

富国中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金
二〇二三年年度报告

2023 年 12 月 31 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 03 月 30 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人广发证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 3 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。

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。

本报告期自 2023 年 9 月 28 日（基金合同生效日）起至 2023 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	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、基金净值表现及利润分配情况.....	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	10
§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	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核报告	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	16
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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.....	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	17
§6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息.....	17
6.2 审计报告的基本内容.....	17
§7 年度财务报告	20
7.1 资产负债表.....	20

7.2 利润表.....	21
7.3 净资产变动表.....	22
7.4 报表附注.....	23
§8 投资组合报告.....	53
8.1 期末基金资产组合情况.....	53
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	53
8.3 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.....	54
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	79
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	81
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	81
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	81
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	81
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	81
8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	82
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	82
8.12 投资组合报告附注.....	82
§9 基金份额持有人信息.....	83
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	83
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	83
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	84
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	84
§10 开放式基金份额变动.....	84
§11 重大事件揭示.....	85
11.1 基金份额持有人大会决议.....	85
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	85
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	85
11.4 基金投资策略的改变.....	85
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	85
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	85
11.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	85
11.8 其他重大事件.....	87
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	87
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况.....	87
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	87

§13 备查文件目录 88

§ 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
场内简称	中证 2000 指数 ETF
基金简称	富国中证 2000ETF
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	255,458,827.00 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)自由贸易试验区世纪大道1196号世纪汇办公楼二座27-30层	广东省广州市黄埔区中新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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.fullgoal.com.cn
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市黄浦区延安东路222号外滩中心30楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2023年9月28日(基金合同生效日)至2023年12月31日
本期已实现收益	-3,895,383.49
本期利润	-651,325.73
加权平均基金份额本期利润	-0.0023
本期加权平均净值利润率	-0.23%

本期基金份额净值增长率	2.94%
3.1.2 期末数据和指标	2023年12月31日
期末可供分配利润	7,509,820.17
期末可供分配基金份额利润	0.0294
期末基金资产净值	262,968,647.17
期末基金份额净值	1.0294
3.1.3 累计期末指标	2023年12月31日
基金份额累计净值增长率	2.94%

注：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。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）。

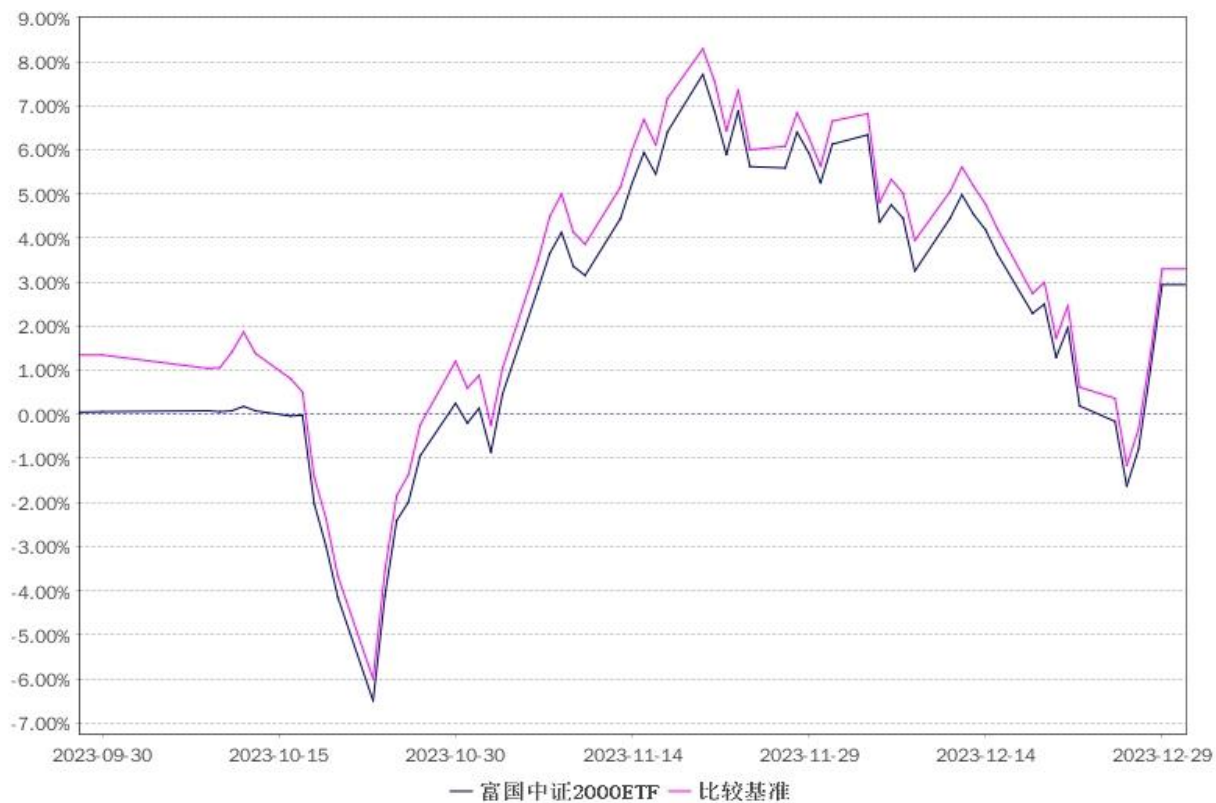
3.2 基金净值表现

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
过去三个月	2.88%	1.08%	1.92%	1.10%	0.96%	-0.02%
自基金合同生效起至今	2.94%	1.06%	3.30%	1.10%	-0.36%	-0.04%

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。

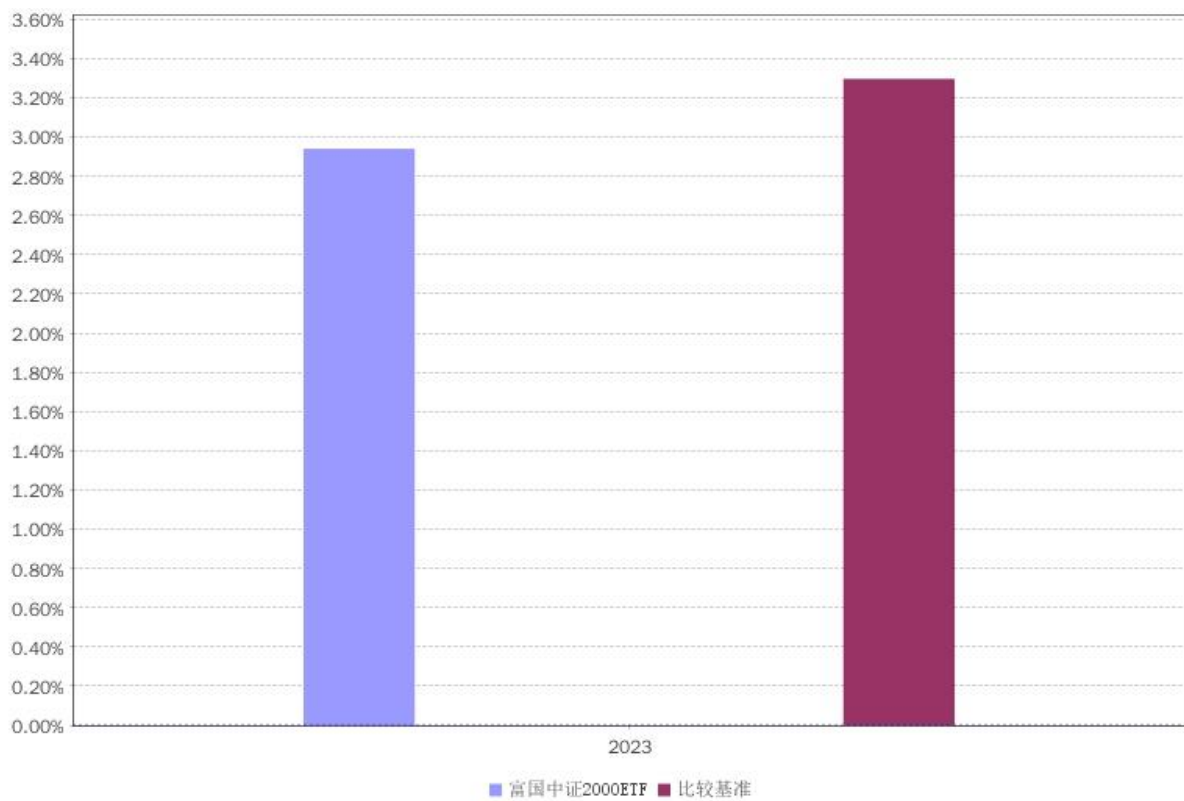
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、截止日期为2023年12月31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，本期末建仓期还未结束。

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



注：2023 年按实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金 2023 年 9 月 28 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日未进行利润分配

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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 2023 年 12 月 31 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 330 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；具有基金从业资格。

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《证券投资基金经营机构董事、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 公平交易制度和控制方法

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。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期，在同向交易价差分析方面，公司采集连续四个季度，不同时间窗口（1日内、3日内、5日内）的同向交易样本，在假设同向交易价差为零及95%的置信水平下，对同向交易价差进行t分布假设检验并对检验结果进行跟踪分析。分析结果显示本投资组合与公司管理的其他投资组合在同向交易价差方面未出现异常。

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。

4.3.3 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2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

2023年初以来，随着主要城市疫情高峰过去，疫情对经济的冲击逐步减小，投资者对2023年经济复苏预期变动更加乐观，A股迎来开门红。进入3月，由于两会政府工作报告公布的GDP增速目标低于市场预期，市场迎来一轮快速调整。4月以来，由于3月PMI验证经济进一步向好，提振市场信心。在经济弱复苏，流动性宽裕的背景下，人工智能相关板块迎来加速上涨。石油化工、建筑等板块在中特估及一带一路等主题概念的驱动下也迎来靓丽表现。进入5月中旬，由于金融、通胀数据均回落，指向经济内生动能不强，复苏斜率放缓压制市场情

绪，同时海外银行业危机和债务违约风险持续发酵，引发市场担忧加剧，各板块均迎来快速调整。2023 年下半年以来，由于国内经济增长压力仍然较大，二季度 GDP 数据不及预期，人民币贬值压力再度加大，市场出现调整。7 月末，随着政治局会议超预期释放利好，美联储如期加息 25bps 但表态偏鸽，指数强势回升。进入 8 月，由于 7 月多项经济金融数据超预期回落，政治局会议后政策出台密度和力度不及预期，同时美债收益率大幅攀升、美联储连续放鹰等外部冲击持续，北向资金大幅流出。进入 4 季度，由于公布的 9 月地产数据超预期下行、物价延续走低等引发市场担忧，资金面出现赎回等负反馈，沪指下破 3000 点。另外，美十年期国债突破新高、巴以冲突等海外风险持续压制全球风险资产。随着中央汇金持续增持 ETF，叠加万亿国债增发出台，市场悲观情绪缓解，走出底部反弹态势，沪指重回 3000 点以上。11 月，海外利率快速下行带动市场走出谷底，但国内经济复苏依然偏缓，市场波折震荡。12 月，海外抢跑降息预期，但国内经济复苏再次放缓叠加政策预期较低，市场创出年内新低。总体来看，2023 年上证综指下跌 3.7%，沪深 300 下跌 11.38%，创业板指下跌 19.41%，中证 500 指数下跌 7.42%。在投资管理上，我们坚持采取采用量化和人工管理相结合的方法进行投资和风险管理。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.0294 元；份额累计净值为 1.0294 元；本报告期，本基金份额净值增长率为 2.94%，同期业绩比较基准收益率为 3.30%。

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，随着年初的快速调整，市场整体风险进一步释放，已具备较高的中长期配置价值。从政策层面看，呵护力度显著提升。其中，央行超预期降准，且下调支农支小再贷款、再贴现利率。房地产政策开始加码发力，“做好经营性物业贷款管理，满足房地产企业合理融资需求”，上海、苏州、广州等地购房政策进一步放开。从估值来看，1 月末市场估值处于历史底部，性价比凸显。沪深 300 指数股权风险溢价再次突破+2x 标准差，其估值分位数回落至近十年 13% 分位附近，创业板指已处于历史估值最底部。从中长期来看，市场具备较高的配置价值。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核报告

