

# 易方达中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

## 2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：国泰君安证券股份有限公司

送出日期：二〇二四年八月三十日

## § 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。

基金托管人国泰君安证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 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	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	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 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合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
7.3 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	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	59
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	61
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	61
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	61
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	61
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	61

7.10	本基金投资股指期货的投资政策	61
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	62
7.12	投资组合报告附注	62
<b>§ 8</b>	<b>基金份额持有人信息</b>	<b>63</b>
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	63
8.2	期末上市基金前十名持有人	63
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	64
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情况	64
<b>§ 9</b>	<b>开放式基金份额变动</b>	<b>64</b>
<b>§ 10</b>	<b>重大事件揭示</b>	<b>64</b>
10.1	基金份额持有人大会决议	64
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	65
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	65
10.4	基金投资策略的改变	65
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	65
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	65
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	65
10.8	其他重大事件	67
<b>§ 11</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息</b>	<b>67</b>
11.1	影响投资者决策的其他重要信息	67
<b>§ 12</b>	<b>备查文件目录</b>	<b>67</b>
12.1	备查文件目录	67
12.2	存放地点	68
12.3	查阅方式	68

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	易方达中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	易方达中证 2000ETF
场内简称	中证 2000 指数 ETF
基金主代码	159532
交易代码	159532
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023 年 9 月 13 日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	国泰君安证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	67,564,791.00 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 21 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的最小化。
投资策略	为了更好地实现跟踪标的指数的目的，基金管理人可根据基金运作及指数情况决定本基金采用抽样复制投资策略或完全复制投资策略。本基金目前采用抽样复制投资策略。本基金采用抽样复制投资策略时，基金管理人将依托指数投资平台，综合考虑指数成份股构成、代表性、相关性、流动性等因素，构建指数化投资组合，追求投资组合与标的指数的风险收益特征尽可能相近，以达到紧密跟踪标的指数的目的。本基金采用完全复制投资策略时，将完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情形导致基金无法完全投资于标的指数成份股时，基金管理人可采取包括成份股替代策略在内的其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到紧密跟踪标的指数的目的。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。此外，本基金将以降低跟踪误差和流动性管理为目的，综合考虑流动性和收益性，适当参与债券和货币市场工具的投资。为更好地实现投资目标，本基金可投资股指期货、国债期货、股票期权。在加强风险防范并遵守审慎原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要参与转融通证券出借业务，并可根据相关法律法规参与融资业务。
业绩比较基准	中证 2000 指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，紧密跟踪标的指数的表

现，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		易方达基金管理有限公司	国泰君安证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王玉	帅芳
	联系电话	020-85102688	021-38031815
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	tgrxp@tg.gtja.com
客户服务电话		400 881 8088	021-38917599-5
传真		020-38798812	021-38677819
注册地址		广东省珠海市横琴新区荣粤道 188号6层	中国（上海）自由贸易试验区商 城路618号
办公地址		广州市天河区珠江新城珠江东 路30号广州银行大厦40-43楼；广 东省珠海市横琴新区荣粤道188 号6层	上海市静安区新闻路669号博华 广场19楼
邮政编码		510620； 519031	200041
法定代表人		刘晓艳	朱健

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.efunds.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人的办公地址

### 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 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日）
---------------	--------------------------------------

本期已实现收益	-5,875,283.53
本期利润	-8,714,750.54
加权平均基金份额本期利润	-0.1190
本期加权平均净值利润率	-13.20%
本期基金份额净值增长率	-19.70%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>报告期末(2024年6月30日)</b>
期末可供分配利润	-11,219,684.78
期末可供分配基金份额利润	-0.1661
期末基金资产净值	56,345,106.22
期末基金份额净值	0.8339
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2024年6月30日)</b>
基金份额累计净值增长率	-16.61%

注：1.所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。

2.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。

3.期末可供分配利润，为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

## 3.2 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	-8.45%	1.80%	-9.15%	1.85%	0.70%	-0.05%
过去三个月	-10.85%	1.94%	-13.75%	2.01%	2.90%	-0.07%
过去六个月	-19.70%	2.41%	-23.28%	2.50%	3.58%	-0.09%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-16.61%	2.00%	-22.51%	2.07%	5.90%	-0.07%

### 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

易方达中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2023 年 9 月 13 日至 2024 年 6 月 30 日)



- 注：1.本基金合同于 2023 年 9 月 13 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。
- 2.按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。
- 3.自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为-16.61%，同期业绩比较基准收益率为-22.51%。

## § 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

经中国证监会证监基金字[2001]4 号文批准，本基金管理人成立于 2001 年 4 月 17 日，注册资本 13,244.2 万元人民币。本基金管理人拥有包括公募、社保、基本养老保险、年金、特定客户资产管理、QDII、投资顾问等在内的多类业务资格，在主动权益、指数投资、债券、多资产、另类资产等投资领域全面布局，为境内外客户提供资产管理解决方案。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		

李栩	<p>本基金的基金经理，易方达中证物联网主题 ETF、易方达中证沪港深 500ETF、易方达中证港股通互联网 ETF、易方达中证生物科技主题 ETF 联接发起式、易方达国证信息技术创新主题 ETF、易方达中证港股通互联网 ETF 联接发起式、易方达中证物联网主题 ETF 联接发起式、易方达中证沪港深 500ETF 联接发起式、易方达国证机器人产业 ETF、易方达上证科创板芯片指数发起式、易方达国证新能源电池 ETF、易方达中证 A50ETF、易方达中证半导体材料设备主题 ETF 的基金经理，易方达中证军工 ETF、易方达中证红利 ETF 联接发起式（自 2022 年 09 月 10 日至 2024 年 04 月 26 日）、易方达 MSCI 中国 A50 互联互通 ETF 联接（自 2022 年 09 月 10 日至 2024 年 04 月 26 日）、易方达中证海外中国互联网 50（QDII-ETF）、易方达中证红利 ETF（自 2022 年 09 月 10 日至 2024 年 04 月 26 日）、易方达 MSCI 中国 A50 互联互通 ETF（自 2022 年 09 月 10 日至 2024 年 04 月 26 日）、易方达中证军工指数（LOF）、易方达中证全指证券公司指数（LOF）、易方达国证信息技术创新主题 ETF 联接发起式、易方达国证新能源电池 ETF 联接发起式、易方达中证 A50ETF 联接发起式、易方达国证机器人产业 ETF 联接发起式的基金经理助理</p>	2023-09-13	-	7 年	<p>硕士研究生，具有基金从业资格。曾任国泰君安证券股份有限公司分析师，易方达基金管理有限公司研究员。</p>
林伟斌	<p>本基金的基金经理，易方达中证 800ETF、易方达中证 800ETF 联接发起式、易方达中证红利 ETF、易方达中证红利 ETF 联接发起式、易方达上证科创板 50ETF、易方达上证科创 50 联接、易方达 MSCI 中国 A50 互联互通 ETF、易方达 MSCI 中国 A50 互联互通 ETF 联接、易方达纳斯达克 100ETF（QDII）、易方达 MSCI 美国 50ETF（QDII）、易方达中证红利低波动 ETF、易方达中证 A50ETF、易方达中证 A50ETF</p>	2023-09-13	-	16 年	<p>博士研究生，具有基金从业资格。曾任中国金融期货交易所股份有限公司研发部研究员，易方达基金管理有限公司指数与量化研究员、基金经理助理、量化基金组合部副总经理、量化策略部副总经理、指数投资部副总经理，易方达沪深 300ETF 发起式、易方达沪深 300ETF 发起式联接、易方达黄金 ETF、易方达中证 500ETF、易方达黄金 ETF 联接、易方达标普医疗保健指数（QDII-LOF）、易方达标普 500 指数（QDII-LOF）、易方达标</p>

	联接发起式的基金经理，指数投资部总经理、指数投资决策委员会委员			普生物科技指数（QDII-LOF）、易方达标普信息科技指数（QDII-LOF）、易方达纳斯达克 100 指数（QDII-LOF）、易方达中证国有企业改革指数（LOF）、易方达上证 50 指数（LOF）、易方达中证 500 质量成长 ETF 的基金经理。
--	---------------------------------	--	--	--

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

2.证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

3.为加强基金流动性管理，本基金安排了相关人员协助基金经理进行现金头寸与流动性管理。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

#### 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

本基金管理人主要通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程，以及强化事后监控分析来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人制定了严格的投资权限管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等，并重视交易执行环节的公平交易措施，以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统内的公平交易模块，以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 31 次，其中 26 次为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易，5 次为不同基金经理管理的基金因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪中证 2000 指数，该指数选取市值规模较小且流动性较好的 2000 只证券作为指数样本。中证 2000 与沪深 300、中证 500 和中证 1000 指数共同构成中证规模指数系列，反映不同市值规模上市公司证券的整体表现。报告期内本基金主要采用抽样复制投资策略，基金管理人将依托指数投资平台，综合考虑指数成份股构成、代表性、相关性、流动性等因素，构建指数化投资组合，追求投资组合与标的指数的风险收益特征尽可能相近，以达到紧密跟踪标的指数的目的。

2024 年上半年，随着宏观政策效应持续释放，经济增长延续回升向好态势，生产稳定增长，需求持续恢复，新质生产力加速发展，国内生产总值录得 61.7 万亿元，同比增长 5.0%。物价方面，随着经济持续恢复，上半年居民消费价格（CPI）同比上涨 0.1%，核心 CPI 同比上涨 0.7%；此外，在节能降碳与大规模设备更新等政策及其他因素的推动下，国内工业品市场供需关系也有所改善。但另一方面，当前外部环境仍然复杂，国内有效需求仍然不足，内生动力有待加强，经济持续回升向好仍面临诸多困难挑战。在这样的情形下，2024 年上半年内 A 股市场呈现震荡特征。风格方面，新“国九条”推出，有望推动资本市场高质量发展，推进金融强国建设。在该背景下，高质量、高股息资产以及一些代表新质生产力方向的成长资产受到了市场更多的关注。受市场风格影响，表征小微盘股的中证 2000 指数在上半年内下跌 23.3%，收益率表现弱于 A 股大盘。

本报告期涵盖本基金的建仓期，建仓期间内本基金采取相对灵活以及审慎的建仓策略，在严格按照基金合同要求以及尽量减少市场冲击的原则下进行基金的建仓工作。在基金的正常运作期，本基金坚持既定的指数化投资策略，在指数权重调整和基金申赎变动时，应用指数复制和量化技术降低冲击成本和减少跟踪误差。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 0.8339 元，本报告期份额净值增长率为-19.70%，同期业绩比较基准收益率为-23.28%。受建仓期影响，年化跟踪误差 2.72%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2024 年 7 月二十届三中全会召开，会议分析了当前形势和任务，强调坚定不移实现全年经济社会发展目标。会议指出，面对纷繁复杂的国际国内形势，面对新一轮科技革命和产业变革，面对人民群众新期待，必须自觉把改革摆在更加突出位置，紧紧围绕推进中国式现代化进一步全面深化改革。展望 2024 年下半年，随着中国式现代化的不断推进，宏观政策效应持续显现，国内经济动能有

望迎来持续改善。在国内经济量的增长与质的提升下，上市公司的盈利能力与质量也有望不断提升，国内股票市场可能在盈利增速提升与估值修复的情形下，迎来较好的投资机会。

长期来看，在高质量发展目标的驱动下，处于细分行业隐形冠军地位的专精特新小市值企业，正逐步走向科技含量更高的产业链，参与全球市场竞争，盈利能力与业务规模均有较好提升，公司的业绩成长进入发展快车道。

