

华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券 投资基金 2025 年中期报告

2025 年 6 月 30 日

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2025 年 8 月 30 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 08 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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 2025 年 1 月 1 日起至 2025 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	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	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
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	13
§ 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等内容真实、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	18
§ 7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
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	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	66
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	68
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	68

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	68
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	68
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	68
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	68
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	68
7.12 投资组合报告附注	68
§ 8 基金份额持有人信息	69
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	69
8.2 期末上市基金前十名持有人	70
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	71
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	71
§ 9 开放式基金份额变动	71
§ 10 重大事件揭示	71
10.1 基金份额持有人大会决议	71
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	71
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	71
10.4 基金投资策略的改变	72
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	72
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	72
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	72
10.8 其他重大事件	74
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	75
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	75
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	75
§ 12 备查文件目录	75
12.1 备查文件目录	75
12.2 存放地点	75
12.3 查阅方式	76

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	中证 2000
场内简称	中证 2000（扩位证券简称：中证 2000ETF）
基金主代码	563300
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023 年 9 月 6 日
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,716,174,000.00 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 9 月 14 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	1、股票（含存托凭证）的投资策略 本基金主要采用最优化抽样复制标的指数。最优化抽样依托量化投资平台，利用长期稳定的风险模型，使用“跟踪误差最小化”的最优化方式创建目标组合，从而实现对标指数的紧密跟踪。在正常市场情况下，本基金力争做到日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。 为了更好地实现跟踪标的指数的目的，基金管理人还可以综合考虑标的指数成份股的流动性、投资限制、交易成本及基金规模等因素，决定是否采用完全复制法的策略。完全复制法指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；当标的指数进行定期调整、指数样本空间或者编制规则变更时，将根据标的指数的编制规则及调整公告，及时进行投资组合的优化调整，尽量降低跟踪误差，力争将日均跟踪偏离度控制在 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 以内。若本基金决定修改复制方法，将在更换复制方法前按规定履行适当程序并公告。 本基金将根据投资目标，在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素的基础上，根据审慎原则合理参与存托凭证的投资，以更好地跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。 2、债券投资策略；3、股指期货的投资策略；4、资产支持证券的投资策略；5、融资及转融通证券出借业务。
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，其长期平均风险和预期收益率理论上高于混

	合型基金、债券型基金和货币市场基金。 本基金属于股票型基金中的指数型基金，跟踪中证 2000 指数，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场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		华泰柏瑞基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	刘万方	张姗
	联系电话	021-38601777	400-61-95555
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		400-888-0001	400-61-95555
传真		021-38601799	0755-83195201
注册地址		上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号 17 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址		上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号 17 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		200135	518040
法定代表人		贾波	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.huatai-pb.com
基金中期报告备置地点	上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层及基金托管人住所

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(2025 年 1 月 1 日-2025 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	328,370,878.14
本期利润	506,599,106.13
加权平均基金份额本期利润	0.2068
本期加权平均净值利润率	19.32%
本期基金份额净值增长率	13.80%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	267,521,196.22
期末可供分配基金份额利润	0.1559
期末基金资产净值	1,983,695,196.22
期末基金份额净值	1.1559

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	15.59%

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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、对期末可供分配利润，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。

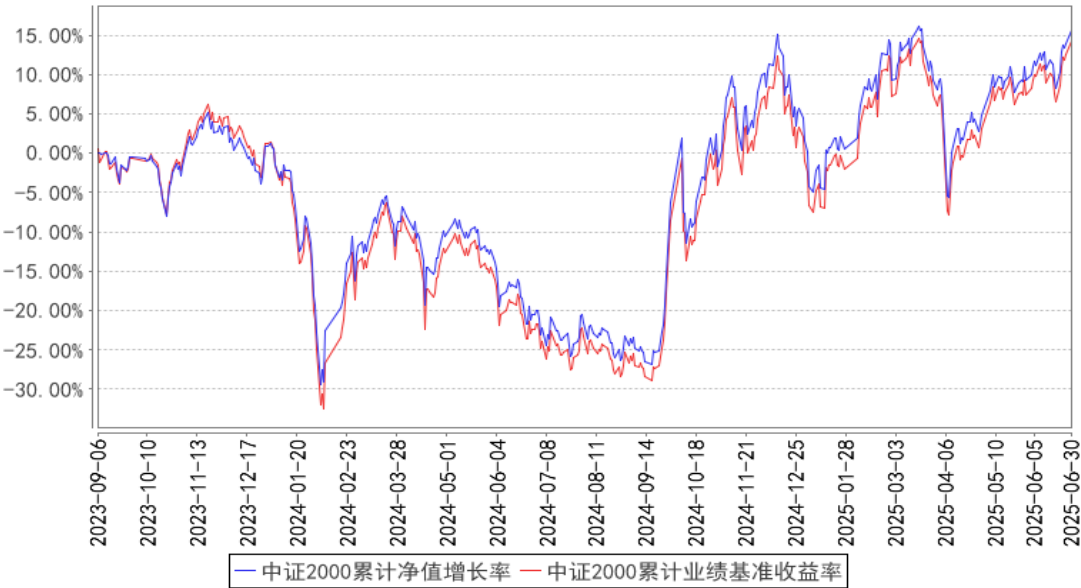
3.2 基金净值表现

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	5.77%	1.13%	6.40%	1.16%	-0.63%	-0.03%
过去三个月	6.91%	2.08%	7.62%	2.12%	-0.71%	-0.04%
过去六个月	13.80%	1.90%	15.24%	1.94%	-1.44%	-0.04%
过去一年	45.51%	2.15%	47.00%	2.18%	-1.49%	-0.03%
自基金合同生效起至今	15.59%	2.05%	14.19%	2.13%	1.40%	-0.08%

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

中证2000累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：图示日期为 2023 年 9 月 6 日至 2025 年 6 月 30 日。

§ 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

本基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司。华泰柏瑞基金管理有限公司是经中国证监会批准，于 2004 年 11 月 18 日成立的合资基金管理公司，注册资本为 2 亿元人民币。目前的股东构成为华泰证券股份有限公司、柏瑞投资有限责任公司（原 AIGGIC）和苏州新区高新技术产业股份有限公司，出资比例分别为 49%、49%和 2%。截至 2025 年 6 月 30 日，公司旗下管理 179 只基金，其中包括股票型基金、混合型基金、债券型基金、货币型基金、QDII 基金、基金中基金等。

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		
柳叶青	本基金的基金经理助理	2024 年 4 月 22 日	-	6 年	英国萨塞克斯大学公司和财务风险管理专业硕士。2018 年 12 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，现任指数投资部基金经理助理。
柳军	副总经理、指数投资部总监、本基金的基金经理	2023 年 9 月 6 日	-	24 年	副总经理，硕士，2000-2001 年任上海汽车集团财务有限公司财务，2001-2004 年任华安基金管理有限公司高级基金核算员，2004 年 7 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任基金事务部总监、指数投资部总监、总经理助理兼指数投资部总监，现任公司副总经理兼指数投资部总监。2009 年 6 月起任上证红利交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2011 年 1 月至 2020 年 2 月任华泰柏瑞上证中小盘 ETF 基金、华泰柏瑞上证中小盘 ETF 联接基金基金经理。2012 年 5 月起任华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2015 年 2 月起任指数投资部总监。2015 年 5 月至 2025 年 1 月任华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2018 年 3 月至 2018 年 11 月任华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 3 月至 2018 年 10 月任华泰柏瑞泰利灵活配置混合型

