

# 平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

## 2024 年年度报告

2024 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：2025 年 3 月 28 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 2025 年 03 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告除特别注明外，金额单位均为人民币元。

本报告期自 2024 年 01 月 01 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 .....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	12
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 .....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 .....	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	14
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 .....	14
§ 5 托管人报告 .....	15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 .....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 .....	15
§ 6 审计报告 .....	15
6.1 审计报告基本信息 .....	15
6.2 审计报告的基本内容 .....	15
§ 7 年度财务报表 .....	17
7.1 资产负债表 .....	17
7.2 利润表 .....	18
7.3 净资产变动表 .....	20
7.4 报表附注 .....	21

<b>§ 8 投资组合报告 .....</b>	<b>47</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	47
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	47
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	49
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	65
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	66
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 .....	66
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 .....	66
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 .....	66
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 .....	66
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	66
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	66
8.12 投资组合报告附注 .....	67
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>67</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	67
9.2 期末上市基金前十名持有人 .....	68
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	68
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 .....	68
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 .....	68
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>68</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>69</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	69
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 .....	69
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	69
11.4 基金投资策略的改变 .....	69
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	69
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 .....	69
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	69
11.8 其他重大事件 .....	70
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>72</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 .....	72
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	72
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>72</b>
13.1 备查文件目录 .....	72
13.2 存放地点 .....	72
13.3 查阅方式 .....	72

## § 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 (自 2025 年 3 月 26 日起, 本基金的场内简称变更为国证 2000ETF 指数基金。)
基金主代码	159521
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023 年 8 月 25 日
基金管理人	平安基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	33,274,435.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2023 年 9 月 7 日

### 2.2 基金产品说明

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

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	平安基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李海波
	联系电话	0755-88622632
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn
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 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
办公地址	深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	518048	518040
法定代表人	罗春风	缪建民

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	容诚会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢 10 层 1001-1 至 1001-26
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2024 年	2023 年 8 月 25 日（基金合同生效日） - 2023 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-10,029,239.77	1,690,560.60
本期利润	-4,840,261.19	-1,439,945.23
加权平均基金份额本期利润	-0.0692	-0.0050
本期加权平均净值利润率	-7.98%	-0.50%
本期基金份额净值增长率	-1.84%	-2.30%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末	2023 年末
期末可供分配利润	-2,242,753.72	-2,556,047.11
期末可供分配基金份额利润	-0.0674	-0.0230
期末基金资产净值	31,910,628.55	108,718,387.89
期末基金份额净值	0.9590	0.9770

3.1.3 累计期末指标	2024 年末	2023 年末
基金份额累计净值增长率	-4.10%	-2.30%

- 注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；  
 2. 期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，而非当期发生数）；  
 3. 上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

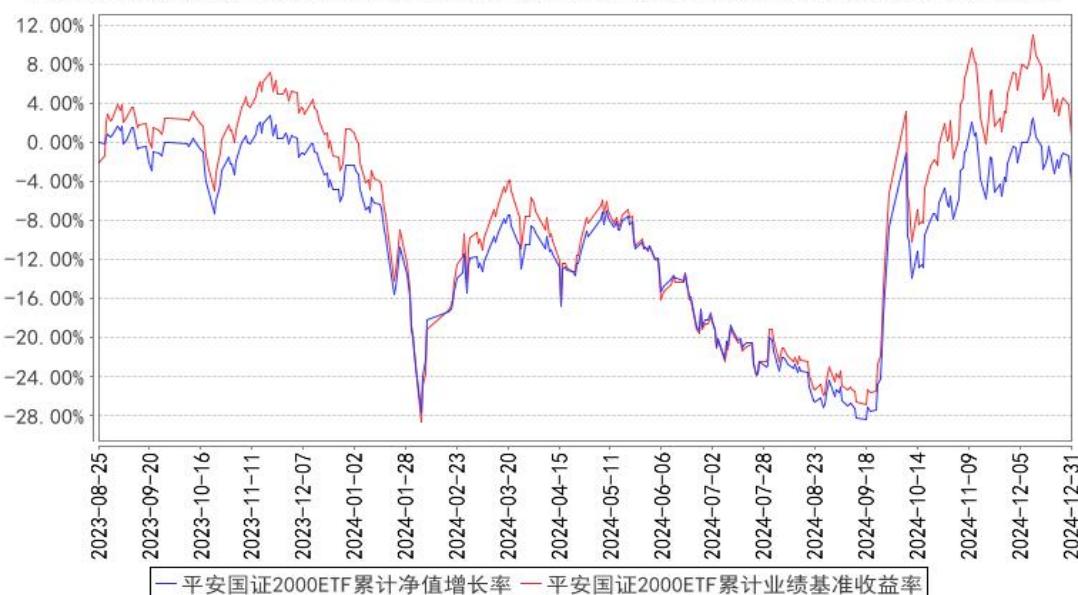
## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	5.07%	2.35%	6.20%	2.53%	-1.13%	-0.18%
过去六个月	17.25%	2.20%	23.58%	2.32%	-6.33%	-0.12%
过去一年	-1.84%	2.04%	-0.73%	2.23%	-1.11%	-0.19%
自基金合同生效起至今	-4.10%	1.82%	0.57%	1.99%	-4.67%	-0.17%

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

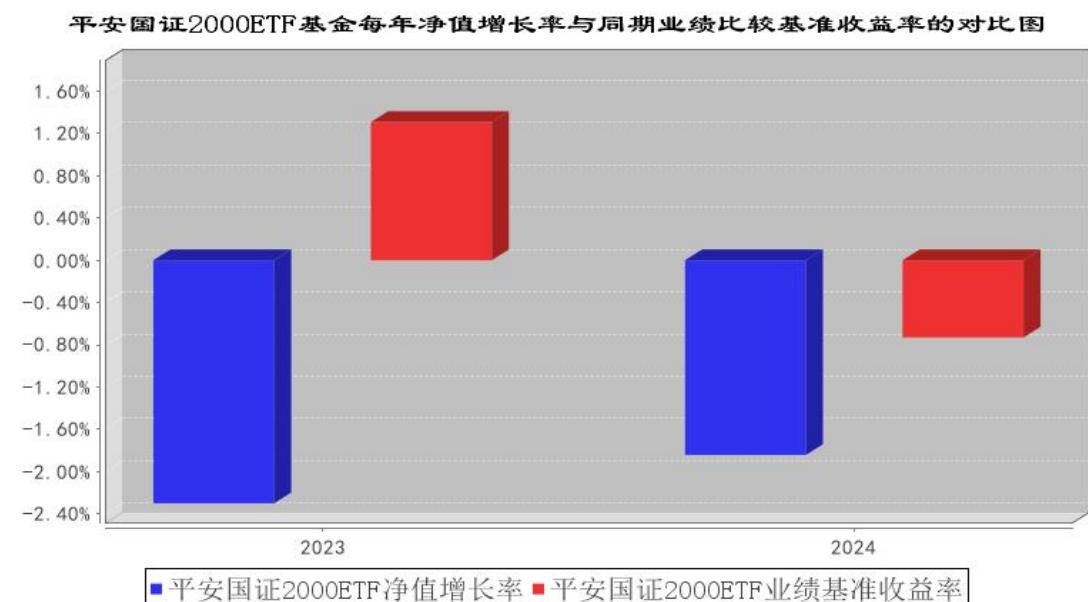
平安国证 2000ETF 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2023 年 08 月 25 日正式生效；

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

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



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、海外、专户七大业务板块。基于平安集团四大研究院和集团整体科技基础设施，平安基金构建了以智能投研、智能运营、智能销售、

智慧风控四大应用方向为基础的资产管理智能解决方案，致力于成为国内领先的科技赋能型智慧资产管理公司。截至 2024 年 12 月 31 日，平安基金共管理 215 只公募基金，公募资产管理总规模约为 6371 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	-	13 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、平安中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金、平安中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、平安国证 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、平安中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金、平安中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安上证红利低波动指数型证券投资基金、平安中证汽车零部件主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理。
李严	平安国证 2000 交易 型开放式 指数证券 投资基金 基金经理	2024 年 1 月 29 日	-	4 年	李严先生，复旦大学应用统计学专业硕士，曾担任东北证券股份有限公司上海证券研究咨询分公司证券分析师。2023 年 4 月加入平安基金管理有限公司，现任 ETF 指数投资中心高级研究员，同时担任平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安创业板交易型开放式指数证券投资基金、平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、平安创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证

					券投资基金、平安中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金、平安中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金、平安中证沪深港黄金产业股票交易型开放式指数证券投资基金基金经理。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 5-10 年期国债活跃券交易型开放式指数证券投资基金、平安中债-中高等级公司债利差因子交易型开放式指数证券投资基金、平安中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金、平安中证粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金、平安中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金、平安中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金、平安中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、平安中证医药及医疗器械创新交易型开放式指数证券投资基金、平安中证新材料主题交易型开放式指数证券投资基金、平安中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、平安中证光伏产业指数组型发起式证券投资基金、平安中证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金、平安中证沪港深线上消费主题交易型开放式指数证券投资基金、平安中证港股通医药卫生综合交易型开放式指数证券投资基金、平安富时中国国企开放共赢交易型开放式指数证券投资基金、平安中证医药及医疗器械创新指数组型发起式证券投资基金、平安中证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、平安中债-0-3 年国开行债券交易型开放式指数证券投资基金、平安中证港股通医药卫生综合交易型开放式指数组证券投资基金联接基金经理助理。
李严	平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理	2024 年 1 月 11 日	2024 年 1 月 29 日	4 年	李严先生, 复旦大学应用统计学专业硕士, 曾担任东北证券股份有限公司上海证券研究咨询分公司证券分析师。2023 年 4 月加入平安基金管理有限公司, 现任 ETF 指数投资中心高级研究员, 同时担任平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基

