

富国中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

二 0 二四年中期报告

2024 年 06 月 30 日

基金管理人： 富国基金管理有限公司

基金托管人： 广发证券股份有限公司

送出日期： 2024 年 08 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

富国基金管理有限公司的董事会、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。本中期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。

基金托管人广发证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 29 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。

富国基金管理有限公司承诺以诚实信用、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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 6 月 30 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 .....	6
2.1	基金基本情况 .....	6
2.2	基金产品说明 .....	6
2.3	基金管理人和基金托管人 .....	6
2.4	信息披露方式 .....	7
2.5	其他相关资料 .....	7
§3	主要财务指标和基金净值表现 .....	8
3.1	主要会计数据和财务指标 .....	8
3.2	基金净值表现 .....	8
§4	管理人报告 .....	10
4.1	基金管理人及基金经理情况 .....	10
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	11
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	11
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明 .....	12
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	13
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	13
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	14
4.8	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合规守信情况声明 .....	15
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	15
5.3	托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 .....	15
§6	中期财务报告（未经审计） .....	16
6.1	资产负债表 .....	16
6.2	利润表 .....	17
6.3	净资产变动表 .....	18
6.4	报表附注 .....	19
§7	投资组合报告 .....	42
7.1	期末基金资产组合情况 .....	42

7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合.....	42
7.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细.....	43
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	68
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	70
7.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	70
7.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	70
7.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	70
7.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	70
7.10	本基金投资股指期货的投资政策.....	70
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	70
7.12	投资组合报告附注.....	70
§8	基金份额持有人信息.....	73
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	73
8.2	期末上市基金前十名持有人.....	73
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	73
8.4	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的情况.....	73
§9	开放式基金份额变动.....	74
§10	重大事件揭示.....	75
10.1	基金份额持有人大会决议.....	75
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	75
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	75
10.4	基金投资策略的改变.....	75
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	75
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	75
10.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	76
10.8	其他重大事件.....	77
§11	影响投资者决策的其他重要信息.....	78
11.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况.....	78
11.2	影响投资者决策的其他重要信息.....	78
§12	备查文件目录.....	79



## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	富国中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	富国中证 2000ETF
场内简称	中证 2000ETF 富国
基金主代码	563200
交易代码	563200
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2023 年 09 月 28 日
基金管理人	富国基金管理有限公司
基金托管人	广发证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	39,458,827.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2023 年 10 月 18 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金通过综合考虑标的指数成份股的流动性、投资限制、交易成本、交易限制等因素，可以选择采取完全复制法或抽样复制法构建基金的股票投资组合，以更好地实现跟踪标的指数的目的。在正常市场情况下，本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。本基金的资产配置策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、可转换债券（含可分离交易可转债）及可交换债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、股票期权投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略详见法律文件。
业绩比较基准	中证 2000 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，预期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。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数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		富国基金管理有限公司	广发证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵瑛	罗琦
	联系电话	021-20361818	020-66338888
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	gzluoqi@gf.com.cn
客户服务电话		95105686、4008880688	95575
传真		021-20361616	020-87553363-6847
注册地址		中国(上海)自由贸易试验	广东省广州市黄埔区中新

	区世纪大道 1196 号世纪汇 办公楼二座 27-30 层	广州知识城腾飞一街 2 号 618 室
办公地址	上海市浦东新区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层	广州市天河区马场路 26 号广发证券大厦 34 楼
邮政编码	200120	510627
法定代表人	裴长江	林传辉

#### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披 露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正 文的管理人互联网网 址	www.fullgoal.com.cn
基金中期报告备置地 点	富国基金管理有限公司 上海市浦东新区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层 广发证券股份有限公司 广州市天河区马场路 26 号 广发证券大厦 34 楼

#### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
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 主要财务指标和基金净值表现

#### 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	报告期(2024年01月01日至2024年06月30日)
本期已实现收益	9,901,248.29
本期利润	4,680,292.40
加权平均基金份额本期利润	0.0600
本期加权平均净值利润率	6.73%
本期基金份额净值增长率	-20.32%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年06月30日)
期末可供分配利润	-7,095,876.42
期末可供分配基金份额利润	-0.1798
期末基金资产净值	32,362,950.58
期末基金份额净值	0.8202
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年06月30日)
基金份额累计净值增长率	-17.98%

注：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（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。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。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，不是当期发生数）。

#### 3.2 基金净值表现

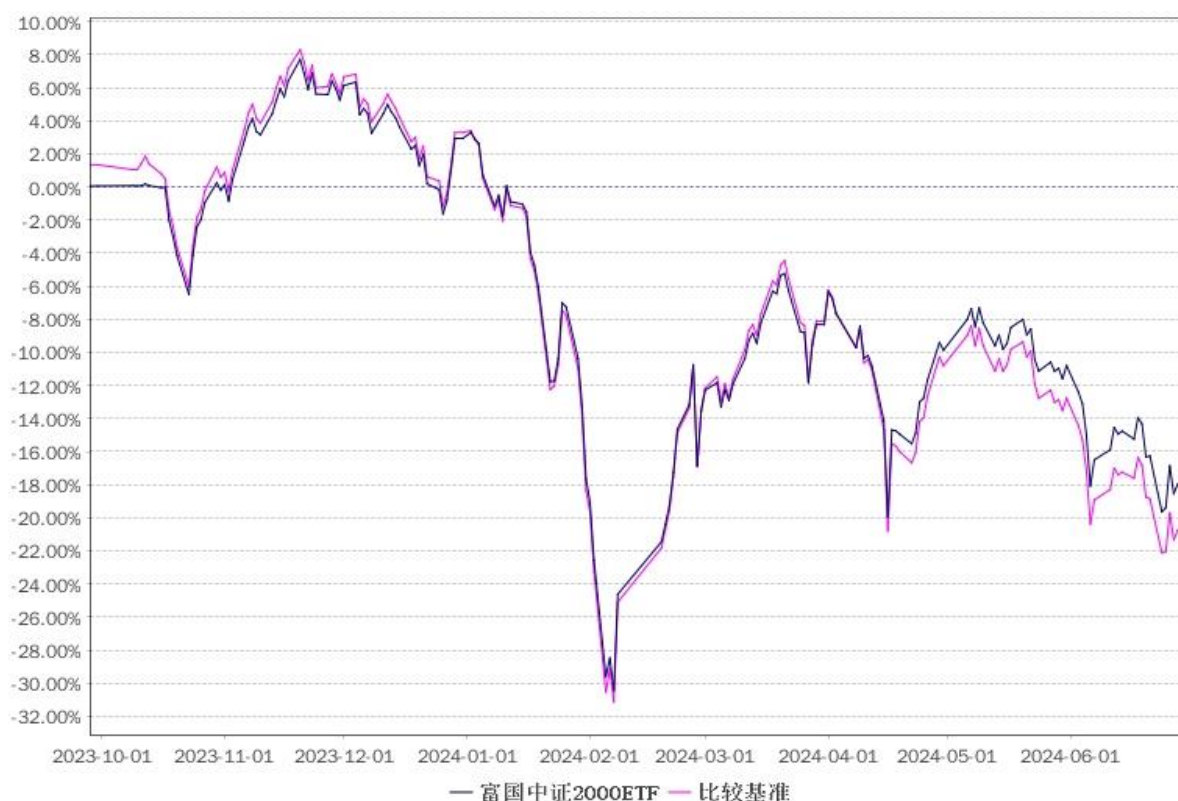
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-8.05%	1.85%	-9.15%	1.85%	1.10%	0.00%
过去三个月	-10.54%	1.94%	-13.75%	2.01%	3.21%	-0.07%
过去六个月	-20.32%	2.42%	-23.28%	2.50%	2.96%	-0.08%
自基金合同生效起至今	-17.98%	2.05%	-20.75%	2.12%	2.77%	-0.07%



注：本基金业绩比较基准根据基金合同中投资策略及资产配置比例等相关规定构建，能够较好地反映本基金的风险收益特征。本基金每个交易日对业绩比较基准依据合同约定的权重比例进行再平衡处理，并用每日连乘方式计算得到指数基准的时间序列。

### 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



注：1、截止日期为2024年6月30日。

2、本基金于2023年9月28日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一年。本基金建仓期6个月，从2023年9月28日起至2024年3月27日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

## § 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

富国基金管理有限公司于 1999 年 4 月 13 日获国家工商行政管理局登记注册成立，是经中国证监会批准设立的首批十家基金管理公司之一。公司于 2001 年 3 月从北京迁址上海。2003 年 9 月，加拿大蒙特利尔银行（BMO）参股富国基金管理有限公司的工商变更登记办理完毕，富国基金管理有限公司成为国内首批成立的十家基金公司中，第一家中外合资的基金管理公司。

目前，公司注册资本金 5.2 亿元人民币，股东为：海通证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、加拿大蒙特利尔银行及山东省金融资产管理股份有限公司。公司在北京、成都、广州设立有分公司，并全资设有两家子公司——富国资产管理（上海）有限公司和富国资产管理（香港）有限公司。公司拥有公募基金、特定客户资产管理、QDII、社保、企业年金、基本养老保险基金等基金公司全部业务牌照。

截至 2024 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理富国天盛灵活配置混合型证券投资基金、富国天惠精选成长混合型证券投资基金（LOF）、富国新兴产业股票型证券投资基金、富国中证智能汽车指数证券投资基金（LOF）、富国中证红利指数增强型证券投资基金、上证综指交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、富国天利增长债券投资基金、富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、富国中债-1-3 年国开行债券指数证券投资基金、富国全球科技互联网股票型证券投资基金（QDII）、富国鑫旺稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、富国富钱包货币市场基金、富国首创水务封闭式基础设施证券投资基金等 350 只公开募集证券投资基金。

#### 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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
金泽宇	本基金现任基金经理	2023-09-28	—	6	博士，自 2018 年 7 月加入富国基金管理有限公司，历任助理定量研究员、初级定量研究员、定量研究员；现任富国基金量化投资部定量基金经理。自 2022 年 07 月起任富

					<p>国中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2022 年 11 月起任富国中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；自 2023 年 09 月起任富国中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2023 年 12 月起任富国创业板中盘 200 交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2024 年 02 月起任富国创业板中盘 200 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理；自 2024 年 05 月起任富国沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2024 年 05 月起任富国中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金基金经理；具有基金从业资格。</p>
--	--	--	--	--	---

注：1、上述任职日期为根据公司决定确定的聘任日期，离任日期为根据公司确定的解聘日期；首任基金经理任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的涵义遵从中国证监会《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为富国中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金的管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、《富国中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，以尽可能减少和分散投资风险、力保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定收益为目标，基金投资组合符合有关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 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据相关法规要求，结合实际情况，制定了内部的《公平交易管理办法》，对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节，实行事前控制、事中监控、事后评估及反馈的流程化管理。在制度、操作层面确保各组合享有同等信息知情权、均

等交易机会，并保持各组合的独立投资决策权。事前控制主要包括：1、一级市场，通过标准化的办公流程，对关联方审核、价格公允性判断及证券公平分配等相关环节进行控制；2、二级市场，通过交易系统的投资备选库、交易对手库及授权管理，对投资标的、交易对手和操作权限进行自动化控制。事中监控主要包括组合间相同投资标的的交易方向、市场冲击的控制，银行间市场交易价格的公允性评估等。1、将主动投资组合的同日反向交易列为限制行为，非经特别控制流程审核同意，不得进行；对于同日同向交易，通过交易系统对组合间的交易公平性进行自动化处理。2、同一基金经理管理的不同组合，对同一投资标的采用相同投资策略的，必须通过交易系统采取同时、同价下达投资指令，确保公平对待其所管理的组合。事后评估及反馈主要包括组合间同一投资标的的临近交易日的同向交易和反向交易的合理性分析评估，以及不同时间窗口下（1日、3日、5日）的季度公平性交易分析评估等。1、通过公平性交易的事后分析评估系统，对涉及公平性交易的投资行为进行分析评估，分析对象涵盖公募、年金、社保及专户产品，并重点分析同类组合（股票型、混合型、债券型）间、不同产品间以及同一基金经理管理不同组合间的交易行为，若发现异常交易行为，风险管理部视情况要求相关当事人做出合理性解释，并按法规要求上报辖区监管机构。2、季度公平性交易分析报告按规定经基金经理或投资经理签字，并经督察长、总经理审阅签字后，归档保存，以备后查。本报告期内公司旗下基金严格遵守公司的相关公平交易制度，未出现违反公平交易制度的情况。

#### **4.3.2 异常交易行为的专项说明**

本报告期内未发现异常交易行为。

公司旗下管理的各投资组合在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面，报告期内本组合与其他投资组合之间，因组合流动性管理或投资策略调整需要，出现1次同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