作为被动型投资基金，本基金将坚持既定的指数化投资策略，以严格控制基金相对目标指数的跟踪偏离为投资目标，追求跟踪误差的最小化，为投资者提供质地优良的指数投资工具，为长期看好 A 股市场小微盘股投资前景的投资者提供方便、高效的工具。

#### 4.6 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，估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

#### 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

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或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

本报告期内，国泰君安证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在易方达中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

### 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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了复核，未发现本基金管理人存在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

本托管人复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况（如有）、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：易方达中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	2,298,440.75	2,099,721.75
结算备付金		334,190.13	933,131.33
存出保证金		366,892.09	1,414,875.94
交易性金融资产	6.4.7.2	53,639,458.44	74,429,551.44

其中：股票投资		53,639,458.44	74,409,550.70
基金投资		-	-
债券投资		-	20,000.74
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	95,397.85
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	86,064.96	-
资产总计		56,725,046.37	78,972,678.31
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024 年 6 月 30 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		222,795.71	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		6,855.51	11,252.68
应付托管费		2,285.13	3,750.89
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	0.13
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	148,003.80	482,432.95
负债合计		379,940.15	497,436.65
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	67,564,791.00	75,564,791.00
未分配利润	6.4.7.8	-11,219,684.78	2,910,450.66
净资产合计		56,345,106.22	78,475,241.66
负债和净资产总计		56,725,046.37	78,972,678.31

注：1.本基金合同生效日为 2023 年 9 月 13 日，2023 年度实际报告期间为 2023 年 9 月 13 日至 2023 年 12 月 31 日。

2.报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.8339 元，基金份额总额 67,564,791.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：易方达中证 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 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-8,517,605.84
1.利息收入		28,513.72
其中：存款利息收入	6.4.7.9	28,513.72
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）		-5,330,066.52
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-5,399,538.79
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	8,911.61
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.13	-441,001.69
股利收益	6.4.7.14	501,562.35
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	-2,839,467.01
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-376,586.03
<b>减：二、营业总支出</b>		197,144.70
1. 管理人报酬		50,646.75
2. 托管费		16,882.23
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	6.4.7.17	-
7. 税金及附加		-
8. 其他费用	6.4.7.18	129,615.72
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-8,714,750.54</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-8,714,750.54</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-

六、综合收益总额		-8,714,750.54
----------	--	---------------

注：本基金合同生效日为 2023 年 9 月 13 日，截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

### 6.3 净资产变动表

会计主体：易方达中证 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 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 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	75,564,791.00	2,910,450.66	78,475,241.66
二、本期期初净资产	75,564,791.00	2,910,450.66	78,475,241.66
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-8,000,000.00	-14,130,135.44	-22,130,135.44
（一）、综合收益总额	-	-8,714,750.54	-8,714,750.54
（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）	-8,000,000.00	-5,415,384.90	-13,415,384.90
其中：1.基金申购款	124,000,000.00	-23,748,847.22	100,251,152.78
2.基金赎回款	-132,000,000.00	18,333,462.32	-113,666,537.68
（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	67,564,791.00	-11,219,684.78	56,345,106.22

注：本基金合同生效日为 2023 年 9 月 13 日，截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

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：

基金管理人负责人：刘晓艳，主管会计工作负责人：陈荣，会计机构负责人：王永铿

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

易方达中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)根据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]1937 号《关于准予易方达中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》进行募集，由易方达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《易方达中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2023 年 9 月 13 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 811,564,791.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 51,791.00 份基金份额。本基金为交易型开放式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司，基金托管人为国泰君安证券股份有限公司。

### 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》《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本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

### 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。

### 6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

##### (1) 印花税

证券(股票)交易印花税税率为 1‰, 由出让方缴纳。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。

##### (2) 增值税、城建税、教育费附加及地方教育费附加

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。金融商品转让, 按照卖出价扣除买入价后的余额为销售额。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, 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;

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, 自 2018 年 1 月 1 日起, 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(以下简称“资管产品运营业务”), 暂适用简易计税方法, 按照 3% 的征收率缴纳增值税, 资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 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, 已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减;

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, 自 2018 年 1 月 1 日起, 资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部

分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3% 和 2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

### （3）企业所得税

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。

### （4）个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金从上市公司分配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，减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，减按 25% 计入应纳税所得额；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。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

## 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 6 月 30 日
活期存款	2,298,440.75
等于：本金	2,297,447.06
加：应计利息	993.69
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-

加：应计利息	-
合计	2,298,440.75

## 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	56,722,455.24	-	53,639,458.44	-3,082,996.80
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	56,722,455.24	-	53,639,458.44	-3,082,996.80

## 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

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	1,990,520.00	-	-	-
IM2407	1,011,520.00	-	-	-
IM2412	979,000.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	1,990,520.00	-	-	-

## 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
----	----	----------	------	--------

IM2407	IM2407	1	971,600.00	-39,920.00
IM2412	IM2412	1	937,800.00	-41,200.00
合计	-	-	-	-81,120.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	-81,120.00
净额	-	-	-	-

注：1. 衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

2. 买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

#### 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

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	10,655.84
待摊费用	75,409.12
合计	86,064.96

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 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	10,867.61
其中：交易所市场	10,867.61
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	65,680.68
应付替代款	71,262.71
可退替代款	192.80
合计	148,003.80

## 6.4.7.7 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 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	75,564,791.00	75,564,791.00
本期申购	124,000,000.00	124,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-132,000,000.00	-132,000,000.00
本期末	67,564,791.00	67,564,791.00

## 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	4,781,134.86	-1,870,684.20	2,910,450.66
本期期初	4,781,134.86	-1,870,684.20	2,910,450.66
本期利润	-5,875,283.53	-2,839,467.01	-8,714,750.54
本期基金份额交易产生的变动数	800,691.66	-6,216,076.56	-5,415,384.90
其中：基金申购款	-1,752,947.19	-21,995,900.03	-23,748,847.22
基金赎回款	2,553,638.85	15,779,823.47	18,333,462.32
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-293,457.01	-10,926,227.77	-11,219,684.78

## 6.4.7.9 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 6 月 30 日	
	活期存款利息收入	15,874.04
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	7,123.69	
其他	5,515.99	
合计	28,513.72	

## 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 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	股票投资收益——买卖股票差价收入	-2,915,237.74
股票投资收益——赎回差价收入	-2,484,301.05	
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	-5,399,538.79
----	---------------

## 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1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	148,496,828.19
减：卖出股票成本总额	151,289,193.33
减：交易费用	122,872.60
买卖股票差价收入	-2,915,237.74

## 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1月1日至2024年6月30日
赎回基金份额对价总额	113,666,537.68
减：现金支付赎回款总额	42,804,488.68
减：赎回股票成本总额	73,346,350.05
减：交易费用	-
赎回差价收入	-2,484,301.05

## 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1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	5.40
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	8,906.21
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	8,911.61

## 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1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	64,314.92
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	55,399.77

减：应计利息总额	6.37
减：交易费用	2.57
买卖债券差价收入	8,906.21

#### 6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.13 衍生工具收益

##### 6.4.7.13.1 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股指期货投资收益	-441,001.69

#### 6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	501,562.35
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	501,562.35

#### 6.4.7.15 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6月30日
1.交易性金融资产	-2,843,347.01
——股票投资	-2,843,347.01
——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	3,880.00
——权证投资	-
——期货投资	3,880.00
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	-2,839,467.01

#### 6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益收入	-376,586.03
合计	-376,586.03

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。

#### 6.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

#### 6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	23,058.36
信息披露费	34,098.48
证券出借违约金	-
其他	72,458.88
合计	129,615.72

注：本报告期内，基金管理人自主承担本基金的信息披露费 5,682.94 元、审计费 3,843.83 元、IOPV 计算与发布费 1,421.52 元、注册登记费 10,655.12 元。

#### 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，本基金无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害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
易方达基金管理有限公司	基金管理人
国泰君安证券股份有限公司	基金托管人、申购赎回代办证券公司
广发证券股份有限公司	基金管理人股东、申购赎回代办证券公司

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1月1日至2024年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国泰君安证券	88,252,065.98	29.80%

## 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

## 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1月1日至2024年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
国泰君安证券	48,217.52	74.97%

## 6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

## 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1月1日至2024年6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
国泰君安证券	8,827.49	29.80%	3,441.45	31.67%

注：1.上述佣金按协议约定的佣金率计算，佣金率由协议签订方参考市场价格确定。本报告期该类佣金协议的服务范围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等。

2.根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，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。

## 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1月1日至2024年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	50,646.75
其中：应支付销售机构的客户维护费	4,081.88
应支付基金管理人的净管理费	46,564.87

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.15% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	16,882.23

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.05% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

**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**

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

**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**

本基金本报告期末未发生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。

**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**

本基金本报告期未发生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。

#### 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固有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 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 6 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	-	-	9,342,605.00	12.3637%

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用按基金合同等相关法律文件有关规定支付。

##### 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

无。

##### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期未在承销期内参与关联方承销证券。

##### 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

本报告期内，基金管理人自主承担本基金的信息披露费 5,682.94 元、审计费 3,843.83 元、IOPV 计算与发布费 1,421.52 元、注册登记费 10,655.12 元。

##### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未发生利润分配。

##### 6.4.12 期末（2024 年 6 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

金额单位：人民币元

<b>6.4.12.1.1</b> 受限证券类别：股票
-----------------------------

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
301566	达利凯普	2023-12-22	6个月	新股流通受限	8.90	16.97	257	2,287.30	4,361.29	-

注：基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，则此新增股票的流通受限期和估值价格与相应原股票一致。

#### 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(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000040	东旭蓝天	2024-05-06	重大事项停牌	2.41	2024-07-09	2.29	3,300	8,842.06	7,953.00	-

#### 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

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金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为 0，无抵押债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 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

本基金管理人按照“自上而下与自下而上相结合，全面管理、专业分工”的思路，将风险控制嵌入到全公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。从投资决策的层次看，投资决策委员会、投资总监、基金投资部门总经理和基金经理对投资行为及相关风险进行管理、监控，并根据其不同权限实施风险控制；从岗位职能的分工上看，基金经理、监察合规管理部门、集中交易部门、核算部以及投资风险管理部从不同角度、不同环节对投资的全过程实行风险监控和管理；从投资管理的流程看，已经形成了一套贯穿“事前的风险定位、事中的风险管理和事后的风险评估”

的健全的风险监控体系。

本基金为股票型基金，预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，紧密跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指包括债券发行人出现拒绝支付利息或到期时拒绝支付本息的违约风险，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下跌的风险，及因交易对手违约而产生的交割风险。本基金管理人建立了内部信用评级制度，通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险。本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场主要通过交易对手库制度防范交易对手风险。

于 2024 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.00%(2023 年 12 月 31 日：0.03%)。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限在一年以内的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的短期融资券。

3. 债券投资以全价列示。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

##### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	0.00	0.00

A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

#### 6.4.13.2.4 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6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	20,000.74
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	20,000.74