					证券投资基金的基金经理。2018 年 4 月起任华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2018 年 10 月起任华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2018 年 12 月起任华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 7 月起任华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019 年 9 月至 2021 年 4 月任华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2020 年 2 月至 2021 年 4 月任华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2020 年 9 月起任华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月起任华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2021 年 5 月起任华泰柏瑞南方东英恒生科技指数交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2021 年 7 月至 2023 年 8 月任华泰柏瑞中证沪港深创新药产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 8 月至 2023 年 12 月任华泰柏瑞中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 12 月起任华泰柏瑞中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 8 月起任华泰柏瑞南方东英恒生科技指数交易型开放式指数证券投资基金联接基金（QDII）的基金经理。2022 年 11 月起任华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 3 月起任华泰柏瑞纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2023 年 9 月起任华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 10 月起任华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。
李沐阳	指数投资部总监助	2023 年 9 月 6 日	-	7 年	美国哥伦比亚大学应用统计学硕士。2017 年 8 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，

	理、本基金的基金经理			历任指数投资部助理研究员、研究员、基金经理助理。2021 年 1 月起任华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月至 2025 年 4 月任华泰柏瑞中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月至 2025 年 2 月任华泰柏瑞中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 8 月起任华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022 年 4 月至 2025 年 6 月任华泰柏瑞中证全指电力公用事业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 11 月起任华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 3 月起任华泰柏瑞纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2023 年 4 月起任华泰柏瑞中证全指电力公用事业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2023 年 9 月起任华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）的基金经理。2023 年 10 月起任华泰柏瑞纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）的基金经理。2023 年 11 月起任华泰柏瑞南方东英新交所泛东南亚科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）、华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2024 年 1 月起任华泰柏瑞南方东英新交所泛东南亚科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）的基金经理。2024 年 7 月起任华泰柏瑞南方东英沙特阿拉伯交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金经理。2024 年 10 月起任华泰柏瑞中证油气产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 10 月起任华泰柏瑞恒生消费交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金经理。2024 年 12 月起任华泰柏瑞上证科创板 200 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 2 月起任华泰柏瑞上证科创板 200 交易型开放式指
--	------------	--	--	---

					数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2025 年 4 月起任华泰柏瑞中证油气产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2025 年 5 月起任华泰柏瑞恒生消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、华泰柏瑞上证科创板半导体材料设备主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。任职日期和离任日期指基金管理公司作出决定之日。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：截至本报告期末，本基金的基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及其他相关法律、法规的规定以及本基金的《基金合同》的约定，在严格控制风险的基础上，忠实履行基金管理职责，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金投资管理符合有关法律、法规的规定及基金合同的约定，不存在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

报告期内，本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求，通过科学完善的制度及流程，从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能的利益输送。

首先投资部和研究部通过规范的决策流程来确保公平对待不同投资组合。其次交易部对投资指令的合规性、有效性及合理性进行独立审核，在交易过程中启用投资交易系统内的公平交易模块，确保公平交易的实施。同时，风险管理部对报告期内的交易进行日常监控和分析评估。

本报告期内，上述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

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人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%的交易共有 2 次，都为指数投资组合因跟踪指数需要而发生的反向交易。

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

2025 年上半年，中证 2000ETF 在经历了剧烈波动后完成 V 型反转。年后小盘股随 AI 算力、新质生产力等主题走强。四月初，因对等关税政策突袭，小盘股一度遭到抛售，指数急速下挫；随着关税暂缓执行，市场风险偏好迅速回暖，小微盘迎来强劲反弹。进入五月，资金布局呈现“杠铃型”特征：一端是政策护航下的大盘蓝筹，另一端是具备高弹性成长特征的小微盘；在成长资金持续加码之下，ETF 跟踪指数自五月中旬起稳步上行，累积涨幅显著。

我们严格按照基金合同的规定，紧密跟踪标的指数、跟踪偏离最小化的投资策略进行被动投资。本报告期内，本基金的日均绝对跟踪偏离度为 0.09%，期间日跟踪误差为 0.11%，较好地实现了本基金的投资目标。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.1559 元，本报告期基金份额净值增长率为 13.80%，业绩比较基准收益率为 15.24%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，随着上市公司中报发布临近，业绩超预期个股有望成为新一轮行情的领头羊；与此同时，国内“稳增长”政策组合拳持续发力，平准基金对冲市场波动的同时，也有助于维持小盘股的风险偏好。资金面方面，若美联储下半年出现再通胀担忧导致流动性收紧，本土“稳信用”与“稳货币”政策能否迅速填补缺口将备受关注。地缘政治摩擦升级、行业和个股估值分化加剧，或均对板块轮动节奏构成挑战。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，基金管理人严格执行基金估值控制流程，定期评估估值技术的合理性，每日将估值结果报托管银行复核后对外披露。参与估值流程的人员包括负责运营的副总经理以及投资研究、风险控制和基金事务部门负责人，基金经理不参与估值流程。参与人员的相关工作经历均在五年以上。参与各方之间不存在任何重大利益冲突。已采用的估值技术相关参数或定价服务均来自独立第三方。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定，在符合有关基金收益分配条件的前提下，本基金收益每年最多分配 4 次，每次基金收益分配数额由基金管理人根据实际情况确定。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使基金份额净值低于面值。截止本报告期末，本基金未进行利润分配，本基金可分配收益为 267,521,196.22 元。

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

本报告期内，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遵规守信情况声明

托管人声明：

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

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

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

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

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	40,982,336.74	66,367,750.19
结算备付金		16,985,048.23	18,481,504.35
存出保证金		3,815,984.41	3,291,305.71
交易性金融资产	6.4.7.2	1,939,676,480.99	2,878,836,325.68
其中：股票投资		1,939,676,480.99	2,878,127,297.71
基金投资		-	-
债券投资		-	709,027.97

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	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		3,838,659.68	1,243,135.75
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		2,005,298,510.05	2,968,220,021.68
负债和净资产	附注号	本期末 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		15,362.40	1,289,810.73
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		687,918.12	164,987.34
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		814,258.13	1,261,254.82
应付托管费		162,851.62	252,250.96
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.85	0.91
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	19,922,922.71	36,198,875.07
负债合计		21,603,313.83	39,167,179.83
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	1,716,174,000.00	2,883,674,000.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	267,521,196.22	45,378,841.85
净资产合计		1,983,695,196.22	2,929,052,841.85
负债和净资产总计		2,005,298,510.05	2,968,220,021.68

注：报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.1559 元，基金份额总额 1,716,174,000.00 份。

6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		514,652,146.54	649,286,578.54
1. 利息收入		144,630.14	245,294.88
其中：存款利息收入	6.4.7.13	144,630.14	245,294.88
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）		324,293,803.45	780,243,605.55
其中：股票投资收益	6.4.7.14	311,621,789.65	772,081,827.82
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	429,160.51	80,704.95
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	12,242,853.29	8,081,072.78
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）	6.4.7.20	178,228,227.99	-66,088,017.17
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.21	11,985,484.96	-65,114,304.72
减：二、营业总支出		8,053,040.41	4,843,440.51
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	6,542,842.71	3,892,037.66
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,308,568.52	778,407.57
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. 22	-	-
7. 税金及附加		0. 27	0. 15
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	201, 628. 91	172, 995. 13
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		506, 599, 106. 13	644, 443, 138. 03
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		506, 599, 106. 13	644, 443, 138. 03
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		506, 599, 106. 13	644, 443, 138. 03

6.3 净资产变动表

会计主体：华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	2, 883, 674, 000. 00	-	45, 378, 841. 85	2, 929, 052, 841. 85
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	2, 883, 674, 000. 00	-	45, 378, 841. 85	2, 929, 052, 841. 85
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1, 167, 500, 000. 00	-	222, 142, 354. 37	-945, 357, 645. 63
（一）、综合收益总额	-	-	506, 599, 106. 13	506, 599, 106. 13
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-1, 167, 500, 000. 00	-	-284, 456, 751. 76	-1, 451, 956, 751. 76
其中：1. 基金申	8, 537, 500, 000. 00	-	429, 234, 576. 05	8, 966, 734, 576. 05