### **4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明**

#### **4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析**

2024年开年以来，国内悲观预期加速释放，海外修正抢跑的降息预期，资金和情绪的负反馈导致市场调整加速。尽管月末超预期降准、地产政策优化以及资本市场政策密集出台使得权重股带领市场短暂反弹，但雪球敲入、私募强制平仓

等消息面和资金面负反馈仍在持续。2月，随着国内经济与政策预期得到重新修正，风险偏好改善驱动市场快速反弹。在海外AI技术迎来突破等信息刺激下，A股迎来大幅反弹，月末沪指成功站上3000点。3月，市场重新进入以景气和政策为驱动的修复期，指数围绕关键点位震荡。经过前期大幅上涨后，投资者关注点重回现实，市场在三月下旬做多动能减弱，沪指一度下挫至3000点以下，但月末在政策预期催化下回到3000点上。4月末，美国一季度经济呈现“滞涨”态势，降息预期推后下非美货币普遍贬值，而国内基本面较为稳健，人民币汇率抗跌走出独立行情，中国资产在全球的配置性价比和逻辑开始凸显，引发外资回流。业绩期进入尾声后，内资风险偏好抬升，合力推动沪指突破3100点。6月进入验证期，国内经济复苏再度放缓，PMI回落枯荣线以下、信用扩张疲软、经济“供强需弱”特征延续。接连落空的预期验证放大悲观情绪，沪指连续调整至3000点以下。

总体来看，2024年上半年上证综指下跌0.25%，沪深300上涨0.89%，创业板指下跌10.99%，中证500指数下跌8.96%。

在投资管理上，本基金采用量化和人工管理相结合的方法，处理基金日常运作中的大额申购和赎回等事件，合理安排股票仓位及头寸，将跟踪误差控制在合理水平，努力为投资者提供合格的投资工具。

#### **4.4.2 报告期内基金的业绩表现**

截至2024年6月30日，本基金份额净值为0.8202元；份额累计净值为0.8202元；本报告期，本基金份额净值增长率为-20.32%，同期业绩比较基准收益率为-23.28%。

#### **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年下半年，风险偏好有望迎来修复窗口。从国内来看，为完成两会政府工作报告中提出的经济增长目标，下半年相关财政政策及货币政策有望进一步发力。从海外看，随着美国通胀数据和就业数据持续走弱，美联储开启降息的概率进一步提升，新兴市场资金有望迎来回流，有助于风险偏好的提升。

#### **4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明**

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中

国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等法律法规、估值指引的相关规定，以及基金合同对估值程序的相关约定，对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值的账务处理、基金份额净值的计算由基金管理人独立完成，并与基金托管人进行账务核对，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

根据相关法律法规、本基金《基金合同》的约定以及基金的实际运作情况，本报告期内本基金未进行收益分配。本基金将严格按照法律法规及基金合同约定进行收益分配。

#### **4.8 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**

1、本报告期内本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

2、自 2024 年 5 月 8 日至 2024 年 6 月 28 日，本基金存在资产净值连续二十个工作日低于五千万元的情况。

3、因前述迷你基金情形，经公司决策，自 2024 年 7 月 1 日起由基金管理人承担本基金项下相关固定费用。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

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

本基金托管人依法对富国基金管理有限公司编制和披露的富国中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年中期报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 中期财务报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：富国中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>		
货币资金	196,350.82	7,972,231.58
结算备付金	131,288.20	1,082,870.23
存出保证金	480,141.06	1,361,221.16
交易性金融资产	31,623,700.14	252,905,727.90
其中：股票投资	31,623,700.14	252,882,758.46
基金投资	—	—
债券投资	—	22,969.44
资产支持证券投资	—	—
贵金属投资	—	—
其他投资	—	—
衍生金融资产	—	—
买入返售金融资产	—	—
应收清算款	—	44,271,544.59
应收股利	—	—
应收申购款	—	—
递延所得税资产	—	—
其他资产	75,409.64	—
资产总计	32,506,889.86	307,593,595.46
<b>负债和净资产</b>	<b>本期末</b> 2024 年 06 月 30 日	<b>上年度末</b> 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	—	—
卖出回购金融资产款	—	—
应付清算款	—	44,016,381.38
应付赎回款	—	—
应付管理人报酬	13,941.34	37,319.90
应付托管费	2,788.28	7,463.99
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	127,209.66	563,783.02
负债合计	143,939.28	44,624,948.29
<b>净资产：</b>		
实收基金	39,458,827.00	255,458,827.00
其他综合收益	—	—
未分配利润	-7,095,876.42	7,509,820.17
净资产合计	32,362,950.58	262,968,647.17
负债和净资产总计	32,506,889.86	307,593,595.46

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.8202 元，基金份额总额 39,458,827.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：富国中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 (2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日)
<b>一、营业总收入</b>	<b>5,031,599.12</b>
1.利息收入	27,896.46
其中：存款利息收入	27,896.46
债券利息收入	—
资产支持证券利息收入	—
买入返售金融资产收入	—
其他利息收入	—
2.投资收益（损失以“-”填列）	10,417,239.16
其中：股票投资收益	10,057,670.77
基金投资收益	—
债券投资收益	18,606.05
资产支持证券投资收益	—
贵金属投资收益	—
衍生工具收益	—
股利收益	340,962.34
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益	—
其他投资收益	—
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-5,220,955.89
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	—
5.其他收入（损失以“-”号填列）	-192,580.61
<b>减：二、营业总支出</b>	<b>351,306.72</b>

1. 管理人报酬	181,517.64
2. 托管费	36,303.48
3. 销售服务费	—
4. 投资顾问费	—
5. 利息支出	—
其中：卖出回购金融资产支出	—
6. 信用减值损失	—
7. 税金及附加	—
8. 其他费用	133,485.60
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	4,680,292.40
减：所得税费用	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	4,680,292.40
五、其他综合收益的税后净额	—
六、综合收益总额	4,680,292.40

注：本基金合同生效日为 2023 年 9 月 28 日，无上年度同期对比数据。

### 6.3 净资产变动表

会计主体：富国中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 (2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日)		
	实收基金	未分配 利润	净资产 合计
一、上期期末净资产	255,458,827.00	7,509,820.17	262,968,647.17
二、本期期初净资产	255,458,827.00	7,509,820.17	262,968,647.17
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	—	—	—
	216,000,000.00	14,605,696.59	230,605,696.59
（一）、综合收益总额	—	4,680,292.40	4,680,292.40
（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）	—	—	—
	216,000,000.00	19,285,988.99	235,285,988.99
其中：1. 基金申购款	186,000,000.00	—	143,355,976.56
		42,644,023.44	
2. 基金赎回款	—	—	—
	402,000,000.00	23,358,034.45	378,641,965.55
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	—	—	—
（四）、其他综合收益结转留存收益	—	—	—
四、本期期末净资产	39,458,827.00	-7,095,876.42	32,362,950.58

注：本基金合同生效日为 2023 年 9 月 28 日，无上年度同期对比数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

陈戈	林志松	徐慧
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

富国中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”），系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】1934 号文《关于准予富国中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》准予公开募集注册。由基金管理人富国基金管理有限公司自 2023 年 9 月 18 日至 2023 年 9 月 22 日止期间向社会公开发行人募集，募集期结束经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具德师报(验)字(23)第 00233 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2023 年 9 月 28 日正式生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。国中证 2000ETF 基金份额净有效认购资金金额为人民币 823,458,827.00 元，折算成基金份额计 823,458,827.00 份（其中，网上现金认购净有效认购资金为人民币 817,278,000.00 元，折算成基金份额计 817,278,000.00 份；网下现金认购净有效认购资金为人民币 0.00 元，折算成基金份额计 0.00 份；网下股票认购净有效认购资金为人民币 6,180,827.00 元，折算成基金份额计 6,180,827.00 份）；有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币 144,676.22 元（其中，根据注册登记机构的记录，网上现金认购的有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币 144,676.22 元，计入基金财产，不折算成投资者基金份额；网下现金认购有效净认购资金在募集期间产生的折算基金份额的利息为人民币 0.00 元，折算成基金份额计 0.00 份）。本基金的基金管理人为富国基金管理有限公司，广发证券股份有限公司担任基金托管人。

本基金的投资范围主要为标的指数成份股和备选成份股（均含存托凭证）。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包含主板、科创板、

创业板及其他经中国证监会允许发行的股票）、存托凭证、债券（国债、央行票据、地方政府债券、政府支持机构债券、政府支持债券、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、衍生工具（股指期货、股票期权等）、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

本基金可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股（均含存托凭证）的比例不得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。

本基金的业绩比较基准为中证 2000 指数收益率。

#### **6.4.2 会计报表的编制基础**

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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》》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### **6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

#### **6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明**

本基金报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度会计报表所

采用的会计政策、会计估计一致。

#### **6.4.5 会计差错更正的说明**

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### **6.4.6 税项**

##### **1 印花税**

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；根据财政部、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》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

##### **2 增值税**

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《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》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金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。对证券投资基金在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

### 3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

### 4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

## 5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《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》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%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；根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《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》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 (2024年06月30日)
活期存款	196,350.82
等于：本金	196,271.50
加：应计利息	79.32
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	196,350.82

注：本基金本报告期末未持有定期存款。

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末（2024年06月30日）			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	33,600,598.27	—	31,623,700.14	—
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	33,600,598.27	—	31,623,700.14	—

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本报告期末本基金未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 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。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末无买断式逆回购交易。

#### 6.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末（2024年06月30日）
应收利息	—
其他应收款	—
待摊费用	75,409.64
合计	75,409.64

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元



项目	本期末（2024年06月30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	26,204.83
其中：交易所市场	26,204.83
银行间市场	—
应付利息	—
预提信息披露费	40,000.00
预提审计费	46,950.76
IOPV 计算发布费	14,054.07
合计	127,209.66

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	255,458,827.00	255,458,827.00
本期申购	186,000,000.00	186,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-402,000,000.00	-402,000,000.00
本期末	39,458,827.00	39,458,827.00

#### 6.4.7.8 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	14,791,999.79	-7,282,179.62	7,509,820.17
本期期初	14,791,999.79	-7,282,179.62	7,509,820.17
本期利润	9,901,248.29	-5,220,955.89	4,680,292.40
本期基金份额交易产生的变动数	-	-1,038,514.03	-
其中：基金申购款	18,247,474.96	-	19,285,988.99
基金赎回款	7,043,761.03	49,687,784.47	42,644,023.44
本期已分配利润	25,291,235.99	48,649,270.44	23,358,034.45
—	—	—	—
本期末	6,445,773.12	13,541,649.54	-7,095,876.42

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）
----	-----------------------------

活期存款利息收入	12,111.40
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	4,521.47
其他	11,263.59
合计	27,896.46

#### 6.4.7.10 股票投资收益

##### 6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）
股票投资收益——买卖股票差价收入	6,922,170.44
股票投资收益——赎回差价收入	3,135,500.33
股票投资收益——申购差价收入	—
合计	10,057,670.77

##### 6.4.7.10.2 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01月01日至2024年06月30日）
卖出股票成交总额	233,468,275.85
减：卖出股票成本总额	226,334,275.06
减：交易费用	211,830.35
买卖股票差价收入	6,922,170.44

##### 6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）
赎回基金份额对价总额	378,641,965.55
减：现金支付赎回款总额	190,434,123.55
减：赎回股票成本总额	185,072,341.67
减：交易费用	—
赎回差价收入	3,135,500.33

##### 6.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无股票投资收益——申购差价收入。

#### 6.4.7.11 债券投资收益

##### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）
债券投资收益——利息收入	11.42
债券投资收益——买卖债券（债转	18,594.63

股及债券到期兑付) 差价收入	
合计	18,606.05

#### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	110,011.28
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	91,400.00
减：应计利息总额	12.24
减：交易费用	4.41
买卖债券差价收入	18,594.63

#### 6.4.7.12 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

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

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

#### 6.4.7.13 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无买卖贵金属交易。

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

##### 6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

##### 6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）
股票投资产生的股利收益	340,962.34
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	340,962.34

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）
1. 交易性金融资产	-5,220,955.89

股票投资	-5,218,887.27
债券投资	-2,068.62
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	-5,220,955.89

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）
基金赎回费收入	—
替代损益	-192,580.61
合计	-192,580.61

#### 6.4.7.18 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）
审计费用	8,950.76
信息披露费	40,000.00
证券出借违约金	—
其他	84,534.84
合计	133,485.60

