神	2,205,168.00	2.03
462	300185	通裕重工	2,204,338.00	2.03
463	688261	东微半导	2,200,706.89	2.02

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

#### 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	600186	莲花健康	3,750,021.00	3.45
2	688408	中信博	3,494,972.55	3.21
3	688123	聚辰股份	3,480,506.71	3.20
4	688568	中科星图	3,444,983.39	3.17
5	688185	康希诺	3,393,211.28	3.12
6	688266	泽璟制药	3,275,188.50	3.01
7	688700	东威科技	3,180,236.40	2.93
8	688091	上海谊众	3,161,347.48	2.91
9	603108	润达医疗	3,146,949.00	2.89
10	688339	亿华通	3,143,760.74	2.89
11	688798	艾为电子	3,115,960.33	2.87
12	688559	海目星	3,108,465.32	2.86
13	688578	艾力斯	3,067,474.34	2.82
14	688133	泰坦科技	3,044,948.53	2.80
15	605123	派克新材	3,004,697.00	2.76
16	688066	航天宏图	2,994,856.61	2.75
17	688106	金宏气体	2,994,493.32	2.75
18	688088	虹软科技	2,952,450.08	2.72
19	688711	宏微科技	2,906,180.88	2.67
20	603896	寿仙谷	2,903,443.00	2.67
21	601137	博威合金	2,894,862.00	2.66
22	603859	能科科技	2,894,351.00	2.66
23	603348	文灿股份	2,890,227.00	2.66
24	600360	华微电子	2,880,367.00	2.65
25	688110	东芯股份	2,873,637.61	2.64
26	600587	新华医疗	2,869,920.00	2.64
27	603728	鸣志电器	2,863,359.00	2.63
28	688596	正帆科技	2,850,846.21	2.62
29	688212	澳华内镜	2,844,227.49	2.62
30	688166	博瑞医药	2,817,179.19	2.59
31	600552	凯盛科技	2,758,733.00	2.54
32	600557	康缘药业	2,755,765.00	2.53
33	605090	九丰能源	2,754,016.00	2.53
34	600197	伊力特	2,750,849.00	2.53
35	688239	航宇科技	2,731,824.03	2.51
36	601126	四方股份	2,731,418.00	2.51
37	688518	联赢激光	2,718,809.51	2.50
38	600877	电科芯片	2,717,168.00	2.50
39	603979	金诚信	2,693,539.00	2.48
40	603300	华铁应急	2,685,235.49	2.47
41	600331	宏达股份	2,678,998.00	2.46
42	688007	光峰科技	2,667,002.72	2.45
43	600850	电科数字	2,652,643.00	2.44

44	600993	马应龙	2,619,468.08	2.41
45	688289	圣湘生物	2,615,057.90	2.41
46	603801	志邦家居	2,609,488.00	2.40
47	600797	浙大网新	2,609,040.00	2.40
48	600055	万东医疗	2,608,561.37	2.40
49	600776	东方通信	2,602,553.00	2.39
50	603393	新天然气	2,594,261.60	2.39
51	600312	平高电气	2,578,653.00	2.37
52	600933	爱柯迪	2,566,497.00	2.36
53	601918	新集能源	2,563,939.00	2.36
54	603118	共进股份	2,560,491.72	2.36
55	603308	应流股份	2,560,244.00	2.35
56	603612	索通发展	2,558,843.00	2.35
57	600586	金晶科技	2,558,607.00	2.35
58	600285	羚锐制药	2,558,543.00	2.35
59	688278	特宝生物	2,554,783.33	2.35
60	600201	生物股份	2,552,700.00	2.35
61	600106	重庆路桥	2,543,600.00	2.34
62	605168	三人行	2,542,962.35	2.34
63	600645	中源协和	2,540,200.20	2.34
64	600986	浙文互联	2,528,800.00	2.33
65	688262	国芯科技	2,522,720.60	2.32
66	603867	新化股份	2,514,652.00	2.31
67	600525	长园集团	2,492,994.00	2.29
68	605376	博迁新材	2,488,746.00	2.29
69	603533	掌阅科技	2,473,920.00	2.28
70	600223	福瑞达	2,468,905.00	2.27
71	688326	经纬恒润	2,465,359.45	2.27
72	601965	中国汽研	2,464,259.00	2.27
73	600976	健民集团	2,457,150.00	2.26
74	603306	华懋科技	2,455,267.00	2.26
75	600006	东风汽车	2,455,251.00	2.26
76	688016	心脉医疗	2,451,402.91	2.25
77	688321	微芯生物	2,447,679.43	2.25
78	603187	海容冷链	2,447,081.10	2.25
79	600151	航天机电	2,445,246.00	2.25
80	600480	凌云股份	2,445,149.00	2.25
81	688037	芯源微	2,440,667.14	2.24
82	688389	普门科技	2,439,487.37	2.24
83	688033	天宜上佳	2,437,048.77	2.24
84	688019	安集科技	2,434,924.03	2.24
85	600821	金开新能	2,432,313.00	2.24
86	600572	康恩贝	2,429,182.00	2.23