购款	00			5
2. 基金赎回款	-9,705,000,000.00	-	-713,691,327.81	-10,418,691,327.81
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	1,716,174,000.00	-	267,521,196.22	1,983,695,196.22
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1,003,674,000.00	-	9,593,454.02	1,013,267,454.02
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,003,674,000.00	-	9,593,454.02	1,013,267,454.02
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	260,000,000.00	-	-269,464,065.14	-9,464,065.14
(一)、综合收益总额	-	-	644,443,138.03	644,443,138.03
(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)	260,000,000.00	-	-913,907,203.17	-653,907,203.17
其中：1. 基金申购款	11,802,500,000.00	-	-2,387,303,504.66	9,415,196,495.34

2. 基金赎回款	-11,542,500.00	-	1,473,396,301.49	-10,069,103,698.51
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	1,263,674,000.00	-	-259,870,611.12	1,003,803,388.88

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：

贾波
基金管理人负责人

房伟力
主管会计工作负责人

赵景云
会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2023]1940 号《关于准予华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》注册，由华泰柏瑞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《华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 588,674,000.00 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2023)第 0459 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2023 年 9 月 6 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 588,674,000.00 份基金份额，无认购资金利息折合基金份额。本基金的基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2023]210 号核准，本基金 588,674,000.00 份基金份额于 2023 年 9 月 14 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资

第 18 页 共 76 页

基金基金合同》的有关规定，本基金以标的指数成份股、备选成份股(含存托凭证)为主要投资对象。此外，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(包括创业板以及其他经中国证监会核准或注册发行的股票)、存托凭证、债券(包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、央行票据、短期融资券、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、货币市场工具、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。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。本基金投资标的指数成份股及备选成份股(均含存托凭证)的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。本基金的业绩比较基准为中证 2000 指数收益率。

本基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司以本基金为目标 ETF，募集成立了华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(以下简称“华泰柏瑞中证 2000ETF 联接基金”)。华泰柏瑞中证 2000ETF 联接基金为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

本财务报表由本基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于 2025 年 8 月 29 日批准报出。

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”)、中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日止期间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 2025 年 06 月 30 日的财务状况以及 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日止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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的非货物期货，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非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售

股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

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 2025 年 6 月 30 日
活期存款	40,982,336.74
等于：本金	40,977,723.39
加：应计利息	4,613.35
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	40,982,336.74

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	1,835,358,850.28	-	1,939,676,480.99	104,317,630.71
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		1,835,358,850.28	-	1,939,676,480.99	104,317,630.71

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末未持有期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

注：无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 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	1,335,484.32
其中：交易所市场	1,335,484.32
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	198,520.30
应退退补款	18,388,918.09
合计	19,922,922.71

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,883,674,000.00	2,883,674,000.00
本期申购	8,537,500,000.00	8,537,500,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-9,705,000,000.00	-9,705,000,000.00
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,716,174,000.00	1,716,174,000.00

注：投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购赎回单位的整数倍。

6.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期末无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	932,280,774.82	-886,901,932.97	45,378,841.85
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	932,280,774.82	-886,901,932.97	45,378,841.85
本期利润	328,370,878.14	178,228,227.99	506,599,106.13
本期基金份额交易产生的变动数	-466,395,953.59	181,939,201.83	-284,456,751.76
其中：基金申购款	3,116,157,952.10	-2,686,923,376.05	429,234,576.05
基金赎回款	-3,582,553,905.69	2,868,862,577.88	-713,691,327.81
本期已分配利润	-	-	-
本期末	794,255,699.37	-526,734,503.15	267,521,196.22

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
活期存款利息收入	103,458.96
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	33,310.95
其他	7,860.23
合计	144,630.14

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	202,211,179.12
股票投资收益——赎回差价收入	109,410,610.53
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	311,621,789.65

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	7,349,221,551.58
减：卖出股票成本总额	7,139,609,554.21
减：交易费用	7,400,818.25
买卖股票差价收入	202,211,179.12

6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
赎回基金份额对价总额	10,418,691,327.81
减：现金支付赎回款总额	6,948,230,555.81
减：赎回股票成本总额	3,361,050,161.47
减：交易费用	-
赎回差价收入	109,410,610.53

6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益——申购差价收入。

6.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益——证券出借差价收入。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	79.14
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	429,081.37
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	429,160.51

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,701,758.87
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成	1,272,500.00

本总额	
减：应计利息总额	109.44
减：交易费用	68.06
买卖债券差价收入	429,081.37

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——申购差价收入。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	12,242,853.29
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	12,242,853.29

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	178,107,480.99
股票投资	178,107,480.99
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	120,747.00
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	178,228,227.99

注：其他为可退替代款的公允价值变动。

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	11,985,484.96
合计	11,985,484.96

注：替代损益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)被替代股票的实际买入成本(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股票在强制退款计算日与申购(赎回)确认日估值的差额。

6.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	34,712.18
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
注册登记费	74,383.76
IOPV 计算发布费	9,916.99
银行划款手续费	23,108.61
合计	201,628.91

6.4.7.24 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

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，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

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
华泰柏瑞基金管理有限公司（“华泰柏瑞基金”）	基金管理人、基金销售机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人
华泰证券股份有限公司（“华泰证券”）	基金管理人的股东、申购赎回代理券商、基金销售机构
华泰联合证券有限责任公司（“华泰联合证券”）	基金管理人的股东华泰证券的控股子公司

华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（“中证 2000 联接”）	本基金的基金管理人管理的其他基金
---	------------------

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 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（%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例（%）
华泰证券	3,897,296,423.33	27.63	3,881,879.76	0.03

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

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 2025年1月1日至2025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（%）
华泰证券	779,570.45	27.63	779,570.45	58.37
关联方名称	上年度可比期间 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（%）
华泰证券	3,671.94	0.24	3,671.94	0.73

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 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	6,542,842.71	3,892,037.66
其中：应支付销售机构的客户维护费	248,163.67	101,244.07
应支付基金管理人的净管理费	6,294,679.04	3,790,793.59

注：支付基金管理人华泰柏瑞基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.50\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 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	1,308,568.52	778,407.57

注：支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方进行的银行间同业市场的债券（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

注：本基金本报告期及上年度可比期间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

注：本基金本报告期及上年度可比期间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

注：本报告期及上年度可比期间，基金管理人未投资本基金。

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 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024 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（%）
华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	27,689,400.00	1.6134	56,036,400.00	1.9432
华泰证券股份有限公司	7,718,082.00	0.4497	7,966,148.00	0.2762

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

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	40,982,336.74	103,458.96	35,081,340.46	84,921.06

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 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
华泰联合证券	301458	钧崴电子	网下申购	7,005	72,852.00
华泰联合证券	688757	胜科纳米	网下申购	5,357	48,641.56
华泰联合证券	113694	清源转债	配售	2,610	261,000.00

华泰联合证券	603014	威高血净	网下申购	2,045	54,192.50
上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 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
华泰联合证券	603312	西典新能	网下申购	1,296	37,609.92
华泰联合证券	688709	成都华微	网下申购	7,139	112,010.91
华泰联合证券	603341	龙旗科技	网下申购	2,978	77,428.00
华泰联合证券	301587	中瑞股份	网下申购	3,056	66,406.88
华泰联合证券	301392	汇成真空	网下申购	2,189	26,705.80

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2025 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

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001335	信凯科技	2025 年 4 月 2 日	6 个月	新股锁定期内	12.80	28.05	80	1,024.00	2,244.00	-
001356	富岭股份	2025 年 1 月 16 日	6 个月	新股锁定期内	5.30	14.44	709	3,757.70	10,237.96	-
001382	新亚电缆	2025 年 3 月 13 日	6 个月	新股锁定期内	7.40	20.21	366	2,708.40	7,396.86	-
001388	信通电子	2025 年 6 月 24 日	1 个月内（含）	新股未上市	16.42	16.42	843	13,842.06	13,842.06	-
001388	信通	2025 年 6 月	6 个月以上	新股锁定	16.42	16.42	94	1,543.48	1,543.48	-