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债和央票。

3. 债券投资以全价列示。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指包括因市场交易量不足，导致基金管理人不能以合理价格及时进行证券交易的风险，或投资组合无法应付客户赎回要求所引起的违约风险。本基金采用分散投资、控制流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时公司已经建立全覆盖、多维度以压力测试为核心的开放式基金流动性风险监测与预警制度，投资风险管理部独立于投资部门负责流动性压力测试的实施与评估。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。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模式带

来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。于 2024 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 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在基金运作过程中按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》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组合的流动性指标进行持续的监测和分析。

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。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在流动性良好的证券交易所或者银行间同业市场交易，除本报告期末本基金持有的流通受限证券章节中所列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，其余均能及时变现。评估结果显示组合高流动性资产比重较高，组合变现比例能力较好。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指因受各种因素影响而引起的基金所持证券及其衍生品市场价格不利波动，使基金资产面临损失的风险，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。投资管理人通过久期、凸度、VAR 等方法评估组合面临的利率风险敞口，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
------------------------	-------	-------	-------	-----	----

资产					
货币资金	2,298,440.75	-	-	-	2,298,440.75
结算备付金	334,190.13	-	-	-	334,190.13
存出保证金	366,892.09	-	-	-	366,892.09
交易性金融资产	-	-	-	53,639,458.44	53,639,458.44
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	86,064.96	86,064.96
资产总计	2,999,522.97	-	-	53,725,523.40	56,725,046.37
负债					
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	-	-	-	222,795.71	222,795.71
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	6,855.51	6,855.51
应付托管费	-	-	-	2,285.13	2,285.13
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	-	-	-	148,003.80	148,003.80
负债总计	-	-	-	379,940.15	379,940.15
利率敏感度缺口	2,999,522.97	-	-	53,345,583.25	56,345,106.22
上年度末					
2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	2,099,721.75	-	-	-	2,099,721.75
结算备付金	933,131.33	-	-	-	933,131.33
存出保证金	1,414,875.94	-	-	-	1,414,875.94

交易性金融资产	-	-	20,000.74	74,409,550.70	74,429,551.44
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	95,397.85	95,397.85
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	4,447,729.02	-	20,000.74	74,504,948.55	78,972,678.31
负债	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	11,252.68	11,252.68
应付托管费	-	-	-	3,750.89	3,750.89
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	0.13	0.13
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	482,432.95	482,432.95
负债总计	-	-	-	497,436.65	497,436.65
利率敏感度缺口	4,447,729.02	-	20,000.74	74,007,511.90	78,475,241.66

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本期末本基金未持有交易性债券投资（不包括可转债），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，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他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

的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金的基金管理人采用 Barra 风险管理系统，通过标准差、跟踪误差、beta 值、VAR 等指标，监控投资组合面临的市场价格波动风险。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 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	53,639,458.44	95.20	74,409,550.70	94.82
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	53,639,458.44	95.20	74,409,550.70	94.82

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	2,694,829.89	3,730,862.90
	2.业绩比较基准下降 5%	-2,694,829.89	-3,730,862.90

#### 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 6 月 30 日
第一层次	53,627,144.15
第二层次	7,953.00
第三层次	4,361.29
合计	53,639,458.44

## 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的金融工具，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金融工具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，确定相关金融工具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

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	53,639,458.44	94.56
	其中：股票	53,639,458.44	94.56
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	2,632,630.88	4.64
8	其他各项资产	452,957.05	0.80
9	合计	56,725,046.37	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

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	153,320.00	0.27
B	采矿业	385,488.00	0.68
C	制造业	37,402,793.74	66.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,197,855.00	2.13
E	建筑业	819,628.00	1.45
F	批发和零售业	2,348,783.60	4.17
G	交通运输、仓储和邮政业	1,099,358.80	1.95
H	住宿和餐饮业	153,516.00	0.27
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,286,304.42	9.38
J	金融业	-	-
K	房地产业	1,144,443.00	2.03
L	租赁和商务服务业	964,056.40	1.71
M	科学研究和技术服务业	1,013,126.18	1.80
N	水利、环境和公共设施管理业	861,225.90	1.53
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	192,310.00	0.34
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	569,009.40	1.01

S	综合	48,240.00	0.09
	合计	53,639,458.44	95.20

## 7.3 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

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	占基金资产净值比例（%）
1	300181	佐力药业	10,300	155,736.00	0.28
2	600133	东湖高新	14,500	151,380.00	0.27
3	603619	中曼石油	5,400	126,468.00	0.22
4	000680	山推股份	13,200	122,364.00	0.22
5	603859	能科科技	5,608	117,880.16	0.21
6	002102	能特科技	49,100	114,403.00	0.20
7	600114	东睦股份	7,300	105,047.00	0.19
8	002716	湖南白银	33,100	102,941.00	0.18
9	000078	海王生物	48,000	101,760.00	0.18
10	000589	贵州轮胎	19,700	99,879.00	0.18
11	002073	软控股份	13,500	99,765.00	0.18
12	300360	炬华科技	5,800	98,600.00	0.17
13	605368	蓝天燃气	7,200	98,208.00	0.17
14	300184	力源信息	21,100	97,693.00	0.17
15	300401	花园生物	6,800	97,512.00	0.17
16	300131	英唐智控	21,800	97,010.00	0.17
17	300779	惠城环保	2,000	96,800.00	0.17
18	002338	奥普光电	2,900	95,758.00	0.17
19	600186	莲花控股	27,700	95,011.00	0.17
20	002062	宏润建设	27,300	95,004.00	0.17
21	603018	华设集团	10,400	94,536.00	0.17
22	000526	学大教育	1,500	92,400.00	0.16
23	688766	普冉股份	949	92,214.33	0.16
24	300255	常山药业	9,200	92,184.00	0.16
25	300176	派生科技	20,900	92,169.00	0.16
26	300053	航宇微	10,100	92,011.00	0.16
27	002922	伊戈尔	4,200	91,812.00	0.16
28	002327	富安娜	9,100	91,455.00	0.16
29	000521	长虹美菱	12,000	90,960.00	0.16
30	002707	众信旅游	15,800	90,692.00	0.16
31	600094	大名城	23,200	89,784.00	0.16
32	000612	焦作万方	13,800	89,700.00	0.16
33	002106	莱宝高科	8,000	87,200.00	0.15

34	002570	贝因美	37,000	86,580.00	0.15
35	600609	金杯汽车	24,800	86,056.00	0.15
36	603887	城地香江	16,400	85,444.00	0.15
37	300825	阿尔特	8,800	85,272.00	0.15
38	002668	TCL 智家	9,400	85,164.00	0.15
39	600200	江苏吴中	9,500	85,120.00	0.15
40	300008	天海防务	21,600	85,104.00	0.15
41	600279	重庆港	23,300	84,579.00	0.15
42	600067	冠城大通	48,300	84,525.00	0.15
43	002367	康力电梯	14,600	84,242.00	0.15
44	002039	黔源电力	4,740	83,424.00	0.15
45	002206	海利得	21,800	83,276.00	0.15
46	000957	中通客车	7,900	83,108.00	0.15
47	300447	全信股份	6,700	82,946.00	0.15
48	002117	东港股份	11,700	82,836.00	0.15
49	300279	和晶科技	19,800	82,566.00	0.15
50	002918	蒙娜丽莎	9,100	82,446.00	0.15
51	600794	保税科技	26,000	82,420.00	0.15
52	002398	垒知集团	22,000	81,840.00	0.15
53	000789	万年青	18,000	81,720.00	0.15
54	600894	广日股份	7,100	81,650.00	0.14
55	300448	浩云科技	19,300	80,867.00	0.14
56	603496	恒为科技	3,300	80,685.00	0.14
57	002533	金杯电工	8,100	80,595.00	0.14
58	600410	华胜天成	20,800	80,496.00	0.14
59	601500	通用股份	15,000	80,100.00	0.14
60	600106	重庆路桥	18,500	79,550.00	0.14
61	002334	英威腾	13,300	79,534.00	0.14
62	002035	华帝股份	12,700	79,121.00	0.14
63	600284	浦东建设	14,800	79,032.00	0.14
64	300025	华星创业	7,400	77,848.00	0.14
65	688269	凯立新材	3,031	77,442.05	0.14
66	002947	恒铭达	2,200	77,440.00	0.14
67	601956	东贝集团	16,900	77,402.00	0.14
68	603855	华荣股份	3,500	77,385.00	0.14
69	002031	巨轮智能	34,000	77,180.00	0.14
70	002474	榕基软件	17,700	77,172.00	0.14
71	300005	探路者	15,400	77,154.00	0.14
72	300468	四方精创	8,900	77,074.00	0.14
73	300507	苏奥传感	13,400	77,050.00	0.14
74	300292	吴通控股	21,700	77,035.00	0.14
75	300439	美康生物	8,300	76,028.00	0.13
76	300353	东土科技	10,400	76,024.00	0.13
77	300490	华自科技	10,600	75,896.00	0.13

78	688510	航亚科技	4,119	75,830.79	0.13
79	600987	航民股份	10,700	75,542.00	0.13
80	300149	睿智医药	19,000	75,240.00	0.13
81	002521	齐峰新材	6,400	75,200.00	0.13
82	300138	晨光生物	8,900	75,027.00	0.13
83	002084	海鸥住工	30,600	74,970.00	0.13
84	002045	国光电器	5,500	74,965.00	0.13
85	605337	李子园	7,600	74,632.00	0.13
86	603067	振华股份	6,400	74,624.00	0.13
87	300622	博士眼镜	6,100	74,237.00	0.13
88	600525	长园集团	17,400	74,124.00	0.13
89	300548	博创科技	3,800	74,062.00	0.13
90	605377	华旺科技	5,580	73,935.00	0.13
91	603686	福龙马	9,700	73,914.00	0.13
92	605136	丽人丽妆	13,400	73,834.00	0.13
93	603227	雪峰科技	11,900	73,780.00	0.13
94	688148	芳源股份	17,504	73,691.84	0.13
95	002611	东方精工	14,000	73,500.00	0.13
96	300571	平治信息	3,500	73,290.00	0.13
97	000510	新金路	26,400	73,128.00	0.13
98	603203	快克智能	3,100	73,098.00	0.13
99	300543	朗科智能	9,100	72,800.00	0.13
100	002345	潮宏基	15,400	72,688.00	0.13
101	300546	雄帝科技	6,300	72,576.00	0.13
102	002480	新筑股份	23,200	72,384.00	0.13
103	603035	常熟汽饰	5,700	72,276.00	0.13
104	002040	南京港	13,200	72,072.00	0.13
105	688311	盟升电子	3,512	71,960.88	0.13
106	300590	移为通信	6,300	71,946.00	0.13
107	300547	川环科技	4,400	71,940.00	0.13
108	002293	罗莱生活	8,900	71,912.00	0.13
109	600897	厦门空港	5,700	71,877.00	0.13
110	600212	绿能慧充	11,500	71,760.00	0.13
111	605196	华通线缆	6,800	71,536.00	0.13
112	301362	民爆光电	2,100	71,526.00	0.13
113	300286	安科瑞	3,300	71,412.00	0.13
114	002452	长高电新	8,600	71,208.00	0.13
115	000897	津滨发展	34,700	71,135.00	0.13
116	300174	元力股份	5,200	70,980.00	0.13
117	002277	友阿股份	32,800	70,848.00	0.13
118	002055	得润电子	10,500	70,665.00	0.13
119	605305	中际联合	2,740	70,664.60	0.13
120	300278	华昌达	24,600	70,602.00	0.13
121	300996	普联软件	4,800	70,416.00	0.12