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

### 6.4.9 关联方关系

#### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或其他重大影响关系的关联方未发生变化。

#### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
富国基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
海通证券股份有限公司（“海通证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
申万宏源证券有限公司（“申万宏源”）	基金管理人的股东、基金代销机构
申万宏源西部证券有限公司	基金管理人的股东控制的子公司、基金代销机构
广发证券股份有限公司	基金托管人

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
海通证券	363,945,057.00	100.00

注：本基金合同生效日为2023年09月28日，无上年度同期对比数据。

##### 6.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。本基金合同生效日为2023年09月28日，无上年度同期对比数据。

##### 6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）
海通证券	110,011.28	100.00

注：本基金合同生效日为2023年09月28日，无上年度同期对比数据。

#### 6.4.10.1.4 债券回购交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行回购交易。本基金合同生效日为2023年09月28日，无上年度同期对比数据。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
海通证券	71,713.60	100.00	26,204.83	100.00

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

2、自2024年7月1日起，根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

本基金合同生效日为2023年09月28日，无上年度同期对比数据。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）
当期发生的基金应支付的管理费	181,517.64
其中：支付销售机构的客户维护费	3,267.19
应支付基金管理人的净管理费	178,250.45

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

本基金合同生效日为 2023 年 9 月 28 日，无上年度同期对比数据。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期（2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日）
当期发生的基金应支付的托管费	36,303.48

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

本基金合同生效日为 2023 年 9 月 28 日，无上年度同期对比数据。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：本基金本报告期末与关联方通过银行间同业市场进行债券（含回购）交易。

本基金合同生效日 2023 年 09 月 28 日，无上年度同期对比数据。

#### 6.4.10.4 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

##### 6.4.10.4.1 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：本基金本报告期末与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率从事证券出借业务。

#### 6.4.10.4.2 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：本基金本报告期末与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率从事证券出借业务。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注：本报告期内本基金的基金管理人未运用自有资金投资本基金。本基金合同生效日为 2023 年 9 月 28 日，无上年度同期对比数据。

##### 6.4.10.5.2 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 06 月 30 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 (%)
广发证券股份有限公司	—	—	8,609,564.00	3.37

##### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

注：本基金本报告期末发生关联方银行存款业务。本基金合同生效日为 2023 年 09 月 28 日，无上年度同期对比数据。

##### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期末在承销期内直接购入关联方承销的证券。

##### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

###### 6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末进行利润分配。



#### 6.4.12 期末（2024年06月30日）本基金持有的流通受限证券

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

注：本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 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 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002308	*ST 威创	2024年05月06日	重大事项停牌	1.97	2024年07月09日	1.87	8,100.00	19,488.82	15,957.00	—

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2024 年 06 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 06 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、风险管理部和合规稽核部、相关职能部门和业务部门构成的四级风险管理架构体系。

##### 6.4.13.2 信用风险

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

风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市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，不得超过该证券的 10%，但标的指数成分券不受此限。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；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。由于国债、央行票据和政策性金融债的信用风险很低，故不进行列示。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的信用债。

#### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末（2024 年 06 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
AAA	—	—
AAA 以下	—	22,969.44
未评级	—	—
合计	—	22,969.44

注：本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的信用债。本表主要列示除短融和超短融之外的信用债，债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

#### 6.4.13.2.3 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有资产支持证券。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有同业存单。

### 6.4.13.3 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基金份额持有人可随时要

求赎回其持有的基金份额，另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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

#### **6.4.13.3.1 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》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除在6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的15%。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资产的公允价值。

本基金本报告期末无重大流动性风险。

#### **6.4.13.4 市场风险**

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

##### **6.4.13.4.1 利率风险**

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为货币资金、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

###### **6.4.13.4.1.1 利率风险敞口**

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公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

单位：人民币元

本期末（2024年06月30日）	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	196,350.82	—	—	—	—	—	196,350.82
结算备付金	131,288.20	—	—	—	—	—	131,288.20
存出保证金	480,141.06	—	—	—	—	—	480,141.06
交易性金融资产	—	—	—	—	—	31,623,700.14	31,623,700.14
其他资产	—	—	—	—	—	75,409.64	75,409.64
资产总计	807,780.08	—	—	—	—	31,699,109.78	32,506,889.86
负债							
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	13,941.34	13,941.34
应付托管费	—	—	—	—	—	2,788.28	2,788.28
其他负债	—	—	—	—	—	127,209.66	127,209.66
负债总计	—	—	—	—	—	143,939.28	143,939.28
利率敏感度缺口	807,780.08	—	—	—	—	31,555,170.50	32,362,950.58
上年度末（2023年12月31日）	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	7,972,231.58	—	—	—	—	—	7,972,231.58
结算备付金	1,082,870.23	—	—	—	—	—	1,082,870.23
存出保证金	1,361,221.16	—	—	—	—	—	1,361,221.16
交易性金融资产	—	—	22,969.44	—	—	252,882,758.46	252,905,727.90
应收清算款	—	—	—	—	—	44,271,544.59	44,271,544.59

资产总计	10,416,322.97	—	22,969.44	—	—	297,154,303.05	307,593,595.46
负债							
应付清算款	—	—	—	—	—	44,016,381.38	44,016,381.38
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	37,319.90	37,319.90
应付托管费	—	—	—	—	—	7,463.99	7,463.99
其他负债	—	—	—	—	—	563,783.02	563,783.02
负债总计	—	—	—	—	—	44,624,948.29	44,624,948.29
利率敏感度缺口	10,416,322.97	—	22,969.44	—	—	252,529,354.76	262,968,647.17

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本期末及上年度末均未持有债券资产（不含可转债），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金其他价格风险主要系市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。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，所面临的最大市场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市场价格风险，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。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

本基金的投资范围主要为标的指数成份股和备选成份股（均含存托凭证）。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包含主板、科创板、创业板及其他经中国证监会允许发行的股票）、存托凭证、债券（国债、央行票据、地方政府债券、政府支持机构债券、政府支持债券、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、衍生工具（股指期货、股票期权等）、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

本基金可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。

基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股（均含存托凭证）的比例不得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。

如法律法规对该比例要求有变更的，在履行适当程序后，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。

本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

金额单位：人民币元

项目	本期末（2024年06月30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	31,623,700.14	97.72	252,882,758.46	96.16
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	22,969.44	0.01
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	31,623,700.14	97.72	252,905,727.90	96.17

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金管理人运用资产-资本定价模型（CAPM）对本基金的市场价格风险进行分析。下表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，业绩比较基准所对应的市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

假设	1. 基金的市场价格风险主要源于市场的系统性风险，即与基金的贝塔系数紧密相关；2. 以下分析，除业绩比较基准发生变动，其他影响基金资产公允价值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024年06月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	1. 业绩比较基准增加 1%	312,439.72	2,486,994.46
2. 业绩比较基准减少 1%	-312,439.72	-2,486,994.46	

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 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。

#### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.14.2.1 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06月30日)	上年度末 (2023年12月31日)
第一层次	31,607,743.14	252,870,951.13
第二层次	15,957.00	14,000.18
第三层次	—	20,776.59
合计	31,623,700.14	252,905,727.90

##### 6.4.14.2.2 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日为确认各层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，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投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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



---

#### **6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

##### 6.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

##### 6.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 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	31,623,700.14	97.28
	其中：股票	31,623,700.14	97.28
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	327,639.02	1.01
8	其他各项资产	555,550.70	1.71
9	合计	32,506,889.86	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

##### 7.2.1.1 积极投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

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	21,261.00	0.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	—	—

N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	21,261.00	0.07

### 7.2.1.2 指数投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

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	182,277.00	0.56
B	采矿业	286,556.00	0.89
C	制造业	21,424,239.87	66.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	830,081.00	2.56
E	建筑业	406,657.00	1.26
F	批发和零售业	1,552,108.30	4.80
G	交通运输、仓储和邮政业	542,331.20	1.68
H	住宿和餐饮业	114,728.00	0.35
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,034,179.11	9.38
J	金融业	91,344.00	0.28
K	房地产业	664,429.00	2.05
L	租赁和商务服务业	402,685.55	1.24
M	科学研究和技术服务业	676,149.20	2.09
N	水利、环境和公共设施管理业	645,728.64	2.00
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	122,020.00	0.38
Q	卫生和社会工作	61,425.00	0.19
R	文化、体育和娱乐业	478,776.40	1.48
S	综合	86,723.87	0.27
	合计	31,602,439.14	97.65

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 7.3.1 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	600590	泰豪科技	35,800	136,398.00	0.42
2	300355	蒙草生态	60,500	133,100.00	0.41
3	600594	益佰制药	39,600	118,800.00	0.37

4	600133	东湖高新	9,400	98,136.00	0.30
5	605136	丽人丽妆	17,000	93,670.00	0.29
6	600624	复旦复华	30,900	91,773.00	0.28
7	300541	先进数通	9,960	89,440.80	0.28
8	603918	金桥信息	8,400	87,780.00	0.27
9	300181	佐力药业	5,800	87,696.00	0.27
10	601020	华钰矿业	6,700	85,760.00	0.26
11	600736	苏州高新	20,400	84,864.00	0.26
12	688138	清溢光电	3,900	83,850.00	0.26
13	002073	软控股份	11,200	82,768.00	0.26
14	301051	信濠光电	3,000	78,690.00	0.24
15	600939	重庆建工	33,900	78,648.00	0.24
16	003037	三和管桩	12,200	77,592.00	0.24
17	600237	铜峰电子	14,800	77,256.00	0.24
18	000036	华联控股	23,300	75,492.00	0.23
19	002885	京泉华	7,000	75,460.00	0.23
20	603969	银龙股份	15,100	74,896.00	0.23
21	600186	莲花控股	21,500	73,745.00	0.23
22	300250	初灵信息	6,700	73,030.00	0.23
23	603917	合力科技	6,700	72,494.00	0.22
24	603421	鼎信通讯	16,200	72,252.00	0.22
25	301091	深城交	2,660	72,192.40	0.22
26	603136	天目湖	6,600	72,138.00	0.22
27	688179	阿拉丁	7,340	70,977.80	0.22
28	600288	大恒科技	10,700	69,657.00	0.22
29	300131	英唐智控	15,600	69,420.00	0.21
30	002892	科力尔	7,200	69,120.00	0.21
31	002912	中新赛克	3,900	69,108.00	0.21
32	002039	黔源电力	3,900	68,640.00	0.21
33	000099	中信海直	4,200	68,208.00	0.21
34	603738	泰晶科技	5,000	68,200.00	0.21
35	300533	冰川网络	4,900	68,012.00	0.21
36	688085	三友医疗	3,966	67,025.40	0.21
37	301372	科净源	2,500	66,625.00	0.21
38	688510	航亚科技	3,600	66,276.00	0.20
39	600694	大商股份	3,910	65,727.10	0.20
40	603507	振江股份	2,000	65,640.00	0.20
41	603496	恒为科技	2,680	65,526.00	0.20
42	603859	能科科技	3,108	65,330.16	0.20
43	300493	润欣科技	8,000	64,720.00	0.20
44	603538	美诺华	5,700	63,669.00	0.20

45	603028	赛福天	11,300	63,619.00	0.20
46	600114	东睦股份	4,400	63,316.00	0.20
47	688135	利扬芯片	3,921	62,814.42	0.19
48	000949	新乡化纤	18,400	62,560.00	0.19
49	600130	波导股份	19,600	62,524.00	0.19
50	300975	商络电子	6,900	62,376.00	0.19
51	002122	汇洲智能	29,600	61,864.00	0.19
52	002589	瑞康医药	28,100	61,820.00	0.19
53	603912	佳力图	10,300	61,800.00	0.19
54	600611	大众交通	22,100	61,659.00	0.19
55	603333	尚纬股份	19,800	61,578.00	0.19
56	600094	大名城	15,900	61,533.00	0.19
57	300802	矩子科技	3,900	61,503.00	0.19
58	002524	光正眼科	19,500	61,425.00	0.19
59	600198	大唐电信	11,900	61,285.00	0.19
60	002559	亚威股份	8,000	61,280.00	0.19
61	688766	普冉股份	621	60,342.57	0.19
62	603380	易德龙	3,000	60,240.00	0.19
63	002521	齐峰新材	5,100	59,925.00	0.19
64	603258	电魂网络	3,700	59,755.00	0.18
65	300184	力源信息	12,900	59,727.00	0.18
66	301382	蜂助手	3,300	59,697.00	0.18
67	600525	长园集团	14,000	59,640.00	0.18
68	603629	利通电子	3,200	59,072.00	0.18
69	603569	长久物流	8,600	58,996.00	0.18
70	603619	中曼石油	2,500	58,550.00	0.18
71	002786	银宝山新	7,300	58,546.00	0.18
72	600106	重庆路桥	13,400	57,620.00	0.18
73	603960	克来机电	2,700	56,970.00	0.18
74	603011	合锻智能	9,600	56,928.00	0.18
75	600640	国脉文化	5,500	56,925.00	0.18
76	300221	银禧科技	10,800	56,808.00	0.18
77	601089	福元医药	4,100	56,785.00	0.18
78	002106	莱宝高科	5,200	56,680.00	0.18
79	601500	通用股份	10,600	56,604.00	0.17
80	002728	特一药业	7,280	56,420.00	0.17
81	688378	奥来德	2,400	56,304.00	0.17
82	688522	纳睿雷达	1,200	56,256.00	0.17
83	688580	伟思医疗	2,100	56,196.00	0.17
84	002611	东方精工	10,700	56,175.00	0.17
85	002178	延华智能	15,400	55,902.00	0.17