	电子	24 日		期内						
001390	古麒绒材	2025 年 5 月 21 日	6 个月	新股 锁定 期内	12.08	18.12	178	2,150.24	3,225.36	-
001395	亚联机械	2025 年 1 月 20 日	6 个月	新股 锁定 期内	19.08	47.25	80	1,526.40	3,780.00	-
301173	毓恬冠佳	2025 年 2 月 24 日	6 个月	新股 锁定 期内	28.33	44.98	173	4,901.09	7,781.54	-
301275	汉朔科技	2025 年 3 月 4 日	6 个月	新股 锁定 期内	27.50	56.19	397	10,917.50	22,307.43	-
301458	钧崴电子	2025 年 1 月 2 日	6 个月	新股 锁定 期内	10.40	34.11	701	7,290.40	23,911.11	-
301479	弘景光电	2025 年 3 月 6 日	6 个月	新股 锁定 期内	41.90	77.87	182	5,447.00	14,172.34	含证 券送 配
301501	恒鑫生活	2025 年 3 月 11 日	6 个月	新股 锁定 期内	39.92	45.22	349	9,620.72	15,781.78	含证 券送 配
301535	浙江华远	2025 年 3 月 18 日	6 个月	新股 锁定 期内	4.92	18.99	734	3,611.28	13,938.66	-
301560	众捷汽车	2025 年 4 月 17 日	6 个月	新股 锁定 期内	16.50	27.45	190	3,135.00	5,215.50	-
301590	优优绿能	2025 年 5 月 28 日	6 个月	新股 锁定 期内	89.60	139.48	73	6,540.80	10,182.04	-
301595	太力	2025 年 5 月	6 个月	新股 锁定	17.05	29.10	196	3,341.80	5,703.60	-

	科技	12 日		期内						
301601	惠通科技	2025 年 1 月 8 日	6 个月	新股 锁定 期内	11.80	33.85	342	4,035.60	11,576.70	-
301602	超研股份	2025 年 1 月 15 日	6 个月	新股 锁定 期内	6.70	24.80	658	4,408.60	16,318.40	-
301636	泽润新能	2025 年 4 月 30 日	6 个月	新股 锁定 期内	33.06	47.46	128	4,231.68	6,074.88	-
301658	首航新能	2025 年 3 月 26 日	6 个月	新股 锁定 期内	11.80	22.98	437	5,156.60	10,042.26	-
301662	宏工科技	2025 年 4 月 10 日	6 个月	新股 锁定 期内	26.60	82.50	143	3,803.80	11,797.50	-
301665	泰禾股份	2025 年 4 月 2 日	6 个月	新股 锁定 期内	10.27	22.39	393	4,036.11	8,799.27	-
301678	新恒汇	2025 年 6 月 13 日	6 个月	新股 锁定 期内	12.80	44.54	382	4,889.60	17,014.28	-
603014	威高血净	2025 年 5 月 12 日	6 个月	新股 锁定 期内	26.50	32.68	205	5,432.50	6,699.40	-
603072	天和磁材	2024 年 12 月 24 日	6 个月 以上	新股 锁定 期内	12.30	54.45	226	2,779.80	12,305.70	-
603120	肯特催化	2025 年 4 月 9 日	6 个月	新股 锁定 期内	15.00	33.43	65	975.00	2,172.95	-
603124	江南新	2025 年 3 月 12 日	6 个月	新股 锁定 期内	10.54	46.31	88	927.52	4,075.28	-

	材									
603202	天有为	2025年4月16日	6个月	新股锁定期内	93.50	90.66	166	15,521.00	15,049.56	-
603210	泰鸿万立	2025年4月1日	6个月	新股锁定期内	8.60	15.61	286	2,459.60	4,464.46	-
603257	中国瑞林	2025年3月28日	6个月	新股锁定期内	20.52	37.47	78	1,600.56	2,922.66	-
603271	永杰新材	2025年3月4日	6个月	新股锁定期内	20.60	35.08	126	2,595.60	4,420.08	-
603382	海阳科技	2025年6月5日	6个月	新股锁定期内	11.50	22.39	105	1,207.50	2,350.95	-
603400	华之杰	2025年6月12日	6个月	新股锁定期内	19.88	43.81	57	1,133.16	2,497.17	-
603409	汇通控股	2025年2月25日	6个月	新股锁定期内	24.18	33.32	100	2,418.00	3,332.00	-
688411	海博思创	2025年1月20日	6个月	新股锁定期内	19.38	83.49	560	10,852.80	46,754.40	-
688545	兴福电子	2025年1月15日	6个月	新股锁定期内	11.68	26.95	994	11,609.92	26,788.30	-
688583	思看科技	2025年1月8日	6个月	新股锁定期内	33.46	79.68	227	5,855.50	18,087.36	含证 券送 配
688755	汉邦科技	2025年5月9日	6个月	新股锁定期内	22.77	39.33	203	4,622.31	7,983.99	-
688757	胜	2025	6个月	新股	9.08	25.94	536	4,866.88	13,903.84	-

	科 纳 米	年 3 月 18 日		锁定 期内						
688758	赛 分 科 技	2025 年 1 月 2 日	6 个月	新股 锁定 期内	4.32	16.97	777	3,356.64	13,185.69	-
688775	影 石 创 新	2025 年 6 月 4 日	6 个月	新股 锁定 期内	47.27	124.16	573	27,085.71	71,143.68	-

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

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

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

4、基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后 6 个月内不得转让。

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
688313	仕佳 光子	2025 年 6 月 30 日	重大 事项 停牌	38.05	2025 年 7 月 11 日	39.98	201,691	7,416,171.91	7,674,342.55	-
300225	*ST 金泰	2025 年 5 月 6 日	重大 事项 停牌	4.22	2025 年 7 月 3 日	4.01	267,700	1,712,706.67	1,129,694.00	-
300280	*ST	2025	重大	8.74	2025	6.99	103,800	1,721,524.69	907,212.00	-

	紫天	年 3 月 17 日	事项 停牌		年 7 月 7 日					
--	----	------------------	----------	--	-----------------	--	--	--	--	--

注：本基金截至 2025 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未参与转融通证券出借业务。

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

本基金为被动式指数基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金，主要投资于标的指数成份股和备选成份股。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，力争实现保持基金净值增长率与标的指数增长率间的高度正相关，并保持跟踪误差在合同约定的范围内。

本基金的基金管理人建立的风险管理体系由“组织、制度、流程和报告”等四个方面构成。组织是指公司的风险管理组织架构包括董事会下设的风险管理与审计委员会、公司管理层的风险控制委员会、风险管理部和合规法律部以及公司各业务部门，董事会对建立基金风险管理内部控制系统和维持其有效性承担最终责任；制度是指风险管理相关的规章制度，是对组织职能及其工作流程等的具体规定；流程是风险管理的工作流程，它详细规定了各部门之间风险管理工作的内容和程序；报告是对流程的必要反映和记录，既是风险管理工作的重要环节，也是对风险管理工作的总结和披露。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工

具特征，通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人开立的托管账户或其他商业银行开立的存款账户，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2025 年 6 月 30 日，本基金无债券投资 (2024 年 12 月 31 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 0.02%)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

于 2025 年 06 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值 (净资产) 无固定到期日且不计息，因此账面余额即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》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动

投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2025 年 06 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合法律法规的相关要求。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，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 2025 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	40,982,336.74	-	-	-	-	-	40,982,336.74
结算备付金	16,985,048.23	-	-	-	-	-	16,985,048.23
存出保证金	3,815,984.41	-	-	-	-	-	3,815,984.41
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,939,676,480.99	1,939,676,480.99
应收清算款	-	-	-	-	-	-3,838,659.	3,838,659.68