本基金管理人始终坚持持有人利益优先原则，报告期内持续完善内控管理机制，全方位推动监察稽核工作深入开展。在基础性工作的基础上，2023 年度基金管理人重点开展的监察稽核工作包括以下方面：

（一）持续推进制度流程建设，保障业务合规开展

公司以建立重点业务内控制度体系，规范各业务部门内部管理为重点，持续强化公司内控管理与风险防范水平。报告期内，公司新增、修订多项内部管理制度，并以制度为基础相应完善业务流程。

（二）深入进行新规学习，扎实推动新规落地

2023 年度，公司从新规解读、制度建立、系统建设、流程改造等方面持续推进各项重要法律法规、监管要求的落地工作，并对落地情况开展专项检查，确保各项业务合法合规开展。

（三）培育合规文化，全面提升员工合规意识

为持续提高全员合规意识，公司对新员工、特定业务条线员工、全体员工开展不同侧重点的合规培训与宣导，结合多维度、多层次的合规谈话及合规考试，多管齐下全面提升员工的合规意识。

（四）立足于合规，不断拓展风险管理职能

报告期内，公司持续推进旗下组合的投资合规风控阈值多维度排查梳理和日常投资合规监督工作的规范化管理，进一步根据系统升级迭代情况整合优化历史风控工具。公司持续强化合规风控培训工作，提升各部门主动合规的能力和意识。公司不断加强对新业务、新品种及整体风险控制能力的研究，保持对各类风险的敏感度，加强日常监测和定期风险评估，持续提升对于各类投资标的的风险管理水平。

（五）持续推进合规风控工作的系统化建设

2023 年公司结合自主研发和专业系统外采等多种途径，持续推动合规风控信息化建设。公司通过搭建、完善覆盖事前、事中、事后的风控系统工具体系，助力有效监测、识别投资组合运作过程中的各类风险，加强投资过程中各类风险的管理能力。在合规管理方面，新增或优化系统管理功能模块包括合规考试、合规谈话、采购及合同一体化管理流程等。通过系统建设，提升合规管理工作质效。

（六）全面加强员工行为管理

报告期内，公司持续加强对从业人员的行为管控，内容包括监控录像、电子邮件、电话录音抽查，特定员工通讯工具集中管理，员工证券投资申报管理及廉洁从业管理等方面。通过日常合规管理与定期事后检查相结合的方式，提升全员合规意识，加强员工行为管理，确保各项业务合规开展。

（七）扎实推进反洗钱工作

公司高度重视反洗钱工作，认真贯彻落实各项反洗钱监管要求。除在客户尽职调查、大额和可疑交易报告、客户资料和交易记录保存等反洗钱核心义务方面积极履职外，还通过重点专项工作等方式有序推动反洗钱工作深入开展。报告期内，主要重点工作包括开展机构洗钱风险评估、持续推动系统建设和数据治理工作、强化客户身份识别前端管控、多层次立体化文化宣贯等。

（八）深入开展内部审计，发挥第三道防线功能

公司围绕各条线各部门制度框架体系建立情况、法规落实情况及当年工作重点开展审计工作。通过基础风险点例行检查与法规落实情况、监管重点排查相结合的方式，深入开展内部审计检查并督导整改完善。报告期内，公司开展多项专项审计，涵盖投研、交易、销售、信息技术、反洗钱等各业务领域。

4.7 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。

4.8 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。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期无需要说明的相关情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本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 2023 年年度报告中的财务指标、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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	德师报(审)字(24)第 P00648 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	富国中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了富国中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金的财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年 9 月 28 日(基金合同生效日)至 2023

	<p>年 12 月 31 日止期间的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附的富国中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了富国中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年 9 月 28 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于富国中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	<p>富国中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p>

	<p>在编制财务报表时,管理层负责评估富国中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督富国中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险,设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能对富国中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表</p>

	使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致富国中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金不能持续经营。 (5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	汪芳 冯适
会计师事务所的地址	上海市黄浦区延安东路 222 号外滩中心 30 楼
审计报告日期	2024 年 03 月 28 日

§ 7 年度财务报告

7.1 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：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2023 年 12 月 31 日
资产：	
货币资金	7,972,231.58
结算备付金	1,082,870.23
存出保证金	1,361,221.16
交易性金融资产	252,905,727.90
其中：股票投资	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	—
资产总计	307,593,595.46
负债和净资产	本期末 2023年12月31日
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	44,016,381.38
应付赎回款	—
应付管理人报酬	37,319.90
应付托管费	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	563,783.02
负债合计	44,624,948.29
净资产：	
实收基金	255,458,827.00
其他综合收益	—
未分配利润	7,509,820.17
净资产合计	262,968,647.17
负债和净资产总计	307,593,595.46

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0294 元，基金份额总额 255,458,827.00 份。本基金合同生效日 2023 年 09 月 28 日。

7.2 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：2023 年 09 月 28 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2023 年 9 月 28 日 (基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入	-38,198.77
1.利息收入	892,149.24
其中：存款利息收入	892,149.24

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）	-3,764,479.88
其中：股票投资收益	-3,906,527.51
基金投资收益	—
债券投资收益	126,965.63
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	15,082.00
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）	3,244,057.76
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	—
5.其他收入（损失以“-”号填列）	-409,925.89
减：二、营业总支出	613,126.96
1. 管理人报酬	408,847.71
2. 托管费	81,769.53
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	0.13
8. 其他费用	122,509.59
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-651,325.73
减：所得税费用	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-651,325.73
五、其他综合收益的税后净额	—
六、综合收益总额	-651,325.73

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。

7.3 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：2023 年 09 月 28 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 9 月 28 日(基金合同生效日) 至 2023 年 12 月 31 日
----	---

	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、本期期初净资产	823,458,827.00	—	823,458,827.00
二、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	568,000,000.00	7,509,820.17	560,490,179.83
（一）、综合收益总额	—	-651,325.73	-651,325.73
（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）	568,000,000.00	8,161,145.90	559,838,854.10
其中：1. 基金申购款	206,000,000.00	3,073,301.23	209,073,301.23
2. 基金赎回款	774,000,000.00	5,087,844.67	768,912,155.33
（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）	—	—	—
三、本期期末净资产	255,458,827.00	7,509,820.17	262,968,647.17

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 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 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。

7.4.2 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2号《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。

7.4.3 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2023年12月31日的财务状况以及2023年9月28日（基金合同生效日）至2023年12月31日止期间的经营成果和净资产变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间系2023年9月28日（基金合同生效日）至2023年12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期

损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济

状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资

产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

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

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的

实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；
债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损

益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 转融通证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额，在转融通证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时扣除适用情况下的相关税费后的净额计入转融通证券出借业务利息收入。出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入计入投资收益；

(8) 其他收入在本基金履行了基金合同中的履约义务，即在客户取得服务控制权时确认收入。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、每一基金份额享有同等分配权；

2、基金每年收益分配次数没有限制，每次基金收益分配数额的确定原则为使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补亏损为前提，收益分配后有可能使基金份额净值低于面值，即基金收益分配基准日（即收益评价日）的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后可能低于面值；

3、若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；

4、本基金收益分配采用现金方式；

5、法律法规、监管机关、登记机构、上海证券交易所另有规定的，从其规定。

在遵守法律法规和监管部门的规定，且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人在与基金托管人协商一致并按照监管部门要求履行适当程序后可对基金收益分配原则和支付方式进行调整，不需召开基金份额持有人大会，并应于变更实施日前在规定媒介公告。

7.4.4.12 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；

(2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；

(3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 (2023年12月31日)
活期存款	7,972,231.58
等于：本金	7,970,452.71
加：应计利息	1,778.87
减：坏账准备	—
定期存款	—
等于：本金	—
加：应计利息	—
减：坏账准备	—
其中：存款期限1个月以内	—
存款期限1-3个月	—
存款期限3个月以上	—
其他存款	—
等于：本金	—
加：应计利息	—
减：坏账准备	—
合计	7,972,231.58

注：本基金本报告期末未持有定期存款。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末(2023年12月31日)			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	249,640,769.32	—	252,882,758.46	3,241,989.14
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—	—
债券	交易所市场	20,900.00	22,969.44	2,068.62
	银行间市场	—	—	—
	合计	20,900.00	0.82	22,969.44
资产支持证券	—	—	—	—
基金	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	249,661,669.32	0.82	252,905,727.90	3,244,057.76

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本报告期末本基金未持有衍生金融资产/负债，本基金合同生效日为2023年

9月28日。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末（2023年12月31日）
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	—
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	491,673.43
其中：交易所市场	491,673.43
银行间市场	—
应付利息	—
预提信息披露费	30,000.00
预提审计费	38,000.00
IOPV 计算发布费	4,109.59
合计	563,783.02

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2023年9月28日(基金合同生效日)至 2023年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日2023年9月28日	823,458,827.00	823,458,827.00
本期申购	206,000,000.00	206,000,000.00
本期赎回(以“-”号填列)	-774,000,000.00	-774,000,000.00
本期末	255,458,827.00	255,458,827.00

7.4.7.8 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
----	-------	-------	---------

基金合同生效日 2023年9月28日	—	—	—
本期利润	-3,895,383.49	3,244,057.76	-651,325.73
本期基金份额交易产生的变动数	18,687,383.28	-10,526,237.38	8,161,145.90
其中：基金申购款	11,753,397.61	-8,680,096.38	3,073,301.23
基金赎回款	6,933,985.67	-1,846,141.00	5,087,844.67
本期已分配利润	—	—	—
本期末	14,791,999.79	-7,282,179.62	7,509,820.17

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 9 月 28 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	874,610.97
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	14,206.53
其他	3,331.74
合计	892,149.24

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 9 月 28 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-3,422,524.92
股票投资收益——赎回差价收入	-484,002.59
股票投资收益——申购差价收入	—
合计	-3,906,527.51

7.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 9 月 28 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	565,673,689.72
减：卖出股票成本总额	568,224,703.70
减：交易费用	871,510.94
买卖股票差价收入	-3,422,524.92

7.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 9 月 28 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日
赎回基金份额对价总额	768,912,155.33
减：现金支付赎回款总额	537,568,422.33
减：赎回股票成本总额	231,827,735.59
减：交易费用	—
赎回差价收入	-484,002.59

7.4.7.10.4 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。

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 9 月 28 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日
债券投资收益——利息收入	47.47
债券投资收益——买卖债券(债转股及债券到期兑付)差价收入	126,918.16
合计	126,965.63

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期2023年9月28日(基金合同生效日)至2023年12月31日
卖出债券(债转股及债券到期兑付)成交总额	407,482.28
减：卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	280,500.00
减：应计利息总额	47.81
减：交易费用	16.31
买卖债券差价收入	126,918.16

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

7.4.7.12.1 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。

7.4.7.12.2 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。

7.4.7.13 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无买卖贵金属交易。

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 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。

7.4.7.14.2 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。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。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 9 月 28 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	15,082.00
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	15,082.00

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 9 月 28 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	3,244,057.76
股票投资	3,241,989.14

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	3,244,057.76

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 9 月 28 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	—
替代损益	-409,925.89
合计	-409,925.89

7.4.7.18 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 9 月 28 日(基金合同生效 日)至 2023 年 12 月 31 日
审计费用	38,000.00
信息披露费	30,000.00
证券出借违约金	—
其他	54,509.59
合计	122,509.59

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

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

山东省金融资产管理股份有限公司	基金管理人的股东
蒙特利尔银行	基金管理人的股东
广发证券股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
申万宏源西部证券有限公司	基金管理人股东控制的子公司、基金代销机构

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 9 月 28 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额 的比例 (%)
海通证券	1,512,321,513.47	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。

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 9 月 28 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券成交总额 的比例 (%)
海通证券	407,482.28	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。

7.4.10.1.4 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。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期2023年9月28日(基金合同生效日)至2023年12月31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	491,673.43	100.00	491,673.43	100.00

注：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。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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期2023年9月28日(基金合同生效日)至2023年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	408,847.71
其中：应支付销售机构的客户维护费	719.95
应支付基金管理人的净管理费	408,127.76