86	600619	海立股份	10,800	55,836.00	0.17
87	300461	田中精机	2,500	55,750.00	0.17
88	002184	海得控制	6,200	55,676.00	0.17
89	688133	泰坦科技	3,500	55,230.00	0.17
90	300566	激智科技	3,900	54,561.00	0.17
91	603367	辰欣药业	3,900	54,366.00	0.17
92	603722	阿科力	1,200	54,300.00	0.17
93	300047	天源迪科	8,300	54,282.00	0.17
94	300608	思特奇	6,000	53,880.00	0.17
95	301139	元道通信	2,500	53,775.00	0.17
96	688588	凌志软件	7,842	53,717.70	0.17
97	603110	东方材料	4,800	53,424.00	0.17
98	605368	蓝天燃气	3,900	53,196.00	0.16
99	600818	中路股份	3,800	53,124.00	0.16
100	300709	精研科技	2,100	53,088.00	0.16
101	603916	苏博特	7,900	53,009.00	0.16
102	600620	天宸股份	12,401	52,952.27	0.16
103	300639	凯普生物	11,500	52,900.00	0.16
104	600638	新黄浦	14,000	52,780.00	0.16
105	002491	通鼎互联	15,600	52,728.00	0.16
106	002590	万安科技	4,000	52,720.00	0.16
107	000965	天保基建	20,100	52,662.00	0.16
108	300548	博创科技	2,700	52,623.00	0.16
109	603032	德新科技	4,600	52,578.00	0.16
110	601700	风范股份	11,900	52,241.00	0.16
111	600716	凤凰股份	19,900	52,138.00	0.16
112	600609	金杯汽车	15,000	52,050.00	0.16
113	300161	华中数控	2,300	51,727.00	0.16
114	300872	天阳科技	3,900	51,675.00	0.16
115	688182	灿勤科技	3,900	51,636.00	0.16
116	688186	广大特材	5,300	51,569.00	0.16
117	002322	理工能科	3,200	51,264.00	0.16
118	603590	康辰药业	2,000	51,080.00	0.16
119	688468	科美诊断	8,061	51,026.13	0.16
120	300005	探路者	10,100	50,601.00	0.16
121	600283	钱江水利	4,000	50,560.00	0.16
122	601007	金陵饭店	7,900	50,244.00	0.16
123	600184	光电股份	5,900	50,209.00	0.16
124	603711	香飘飘	3,600	49,860.00	0.15
125	603681	永冠新材	3,900	49,725.00	0.15
126	603601	再升科技	17,900	49,404.00	0.15

127	603178	圣龙股份	2,300	49,289.00	0.15
128	603987	康德莱	8,060	49,246.60	0.15
129	688299	长阳科技	3,850	49,241.50	0.15
130	600897	厦门空港	3,900	49,179.00	0.15
131	600088	中视传媒	3,000	49,110.00	0.15
132	002095	生意宝	4,000	48,960.00	0.15
133	300504	天邑股份	4,000	48,760.00	0.15
134	688550	瑞联新材	2,100	48,699.00	0.15
135	002196	方正电机	11,600	48,604.00	0.15
136	300485	赛升药业	7,900	48,506.00	0.15
137	600894	广日股份	4,200	48,300.00	0.15
138	002876	三利谱	2,000	48,240.00	0.15
139	603809	豪能股份	5,968	48,221.44	0.15
140	002588	史丹利	6,400	48,192.00	0.15
141	300946	恒而达	1,800	47,952.00	0.15
142	002177	御银股份	14,800	47,804.00	0.15
143	603125	常青科技	2,770	47,671.70	0.15
144	600127	金健米业	7,900	47,637.00	0.15
145	601956	东贝集团	10,400	47,632.00	0.15
146	603516	淳中科技	1,500	47,355.00	0.15
147	301509	金凯生科	1,300	47,294.00	0.15
148	603018	华设集团	5,200	47,268.00	0.15
149	301303	真兰仪表	4,080	47,001.60	0.15
150	300556	丝路视觉	2,800	46,844.00	0.14
151	603662	柯力传感	2,000	46,680.00	0.14
152	603867	新化股份	2,000	46,660.00	0.14
153	603067	振华股份	4,000	46,640.00	0.14
154	002937	兴瑞科技	2,000	46,620.00	0.14
155	603633	徕木股份	5,870	46,431.70	0.14
156	603855	华荣股份	2,100	46,431.00	0.14
157	601968	宝钢包装	9,900	46,332.00	0.14
158	002338	奥普光电	1,400	46,228.00	0.14
159	603998	方盛制药	4,500	46,215.00	0.14
160	603015	弘讯科技	6,100	46,116.00	0.14
161	301127	天源环保	3,900	46,098.00	0.14
162	000926	福星股份	14,500	45,965.00	0.14
163	300465	高伟达	6,300	45,801.00	0.14
164	603977	国泰集团	4,500	45,765.00	0.14
165	300378	鼎捷软件	2,800	45,556.00	0.14
166	000612	焦作万方	7,000	45,500.00	0.14
167	600180	瑞茂通	11,900	45,339.00	0.14

168	002587	奥拓电子	8,400	45,192.00	0.14
169	688305	科德数控	700	45,122.00	0.14
170	300276	三丰智能	12,800	45,056.00	0.14
171	301330	熵基科技	2,000	44,960.00	0.14
172	600495	晋西车轴	14,000	44,940.00	0.14
173	301062	上海艾录	4,400	44,924.00	0.14
174	603315	福鞍股份	4,700	44,838.00	0.14
175	603203	快克智能	1,900	44,802.00	0.14
176	600880	博瑞传播	11,900	44,744.00	0.14
177	300900	广联航空	2,380	44,577.40	0.14
178	300510	金冠股份	12,700	44,450.00	0.14
179	688025	杰普特	1,100	44,429.00	0.14
180	002584	西陇科学	7,900	44,398.00	0.14
181	688222	成都先导	3,900	44,265.00	0.14
182	603618	杭电股份	10,000	43,800.00	0.14
183	600054	黄山旅游	3,900	43,758.00	0.14
184	002376	新北洋	8,100	43,659.00	0.13
185	688252	天德钰	3,000	43,590.00	0.13
186	300779	惠城环保	900	43,560.00	0.13
187	600576	祥源文旅	9,900	43,461.00	0.13
188	600686	金龙汽车	5,900	43,424.00	0.13
189	603173	福斯达	2,000	43,420.00	0.13
190	000663	永安林业	10,300	43,157.00	0.13
191	300516	久之洋	1,500	43,065.00	0.13
192	600973	宝胜股份	11,900	42,959.00	0.13
193	000936	华西股份	7,500	42,900.00	0.13
194	600630	龙头股份	5,300	42,824.00	0.13
195	600336	澳柯玛	10,000	42,800.00	0.13
196	300825	阿尔特	4,400	42,636.00	0.13
197	603165	荣晟环保	4,000	42,480.00	0.13
198	600278	东方创业	7,900	42,423.00	0.13
199	603322	超讯通信	1,600	42,416.00	0.13
200	605388	均瑶健康	7,740	42,415.20	0.13
201	603273	天元智能	2,300	42,205.00	0.13
202	600178	东安动力	4,200	42,084.00	0.13
203	603630	拉芳家化	4,000	42,040.00	0.13
204	600664	哈药股份	15,900	41,976.00	0.13
205	300561	汇金科技	5,200	41,912.00	0.13
206	603527	众源新材	5,900	41,890.00	0.13
207	605128	上海沿浦	1,500	41,835.00	0.13
208	603901	永创智能	5,900	41,831.00	0.13



209	002609	捷顺科技	5,500	41,690.00	0.13
210	300353	东土科技	5,700	41,667.00	0.13
211	600053	九鼎投资	3,000	41,610.00	0.13
212	600222	太龙药业	9,900	41,580.00	0.13
213	600310	广西能源	11,900	41,412.00	0.13
214	605286	同力日升	1,700	41,361.00	0.13
215	002449	国星光电	5,800	41,296.00	0.13
216	300279	和晶科技	9,900	41,283.00	0.13
217	300494	盛天网络	4,100	41,205.00	0.13
218	003032	传智教育	4,100	41,041.00	0.13
219	605398	新炬网络	2,000	40,980.00	0.13
220	601579	会稽山	4,000	40,960.00	0.13
221	301018	申菱环境	2,100	40,824.00	0.13
222	603309	维力医疗	3,700	40,737.00	0.13
223	002046	国机精工	4,000	40,680.00	0.13
224	300328	宜安科技	9,500	40,660.00	0.13
225	600540	新赛股份	11,900	40,579.00	0.13
226	002284	亚太股份	6,000	40,560.00	0.13
227	300809	华辰装备	2,000	40,520.00	0.13
228	601616	广电电气	13,900	40,449.00	0.12
229	600268	国电南自	7,080	40,426.80	0.12
230	600756	浪潮软件	4,000	40,400.00	0.12
231	002476	宝莫股份	11,000	40,370.00	0.12
232	605337	李子园	4,110	40,360.20	0.12
233	603196	日播时尚	5,700	40,242.00	0.12
234	300603	立昂技术	5,800	40,078.00	0.12
235	301159	三维天地	1,500	40,005.00	0.12
236	603663	三祥新材	2,780	40,004.20	0.12
237	688590	新致软件	3,100	39,990.00	0.12
238	300904	威力传动	1,000	39,970.00	0.12
239	603191	望变电气	2,700	39,960.00	0.12
240	002866	传艺科技	3,100	39,897.00	0.12
241	002881	美格智能	2,000	39,680.00	0.12
242	600479	千金药业	3,900	39,663.00	0.12
243	002845	同兴达	3,000	39,660.00	0.12
244	600523	贵航股份	4,000	39,600.00	0.12
245	600218	全柴动力	5,900	39,589.00	0.12
246	601388	怡球资源	18,000	39,420.00	0.12
247	002327	富安娜	3,900	39,195.00	0.12
248	300645	正元智慧	3,100	39,153.00	0.12
249	603703	盛洋科技	3,900	39,117.00	0.12

250	600858	银座股份	9,900	38,907.00	0.12
251	002277	友阿股份	18,000	38,880.00	0.12
252	300508	维宏股份	2,000	38,860.00	0.12
253	300590	移为通信	3,400	38,828.00	0.12
254	000925	众合科技	5,900	38,822.00	0.12
255	300401	花园生物	2,700	38,718.00	0.12
256	601226	华电重工	7,900	38,710.00	0.12
257	600367	红星发展	3,900	38,649.00	0.12
258	603610	麒盛科技	3,900	38,532.00	0.12
259	601199	江南水务	7,900	38,473.00	0.12
260	301318	维海德	1,400	38,458.00	0.12
261	605377	华旺科技	2,900	38,425.00	0.12
262	600228	返利科技	7,900	38,394.00	0.12
263	300615	欣天科技	4,000	38,280.00	0.12
264	603520	司太立	4,000	38,160.00	0.12
265	300063	天龙集团	10,000	38,100.00	0.12
266	605199	葫芦娃	3,900	38,025.00	0.12
267	603800	道森股份	1,900	38,000.00	0.12
268	688391	钜泉科技	1,300	37,921.00	0.12
269	600470	六国化工	9,900	37,818.00	0.12
270	000899	赣能股份	3,900	37,713.00	0.12
271	603135	中重科技	3,000	37,590.00	0.12
272	300690	双一科技	2,000	37,580.00	0.12
273	600537	亿晶光电	14,900	37,548.00	0.12
274	600825	新华传媒	9,900	37,521.00	0.12
275	603508	思维列控	2,000	37,500.00	0.12
276	002161	远望谷	8,100	37,422.00	0.12
277	603200	上海洗霸	1,800	37,404.00	0.12
278	000993	闽东电力	3,900	37,401.00	0.12
279	603999	读者传媒	7,900	37,367.00	0.12
280	000514	渝开发	11,900	37,366.00	0.12
281	002827	高争民爆	1,700	37,213.00	0.11
282	300239	东宝生物	7,900	37,209.00	0.11
283	300688	创业黑马	1,500	37,200.00	0.11
284	600292	远达环保	7,900	37,051.00	0.11
285	000797	中国武夷	15,900	37,047.00	0.11
286	002102	能特科技	15,900	37,047.00	0.11
287	002565	顺灏股份	15,500	37,045.00	0.11
288	600353	旭光电子	6,000	37,020.00	0.11
289	600698	湖南天雁	10,900	36,951.00	0.11
290	301030	仕净科技	1,500	36,930.00	0.11