				金联接基金、平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安创业板交易型开放式指数证券投资基金、平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、平安创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金、平安中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金、平安中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金、平安中证沪深港黄金产业股票交易型开放式指数证券投资基金基金经理。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 5-10 年期国债活跃券交易型开放式指数证券投资基金、平安中债-中高等级公司债利差因子交易型开放式指数证券投资基金、平安中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金、平安中证粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金、平安中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金、平安中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金、平安中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、平安中证医药及医疗器械创新交易型开放式指数证券投资基金、平安中证新材料主题交易型开放式指数证券投资基金、平安中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、平安中证光伏产业指数组型发起式证券投资基金、平安中证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金、平安中证沪港深线上消费主题交易型开放式指数证券投资基金、平安中证港股通医药卫生综合交易型开放式指数证券投资基金、平安富时中国国企开放共赢交易型开放式指数证券投资基金、平安中证医药及医疗器械创新指数组型发起式证券投资基金、平安中证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、平安中债-0-3 年国开行债券交易型开放式指数证券投资基金、平安中证港股通医药卫生综合交易型开放式指
--	--	--	--	---

					数证券投资基金管理基金基金经理助理。
--	--	--	--	--	--------------------

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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

注：无。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作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

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。

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

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.9590 元，本报告期基金份额净值增长率为 -1.84%，业绩比较基准收益率为 -0.73%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

自 2024 年 9 月底货币财政“组合拳”以来，A 股市场的流动性出现了反转性的变化，市场交易思维也从存量博弈转向增量进取的节奏。展望 2025 年上半年，对于 A 股市场可以更加积极乐观一些。

从国内经济上看，25 年会是财政持续扩张的一年。当前处于经济体制转型的拐点，政策方向在于启动新一轮化债后改善地方财政支出结构、打通流动性拐点，支持稳楼市、促消费、修复居民资产负债表，持续推动经济良性循环。中央财政的持续发力程度将是市场交易的长期最重要变量。

从市场上看，由科技浪潮引领的投资主线行情有望贯穿全年，看好由主线带动整体市场价格中枢的上移，从而带来更好的赚钱效应。但是节奏上需要进行把握，25 年会存在现实与预期的碰撞，政策指引下的持续上行方向是明确的，但是市场的过热情绪、预期定价往往与现实节奏出现偏离，从而引起市场的波动。在投资策略上更加注重核心卫星的方法，核心配置策略用来交易政策导向下的经济复苏预期，而卫星交易策略把握市场题材带来的市场波动。

作为指数投资管理人，我们继续坚持做好工具化产品运营，与投资者同行。

#### 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 人的情形。本基金报告期内出现连续 20 个工作日基金资产净值低于 5,000 万元的情形。截至报告期末，以上情况未消除。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：

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

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

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

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

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

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

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

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	容诚审字[2025]200Z0236 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	我们审计了平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“平安国证 2000ETF 基金”)财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和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 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。

	审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，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。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>平安国证 2000ETF 基金的基金管理人平安基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估平安国证 2000ETF 基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算平安国证 2000ETF 基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <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> <ul style="list-style-type: none"> <li>(1)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</li> <li>(2)了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</li> <li>(3)评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</li> <li>(4)对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对平安国证 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</li> </ul>

	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。
	（5）评价财务报表的总体列报、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 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。
会计师事务所的名称	容诚会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	沈兆杰 李崇
会计师事务所的地址	北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 框 10 层 1001-1 至 1001-26
审计报告日期	2025 年 3 月 24 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金管理人

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	2,163,170.92	4,536,025.31
结算备付金		65,940.27	272,008.18
存出保证金		7,641.36	293,925.36
交易性金融资产	7.4.7.2	30,481,042.60	103,892,268.79
其中：股票投资		30,481,042.60	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		32,717,795.15	109,213,530.42
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年12月31日</b>	<b>上年度末 2023年12月31日</b>
<b>负债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7. 4. 7. 3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		546,335.52	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		17,533.12	46,713.73
应付托管费		3,506.63	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	239,791.33	439,086.05
负债合计		807,166.60	495,142.53
<b>净资产:</b>			
实收基金	7. 4. 7. 10	33,274,435.00	111,274,435.00
未分配利润	7. 4. 7. 12	-1,363,806.45	-2,556,047.11
净资产合计		31,910,628.55	108,718,387.89
负债和净资产总计		32,717,795.15	109,213,530.42

注： 报告截止日 2024 年 12 月 31 日， 基金份额净值 0.9590 元， 基金份额总额 33,274,435.00 份。

## 7.2 利润表

会计主体：平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年1月1日至2024年 12月31日	上年度可比期间 2023年8月25日(基金合 同生效日)至2023年12 月31日
<b>一、营业总收入</b>		-4,200,185.73	-703,324.28
1. 利息收入		14,433.08	208,555.03
其中：存款利息收入	7. 4. 7. 13	14,433.08	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“-”号填列)		-9,348,791.84	1,232,164.77
其中: 股票投资收益	7.4.7.14	-10,227,886.50	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	879,094.66	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	5,188,978.58	-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	-54,805.55	986,461.75
<b>减: 二、营业总支出</b>		640,075.46	736,620.95
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	306,163.84	486,994.20
其中: 暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	61,232.74	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	272,678.88	152,227.89
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		-4,840,261.19	-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>		-4,840,261.19	-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>		-4,840,261.19	-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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期			
	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	111,274,435.00	-	-2,556,047.11	108,718,387.89
二、本期期初净资产	111,274,435.00	-	-2,556,047.11	108,718,387.89
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-78,000,000.00	-	1,192,240.66	-76,807,759.34
(一)、综合收益总额	-	-	-4,840,261.19	-4,840,261.19
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	-78,000,000.00	-	6,032,501.85	-71,967,498.15
其中：1. 基金申购款	66,000,000.00	-	-9,776,645.45	56,223,354.55
2. 基金赎回款	-144,000,000.00	-	15,809,147.30	-128,190,852.70
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	33,274,435.00	-	-1,363,806.45	31,910,628.55
项目	上年度可比期间			
	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	-1,002,000,000	-	-2,556,047.11	-1,004,556,047.

变动额(减少以“-”号填列)	. 00			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净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	-1, 002, 000, 000 . 00	-	-1, 116, 101. 88	-1, 003, 116, 101. 88
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. 90
(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管理法》和《平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于国证 2000 指数的成份股及其备选成份股(包括存托凭证)。为更好地实现投资目标，本基金还可投资于非成份股(包括主板、创业板及其他经中国证监会允许投资的股票、存托凭证)、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债券、政府支持债券等)、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权、信用衍生品、银行存款(协议存款、通知存款以及定期存款等)、同业存单、资产支持证券、债券回购、现金以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金将根据法律法规的规定参与融资和转融通证券出借业务。本基金的投资组合比例为：本基金投资于国证 2000 指数的成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。本基金在每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：国证 2000 指数收益率。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(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基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

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 2024 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

## 7.4.4 重要会计政策和会计估计

### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。比较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。

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

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；  
(2)该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者  
(3)该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报  
酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### **7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则**

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值  
并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最  
近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。  
有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价  
格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的  
公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制  
等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基  
金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够的可利用数据和其他信息  
支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关  
资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

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

#### **7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

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

#### **7.4.4.7 实收基金**

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

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

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

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

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

#### **7.4.4.8 损益平准金**

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### **7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量**

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价

值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

#### **7.4.4.10 费用的确认和计量**

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

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

#### **7.4.4.11 基金的收益分配政策**

本基金的收益分配政策为：(1) 基金收益评价日核定的基金份额净值增长率超过同期标的指数增长率达到 0.01% 以上时，基金管理人可进行收益分配；(2) 本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近同期标的指数增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值；(3) 本基金的收益分配采取现金分红的方式；(4) 《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；(5) 每一基金份额享有同等分配权；(6) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### **7.4.4.12 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。

##### **7.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### **7.4.5.3 差错更正的说明**

本基金本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### **7.4.6 税项**

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	2,163,170.92	4,536,025.31
等于：本金	2,162,983.08	4,535,571.44
加：应计利息	187.84	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	2,163,170.92	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 2024 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动

股票	28,422,569.85	-	30,481,042.60	2,058,472.75
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	28,422,569.85	-	30,481,042.60	2,058,472.75
项目	上年度末 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 2024 年 12 月 31 日，股票投资的公允价值和公允价值变动包含的可退替代款的估值增值为零(2023 年 12 月 31 日：同)。

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

##### 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末未持有期货合约。

##### 7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

**7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明**

无。
----

**7.4.7.5 债权投资****7.4.7.5.1 债权投资情况**

注：本基金本报告期末及上年度末均无债权投资。

**7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况**

注：本基金本报告期末及上年度末均无债权投资。

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

注：本基金本报告期末及上年度末均无其他债权投资。

**7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况**

注：本基金本报告期末及上年度末无其他债权投资。

**7.4.7.7 其他权益工具投资****7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况**

注：本基金本报告期末及上年度末无其他权益工具投资。

**7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况**

注：本基金本报告期末及上年度末无其他权益工具投资。

**7.4.7.8 其他资产**

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

**7.4.7.9 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2024年12月31日	上年度末 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	4,543.06	151,503.21
其中：交易所市场	4,543.06	151,503.21
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	120,000.00	86,356.16
应退退补款	115,248.27	125,961.50
可退替代款	-	592.00
现金差额	-	74,673.18
合计	239,791.33	439,086.05