						68	
资产总计	61,783,369.38	-	-	-	-	1,943,515,140.67	2,005,298,510.05
负债							
交易性金融负债	-	-	-	-	-	15,362.40	15,362.40
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	814,258.13	814,258.13
应付托管费	-	-	-	-	-	162,851.62	162,851.62
应付清算款	-	-	-	-	-	687,918.12	687,918.12
应交税费	-	-	-	-	-	0.85	0.85
其他负债	-	-	-	-	-	19,922,922.71	19,922,922.71
负债总计	-	-	-	-	-	21,603,313.83	21,603,313.83
利率敏感度缺口	61,783,369.38	-	-	-	-	1,921,911,826.84	1,983,695,196.22
上年度末 2024 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	66,367,750.19	-	-	-	-	-	66,367,750.19
结算备付金	18,481,504.35	-	-	-	-	-	18,481,504.35
存出保证金	3,291,305.71	-	-	-	-	-	3,291,305.71
交易性金融资产	-	-	-	-	709,027.97	2,878,127,297.71	2,878,836,325.68
应收清算款	-	-	-	-	-	1,243,135.75	1,243,135.75
资产总计	88,140,560.25	-	-	-	709,027.97	2,879,370,433.46	2,968,220,021.68
负债							
交易性金融负债	-	-	-	-	-	1,289,810.73	1,289,810.73
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,261,254.82	1,261,254.82
应付托管费	-	-	-	-	-	252,250.96	252,250.96
应付清算款	-	-	-	-	-	164,987.34	164,987.34
应交税费	-	-	-	-	-	0.91	0.91
其他负债	-	-	-	-	-	36,198,875.07	36,198,875.07
负债总计	-	-	-	-	-	39,167,179.83	39,167,179.83

利率敏感度缺 口	88,140,560.25	-	-	-	709,027.97	2,840,203,253.63	2,929,052,841.85
-------------	---------------	---	---	---	------------	------------------	------------------

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2025 年 06 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2024 年 12 月 31 日：0.02%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2024 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金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。

本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

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 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024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	1,939,676,480.99	97.78	2,878,127,297.71	98.26
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-15,362.40	-0.00	-1,289,810.73	-0.04

合计	1,939,661,118.59	97.78	2,876,837,486.98	98.22
----	------------------	-------	------------------	-------

注：其他包含可退替代款。

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（2025年6月30日）	上年度末（2024年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	94,624,472.81	137,732,544.66
	业绩比较基准下降5%	-94,624,472.81	-137,732,544.66

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 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
第一层次	1,929,464,207.96	2,865,128,411.35
第二层次	9,726,634.09	13,063,948.47
第三层次	485,638.94	643,965.86
合计	1,939,676,480.99	2,878,836,325.68

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2025 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2024 年 12 月 31 日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 基金申购款

于 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日止期间，本基金申购基金份额的对价总额为 8,966,734,576.05 元(2024 年度：19,528,870,308.91 元)，其中包括以股票支付的申购款 2,627,961,483.81 元和以现金支付的申购款 6,338,773,092.24 元(2024 年度：其中包括以股票支付的申购款 6,233,074,947.00 元和以现金支付的申购款 13,295,795,361.91 元)。

(2) 除基金申购款外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	1,939,676,480.99	96.73
	其中：股票	1,939,676,480.99	96.73
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	57,967,384.97	2.89
8	其他各项资产	7,654,644.09	0.38
9	合计	2,005,298,510.05	100.00

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	12,852,451.00	0.65
B	采矿业	15,495,608.70	0.78
C	制造业	1,344,177,472.52	67.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	38,064,314.48	1.92
E	建筑业	21,799,191.55	1.10
F	批发和零售业	71,106,171.88	3.58
G	交通运输、仓储和邮政业	27,691,337.00	1.40
H	住宿和餐饮业	2,057,349.00	0.10
I	信息传输、软件和信息技术服务业	210,816,178.58	10.63
J	金融业	1,328,776.24	0.07
K	房地产业	41,716,566.00	2.10
L	租赁和商务服务业	39,890,959.50	2.01
M	科学研究和技术服务业	46,433,183.62	2.34
N	水利、环境和公共设施管理业	32,781,227.66	1.65
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	12,679,970.00	0.64
Q	卫生和社会工作	1,316,290.00	0.07
R	文化、体育和娱乐业	10,506,601.00	0.53
S	综合	6,393,365.00	0.32
	合计	1,937,107,013.73	97.65

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—

C	制造业	1,600,071.28	0.08
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	2,244.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	31,536.78	0.00
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	907,212.00	0.05
M	科学研究和技术服务业	28,403.20	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	2,569,467.26	0.13

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300969	恒帅股份	132,100	8,848,058.00	0.45
2	688049	炬芯科技	136,022	8,229,331.00	0.41
3	688313	仕佳光子	201,691	7,674,342.55	0.39
4	688239	航宇科技	203,491	7,118,115.18	0.36
5	688621	阳光诺和	135,927	6,781,398.03	0.34
6	688382	益方生物	201,790	6,622,747.80	0.33
7	688510	航亚科技	272,044	6,578,023.92	0.33
8	300842	帝科股份	136,803	5,996,075.49	0.30
9	600425	青松建化	1,556,566	5,697,031.56	0.29

10	002104	恒宝股份	272,900	5,433,439.00	0.27
11	688259	创耀科技	135,822	5,385,342.30	0.27
12	688087	英科再生	203,491	5,229,718.70	0.26
13	688598	金博股份	203,791	5,180,367.22	0.26
14	002017	东信和平	272,100	5,014,803.00	0.25
15	300378	鼎捷数智	136,800	5,006,880.00	0.25
16	688428	诺诚健华	203,491	4,971,285.13	0.25
17	300349	金卡智能	409,700	4,895,915.00	0.25
18	301195	北路智控	136,750	4,895,650.00	0.25
19	301080	百普赛斯	68,400	4,892,652.00	0.25
20	002956	西麦食品	205,100	4,813,697.00	0.24
21	002971	和远气体	205,180	4,786,849.40	0.24
22	300766	每日互动	136,800	4,779,792.00	0.24
23	002478	常宝股份	884,600	4,644,150.00	0.23
24	688158	优刻得	203,491	4,602,966.42	0.23
25	002752	昇兴股份	820,400	4,569,628.00	0.23
26	002379	宏创控股	341,900	4,540,432.00	0.23
27	300203	聚光科技	205,100	4,538,863.00	0.23
28	003000	劲仔食品	338,100	4,473,063.00	0.23
29	688039	当虹科技	136,022	4,464,242.04	0.23
30	601588	北辰实业	2,549,900	4,411,327.00	0.22
31	300098	高新兴	848,100	4,410,120.00	0.22
32	300353	东土科技	205,100	4,378,885.00	0.22
33	300872	天阳科技	189,500	4,369,870.00	0.22
34	300545	联得装备	136,800	4,350,240.00	0.22
35	002983	芯瑞达	204,847	4,340,707.93	0.22
36	688233	神工股份	136,022	4,321,418.94	0.22
37	300053	航宇微	326,800	4,313,760.00	0.22
38	002870	香山股份	136,800	4,310,568.00	0.22
39	603859	能科科技	132,920	4,295,974.40	0.22
40	002452	长高电新	615,300	4,276,335.00	0.22
41	000521	长虹美菱	613,700	4,259,078.00	0.21
42	002170	芭田股份	410,200	4,204,550.00	0.21
43	688590	新致软件	203,791	4,185,867.14	0.21
44	688225	亚信安全	203,491	4,149,181.49	0.21
45	003010	若羽臣	68,400	4,145,040.00	0.21
46	300340	科恒股份	189,600	4,133,280.00	0.21
47	300731	科创新源	136,800	4,127,256.00	0.21
48	603067	振华股份	269,960	4,114,190.40	0.21
49	300131	英唐智控	529,900	4,069,632.00	0.21
50	600071	凤凰光学	188,100	4,017,816.00	0.20
51	603069	海汽集团	188,000	4,017,560.00	0.20
52	002345	潮宏基	271,700	3,974,971.00	0.20