291	603070	万控智造	3,300	36,927.00	0.11
292	300978	东箭科技	4,000	36,920.00	0.11
293	301052	果麦文化	1,800	36,900.00	0.11
294	603897	长城科技	2,100	36,855.00	0.11
295	002849	威星智能	3,300	36,828.00	0.11
296	600212	绿能慧充	5,900	36,816.00	0.11
297	603628	清源股份	3,000	36,810.00	0.11
298	605208	永茂泰	5,900	36,757.00	0.11
299	002148	北纬科技	7,900	36,735.00	0.11
300	000777	中核科技	2,400	36,672.00	0.11
301	600571	信雅达	3,500	36,540.00	0.11
302	002575	群兴玩具	8,300	36,520.00	0.11
303	002979	雷赛智能	2,000	36,400.00	0.11
304	300968	格林精密	3,900	36,114.00	0.11
305	603908	牧高笛	1,800	36,108.00	0.11
306	300238	冠昊生物	4,000	36,000.00	0.11
307	300708	聚灿光电	4,000	36,000.00	0.11
308	603065	宿迁联盛	4,800	35,856.00	0.11
309	600345	长江通信	2,000	35,820.00	0.11
310	603085	天成自控	4,000	35,760.00	0.11
311	000819	岳阳兴长	2,000	35,740.00	0.11
312	300360	炬华科技	2,100	35,700.00	0.11
313	605389	长龄液压	1,700	35,683.00	0.11
314	300337	银邦股份	4,400	35,640.00	0.11
315	603336	宏辉果蔬	11,840	35,638.40	0.11
316	601999	出版传媒	6,800	35,496.00	0.11
317	003019	宸展光电	1,400	35,462.00	0.11
318	002343	慈文传媒	6,800	35,360.00	0.11
319	605555	德昌股份	1,900	35,359.00	0.11
320	300884	狄耐克	4,100	35,342.00	0.11
321	000680	山推股份	3,800	35,226.00	0.11
322	300399	天利科技	4,000	35,160.00	0.11
323	300292	吴通控股	9,900	35,145.00	0.11
324	600488	津药药业	10,200	34,986.00	0.11
325	688357	建龙微纳	1,500	34,950.00	0.11
326	688435	英方软件	1,400	34,944.00	0.11
327	300288	朗玛信息	3,300	34,881.00	0.11
328	002543	万和电气	3,500	34,860.00	0.11
329	600560	金自天正	2,600	34,840.00	0.11
330	600605	汇通能源	1,400	34,832.00	0.11
331	600814	杭州解百	5,900	34,810.00	0.11

332	603617	君禾股份	5,900	34,810.00	0.11
333	300592	华凯易佰	3,040	34,747.20	0.11
334	300921	南凌科技	2,000	34,640.00	0.11
335	301073	君亭酒店	1,900	34,580.00	0.11
336	688205	德科立	1,200	34,572.00	0.11
337	605086	龙高股份	2,000	34,520.00	0.11
338	688733	壹石通	2,300	34,385.00	0.11
339	688486	龙迅股份	600	34,380.00	0.11
340	688189	南新制药	6,100	34,343.00	0.11
341	605228	神通科技	4,000	34,320.00	0.11
342	300893	松原股份	1,200	34,284.00	0.11
343	605366	宏柏新材	5,900	34,279.00	0.11
344	600351	亚宝药业	6,100	34,221.00	0.11
345	600721	百花医药	5,900	34,220.00	0.11
346	603948	建业股份	2,100	34,188.00	0.11
347	300278	华昌达	11,900	34,153.00	0.11
348	601121	宝地矿业	6,000	34,140.00	0.11
349	600081	东风科技	3,900	34,125.00	0.11
350	603095	越剑智能	2,600	34,086.00	0.11
351	603611	诺力股份	2,000	34,080.00	0.11
352	002045	国光电器	2,500	34,075.00	0.11
353	603076	乐惠国际	1,600	34,064.00	0.11
354	002886	沃特股份	2,500	34,050.00	0.11
355	600468	百利电气	7,900	34,049.00	0.11
356	603878	武进不锈	5,200	34,008.00	0.11
357	600035	楚天高速	7,900	33,891.00	0.10
358	002329	皇氏集团	12,500	33,875.00	0.10
359	301486	致尚科技	800	33,848.00	0.10
360	603266	天龙股份	2,000	33,840.00	0.10
361	603053	成都燃气	3,500	33,810.00	0.10
362	603158	腾龙股份	4,800	33,792.00	0.10
363	301270	汉仪股份	1,400	33,782.00	0.10
364	603815	交建股份	5,900	33,748.00	0.10
365	603689	皖天然气	4,100	33,702.00	0.10
366	603615	茶花股份	3,200	33,696.00	0.10
367	605305	中际联合	1,300	33,527.00	0.10
368	002149	西部材料	2,400	33,504.00	0.10
369	603861	白云电器	4,000	33,480.00	0.10
370	600693	东百集团	11,900	33,439.00	0.10
371	000922	佳电股份	2,800	33,404.00	0.10
372	301292	海科新源	2,700	33,399.00	0.10

373	603318	水发燃气	5,900	33,394.00	0.10
374	605299	舒华体育	4,100	33,292.00	0.10
375	301226	祥明智能	2,000	33,280.00	0.10
376	301085	亚康股份	800	33,216.00	0.10
377	002026	山东威达	4,000	33,200.00	0.10
378	301218	华是科技	1,600	33,136.00	0.10
379	300195	长荣股份	7,900	33,101.00	0.10
380	600790	轻纺城	10,200	32,844.00	0.10
381	601339	百隆东方	6,300	32,823.00	0.10
382	603429	集友股份	7,900	32,785.00	0.10
383	002955	鸿合科技	1,400	32,732.00	0.10
384	002660	茂硕电源	4,400	32,648.00	0.10
385	300320	海达股份	4,000	32,640.00	0.10
386	605196	华通线缆	3,100	32,612.00	0.10
387	600792	云煤能源	9,900	32,571.00	0.10
388	600866	星湖科技	5,900	32,568.00	0.10
389	002017	东信和平	3,900	32,487.00	0.10
390	688292	浩瀚深度	2,100	32,466.00	0.10
391	603970	中农立华	1,900	32,452.00	0.10
392	002364	中恒电气	5,900	32,450.00	0.10
393	600513	联环药业	4,000	32,440.00	0.10
394	002519	银河电子	6,600	32,406.00	0.10
395	301150	中一科技	1,800	32,346.00	0.10
396	300231	银信科技	4,400	32,340.00	0.10
397	600318	新力金融	5,100	32,334.00	0.10
398	000551	创元科技	3,700	32,301.00	0.10
399	605218	伟时电子	2,000	32,300.00	0.10
400	300227	光韵达	5,900	32,273.00	0.10
401	000524	岭南控股	4,000	32,240.00	0.10
402	002922	伊戈尔	1,474	32,221.64	0.10
403	300719	安达维尔	1,900	32,205.00	0.10
404	603153	上海建科	1,900	32,129.00	0.10
405	300375	鹏翎股份	8,300	32,121.00	0.10
406	603096	新经典	1,900	32,110.00	0.10
407	600215	派斯林	4,500	32,085.00	0.10
408	002933	新兴装备	1,400	32,074.00	0.10
409	002972	科安达	3,500	32,060.00	0.10
410	002406	远东传动	6,500	32,045.00	0.10
411	603889	新澳股份	4,140	32,043.60	0.10
412	300404	博济医药	4,000	32,040.00	0.10
413	600851	海欣股份	7,000	31,990.00	0.10

414	600419	天润乳业	4,000	31,880.00	0.10
415	603058	永吉股份	4,000	31,800.00	0.10
416	600173	卧龙地产	8,500	31,790.00	0.10
417	603408	建霖家居	2,400	31,656.00	0.10
418	600121	郑州煤电	9,700	31,622.00	0.10
419	000888	峨眉山A	2,900	31,581.00	0.10
420	600613	神奇制药	5,900	31,565.00	0.10
421	600730	中国高科	7,900	31,521.00	0.10
422	600617	国新能源	12,600	31,500.00	0.10
423	688551	科威尔	1,000	31,500.00	0.10
424	301519	舜禹股份	1,900	31,464.00	0.10
425	002689	远大智能	14,700	31,458.00	0.10
426	688579	山大地纬	3,997	31,376.45	0.10
427	001316	润贝航科	1,000	31,310.00	0.10
428	600822	上海物贸	4,000	31,280.00	0.10
429	300086	康芝药业	8,900	31,239.00	0.10
430	603676	卫信康	3,900	31,239.00	0.10
431	300926	博俊科技	1,560	31,231.20	0.10
432	001380	华纬科技	1,600	31,104.00	0.10
433	301257	普蕊斯	1,100	31,075.00	0.10
434	300842	帝科股份	800	31,040.00	0.10
435	603360	百傲化学	2,640	31,020.00	0.10
436	600229	城市传媒	4,500	31,005.00	0.10
437	300299	富春股份	8,900	30,883.00	0.10
438	603088	宁波精达	4,100	30,873.00	0.10
439	601599	浙文影业	10,700	30,816.00	0.10
440	000526	学大教育	500	30,800.00	0.10
441	002829	星网宇达	2,300	30,797.00	0.10
442	300941	创识科技	1,700	30,702.00	0.09
443	002908	德生科技	4,000	30,680.00	0.09
444	603213	镇洋发展	4,100	30,668.00	0.09
445	002238	天威视讯	3,900	30,615.00	0.09
446	002481	双塔食品	7,900	30,573.00	0.09
447	002882	金龙羽	2,000	30,560.00	0.09
448	688613	奥精医疗	2,400	30,552.00	0.09
449	301313	凡拓数创	1,500	30,525.00	0.09
450	603009	北特科技	1,700	30,481.00	0.09
451	300396	迪瑞医疗	1,500	30,465.00	0.09
452	603937	丽岛新材	3,900	30,264.00	0.09
453	600735	新华锦	7,900	30,257.00	0.09
454	300523	辰安科技	2,000	30,180.00	0.09

455	300939	秋田微	1,000	30,140.00	0.09
456	300691	联合光电	2,000	30,100.00	0.09
457	603122	合富中国	5,900	30,031.00	0.09
458	603119	浙江荣泰	1,690	29,946.80	0.09
459	605108	同庆楼	1,400	29,904.00	0.09
460	603081	大丰实业	3,200	29,824.00	0.09
461	605118	力鼎光电	2,000	29,780.00	0.09
462	300559	佳发教育	3,100	29,667.00	0.09
463	600987	航民股份	4,200	29,652.00	0.09
464	300351	永贵电器	2,000	29,600.00	0.09
465	000521	长虹美菱	3,900	29,562.00	0.09
466	688319	欧林生物	3,300	29,535.00	0.09
467	688332	中科蓝讯	500	29,495.00	0.09
468	605277	新亚电子	2,280	29,457.60	0.09
469	000957	中通客车	2,800	29,456.00	0.09
470	688320	禾川科技	1,200	29,448.00	0.09
471	600826	兰生股份	5,460	29,374.80	0.09
472	603579	荣泰健康	1,900	29,374.00	0.09
473	603687	大胜达	4,100	29,356.00	0.09
474	002319	乐通股份	3,400	29,308.00	0.09
475	600616	金枫酒业	6,100	29,280.00	0.09
476	301011	华立科技	1,900	29,279.00	0.09
477	601188	龙江交通	9,900	29,205.00	0.09
478	002988	豪美新材	1,900	29,165.00	0.09
479	601789	宁波建工	7,900	29,072.00	0.09
480	605198	安德利	1,100	29,040.00	0.09
481	301141	中科磁业	900	29,025.00	0.09
482	600386	北巴传媒	10,400	29,016.00	0.09
483	600249	两面针	7,900	28,993.00	0.09
484	603890	春秋电子	3,200	28,992.00	0.09
485	300796	贝斯美	2,000	28,940.00	0.09
486	600982	宁波能源	8,100	28,917.00	0.09
487	600551	时代出版	4,080	28,886.40	0.09
488	300172	中电环保	6,400	28,864.00	0.09
489	300290	荣科科技	3,100	28,861.00	0.09
490	300985	致远新能	1,800	28,836.00	0.09
491	603211	晋拓股份	2,100	28,791.00	0.09
492	002952	亚世光电	1,400	28,770.00	0.09
493	300062	中能电气	5,900	28,733.00	0.09
494	002166	莱茵生物	4,200	28,728.00	0.09
495	300491	通合科技	2,000	28,720.00	0.09