注：1. 应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 2024年1月1日至2024年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	111,274,435.00	111,274,435.00
本期申购	66,000,000.00	66,000,000.00
本期赎回(以“-”号填列)	-144,000,000.00	-144,000,000.00
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	33,274,435.00	33,274,435.00

注：投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购、赎回单位的整数倍。

#### 7.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期末及上年度末无其他综合收益。

#### 7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,276,220.00	-3,832,267.11	-2,556,047.11
本期期初	1,276,220.00	-3,832,267.11	-2,556,047.11
本期利润	-10,029,239.77	5,188,978.58	-4,840,261.19
本期基金份额交易产生的变动数	6,510,266.05	-477,764.20	6,032,501.85
其中：基金申购款	-3,560,255.65	-6,216,389.80	-9,776,645.45
基金赎回款	10,070,521.70	5,738,625.60	15,809,147.30
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,242,753.72	878,947.27	-1,363,806.45

#### 7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日		上年度可比期间 2023年8月25日(基金合同生效日)至2023年12月
	2024年1月1日至2024年12月31日	日	

		31 日
活期存款利息收入	10,415.16	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	2,825.65	36,755.87
其他	1,192.27	4,009.90
合计	14,433.08	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 2024年1月1日至2024年12月31 日	上年度可比期间 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	-8,195,761.16	-417,184.30
股票投资收益——赎回差价收入	-2,032,125.34	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	-10,227,886.50	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 2024年1月1日至2024年12月31 日	上年度可比期间 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	95,329,657.04	559,862,087.77
减：卖出股票成本总额	103,361,611.13	558,565,067.94
减：交易费用	163,807.07	1,714,204.13
买卖股票差价收入	-8,195,761.16	-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 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 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	128,190,852.70	1,071,563,003.90
减：现金支付赎回款总额	61,302,876.70	464,945,139.90
减：赎回股票成本总额	68,920,101.34	605,088,925.42
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	-2,032,125.34	1,528,938.58

#### 7.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无股票投资收益—申购差价收入。

#### 7.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无股票投资收益——证券出借差价收入。

### 7.4.7.15 债券投资收益

#### 7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无债券投资收益。

#### 7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无债券买卖差价收入。

#### 7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无债券赎回差价收入。

#### 7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无债券申购差价收入。

### 7.4.7.16 资产支持证券投资收益

#### 7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无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：本基金本报告期内及上年度可比期间均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：本基金本报告期内及上年度可比期间均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：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资。

#### 7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资。

#### 7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资。

#### 7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资。

#### 7.4.7.18 衍生工具收益

##### 7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

##### 7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具收益——其他投资收益。

#### 7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月 31日	上年度可比期间 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	879,094.66	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	879,094.66	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 2024年1月1日至2024年 12月31日	上年度可比期间 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	5,188,978.58	-3,130,505.83
股票投资	5,188,978.58	-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	5,188,978.58	-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  
(2023 年度：同)。

#### 7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 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	-54,805.55	986,461.75
合计	-54,805.55	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：本基金本报告期内及上年度可比期间均无信用减值损失。

#### 7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 8 月 25 日（基金合同生效日） 至 2023 年 12 月 31 日
审计费用	20,000.00	30,000.00
信息披露费	80,000.00	50,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	2,278.88	3,371.73
其他	170,400.00	68,856.16
合计	272,678.88	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

根据《公开募集证券投资基金管理办法》的相关规定，开放式基金在基金合同生效后，连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5.000 万元情形的，

基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。于 2025 年 2 月 11 日，本基金出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5,000 万元的情形，本基金的基金管理人已向中国证监会报告并在评估后续处理方案。

#### 7.4.9 关联方关系

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 7.4.10.1.2 债券交易

注：

本基金本报告期内及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的债券交易。

###### 7.4.10.1.3 债券回购交易

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

###### 7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

###### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

### 7.4.10.2 关联方报酬

#### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12 月31日	上年度可比期间 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	306,163.84	486,994.20
其中：应付销售机构的客户维护 费	19,574.59	11,145.86
应支付基金管理人的净管理费	286,589.25	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 2024年1月1日至2024年12 月31日	上年度可比期间 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	61,232.74	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：本基金本报告期内及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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

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

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

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

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

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024年12月31日		上年度末 2023年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例（%）
方正证券	3,041,361.00	9.1402	7,273,731.00	6.5367

注：投资相关费率符合基金合同和招募说明书等法律文件的约定

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年12月31日		上年度可比期间 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	期末余额	当期利息收入
招商银行-活期	2,163,170.92	10,415.16	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：本基金本报告期内及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2024年12月31日）本基金持有的流通受限证券

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

注：本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期内未持有暂时停牌等流通受限股票。

### 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。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（上年度末：同）。

#### 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 2024年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
货币资金	2,163,170.92	-	-	-	2,163,170.92
结算备付金	65,940.27	-	-	-	65,940.27
存出保证金	7,641.36	-	-	-	7,641.36
交易性金融资产	-	-	-	30,481,042.60	30,481,042.60
<b>资产总计</b>	<b>2,236,752.55</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>30,481,042.60</b>	<b>32,717,795.15</b>
<b>负债</b>					
应付管理人报酬	-	-	-	17,533.12	17,533.12
应付托管费	-	-	-	3,506.63	3,506.63
应付清算款	-	-	-	546,335.52	546,335.52
其他负债	-	-	-	239,791.33	239,791.33
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>807,166.60</b>	<b>807,166.60</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>2,236,752.55</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>29,673,876.00</b>	<b>31,910,628.55</b>
<b>上年度末</b>	<b>1年以内</b>	<b>1-5年</b>	<b>5年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>

2023 年 12 月 31 日					
<b>资产</b>					
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	
<b>资产总计</b>	<b>5,101,958.85</b>	<b>-</b>	<b>-104,111,571.57</b>	<b>109,213,530.42</b>	
<b>负债</b>					
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	
<b>负债总计</b>	<b>5,101,958.85</b>	<b>-</b>	<b>-103,616,429.04</b>	<b>108,718,387.89</b>	

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（上年度末：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年度末：同）。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 7.4.13.4.2.1 外汇风险的敏感性分析

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 2024 年 12 月 31 日		上年度末 2023年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)

交易性金融资产—股票投资	30,481,042.60	95.52	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	30,481,042.60	95.52	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）	
分析		本期末（2024 年 12 月 31 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
沪深 300 指数上升 5%	1,961,541.45	4,700,047.22	
沪深 300 指数下降 5%	-1,961,541.45	-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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	30,481,042.60	103,628,804.33
第二层次	—	190,800.00
第三层次	—	72,664.46
合计	30,481,042.60	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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	0.00	72,664.46	72,664.46
当期购买	0.00	0.00	0.00
当期出售/结算	0.00	0.00	0.00
转入第三层次	0.00	9,263.00	9,263.00
转出第三层次	0.00	72,664.46	72,664.46
当期利得或损失总额	0.00	-9,263.00	-9,263.00
其中：计入损益的利得或损失	0.00	-9,263.00	-9,263.00
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	0.00	0.00
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—	0.00	-9,263.00	-9,263.00

一公允价值变动损益				
项目	上年度可比期间 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	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	0.00
转入第三层次	0.00	0.00	0.00	0.00
转出第三层次	0.00	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	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：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
-	-	-	-	-	-
项目	上年度末公允价值	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	平均价格亚洲期权模型	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 2024 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(2023 年 12 月 31 日：同)。

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 基金申购款于 2024 年度，本基金申购基金份额的对价总额为 56,223,354.55 元(2023 年 8 月 25 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日：68,446,902.02 元)，其中包括以股票支付的申购款 24,637,835.2 元和以现金支付的申购款 31,585,519.35 元(2023 年 8 月 25 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日：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	30,481,042.60	93.16
	其中：股票	30,481,042.60	93.16
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	2,229,111.19	6.81
8	其他各项资产	7,641.36	0.02
9	合计	32,717,795.15	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	260,717.00	0.82
B	采矿业	511,464.64	1.60
C	制造业	19,916,166.82	62.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	672,279.72	2.11

E	建筑业	457,903.00	1.43
F	批发和零售业	835,839.10	2.62
G	交通运输、仓储和 邮政业	620,125.00	1.94
H	住宿和餐饮业	60,086.00	0.19
I	信息传输、软件和 信息技术服务业	3,727,083.77	11.68
J	金融业	293,885.00	0.92
K	房地产业	483,036.00	1.51
L	租赁和商务服务 业	342,469.80	1.07
M	科学研究和技术 服务业	564,403.99	1.77
N	水利、环境和公共 设施管理业	350,154.30	1.10
O	居民服务、修理和 其他服务业	-	-
P	教育	7,048.00	0.02
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐 业	340,909.00	1.07
S	综合	18,480.00	0.06
	合计	29,462,051.14	92.33

### 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	314,224.18	0.98
D	电力、热力、燃气 及水生产和供应业	161,046.00	0.50
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和 邮政业	152,015.00	0.48
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和 信息技术服务业	391,706.28	1.23
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服 务业	-	-
N	水利、环境和公共	-	-