53	003038	鑫铂股份	203,318	3,962,667.82	0.20
54	002083	孚日股份	819,300	3,957,219.00	0.20
55	002641	公元股份	948,700	3,918,131.00	0.20
56	300048	合康新能	666,400	3,911,768.00	0.20
57	600410	华胜天成	407,800	3,910,802.00	0.20
58	603727	博迈科	266,890	3,904,600.70	0.20
59	688678	福立旺	203,331	3,871,422.24	0.20
60	000655	金岭矿业	547,000	3,861,820.00	0.19
61	688733	壹石通	201,769	3,821,504.86	0.19
62	300092	科新机电	273,500	3,820,795.00	0.19
63	000888	峨眉山 A	271,661	3,819,553.66	0.19
64	603416	信捷电气	68,000	3,812,760.00	0.19
65	002115	三维通信	410,200	3,786,146.00	0.19
66	600694	大商股份	203,940	3,783,087.00	0.19
67	688277	天智航	271,856	3,778,798.40	0.19
68	688360	德马科技	203,691	3,778,468.05	0.19
69	300061	旗天科技	273,500	3,760,625.00	0.19
70	300802	矩子科技	199,000	3,749,160.00	0.19
71	688182	灿勤科技	136,022	3,748,766.32	0.19
72	600846	同济科技	327,800	3,730,364.00	0.19
73	300444	双杰电气	539,300	3,726,563.00	0.19
74	300105	龙源技术	476,900	3,676,899.00	0.19
75	300245	天玑科技	189,600	3,672,552.00	0.19
76	688533	上声电子	136,081	3,664,661.33	0.18
77	600251	冠农股份	475,400	3,627,302.00	0.18
78	002334	英威腾	457,400	3,627,182.00	0.18
79	688687	凯因科技	136,022	3,616,824.98	0.18
80	688663	新风光	133,312	3,592,758.40	0.18
81	605196	华通线缆	203,900	3,590,679.00	0.18
82	002293	罗莱生活	410,200	3,585,148.00	0.18
83	002467	二六三	547,000	3,539,090.00	0.18
84	301162	国能日新	68,457	3,537,857.76	0.18
85	603887	城地香江	203,921	3,535,990.14	0.18
86	300494	盛天网络	258,000	3,519,120.00	0.18
87	300825	阿尔特	324,300	3,505,683.00	0.18
88	301127	武汉天源	205,100	3,505,159.00	0.18
89	600496	精工钢构	1,088,600	3,483,520.00	0.18
90	002443	金洲管道	547,000	3,478,920.00	0.18
91	300314	戴维医疗	273,500	3,473,450.00	0.18
92	002919	名臣健康	203,312	3,433,939.68	0.17
93	300293	蓝英装备	136,400	3,429,096.00	0.17
94	300990	同飞股份	68,340	3,410,166.00	0.17
95	300355	蒙草生态	801,000	3,404,250.00	0.17

96	300320	海达股份	341,900	3,398,486.00	0.17
97	301181	标榜股份	136,800	3,389,904.00	0.17
98	000554	泰山石油	478,600	3,383,702.00	0.17
99	688593	新相微	203,491	3,323,008.03	0.17
100	002177	御银股份	410,200	3,306,212.00	0.17
101	002640	跨境通	658,400	3,298,584.00	0.17
102	600105	永鼎股份	407,200	3,294,248.00	0.17
103	600592	龙溪股份	136,000	3,284,400.00	0.17
104	002970	锐明技术	66,469	3,283,568.60	0.17
105	300424	航新科技	189,500	3,282,140.00	0.17
106	002703	浙江世宝	250,100	3,281,312.00	0.17
107	300532	今天国际	271,750	3,277,305.00	0.17
108	300047	天源迪科	205,100	3,271,345.00	0.16
109	300278	华昌达	598,300	3,266,718.00	0.16
110	000526	学大教育	68,400	3,266,100.00	0.16
111	002912	中新赛克	136,759	3,261,702.15	0.16
112	301270	汉仪股份	68,420	3,260,897.20	0.16
113	301101	明月镜片	66,450	3,252,727.50	0.16
114	300120	经纬辉开	324,200	3,251,726.00	0.16
115	002339	积成电子	409,300	3,241,656.00	0.16
116	300559	佳发教育	273,500	3,227,300.00	0.16
117	002922	伊戈尔	205,100	3,226,223.00	0.16
118	000700	模塑科技	410,200	3,220,070.00	0.16
119	600576	祥源文旅	396,100	3,196,527.00	0.16
120	600113	浙江东日	123,950	3,195,431.00	0.16
121	002609	捷顺科技	273,500	3,194,480.00	0.16
122	300400	劲拓股份	189,500	3,191,180.00	0.16
123	600054	黄山旅游	271,300	3,185,062.00	0.16
124	002878	元隆雅图	136,800	3,184,704.00	0.16
125	603050	科林电气	193,227	3,180,516.42	0.16
126	603018	华设集团	386,200	3,170,702.00	0.16
127	600255	鑫科材料	948,700	3,168,658.00	0.16
128	300389	艾比森	273,100	3,162,498.00	0.16
129	300895	铜牛信息	68,455	3,161,936.45	0.16
130	603166	福达股份	203,900	3,154,333.00	0.16
131	300217	东方电热	598,300	3,153,041.00	0.16
132	002364	中恒电气	205,100	3,146,234.00	0.16
133	688133	泰坦科技	136,022	3,131,226.44	0.16
134	603809	豪能股份	203,900	3,119,670.00	0.16
135	300382	斯莱克	205,100	3,119,571.00	0.16
136	300403	汉字集团	205,100	3,115,469.00	0.16
137	300435	中泰股份	205,100	3,113,418.00	0.16
138	600106	重庆路桥	507,800	3,112,814.00	0.16

139	300331	苏大维格	136,800	3,095,784.00	0.16
140	300460	惠伦晶体	271,700	3,091,946.00	0.16
141	603722	阿科力	66,500	3,088,260.00	0.16
142	300541	先进数通	189,560	3,080,350.00	0.16
143	300248	新开普	205,100	3,074,449.00	0.15
144	002579	中京电子	202,800	3,072,420.00	0.15
145	603187	海容冷链	260,900	3,068,184.00	0.15
146	002102	能特科技	969,000	3,062,040.00	0.15
147	600609	金杯汽车	576,900	3,051,801.00	0.15
148	300192	科德教育	203,300	3,049,500.00	0.15
149	603011	合锻智能	195,300	3,042,774.00	0.15
150	002543	万和电气	273,500	3,038,585.00	0.15
151	300046	台基股份	68,600	3,035,550.00	0.15
152	300592	华凯易佰	269,694	3,034,057.50	0.15
153	300489	光智科技	68,400	3,020,544.00	0.15
154	300421	力星股份	201,300	3,015,474.00	0.15
155	603111	康尼机电	457,700	3,011,666.00	0.15
156	603855	华荣股份	136,000	3,009,680.00	0.15
157	002250	联化科技	273,500	3,008,500.00	0.15
158	300840	酷特智能	134,900	3,008,270.00	0.15
159	000777	中核科技	136,800	3,008,232.00	0.15
160	002527	新时达	205,100	2,992,409.00	0.15
161	002392	北京利尔	478,600	2,986,464.00	0.15
162	002829	星网宇达	136,782	2,984,583.24	0.15
163	002175	东方智造	650,200	2,971,414.00	0.15
164	688588	凌志软件	203,933	2,971,303.81	0.15
165	605133	嵘泰股份	67,400	2,970,992.00	0.15
166	000531	穗恒运 A	478,600	2,943,390.00	0.15
167	600992	贵绳股份	192,000	2,941,440.00	0.15
168	300193	佳士科技	324,000	2,932,200.00	0.15
169	603938	三孚股份	203,900	2,932,082.00	0.15
170	002803	吉宏股份	205,100	2,924,726.00	0.15
171	002437	誉衡药业	1,025,500	2,922,675.00	0.15
172	300729	乐歌股份	203,330	2,911,685.60	0.15
173	301391	卡莱特	68,020	2,911,256.00	0.15
174	002580	圣阳股份	205,160	2,898,910.80	0.15
175	002035	华帝股份	460,500	2,896,545.00	0.15
176	002510	天汽模	410,200	2,896,012.00	0.15
177	000948	南天信息	136,730	2,891,839.50	0.15
178	600843	上工申贝	256,300	2,883,375.00	0.15
179	688339	亿华通	134,958	2,881,353.30	0.15
180	002255	海陆重工	341,900	2,878,798.00	0.15
181	002235	安妮股份	271,400	2,876,840.00	0.15