122	000922	佳电股份	5,900	70,387.00	0.12
123	301181	标榜股份	3,100	70,308.00	0.12
124	600351	亚宝药业	12,500	70,125.00	0.12
125	300903	科翔股份	8,500	70,040.00	0.12
126	300378	鼎捷软件	4,300	69,961.00	0.12
127	000700	模塑科技	13,300	69,825.00	0.12
128	300453	三鑫医疗	10,900	69,651.00	0.12
129	300607	拓斯达	5,100	69,462.00	0.12
130	300802	矩子科技	4,400	69,388.00	0.12
131	301149	隆华新材	7,500	69,300.00	0.12
132	688049	炬芯科技	3,131	69,257.72	0.12
133	300978	东箭科技	7,500	69,225.00	0.12
134	002296	辉煌科技	6,700	69,077.00	0.12
135	300396	迪瑞医疗	3,400	69,054.00	0.12
136	600866	星湖科技	12,500	69,000.00	0.12
137	603507	振江股份	2,100	68,922.00	0.12
138	300019	硅宝科技	5,200	68,900.00	0.12
139	002527	新时达	11,500	68,885.00	0.12
140	300629	新劲刚	3,900	68,874.00	0.12
141	300790	宇瞳光学	5,100	68,850.00	0.12
142	688378	奥来德	2,933	68,808.18	0.12
143	601388	怡球资源	31,400	68,766.00	0.12
144	002845	同兴达	5,200	68,744.00	0.12
145	300815	玉禾田	5,900	68,676.00	0.12
146	002476	宝莫股份	18,700	68,629.00	0.12
147	300925	法本信息	6,800	68,612.00	0.12
148	002285	世联行	43,000	68,370.00	0.12
149	000949	新乡化纤	20,100	68,340.00	0.12
149	300494	盛天网络	6,800	68,340.00	0.12
151	002140	东华科技	8,800	68,200.00	0.12
152	300560	中富通	6,300	68,166.00	0.12
153	600255	鑫科材料	39,400	68,162.00	0.12
154	688621	阳光诺和	1,594	68,063.80	0.12
155	300943	春晖智控	6,300	67,977.00	0.12
156	603050	科林电气	2,800	67,928.00	0.12
157	002286	保龄宝	12,300	67,773.00	0.12
158	603916	苏博特	10,100	67,771.00	0.12
159	002588	史丹利	9,000	67,770.00	0.12
160	603867	新化股份	2,900	67,657.00	0.12
161	000888	峨眉山 A	6,200	67,518.00	0.12
162	300120	经纬辉开	13,000	67,470.00	0.12
163	301030	仕净科技	2,740	67,458.80	0.12
164	000554	泰山石油	13,300	67,431.00	0.12
165	300179	四方达	10,200	67,422.00	0.12

166	002559	亚威股份	8,800	67,408.00	0.12
167	603667	五洲新春	4,100	67,240.00	0.12
168	300493	润欣科技	8,300	67,147.00	0.12
169	000815	美利云	9,300	66,867.00	0.12
170	300842	帝科股份	1,720	66,736.00	0.12
171	002297	博云新材	11,100	66,600.00	0.12
172	300796	贝斯美	4,600	66,562.00	0.12
173	600035	楚天高速	15,500	66,495.00	0.12
174	000533	顺钠股份	20,200	66,458.00	0.12
175	603611	诺力股份	3,900	66,456.00	0.12
176	603111	康尼机电	11,400	66,348.00	0.12
177	603516	淳中科技	2,100	66,297.00	0.12
178	002685	华东重机	28,200	66,270.00	0.12
179	002284	亚太股份	9,800	66,248.00	0.12
180	000797	中国武夷	28,400	66,172.00	0.12
181	300541	先进数通	7,350	66,003.00	0.12
182	603275	众辰科技	2,200	66,000.00	0.12
183	603408	建霖家居	5,000	65,950.00	0.12
184	002279	久其软件	15,300	65,943.00	0.12
185	300331	苏大维格	4,100	65,928.00	0.12
186	300328	宜安科技	15,400	65,912.00	0.12
187	603136	天目湖	6,030	65,907.90	0.12
188	600735	新华锦	17,200	65,876.00	0.12
189	002766	索菱股份	13,600	65,824.00	0.12
190	002149	西部材料	4,700	65,612.00	0.12
191	300384	三联虹普	5,000	65,600.00	0.12
192	000912	泸天化	18,900	65,583.00	0.12
193	002512	达华智能	19,000	65,550.00	0.12
194	002298	中电兴发	14,800	65,416.00	0.12
195	002937	兴瑞科技	2,800	65,268.00	0.12
196	002419	天虹股份	15,600	65,208.00	0.12
197	301116	益客食品	7,300	65,189.00	0.12
198	300578	会畅通讯	4,400	65,120.00	0.12
199	002379	宏创控股	11,100	65,046.00	0.12
200	002968	新大正	7,300	65,043.00	0.12
201	605066	天正电气	11,675	65,029.75	0.12
202	002642	荣联科技	12,600	65,016.00	0.12
203	300245	天玑科技	12,100	64,977.00	0.12
204	300228	富瑞特装	11,900	64,974.00	0.12
205	002562	兄弟科技	21,800	64,964.00	0.12
206	002107	沃华医药	16,500	64,845.00	0.12
207	300460	惠伦晶体	7,600	64,828.00	0.12
208	300708	聚灿光电	7,200	64,800.00	0.12
209	002479	富春环保	18,400	64,768.00	0.11

210	600127	金健米业	10,700	64,521.00	0.11
211	600858	银座股份	16,400	64,452.00	0.11
212	002722	物产金轮	5,700	64,410.00	0.11
213	300252	金信诺	10,300	64,375.00	0.11
214	000788	北大医药	12,900	64,371.00	0.11
215	605266	健之佳	2,480	64,356.00	0.11
216	688677	海泰新光	1,639	64,297.97	0.11
217	300766	每日互动	6,500	64,285.00	0.11
218	002664	信质集团	5,400	64,260.00	0.11
219	000931	中关村	18,200	64,246.00	0.11
220	603313	梦百合	8,600	64,242.00	0.11
221	000948	南天信息	5,200	64,220.00	0.11
222	002965	祥鑫科技	2,100	64,197.00	0.11
223	603889	新澳股份	8,292	64,180.08	0.11
224	300589	江龙船艇	5,400	64,152.00	0.11
225	002799	环球印务	10,900	64,092.00	0.11
226	003019	宸展光电	2,530	64,084.90	0.11
227	300946	恒而达	2,400	63,936.00	0.11
228	300681	英搏尔	4,900	63,896.00	0.11
229	002833	弘亚数控	3,500	63,840.00	0.11
230	300420	五洋自控	29,100	63,729.00	0.11
231	301004	嘉益股份	700	63,700.00	0.11
232	600571	信雅达	6,100	63,684.00	0.11
233	300437	清水源	7,900	63,674.00	0.11
234	002609	捷顺科技	8,400	63,672.00	0.11
235	000576	甘化科工	10,600	63,600.00	0.11
236	688699	明微电子	2,003	63,595.25	0.11
237	002082	万邦德	15,100	63,571.00	0.11
238	600973	宝胜股份	17,600	63,536.00	0.11
239	000548	湖南投资	15,800	63,516.00	0.11
240	688369	致远互联	4,035	63,470.55	0.11
241	002852	道道全	8,800	63,360.00	0.11
242	603639	海利尔	5,200	63,284.00	0.11
243	603214	爱婴室	5,600	63,224.00	0.11
244	002361	神剑股份	19,500	63,180.00	0.11
244	300337	银邦股份	7,800	63,180.00	0.11
246	300276	三丰智能	17,900	63,008.00	0.11
247	600184	光电股份	7,400	62,974.00	0.11
248	002519	银河电子	12,800	62,848.00	0.11
249	600130	波导股份	19,700	62,843.00	0.11
250	300436	广生堂	4,000	62,840.00	0.11
251	300320	海达股份	7,700	62,832.00	0.11
252	002364	中恒电气	11,400	62,700.00	0.11
253	002639	雪人股份	12,500	62,625.00	0.11

254	300057	万顺新材	15,500	62,620.00	0.11
255	000751	锌业股份	23,900	62,618.00	0.11
256	301468	博盈特焊	2,700	62,451.00	0.11
257	300575	中旗股份	9,400	62,416.00	0.11
258	300435	中泰股份	5,300	62,381.00	0.11
259	603987	康德莱	10,200	62,322.00	0.11
260	002198	嘉应制药	8,200	62,320.00	0.11
261	603809	豪能股份	7,700	62,216.00	0.11
262	300412	迦南科技	21,600	62,208.00	0.11
263	300354	东华测试	2,000	62,140.00	0.11
264	002785	万里石	2,500	62,125.00	0.11
265	600738	丽尚国潮	16,900	62,023.00	0.11
266	002282	博深股份	9,700	61,983.00	0.11
267	002565	顺灏股份	25,900	61,901.00	0.11
268	603508	思维列控	3,300	61,875.00	0.11
269	300304	云意电气	9,500	61,845.00	0.11
270	600744	华银电力	19,200	61,824.00	0.11
271	002943	宇晶股份	2,990	61,803.30	0.11
272	603088	宁波精达	8,200	61,746.00	0.11
273	300231	银信科技	8,400	61,740.00	0.11
274	300239	东宝生物	13,100	61,701.00	0.11
275	002331	皖通科技	8,400	61,656.00	0.11
276	600708	光明地产	35,200	61,600.00	0.11
277	300399	天利科技	7,000	61,530.00	0.11
278	300318	博晖创新	12,600	61,488.00	0.11
279	300997	欢乐家	5,200	61,464.00	0.11
280	603738	泰晶科技	4,500	61,380.00	0.11
281	300164	通源石油	17,500	61,250.00	0.11
282	002803	吉宏股份	5,500	61,215.00	0.11
283	000777	中核科技	4,000	61,120.00	0.11
284	300241	瑞丰光电	14,900	61,090.00	0.11
285	300465	高伟达	8,400	61,068.00	0.11
286	000862	银星能源	12,800	61,056.00	0.11
287	002437	誉衡药业	35,900	61,030.00	0.11
288	002515	金字火腿	16,100	61,019.00	0.11
289	002057	中钢天源	8,700	60,900.00	0.11
290	002328	新朋股份	13,000	60,840.00	0.11
291	002677	浙江美大	7,500	60,825.00	0.11
292	000819	岳阳兴长	3,400	60,758.00	0.11
293	600180	瑞茂通	15,900	60,579.00	0.11
294	002301	齐心集团	12,500	60,375.00	0.11
295	600742	一汽富维	8,100	60,345.00	0.11
296	300444	双杰电气	9,500	60,325.00	0.11
297	003000	劲仔食品	5,000	60,250.00	0.11