	设施管理业		
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,018,991.46	3.19

### 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	600064	南京高科	50,800	394,716.00	1.24
2	300674	宇信科技	14,000	273,280.00	0.86
3	002839	张家港行	62,400	272,688.00	0.85
4	688018	乐鑫科技	1,080	235,440.00	0.74
5	301171	易点天下	8,200	231,158.00	0.72
6	600363	联创光电	4,600	220,248.00	0.69
7	600850	电科数字	9,100	217,490.00	0.68
8	688088	虹软科技	5,332	205,601.92	0.64
9	300857	协创数据	1,700	181,713.00	0.57
10	601028	玉龙股份	15,700	179,922.00	0.56
11	002315	焦点科技	4,300	179,224.00	0.56
12	300627	华测导航	4,200	175,560.00	0.55
13	600648	外高桥	14,700	175,077.00	0.55
14	300525	博思软件	11,200	174,496.00	0.55
15	300679	电连技术	2,900	173,130.00	0.54
16	002851	麦格米特	2,800	172,088.00	0.54
17	002222	福晶科技	5,170	167,508.00	0.52
18	603039	泛微网络	3,400	166,600.00	0.52
19	002130	沃尔核材	6,300	159,075.00	0.50
20	002063	远光软件	26,400	152,064.00	0.48
21	000810	创维数字	9,400	149,648.00	0.47
22	002139	拓邦股份	10,300	140,183.00	0.44
23	300811	铂科新材	2,600	140,166.00	0.44
24	300570	太辰光	1,900	138,130.00	0.43
25	301050	雷电微力	2,620	135,139.60	0.42
26	688116	天奈科技	3,400	131,954.00	0.41

27	601137	博威合金	6,400	129,920.00	0.41
28	002126	银轮股份	6,700	125,424.00	0.39
29	300638	广和通	6,000	120,900.00	0.38
30	688016	心脉医疗	1,100	120,835.00	0.38
31	300770	新媒股份	2,900	117,189.00	0.37
32	600158	中体产业	13,800	114,126.00	0.36
33	300687	赛意信息	6,200	112,840.00	0.35
34	300613	富瀚微	1,900	111,150.00	0.35
35	603306	华懋科技	3,500	110,635.00	0.35
36	605168	三人行	3,080	110,633.60	0.35
37	688279	峰昭科技	700	110,390.00	0.35
38	688300	联瑞新材	1,700	109,480.00	0.34
39	603267	鸿远电子	3,000	108,690.00	0.34
40	300319	麦捷科技	8,600	107,328.00	0.34
41	002351	漫步者	6,500	107,250.00	0.34
42	002605	姚记科技	3,900	103,974.00	0.33
43	603662	柯力传感	1,600	103,360.00	0.32
44	600452	涪陵电力	9,708	102,807.72	0.32
45	300224	正海磁材	8,300	102,173.00	0.32
46	300655	晶瑞电材	10,900	102,024.00	0.32
47	688190	云路股份	1,100	101,200.00	0.32
48	600757	长江传媒	10,500	100,485.00	0.31
49	300900	广联航空	4,560	100,320.00	0.31
50	600459	贵研铂业	7,300	100,229.00	0.31
51	601208	东材科技	13,200	99,528.00	0.31
52	688630	芯碁微装	1,700	98,124.00	0.31
53	300827	上能电气	2,200	96,580.00	0.30
54	688408	中信博	1,341	96,552.00	0.30
55	002245	蔚蓝锂芯	9,000	96,210.00	0.30
56	603383	顶点软件	2,460	92,250.00	0.29
57	600201	生物股份	13,400	91,924.00	0.29
58	002215	诺普信	8,100	90,963.00	0.29
59	600821	金开新能	16,800	90,720.00	0.28
60	300327	中颖电子	3,700	90,539.00	0.28
61	300087	荃银高科	7,600	89,680.00	0.28
62	601512	中新集团	11,500	88,320.00	0.28
63	600888	新疆众和	12,400	88,040.00	0.28
64	300634	彩讯股份	4,000	87,200.00	0.27
65	002117	东港股份	7,300	85,264.00	0.27
66	002057	中钢天源	11,800	85,196.00	0.27
67	002004	华邦健康	18,300	82,716.00	0.26
68	688596	正帆科技	2,324	82,618.20	0.26
69	688348	昱能科技	1,680	81,984.00	0.26

70	688700	东威科技	2,773	81,692.58	0.26
71	688409	富创精密	1,584	81,686.88	0.26
72	002698	博实股份	4,700	79,900.00	0.25
73	600971	恒源煤电	8,400	79,044.00	0.25
74	688007	光峰科技	5,300	78,387.00	0.25
75	002675	东诚药业	6,400	78,208.00	0.25
76	300768	迪普科技	4,400	77,000.00	0.24
77	300576	容大感光	1,700	76,806.00	0.24
78	688198	佰仁医疗	700	76,307.00	0.24
79	603599	广信股份	6,300	75,915.00	0.24
80	002335	科华数据	2,600	75,192.00	0.24
81	688601	力芯微	1,800	74,574.00	0.23
82	688259	创耀科技	2,100	73,731.00	0.23
83	600428	中远海特	10,000	73,000.00	0.23
84	300793	佳禾智能	3,700	72,927.00	0.23
85	688800	瑞可达	1,454	72,859.94	0.23
86	301031	中熔电气	700	72,814.00	0.23
87	000612	焦作万方	11,300	72,546.00	0.23
88	603063	禾望电气	3,605	71,955.80	0.23
89	603859	能科科技	2,400	71,760.00	0.22
90	603258	电魂网络	3,600	71,604.00	0.22
91	300532	今天国际	6,150	70,233.00	0.22
92	688639	华恒生物	2,166	69,766.86	0.22
93	688166	博瑞医药	2,304	69,580.80	0.22
94	688106	金宏气体	4,083	69,451.83	0.22
95	688366	昊海生科	1,140	69,061.20	0.22
96	002332	仙琚制药	6,900	68,586.00	0.21
97	600587	新华医疗	4,100	68,265.00	0.21
98	688305	科德数控	1,000	68,170.00	0.21
99	601882	海天精工	3,100	67,983.00	0.21
100	300470	中密控股	1,800	67,860.00	0.21
101	300693	盛弘股份	2,500	67,400.00	0.21
102	002020	京新药业	5,200	66,560.00	0.21
103	000811	冰轮环境	5,400	66,204.00	0.21
104	300685	艾德生物	2,900	66,120.00	0.21
105	002539	云图控股	8,400	65,688.00	0.21
106	002401	中远海科	4,100	65,108.00	0.20
107	688127	蓝特光学	2,400	65,040.00	0.20
108	600572	康恩贝	13,900	64,774.00	0.20
109	002519	银河电子	10,900	64,746.00	0.20
110	002458	益生股份	6,700	64,387.00	0.20
111	300580	贝斯特	2,800	64,260.00	0.20
112	688029	南微医学	947	64,007.73	0.20

113	688690	纳微科技	3,624	63,782.40	0.20
114	600750	江中药业	2,800	63,560.00	0.20
115	300872	天阳科技	4,000	63,000.00	0.20
116	000090	天健集团	15,300	62,883.00	0.20
117	688035	德邦科技	1,700	62,475.00	0.20
118	688556	高测股份	5,580	62,384.40	0.20
119	600125	铁龙物流	10,500	62,265.00	0.20
120	600269	赣粤高速	11,000	61,710.00	0.19
121	002093	国脉科技	7,900	61,620.00	0.19
122	600586	金晶科技	10,900	61,258.00	0.19
123	002276	万马股份	7,200	60,912.00	0.19
124	002891	中宠股份	1,700	60,690.00	0.19
125	002706	良信股份	7,900	60,672.00	0.19
126	002338	奥普光电	1,600	60,352.00	0.19
127	688621	阳光诺和	1,600	60,320.00	0.19
128	300428	立中集团	3,700	60,310.00	0.19
129	688677	海泰新光	1,600	60,256.00	0.19
130	002334	英威腾	8,000	60,160.00	0.19
131	002106	莱宝高科	5,500	60,005.00	0.19
132	002947	恒铭达	1,800	59,994.00	0.19
133	600502	安徽建工	12,500	59,750.00	0.19
134	600776	东方通信	5,300	59,307.00	0.19
135	002859	洁美科技	2,828	58,681.00	0.18
136	300217	东方电热	13,000	58,630.00	0.18
137	300779	惠城环保	600	58,560.00	0.18
138	688383	新益昌	1,300	58,331.00	0.18
139	002965	祥鑫科技	1,700	58,191.00	0.18
140	603393	新天然气	1,900	57,513.00	0.18
141	688289	圣湘生物	2,524	57,294.80	0.18
142	603128	华贸物流	8,900	57,227.00	0.18
143	300566	激智科技	2,900	57,188.00	0.18
144	300855	图南股份	2,600	56,992.00	0.18
145	300260	新莱应材	2,100	56,889.00	0.18
146	300662	科锐国际	2,700	56,862.00	0.18
147	000928	中钢国际	8,900	56,693.00	0.18
148	002895	川恒股份	2,300	56,580.00	0.18
149	000501	武商集团	5,400	56,484.00	0.18
150	300041	回天新材	6,100	56,120.00	0.18
151	002991	甘源食品	600	56,112.00	0.18
152	002006	精工科技	3,400	56,100.00	0.18
152	002815	崇达技术	5,500	56,100.00	0.18
153	002061	浙江交科	13,700	55,896.00	0.18
154	688508	芯朋微	1,300	55,861.00	0.18