182	002708	光洋股份	259,800	2,865,594.00	0.14
183	300288	朗玛信息	189,400	2,861,834.00	0.14
184	300790	宇瞳光学	136,800	2,860,488.00	0.14
185	002639	雪人集团	273,500	2,858,075.00	0.14
186	002301	齐心集团	400,500	2,855,565.00	0.14
187	002122	汇洲智能	683,700	2,851,029.00	0.14
188	300654	世纪天鸿	271,700	2,847,416.00	0.14
189	002106	莱宝高科	273,500	2,830,725.00	0.14
190	605300	佳禾食品	201,741	2,826,391.41	0.14
191	688135	利扬芯片	136,219	2,821,095.49	0.14
192	300430	诚益通	134,900	2,812,665.00	0.14
193	688015	交控科技	134,811	2,809,461.24	0.14
194	300485	赛升药业	205,100	2,807,819.00	0.14
195	002515	金字火腿	478,572	2,804,431.92	0.14
196	002055	得润电子	383,000	2,795,900.00	0.14
197	002394	联发股份	339,400	2,793,262.00	0.14
198	300581	晨曦航空	136,400	2,792,108.00	0.14
199	002346	柘中股份	205,100	2,789,360.00	0.14
200	300304	云意电气	382,900	2,787,512.00	0.14
201	300222	科大智能	273,500	2,786,965.00	0.14
202	300063	天龙集团	324,000	2,786,400.00	0.14
203	300007	汉威科技	68,400	2,777,040.00	0.14
204	300563	神宇股份	68,400	2,774,304.00	0.14
205	300831	派瑞股份	189,600	2,773,848.00	0.14
206	603367	辰欣药业	197,800	2,773,156.00	0.14
207	688518	联赢激光	135,999	2,773,019.61	0.14
208	600101	明星电力	271,480	2,769,096.00	0.14
209	605016	百龙创园	134,056	2,765,575.28	0.14
210	002285	世联行	1,211,400	2,761,992.00	0.14
211	002367	康力电梯	392,300	2,757,869.00	0.14
212	300551	古鳌科技	255,400	2,748,104.00	0.14
213	002765	蓝黛科技	205,100	2,746,289.00	0.14
214	002860	星帅尔	205,100	2,736,034.00	0.14
215	300149	睿智医药	258,000	2,734,800.00	0.14
216	301051	信濠光电	136,748	2,728,122.60	0.14
217	600979	广安爱众	540,500	2,724,120.00	0.14
218	300471	厚普股份	255,400	2,717,456.00	0.14
219	300189	神农种业	613,700	2,712,554.00	0.14
220	300139	晓程科技	134,900	2,711,490.00	0.14
221	000592	平潭发展	888,800	2,710,840.00	0.14
222	002448	中原内配	323,800	2,710,206.00	0.14
223	002845	同兴达	189,500	2,709,850.00	0.14
224	000417	合百集团	478,600	2,708,876.00	0.14

225	603010	万盛股份	271,800	2,701,692.00	0.14
226	300606	金太阳	136,800	2,697,696.00	0.14
227	601929	吉视传媒	1,488,500	2,694,185.00	0.14
228	002846	英联股份	134,921	2,693,023.16	0.14
229	688299	长阳科技	136,022	2,689,154.94	0.14
230	603322	超讯通信	68,000	2,684,640.00	0.14
231	002965	祥鑫科技	68,400	2,682,648.00	0.14
232	002540	亚太科技	459,900	2,681,217.00	0.14
233	002328	新朋股份	460,500	2,680,110.00	0.14
234	300584	海辰药业	67,600	2,674,932.00	0.13
235	301185	鸥玛软件	136,500	2,671,305.00	0.13
236	300709	精研科技	68,400	2,671,020.00	0.13
237	601579	会稽山	134,100	2,669,931.00	0.13
238	300566	激智科技	136,800	2,666,232.00	0.13
239	600230	沧州大化	253,200	2,666,196.00	0.13
240	002533	金杯电工	273,500	2,663,890.00	0.13
241	300719	安达维尔	136,800	2,660,760.00	0.13
242	300354	东华测试	68,400	2,659,392.00	0.13
243	600353	旭光电子	198,700	2,650,658.00	0.13
244	300815	玉禾田	128,900	2,648,895.00	0.13
245	000949	新乡化纤	683,700	2,645,919.00	0.13
246	000815	美利云	205,100	2,645,790.00	0.13
247	603569	长久物流	338,100	2,637,180.00	0.13
248	002471	中超控股	543,300	2,635,005.00	0.13
249	300145	南方泵业	752,100	2,632,350.00	0.13
250	603918	金桥信息	131,600	2,630,684.00	0.13
251	000551	创元科技	204,600	2,629,110.00	0.13
252	300867	圣元环保	136,800	2,623,824.00	0.13
253	688292	浩瀚深度	136,277	2,621,969.48	0.13
254	002570	贝因美	410,200	2,617,076.00	0.13
255	605286	同力日升	66,034	2,616,267.08	0.13
256	300491	通合科技	136,800	2,612,880.00	0.13
257	300745	欣锐科技	136,800	2,611,512.00	0.13
258	300173	福能东方	410,200	2,600,668.00	0.13
259	300307	慈星股份	325,000	2,596,750.00	0.13
260	301018	申菱环境	68,400	2,595,096.00	0.13
261	300680	隆盛科技	68,400	2,593,044.00	0.13
262	000880	潍柴重机	68,400	2,586,888.00	0.13
263	600742	富维股份	271,500	2,581,965.00	0.13
264	000886	海南高速	383,400	2,576,448.00	0.13
265	002685	华东重机	341,900	2,574,507.00	0.13
266	300410	正业科技	341,100	2,571,894.00	0.13
267	300809	华辰装备	68,400	2,570,472.00	0.13

268	300041	回天新材	272,600	2,567,892.00	0.13
269	688179	阿拉丁	201,751	2,566,272.72	0.13
270	002483	润邦股份	410,200	2,563,750.00	0.13
271	000833	粤桂股份	205,100	2,561,699.00	0.13
272	688148	芳源股份	472,613	2,556,836.33	0.13
273	300310	宜通世纪	383,100	2,547,615.00	0.13
274	601177	杭齿前进	136,000	2,547,280.00	0.13
275	688697	纽威数控	190,411	2,540,082.74	0.13
276	603960	克来机电	135,200	2,537,704.00	0.13
277	002169	智光电气	392,100	2,536,887.00	0.13
278	603078	江化微	136,000	2,535,040.00	0.13
279	002940	昂利康	68,300	2,534,613.00	0.13
280	000912	泸天化	547,000	2,527,140.00	0.13
281	000900	现代投资	596,300	2,522,349.00	0.13
282	002519	银河电子	451,200	2,522,208.00	0.13
283	600686	金龙汽车	203,300	2,520,920.00	0.13
284	600605	汇通能源	67,600	2,520,804.00	0.13
285	002997	瑞鹄模具	68,400	2,520,540.00	0.13
286	002342	巨力索具	410,200	2,514,526.00	0.13
287	002057	中钢天源	270,500	2,512,945.00	0.13
288	300399	天利科技	68,400	2,503,440.00	0.13
289	000859	国风新材	341,900	2,495,870.00	0.13
290	688653	康希通信	203,491	2,492,764.75	0.13
291	300201	海伦哲	452,000	2,490,520.00	0.13
292	300452	山河药辅	202,815	2,488,540.05	0.13
293	000925	众合科技	323,900	2,487,552.00	0.13
294	002565	顺灏股份	405,700	2,486,941.00	0.13
295	300138	晨光生物	205,100	2,485,812.00	0.13
296	600784	鲁银投资	387,800	2,481,920.00	0.13
297	601199	江南水务	469,791	2,480,496.48	0.13
298	002165	红宝丽	269,700	2,478,543.00	0.12
299	300213	佳讯飞鸿	273,500	2,475,175.00	0.12
300	600794	保税科技	464,100	2,473,653.00	0.12
301	002277	友阿股份	410,200	2,465,302.00	0.12
302	603199	九华旅游	68,000	2,464,320.00	0.12
303	300708	聚灿光电	205,100	2,461,200.00	0.12
304	002361	神剑股份	392,200	2,459,094.00	0.12
305	600292	远达环保	203,900	2,459,034.00	0.12
306	000670	盈方微	341,900	2,458,261.00	0.12
307	002014	永新股份	202,800	2,457,936.00	0.12
308	603660	苏州科达	339,900	2,457,477.00	0.12
309	300436	广生堂	68,200	2,448,380.00	0.12
310	603811	诚意药业	265,100	2,446,873.00	0.12