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，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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期2023年9月28日(基金合同生效日)至2023年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	81,769.53

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，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。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：本基金本报告期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。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：本基金本报告期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。

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

注：本基金本报告期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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期内本基金的基金管理人未运用固有资金投资本基金。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。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末（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（%）
广发证券股份有限公司	8,609,564.00	3.37

注：本基金合同生效日为2023年09月28日，无上年度末数据。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

注：本基金本报告期未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。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期2023年9月28日(基金合同生效日)至2023年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
海通证券股份有限公司	301568	思泰克	IPO网下申购	1,011	23,485.53

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期未进行利润分配。

7.4.12 期末（2023年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票

金额单位：人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001239	永达股份	2023-12-04	6个月	新股限售	12.05	19.92	75	903.75	1,494.00	—
001358	兴欣新材	2023-12-14	6个月	新股限售	41.00	44.16	21	861.00	927.36	—
301413	安培龙	2023-12-11	6个月	新股限售	33.25	58.19	51	1,695.75	2,967.69	—
301508	中机认检	2023-11-23	6个月	新股限售	16.82	26.68	140	2,354.80	3,735.20	—
301516	中远通	2023-12-01	6个月	新股限售	6.87	15.51	268	1,841.16	4,156.68	—
301568	思泰克	2023-11-21	6个月	新股限售	23.23	35.58	102	2,369.46	3,629.16	—

688652	京仪装备	2023-11-22	6 个月	新股限售	31.95	52.25	74	2,364.30	3,866.50	—
--------	------	------------	------	------	-------	-------	----	----------	----------	---

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券

金额单位：人民币元

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： 张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113681	镇洋转债	2023-12-29	1 个月内 (含)	认购新发 证券	100.00	100.00	140	14,000.00	14,000.18	—

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2023 年 12 月 31 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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 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。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中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。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、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。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本表主要列示短期融资券和超短期融资券，债券评级取自第三方评级机构的债项评级，未评级债券列示超短期融资券。本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的信用债。

7.4.13.2.2 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（2023 年 12 月 31 日）
AAA	—
AAA 以下	22,969.44
未评级	—
合计	22,969.44

注：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。

7.4.13.2.3 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。此表中资产支持证券的债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末未持有同业存单。本表主要列示同业存单，评级取自第三方评级机构的主体评级。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于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。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《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7.4.12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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 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（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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本期末未持有债券资产（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。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。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 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（2023年12月31日）	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	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	252,905,727.90	96.17

7.4.13.4.3.2 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。基金合同生效日为2023年09月28日。

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（2023年12月31日）
	1. 业绩比较基准增加1%	2,486,994.46
	2. 业绩比较基准减少1%	-2,486,994.46

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的

输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 (2023年12月31日)
第一层次	252,870,951.13
第二层次	14,000.18
第三层次	20,776.59
合计	252,905,727.90

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生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。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 9 月 28 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	—	—	—
当期购买	—	12,390.22	12,390.22
当期出售/结算	—	—	—
转入第三层次	—	—	—

转出第三层次	—	—	—
当期利得或损失总额	—	8,386.37	8,386.37
其中：计入损益的利得或损失	—	8,386.37	8,386.37
期末余额	—	20,776.59	20,776.59
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	—	8,386.37	8,386.37

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	20,776.59	平均价格亚式期权模型	股票在剩余限售期内的股价的预期年化波动率	0.5141-2.1752	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.4 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。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.15.1 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。

7.4.15.2 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。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	252,882,758.46	82.21
	其中：股票	252,882,758.46	82.21
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	22,969.44	0.01
	其中：债券	22,969.44	0.01
	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	9,055,101.81	2.94
8	其他各项资产	45,632,765.75	14.84
9	合计	307,593,595.46	100.00

注：上表中的股票投资项的金额包含可退替代款估值增值，而 8.2 的合计项及 8.3 不含可退替代款估值增值

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 期末按行业分类的境内股票投资组合

8.2.1.1 期末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	17,041.39	0.01
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	3,735.20	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	20,776.59	0.01

8.2.1.2 期末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	1,735,422.00	0.66
B	采矿业	2,120,109.00	0.81
C	制造业	174,121,269.25	66.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,482,081.00	2.08
E	建筑业	4,929,276.00	1.87
F	批发和零售业	9,587,419.00	3.65
G	交通运输、仓储和邮政业	4,527,285.20	1.72
H	住宿和餐饮业	455,930.00	0.17
I	信息传输、软件和信息技术服务业	23,646,931.48	8.99
J	金融业	175,212.00	0.07
K	房地产业	6,126,613.00	2.33
L	租赁和商务服务业	3,643,263.50	1.39
M	科学研究和技术服务业	6,489,205.18	2.47
N	水利、环境和公共设施管理业	4,188,138.16	1.59
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	603,093.00	0.23
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	4,064,617.00	1.55
S	综合	917,047.00	0.35
	合计	252,812,911.77	96.14

8.3 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

8.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例
----	------	------	-------	---------	-----------

					(%)
1	000766	通化金马	49,900	995,006.00	0.38
2	688558	国盛智科	24,400	692,960.00	0.26
3	688216	气派科技	25,000	691,750.00	0.26
4	688181	八亿时空	25,222	680,994.00	0.26
5	600186	莲花健康	112,200	678,810.00	0.26
6	600106	重庆路桥	88,200	589,176.00	0.22
7	600226	瀚叶股份	214,600	560,106.00	0.21
8	300049	福瑞股份	12,700	553,593.00	0.21
9	688138	清溢光电	24,300	549,666.00	0.21
10	600133	东湖高新	50,700	546,039.00	0.21
11	688135	利扬芯片	24,400	544,364.00	0.21
12	688231	隆达股份	24,600	541,446.00	0.21
13	688317	之江生物	25,200	528,696.00	0.20
14	688132	邦彦技术	24,600	527,178.00	0.20
15	600756	浪潮软件	37,700	522,899.00	0.20
16	688323	瑞华泰	24,300	521,721.00	0.20
17	301280	珠城科技	12,700	521,716.00	0.20
18	688136	科兴制药	25,400	514,350.00	0.20
19	300098	高新兴	126,600	513,996.00	0.20
20	601020	华钰矿业	49,800	512,940.00	0.20
21	688030	山石网科	25,200	504,504.00	0.19
22	688287	观典防务	50,600	499,422.00	0.19
23	688085	三友医疗	25,166	490,737.00	0.19
24	300852	四会富仕	12,700	489,458.00	0.19
25	002975	博杰股份	12,700	485,140.00	0.18
26	688227	品高股份	25,400	484,378.00	0.18
27	688179	阿拉丁	25,200	482,832.00	0.18
28	603987	康德莱	50,460	481,388.40	0.18
29	600622	光大嘉宝	185,100	477,558.00	0.18
30	688697	纽威数控	25,319	476,756.77	0.18
31	603859	能科科技	12,600	475,398.00	0.18
32	600345	长江通信	24,500	474,565.00	0.18
33	688267	中触媒	24,662	474,003.64	0.18
34	688015	交控科技	25,200	472,752.00	0.18
35	688225	亚信安全	25,550	468,587.00	0.18
36	300590	移为通信	38,000	456,380.00	0.17
37	600525	长园集团	85,300	456,355.00	0.17
38	603189	网达软件	25,300	448,822.00	0.17
39	301318	维海德	12,650	447,936.50	0.17
40	688505	复旦张江	48,400	446,732.00	0.17

41	603959	百利科技	49,200	437,388.00	0.17
42	600351	亚宝药业	63,200	436,080.00	0.17
43	601089	福元医药	25,200	434,448.00	0.17
44	600708	光明地产	201,200	432,580.00	0.16
45	603660	苏州科达	48,900	429,831.00	0.16
46	300708	聚灿光电	37,900	427,512.00	0.16
47	300705	九典制药	12,800	425,344.00	0.16
48	600664	哈药股份	126,100	422,435.00	0.16
49	600103	青山纸业	176,350	421,476.50	0.16
50	600184	光电股份	36,800	420,624.00	0.16
51	600200	江苏吴中	50,600	415,932.00	0.16
52	603387	基蛋生物	37,800	415,800.00	0.16
53	300468	四方精创	38,300	415,555.00	0.16
54	600198	大唐电信	63,200	415,224.00	0.16
55	600269	赣粤高速	101,000	415,110.00	0.16
56	603220	中贝通信	12,200	414,312.00	0.16
57	301093	华兰股份	12,800	413,440.00	0.16
58	600255	鑫科材料	187,000	413,270.00	0.16
59	300129	泰胜风能	38,300	412,491.00	0.16
60	600054	黄山旅游	37,900	412,352.00	0.16
61	600135	乐凯胶片	50,900	410,763.00	0.16
62	600590	泰豪科技	61,400	410,152.00	0.16
63	600744	华银电力	126,500	409,860.00	0.16
64	300946	恒而达	12,700	409,829.00	0.16
65	300494	盛天网络	25,900	409,479.00	0.16
66	600479	千金药业	38,000	409,260.00	0.16
67	300181	佐力药业	38,300	408,278.00	0.16
68	002106	莱宝高科	38,300	407,512.00	0.15
69	688306	均普智能	72,951	406,337.07	0.15
70	600105	永鼎股份	73,100	404,974.00	0.15
71	300046	台基股份	25,400	404,114.00	0.15
72	603078	江化微	25,200	403,704.00	0.15
73	000070	特发信息	50,250	398,985.00	0.15
74	600855	航天长峰	37,200	398,784.00	0.15
75	300149	睿智医药	51,904	397,065.60	0.15
76	002197	证通电子	38,200	396,898.00	0.15
77	603738	泰晶科技	24,200	395,670.00	0.15
78	603508	思维列控	25,200	395,640.00	0.15
79	605305	中际联合	12,200	394,182.00	0.15
80	300766	每日互动	25,500	393,465.00	0.15
81	603977	国泰集团	37,600	391,040.00	0.15

82	603496	恒为科技	12,480	388,876.80	0.15
83	603686	福龙马	37,900	387,717.00	0.15
84	688148	芳源股份	50,400	386,568.00	0.15
85	300131	英唐智控	64,300	386,443.00	0.15
86	300617	安靠智电	12,700	385,572.00	0.15
87	688722	同益中	25,200	385,560.00	0.15
88	600237	铜峰电子	49,800	385,452.00	0.15
89	603330	天洋新材	50,700	384,306.00	0.15
90	300355	蒙草生态	102,400	384,000.00	0.15
91	300184	力源信息	63,800	379,610.00	0.14
92	605599	菜百股份	25,400	378,206.00	0.14
93	300678	中科信息	12,600	377,748.00	0.14
94	688222	成都先导	25,200	377,748.00	0.14
95	600080	金花股份	50,600	376,970.00	0.14
96	002527	新时达	38,400	376,704.00	0.14
97	605286	同力日升	12,600	376,236.00	0.14
98	603960	克来机电	25,200	374,724.00	0.14
99	300353	东土科技	38,500	372,680.00	0.14
100	002122	汇洲智能	89,300	372,381.00	0.14
101	688553	汇宇制药	24,600	372,198.00	0.14
102	603367	辰欣药业	25,300	370,392.00	0.14
103	601038	一拖股份	25,400	370,078.00	0.14
104	002031	巨轮智能	89,300	369,702.00	0.14
105	603681	永冠新材	24,400	368,440.00	0.14
106	002707	众信旅游	51,200	365,568.00	0.14
107	600742	一汽富维	38,200	364,810.00	0.14
108	301132	满坤科技	12,700	364,617.00	0.14
109	688509	正元地信	75,426	364,307.58	0.14
110	603315	福鞍股份	25,000	363,250.00	0.14
111	002154	报喜鸟	63,900	362,952.00	0.14
112	603309	维力医疗	25,400	361,442.00	0.14
113	603633	徕木股份	37,670	360,878.60	0.14
114	600130	波导股份	75,000	360,750.00	0.14
115	603237	五芳斋	12,300	360,390.00	0.14
116	605268	王力安防	37,000	360,380.00	0.14
117	603520	司太立	25,400	357,632.00	0.14
118	003020	立方制药	12,700	357,505.00	0.14
119	002270	华明装备	25,300	357,236.00	0.14
120	603190	亚通精工	12,200	357,216.00	0.14
121	600620	天宸股份	38,000	357,200.00	0.14
122	600503	华丽家族	139,800	356,490.00	0.14