155	300835	龙磁科技	1,800	55,656.00	0.17
156	000923	河钢资源	4,000	55,600.00	0.17
157	688518	联赢激光	3,510	55,598.40	0.17
158	603738	泰晶科技	3,700	55,426.00	0.17
159	600211	西藏药业	1,500	55,410.00	0.17
160	600285	羚锐制药	2,500	55,400.00	0.17
161	002233	塔牌集团	7,200	55,224.00	0.17
162	300596	利安隆	1,800	54,900.00	0.17
163	002283	天润工业	10,300	54,796.00	0.17
164	002041	登海种业	5,000	54,450.00	0.17
165	600629	华建集团	5,900	54,398.00	0.17
166	603619	中曼石油	2,800	54,208.00	0.17
167	000973	佛塑科技	9,100	54,054.00	0.17
168	603227	雪峰科技	6,200	53,878.00	0.17
169	300440	运达科技	6,800	53,856.00	0.17
170	000682	东方电子	5,000	53,550.00	0.17
171	301039	中集车辆	5,900	53,395.00	0.17
172	603920	世运电路	1,800	52,920.00	0.17
173	300463	迈克生物	4,000	52,800.00	0.17
174	688091	上海谊众	1,310	52,295.20	0.16
175	000048	京基智农	2,900	52,200.00	0.16
176	603018	华设集团	6,300	51,723.00	0.16
177	300592	华凯易佰	3,600	51,408.00	0.16
178	301339	通行宝	2,500	50,850.00	0.16
179	300341	麦克奥迪	2,900	50,779.00	0.16
180	000915	华特达因	1,800	50,724.00	0.16
181	300181	佐力药业	3,300	50,688.00	0.16
182	600292	远达环保	3,900	50,661.00	0.16
183	688268	华特气体	1,100	50,512.00	0.16
184	300049	福瑞股份	1,600	50,464.00	0.16
185	688391	钜泉科技	1,655	50,229.25	0.16
186	600420	国药现代	4,200	50,148.00	0.16
187	300545	联得装备	1,600	50,128.00	0.16
188	301018	申菱环境	1,300	50,102.00	0.16
189	300129	泰胜风能	7,100	50,055.00	0.16
190	000685	中山公用	5,400	49,842.00	0.16
191	688146	中船特气	1,700	49,368.00	0.15
192	601200	上海环境	6,040	49,346.80	0.15
193	002993	奥海科技	1,200	49,200.00	0.15
194	688059	华锐精密	1,100	49,170.00	0.15
195	300718	长盛轴承	1,600	49,104.00	0.15
196	600284	浦东建设	7,800	48,906.00	0.15
197	002170	芭田股份	5,600	48,888.00	0.15

198	002017	东信和平	4,700	48,739.00	0.15
199	301363	美好医疗	1,500	48,630.00	0.15
200	301102	兆讯传媒	4,440	48,529.20	0.15
201	603283	赛腾股份	700	48,412.00	0.15
202	688698	伟创电气	1,100	48,400.00	0.15
203	605123	派克新材	900	48,384.00	0.15
204	300382	斯莱克	4,500	48,330.00	0.15
205	600055	万东医疗	3,200	48,320.00	0.15
206	601890	亚星锚链	6,200	48,298.00	0.15
207	002274	华昌化工	6,200	48,174.00	0.15
208	605577	龙版传媒	3,300	47,949.00	0.15
209	002697	红旗连锁	8,100	47,871.00	0.15
210	601369	陕鼓动力	5,500	47,850.00	0.15
211	000061	农产品	6,800	47,668.00	0.15
212	000552	甘肃能化	17,300	47,575.00	0.15
213	002270	华明装备	2,800	47,292.00	0.15
214	600195	中牧股份	7,000	46,970.00	0.15
215	002003	伟星股份	3,300	46,761.00	0.15
216	603360	百傲化学	2,100	46,725.00	0.15
217	600229	城市传媒	6,700	46,699.00	0.15
218	000650	仁和药业	8,100	46,656.00	0.15
219	603801	志邦家居	3,640	46,628.40	0.15
220	002226	江南化工	8,600	46,612.00	0.15
221	002990	盛视科技	2,000	46,340.00	0.15
222	002536	飞龙股份	4,000	46,320.00	0.15
223	301004	嘉益股份	400	46,260.00	0.14
224	300507	苏奥传感	6,900	46,230.00	0.14
225	300138	晨光生物	5,300	46,216.00	0.14
226	002516	旷达科技	9,100	46,137.00	0.14
227	000828	东莞控股	4,300	45,967.00	0.14
228	603505	金石资源	1,936	45,960.64	0.14
229	603100	川仪股份	2,130	45,901.50	0.14
230	003006	百亚股份	1,900	45,581.00	0.14
231	688356	键凯科技	800	45,552.00	0.14
232	001323	慕思股份	1,200	45,372.00	0.14
233	600059	古越龙山	5,100	45,288.00	0.14
234	301382	蜂助手	1,700	45,084.00	0.14
235	600197	伊力特	2,600	44,850.00	0.14
236	300590	移为通信	2,900	44,834.00	0.14
237	688239	航宇科技	1,200	44,760.00	0.14
238	688559	海目星	1,300	44,720.00	0.14
239	300384	三联虹普	2,400	44,688.00	0.14
239	300416	苏试试验	3,800	44,688.00	0.14

240	000900	现代投资	10,100	44,541.00	0.14
241	300263	隆华科技	6,100	44,530.00	0.14
242	002053	云南能投	3,900	44,460.00	0.14
243	002158	汉钟精机	2,400	44,448.00	0.14
244	600993	马应龙	1,700	44,387.00	0.14
245	003021	兆威机电	600	44,346.00	0.14
246	600480	凌云股份	4,100	44,321.00	0.14
247	300415	伊之密	2,200	44,132.00	0.14
248	300119	瑞普生物	2,400	44,088.00	0.14
249	688586	江航装备	4,600	44,022.00	0.14
250	603078	江化微	2,600	43,524.00	0.14
251	603566	普莱柯	3,400	43,384.00	0.14
252	000507	珠海港	8,500	43,350.00	0.14
253	002035	华帝股份	5,900	43,306.00	0.14
254	300680	隆盛科技	1,800	43,128.00	0.14
255	603809	豪能股份	3,692	42,937.96	0.13
256	603279	景津装备	2,400	42,912.00	0.13
257	002349	精华制药	5,600	42,840.00	0.13
258	002832	比音勒芬	2,000	42,820.00	0.13
259	603508	思维列控	1,800	42,804.00	0.13
260	002550	千红制药	6,900	42,780.00	0.13
261	002043	兔宝宝	3,600	42,768.00	0.13
262	603229	奥翔药业	4,280	42,757.20	0.13
263	603989	艾华集团	2,800	42,224.00	0.13
264	600351	亚宝药业	6,900	42,021.00	0.13
265	002345	潮宏基	7,200	41,832.00	0.13
265	300443	金雷股份	2,100	41,832.00	0.13
266	688533	上声电子	1,200	41,784.00	0.13
267	600976	健民集团	1,000	41,680.00	0.13
268	688138	清溢光电	1,800	41,220.00	0.13
269	300174	元力股份	2,800	41,216.00	0.13
270	002206	海利得	9,600	41,184.00	0.13
271	603708	家家悦	3,600	41,004.00	0.13
272	002469	三维化学	5,600	40,880.00	0.13
273	300969	恒帅股份	500	40,835.00	0.13
274	300792	壹网壹创	1,700	40,800.00	0.13
275	300403	汉字集团	4,100	40,795.00	0.13
276	603855	华荣股份	2,000	40,580.00	0.13
277	300783	三只松鼠	1,100	40,557.00	0.13
278	603328	依顿电子	4,100	40,426.00	0.13
279	000848	承德露露	4,500	40,365.00	0.13
280	300725	药石科技	1,200	40,320.00	0.13
281	000541	佛山照明	6,500	40,300.00	0.13