298	300532	今天国际	4,900	60,221.00	0.11
299	603808	歌力思	9,500	60,135.00	0.11
300	000042	中洲控股	15,200	60,040.00	0.11
301	601968	宝钢包装	12,800	59,904.00	0.11
302	301263	泰恩康	4,780	59,893.40	0.11
303	600105	永鼎股份	16,100	59,892.00	0.11
304	600226	亨通股份	30,400	59,888.00	0.11
305	300219	鸿利智汇	10,700	59,813.00	0.11
306	600533	栖霞建设	30,500	59,780.00	0.11
307	300094	国联水产	23,500	59,690.00	0.11
308	000524	岭南控股	7,400	59,644.00	0.11
309	301061	匠心家居	1,270	59,639.20	0.11
310	600686	金龙汽车	8,100	59,616.00	0.11
311	603617	君禾股份	10,100	59,590.00	0.11
312	300240	飞力达	11,200	59,584.00	0.11
313	603998	方盛制药	5,800	59,566.00	0.11
314	688486	龙迅股份	1,039	59,534.70	0.11
315	002438	江苏神通	5,500	59,455.00	0.11
316	300686	智动力	8,200	59,450.00	0.11
317	002042	华孚时尚	15,600	59,436.00	0.11
318	300258	精锻科技	7,300	59,349.00	0.11
319	000652	泰达股份	19,900	59,302.00	0.11
320	001896	豫能控股	13,700	59,184.00	0.11
321	300200	高盟新材	7,600	59,128.00	0.10
322	600594	益佰制药	19,700	59,100.00	0.10
323	688022	瀚川智能	4,307	59,048.97	0.10
324	002703	浙江世宝	5,300	59,042.00	0.10
325	002536	飞龙股份	6,200	59,024.00	0.10
326	300653	正海生物	2,900	59,015.00	0.10
327	603119	浙江荣泰	3,330	59,007.60	0.10
328	600237	铜峰电子	11,300	58,986.00	0.10
329	002009	天奇股份	5,200	58,968.00	0.10
330	600268	国电南自	10,320	58,927.20	0.10
331	600694	大商股份	3,500	58,835.00	0.10
332	600470	六国化工	15,400	58,828.00	0.10
333	300217	东方电热	15,600	58,812.00	0.10
334	300566	激智科技	4,200	58,758.00	0.10
335	002469	三维化学	10,300	58,710.00	0.10
336	603031	安孚科技	2,600	58,708.00	0.10
337	300441	鲍斯股份	9,900	58,707.00	0.10
338	002033	丽江股份	6,700	58,692.00	0.10
339	688588	凌志软件	8,561	58,642.85	0.10
340	603706	东方环宇	4,000	58,600.00	0.10
341	002122	汇洲智能	28,000	58,520.00	0.10

342	300586	美联新材	9,300	58,497.00	0.10
343	000551	创元科技	6,700	58,491.00	0.10
344	600622	光大嘉宝	31,600	58,460.00	0.10
345	601113	华鼎股份	17,800	58,384.00	0.10
346	002520	日发精机	15,400	58,366.00	0.10
347	600300	维维股份	24,300	58,320.00	0.10
348	002401	中远海科	3,900	58,266.00	0.10
349	002979	雷赛智能	3,200	58,240.00	0.10
350	300793	佳禾智能	4,200	58,212.00	0.10
351	688365	光云科技	9,668	58,201.36	0.10
352	002026	山东威达	7,000	58,100.00	0.10
353	300718	长盛轴承	4,200	58,044.00	0.10
354	600826	兰生股份	10,780	57,996.40	0.10
355	603890	春秋电子	6,400	57,984.00	0.10
356	603365	水星家纺	3,700	57,905.00	0.10
357	002876	三利谱	2,400	57,888.00	0.10
358	688590	新致软件	4,483	57,830.70	0.10
359	002116	中国海诚	6,200	57,722.00	0.10
360	688025	杰普特	1,428	57,676.92	0.10
361	605108	同庆楼	2,700	57,672.00	0.10
362	603982	泉峰汽车	7,200	57,600.00	0.10
363	603399	吉翔股份	9,300	57,567.00	0.10
364	300047	天源迪科	8,800	57,552.00	0.10
365	300310	宜通世纪	15,400	57,442.00	0.10
366	300227	光韵达	10,500	57,435.00	0.10
367	603208	江山欧派	3,000	57,420.00	0.10
368	002431	棕榈股份	41,000	57,400.00	0.10
369	002115	三维通信	11,800	57,348.00	0.10
370	000593	德龙汇能	12,300	57,318.00	0.10
371	300430	诚益通	3,800	57,304.00	0.10
372	300400	劲拓股份	5,000	57,200.00	0.10
373	300893	松原股份	2,000	57,140.00	0.10
374	002263	大东南	27,600	57,132.00	0.10
375	600189	泉阳泉	8,600	57,104.00	0.10
376	605018	长华集团	6,300	57,078.00	0.10
377	301319	唯特偶	1,900	57,057.00	0.10
378	300972	万辰集团	2,700	57,051.00	0.10
379	600624	复旦复华	19,200	57,024.00	0.10
380	301011	华立科技	3,700	57,017.00	0.10
381	603977	国泰集团	5,600	56,952.00	0.10
382	600640	国脉文化	5,500	56,925.00	0.10
383	300061	旗天科技	12,700	56,896.00	0.10
384	002481	双塔食品	14,700	56,889.00	0.10
385	688252	天德钰	3,914	56,870.42	0.10

386	688468	科美诊断	8,959	56,710.47	0.10
387	688300	联瑞新材	1,179	56,709.90	0.10
388	002232	启明信息	4,300	56,674.00	0.10
389	300042	朗科科技	2,800	56,532.00	0.10
390	300545	联得装备	2,300	56,465.00	0.10
391	688371	菲沃泰	5,621	56,434.84	0.10
392	002132	恒星科技	26,600	56,392.00	0.10
393	300247	融捷健康	23,200	56,376.00	0.10
394	300499	高澜股份	5,200	56,368.00	0.10
395	300986	志特新材	8,300	56,191.00	0.10
396	603590	康辰药业	2,200	56,188.00	0.10
397	300081	恒信东方	12,700	56,134.00	0.10
398	002955	鸿合科技	2,400	56,112.00	0.10
399	002589	瑞康医药	25,500	56,100.00	0.10
400	300580	贝斯特	3,816	56,095.20	0.10
401	688522	纳睿雷达	1,195	56,021.60	0.10
402	603662	柯力传感	2,400	56,016.00	0.10
403	300307	慈星股份	9,400	55,930.00	0.10
404	600818	中路股份	4,000	55,920.00	0.10
405	603551	奥普科技	5,700	55,860.00	0.10
406	002543	万和电气	5,600	55,776.00	0.10
407	600088	中视传媒	3,400	55,658.00	0.10
408	300193	佳士科技	7,500	55,650.00	0.10
408	300872	天阳科技	4,200	55,650.00	0.10
410	300582	英飞特	6,500	55,640.00	0.10
411	002548	金新农	13,700	55,622.00	0.10
412	300709	精研科技	2,200	55,616.00	0.10
413	688103	国力股份	1,598	55,546.48	0.10
414	688181	八亿时空	2,930	55,523.50	0.10
415	001283	豪鹏科技	1,300	55,510.00	0.10
416	000892	欢瑞世纪	22,200	55,500.00	0.10
417	002523	天桥起重	25,800	55,470.00	0.10
418	300951	博硕科技	1,780	55,447.00	0.10
419	603918	金桥信息	5,300	55,385.00	0.10
420	002369	卓翼科技	15,000	55,350.00	0.10
421	300805	电声股份	8,700	55,332.00	0.10
422	000698	沈阳化工	18,200	55,328.00	0.10
423	300603	立昂技术	8,000	55,280.00	0.10
424	600616	金枫酒业	11,500	55,200.00	0.10
425	603387	基蛋生物	7,100	55,096.00	0.10
426	688595	芯海科技	1,835	55,050.00	0.10
427	000965	天保基建	21,000	55,020.00	0.10
427	300976	达瑞电子	1,200	55,020.00	0.10
429	688306	均普智能	13,545	54,992.70	0.10

430	300745	欣锐科技	3,800	54,948.00	0.10
431	600479	千金药业	5,400	54,918.00	0.10
432	603528	多伦科技	7,700	54,901.00	0.10
433	600590	泰豪科技	14,400	54,864.00	0.10
434	603960	克来机电	2,600	54,860.00	0.10
435	300774	倍杰特	8,400	54,852.00	0.10
436	002825	纳尔股份	8,800	54,824.00	0.10
437	600960	渤海汽车	20,600	54,796.00	0.10
438	600979	广安爱众	16,300	54,768.00	0.10
439	000655	金岭矿业	9,900	54,747.00	0.10
440	600288	大恒科技	8,400	54,684.00	0.10
441	301519	舜禹股份	3,300	54,648.00	0.10
442	002676	顺威股份	11,800	54,634.00	0.10
442	300968	格林精密	5,900	54,634.00	0.10
444	688061	灿瑞科技	1,988	54,630.24	0.10
445	300862	蓝盾光电	2,400	54,624.00	0.10
446	300145	中金环境	21,800	54,500.00	0.10
447	301013	利和兴	5,100	54,468.00	0.10
448	002376	新北洋	10,100	54,439.00	0.10
449	603897	长城科技	3,100	54,405.00	0.10
450	300508	维宏股份	2,800	54,404.00	0.10
451	603319	湘油泵	3,400	54,366.00	0.10
452	603429	集友股份	13,100	54,365.00	0.10
453	603722	阿科力	1,200	54,300.00	0.10
454	600353	旭光电子	8,800	54,296.00	0.10
455	300515	三德科技	5,500	54,285.00	0.10
456	300938	信测标准	2,730	54,272.40	0.10
457	300939	秋田微	1,800	54,252.00	0.10
458	301126	达嘉维康	6,000	54,180.00	0.10
459	300063	天龙集团	14,200	54,102.00	0.10
460	688095	福昕软件	1,181	54,101.61	0.10
461	603096	新经典	3,200	54,080.00	0.10
462	300161	华中数控	2,400	53,976.00	0.10
463	301330	熵基科技	2,400	53,952.00	0.10
464	688609	九联科技	6,117	53,951.94	0.10
465	300636	同和药业	5,300	53,901.00	0.10
466	300481	濮阳惠成	3,900	53,820.00	0.10
467	300032	金龙机电	17,300	53,803.00	0.10
468	600152	维科技术	11,200	53,760.00	0.10
469	000838	财信发展	24,100	53,743.00	0.10
470	002491	通鼎互联	15,900	53,742.00	0.10
471	600368	五洲交通	15,040	53,692.80	0.10
472	600230	沧州大化	5,300	53,689.00	0.10
473	300349	金卡智能	4,500	53,640.00	0.10