496	603282	亚光股份	1,700	28,662.00	0.09
497	301185	鸥玛软件	2,000	28,660.00	0.09
498	002035	华帝股份	4,600	28,658.00	0.09
499	300430	诚益通	1,900	28,652.00	0.09
500	300127	银河磁体	1,900	28,595.00	0.09
501	002766	索菱股份	5,900	28,556.00	0.09
502	301320	豪江智能	1,900	28,538.00	0.09
503	600558	大西洋	7,900	28,440.00	0.09
504	603708	家家悦	3,500	28,385.00	0.09
505	301133	金钟股份	1,300	28,327.00	0.09
506	600758	辽宁能源	9,900	28,314.00	0.09
507	600108	亚盛集团	11,900	28,203.00	0.09
508	603052	可川科技	1,000	28,150.00	0.09
509	600354	敦煌种业	5,900	28,143.00	0.09
510	300771	智莱科技	3,200	28,128.00	0.09
511	603339	四方科技	3,100	28,117.00	0.09
512	002334	英威腾	4,700	28,106.00	0.09
513	603817	海峡环保	5,900	28,084.00	0.09
514	603219	富佳股份	1,900	28,044.00	0.09
515	600789	鲁抗医药	4,000	28,000.00	0.09
516	300858	科拓生物	1,900	27,968.00	0.09
517	605289	罗曼股份	1,100	27,940.00	0.09
518	301111	粤万年青	2,000	27,900.00	0.09
519	300740	水羊股份	1,900	27,892.00	0.09
520	000931	中关村	7,900	27,887.00	0.09
521	002296	辉煌科技	2,700	27,837.00	0.09
522	002679	福建金森	4,000	27,720.00	0.09
523	300793	佳禾智能	2,000	27,720.00	0.09
524	000803	山高环能	7,936	27,696.64	0.09
525	002510	天汽模	7,100	27,619.00	0.09
526	603190	亚通精工	1,200	27,552.00	0.09
527	002935	天奥电子	2,280	27,542.40	0.09
528	002759	天际股份	4,000	27,520.00	0.09
529	002380	科远智慧	1,500	27,450.00	0.08
530	300007	汉威科技	2,000	27,440.00	0.08
531	603239	浙江仙通	2,000	27,420.00	0.08
532	688287	观典防务	5,211	27,409.86	0.08
533	603209	兴通股份	1,980	27,403.20	0.08
534	002833	弘亚数控	1,500	27,360.00	0.08
535	002846	英联股份	4,000	27,320.00	0.08
536	300174	元力股份	2,000	27,300.00	0.08



537	300607	拓斯达	2,000	27,240.00	0.08
538	601008	连云港	7,900	27,176.00	0.08
539	600992	贵绳股份	1,600	27,136.00	0.08
540	002654	万润科技	2,500	27,125.00	0.08
541	002957	科瑞技术	2,000	27,120.00	0.08
542	300179	四方达	4,100	27,101.00	0.08
543	603031	安孚科技	1,200	27,096.00	0.08
544	301126	达嘉维康	3,000	27,090.00	0.08
545	603966	法兰泰克	3,940	27,067.80	0.08
546	002787	华源控股	4,000	27,040.00	0.08
547	603949	雪龙集团	2,400	27,024.00	0.08
548	600854	春兰股份	7,900	27,018.00	0.08
549	300790	宇瞳光学	2,000	27,000.00	0.08
550	605186	健麾信息	1,200	26,952.00	0.08
551	600592	龙溪股份	3,100	26,877.00	0.08
552	002533	金杯电工	2,700	26,865.00	0.08
553	603558	健盛集团	2,700	26,865.00	0.08
554	603217	元利科技	1,900	26,790.00	0.08
555	300099	尤洛卡	5,900	26,786.00	0.08
556	300515	三德科技	2,700	26,649.00	0.08
557	002623	亚玛顿	1,600	26,608.00	0.08
558	300913	兆龙互连	800	26,576.00	0.08
559	600979	广安爱众	7,900	26,544.00	0.08
560	300414	中光防雷	4,000	26,440.00	0.08
561	300543	朗科智能	3,300	26,400.00	0.08
562	002669	康达新材	3,200	26,336.00	0.08
563	300729	乐歌股份	1,700	26,333.00	0.08
564	002451	摩恩电气	4,900	26,313.00	0.08
565	300066	三川智慧	9,200	26,312.00	0.08
566	301322	绿通科技	1,400	26,278.00	0.08
567	603109	神驰机电	2,000	26,220.00	0.08
568	002165	红宝丽	7,900	26,070.00	0.08
569	000716	黑芝麻	7,200	26,064.00	0.08
570	600980	北矿科技	2,000	26,060.00	0.08
571	002552	宝鼎科技	2,000	26,040.00	0.08
572	600794	保税科技	8,200	25,994.00	0.08
573	300248	新开普	4,000	25,960.00	0.08
574	300962	中金辐照	1,900	25,916.00	0.08
575	300922	天秦装备	1,995	25,915.05	0.08
576	688533	上声电子	1,000	25,870.00	0.08
577	300681	英搏尔	1,980	25,819.20	0.08

578	603163	圣晖集成	1,000	25,800.00	0.08
579	002792	通宇通讯	2,470	25,786.80	0.08
580	000561	烽火电子	4,000	25,640.00	0.08
581	603950	长源东谷	1,900	25,612.00	0.08
582	605089	味知香	1,200	25,608.00	0.08
583	301383	天键股份	980	25,597.60	0.08
584	002361	神剑股份	7,900	25,596.00	0.08
585	002282	博深股份	4,000	25,560.00	0.08
586	300112	万讯自控	3,700	25,530.00	0.08
587	600785	新华百货	1,900	25,498.00	0.08
588	301201	诚达药业	1,400	25,480.00	0.08
589	301568	思泰克	800	25,456.00	0.08
590	300805	电声股份	4,000	25,440.00	0.08
591	300911	亿田智能	1,000	25,440.00	0.08
592	603223	恒通股份	3,900	25,428.00	0.08
593	000589	贵州轮胎	5,000	25,350.00	0.08
594	002824	和胜股份	1,980	25,264.80	0.08
595	002082	万邦德	6,000	25,260.00	0.08
596	300586	美联新材	4,000	25,160.00	0.08
597	002896	中大力德	900	25,110.00	0.08
598	301263	泰恩康	2,000	25,060.00	0.08
599	300852	四会富仕	860	25,043.20	0.08
600	002232	启明信息	1,900	25,042.00	0.08
601	688618	三旺通信	1,000	25,030.00	0.08
602	603811	诚意药业	4,000	25,000.00	0.08
603	603090	宏盛股份	1,400	24,948.00	0.08
604	002825	纳尔股份	4,000	24,920.00	0.08
605	600713	南京医药	5,900	24,898.00	0.08
606	300444	双杰电气	3,900	24,765.00	0.08
607	002577	雷柏科技	2,000	24,740.00	0.08
608	000948	南天信息	2,000	24,700.00	0.08
609	300711	广哈通信	1,600	24,688.00	0.08
610	605378	野马电池	1,600	24,672.00	0.08
611	000886	海南高速	5,900	24,662.00	0.08
612	002574	明牌珠宝	5,900	24,662.00	0.08
613	600644	乐山电力	3,800	24,662.00	0.08
614	001358	兴欣新材	1,200	24,624.00	0.08
615	603353	和顺石油	1,900	24,624.00	0.08
616	600251	冠农股份	3,400	24,616.00	0.08
617	600769	祥龙电业	3,900	24,531.00	0.08
618	603697	有友食品	4,200	24,360.00	0.08

619	603639	海利尔	2,000	24,340.00	0.08
620	002093	国脉科技	4,000	24,280.00	0.08
621	300585	奥联电子	2,100	24,234.00	0.07
622	603598	引力传媒	1,900	24,168.00	0.07
623	300606	金太阳	1,300	24,128.00	0.07
624	003000	劲仔食品	2,000	24,100.00	0.07
625	605188	国光连锁	3,100	24,025.00	0.07
626	603206	嘉环科技	1,900	23,997.00	0.07
627	605007	五洲特纸	1,900	23,997.00	0.07
628	002907	华森制药	1,900	23,978.00	0.07
629	688259	创耀科技	600	23,976.00	0.07
630	300381	溢多利	3,900	23,946.00	0.07
631	301311	昆船智能	1,300	23,894.00	0.07
632	002878	元隆雅图	1,900	23,883.00	0.07
633	300349	金卡智能	2,000	23,840.00	0.07
634	002664	信质集团	2,000	23,800.00	0.07
635	300307	慈星股份	4,000	23,800.00	0.07
636	300828	锐新科技	2,000	23,740.00	0.07
637	300997	欢乐家	2,000	23,640.00	0.07
638	000863	三湘印象	5,900	23,600.00	0.07
639	600279	重庆港	6,500	23,595.00	0.07
640	300435	中泰股份	2,000	23,540.00	0.07
641	300707	威唐工业	1,900	23,522.00	0.07
642	000529	广弘控股	4,000	23,520.00	0.07
643	300342	天银机电	1,600	23,408.00	0.07
644	003025	思进智能	1,900	23,389.00	0.07
645	301211	亨迪药业	1,600	23,376.00	0.07
646	605266	健之佳	900	23,355.00	0.07
647	603006	黎明股份	2,400	23,352.00	0.07
648	001229	魅视科技	800	23,336.00	0.07
649	000715	中兴商业	4,900	23,324.00	0.07
650	002150	通润装备	1,900	23,237.00	0.07
651	300424	航新科技	1,900	23,237.00	0.07
652	300989	蕾奥规划	1,900	23,237.00	0.07
653	002823	凯中精密	1,900	23,180.00	0.07
654	002363	隆基机械	4,000	23,160.00	0.07
655	603578	三星新材	1,900	22,990.00	0.07
656	300798	锦鸡股份	3,700	22,977.00	0.07
657	002843	泰嘉股份	1,500	22,965.00	0.07
658	300011	鼎汉技术	4,600	22,954.00	0.07
659	603757	大元泵业	1,200	22,920.00	0.07

660	000532	华金资本	1,900	22,914.00	0.07
661	688121	卓然股份	1,900	22,838.00	0.07
662	601116	三江购物	3,000	22,830.00	0.07
663	300213	佳讯飞鸿	4,000	22,800.00	0.07
664	600476	湘邮科技	1,900	22,800.00	0.07
665	603396	金辰股份	700	22,729.00	0.07
666	002438	江苏神通	2,100	22,701.00	0.07
667	301102	兆讯传媒	1,925	22,695.75	0.07
668	603768	常青股份	2,000	22,680.00	0.07
669	300107	建新股份	2,300	22,655.00	0.07
670	002668	TCL 智家	2,500	22,650.00	0.07
671	002290	禾盛新材	1,700	22,644.00	0.07
672	002897	意华股份	600	22,596.00	0.07
673	603214	爱婴室	2,000	22,580.00	0.07
674	002386	天原股份	5,900	22,538.00	0.07
675	002042	华孚时尚	5,900	22,479.00	0.07
676	300890	翔丰华	900	22,455.00	0.07
677	002880	卫光生物	800	22,416.00	0.07
678	600359	新农开发	4,000	22,360.00	0.07
679	002803	吉宏股份	2,000	22,260.00	0.07
680	600526	菲达环保	6,000	22,260.00	0.07
681	603701	德宏股份	2,100	22,218.00	0.07
682	300480	光力科技	1,400	22,162.00	0.07
683	603366	日出东方	6,200	22,134.00	0.07
684	300522	世名科技	2,000	22,100.00	0.07
685	300484	蓝海华腾	1,600	22,064.00	0.07
686	000153	丰原药业	4,100	22,058.00	0.07
687	300310	宜通世纪	5,900	22,007.00	0.07
688	603230	内蒙新华	1,900	21,926.00	0.07
689	002115	三维通信	4,500	21,870.00	0.07
690	301331	恩威医药	1,000	21,870.00	0.07
691	300403	汉宇集团	3,200	21,856.00	0.07
692	688601	力芯微	500	21,845.00	0.07
693	603050	科林电气	900	21,834.00	0.07
694	601086	国芳集团	5,900	21,771.00	0.07
695	301370	国科恒泰	2,000	21,740.00	0.07
696	000713	丰乐种业	4,000	21,720.00	0.07
697	601113	华鼎股份	6,600	21,648.00	0.07
698	002735	王子新材	2,200	21,626.00	0.07
699	002535	林州重机	7,900	21,567.00	0.07
700	300100	双林股份	2,000	21,540.00	0.07