282	300360	炬华科技	2,400	40,248.00	0.13
283	002979	雷赛智能	1,300	40,027.00	0.13
284	002135	东南网架	9,400	39,950.00	0.13
285	002588	史丹利	5,400	39,852.00	0.12
286	600694	大商股份	1,510	39,818.70	0.12
287	300219	鸿利智汇	5,300	39,697.00	0.12
288	603337	杰克股份	1,300	39,598.00	0.12
289	300039	上海凯宝	6,400	39,552.00	0.12
290	605108	同庆楼	1,600	39,216.00	0.12
291	603187	海容冷链	3,500	39,165.00	0.12
292	601126	四方股份	2,300	39,008.00	0.12
292	603867	新化股份	1,600	39,008.00	0.12
293	301263	泰恩康	2,600	38,974.00	0.12
294	300400	劲拓股份	2,400	38,928.00	0.12
295	000731	四川美丰	5,300	38,902.00	0.12
296	000822	山东海化	6,800	38,624.00	0.12
297	300320	海达股份	4,000	38,400.00	0.12
298	000521	长虹美菱	4,700	38,352.00	0.12
299	301297	富乐德	900	38,250.00	0.12
300	603368	柳药集团	2,140	38,220.40	0.12
301	300660	江苏雷利	1,000	38,220.00	0.12
301	300850	新强联	2,000	38,220.00	0.12
302	003038	鑫铂股份	2,300	38,134.00	0.12
303	002997	瑞鹄模具	1,100	38,115.00	0.12
304	688531	日联科技	800	38,104.00	0.12
305	603067	振华股份	3,000	37,890.00	0.12
306	601163	三角轮胎	2,500	37,675.00	0.12
307	000417	合百集团	5,900	37,642.00	0.12
308	688403	汇成股份	4,200	37,632.00	0.12
309	000498	山东路桥	6,300	37,485.00	0.12
310	002960	青鸟消防	3,200	37,344.00	0.12
311	301175	中科环保	6,900	37,260.00	0.12
312	300179	四方达	3,300	37,125.00	0.12
313	000888	峨眉山 A	2,800	37,044.00	0.12
314	002737	葵花药业	1,800	36,882.00	0.12
315	300127	银河磁体	1,500	36,870.00	0.12
316	688376	美埃科技	1,100	36,729.00	0.12
317	300401	花园生物	2,500	36,650.00	0.11
318	002545	东方铁塔	5,200	36,556.00	0.11
319	300729	乐歌股份	2,300	36,524.00	0.11
320	301550	斯菱股份	500	36,395.00	0.11
321	003012	东鹏控股	5,500	36,355.00	0.11
322	300480	光力科技	2,800	36,260.00	0.11

323	688739	成大生物	1,400	36,092.00	0.11
324	300406	九强生物	2,700	36,072.00	0.11
325	688377	迪威尔	1,861	35,880.08	0.11
326	300194	福安药业	8,000	35,680.00	0.11
327	300349	金卡智能	2,600	35,542.00	0.11
328	605377	华旺科技	2,660	35,511.00	0.11
329	002296	辉煌科技	3,600	35,316.00	0.11
330	300664	鹏鹞环保	6,000	35,280.00	0.11
331	300121	阳谷华泰	2,900	35,061.00	0.11
332	300130	新国都	1,600	34,656.00	0.11
333	603318	水发燃气	4,800	34,560.00	0.11
334	300740	水羊股份	2,600	34,372.00	0.11
335	601827	三峰环境	4,000	34,320.00	0.11
336	688389	普门科技	2,296	34,187.44	0.11
337	600163	中闽能源	5,600	34,104.00	0.11
338	300258	精锻科技	3,800	33,858.00	0.11
339	002448	中原内配	5,400	33,804.00	0.11
340	300019	硅宝科技	2,300	33,672.00	0.11
341	688128	中国电研	1,600	33,616.00	0.11
342	603167	渤海轮渡	3,800	33,592.00	0.11
343	603058	永吉股份	3,800	33,516.00	0.11
344	688025	杰普特	702	33,345.00	0.10
345	603881	数据港	1,470	33,295.50	0.10
346	301488	豪恩汽电	600	33,174.00	0.10
347	300441	鲍斯股份	3,800	33,136.00	0.10
348	002897	意华股份	800	33,080.00	0.10
349	002580	圣阳股份	3,900	33,072.00	0.10
350	002515	金字火腿	7,300	33,069.00	0.10
351	301345	涛涛车业	500	33,050.00	0.10
352	300547	川环科技	1,200	33,048.00	0.10
353	002443	金洲管道	5,600	32,928.00	0.10
354	605599	菜百股份	2,900	32,915.00	0.10
355	002033	丽江股份	3,700	32,819.00	0.10
356	300841	康华生物	600	32,712.00	0.10
357	300481	濮阳惠成	2,200	32,604.00	0.10
358	002783	凯龙股份	4,000	32,600.00	0.10
359	000913	钱江摩托	1,800	32,418.00	0.10
360	301262	海看股份	1,300	32,331.00	0.10
361	603158	腾龙股份	4,000	32,320.00	0.10
362	000551	创元科技	2,700	32,292.00	0.10
363	002478	常宝股份	6,100	32,269.00	0.10
364	000534	万泽股份	2,500	32,175.00	0.10
365	300160	秀强股份	5,900	32,096.00	0.10

366	300304	云意电气	4,000	32,000.00	0.10
367	002438	江苏神通	2,600	31,720.00	0.10
368	603230	内蒙新华	2,500	31,650.00	0.10
369	000922	佳电股份	2,800	31,612.00	0.10
370	688252	天德钰	1,318	31,566.10	0.10
371	002026	山东威达	3,200	31,488.00	0.10
372	301030	仕净科技	1,300	31,382.00	0.10
373	001337	四川黄金	1,500	31,320.00	0.10
374	300815	禾丰牧业	2,000	31,180.00	0.10
375	300447	全信股份	2,200	31,174.00	0.10
376	605305	中际联合	1,100	31,163.00	0.10
377	000026	飞亚达	3,000	31,110.00	0.10
378	002884	凌霄泵业	1,700	31,059.00	0.10
379	688478	晶升股份	1,100	31,031.00	0.10
380	600479	千金药业	2,900	30,972.00	0.10
381	688432	有研硅	2,739	30,950.70	0.10
382	688112	鼎阳科技	1,100	30,833.00	0.10
383	600738	丽尚国潮	6,200	30,814.00	0.10
384	600929	雪天盐业	5,500	30,745.00	0.10
385	300856	科思股份	1,200	30,744.00	0.10
386	300705	九典制药	1,700	30,515.00	0.10
387	002937	兴瑞科技	1,800	30,420.00	0.10
388	688663	新风光	1,400	30,394.00	0.10
389	603209	兴通股份	1,900	30,362.00	0.10
390	688179	阿拉丁	2,193	30,263.40	0.09
391	000707	双环科技	4,100	30,258.00	0.09
392	300629	新劲刚	1,400	30,240.00	0.09
393	300193	佳士科技	3,400	30,226.00	0.09
394	688697	纽威数控	1,800	29,952.00	0.09
395	603730	岱美股份	3,320	29,846.80	0.09
396	301525	儒竞科技	500	29,800.00	0.09
397	603896	寿仙谷	1,400	29,694.00	0.09
398	688799	华纳药厂	700	29,316.00	0.09
399	603915	国茂股份	2,500	29,300.00	0.09
400	688123	聚辰股份	500	29,260.00	0.09
401	300802	矩子科技	1,600	29,232.00	0.09
402	603012	创力集团	5,500	29,205.00	0.09
403	605507	国邦医药	1,400	29,162.00	0.09
404	301215	中汽股份	4,900	29,155.00	0.09
405	002913	奥士康	1,200	28,932.00	0.09
406	688553	汇宇制药	1,900	28,880.00	0.09
407	002367	康力电梯	4,200	28,854.00	0.09
408	603061	金海通	400	28,832.00	0.09

409	603098	森特股份	3,000	28,800.00	0.09
410	002752	昇兴股份	4,500	28,575.00	0.09
411	002818	富森美	1,900	28,386.00	0.09
412	000906	浙商中拓	4,300	28,380.00	0.09
413	001338	永顺泰	2,600	28,288.00	0.09
414	001208	华菱线缆	3,100	28,148.00	0.09
415	603297	永新光学	300	28,146.00	0.09
416	600874	创业环保	4,700	28,059.00	0.09
417	300435	中泰股份	2,300	27,784.00	0.09
418	300272	开能健康	4,500	27,675.00	0.09
419	600523	贵航股份	2,300	27,416.00	0.09
420	301162	国能日新	600	27,300.00	0.09
421	603357	设计总院	3,000	27,180.00	0.09
422	001258	立新能源	3,400	27,064.00	0.08
423	605016	百龙创园	1,600	27,040.00	0.08
424	601886	江河集团	5,000	27,000.00	0.08
425	600548	深高速	2,000	26,960.00	0.08
426	300616	尚品宅配	2,200	26,950.00	0.08
427	300569	天能重工	5,400	26,892.00	0.08
428	688352	颀中科技	2,197	26,649.61	0.08
429	603699	纽威股份	1,200	26,604.00	0.08
430	301080	百普赛斯	600	26,484.00	0.08
431	300926	博俊科技	1,200	26,412.00	0.08
432	002034	旺能环境	1,700	26,350.00	0.08
433	300396	迪瑞医疗	1,600	26,144.00	0.08
434	603916	苏博特	3,500	26,110.00	0.08
435	603367	辰欣药业	1,900	26,106.00	0.08
436	301391	卡莱特	700	25,907.00	0.08
437	600897	厦门空港	1,700	25,891.00	0.08
438	300858	科拓生物	1,800	25,884.00	0.08
439	002646	天佑德酒	2,400	25,800.00	0.08
440	301149	隆华新材	2,600	25,714.00	0.08
441	002300	太阳电缆	4,800	25,632.00	0.08
442	603713	密尔克卫	500	25,600.00	0.08
443	600279	重庆港	5,300	25,599.00	0.08
444	002843	泰嘉股份	1,200	25,584.00	0.08
445	603013	亚普股份	1,700	25,466.00	0.08
446	600724	宁波富达	4,000	25,400.00	0.08
447	688046	药康生物	1,973	25,353.05	0.08
448	603203	快克智能	1,100	25,322.00	0.08
449	605183	确成股份	1,500	25,275.00	0.08
450	301383	天键股份	480	25,272.00	0.08
451	603105	芯能科技	2,800	25,228.00	0.08