474	300614	百川畅银	5,900	53,631.00	0.10
475	603878	武进不锈	8,200	53,628.00	0.10
476	603629	利通电子	2,900	53,534.00	0.10
477	605286	同力日升	2,200	53,526.00	0.09
478	300007	汉威科技	3,900	53,508.00	0.09
479	300791	仙乐健康	2,120	53,424.00	0.09
479	600354	敦煌种业	11,200	53,424.00	0.09
479	603099	长白山	2,400	53,424.00	0.09
482	002448	中原内配	9,300	53,382.00	0.09
483	300928	华安鑫创	1,500	53,310.00	0.09
484	603258	电魂网络	3,300	53,295.00	0.09
485	300403	汉宇集团	7,800	53,274.00	0.09
486	002363	隆基机械	9,200	53,268.00	0.09
487	300662	科锐国际	3,300	53,229.00	0.09
488	000096	广聚能源	5,600	53,200.00	0.09
488	002374	中锐股份	30,400	53,200.00	0.09
490	301150	中一科技	2,960	53,191.20	0.09
491	688313	仕佳光子	5,577	53,093.04	0.09
492	000822	山东海化	9,100	53,053.00	0.09
493	300192	科德教育	5,400	53,028.00	0.09
494	300752	隆利科技	3,900	52,962.00	0.09
495	002404	嘉欣丝绸	10,000	52,900.00	0.09
496	603676	卫信康	6,600	52,866.00	0.09
497	300902	国安达	2,660	52,854.20	0.09
498	300569	天能重工	12,700	52,832.00	0.09
499	300100	双林股份	4,900	52,773.00	0.09
500	300667	必创科技	3,900	52,767.00	0.09
501	600386	北巴传媒	18,900	52,731.00	0.09
502	002819	东方中科	2,500	52,700.00	0.09
503	002933	新兴装备	2,300	52,693.00	0.09
504	688150	莱特光电	2,715	52,671.00	0.09
505	688299	长阳科技	4,118	52,669.22	0.09
506	002166	莱茵生物	7,700	52,668.00	0.09
507	301382	蜂助手	2,900	52,461.00	0.09
508	603758	秦安股份	6,900	52,440.00	0.09
509	601599	浙文影业	18,200	52,416.00	0.09
510	000863	三湘印象	13,100	52,400.00	0.09
511	002630	华西能源	24,700	52,364.00	0.09
512	002225	濮耐股份	12,800	52,352.00	0.09
513	300265	通光线缆	7,500	52,350.00	0.09
514	688238	和元生物	11,302	52,328.26	0.09
515	300539	横河精密	6,500	52,325.00	0.09
516	603186	华正新材	2,200	52,316.00	0.09
517	001207	联科科技	3,600	52,272.00	0.09

517	301096	百诚医药	900	52,272.00	0.09
519	600379	宝光股份	6,300	52,227.00	0.09
520	300238	冠昊生物	5,800	52,200.00	0.09
521	300111	向日葵	27,900	52,173.00	0.09
522	002014	永新股份	5,500	52,140.00	0.09
523	300531	优博讯	5,000	52,100.00	0.09
524	300016	北陆药业	11,800	52,038.00	0.09
525	301278	快可电子	1,600	52,032.00	0.09
526	603069	海汽集团	3,200	52,000.00	0.09
527	300248	新开普	8,000	51,920.00	0.09
527	600814	杭州解百	8,800	51,920.00	0.09
529	603708	家家悦	6,400	51,904.00	0.09
530	002771	真视通	3,200	51,872.00	0.09
531	002892	科力尔	5,400	51,840.00	0.09
532	300377	赢时胜	10,200	51,816.00	0.09
532	300950	德固特	3,400	51,816.00	0.09
534	688687	凯因科技	2,031	51,810.81	0.09
535	002161	远望谷	11,200	51,744.00	0.09
536	603558	健盛集团	5,200	51,740.00	0.09
537	002066	瑞泰科技	6,500	51,675.00	0.09
537	002213	大为股份	5,300	51,675.00	0.09
539	002587	奥拓电子	9,600	51,648.00	0.09
539	600860	京城股份	6,400	51,648.00	0.09
541	600551	时代出版	7,280	51,542.40	0.09
542	300500	启迪设计	4,600	51,520.00	0.09
543	000936	华西股份	9,000	51,480.00	0.09
544	601226	华电重工	10,500	51,450.00	0.09
545	002636	金安国纪	8,100	51,435.00	0.09
546	605162	新中港	7,100	51,333.00	0.09
547	603727	博迈科	3,900	51,324.00	0.09
548	002478	常宝股份	10,300	51,294.00	0.09
549	002406	远东传动	10,400	51,272.00	0.09
549	300317	珈伟新能	13,600	51,272.00	0.09
551	688133	泰坦科技	3,249	51,269.22	0.09
552	000899	赣能股份	5,300	51,251.00	0.09
553	600526	菲达环保	13,800	51,198.00	0.09
554	300127	银河磁体	3,400	51,170.00	0.09
554	300691	联合光电	3,400	51,170.00	0.09
556	600488	津药药业	14,900	51,107.00	0.09
557	002111	威海广泰	4,900	51,058.00	0.09
558	601218	吉鑫科技	18,300	51,057.00	0.09
559	002824	和胜股份	4,000	51,040.00	0.09
559	300833	浩洋股份	1,100	51,040.00	0.09
561	301201	诚达药业	2,800	50,960.00	0.09

562	600262	北方股份	3,100	50,933.00	0.09
563	603815	交建股份	8,900	50,908.00	0.09
564	002919	名臣健康	4,380	50,851.80	0.09
565	002046	国机精工	5,000	50,850.00	0.09
565	603116	红蜻蜓	11,300	50,850.00	0.09
567	300275	梅安森	5,100	50,847.00	0.09
568	688253	英诺特	1,333	50,800.63	0.09
569	603601	再升科技	18,400	50,784.00	0.09
570	002860	星帅尔	6,200	50,778.00	0.09
571	603569	长久物流	7,400	50,764.00	0.09
572	002787	华源控股	7,500	50,700.00	0.09
573	002164	宁波东力	13,200	50,688.00	0.09
574	688332	中科蓝讯	859	50,672.41	0.09
575	603199	九华旅游	1,700	50,660.00	0.09
576	603811	诚意药业	8,100	50,625.00	0.09
577	300306	远方信息	5,400	50,598.00	0.09
578	001228	永泰运	2,400	50,592.00	0.09
579	301152	天力锂能	2,100	50,589.00	0.09
580	300700	岱勒新材	6,500	50,570.00	0.09
581	301195	北路智控	1,700	50,558.00	0.09
582	002786	银宝山新	6,300	50,526.00	0.09
583	605007	五洲特纸	4,000	50,520.00	0.09
584	300617	安靠智电	1,800	50,490.00	0.09
585	002970	锐明技术	1,400	50,442.00	0.09
586	300786	国林科技	4,100	50,266.00	0.09
587	002849	威星智能	4,500	50,220.00	0.09
587	603967	中创物流	5,400	50,220.00	0.09
589	603223	恒通股份	7,700	50,204.00	0.09
590	603929	亚翔集成	2,100	50,190.00	0.09
591	002300	太阳电缆	9,500	50,160.00	0.09
592	300250	初灵信息	4,600	50,140.00	0.09
593	002090	金智科技	5,800	50,112.00	0.09
593	603600	永艺股份	4,800	50,112.00	0.09
595	600558	大西洋	13,900	50,040.00	0.09
596	000409	云鼎科技	6,200	50,034.00	0.09
597	600981	汇鸿集团	29,600	50,024.00	0.09
598	000925	众合科技	7,600	50,008.00	0.09
599	603800	道森股份	2,500	50,000.00	0.09
600	300121	阳谷华泰	6,400	49,920.00	0.09
600	600327	大东方	15,600	49,920.00	0.09
602	002170	芭田股份	8,300	49,883.00	0.09
603	000759	中百集团	14,800	49,876.00	0.09
604	301051	信濠光电	1,900	49,837.00	0.09
605	002169	智光电气	11,300	49,833.00	0.09

606	603209	兴通股份	3,600	49,824.00	0.09
607	300559	佳发教育	5,200	49,764.00	0.09
608	300632	光莆股份	5,000	49,750.00	0.09
609	002112	三变科技	5,600	49,728.00	0.09
610	301218	华是科技	2,400	49,704.00	0.09
611	688222	成都先导	4,378	49,690.30	0.09
612	300062	中能电气	10,200	49,674.00	0.09
613	002790	瑞尔特	5,500	49,665.00	0.09
614	688391	钜泉科技	1,702	49,647.34	0.09
615	002734	利民股份	7,200	49,608.00	0.09
616	300365	恒华科技	10,100	49,591.00	0.09
617	002885	京泉华	4,600	49,588.00	0.09
618	000404	长虹华意	9,300	49,569.00	0.09
619	300729	乐歌股份	3,200	49,568.00	0.09
620	002264	新华都	9,700	49,567.00	0.09
621	605319	无锡振华	2,800	49,560.00	0.09
622	600367	红星发展	5,000	49,550.00	0.09
623	603012	创力集团	11,100	49,506.00	0.09
624	603626	科森科技	8,900	49,484.00	0.09
625	002577	雷柏科技	4,000	49,480.00	0.09
626	301139	元道通信	2,300	49,473.00	0.09
627	300440	运达科技	9,400	49,350.00	0.09
628	300467	迅游科技	3,600	49,320.00	0.09
629	002441	众业达	6,500	49,270.00	0.09
630	603011	合锻智能	8,300	49,219.00	0.09
631	300619	金银河	2,030	49,207.20	0.09
632	688233	神工股份	2,553	49,196.31	0.09
633	605398	新炬网络	2,400	49,176.00	0.09
634	002165	红宝丽	14,900	49,170.00	0.09
634	603085	天成自控	5,500	49,170.00	0.09
636	300909	汇创达	2,200	49,148.00	0.09
637	301073	君亭酒店	2,700	49,140.00	0.09
638	600619	海立股份	9,500	49,115.00	0.09
639	002908	德生科技	6,400	49,088.00	0.09
640	002886	沃特股份	3,600	49,032.00	0.09
641	300864	南大环境	2,500	49,000.00	0.09
642	603028	赛福天	8,700	48,981.00	0.09
643	688787	海天瑞声	892	48,952.96	0.09
644	002418	康盛股份	25,900	48,951.00	0.09
645	603901	永创智能	6,900	48,921.00	0.09
646	603191	望变电气	3,300	48,840.00	0.09
647	603668	天马科技	4,300	48,805.00	0.09
648	300572	安车检测	4,200	48,804.00	0.09
649	603931	格林达	2,400	48,792.00	0.09

650	000011	深物业 A	6,300	48,762.00	0.09
651	688519	南亚新材	1,907	48,761.99	0.09
652	301063	海锅股份	3,400	48,756.00	0.09
653	603999	读者传媒	10,300	48,719.00	0.09
654	688195	腾景科技	1,984	48,627.84	0.09
655	301018	申菱环境	2,500	48,600.00	0.09
656	000707	双环科技	7,100	48,564.00	0.09
657	002733	雄韬股份	4,500	48,465.00	0.09
658	300514	友讯达	3,200	48,416.00	0.09
659	603518	锦泓集团	5,500	48,400.00	0.09
660	300969	恒帅股份	700	48,391.00	0.09
661	688159	有方科技	1,278	48,385.08	0.09
662	600310	广西能源	13,900	48,372.00	0.09
663	301102	兆讯传媒	4,100	48,339.00	0.09
664	002420	毅昌科技	10,600	48,336.00	0.09
665	301302	华如科技	2,800	48,300.00	0.09
666	688035	德邦科技	1,499	48,297.78	0.09
667	002362	汉王科技	2,900	48,285.00	0.09
668	300172	中电环保	10,700	48,257.00	0.09
669	300606	金太阳	2,600	48,256.00	0.09
670	300926	博俊科技	2,410	48,248.20	0.09
671	000532	华金资本	4,000	48,240.00	0.09
671	002227	奥特迅	6,000	48,240.00	0.09
671	002702	海欣食品	13,400	48,240.00	0.09
674	002887	绿茵生态	7,400	48,174.00	0.09
675	300879	大叶股份	3,600	48,168.00	0.09
676	002827	高争民爆	2,200	48,158.00	0.09
677	002386	天原股份	12,600	48,132.00	0.09
678	002749	国光股份	3,200	48,128.00	0.09
679	301203	国泰环保	1,700	48,127.00	0.09
680	002956	西麦食品	3,500	48,090.00	0.09
681	001215	千味央厨	1,700	48,059.00	0.09
682	002104	恒宝股份	9,100	48,048.00	0.09
683	300402	宝色股份	3,700	48,026.00	0.09
684	002561	徐家汇	6,900	48,024.00	0.09
685	002445	中南文化	29,100	48,015.00	0.09
686	688080	映翰通	1,581	47,951.73	0.09
687	002514	宝馨科技	11,600	47,908.00	0.09
688	300299	富春股份	13,800	47,886.00	0.08
689	603110	东方材料	4,300	47,859.00	0.08
690	300712	永福股份	2,200	47,850.00	0.08
691	603101	汇嘉时代	9,700	47,821.00	0.08
692	002940	昂利康	3,300	47,784.00	0.08
693	688079	美迪凯	6,431	47,718.02	0.08