123	603203	快克智能	12,300	355,593.00	0.14
124	600278	东方创业	50,600	353,188.00	0.13
125	300252	金信诺	38,200	352,586.00	0.13
126	605133	嵘泰股份	12,700	351,409.00	0.13
127	603822	嘉澳环保	12,600	350,406.00	0.13
128	600425	青松建化	88,600	349,970.00	0.13
129	603968	醋化股份	24,600	349,566.00	0.13
130	300872	天阳科技	25,500	348,840.00	0.13
131	300825	阿尔特	25,300	347,875.00	0.13
132	600501	航天晨光	25,400	347,472.00	0.13
133	000670	盈方微	51,000	345,780.00	0.13
134	300853	申昊科技	12,700	345,440.00	0.13
135	603999	读者传媒	50,200	344,874.00	0.13
136	605399	晨光新材	25,400	344,424.00	0.13
137	600619	海立股份	50,500	343,905.00	0.13
138	002829	星网宇达	12,700	343,408.00	0.13
139	600218	全柴动力	35,800	342,606.00	0.13
140	600268	国电南自	49,100	342,227.00	0.13
141	002510	天汽模	70,400	342,144.00	0.13
142	300719	安达维尔	25,600	341,248.00	0.13
143	300292	吴通控股	91,600	340,752.00	0.13
144	300712	永福股份	12,700	340,360.00	0.13
145	603626	科森科技	37,400	339,966.00	0.13
146	603386	骏亚科技	24,600	339,480.00	0.13
147	300005	探路者	51,200	338,944.00	0.13
148	002284	亚太股份	38,600	338,522.00	0.13
149	603277	银都股份	12,600	337,932.00	0.13
150	300493	润欣科技	39,700	337,847.00	0.13
151	603076	乐惠国际	12,600	337,680.00	0.13
152	600461	洪城环境	36,900	337,266.00	0.13
153	600789	鲁抗医药	47,200	337,008.00	0.13
154	688299	长阳科技	24,150	336,892.50	0.13
155	600468	百利电气	50,200	336,340.00	0.13
156	002640	跨境通	89,700	335,478.00	0.13
157	300722	新余国科	12,800	335,232.00	0.13
158	300047	天源迪科	38,300	335,125.00	0.13
159	002937	兴瑞科技	12,800	333,568.00	0.13
160	301126	达嘉维康	25,600	333,568.00	0.13
161	688079	美迪凯	25,000	332,750.00	0.13
162	600353	旭光电子	36,400	332,696.00	0.13
163	002334	英威腾	38,100	332,613.00	0.13

164	000925	众合科技	38,400	332,544.00	0.13
165	002279	久其软件	51,000	332,010.00	0.13
166	603327	福蓉科技	24,900	331,917.00	0.13
167	300548	博创科技	12,300	331,731.00	0.13
168	301119	正强股份	12,800	331,264.00	0.13
169	603810	丰山集团	24,700	330,239.00	0.13
170	603199	九华旅游	12,700	329,565.00	0.13
171	002642	荣联科技	38,400	329,472.00	0.13
172	300255	常山药业	25,300	329,153.00	0.13
173	600162	香江控股	189,100	329,034.00	0.13
174	600735	新华锦	51,000	328,950.00	0.13
175	300706	阿石创	12,700	328,676.00	0.12
176	603088	宁波精达	38,100	328,422.00	0.12
177	002903	宇环数控	12,800	327,040.00	0.12
178	002681	奋达科技	66,000	326,700.00	0.12
179	300429	强力新材	25,400	326,644.00	0.12
180	603507	振江股份	12,600	326,466.00	0.12
181	603303	得邦照明	25,400	326,390.00	0.12
182	002587	奥拓电子	38,000	325,660.00	0.12
183	600509	天富能源	50,000	325,500.00	0.12
184	600067	冠城大通	129,500	325,045.00	0.12
185	603755	日辰股份	12,200	324,276.00	0.12
186	600987	航民股份	37,000	324,120.00	0.12
187	600825	新华传媒	72,500	324,075.00	0.12
188	600495	晋西车轴	75,700	323,996.00	0.12
189	600731	湖南海利	49,300	323,901.00	0.12
190	300032	金龙机电	51,300	323,703.00	0.12
191	603937	丽岛新材	25,500	323,085.00	0.12
192	600467	好当家	135,600	322,728.00	0.12
193	603380	易德龙	12,600	322,686.00	0.12
194	603052	可川科技	7,400	322,492.00	0.12
195	600533	栖霞建设	110,000	322,300.00	0.12
196	600638	新黄浦	62,200	321,574.00	0.12
197	300219	鸿利智汇	38,150	321,223.00	0.12
198	688313	仕佳光子	25,250	320,927.50	0.12
199	605116	奥锐特	12,400	320,168.00	0.12
200	688277	天智航	24,259	319,733.62	0.12
201	301302	华如科技	12,700	318,897.00	0.12
202	600961	株冶集团	38,100	318,516.00	0.12
203	601929	吉视传媒	175,000	318,500.00	0.12
204	688488	艾迪药业	25,400	317,754.00	0.12

205	603815	交建股份	38,000	317,680.00	0.12
206	600651	飞乐音响	88,200	317,520.00	0.12
207	600616	金枫酒业	50,700	317,382.00	0.12
208	301282	金禄电子	12,700	317,373.00	0.12
209	300331	苏大维格	12,700	317,246.00	0.12
210	600897	厦门空港	25,400	317,246.00	0.12
211	603727	博迈科	25,300	317,009.00	0.12
212	300057	万顺新材	51,300	316,521.00	0.12
213	688108	赛诺医疗	25,200	316,260.00	0.12
214	300020	银江技术	38,100	316,230.00	0.12
215	688579	山大地纬	24,900	316,230.00	0.12
216	603180	金牌厨柜	12,600	316,134.00	0.12
217	601789	宁波建工	76,200	315,468.00	0.12
218	605567	春雪食品	25,000	315,250.00	0.12
219	301135	瑞德智能	12,700	315,214.00	0.12
220	605366	宏柏新材	38,100	315,087.00	0.12
221	300488	恒锋工具	12,800	314,624.00	0.12
222	300349	金卡智能	25,300	314,226.00	0.12
223	300900	广联航空	12,700	313,436.00	0.12
224	600114	东睦股份	20,200	312,898.00	0.12
225	603703	盛洋科技	24,400	312,564.00	0.12
226	002277	友阿股份	77,500	312,325.00	0.12
227	002519	银河电子	50,500	311,585.00	0.12
228	300656	民德电子	12,700	311,531.00	0.12
229	300831	派瑞股份	25,400	311,404.00	0.12
230	603966	法兰泰克	38,040	311,167.20	0.12
231	600558	大西洋	76,300	310,541.00	0.12
232	301118	恒光股份	12,700	310,261.00	0.12
233	000936	华西股份	38,300	310,230.00	0.12
234	301388	欣灵电气	12,700	309,753.00	0.12
235	603060	国检集团	36,800	309,120.00	0.12
236	600180	瑞茂通	50,700	308,763.00	0.12
237	600488	津药药业	63,000	308,700.00	0.12
238	605388	均瑶健康	24,600	308,484.00	0.12
239	600173	卧龙地产	61,600	308,000.00	0.12
240	601007	金陵饭店	38,100	307,848.00	0.12
241	601008	连云港	76,000	307,800.00	0.12
242	600609	金杯汽车	63,300	307,638.00	0.12
243	300830	金现代	38,100	307,467.00	0.12
244	688659	元琛科技	24,600	306,270.00	0.12
245	300008	天海防务	76,800	305,664.00	0.12

246	603887	城地香江	38,000	305,520.00	0.12
247	603757	大元泵业	12,600	305,424.00	0.12
248	603969	银龙股份	50,900	305,400.00	0.12
249	600433	冠豪高新	88,200	305,172.00	0.12
250	002438	江苏神通	25,500	304,725.00	0.12
251	300968	格林精密	25,200	304,416.00	0.12
252	688588	凌志软件	25,442	302,759.80	0.12
253	603901	永创智能	25,300	301,070.00	0.11
254	300925	法本信息	25,500	299,625.00	0.11
255	603667	五洲新春	12,800	299,520.00	0.11
256	600838	上海九百	38,000	299,060.00	0.11
257	603086	先达股份	50,800	298,704.00	0.11
258	603809	豪能股份	25,200	298,620.00	0.11
259	600207	安彩高科	62,500	298,125.00	0.11
260	002046	国机精工	25,800	297,990.00	0.11
261	300227	光韵达	38,000	297,920.00	0.11
262	600892	大晟文化	48,800	296,704.00	0.11
263	600470	六国化工	50,700	296,088.00	0.11
264	301123	奕东电子	12,600	295,596.00	0.11
265	300996	普联软件	12,900	295,410.00	0.11
266	300490	华自科技	25,400	294,894.00	0.11
267	603222	济民医疗	36,800	294,768.00	0.11
268	300691	联合光电	12,700	294,513.00	0.11
269	603610	麒盛科技	24,700	294,424.00	0.11
270	300843	胜蓝股份	12,800	294,144.00	0.11
271	600829	人民同泰	37,600	294,032.00	0.11
272	300966	共同药业	12,800	294,016.00	0.11
273	300112	万讯自控	25,500	293,250.00	0.11
274	002559	亚威股份	25,400	292,862.00	0.11
275	001219	青岛食品	12,700	292,735.00	0.11
276	002609	捷顺科技	25,600	292,352.00	0.11
277	600190	锦州港	101,500	292,320.00	0.11
278	002075	沙钢股份	76,400	291,848.00	0.11
279	603359	东珠生态	38,000	291,840.00	0.11
280	003019	宸展光电	12,900	291,540.00	0.11
281	603018	华设集团	38,200	290,320.00	0.11
282	603758	秦安股份	25,300	289,432.00	0.11
283	603090	宏盛股份	12,300	289,296.00	0.11
284	002729	好利科技	12,700	289,052.00	0.11
285	605389	长龄液压	10,800	289,008.00	0.11
286	600973	宝胜股份	61,300	288,723.00	0.11

287	600419	天润乳业	24,600	288,558.00	0.11
288	603878	武进不锈	38,200	288,410.00	0.11
289	603687	大胜达	25,100	288,399.00	0.11
290	301329	信音电子	12,700	288,290.00	0.11
291	300241	瑞丰光电	51,200	288,256.00	0.11
292	605555	德昌股份	12,600	287,910.00	0.11
293	603948	建业股份	12,600	286,524.00	0.11
294	002455	百川股份	38,500	285,670.00	0.11
295	603028	赛福天	25,600	285,440.00	0.11
296	600513	联环药业	25,600	285,184.00	0.11
297	300536	农尚环境	12,600	284,760.00	0.11
298	600757	长江传媒	38,100	283,845.00	0.11
299	603173	福斯达	12,600	283,752.00	0.11
300	603011	合锻智能	37,700	283,504.00	0.11
301	600576	祥源文旅	38,100	283,464.00	0.11
302	601599	浙文影业	66,300	281,775.00	0.11
303	688609	九联科技	21,300	281,160.00	0.11
304	605319	无锡振华	12,200	280,844.00	0.11
305	605088	冠盛股份	12,200	280,600.00	0.11
306	002940	昂利康	12,900	280,059.00	0.11
307	600288	大恒科技	24,600	279,948.00	0.11
308	603998	方盛制药	25,500	279,480.00	0.11
309	603890	春秋电子	24,400	279,380.00	0.11
310	002801	微光股份	12,800	278,400.00	0.11
311	300120	经纬辉开	38,300	278,058.00	0.11
312	688365	光云科技	25,512	277,825.68	0.11
313	600668	尖峰集团	25,100	277,355.00	0.11
314	600939	重庆建工	84,500	277,160.00	0.11
315	002102	冠福股份	102,200	276,962.00	0.11
316	300520	科大国创	12,700	276,098.00	0.10
317	603358	华达科技	11,800	275,884.00	0.10
318	300793	佳禾智能	12,700	275,717.00	0.10
319	300466	赛摩智能	38,400	275,712.00	0.10
320	300448	浩云科技	51,200	275,456.00	0.10
321	603181	皇马科技	25,200	275,436.00	0.10
322	002115	三维通信	38,100	275,082.00	0.10
323	002042	华孚时尚	63,900	274,770.00	0.10
324	300205	ST天喻	25,300	274,758.00	0.10
325	300629	新劲刚	12,700	274,701.00	0.10
326	688183	生益电子	24,150	274,585.50	0.10
327	300213	佳讯飞鸿	38,100	274,320.00	0.10