701	605399	晨光新材	2,000	21,500.00	0.07
702	603519	立霸股份	1,900	21,489.00	0.07
703	002722	物产金轮	1,900	21,470.00	0.07
704	301396	宏景科技	1,100	21,461.00	0.07
705	301528	多浦乐	500	21,420.00	0.07
706	600798	宁波海运	7,900	21,409.00	0.07
707	000530	冰山冷热	5,900	21,358.00	0.07
708	002523	天桥起重	9,900	21,285.00	0.07
709	000558	莱茵体育	9,900	21,186.00	0.07
710	002703	浙江世宝	1,900	21,166.00	0.07
711	300698	万马科技	600	21,078.00	0.07
712	002658	雪迪龙	4,100	21,033.00	0.06
713	301319	唯特偶	700	21,021.00	0.06
714	600838	上海九百	3,900	20,982.00	0.06
715	002333	罗普斯金	3,900	20,943.00	0.06
716	000159	国际实业	4,000	20,880.00	0.06
717	603291	联合水务	1,700	20,842.00	0.06
718	003005	竞业达	1,000	20,840.00	0.06
719	603232	格尔软件	2,000	20,840.00	0.06
720	002676	顺威股份	4,500	20,835.00	0.06
721	603319	湘油泵	1,300	20,787.00	0.06
722	002578	闽发铝业	7,900	20,777.00	0.06
723	002526	山东矿机	8,800	20,768.00	0.06
724	600829	人民同泰	3,700	20,757.00	0.06
725	600749	西藏旅游	1,600	20,688.00	0.06
726	600293	三峡新材	8,300	20,667.00	0.06
727	603107	上海汽配	1,300	20,657.00	0.06
728	688285	高铁电气	3,200	20,576.00	0.06
729	002613	北玻股份	5,900	20,532.00	0.06
730	603289	泰瑞机器	2,300	20,516.00	0.06
731	603215	比依股份	1,600	20,464.00	0.06
732	002012	凯恩股份	6,000	20,460.00	0.06
733	301408	华人健康	2,000	20,460.00	0.06
734	603967	中创物流	2,200	20,460.00	0.06
735	300758	七彩化学	1,900	20,425.00	0.06
736	000962	东方钽业	2,000	20,420.00	0.06
737	301137	哈焊华通	1,400	20,398.00	0.06
738	002553	南方精工	2,200	20,394.00	0.06
739	002953	日丰股份	2,600	20,384.00	0.06
740	301092	争光股份	900	20,376.00	0.06
741	000509	华塑控股	7,900	20,303.00	0.06

742	300667	必创科技	1,500	20,295.00	0.06
743	603378	亚士创能	4,000	20,240.00	0.06
744	300958	建工修复	1,900	20,197.00	0.06
745	300925	法本信息	2,000	20,180.00	0.06
746	001387	雪祺电气	1,300	20,150.00	0.06
747	002546	新联电子	6,200	20,150.00	0.06
748	002599	盛通股份	4,000	20,000.00	0.06
749	300359	全通教育	4,900	19,992.00	0.06
750	000788	北大医药	4,000	19,960.00	0.06
751	603062	麦加芯彩	600	19,926.00	0.06
752	002014	永新股份	2,100	19,908.00	0.06
753	000534	万泽股份	2,000	19,860.00	0.06
754	600833	第一医药	1,900	19,855.00	0.06
755	300649	杭州园林	1,900	19,817.00	0.06
756	002111	威海广泰	1,900	19,798.00	0.06
757	688247	宣泰医药	2,400	19,728.00	0.06
758	000633	合金投资	5,000	19,700.00	0.06
759	301399	英特科技	1,000	19,680.00	0.06
760	300542	新晨科技	1,600	19,664.00	0.06
761	300654	世纪天鸿	2,300	19,550.00	0.06
762	300629	新劲刚	1,100	19,426.00	0.06
763	002401	中远海科	1,300	19,422.00	0.06
764	002246	北化股份	2,300	19,343.00	0.06
765	001339	智微智能	700	19,327.00	0.06
766	601518	吉林高速	7,900	19,276.00	0.06
767	002976	瑞玛精密	800	19,200.00	0.06
768	600327	大东方	6,000	19,200.00	0.06
769	603698	航天工程	1,600	19,152.00	0.06
770	002181	粤传媒	5,900	19,057.00	0.06
771	000541	佛山照明	3,900	18,993.00	0.06
772	300275	梅安森	1,900	18,943.00	0.06
773	001299	美能能源	1,600	18,880.00	0.06
774	600629	华建集团	4,300	18,748.00	0.06
775	600738	丽尚国潮	5,100	18,717.00	0.06
776	300192	科德教育	1,900	18,658.00	0.06
777	603017	中衡设计	2,100	18,606.00	0.06
778	002919	名臣健康	1,600	18,576.00	0.06
779	002137	实益达	3,900	18,564.00	0.06
780	002923	润都股份	2,000	18,520.00	0.06
781	300840	酷特智能	2,000	18,500.00	0.06
782	002570	贝因美	7,900	18,486.00	0.06

783	600784	鲁银投资	3,900	18,486.00	0.06
784	600573	惠泉啤酒	2,100	18,396.00	0.06
785	000722	湖南发展	2,000	18,380.00	0.06
786	603357	设计总院	2,000	18,380.00	0.06
787	002538	司尔特	4,100	18,368.00	0.06
788	002900	哈三联	2,000	18,360.00	0.06
789	300439	美康生物	2,000	18,320.00	0.06
790	001217	华尔泰	2,000	18,300.00	0.06
791	001212	中旗新材	900	18,270.00	0.06
792	603066	音飞储存	2,000	18,260.00	0.06
793	600230	沧州大化	1,800	18,234.00	0.06
794	002962	五方光电	1,200	18,144.00	0.06
795	600853	龙建股份	5,900	18,113.00	0.06
796	002536	飞龙股份	1,900	18,088.00	0.06
797	301516	中远通	968	18,033.84	0.06
798	002970	锐明技术	500	18,015.00	0.06
799	301058	中粮科工	1,900	17,993.00	0.06
800	000570	苏常柴A	4,000	17,880.00	0.06
801	603270	金帝股份	900	17,856.00	0.06
802	300945	曼卡龙	2,000	17,820.00	0.06
803	603099	长白山	800	17,808.00	0.06
804	301567	贝隆精密	400	17,776.00	0.05
805	000409	云鼎科技	2,200	17,754.00	0.05
806	002116	中国海诚	1,900	17,689.00	0.05
807	301136	招标股份	1,500	17,670.00	0.05
808	603130	云中马	1,000	17,640.00	0.05
809	300996	普联软件	1,200	17,604.00	0.05
810	603518	锦泓集团	2,000	17,600.00	0.05
811	002033	丽江股份	2,000	17,520.00	0.05
812	002980	华盛昌	800	17,512.00	0.05
813	301391	卡莱特	400	17,512.00	0.05
814	600830	香溢融通	2,500	17,400.00	0.05
815	605179	一鸣食品	1,900	17,347.00	0.05
816	601065	江盐集团	2,000	17,340.00	0.05
817	002090	金智科技	2,000	17,280.00	0.05
818	003027	同兴环保	1,400	17,220.00	0.05
819	002136	安纳达	1,900	17,214.00	0.05
820	300605	恒锋信息	1,900	17,214.00	0.05
821	301063	海锅股份	1,200	17,208.00	0.05
822	300341	麦克奥迪	2,000	17,160.00	0.05
823	000852	石化机械	3,200	17,152.00	0.05

824	605068	明新旭腾	1,300	17,134.00	0.05
825	001283	豪鹏科技	400	17,080.00	0.05
826	000823	超声电子	2,000	17,020.00	0.05
827	301366	一博科技	500	17,020.00	0.05
828	301199	迈赫股份	700	16,926.00	0.05
829	603767	中马传动	1,400	16,926.00	0.05
830	002112	三变科技	1,900	16,872.00	0.05
831	002917	金奥博	1,900	16,872.00	0.05
832	601566	九牧王	2,000	16,840.00	0.05
833	600501	航天晨光	1,300	16,731.00	0.05
834	603933	睿能科技	1,300	16,718.00	0.05
835	001378	德冠新材	700	16,702.00	0.05
836	000037	深南电 A	1,900	16,625.00	0.05
837	300317	珈伟新能	4,400	16,588.00	0.05
838	600379	宝光股份	2,000	16,580.00	0.05
839	002452	长高电新	2,000	16,560.00	0.05
840	002702	海欣食品	4,600	16,560.00	0.05
841	002469	三维化学	2,900	16,530.00	0.05
842	603035	常熟汽饰	1,300	16,484.00	0.05
843	000677	恒天海龙	5,900	16,461.00	0.05
844	002860	星帅尔	2,000	16,380.00	0.05
845	600727	鲁北化工	2,600	16,380.00	0.05
846	002263	大东南	7,900	16,353.00	0.05
847	001319	铭科精技	1,000	16,300.00	0.05
848	605016	百龙创园	800	16,296.00	0.05
849	300258	精锻科技	2,000	16,260.00	0.05
850	688678	福立旺	1,500	16,245.00	0.05
851	300225	金力泰	3,300	16,203.00	0.05
852	605056	咸亨国际	1,500	16,170.00	0.05
853	002632	道明光学	2,000	16,120.00	0.05
854	300445	康斯特	1,000	16,100.00	0.05
855	003011	海象新材	1,200	16,092.00	0.05
856	002707	众信旅游	2,800	16,072.00	0.05
857	000045	深纺织 A	2,000	16,040.00	0.05
858	301198	喜悦智行	2,000	16,020.00	0.05
859	300138	晨光生物	1,900	16,017.00	0.05
860	688212	澳华内镜	400	16,004.00	0.05
861	301265	华新环保	2,022	15,994.02	0.05
862	688577	浙海德曼	400	15,968.00	0.05
863	603758	秦安股份	2,100	15,960.00	0.05
864	603097	江苏华辰	600	15,912.00	0.05



865	002066	瑞泰科技	2,000	15,900.00	0.05
866	603648	畅联股份	2,000	15,840.00	0.05
867	000544	中原环保	2,000	15,740.00	0.05
868	002903	宇环数控	900	15,723.00	0.05
869	688668	鼎通科技	400	15,716.00	0.05
870	688677	海泰新光	400	15,692.00	0.05
871	605167	利柏特	2,000	15,620.00	0.05
872	600962	国投中鲁	1,300	15,548.00	0.05
873	603329	上海雅仕	1,400	15,428.00	0.05
874	301066	万事利	1,900	15,390.00	0.05
875	300994	久祺股份	1,400	15,386.00	0.05
876	300933	中辰股份	2,500	15,375.00	0.05
877	001314	亿道信息	400	15,372.00	0.05
878	002164	宁波东力	4,000	15,360.00	0.05
879	300580	贝斯特	1,040	15,288.00	0.05
880	000912	泸天化	4,400	15,268.00	0.05
881	300812	易天股份	700	15,267.00	0.05
882	603004	鼎龙科技	900	15,255.00	0.05
883	603686	福龙马	2,000	15,240.00	0.05
884	300718	长盛轴承	1,100	15,202.00	0.05
885	002441	众业达	2,000	15,160.00	0.05
886	603082	北自科技	500	15,120.00	0.05
887	002788	鹭燕医药	1,900	14,972.00	0.05
888	003007	直真科技	600	14,970.00	0.05
889	600742	一汽富维	2,000	14,900.00	0.05
890	605066	天正电气	2,675	14,899.75	0.05
891	002117	东港股份	2,100	14,868.00	0.05
892	301012	扬电科技	600	14,856.00	0.05
893	002877	智能自控	2,000	14,780.00	0.05
894	002140	东华科技	1,900	14,725.00	0.05
895	000011	深物业A	1,900	14,706.00	0.05
896	300553	集智股份	600	14,694.00	0.05
897	002852	道道全	2,000	14,400.00	0.04
898	300247	融捷健康	5,900	14,337.00	0.04
899	002631	德尔未来	4,000	14,320.00	0.04
900	603168	莎普爱思	1,900	14,307.00	0.04
901	001313	粤海饲料	1,900	14,288.00	0.04
902	300402	宝色股份	1,100	14,278.00	0.04
903	002606	大连电瓷	1,900	14,269.00	0.04
904	300434	金石亚药	1,900	14,250.00	0.04
905	300905	宝丽迪	500	14,205.00	0.04