694	688589	力合微	1,890	47,646.90	0.08
695	688359	三孚新科	1,191	47,640.00	0.08
696	002881	美格智能	2,400	47,616.00	0.08
697	600121	郑州煤电	14,600	47,596.00	0.08
698	300608	思特奇	5,300	47,594.00	0.08
699	002632	道明光学	5,900	47,554.00	0.08
700	003020	立方制药	2,600	47,528.00	0.08
701	002896	中大力德	1,700	47,430.00	0.08
702	603610	麒盛科技	4,800	47,424.00	0.08
703	603330	天洋新材	9,900	47,421.00	0.08
704	000570	苏常柴 A	10,600	47,382.00	0.08
705	300018	中元股份	10,300	47,380.00	0.08
706	600071	凤凰光学	2,900	47,357.00	0.08
707	300249	依米康	7,300	47,304.00	0.08
708	000610	西安旅游	3,700	47,249.00	0.08
709	301168	通灵股份	1,700	47,226.00	0.08
710	002584	西陇科学	8,400	47,208.00	0.08
711	600103	青山纸业	27,600	47,196.00	0.08
712	600831	广电网络	17,600	47,168.00	0.08
713	300225	金力泰	9,600	47,136.00	0.08
714	603969	银龙股份	9,500	47,120.00	0.08
715	002805	丰元股份	4,500	47,115.00	0.08
716	601789	宁波建工	12,800	47,104.00	0.08
717	001331	胜通能源	3,400	47,090.00	0.08
718	002752	昇兴股份	9,300	47,058.00	0.08
719	300710	万隆光电	3,100	47,027.00	0.08
720	600721	百花医药	8,100	46,980.00	0.08
721	000779	甘咨询	6,700	46,967.00	0.08
722	301101	明月镜片	2,100	46,914.00	0.08
723	688356	键凯科技	798	46,906.44	0.08
724	002022	科华生物	8,300	46,895.00	0.08
725	605098	行动教育	1,100	46,882.00	0.08
726	002858	力盛体育	4,500	46,800.00	0.08
727	300921	南凌科技	2,700	46,764.00	0.08
728	300194	福安药业	12,500	46,750.00	0.08
729	688533	上声电子	1,806	46,721.22	0.08
730	688176	亚虹医药	9,143	46,720.73	0.08
731	000428	华天酒店	16,800	46,704.00	0.08
732	605050	福然德	5,300	46,693.00	0.08
733	002792	通宇通讯	4,460	46,562.40	0.08
734	002614	奥佳华	8,400	46,452.00	0.08
735	688418	震有科技	2,711	46,439.43	0.08
736	601116	三江购物	6,100	46,421.00	0.08
737	300221	银禧科技	8,800	46,288.00	0.08

738	002917	金奥博	5,200	46,176.00	0.08
738	605028	世茂能源	3,200	46,176.00	0.08
740	002658	雪迪龙	9,000	46,170.00	0.08
741	603602	纵横通信	3,700	46,139.00	0.08
742	002669	康达新材	5,600	46,088.00	0.08
743	002412	汉森制药	8,900	46,013.00	0.08
744	000701	厦门信达	12,300	46,002.00	0.08
745	000812	陕西金叶	12,800	45,952.00	0.08
746	300351	永贵电器	3,100	45,880.00	0.08
747	688678	福立旺	4,234	45,854.22	0.08
748	688377	迪威尔	3,498	45,823.80	0.08
749	000026	飞亚达	5,200	45,812.00	0.08
750	002757	南兴股份	3,800	45,790.00	0.08
751	002915	中欣氟材	4,600	45,770.00	0.08
752	603158	腾龙股份	6,500	45,760.00	0.08
753	603167	渤海轮渡	5,600	45,752.00	0.08
754	002688	金河生物	12,600	45,738.00	0.08
755	688212	澳华内镜	1,142	45,691.42	0.08
756	300513	恒实科技	5,600	45,640.00	0.08
757	002471	中超控股	23,400	45,630.00	0.08
758	300355	蒙草生态	20,700	45,540.00	0.08
759	300740	水羊股份	3,100	45,508.00	0.08
760	002540	亚太科技	8,600	45,494.00	0.08
761	300341	麦克奥迪	5,300	45,474.00	0.08
761	600229	城市传媒	6,600	45,474.00	0.08
763	688698	伟创电气	1,686	45,471.42	0.08
764	603396	金辰股份	1,400	45,458.00	0.08
765	300381	溢多利	7,400	45,436.00	0.08
766	002553	南方精工	4,900	45,423.00	0.08
767	688143	长盈通	2,120	45,410.40	0.08
768	300731	科创新源	3,100	45,384.00	0.08
769	603015	弘讯科技	6,000	45,360.00	0.08
770	002878	元隆雅图	3,600	45,252.00	0.08
771	002150	通润装备	3,700	45,251.00	0.08
772	001205	盛航股份	2,800	45,248.00	0.08
773	300873	海晨股份	3,100	45,198.00	0.08
774	688108	赛诺医疗	5,054	45,182.76	0.08
775	300556	丝路视觉	2,700	45,171.00	0.08
776	002823	凯中精密	3,700	45,140.00	0.08
777	600178	东安动力	4,500	45,090.00	0.08
778	688102	斯瑞新材	3,947	45,074.74	0.08
779	000926	福星股份	14,200	45,014.00	0.08
780	600855	航天长峰	4,400	45,012.00	0.08
781	002377	国创高新	25,400	44,958.00	0.08

782	600664	哈药股份	17,000	44,880.00	0.08
783	688628	优利德	1,369	44,862.13	0.08
784	001299	美能能源	3,800	44,840.00	0.08
785	300148	天舟文化	19,400	44,814.00	0.08
786	301118	恒光股份	3,000	44,730.00	0.08
787	600408	安泰集团	28,300	44,714.00	0.08
788	605555	德昌股份	2,400	44,664.00	0.08
789	300788	中信出版	1,800	44,658.00	0.08
790	000530	冰山冷热	12,300	44,526.00	0.08
791	002599	盛通股份	8,900	44,500.00	0.08
791	002682	龙洲股份	12,500	44,500.00	0.08
793	002255	海陆重工	9,100	44,499.00	0.08
794	003029	吉大正元	2,500	44,475.00	0.08
795	600629	华建集团	10,200	44,472.00	0.08
796	300213	佳讯飞鸿	7,800	44,460.00	0.08
797	300011	鼎汉技术	8,900	44,411.00	0.08
798	300840	酷特智能	4,800	44,400.00	0.08
799	300350	华鹏飞	9,400	44,368.00	0.08
800	002538	司尔特	9,900	44,352.00	0.08
801	002728	特一药业	5,720	44,330.00	0.08
802	301328	维峰电子	1,200	44,292.00	0.08
803	600592	龙溪股份	5,100	44,217.00	0.08
804	300483	首华燃气	6,100	44,103.00	0.08
805	600784	鲁银投资	9,300	44,082.00	0.08
806	301345	涛涛车业	800	44,080.00	0.08
807	002864	盘龙药业	1,700	43,996.00	0.08
808	300503	昊志机电	3,600	43,956.00	0.08
809	002380	科远智慧	2,400	43,920.00	0.08
810	301062	上海艾录	4,300	43,903.00	0.08
811	300592	华凯易佰	3,840	43,891.20	0.08
812	605369	拱东医疗	1,100	43,890.00	0.08
813	605299	舒华体育	5,400	43,848.00	0.08
814	300795	米奥会展	2,500	43,825.00	0.08
815	002866	传艺科技	3,400	43,758.00	0.08
816	603538	美诺华	3,900	43,563.00	0.08
817	688210	统联精密	1,964	43,502.60	0.08
818	300898	熊猫乳品	2,600	43,446.00	0.08
819	603779	威龙股份	5,100	43,350.00	0.08
820	688205	德科立	1,503	43,301.43	0.08
821	300452	山河药辅	3,800	43,168.00	0.08
822	603660	苏州科达	7,900	43,134.00	0.08
823	688121	卓然股份	3,587	43,115.74	0.08
824	605158	华达新材	6,700	43,081.00	0.08
825	300520	科大国创	2,700	43,065.00	0.08

826	600846	同济科技	6,300	43,029.00	0.08
827	601579	会稽山	4,200	43,008.00	0.08
828	600513	联环药业	5,300	42,983.00	0.08
829	603520	司太立	4,500	42,930.00	0.08
830	603416	信捷电气	1,500	42,870.00	0.08
831	002843	泰嘉股份	2,800	42,868.00	0.08
832	600257	大湖股份	9,500	42,845.00	0.08
833	601999	出版传媒	8,200	42,804.00	0.08
834	603970	中农立华	2,500	42,700.00	0.08
835	688550	瑞联新材	1,840	42,669.60	0.08
836	600468	百利电气	9,900	42,669.00	0.08
837	688085	三友医疗	2,524	42,655.60	0.08
838	002912	中新赛克	2,400	42,528.00	0.08
839	603222	济民医疗	7,700	42,350.00	0.08
840	002846	英联股份	6,200	42,346.00	0.08
841	300288	朗玛信息	4,000	42,280.00	0.08
842	600292	远达环保	9,000	42,210.00	0.07
843	600159	大龙地产	19,000	42,180.00	0.07
844	688382	益方生物	5,833	42,172.59	0.07
845	002615	哈尔斯	6,800	42,160.00	0.07
846	300698	万马科技	1,200	42,156.00	0.07
847	600683	京投发展	11,300	42,149.00	0.07
848	600052	东望时代	9,800	42,042.00	0.07
849	688733	壹石通	2,810	42,009.50	0.07
850	002526	山东矿机	17,800	42,008.00	0.07
851	301191	菲菱科思	600	41,982.00	0.07
852	003025	思进智能	3,400	41,854.00	0.07
853	603309	维力医疗	3,800	41,838.00	0.07
854	600658	电子城	12,700	41,783.00	0.07
855	002870	香山股份	1,400	41,762.00	0.07
856	688071	华依科技	1,925	41,714.75	0.07
857	002017	东信和平	5,000	41,650.00	0.07
858	688258	卓易信息	1,247	41,649.80	0.07
859	688626	翔宇医疗	1,312	41,642.88	0.07
860	688560	明冠新材	3,910	41,641.50	0.07
861	300533	冰川网络	3,000	41,640.00	0.07
862	002238	天威视讯	5,300	41,605.00	0.07
863	601188	龙江交通	14,100	41,595.00	0.07
864	603711	香飘飘	3,000	41,550.00	0.07
865	003038	鑫铂股份	2,800	41,356.00	0.07
866	301066	万事利	5,100	41,310.00	0.07
867	002290	禾盛新材	3,100	41,292.00	0.07
868	601566	九牧王	4,900	41,258.00	0.07
869	002235	安妮股份	10,400	41,184.00	0.07