87	600363	联创光电	2,419,404.54	2.23
88	601011	宝泰隆	2,417,448.00	2.22
89	600750	江中药业	2,415,155.00	2.22
90	600422	昆药集团	2,410,084.00	2.22
91	688556	高测股份	2,408,350.10	2.22
92	600125	铁龙物流	2,404,995.00	2.21
93	688608	恒玄科技	2,401,700.80	2.21
94	600720	中交设计	2,400,449.00	2.21
95	603477	巨星农牧	2,399,416.00	2.21
96	600996	贵广网络	2,384,649.00	2.19
97	603323	苏农银行	2,381,558.00	2.19
98	600059	吉越龙山	2,380,143.00	2.19
99	688739	成大生物	2,376,560.79	2.19
100	600531	豫光金铅	2,375,990.00	2.19
101	688639	华恒生物	2,368,977.51	2.18
102	600328	中盐化工	2,368,368.80	2.18
103	603881	数据港	2,361,453.40	2.17
104	600366	宁波韵升	2,361,125.00	2.17
105	600158	中体产业	2,359,735.00	2.17
106	600452	涪陵电力	2,352,232.00	2.16
107	601369	陕鼓动力	2,351,500.00	2.16
108	603008	喜临门	2,351,153.00	2.16
109	600210	紫江企业	2,349,717.00	2.16
110	603619	中曼石油	2,349,381.00	2.16
111	601975	招商南油	2,344,506.00	2.16
112	600633	浙数文化	2,343,893.30	2.16
113	603505	金石资源	2,341,595.60	2.15
114	603566	普莱柯	2,339,333.00	2.15
115	600123	兰花科创	2,338,161.00	2.15
116	600248	陕建股份	2,337,419.00	2.15
117	600072	中船科技	2,337,317.00	2.15
118	600729	重庆百货	2,331,533.00	2.14
119	688116	天奈科技	2,330,320.12	2.14
120	600490	鹏欣资源	2,329,048.00	2.14
121	600391	航发科技	2,323,928.00	2.14
122	601858	中国科传	2,311,921.45	2.13
123	600252	中恒集团	2,310,337.00	2.13
124	600888	新疆众和	2,304,834.00	2.12
125	600869	远东股份	2,299,292.00	2.11
126	600206	有研新材	2,296,273.96	2.11
127	600963	岳阳林纸	2,296,221.00	2.11
128	603018	华设集团	2,292,593.30	2.11
129	600017	日照港	2,287,908.00	2.10

130	601619	嘉泽新能	2,277,573.00	2.09
131	600459	贵研铂业	2,274,620.72	2.09
132	603197	保隆科技	2,274,076.50	2.09
133	601860	紫金银行	2,273,731.00	2.09
134	603368	柳药集团	2,273,559.28	2.09
135	600577	精达股份	2,265,885.00	2.08
136	603179	新泉股份	2,262,801.28	2.08
137	688027	国盾量子	2,262,087.64	2.08
138	688676	金盘科技	2,261,100.69	2.08
139	600389	江山股份	2,260,336.00	2.08
140	603888	新华网	2,259,041.36	2.08
141	600649	城投控股	2,251,748.00	2.07
142	603169	兰石重装	2,247,420.00	2.07
143	600269	赣粤高速	2,244,446.00	2.06
144	600211	西藏药业	2,241,182.97	2.06
145	600771	广誉远	2,231,751.00	2.05
146	603690	至纯科技	2,230,138.20	2.05
147	688366	昊海生科	2,229,796.17	2.05
148	603100	川仪股份	2,223,048.00	2.04
149	600305	恒顺醋业	2,222,461.00	2.04
150	688235	百济神州	2,214,436.59	2.04
151	600835	上海机电	2,209,558.00	2.03
152	600138	中青旅	2,206,448.85	2.03
153	688208	道通科技	2,204,687.96	2.03
154	603599	广信股份	2,204,513.20	2.03
155	603766	隆鑫通用	2,203,067.00	2.03
156	600063	皖维高新	2,201,314.00	2.02
157	600478	科力远	2,200,361.00	2.02
158	603083	剑桥科技	2,198,351.00	2.02
159	600094	大名城	2,198,275.00	2.02
160	600811	东方集团	2,197,701.00	2.02
161	600610	中毅达	2,194,917.00	2.02
162	600105	永鼎股份	2,186,036.00	2.01
163	600761	安徽合力	2,185,307.00	2.01
164	601208	东材科技	2,183,415.00	2.01
165	600477	杭萧钢构	2,180,332.00	2.01
166	600773	西藏城投	2,175,779.80	2.00