328	600212	绿能慧充	38,100	273,558.00	0.10
329	600551	时代出版	25,100	273,339.00	0.10
330	688176	亚虹医药	25,350	273,273.00	0.10
331	300684	中石科技	12,700	272,923.00	0.10
332	300378	鼎捷软件	12,800	272,768.00	0.10
333	300100	双林股份	26,100	272,223.00	0.10
334	603040	新坐标	10,400	271,960.00	0.10
335	300228	富瑞特装	38,300	271,930.00	0.10
336	603516	淳中科技	12,100	271,887.00	0.10
337	600537	亿晶光电	49,300	271,643.00	0.10
338	300063	天龙集团	38,900	271,133.00	0.10
339	600371	万向德农	25,200	270,396.00	0.10
340	603200	上海洗霸	12,700	270,383.00	0.10
341	300988	津荣天宇	12,700	270,256.00	0.10
342	603130	云中马	12,500	269,375.00	0.10
343	688468	科美诊断	24,961	269,329.19	0.10
344	600769	祥龙电业	25,600	269,312.00	0.10
345	300480	光力科技	12,600	269,010.00	0.10
346	300485	赛升药业	25,400	268,986.00	0.10
347	603551	奥普家居	25,400	268,986.00	0.10
348	600152	维科技术	36,800	267,904.00	0.10
349	300351	永贵电器	12,900	267,288.00	0.10
350	002491	通鼎互联	51,000	267,240.00	0.10
351	300328	宜安科技	38,300	266,568.00	0.10
352	002169	智光电气	38,700	266,256.00	0.10
353	603527	众源新材	24,600	265,926.00	0.10
354	603818	曲美家居	49,200	265,680.00	0.10
355	300829	金丹科技	12,700	265,176.00	0.10
356	002017	东信和平	25,400	264,414.00	0.10
357	002345	潮宏基	38,800	264,228.00	0.10
358	300007	汉威科技	12,700	263,906.00	0.10
359	600189	泉阳泉	25,200	263,592.00	0.10
360	603811	诚意药业	25,400	263,398.00	0.10
361	002803	吉宏股份	12,800	263,168.00	0.10
362	600758	辽宁能源	72,600	262,812.00	0.10
363	300246	宝莱特	25,500	262,650.00	0.10
364	601500	通用股份	63,400	262,476.00	0.10
365	300231	银信科技	25,500	262,395.00	0.10
366	603655	朗博科技	12,600	262,332.00	0.10
367	301519	舜禹股份	12,700	262,128.00	0.10
368	300105	龙源技术	38,600	262,094.00	0.10

369	300304	云意电气	38,600	262,094.00	0.10
370	600830	香溢融通	36,700	261,671.00	0.10
371	600979	广安爱众	75,600	261,576.00	0.10
372	601388	怡球资源	99,600	260,952.00	0.10
373	603889	新澳股份	36,640	260,876.80	0.10
374	002824	和胜股份	12,680	260,827.60	0.10
375	300317	珈伟新能	51,200	260,608.00	0.10
376	603360	百傲化学	24,600	260,022.00	0.10
377	300523	辰安科技	12,800	259,840.00	0.10
378	603601	再升科技	60,400	259,720.00	0.10
379	600644	乐山电力	37,300	259,608.00	0.10
380	000790	华神科技	51,300	259,578.00	0.10
381	300444	双杰电气	38,400	258,816.00	0.10
382	600794	保税科技	63,400	258,672.00	0.10
383	301185	鸥玛软件	12,700	258,572.00	0.10
384	002164	宁波东力	38,300	258,525.00	0.10
385	603313	梦百合	24,600	258,300.00	0.10
386	002886	沃特股份	12,600	258,174.00	0.10
387	603399	吉翔股份	25,200	257,796.00	0.10
388	300048	合康新能	50,900	257,554.00	0.10
389	301012	扬电科技	12,700	256,540.00	0.10
390	002584	西陇科学	26,200	256,498.00	0.10
391	300278	华昌达	67,100	256,322.00	0.10
392	301339	通行宝	12,700	256,286.00	0.10
393	603067	振华股份	25,100	255,769.00	0.10
394	002765	蓝黛科技	38,100	255,651.00	0.10
395	600573	惠泉啤酒	24,600	255,348.00	0.10
396	601177	杭齿前进	24,600	255,102.00	0.10
397	600693	东百集团	63,600	255,036.00	0.10
398	002869	金溢科技	12,600	255,024.00	0.10
399	300840	酷特智能	12,800	254,848.00	0.10
400	000541	佛山照明	38,300	254,695.00	0.10
401	300041	回天新材	25,400	254,508.00	0.10
402	603676	卫信康	24,400	254,492.00	0.10
403	600379	宝光股份	25,300	254,265.00	0.10
404	603017	中衡设计	25,400	254,254.00	0.10
405	605368	蓝天燃气	23,600	254,172.00	0.10
406	603280	南方路机	9,500	254,030.00	0.10
407	600880	博瑞传播	50,700	254,007.00	0.10
408	300622	博士眼镜	12,800	253,824.00	0.10
409	600121	郑州煤电	62,500	253,750.00	0.10

410	300903	科翔股份	25,200	253,512.00	0.10
411	601968	宝钢包装	49,300	252,909.00	0.10
412	301187	欧圣电气	12,700	252,857.00	0.10
413	600851	海欣股份	36,800	252,816.00	0.10
414	603518	锦泓集团	25,200	252,504.00	0.10
415	002073	软控股份	38,400	252,288.00	0.10
416	003029	吉大正元	12,800	252,288.00	0.10
417	002474	榕基软件	38,300	252,014.00	0.10
418	300402	宝色股份	12,700	251,968.00	0.10
419	603096	新经典	12,800	251,904.00	0.10
420	300538	同益股份	12,600	251,874.00	0.10
421	002655	共达电声	18,600	251,658.00	0.10
422	300581	晨曦航空	25,600	251,648.00	0.10
423	301317	鑫磊股份	12,800	251,648.00	0.10
424	603855	华荣股份	12,600	251,496.00	0.10
425	300690	双一科技	13,400	251,384.00	0.10
426	300291	百纳千成	39,000	251,160.00	0.10
427	301303	真兰仪表	12,700	250,063.00	0.10
428	002858	力盛体育	13,100	248,900.00	0.09
429	603916	苏博特	24,400	248,636.00	0.09
430	601700	风范股份	49,600	248,496.00	0.09
431	605299	舒华体育	25,100	248,490.00	0.09
432	603126	中材节能	36,800	248,032.00	0.09
433	300479	神思电子	12,600	247,968.00	0.09
434	603648	畅联股份	25,400	247,904.00	0.09
435	688119	中钢洛耐	50,800	247,904.00	0.09
436	301292	海科新源	12,700	247,650.00	0.09
437	002167	东方锆业	38,500	247,555.00	0.09
438	002329	皇氏集团	38,200	247,536.00	0.09
439	600774	汉商集团	25,100	247,486.00	0.09
440	300647	超频三	38,500	247,170.00	0.09
441	002082	万邦德	38,600	247,040.00	0.09
442	603223	恒通股份	25,000	246,750.00	0.09
443	002476	宝莫股份	38,400	246,528.00	0.09
444	603336	宏辉果蔬	48,240	246,506.40	0.09
445	002930	宏川智慧	12,700	246,253.00	0.09
446	603015	弘讯科技	25,200	245,952.00	0.09
447	002406	远东传动	38,500	245,630.00	0.09
448	300248	新开普	25,600	245,504.00	0.09
449	301102	兆讯传媒	12,825	245,470.50	0.09
450	300858	科拓生物	12,700	245,110.00	0.09

451	600327	大东方	48,800	244,976.00	0.09
452	600713	南京医药	50,600	244,904.00	0.09
453	000836	富通信息	91,200	244,416.00	0.09
454	300681	英搏尔	12,680	244,343.60	0.09
455	301389	隆扬电子	12,800	244,224.00	0.09
456	600358	国旅联合	46,600	244,184.00	0.09
457	002957	科瑞技术	12,700	243,967.00	0.09
458	300307	慈星股份	38,000	243,960.00	0.09
459	300933	中辰股份	25,800	243,810.00	0.09
460	603778	国晟科技	43,700	242,972.00	0.09
461	300802	矩子科技	12,700	242,824.00	0.09
462	603861	白云电器	24,800	242,544.00	0.09
463	605377	华旺科技	12,700	242,443.00	0.09
464	603823	百合花	24,600	242,064.00	0.09
465	601199	江南水务	48,800	242,048.00	0.09
466	300025	华星创业	25,200	241,668.00	0.09
467	601226	华电重工	36,700	241,486.00	0.09
468	300718	长盛轴承	13,000	241,150.00	0.09
469	603538	美诺华	12,600	240,912.00	0.09
470	002388	新亚制程	38,300	240,907.00	0.09
471	603611	诺力股份	12,700	240,411.00	0.09
472	605151	西上海	12,600	240,408.00	0.09
473	688221	前沿生物	24,225	240,312.00	0.09
474	603618	杭电股份	37,500	240,000.00	0.09
475	300503	昊志机电	12,900	239,553.00	0.09
476	600846	同济科技	25,700	239,010.00	0.09
477	301197	工大科雅	12,700	238,633.00	0.09
478	600736	苏州高新	50,100	238,476.00	0.09
479	300707	威唐工业	12,800	237,952.00	0.09
480	002263	大东南	94,400	237,888.00	0.09
481	300310	宜通世纪	53,800	237,796.00	0.09
482	603035	常熟汽饰	12,600	237,762.00	0.09
483	603918	金桥信息	12,700	237,490.00	0.09
484	000701	厦门信达	38,600	237,390.00	0.09
485	300566	激智科技	12,700	237,236.00	0.09
486	600310	广西能源	63,200	236,368.00	0.09
487	002878	元隆雅图	12,700	236,347.00	0.09
488	603697	有友食品	25,400	236,220.00	0.09
489	000409	云鼎科技	25,500	236,130.00	0.09
490	300680	隆盛科技	12,600	235,620.00	0.09
491	605060	联德股份	12,600	235,620.00	0.09

492	002849	威星智能	12,600	235,116.00	0.09
493	603869	新智认知	24,900	235,056.00	0.09
494	603421	鼎信通讯	25,000	235,000.00	0.09
495	600784	鲁银投资	38,200	234,930.00	0.09
496	301320	豪江智能	12,700	234,569.00	0.09
497	000040	东旭蓝天	63,500	233,680.00	0.09
498	002935	天奥电子	12,800	233,472.00	0.09
499	300420	五洋停车	76,800	233,472.00	0.09
500	605066	天正电气	25,400	233,172.00	0.09
501	603808	歌力思	25,400	232,918.00	0.09
502	600868	梅雁吉祥	91,300	232,815.00	0.09
503	605208	永茂泰	24,500	232,750.00	0.09
504	603558	健盛集团	24,000	232,560.00	0.09
505	002148	北纬科技	38,500	232,540.00	0.09
506	300504	天邑股份	12,700	232,283.00	0.09
507	600965	福成股份	36,800	232,208.00	0.09
508	603619	中曼石油	12,500	231,500.00	0.09
509	603136	天目湖	12,600	231,462.00	0.09
510	300572	安车检测	12,800	231,296.00	0.09
511	603668	天马科技	12,600	231,084.00	0.09
512	300645	正元智慧	12,700	231,013.00	0.09
513	601616	广电电气	63,600	230,868.00	0.09
514	301082	久盛电气	12,700	230,505.00	0.09
515	002401	中远海科	12,700	230,124.00	0.09
516	002885	京泉华	12,700	230,124.00	0.09
517	300404	博济医药	25,700	230,015.00	0.09
518	601595	上海电影	8,900	229,887.00	0.09
519	002728	特一药业	12,800	229,376.00	0.09
520	603886	元祖股份	12,575	229,242.25	0.09
521	301305	朗坤环境	12,700	229,235.00	0.09
522	002210	飞马国际	128,000	229,120.00	0.09
523	300510	金冠股份	38,300	228,651.00	0.09
524	600354	敦煌种业	38,100	228,600.00	0.09
525	300987	川网传媒	12,900	228,588.00	0.09
526	600336	澳柯玛	37,900	228,537.00	0.09
527	300560	中富通	12,900	228,459.00	0.09
528	688459	哈铁科技	24,400	228,384.00	0.09
529	600980	北矿科技	12,900	228,201.00	0.09
530	000957	中通客车	25,400	228,092.00	0.09
531	600684	珠江股份	65,700	227,979.00	0.09
532	600220	江苏阳光	114,500	227,855.00	0.09