906	002598	山东章鼓	1,900	14,098.00	0.04
907	300193	佳士科技	1,900	14,098.00	0.04
908	002730	电光科技	2,000	14,080.00	0.04
909	603002	宏昌电子	3,000	14,070.00	0.04
910	688663	新风光	600	13,962.00	0.04
911	000920	沃顿科技	1,900	13,927.00	0.04
912	002561	徐家汇	2,000	13,920.00	0.04
913	301072	中捷精工	700	13,916.00	0.04
914	000631	顺发恒业	5,900	13,806.00	0.04
915	002365	永安药业	1,900	13,718.00	0.04
916	301307	美利信	700	13,706.00	0.04
917	002989	中天精装	900	13,689.00	0.04
918	300304	云意电气	2,100	13,671.00	0.04
919	600846	同济科技	2,000	13,660.00	0.04
920	300164	通源石油	3,900	13,650.00	0.04
921	603126	中材节能	2,500	13,625.00	0.04
922	300426	唐德影视	2,000	13,560.00	0.04
923	002069	獐子岛	5,600	13,552.00	0.04
924	002790	瑞尔特	1,500	13,545.00	0.04
925	002835	同为股份	800	13,512.00	0.04
926	600425	青松建化	4,100	13,448.00	0.04
927	000705	浙江震元	1,900	13,433.00	0.04
928	301202	朗威股份	500	13,380.00	0.04
929	300987	川网传媒	1,100	13,354.00	0.04
930	000779	甘咨询	1,900	13,319.00	0.04
931	002057	中钢天源	1,900	13,300.00	0.04
932	688210	统联精密	600	13,290.00	0.04
933	688628	优利德	400	13,108.00	0.04
934	688003	天准科技	400	13,104.00	0.04
935	002734	利民股份	1,900	13,091.00	0.04
936	688035	德邦科技	400	12,888.00	0.04
937	002999	天禾股份	2,400	12,840.00	0.04
938	688290	景业智能	400	12,840.00	0.04
939	000404	长虹华意	2,400	12,792.00	0.04
940	688687	凯因科技	500	12,755.00	0.04
941	301393	昊帆生物	300	12,741.00	0.04
942	688102	斯瑞新材	1,100	12,562.00	0.04
943	000919	金陵药业	2,000	12,520.00	0.04
944	002132	恒星科技	5,900	12,508.00	0.04
945	605319	无锡振华	700	12,390.00	0.04
946	002695	煌上煌	1,900	12,331.00	0.04

947	600101	明星电力	1,000	12,300.00	0.04
948	301256	华融化学	2,000	12,280.00	0.04
949	300350	华鹏飞	2,600	12,272.00	0.04
950	002566	益盛药业	2,000	12,240.00	0.04
951	300950	德固特	800	12,192.00	0.04
952	301297	富乐德	600	12,186.00	0.04
953	301398	星源卓镁	300	12,165.00	0.04
954	000850	华茂股份	4,000	12,160.00	0.04
955	300453	三鑫医疗	1,900	12,141.00	0.04
956	605268	王力安防	1,700	12,121.00	0.04
957	002339	积成电子	2,000	12,040.00	0.04
958	301138	华研精机	500	11,945.00	0.04
959	301128	强瑞技术	300	11,940.00	0.04
960	003016	欣贺股份	1,900	11,894.00	0.04
961	002905	金逸影视	1,900	11,780.00	0.04
962	002580	圣阳股份	1,900	11,685.00	0.04
963	000822	山东海化	2,000	11,660.00	0.04
964	301280	珠城科技	300	11,640.00	0.04
965	603739	蔚蓝生物	900	11,628.00	0.04
966	300835	龙磁科技	400	11,620.00	0.04
967	002614	奥佳华	2,100	11,613.00	0.04
968	300847	中船汉光	800	11,592.00	0.04
969	301312	智立方	300	11,538.00	0.04
970	688228	开普云	300	11,448.00	0.04
971	000978	桂林旅游	1,900	11,400.00	0.04
972	002297	博云新材	1,900	11,400.00	0.04
973	300441	鲍斯股份	1,900	11,267.00	0.03
974	000753	漳州发展	4,000	11,240.00	0.03
975	300797	钢研纳克	1,200	11,112.00	0.03
976	002162	悦心健康	4,000	11,040.00	0.03
977	002981	朝阳科技	600	10,986.00	0.03
978	002103	广博股份	2,200	10,912.00	0.03
979	000833	粤桂股份	2,320	10,857.60	0.03
980	605162	新中港	1,500	10,845.00	0.03
981	002160	常铝股份	4,000	10,840.00	0.03
982	002264	新华都	2,100	10,731.00	0.03
983	000068	华控赛格	3,900	10,530.00	0.03
984	002286	保龄宝	1,900	10,469.00	0.03
985	300095	华伍股份	1,900	10,469.00	0.03
986	300781	因赛集团	200	10,436.00	0.03
987	301285	鸿日达	400	10,436.00	0.03

988	301277	新天地	800	10,384.00	0.03
989	603312	西典新能	400	10,280.00	0.03
990	603931	格林达	500	10,165.00	0.03
991	688195	腾景科技	400	9,804.00	0.03
992	300272	开能健康	2,000	9,800.00	0.03
993	301076	新瀚新材	500	9,685.00	0.03
994	002395	双象股份	600	9,018.00	0.03
995	301281	科源制药	400	8,980.00	0.03
996	688698	伟创电气	300	8,091.00	0.03
997	001239	永达股份	575	7,981.00	0.02
998	300969	恒帅股份	100	6,913.00	0.02
999	301413	安培龙	67	2,770.45	0.01

### 7.3.2 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	002308	*ST 威创	8,100	15,957.00	0.05
2	002435	ST 长康	13,600	5,304.00	0.02

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 7.4.1 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	300705	九典制药	549,081.00	0.21
2	000628	高新发展	534,028.00	0.20
3	000766	通化金马	506,585.00	0.19
4	002270	华明装备	430,618.00	0.16
5	603052	可川科技	388,617.00	0.15
6	300049	福瑞股份	367,206.96	0.14
7	603628	清源股份	366,764.00	0.14
8	300355	蒙草生态	346,475.00	0.13
9	300857	协创数据	315,219.00	0.12
10	300181	佐力药业	308,050.00	0.12
11	300708	聚灿光电	288,552.00	0.11
12	002154	报喜鸟	283,833.00	0.11
13	300852	四会富仕	278,485.40	0.11
14	605118	力鼎光电	272,581.00	0.10
15	300494	盛天网络	268,805.00	0.10
16	002655	共达电声	267,143.00	0.10
17	300678	中科信息	266,157.00	0.10

18	300353	东土科技	265,915.00	0.10
19	002122	汇洲智能	256,433.00	0.10
20	600622	光大嘉宝	255,525.00	0.10

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

#### 7.4.2 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	000766	通化金马	1,543,023.00	0.59
2	300049	福瑞股份	1,003,720.00	0.38
3	300705	九典制药	1,001,713.00	0.38
4	301318	维海德	929,656.50	0.35
5	002270	华明装备	863,749.00	0.33
6	301280	珠城科技	799,587.00	0.30
7	300098	高新兴	776,412.00	0.30
8	002975	博杰股份	756,002.00	0.29
9	300852	四会富仕	748,549.00	0.28
10	300181	佐力药业	682,887.00	0.26
11	000070	ST 特信	679,669.00	0.26
12	300678	中科信息	677,657.00	0.26
13	300708	聚灿光电	676,723.00	0.26
14	002154	报喜鸟	668,550.00	0.25
15	300494	盛天网络	653,459.00	0.25
16	300590	移为通信	647,686.00	0.25
17	300468	四方精创	636,985.00	0.24
18	300046	台基股份	633,708.00	0.24
19	300946	恒而达	620,692.00	0.24
20	002197	ST 证通	619,254.00	0.24

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

#### 7.4.3 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	130,476,781.15
卖出股票收入（成交）总额	233,468,275.85

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

---

## 7.5 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。

## 7.6 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。

## 7.7 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。

## 7.8 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。

## 7.9 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。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，以降低交易成本，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金根据基金合同的约定，不允许投资国债期货。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 声明本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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，贵州益佰制药股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到贵州省药品监督管理局的处罚。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，西藏华钰矿业股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到山南市生态环境局的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规、基金合同及公司投资制度的要求。基金管理人将密切跟踪相关进展，遵循价值投资的理念进行投资决策。

本基金持有的其余证券的发行主体本期未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。

### 7.12.2 声明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

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。

### 7.12.3 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	480,141.06
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	75,409.64
8	其他	—
9	合计	555,550.70

### 7.12.4 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。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.12.5.1 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未持有流通受限的股票。

#### 7.12.5.2 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(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002308	威创股份	15,957.00	0.05	筹划重大事项

---

#### **7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。



## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 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(%)
1,164	33,899.34	12,888,574.00	32.66	26,570,253.00	67.34

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例(%)
1	招商证券股份有限公司	3,390,313.00	8.59
2	中信建投证券股份有限公司	2,158,962.00	5.47
3	中国银河证券股份有限公司	2,000,000.00	5.07
4	中国国际金融股份有限公司	1,874,398.00	4.75
5	胡一川	1,329,000.00	3.37
6	雷鸣瑶	1,329,000.00	3.37
7	李迎九	1,171,500.00	2.97
8	丘德彪	1,000,000.00	2.53
9	王磊	1,000,000.00	2.53
10	常州鑫爵工艺礼品包装有限公司	950,000.00	2.41

### 8.3 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	—	—

### 8.4 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的情况

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 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2023年09月28日)基金份额总额	823,458,827.00
报告期期初基金份额总额	255,458,827.00
本报告期基金总申购份额	186,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	402,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	39,458,827.00

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金没有召开基金份额持有人大会。

### 10.2 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

本报告期内本基金基金管理人无重大人事变动。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金资产的诉讼。

本报告期内，本基金托管人不涉及公募基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	富国基金管理有限公司
受到稽查或处罚等措施的时间	2024-02-02
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会上海监管局
受到的具体措施类型	责令改正
受到稽查或处罚等措施的原因	个别规定及制度未严格执行。
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司已完成整改。
其他	—
措施 2	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	督察长
受到稽查或处罚等措施的时间	2024-02-02
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会上海监管局
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	个别规定及制度未严格执行。
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司已完成整改。
其他	—

## 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

## 10.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 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 (%)	
海通证券	4	363,945,057.00	100.00	71,713.60	100.00	—
中信证券	1	—	—	—	—	—

注：我公司对基金交易单元的选择是综合考虑券商的研究能力及其它相关因素后决定的。本报告期内本基金租用券商交易单元无变更。

### 10.7.2 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 (%)
海通证券	110,011.28	100.00	—	—	—	—
中信证券	—	—	—	—	—	—

## 10.8 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	关于富国基金管理有限公司旗下部分上交所上市基金场内扩位简称变更的公告	规定披露媒介	2024年03月14日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2024-01-05 至 2024-01-07	15,222,012.00	133,047,850.00	146,110,900.00	2,158,962.00	5.47%

#### 产品特有风险

本基金于本报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情形，本基金管理人已经采取措施，审慎确认大额申购与大额赎回，防控产品流动性风险并公平对待投资者。本基金管理人提请投资者注意因单一投资者持有基金份额集中导致的产品流动性风险、大额赎回风险以及净值波动风险等特有风险。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，经向上海证券交易所申请并获得同意，本基金管理人决定自 2024 年 3 月 14 日起将本基金的场内扩位简称由“中证 2000 指数 ETF”变更为“中证 2000ETF 富国”。具体可参见基金管理人于 2024 年 3 月 14 日发布的《关于富国基金管理有限公司旗下部分上交所上市基金场内扩位简称变更的公告》。

## § 12 备查文件目录

备查文件名称	备查文件存放地点	备查文件查阅方式
1、中国证监会批准设立富国中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金的文件 2、富国中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同 3、富国中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金托管协议 4、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件 5、富国中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金财务报表及报表附注 6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告	中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层	投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人富国基金管理有限公司。咨询电话:95105686、4008880688(全国统一,免长途话费)公司网址: <a href="http://www.fullgoal.com.cn">http://www.fullgoal.com.cn</a> 。