452	301069	凯盛新材	1,700	25,194.00	0.08
453	002154	报喜鸟	5,700	25,137.00	0.08
454	002847	盐津铺子	400	25,040.00	0.08
455	688378	奥来德	1,096	24,999.76	0.08
456	002922	伊戈尔	1,400	24,948.00	0.08
457	603630	拉芳家化	1,800	24,804.00	0.08
458	688510	航亚科技	1,420	24,736.40	0.08
459	603281	江瀚新材	1,000	24,400.00	0.08
460	300354	东华测试	700	24,353.00	0.08
461	600368	五洲交通	5,100	24,327.00	0.08
462	001322	箭牌家居	3,000	24,270.00	0.08
463	000791	甘肃能源	4,000	24,120.00	0.08
464	600468	百利电气	5,100	23,970.00	0.08
465	301393	昊帆生物	600	23,946.00	0.08
466	300239	东宝生物	3,800	23,788.00	0.07
467	300873	海晨股份	1,400	23,674.00	0.07
468	600618	氯碱化工	2,400	23,664.00	0.07
469	002651	利君股份	3,200	23,456.00	0.07
470	300653	正海生物	1,100	23,430.00	0.07
471	603299	苏盐井神	2,100	23,394.00	0.07
472	603165	荣晟环保	1,900	23,256.00	0.07
473	002918	蒙娜丽莎	2,200	23,232.00	0.07
474	002452	长高电新	3,100	23,002.00	0.07
475	002029	七匹狼	3,500	22,890.00	0.07
476	603309	维力医疗	1,900	22,762.00	0.07
477	002140	东华科技	2,300	22,724.00	0.07
478	002950	奥美医疗	2,600	22,698.00	0.07
479	002275	桂林三金	1,500	22,635.00	0.07
480	002096	易普力	1,900	22,572.00	0.07
481	603408	建霖家居	1,800	22,554.00	0.07
482	600475	华光环能	2,500	22,525.00	0.07
483	601089	福元医药	1,400	22,400.00	0.07
484	600814	杭州解百	2,700	22,383.00	0.07
485	600283	钱江水利	2,400	22,272.00	0.07
486	003039	顺控发展	1,700	22,236.00	0.07
487	605196	华通线缆	1,900	22,192.00	0.07
488	300809	华辰装备	700	22,176.00	0.07
489	300105	龙源技术	2,900	22,127.00	0.07
490	300820	英杰电气	400	22,100.00	0.07
491	300795	米奥会展	1,100	22,011.00	0.07
492	300439	美康生物	2,100	21,945.00	0.07
493	002870	香山股份	700	21,910.00	0.07
494	300978	东箭科技	2,000	21,780.00	0.07

495	002946	新乳业	1, 500	21, 765.00	0.07
496	688236	春立医疗	1, 700	21, 760.00	0.07
497	300062	中能电气	3, 700	21, 756.00	0.07
498	002088	鲁阳节能	1, 700	21, 743.00	0.07
499	600488	津药药业	5, 100	21, 624.00	0.07
500	603611	诺力股份	1, 200	21, 540.00	0.07
501	603339	四方科技	1, 700	21, 488.00	0.07
502	002612	朗姿股份	1, 300	21, 268.00	0.07
503	600643	爱建集团	4, 100	21, 197.00	0.07
504	603590	康辰药业	900	21, 168.00	0.07
505	601065	江盐集团	2, 400	21, 048.00	0.07
506	301073	君亭酒店	1, 000	20, 870.00	0.07
507	002393	力生制药	1, 180	20, 815.20	0.07
508	605266	健之佳	900	20, 763.00	0.07
509	603758	秦安股份	2, 500	20, 650.00	0.06
510	300452	山河药辅	1, 700	20, 587.00	0.06
511	300286	安科瑞	1, 000	20, 550.00	0.06
512	002083	孚日股份	4, 200	20, 538.00	0.06
513	688222	成都先导	1, 647	20, 291.04	0.06
514	300389	艾比森	1, 700	20, 247.00	0.06
515	605598	上海港湾	900	20, 169.00	0.06
516	688566	吉贝尔	900	20, 160.00	0.06
517	601579	会稽山	1, 800	19, 908.00	0.06
518	603136	天目湖	1, 745	19, 718.50	0.06
519	002632	道明光学	2, 200	19, 580.00	0.06
520	300973	立高食品	500	19, 515.00	0.06
521	300453	三鑫医疗	2, 600	19, 396.00	0.06
522	603071	物产环能	1, 500	19, 380.00	0.06
523	603558	健盛集团	1, 800	19, 368.00	0.06
524	002970	锐明技术	400	19, 052.00	0.06
525	301048	金鹰重工	2, 000	18, 740.00	0.06
526	000532	华金资本	1, 400	18, 480.00	0.06
527	300881	盛德鑫泰	600	18, 444.00	0.06
528	688410	山外山	1, 639	18, 291.24	0.06
529	000899	赣能股份	2, 100	18, 291.00	0.06
530	605368	蓝天燃气	1, 600	18, 288.00	0.06
531	605388	均瑶健康	2, 900	18, 241.00	0.06
532	603439	贵州三力	1, 400	18, 200.00	0.06
533	003013	地铁设计	1, 200	18, 144.00	0.06
534	603355	莱克电气	800	18, 120.00	0.06
535	301509	金凯生科	700	18, 116.00	0.06
536	603515	欧普照明	1, 100	18, 095.00	0.06
537	001311	多利科技	700	18, 053.00	0.06

538	301439	泓淋电力	1, 300	17, 875. 00	0. 06
539	002943	宇晶股份	900	17, 856. 00	0. 06
540	000655	金岭矿业	2, 900	17, 835. 00	0. 06
541	003000	劲仔食品	1, 300	17, 810. 00	0. 06
542	603519	立霸股份	1, 500	17, 730. 00	0. 06
543	002677	浙江美大	2, 400	17, 616. 00	0. 06
544	301558	三态股份	2, 000	17, 520. 00	0. 05
545	301278	快可电子	500	17, 475. 00	0. 05
546	002940	昂利康	1, 300	17, 134. 00	0. 05
547	605116	奥锐特	800	16, 896. 00	0. 05
548	002833	弘亚数控	1, 000	16, 830. 00	0. 05
549	603416	信捷电气	400	16, 780. 00	0. 05
550	300962	中金辐照	1, 000	16, 730. 00	0. 05
551	300797	钢研纳克	1, 400	16, 534. 00	0. 05
552	688315	诺禾致源	1, 315	16, 437. 50	0. 05
553	002788	鹭燕医药	2, 000	16, 420. 00	0. 05
554	002412	汉森制药	2, 700	16, 227. 00	0. 05
555	002404	嘉欣丝绸	2, 600	16, 094. 00	0. 05
556	600796	钱江生化	2, 800	16, 072. 00	0. 05
557	601022	宁波远洋	2, 000	16, 060. 00	0. 05
558	301195	北路智控	500	16, 055. 00	0. 05
559	002615	哈尔斯	2, 000	15, 900. 00	0. 05
560	603693	江苏新能	1, 600	15, 760. 00	0. 05
561	601133	柏诚股份	1, 400	15, 708. 00	0. 05
562	300722	新余国科	578	15, 617. 56	0. 05
563	688439	振华风光	300	15, 387. 00	0. 05
564	002790	瑞尔特	2, 100	15, 330. 00	0. 05
565	300430	诚益通	1, 000	15, 300. 00	0. 05
566	301096	百诚医药	400	15, 176. 00	0. 05
567	603112	华翔股份	1, 200	15, 000. 00	0. 05
568	000411	英特集团	1, 400	14, 910. 00	0. 05
569	301211	亨迪药业	700	14, 882. 00	0. 05
570	000544	中原环保	1, 700	14, 841. 00	0. 05
571	002749	国光股份	1, 000	14, 220. 00	0. 04
572	603970	中农立华	1, 000	14, 200. 00	0. 04
573	603507	振江股份	590	14, 183. 60	0. 04
574	603053	成都燃气	1, 400	14, 042. 00	0. 04
575	603929	亚翔集成	500	13, 865. 00	0. 04
576	605338	巴比食品	800	13, 816. 00	0. 04
577	001301	尚太科技	200	13, 710. 00	0. 04
578	300894	火星人	1, 000	13, 700. 00	0. 04
579	605337	李子园	1, 200	13, 548. 00	0. 04
580	603239	浙江仙通	1, 000	13, 450. 00	0. 04