533	002835	同为股份	12,700	227,838.00	0.09
534	300616	尚品宅配	12,700	227,584.00	0.09
535	300729	乐歌股份	12,700	227,457.00	0.09
536	300415	伊之密	12,900	227,427.00	0.09
537	301188	力诺特玻	12,700	227,203.00	0.09
538	002150	通润装备	12,800	227,072.00	0.09
539	300578	会畅通讯	12,700	226,822.00	0.09
540	000011	深物业 A	25,600	226,816.00	0.09
541	002636	金安国纪	25,400	226,314.00	0.09
542	603206	嘉环科技	12,700	226,187.00	0.09
543	603050	科林电气	12,600	226,170.00	0.09
544	603357	设计总院	25,400	226,060.00	0.09
545	601518	吉林高速	88,600	225,930.00	0.09
546	300642	透景生命	12,800	225,920.00	0.09
547	002577	雷柏科技	12,800	225,664.00	0.09
548	002514	宝馨科技	25,700	225,646.00	0.09
549	002323	雅博股份	92,800	225,504.00	0.09
550	600094	大名城	75,100	225,300.00	0.09
551	002833	弘亚数控	12,700	225,298.00	0.09
552	000099	中信海直	25,600	225,280.00	0.09
553	603897	长城科技	11,000	225,280.00	0.09
554	002708	光洋股份	27,200	225,216.00	0.09
555	300403	汉宇集团	25,400	224,790.00	0.09
556	600798	宁波海运	61,400	224,724.00	0.09
557	603069	海汽集团	12,200	224,480.00	0.09
558	002822	ST 中装	51,200	224,256.00	0.09
559	605162	新中港	24,400	224,236.00	0.09
560	002580	圣阳股份	25,800	223,686.00	0.09
561	002845	同兴达	12,600	223,650.00	0.09
562	301248	杰创智能	12,700	223,647.00	0.09
563	300200	高盟新材	25,300	223,399.00	0.08
564	603058	永吉股份	24,600	223,122.00	0.08
565	600807	济南高新	63,500	222,885.00	0.08
566	300958	建工修复	12,800	222,592.00	0.08
567	603217	元利科技	12,200	222,528.00	0.08
568	603912	佳力图	25,200	222,516.00	0.08
569	300194	福安药业	50,800	222,504.00	0.08
570	300410	正业科技	25,300	222,387.00	0.08
571	300975	商络电子	26,800	221,636.00	0.08
572	300481	濮阳惠成	12,700	221,615.00	0.08
573	603319	湘油泵	12,600	221,004.00	0.08

574	000042	中洲控股	38,500	220,990.00	0.08
575	300551	古鳌科技	12,700	220,980.00	0.08
576	600505	西昌电力	26,000	220,740.00	0.08
577	300608	思特奇	13,000	220,350.00	0.08
578	603917	合力科技	12,400	220,224.00	0.08
579	300879	大叶股份	12,700	219,964.00	0.08
580	300127	银河磁体	12,700	219,837.00	0.08
581	002337	赛象科技	38,700	219,816.00	0.08
582	300299	富春股份	38,000	219,260.00	0.08
583	600251	冠农股份	25,200	218,988.00	0.08
584	603138	海量数据	12,300	218,940.00	0.08
585	603528	多伦科技	24,100	218,828.00	0.08
586	300389	艾比森	12,600	218,484.00	0.08
587	603215	比依股份	12,600	217,980.00	0.08
588	300667	必创科技	12,700	217,932.00	0.08
589	600853	龙建股份	51,000	217,770.00	0.08
590	000510	新金路	38,400	217,728.00	0.08
591	002300	太阳电缆	25,600	217,600.00	0.08
592	002548	金新农	38,582	217,216.66	0.08
593	002117	东港股份	25,400	217,170.00	0.08
594	300518	新讯达	12,700	216,916.00	0.08
595	600215	派斯林	25,400	216,916.00	0.08
596	300817	双飞集团	12,800	216,704.00	0.08
597	300922	天秦装备	12,695	216,703.65	0.08
598	002575	群兴玩具	38,400	216,576.00	0.08
599	600826	兰生股份	24,400	215,696.00	0.08
600	300547	川环科技	12,800	215,680.00	0.08
601	300700	岱勒新材	12,700	215,519.00	0.08
602	002232	启明信息	12,700	215,265.00	0.08
603	603378	亚士创能	25,400	214,884.00	0.08
604	300019	硅宝科技	13,000	214,630.00	0.08
605	603836	海程邦达	12,100	214,533.00	0.08
606	300740	水羊股份	12,800	213,376.00	0.08
607	000561	烽火电子	25,400	213,360.00	0.08
608	002045	国光电器	12,800	213,120.00	0.08
609	002827	高争民爆	12,700	212,725.00	0.08
610	300505	川金诺	12,700	212,725.00	0.08
611	300519	新光药业	12,800	212,096.00	0.08
612	603689	皖天然气	24,400	212,036.00	0.08
613	300787	海能实业	12,600	211,932.00	0.08
614	300532	今天国际	12,900	211,818.00	0.08

615	300375	鹏翎股份	38,300	211,799.00	0.08
616	300320	海达股份	27,200	211,616.00	0.08
617	603398	沐邦高科	11,800	211,338.00	0.08
618	603256	宏和科技	25,400	211,328.00	0.08
619	603429	集友股份	25,400	211,328.00	0.08
620	002962	五方光电	9,000	211,230.00	0.08
621	002664	信质集团	12,700	211,201.00	0.08
622	000506	中润资源	51,100	211,043.00	0.08
623	300095	华伍股份	25,600	210,688.00	0.08
624	002989	中天精装	12,900	210,528.00	0.08
625	600101	明星电力	25,000	210,250.00	0.08
626	300174	元力股份	13,100	209,731.00	0.08
627	002792	通宇通讯	12,500	209,500.00	0.08
628	300288	朗玛信息	12,700	208,915.00	0.08
629	600113	浙江东日	25,400	208,788.00	0.08
630	002296	辉煌科技	25,300	208,725.00	0.08
631	000713	丰乐种业	27,200	208,624.00	0.08
632	603109	神驰机电	12,700	208,534.00	0.08
633	600071	凤凰光学	9,100	208,481.00	0.08
634	603209	兴通股份	12,780	208,186.20	0.08
635	301263	泰恩康	12,700	207,391.00	0.08
636	300162	雷曼光电	25,600	207,360.00	0.08
637	300867	圣元环保	13,000	207,350.00	0.08
638	300337	银邦股份	25,600	207,104.00	0.08
639	002248	华东数控	25,400	207,010.00	0.08
640	300790	宇瞳光学	12,700	206,629.00	0.08
641	002915	中欣氟材	11,300	206,338.00	0.08
642	603135	中重科技	12,600	206,136.00	0.08
643	603214	爱婴室	12,600	206,136.00	0.08
644	600992	贵绳股份	12,800	206,080.00	0.08
645	300217	东方电热	38,300	206,054.00	0.08
646	301158	德石股份	12,800	205,952.00	0.08
647	002057	中钢天源	25,600	205,824.00	0.08
648	300756	金马游乐	12,700	205,740.00	0.08
649	002033	丽江股份	25,400	205,486.00	0.08
650	300586	美联新材	25,400	205,486.00	0.08
651	300514	友讯达	12,600	205,380.00	0.08
652	300400	劲拓股份	12,600	205,254.00	0.08
653	002879	长缆科技	12,800	205,056.00	0.08
654	002238	天威视讯	13,200	204,996.00	0.08
655	000859	国风新材	38,600	204,966.00	0.08

656	300950	德固特	12,700	204,851.00	0.08
657	300172	中电环保	38,100	204,597.00	0.08
658	300796	贝斯美	12,700	204,470.00	0.08
659	002892	科力尔	12,700	204,343.00	0.08
660	603701	德宏股份	13,000	203,970.00	0.08
661	002805	丰元股份	12,700	202,946.00	0.08
662	301285	鸿日达	12,700	202,946.00	0.08
663	301013	利和兴	12,800	202,880.00	0.08
664	002149	西部材料	12,900	202,788.00	0.08
665	600738	丽尚国潮	38,100	202,692.00	0.08
666	002141	贤丰控股	64,100	202,556.00	0.08
667	002606	大连电瓷	25,600	202,240.00	0.08
668	600831	广电网络	38,500	201,740.00	0.08
669	603628	清源股份	9,600	201,600.00	0.08
670	002166	莱茵生物	25,900	201,243.00	0.08
671	603329	上海雅仕	12,600	200,844.00	0.08
672	300615	欣天科技	12,700	200,787.00	0.08
673	600982	宁波能源	49,000	200,410.00	0.08
674	300546	雄帝科技	12,700	200,279.00	0.08
675	300828	锐新科技	12,800	200,192.00	0.08
676	300559	佳发教育	12,900	199,950.00	0.08
677	300381	溢多利	27,100	199,727.00	0.08
678	603639	海利尔	12,700	199,390.00	0.08
679	002907	华森制药	12,900	199,305.00	0.08
680	601188	龙江交通	49,400	199,082.00	0.08
681	300446	航天智造	12,700	199,009.00	0.08
682	300607	拓斯达	12,700	199,009.00	0.08
683	300193	佳士科技	25,600	198,912.00	0.08
684	605300	佳禾食品	12,700	198,882.00	0.08
685	300962	中金辐照	12,800	198,656.00	0.08
686	002757	南兴股份	12,700	198,628.00	0.08
687	002198	嘉应制药	27,100	197,288.00	0.08
688	002722	物产金轮	12,800	197,248.00	0.08
689	001299	美能能源	12,700	197,231.00	0.08
690	605138	盛泰集团	25,400	196,850.00	0.07
691	603848	好太太	12,700	196,596.00	0.07
692	603289	泰瑞机器	17,800	196,512.00	0.07
693	603933	睿能科技	12,600	195,930.00	0.07
694	002184	海得控制	12,800	195,840.00	0.07
695	605167	利柏特	20,600	195,494.00	0.07
696	603239	浙江仙通	12,800	195,456.00	0.07