注：“卖出金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交量）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	1,233,458,418.98
卖出股票收入（成交）总额	559,862,087.77

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投资。

### 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，广誉远中药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	293,925.36

2	应收清算款	219,302.78
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	513,228.14

#### 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

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	301526	国际复材	8,815.45	0.01	新股锁定
2	301517	陕西华达	7,252.54	0.01	新股锁定
3	301489	思泉新材	6,090.45	0.01	新股锁定
4	301413	安培龙	5,353.48	0.00	新股锁定
5	603062	麦加芯彩	1,734.30	0.00	新股锁定

#### 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 (%)
1,008	110,391.30	66,905,502.00	60.13	44,368,933.00	39.87

#### 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	中信保诚人寿保险有	14,999,934.00	13.48

	限公司一成长先锋投 资账户		
2	招商证券股份有限公 司	11,020,025.00	9.90
3	信泰人寿保险股份有 限公司一传统产品	9,934,600.00	8.93
4	方正证券股份有限公 司	7,273,731.00	6.54
5	中信建投证券股份有 限公司	6,308,079.00	5.67
6	华泰证券股份有限公 司	3,800,256.00	3.42
7	中国银河证券股份有 限公司	3,224,740.00	2.90
8	中信证券股份有限公 司	3,019,531.00	2.71
9	常利芳	2,000,077.00	1.80
10	杨丹彤	2,000,038.00	1.80

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

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	15,000.00	0.0135

### 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
基金合同生效日起至报告期期末基金 总申购份额	69,000,000.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基 金总赎回份额	1,071,000,000.00
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	111,274,435.00
--------------	----------------

## § 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

基金管理人：本报告期内，公司 4 名董事发生变更，董事在最近 12 个月内变更未超过百分之五十。

基金托管人：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，无涉及本基金管理人、基金财产、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

本基金初次聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）服务，报告期内应支付给该事务所的报酬为 30,000.00 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

措施	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	平安基金管理有限公司
受到稽查或处罚等措施的时间	2023 年 12 月 29 日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会深圳监管局
受到的具体措施类型	出具警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	公司管理的两只基金在债券投资过程中，参考外部评级机构的范围不符合监管规定。
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	已完成整改
其他	无

#### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

### 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	682,503,823. 94	38.07	502,260.40	38.07	-
信达证券	1	594,104,422. 85	33.14	437,207.68	33.14	-
国投证券	1	323,153,728. 53	18.03	237,809.11	18.02	-
东吴证券	1	193,035,270. 93	10.77	142,057.16	10.77	-
银河证券	3	-	-	-	-	-

注：1 基金交易单元的选择标准如下：

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

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

3、本基金本报告期合同生效，上述租用席位均为本期新增所用。

### 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	-	-	200,000,000. 00	100.00	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
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	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 08 月 04 日
2	平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金发售公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 08 月 04 日
3	平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金托管协议	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 08 月 04 日
4	平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 08 月 04 日
5	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	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 08 月 04 日
6	关于平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金上网发售的提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 08 月 16 日
7	平安基金管理有限公司关于新增平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金网下现金认购代办券商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 08 月 16 日
8	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	2023 年 08 月 26 日
9	平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 08 月 26 日
10	平安基金管理有限公司关于平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金开放申购赎回业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 09 月 04 日
11	平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金份额上市交易公告书	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 09 月 04 日
12	关于新增平安国证 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	2023 年 09 月 07 日
13	平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金上市交易提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 09 月 07 日
14	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	2023 年 09 月 07 日
15	平安基金管理有限公司关于新增平安国证 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	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 09 月 07 日
16	平安基金管理有限公司关于新增平安国证 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	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 09 月 18 日
17	平安基金管理有限公司关于新增东北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	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 09 月 22 日

18	关于新增平安国证 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	2023 年 09 月 22 日
19	平安基金管理有限公司关于旗下基金新增浙商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	2023 年 11 月 14 日
20	平安基金管理有限公司关于旗下基金新增西部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	2023 年 12 月 01 日
21	平安基金管理有限公司关于子公司住所变更的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 12 月 05 日
22	平安基金管理有限公司关于旗下基金新增华金证券股份有限公司为申购赎回代办机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 12 月 11 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	-	-	-	-	-	-	-
个人	1	2023 年 09 月 08 日-2023 年 09 月 17 日	0.00	404,902,454.00	404,902,454.00	0.00	-

#### 产品特有风险

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。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 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

2024 年 3 月 29 日