581	300951	博硕科技	400	11,948.00	0.04
582	603125	常青科技	600	11,520.00	0.04
583	301507	民生健康	900	11,421.00	0.04
584	605018	长华集团	1,300	11,414.00	0.04
585	300314	戴维医疗	1,000	11,260.00	0.04
586	688636	智明达	400	11,240.00	0.04
587	301061	匠心家居	180	11,124.00	0.03
588	003020	立方制药	600	10,824.00	0.03
589	603966	法兰泰克	1,400	10,808.00	0.03
590	301168	通灵股份	400	10,732.00	0.03
591	300870	欧陆通	100	10,678.00	0.03
592	605319	无锡振华	500	10,525.00	0.03
593	300636	同和药业	1,300	10,361.00	0.03
594	002983	芯瑞达	500	9,820.00	0.03
595	603983	丸美生物	300	9,678.00	0.03
596	603931	格林达	400	9,276.00	0.03
597	001215	千味央厨	300	9,204.00	0.03
598	301456	盘古智能	400	9,036.00	0.03
599	603119	浙江荣泰	400	8,956.00	0.03
600	301191	菲菱科思	100	8,945.00	0.03
601	002956	西麦食品	500	8,335.00	0.03
602	603396	金辰股份	300	8,070.00	0.03
603	301046	能辉科技	400	8,024.00	0.03
604	605009	豪悦护理	200	7,992.00	0.03
605	300997	欢乐家	500	7,730.00	0.02
606	603877	太平鸟	500	7,400.00	0.02
607	688205	德科立	80	7,280.00	0.02
608	605098	行动教育	200	7,048.00	0.02
609	300727	润禾材料	200	6,748.00	0.02
610	300833	浩洋股份	150	6,622.50	0.02
611	603848	好太太	400	6,584.00	0.02
612	301367	怡和嘉业	100	6,300.00	0.02
613	603193	润本股份	259	6,047.65	0.02
614	300402	宝色股份	400	5,900.00	0.02
615	001269	欧晶科技	200	5,698.00	0.02
616	301179	泽宇智能	300	5,601.00	0.02
617	603992	松霖科技	300	5,541.00	0.02
618	300946	恒而达	200	5,432.00	0.02
619	301325	曼恩斯特	100	5,419.00	0.02
620	002880	卫光生物	200	5,402.00	0.02
621	301172	君逸数码	200	5,368.00	0.02
622	301421	波长光电	100	5,367.00	0.02

623	301333	诺思格	100	4,999.00	0.02
624	603387	基蛋生物	600	4,950.00	0.02
625	002959	小熊电器	100	4,791.00	0.02
626	301408	华人健康	400	4,412.00	0.01
627	688526	科前生物	300	4,287.00	0.01
628	301377	鼎泰高科	200	4,230.00	0.01
629	301328	维峰电子	100	4,227.00	0.01
630	300791	仙乐健康	160	4,212.80	0.01
631	301266	宇邦新材	100	3,350.00	0.01
632	001328	登康口腔	100	3,176.00	0.01
633	300908	仲景食品	100	3,074.00	0.01
634	603291	联合水务	200	2,326.00	0.01
635	603277	银都股份	100	2,317.00	0.01
636	301381	赛维时代	100	2,276.00	0.01
637	300852	四会富仕	80	2,097.60	0.01
638	603324	盛剑科技	80	2,071.20	0.01
639	605005	合兴股份	100	1,630.00	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	688568	中科星图	7,676	391,706.28	1.23
2	000429	粤高速 A	6,200	91,140.00	0.29
3	605090	九丰能源	2,900	82,737.00	0.26
4	000543	皖能电力	9,900	78,309.00	0.25
5	688676	金盘科技	1,800	74,556.00	0.23
6	688100	威胜信息	1,900	68,780.00	0.22
7	000088	盐田港	12,500	60,875.00	0.19
8	688219	会通股份	3,718	38,146.68	0.12
9	603556	海兴电力	1,000	36,990.00	0.12
10	001223	欧克科技	500	21,935.00	0.07
11	688357	建龙微纳	960	21,052.80	0.07
12	688358	祥生医疗	700	17,094.00	0.05
13	603057	紫燕食品	700	14,063.00	0.04
14	300488	恒锋工具	300	8,208.00	0.03
15	301526	国际复材	1,981	7,329.70	0.02
16	301122	采纳股份	300	6,069.00	0.02
17	002288	*ST 超华	12,600	0.00	0.00
17	002435	ST 长康	10,700	0.00	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600064	南京高科	796,349.00	0.73
2	688029	南微医学	503,034.98	0.46
3	002839	张家港行	492,683.00	0.45
4	600850	电科数字	424,155.00	0.39
5	688088	虹软科技	415,722.19	0.38
6	688409	富创精密	392,073.02	0.36
7	688018	乐鑫科技	371,451.06	0.34
8	688235	百济神州	371,000.67	0.34
9	600648	外高桥	363,643.00	0.33
10	601028	玉龙股份	361,589.00	0.33
11	300075	数字政通	334,795.40	0.31
12	688568	中科星图	332,850.08	0.31
13	600363	联创光电	329,273.00	0.30
14	605168	三人行	305,092.70	0.28
15	688639	华恒生物	295,332.14	0.27
16	600459	贵研铂业	290,044.00	0.27
17	603039	泛微网络	288,112.00	0.27
18	601918	新集能源	285,182.00	0.26
19	300674	宇信科技	276,368.00	0.25
20	300525	博思软件	272,660.80	0.25

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初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	688235	百济神州	828,645.24	0.76
2	600064	南京高科	774,405.00	0.71
3	603979	金诚信	760,380.00	0.70
4	688029	南微医学	681,429.51	0.63
5	600363	联创光电	625,745.00	0.58
6	300573	兴齐眼药	599,925.92	0.55
7	688409	富创精密	551,552.08	0.51
8	600850	电科数字	547,532.00	0.50
9	688213	思特威	520,338.58	0.48
10	688333	铂力特	517,234.63	0.48
11	600771	广誉远	502,654.00	0.46
12	688018	乐鑫科技	491,366.00	0.45

13	600761	安徽合力	486,791.00	0.45
14	688278	特宝生物	467,649.63	0.43
15	600422	昆药集团	435,258.00	0.40
16	600123	兰花科创	424,809.00	0.39
17	688019	安集科技	416,214.80	0.38
18	688076	诺泰生物	401,091.76	0.37
19	603505	金石资源	398,773.00	0.37
20	600908	无锡银行	397,377.00	0.37

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	69,043,672.50
卖出股票收入（成交）总额	95,329,657.04

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

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

### 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	7,641.36
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,641.36

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中无流通受限的股票。

#### 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的股票。

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构	
		机构投资者	个人投资者

		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
592	56,206.82	13,005,870.00	39.09	20,268,565.00	60.91

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例 (%)
1	招商证券股份有限公司	6,010,111.00	18.06
2	方正证券股份有限公司	3,041,361.00	9.14
3	常利芳	2,000,077.00	6.01
4	杨丹彤	2,000,038.00	6.01
5	华泰证券股份有限公司	1,569,969.00	4.72
6	中信证券股份有限公司	1,349,989.00	4.06
7	中国银河证券股份有限公司	1,024,440.00	3.08
8	丁王云心	1,020,039.00	3.07
9	杨常青	500,009.00	1.50
10	杨永清	475,119.00	1.43

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	0.0451

### 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)	1,113,274,435.00
基金份额总额	
本报告期期初基金份额总额	111,274,435.00
本报告期基金总申购份额	66,000,000.00

减：本报告期基金总赎回份额	144,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	33,274,435.00

## § 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

报告期内，本基金管理人无重大人事变动。

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

报告期内，无涉及基金管理人、基金财产的诉讼事项。

报告期内，无涉及基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

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

经基金管理人董事会审议通过，并履行适当程序，聘任容诚会计师事务所（特殊普通合伙）

为本基金的审计机构，报告期内应支付给该事务所的报酬为 20,000.00 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

注：报告期内，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 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	120,342,474. 80	73.21	75,234.47	71.25	-

国投证券	1	34,228,345.08	20.82	24,144.01	22.86	-
信达证券	1	7,325,276.17	4.46	5,390.74	5.11	-
银河证券	3	1,814,817.18	1.10	337.41	0.32	-
东吴证券	1	662,416.31	0.40	487.54	0.46	-

注：1、基金交易单元的选择标准如下：

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

2、基金管理人根据上述标准，考察后与确定选用交易单元的券商签订交易单元租用协议，自2024年7月1日起，按照《公开募集证券投资基金管理费用管理规定》等相关要求执行。

3、本报告期内本基金租用证券公司交易单元无变更情况。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券 成交总额 的比例(%)	成交金额	占当期债券 回购成交总 额的比例 (%)	成交金额	占当期 权证 成交总 额的比 例(%)
中信证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-

### 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	关于指定证券投资基金主流流动性服务商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024年01月03日
2	平安基金管理有限公司关于提醒投资者及时完善、更新身份信息资料以免影响业务办理的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024年01月15日
3	平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2024年01月22日
4	平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2024年01月30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更新	中国证监会规定报刊及网站	2024年01月31日

6	平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书更新	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 01 月 31 日
7	平安基金管理有限公司关于旗下基金新增长江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	2024 年 02 月 08 日
8	平安基金管理有限公司关于旗下基金新增国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	2024 年 03 月 21 日
9	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	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 03 月 29 日
10	关于平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商终止的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 04 月 12 日
11	关于平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商终止的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 04 月 16 日
12	平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 04 月 22 日
13	平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 05 月 31 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	2024 年 05 月 31 日
15	关于调整平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金主流流动性服务商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 06 月 25 日
16	平安基金管理有限公司关于旗下基金估值调整情况的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 06 月 28 日
17	关于平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商终止的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 07 月 09 日
18	平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年第 2 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 07 月 19 日
19	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增渤海证券股份有限公司为申购赎回代办机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 07 月 22 日
20	平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年中期报告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 08 月 30 日
21	关于平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商终止的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 09 月 13 日
22	平安基金管理有限公司关于旗下基金估值调整情况的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 09 月 14 日
23	平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年第 3 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 10 月 25 日

24	关于平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商终止的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 11 月 11 日
25	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金改聘会计师事务所公告 2	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 11 月 16 日
26	平安基金管理有限公司关于提醒投资者及时完善、更新身份信息资料以免影响业务办理的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 12 月 20 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

注：无。

### 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

2025 年 3 月 28 日