869	603648	畅联股份	5,200	41,184.00	0.07
871	002103	广博股份	8,300	41,168.00	0.07
872	603032	德新科技	3,600	41,148.00	0.07
873	603081	大丰实业	4,400	41,008.00	0.07
874	301160	翔楼新材	1,100	40,975.00	0.07
875	600825	新华传媒	10,800	40,932.00	0.07
876	688236	春立医疗	2,885	40,909.30	0.07
877	000716	黑芝麻	11,300	40,906.00	0.07
878	603217	元利科技	2,900	40,890.00	0.07
879	003015	日久光电	4,500	40,860.00	0.07
880	300707	威唐工业	3,300	40,854.00	0.07
881	000421	南京公用	9,200	40,848.00	0.07
882	300654	世纪天鸿	4,800	40,800.00	0.07
883	603776	永安行	4,100	40,672.00	0.07
884	688662	富信科技	1,664	40,601.60	0.07
885	300847	中船汉光	2,800	40,572.00	0.07
886	301439	泓淋电力	3,200	40,544.00	0.07
887	603367	辰欣药业	2,900	40,426.00	0.07
888	603633	徕木股份	5,100	40,341.00	0.07
889	688059	华锐精密	888	40,297.44	0.07
890	300683	海特生物	1,900	40,204.00	0.07
891	300908	仲景食品	1,444	40,114.32	0.07
892	600796	钱江生化	9,200	40,112.00	0.07
893	605277	新亚电子	3,100	40,052.00	0.07
894	688663	新风光	1,714	39,884.78	0.07
895	002160	常铝股份	14,700	39,837.00	0.07
896	002769	普路通	7,600	39,748.00	0.07
897	688488	艾迪药业	3,880	39,653.60	0.07
898	002560	通达股份	7,200	39,600.00	0.07
899	600239	云南城投	21,300	39,405.00	0.07
900	603687	大胜达	5,500	39,380.00	0.07
901	688416	恒烁股份	1,036	39,336.92	0.07
902	002641	公元股份	10,000	39,300.00	0.07
903	603990	麦迪科技	4,500	39,195.00	0.07
904	603315	福鞍股份	4,100	39,114.00	0.07
905	000631	顺发恒业	16,700	39,078.00	0.07
906	688292	浩瀚深度	2,527	39,067.42	0.07
907	688580	伟思医疗	1,459	39,042.84	0.07
908	300870	欧陆通	900	39,042.00	0.07
909	002838	道恩股份	4,300	38,958.00	0.07
910	605366	宏柏新材	6,700	38,927.00	0.07
911	002835	同为股份	2,300	38,847.00	0.07
911	300551	古鳌科技	6,900	38,847.00	0.07
913	002975	博杰股份	1,300	38,844.00	0.07

914	300491	通合科技	2,700	38,772.00	0.07
915	603767	中马传动	3,200	38,688.00	0.07
916	300445	康斯特	2,400	38,640.00	0.07
917	603178	圣龙股份	1,800	38,574.00	0.07
918	600215	派斯林	5,400	38,502.00	0.07
919	300135	宝利国际	15,300	38,403.00	0.07
920	688246	嘉和美康	1,881	38,297.16	0.07
921	600207	安彩高科	10,100	38,279.00	0.07
922	688566	吉贝尔	1,694	38,115.00	0.07
923	300105	龙源技术	5,900	38,114.00	0.07
924	688320	禾川科技	1,551	38,061.54	0.07
925	688577	浙海德曼	927	37,005.84	0.07
926	002723	小崧股份	5,900	36,993.00	0.07
927	002995	天地在线	2,800	36,960.00	0.07
928	688799	华纳药厂	871	36,956.53	0.07
929	300892	品渥食品	2,700	36,828.00	0.07
930	688308	欧科亿	1,892	36,742.64	0.07
931	688661	和林微纳	1,195	36,626.75	0.07
932	688293	奥浦迈	1,160	36,273.20	0.06
933	603778	国晟科技	12,900	36,249.00	0.06
934	600706	曲江文旅	3,800	36,138.00	0.06
935	000045	深纺织 A	4,500	36,090.00	0.06
936	003028	振邦智能	1,000	36,060.00	0.06
937	300510	金冠股份	10,300	36,050.00	0.06
938	300798	锦鸡股份	5,800	36,018.00	0.06
938	603278	大业股份	5,800	36,018.00	0.06
940	603933	睿能科技	2,800	36,008.00	0.06
941	605289	罗曼股份	1,400	35,560.00	0.06
942	002712	思美传媒	10,000	35,500.00	0.06
943	002576	通达动力	3,100	35,185.00	0.06
944	688138	清溢光电	1,626	34,959.00	0.06
945	605399	晨光新材	3,200	34,400.00	0.06
946	603661	恒林股份	800	33,768.00	0.06
947	301333	诺思格	1,000	33,610.00	0.06
948	301391	卡莱特	760	33,272.80	0.06
949	688160	步科股份	820	32,791.80	0.06
950	688070	纵横股份	1,128	31,877.28	0.06
951	000040	东旭蓝天	3,300	7,953.00	0.01
952	301566	达利凯普	257	4,361.29	0.01

#### 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	688269	凯立新材	597,473.25	0.76
2	603283	赛腾股份	571,934.00	0.73
3	688788	科思科技	473,456.85	0.60
4	600133	东湖高新	466,340.00	0.59
5	688308	欧科亿	402,528.65	0.51
6	000766	通化金马	345,906.00	0.44
7	688136	科兴制药	343,781.11	0.44
8	688199	久日新材	343,183.51	0.44
9	688150	莱特光电	343,017.96	0.44
10	688377	迪威尔	341,121.51	0.43
11	688369	致远互联	340,264.80	0.43
12	688663	新风光	335,987.42	0.43
13	600826	兰生股份	330,874.00	0.42
14	603383	顶点软件	323,279.00	0.41
15	688049	炬芯科技	319,641.17	0.41
16	688148	芳源股份	319,169.45	0.41
17	600200	江苏吴中	318,855.00	0.41
18	600461	洪城环境	317,949.80	0.41
19	688519	南亚新材	317,406.32	0.40
20	688236	春立医疗	312,778.71	0.40

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	603283	赛腾股份	743,228.00	0.95
2	688269	凯立新材	511,441.86	0.65
3	600461	洪城环境	477,544.00	0.61
4	688788	科思科技	462,372.90	0.59
5	688308	欧科亿	423,449.16	0.54
6	603383	顶点软件	417,115.20	0.53
7	688199	久日新材	413,421.38	0.53
8	601588	北辰实业	380,504.00	0.48
9	688519	南亚新材	360,307.37	0.46
10	600133	东湖高新	356,163.00	0.45
11	688150	莱特光电	355,561.79	0.45
12	688663	新风光	353,562.20	0.45
13	600269	赣粤高速	350,843.00	0.45
14	601020	华钰矿业	347,840.00	0.44

15	688136	科兴制药	346,012.47	0.44
16	605599	莱百股份	340,833.00	0.43
17	688369	致远互联	339,771.74	0.43
18	688658	悦康药业	339,172.63	0.43
19	688377	迪威尔	332,296.68	0.42
20	600186	莲花控股	327,908.00	0.42

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	147,632,017.13
卖出股票收入（成交）总额	148,496,828.19

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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

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

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 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

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

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金将根据风险管理的原

则，以套期保值为目的，按照相关法律法规的有关规定，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约来进行投资。为更有效地进行流动性管理，本基金在出现需要及时调整组合市场暴露情况时，通过股指期货套保交易满足基金的投资替代需求和风险管理需求。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。本报告期内，本基金投资股指期货符合既定的投资政策和投资目的。

## 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

本基金本报告期末投资国债期货。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

**7.12.1** 本基金投资的前十名证券的发行主体中，贵州轮胎股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到贵州省统计局的处罚。

本基金为指数型基金，上述主体所发行的证券系标的指数成份股，上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期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** 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 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	366,892.09
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	10,655.84

7	待摊费用	75,409.12
8	其他	-
9	合计	452,957.05

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### § 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
1,522	44,392.11	17,810,987.00	26.36%	49,753,804.00	73.64%

#### 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	4,385,154.00	6.49%
2	东方证券股份有限公司	4,259,165.00	6.30%
3	海通证券股份有限公司	2,889,455.00	4.28%
4	方正证券股份有限公司	2,126,566.00	3.15%
5	中国国际金融股份有限公司	1,652,636.00	2.45%
6	张仲珏	1,330,700.00	1.97%
7	郭金荣	1,107,100.00	1.64%
8	华泰证券股份有限公司	1,022,935.00	1.51%
9	陈诗建	1,003,700.00	1.49%

10	刘谋智	1,000,000.00	1.48%
----	-----	--------------	-------

注：本表统计的上市基金前十名持有人均为场内持有人。

### 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	0.00	0.0000%

### 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 9 月 13 日）基金份额总额	811,564,791.00
本报告期期初基金份额总额	75,564,791.00
本报告期基金总申购份额	124,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	132,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	67,564,791.00

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未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

本报告期内本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，南翰仪同志任职国泰君安证券资产托管部副总经理(主持工作)。陈忠义同志任国泰君安证券公司副总裁，不再兼任资产托管部总经理职务。具体信息参见国泰君安证券资产托管与基金服务网站公告《关于国泰君安证券股份有限公司资产托管部负责人变更的公告》。

## 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

## 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

## 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

本报告期，基金管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到稽查或处罚。

## 10.7 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	
长江证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-

国泰君安	2	88,252,065.98	29.80%	8,827.49	29.80%	-
国信证券	2	207,876,779.34	70.20%	20,793.67	70.20%	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元，无新增交易单元。

b) 本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。本报告期内基金交易单元的选择标准如下：

- 1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- 2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- 3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

c) 基金交易单元的选择程序如下：

- 1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。
- 2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

#### 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
长江证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	48,217.52	74.97%	-	-	-	-
国信证券	16,097.40	25.03%	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
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	易方达基金管理有限公司关于指定证券投资基金主流动性服务商的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-01-03
2	易方达基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 4 季度报告提示性公告	证券时报	2024-01-19
3	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加联储证券为一级交易商的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-03-11
4	易方达基金管理有限公司旗下基金 2023 年年度报告提示性公告	证券时报	2024-03-29
5	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加渤海证券为一级交易商的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-04-19
6	易方达基金管理有限公司旗下基金 2024 年第 1 季度报告提示性公告	证券时报	2024-04-20
7	易方达基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-04-23
8	易方达基金管理有限公司关于易方达中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-04-26
9	易方达基金管理有限公司关于易方达中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-05-29

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 影响投资者决策的其他重要信息

自 2024 年 6 月 5 日至 2024 年 6 月 30 日，基金管理人自主承担本基金的信息披露费、审计费等固定费用。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

1. 中国证监会准予易方达中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金注册的文件；

2. 《易方达中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》;
3. 《易方达中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》;
4. 基金管理人业务资格批件、营业执照。

## 12.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼。

## 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇二四年八月三十日