697	300541	先进数通	12,700	195,453.00	0.07
698	300342	天银机电	12,700	195,199.00	0.07
699	600854	春兰股份	37,000	194,990.00	0.07
700	000812	陕西金叶	38,500	194,810.00	0.07
701	300531	优博讯	12,700	194,691.00	0.07
702	003002	壶化股份	12,800	194,432.00	0.07
703	002376	新北洋	25,500	194,310.00	0.07
704	603630	拉芳家化	12,700	194,310.00	0.07
705	002104	恒宝股份	25,300	194,304.00	0.07
706	603191	望变电气	12,500	194,125.00	0.07
707	600819	耀皮玻璃	38,100	193,929.00	0.07
708	603767	中马传动	12,600	193,914.00	0.07
709	300314	戴维医疗	12,800	193,792.00	0.07
710	603970	中农立华	12,600	193,536.00	0.07
711	600629	华建集团	37,500	193,500.00	0.07
712	301088	戎美股份	12,700	193,421.00	0.07
713	600613	神奇制药	25,400	193,294.00	0.07
714	605196	华通线缆	25,100	193,270.00	0.07
715	300739	明阳电路	12,600	192,906.00	0.07
716	601999	出版传媒	25,900	192,696.00	0.07
717	300721	怡达股份	12,900	192,597.00	0.07
718	600686	金龙汽车	25,400	192,278.00	0.07
719	000417	合肥百货	38,500	192,115.00	0.07
720	603182	嘉华股份	13,000	192,010.00	0.07
721	002882	金龙羽	12,800	192,000.00	0.07
722	002009	天奇股份	12,700	191,643.00	0.07
723	000948	南天信息	12,700	191,389.00	0.07
724	000797	中国武夷	64,000	191,360.00	0.07
725	002093	国脉科技	25,400	191,008.00	0.07
726	002733	雄韬股份	12,700	191,008.00	0.07
727	600785	新华百货	12,900	190,920.00	0.07
728	002454	松芝股份	25,400	190,754.00	0.07
729	603230	内蒙新华	12,300	190,650.00	0.07
730	300605	恒锋信息	12,700	190,119.00	0.07
731	603318	水发燃气	25,200	189,756.00	0.07
732	600665	天地源	50,100	189,378.00	0.07
733	000680	山推股份	38,300	189,202.00	0.07
734	000700	模塑科技	27,000	189,000.00	0.07
735	605336	帅丰电器	12,700	188,976.00	0.07
736	002175	东方智造	67,800	188,484.00	0.07
737	600359	新农开发	25,400	188,214.00	0.07

738	002922	伊戈尔	12,674	188,208.90	0.07
739	600814	杭州解百	27,000	187,920.00	0.07
740	603950	长源东谷	12,200	187,880.00	0.07
741	000777	中核科技	12,900	187,566.00	0.07
742	603151	邦基科技	12,400	187,116.00	0.07
743	300447	全信股份	12,900	187,050.00	0.07
744	002526	山东矿机	64,400	186,760.00	0.07
745	300994	久祺股份	12,700	186,690.00	0.07
746	300500	启迪设计	13,000	186,290.00	0.07
747	003032	传智教育	12,900	185,760.00	0.07
748	603602	纵横通信	12,600	185,724.00	0.07
749	301439	泓淋电力	12,700	185,674.00	0.07
750	300815	玉禾田	12,700	185,420.00	0.07
751	300943	春晖智控	12,900	184,986.00	0.07
752	605199	葫芦娃	12,200	184,952.00	0.07
753	300501	海顺新材	12,800	184,704.00	0.07
754	603009	北特科技	12,400	183,892.00	0.07
755	002196	方正电机	25,600	183,808.00	0.07
756	600706	曲江文旅	12,400	183,768.00	0.07
757	002350	北京科锐	27,200	183,600.00	0.07
758	600560	金白天正	12,400	183,520.00	0.07
759	300240	飞力达	27,200	183,328.00	0.07
760	002462	嘉事堂	12,900	183,309.00	0.07
761	000788	北大医药	27,300	183,183.00	0.07
762	300430	诚益通	12,800	182,912.00	0.07
763	300967	晓鸣股份	12,800	182,784.00	0.07
764	600229	城市传媒	24,200	182,710.00	0.07
765	300435	中泰股份	12,700	182,626.00	0.07
766	000633	合金投资	25,700	182,470.00	0.07
767	300452	山河药辅	12,800	182,272.00	0.07
768	300499	高澜股份	12,700	182,118.00	0.07
769	002638	勤上股份	67,000	181,570.00	0.07
770	300650	太龙股份	12,600	181,566.00	0.07
771	002676	顺威股份	38,300	181,542.00	0.07
772	002908	德生科技	12,700	181,102.00	0.07
773	600894	广日股份	24,600	180,810.00	0.07
774	605277	新亚电子	12,100	180,774.00	0.07
775	300164	通源石油	37,800	180,306.00	0.07
776	300806	斯迪克	12,800	180,096.00	0.07
777	000631	顺发恒业	54,200	179,944.00	0.07
778	603698	航天工程	12,500	179,625.00	0.07

779	300945	曼卡龙	12,700	179,451.00	0.07
780	600178	东安动力	12,100	179,443.00	0.07
781	605179	一鸣食品	12,100	179,080.00	0.07
782	300589	江龙船艇	12,900	179,052.00	0.07
783	002949	华阳国际	12,800	178,816.00	0.07
784	002213	大为股份	12,700	178,689.00	0.07
785	002418	康盛股份	64,000	178,560.00	0.07
786	603578	三星新材	12,500	178,375.00	0.07
787	002536	飞龙股份	12,800	178,048.00	0.07
788	600526	菲达环保	35,900	177,346.00	0.07
789	600683	京投发展	37,100	177,338.00	0.07
790	300486	东杰智能	25,600	176,896.00	0.07
791	002137	实益达	25,400	176,276.00	0.07
792	600108	亚盛集团	63,400	176,252.00	0.07
793	300360	炬华科技	12,900	176,214.00	0.07
794	300399	天利科技	12,700	175,768.00	0.07
795	300978	东箭科技	12,800	175,744.00	0.07
796	603227	雪峰科技	25,400	175,260.00	0.07
797	600053	九鼎投资	12,400	175,212.00	0.07
798	000822	山东海化	25,600	175,104.00	0.07
799	002900	哈三联	12,800	174,720.00	0.07
800	300138	晨光生物	13,000	174,590.00	0.07
801	002379	宏创控股	38,400	174,336.00	0.07
802	300673	佩蒂股份	13,100	174,230.00	0.07
803	600860	京城股份	13,000	174,070.00	0.07
804	002272	川润股份	25,400	173,736.00	0.07
805	600523	贵航股份	12,600	173,502.00	0.07
806	605337	李子园	12,310	173,447.90	0.07
807	002449	国星光电	18,300	173,301.00	0.07
808	300507	苏奥传感	25,600	173,056.00	0.07
809	300730	科创信息	12,700	172,720.00	0.07
810	300778	新城市	12,700	172,720.00	0.07
811	300238	冠昊生物	12,700	172,212.00	0.07
812	300092	科新机电	12,900	171,828.00	0.07
813	603081	大丰实业	12,600	171,612.00	0.07
814	300522	世名科技	12,700	171,450.00	0.07
815	002703	浙江世宝	12,800	171,008.00	0.07
816	603219	富佳股份	12,600	170,856.00	0.06
817	002599	盛通股份	25,600	170,752.00	0.06
818	603777	来伊份	12,700	170,434.00	0.06
819	002290	禾盛新材	13,100	170,431.00	0.06

820	002132	恒星科技	54,400	170,272.00	0.06
821	300239	东宝生物	27,300	170,079.00	0.06
822	002119	康强电子	12,700	169,799.00	0.06
823	600230	沧州大化	12,600	169,722.00	0.06
824	002343	慈文传媒	25,900	169,386.00	0.06
825	002448	中原内配	25,400	168,656.00	0.06
826	603003	龙宇股份	12,200	168,482.00	0.06
827	301215	中汽股份	27,300	168,441.00	0.06
828	603232	格尔软件	12,300	168,387.00	0.06
829	603002	宏昌电子	26,800	168,304.00	0.06
830	603065	宿迁联盛	12,200	168,116.00	0.06
831	300272	开能健康	27,100	168,020.00	0.06
832	301116	益客食品	13,100	167,942.00	0.06
833	002540	亚太科技	25,400	167,894.00	0.06
834	300424	航新科技	12,800	167,680.00	0.06
835	300542	新晨科技	12,800	167,680.00	0.06
836	002953	日丰股份	13,200	167,640.00	0.06
837	300884	狄耐克	12,800	167,424.00	0.06
838	002860	星帅尔	12,900	167,055.00	0.06
839	300711	广哈通信	12,500	166,875.00	0.06
840	000852	石化机械	27,100	166,665.00	0.06
841	300963	中洲特材	12,700	166,624.00	0.06
842	002358	森源电气	38,300	166,605.00	0.06
843	000534	万泽股份	12,700	166,243.00	0.06
844	000159	国际实业	25,600	166,144.00	0.06
845	601133	柏诚股份	12,600	165,942.00	0.06
846	002308	威创股份	51,100	165,564.00	0.06
847	600367	红星发展	12,900	165,378.00	0.06
848	300258	精锻科技	12,800	165,376.00	0.06
849	002735	王子新材	12,700	165,100.00	0.06
850	000862	银星能源	27,100	165,039.00	0.06
851	688373	盟科药业	25,200	164,556.00	0.06
852	301136	招标股份	13,000	164,450.00	0.06
853	002538	司尔特	27,200	164,288.00	0.06
854	300697	电工合金	12,700	164,084.00	0.06
855	603990	麦迪科技	12,700	164,084.00	0.06
856	600658	电子城	36,700	164,049.00	0.06
857	002322	理工能科	12,800	163,840.00	0.06
858	300986	志特新材	12,800	162,944.00	0.06
859	002923	润都股份	13,200	162,888.00	0.06
860	002682	龙洲股份	18,400	162,104.00	0.06

861	603708	家家悦	12,400	162,068.00	0.06
862	603817	海峡环保	25,400	162,052.00	0.06
863	300484	蓝海华腾	12,800	161,664.00	0.06
864	300797	钢研纳克	12,600	161,658.00	0.06
865	300632	光莆股份	12,800	161,536.00	0.06
866	002823	凯中精密	12,700	161,290.00	0.06
867	301059	金三江	13,300	161,196.00	0.06
868	000965	天保基建	51,400	160,882.00	0.06
869	000926	福星股份	38,500	160,545.00	0.06
870	300061	旗天科技	27,300	159,978.00	0.06
871	002435	长江健康	38,300	159,711.00	0.06
872	603377	东方时尚	37,800	159,138.00	0.06
873	603519	立霸股份	12,200	159,088.00	0.06
874	002968	新大正	12,700	158,877.00	0.06
875	301149	隆华新材	12,800	158,336.00	0.06
876	002818	富森美	12,700	158,242.00	0.06
877	002873	新天药业	12,700	158,242.00	0.06
878	300643	万通智控	12,700	158,242.00	0.06
879	600300	维维股份	50,800	157,988.00	0.06
880	002420	毅昌科技	25,300	157,872.00	0.06
881	002679	福建金森	12,800	157,824.00	0.06
882	300539	横河精密	12,700	157,607.00	0.06
883	600283	钱江水利	12,500	157,375.00	0.06
884	000962	东方钨业	12,700	157,353.00	0.06
885	603569	长久物流	12,700	157,353.00	0.06
886	600301	华锡有色	12,500	157,250.00	0.06
887	600512	腾达建设	63,400	157,232.00	0.06
888	603176	汇通集团	25,400	156,972.00	0.06
889	000589	贵州轮胎	25,600	156,672.00	0.06
890	000892	欢瑞世纪	38,200	156,238.00	0.06
891	002553	南方精工	12,800	156,160.00	0.06
892	603366	日出东方	25,000	155,750.00	0.06
893	300460	惠伦晶体	12,700	155,702.00	0.06
894	002107	沃华医药	25,600	155,392.00	0.06
895	003000	劲仔食品	12,700	155,194.00	0.06
896	301332	德尔玛	12,700	155,194.00	0.06
897	603787	新日股份	12,400	155,124.00	0.06
898	300145	中金环境	51,300	154,926.00	0.06
899	000521	长虹美菱	27,500	154,825.00	0.06
900	300306	远方信息	12,700	153,416.00	0.06
901	603165	荣晟环保	12,800	153,344.00	0.06

902	301198	喜悦智行	12,600	152,964.00	0.06
903	300733	西菱动力	12,700	152,908.00	0.06
904	603711	香飘飘	8,900	152,546.00	0.06
905	300582	英飞特	12,700	152,527.00	0.06
906	000863	三湘印象	38,600	152,470.00	0.06
907	000532	华金资本	12,700	152,273.00	0.06
908	002264	新华都	27,600	152,076.00	0.06
909	600962	国投中鲁	12,600	151,830.00	0.06
910	002799	环球印务	12,700	151,638.00	0.06
911	605228	神通科技	12,800	151,168.00	0.06
912	002419	天虹股份	27,300	150,969.00	0.06
913	300513	恒实科技	12,700	150,876.00	0.06
914	300483	首华燃气	12,700	150,749.00	0.06
915	003015	日久光电	12,800	150,528.00	0.06
916	002669	康达新材	12,600	150,192.00	0.06
917	300359	全通教育	27,300	150,150.00	0.06
918	000803	山高环能	25,836	150,107.16	0.06
919	000045	深纺织 A	12,700	149,860.00	0.06
920	300341	麦克奥迪	12,700	149,860.00	0.06
921	300439	美康生物	12,900	149,769.00	0.06
922	301120	新特电气	12,900	149,511.00	0.06
923	600469	风神股份	24,200	149,314.00	0.06
924	300515	三德科技	12,900	148,866.00	0.06
925	300561	汇金科技	12,600	148,680.00	0.06
926	603339	四方科技	12,500	148,625.00	0.06
927	000570	苏常柴 A	25,800	148,608.00	0.06
928	600228	返利科技	19,000	148,200.00	0.06
929	002186	全聚德	12,700	148,082.00	0.06
930	600833	第一医药	12,300	147,846.00	0.06
931	002766	索菱股份	27,100	147,695.00	0.06
932	300275	梅安森	12,800	147,584.00	0.06
933	003037	三和管桩	13,200	147,576.00	0.06
934	603177	德创环保	12,400	146,568.00	0.06
935	603856	东宏股份	12,500	145,875.00	0.06
936	000530	冰山冷热	27,300	145,782.00	0.06
937	000411	英特集团	13,000	145,730.00	0.06
938	002712	思美传媒	25,600	145,408.00	0.06
939	605118	力鼎光电	6,000	145,140.00	0.06
940	002590	万安科技	12,700	144,399.00	0.05
941	301058	中粮科工	13,200	144,276.00	0.05
942	002725	跃岭股份	12,900	144,222.00	0.05

943	301025	读客文化	12,700	144,145.00	0.05
944	002346	柘中股份	12,900	143,835.00	0.05
945	002515	金字火腿	25,400	143,256.00	0.05
946	300654	世纪天鸿	12,700	143,256.00	0.05
947	002667	威领股份	12,700	143,129.00	0.05
948	300610	晨化股份	12,700	143,129.00	0.05
949	002170	芭田股份	25,600	142,080.00	0.05
950	003025	思进智能	10,500	141,855.00	0.05
951	002066	瑞泰科技	12,700	141,097.00	0.05
952	002386	天原股份	27,300	140,868.00	0.05
953	002731	萃华珠宝	12,700	140,462.00	0.05
954	300434	金石亚药	12,700	140,462.00	0.05
955	600081	东风科技	12,500	140,375.00	0.05
956	300426	唐德影视	12,700	140,081.00	0.05
957	000014	沙河股份	12,700	139,827.00	0.05
958	300543	朗科智能	12,800	139,776.00	0.05
959	002852	道道全	12,900	139,578.00	0.05
960	301127	天源环保	12,700	139,573.00	0.05
961	601065	江盐集团	12,200	139,568.00	0.05
962	002846	英联股份	12,700	139,065.00	0.05
963	002478	常宝股份	25,500	138,975.00	0.05
964	002996	顺博合金	12,700	138,684.00	0.05
965	301062	上海艾录	12,800	138,496.00	0.05
966	300636	同和药业	13,100	138,074.00	0.05
967	300771	智莱科技	12,700	138,049.00	0.05
968	300247	融捷健康	38,500	137,060.00	0.05
969	601116	三江购物	12,600	136,836.00	0.05
970	603663	三祥新材	12,380	136,056.20	0.05
971	301296	新巨丰	13,200	135,960.00	0.05
972	603213	镇洋发展	12,600	135,954.00	0.05
973	601579	会稽山	12,600	135,324.00	0.05
974	301048	金鹰重工	12,800	134,912.00	0.05
975	600661	昂立教育	12,600	134,820.00	0.05
976	000551	创元科技	12,800	134,016.00	0.05
977	001267	汇绿生态	25,600	133,888.00	0.05
978	300918	南山智尚	12,900	133,257.00	0.05
979	300071	福石控股	38,500	133,210.00	0.05
980	002112	三变科技	12,700	133,096.00	0.05
981	002695	煌上煌	12,700	132,969.00	0.05
982	002790	瑞尔特	12,700	132,588.00	0.05
983	000922	佳电股份	12,900	132,483.00	0.05

984	600636	国新文化	12,500	131,750.00	0.05
985	300774	倍杰特	12,800	131,712.00	0.05
986	301265	华新环保	12,822	131,425.50	0.05
987	600753	庚星股份	12,600	131,292.00	0.05
988	002116	中国海诚	12,700	130,683.00	0.05
989	600822	上海物贸	12,900	130,677.00	0.05
990	603311	金海高科	12,600	130,284.00	0.05
991	002723	小崧股份	12,600	128,898.00	0.05
992	300066	三川智慧	25,500	128,775.00	0.05
993	300211	亿通科技	12,700	128,397.00	0.05
994	300534	陇神戎发	12,700	125,349.00	0.05
995	300192	科德教育	12,500	123,375.00	0.05
996	601566	九牧王	12,200	121,634.00	0.05
997	603168	莎普爱思	8,800	118,008.00	0.04
998	002181	粤传媒	25,600	117,760.00	0.04
999	600386	北巴传媒	24,800	111,104.00	0.04

8.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	301516	中远通	268	4,156.68	0.00
2	688652	京仪装备	74	3,866.50	0.00
3	301508	中机认检	140	3,735.20	0.00
4	301568	思泰克	102	3,629.16	0.00
5	301413	安培龙	51	2,967.69	0.00
6	001239	永达股份	75	1,494.00	0.00
7	001358	兴欣新材	21	927.36	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	600186	莲花健康	2,656,097.00	1.01
2	300098	高新兴	2,544,029.00	0.97
3	300255	常山药业	2,372,700.00	0.90
4	300047	天源迪科	2,185,265.00	0.83
5	688689	银河微电	2,075,825.66	0.79
6	300355	蒙草生态	2,017,889.00	0.77
7	002642	荣联科技	2,004,558.00	0.76

8	000766	通化金马	2,001,318.00	0.76
9	300852	四会富仕	1,968,537.00	0.75
10	300608	思特奇	1,949,848.00	0.74
11	301280	珠城科技	1,878,163.33	0.71
12	300719	安达维尔	1,856,675.00	0.71
13	300149	睿智医药	1,849,815.76	0.70
14	600756	浪潮软件	1,847,509.00	0.70
15	300005	探路者	1,846,199.00	0.70
16	688138	清溢光电	1,841,665.34	0.70
17	300590	移为通信	1,807,136.75	0.69
18	000070	特发信息	1,802,675.00	0.69
19	688028	沃尔德	1,798,565.12	0.68
20	300353	东土科技	1,780,487.00	0.68

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

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	300364	中文在线	2,121,652.00	0.81
2	000766	通化金马	2,044,858.61	0.78
3	300608	思特奇	1,990,042.00	0.76
4	300098	高新兴	1,908,882.00	0.73
5	300047	天源迪科	1,883,273.00	0.72
6	002354	天娱数科	1,725,262.00	0.66
7	002154	报喜鸟	1,705,853.00	0.65
8	300255	常山药业	1,693,653.00	0.64
9	300355	蒙草生态	1,638,546.00	0.62
10	300959	线上线下	1,567,668.00	0.60
11	300719	安达维尔	1,541,650.00	0.59
12	300698	万马科技	1,507,526.00	0.57
13	002229	鸿博股份	1,489,000.00	0.57
14	300852	四会富仕	1,468,681.00	0.56
15	300005	探路者	1,468,527.00	0.56
16	301306	西测测试	1,468,363.00	0.56
17	300354	东华测试	1,456,661.00	0.55
18	002642	荣联科技	1,449,502.00	0.55
19	301389	隆扬电子	1,432,870.00	0.54
20	300890	翔丰华	1,425,623.00	0.54

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易

费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	946,770,703.05
卖出股票收入（成交）总额	565,673,689.72

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	22,969.44	0.01
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	22,969.44	0.01

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113681	镇洋转债	140	14,000.18	0.01
2	123234	中能转债	69	8,969.26	0.00

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金根据基金合同的约定，不允许投资国债期货。

8.11.2 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 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。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,361,221.16
2	应收清算款	44,271,544.59
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	45,632,765.75

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中未持有流通受限的股票。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	301516	中远通	4,156.68	0.00	新股限售
2	688652	京仪装备	3,866.50	0.00	新股限售
3	301508	中机认检	3,735.20	0.00	新股限售
4	301568	思泰克	3,629.16	0.00	新股限售
5	301413	安培龙	2,967.69	0.00	新股限售

8.12.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
1,233	207,184.77	222,752,890.00	87.20	32,705,937.00	12.80

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例(%)
----	-------	---------	-------------

1	中国国际金融股份有限公司	23,577,200.00	9.23
2	弘康人寿保险股份有限公司—自有	18,413,900.00	7.21
3	财通证券股份有限公司	17,753,499.00	6.95
4	中信建投证券股份有限公司	15,222,012.00	5.96
5	国泰君安证券股份有限公司	14,760,000.00	5.78
6	方正证券股份有限公司	12,034,500.00	4.71
7	青岛汉弩私募基金管理有限公司—汉弩金石3号私募证券投资基金	11,000,000.00	4.31
8	上海鹤禧私募基金管理有限公司—鹤禧阿尔法一号私募证券投资基金	10,043,500.00	3.93
9	浙江海宁平凡投资管理有限公司—平凡优泰私募证券投资基金	10,000,000.00	3.91
10	华泰证券股份有限公司	10,000,000.00	3.91

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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、基金投资和研发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

§ 10 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
基金合同生效日2023年9月28日起至报告期期末基金总申购份额	206,000,000.00
减：基金合同生效日2023年9月28日起至报告期期末基金总赎回份额	774,000,000.00
基金合同生效日2023年9月28日起至报告期期末基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	255,458,827.00

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 2023 年 11 月 23 日发布公告,李强先生自 2023 年 11 月 22 日起担任首席信息官,同日起林志松先生不再兼任首席信息官。

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。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内,为本基金提供审计服务的机构由安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)变更为德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)。本基金本年度支付给审计机构德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)的报酬为 3.8 万元人民币,其已提供审计服务的连续年限为 2 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注:本报告期内,基金管理人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

11.6.2 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。

11.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	----	------	-----------	----

	单元数量	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	1,512,321,513.47	100.00	491,673.43	100.00	—
中信证券	1	—	—	—	—	—

注：我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。本基金合同生效日为2023年9月28日，本表中所列券商交易单元均为本报告期新增。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
海通证券	407,482.28	100.00	—	—	—	—
中信证券	—	—	—	—	—	—

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	信息披露方式	披露日期
1	富国中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效公告	规定披露媒介	2023 年 09 月 29 日
2	富国中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书	规定披露媒介	2023 年 10 月 13 日
3	富国中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金开放申购、赎回业务的公告	规定披露媒介	2023 年 10 月 13 日
4	富国中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金上市交易提示性公告	规定披露媒介	2023 年 10 月 18 日
5	关于旗下部分基金改聘会计师事务所的公告	规定披露媒介	2023 年 11 月 14 日
6	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2023 年 11 月 22 日
7	富国基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	规定披露媒介	2023 年 11 月 23 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本基金本报告期无单一投资者持有基金份额达到或超过 20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

一、本报告期内，根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、基金合同及招募说明书等法律文件，经履行适当程序，基金管理人决定自 2023 年 11 月 14 日起，将本基金会计师事务所改聘为德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）。具体可参见基金管理人于 2023 年 11 月 14 日发布的《富国基金

管理有限公司关于旗下部分基金改聘会计师事务所的公告》。二、本报告期内，经基金管理人董事会七届一次会议审议通过并按规定备案，李强先生自 2023 年 11 月 22 日起担任首席信息官，同日起林志松先生不再兼任首席信息官。具体可参见基金管理人于 2023 年 11 月 23 日发布的《富国基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。

§ 13 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： http://www.fullgoal.com.cn 。