311	601789	宁波建工	440,400	2,444,220.00	0.12
312	300499	高澜股份	136,800	2,435,040.00	0.12
313	000973	佛塑科技	341,900	2,434,328.00	0.12
314	300582	英飞特	189,500	2,429,390.00	0.12
315	002117	东港股份	205,100	2,428,384.00	0.12
316	301263	泰恩康	68,400	2,420,676.00	0.12
317	300081	恒信东方	341,900	2,420,652.00	0.12
318	002455	百川股份	323,400	2,419,032.00	0.12
319	603319	湘油泵	68,000	2,408,560.00	0.12
320	600351	亚宝药业	396,600	2,407,362.00	0.12
321	300384	三联虹普	136,800	2,406,312.00	0.12
322	605098	行动教育	67,100	2,400,838.00	0.12
323	301030	仕净科技	136,780	2,400,489.00	0.12
324	300067	安诺其	410,200	2,399,670.00	0.12
325	605167	利柏特	197,300	2,399,168.00	0.12
326	300546	雄帝科技	66,500	2,384,690.00	0.12
327	002547	春兴精工	505,200	2,384,544.00	0.12
328	688711	宏微科技	135,354	2,380,876.86	0.12
329	605377	华旺科技	270,112	2,379,686.72	0.12
330	301076	新瀚新材	68,400	2,378,952.00	0.12
331	002526	山东矿机	615,300	2,375,058.00	0.12
332	002386	天原股份	478,600	2,373,856.00	0.12
333	300328	宜安科技	205,100	2,373,007.00	0.12
334	002225	濮耐股份	478,600	2,369,070.00	0.12
335	002401	中远海科	136,400	2,367,904.00	0.12
336	000036	华联控股	647,700	2,364,105.00	0.12
337	600684	珠江股份	532,300	2,358,089.00	0.12
338	603969	银龙股份	321,303	2,355,150.99	0.12
339	300252	金信诺	205,100	2,354,548.00	0.12
340	002669	康达新材	202,700	2,351,320.00	0.12
341	600571	信雅达	136,000	2,347,360.00	0.12
342	003015	日久光电	136,800	2,346,120.00	0.12
343	002103	广博股份	204,500	2,345,615.00	0.12
344	600180	瑞茂通	527,337	2,341,376.28	0.12
345	002521	齐峰新材	255,600	2,336,184.00	0.12
346	000523	红棉股份	716,000	2,334,160.00	0.12
347	002575	群兴玩具	273,501	2,327,493.51	0.12
348	002512	达华智能	460,800	2,327,040.00	0.12
349	600619	海立股份	203,900	2,326,499.00	0.12
350	002491	通鼎互联	408,400	2,319,712.00	0.12
351	600278	东方创业	322,400	2,318,056.00	0.12
352	300005	探路者	271,700	2,317,601.00	0.12
353	300153	科泰电源	68,400	2,315,340.00	0.12

354	600187	国中水务	711,600	2,312,700.00	0.12
355	603339	四方科技	192,100	2,305,200.00	0.12
356	300700	岱勒新材	204,640	2,304,246.40	0.12
357	600368	五洲交通	542,200	2,298,928.00	0.12
358	600495	晋西车轴	459,500	2,297,500.00	0.12
359	600212	绿能慧充	271,900	2,294,836.00	0.12
360	002474	榕基软件	323,300	2,292,197.00	0.12
361	301266	宇邦新材	68,370	2,285,609.10	0.12
362	301278	快可电子	68,450	2,281,438.50	0.12
363	002167	东方锆业	204,800	2,279,424.00	0.11
364	300533	冰川网络	68,200	2,278,562.00	0.11
365	600624	复旦复华	321,700	2,274,419.00	0.11
366	300071	福石控股	451,700	2,272,051.00	0.11
367	603357	设计总院	261,601	2,265,464.66	0.11
368	002375	亚厦股份	587,800	2,263,030.00	0.11
369	300806	斯迪克	136,800	2,257,200.00	0.11
370	300465	高伟达	136,400	2,254,692.00	0.11
371	002733	雄韬股份	136,800	2,253,096.00	0.11
372	002523	天桥起重	615,300	2,245,845.00	0.11
373	002732	燕塘乳业	136,300	2,244,861.00	0.11
374	300622	博士眼镜	64,490	2,242,317.30	0.11
375	000957	中通客车	204,900	2,239,557.00	0.11
376	002279	久其软件	341,900	2,239,445.00	0.11
377	300890	翔丰华	68,400	2,235,996.00	0.11
378	002827	高争民爆	68,200	2,235,596.00	0.11
379	000731	四川美丰	323,900	2,234,910.00	0.11
380	300490	华自科技	255,400	2,234,750.00	0.11
381	300174	元力股份	136,800	2,229,840.00	0.11
382	000936	华西股份	323,900	2,228,432.00	0.11
383	605488	福莱新材	68,000	2,225,640.00	0.11
384	300302	同有科技	136,800	2,221,632.00	0.11
385	688512	慧智微	203,491	2,220,086.81	0.11
386	603701	德宏股份	126,647	2,213,789.56	0.11
387	300341	麦克奥迪	136,800	2,213,424.00	0.11
388	603686	福龙马	135,300	2,210,802.00	0.11
389	600035	楚天高速	521,000	2,209,040.00	0.11
390	000920	沃顿科技	204,100	2,204,280.00	0.11
391	600127	金健米业	320,300	2,200,461.00	0.11
392	300291	百纳千成	385,000	2,198,350.00	0.11
393	600526	菲达环保	457,600	2,196,480.00	0.11
394	002298	中电鑫龙	323,400	2,195,886.00	0.11
395	600108	亚盛集团	739,000	2,187,440.00	0.11
396	300025	华星创业	314,900	2,185,406.00	0.11

397	600533	栖霞建设	865,400	2,180,808.00	0.11
398	300688	创业黑马	68,400	2,180,592.00	0.11
399	002628	成都路桥	476,900	2,165,126.00	0.11
400	300473	德尔股份	66,500	2,164,575.00	0.11
401	000576	甘化科工	204,700	2,151,397.00	0.11
402	002884	凌霄泵业	134,900	2,150,306.00	0.11
403	300469	信息发展	68,400	2,147,076.00	0.11
404	600744	华银电力	475,800	2,145,858.00	0.11
405	002819	东方中科	68,400	2,140,920.00	0.11
406	000819	岳阳兴长	136,600	2,137,790.00	0.11
407	002290	禾盛新材	68,400	2,137,500.00	0.11
408	300057	万顺新材	392,100	2,136,945.00	0.11
409	002935	天奥电子	133,280	2,132,480.00	0.11
410	688222	成都先导	132,466	2,130,053.28	0.11
411	300228	富瑞特装	273,100	2,127,449.00	0.11
412	002210	飞马国际	751,200	2,125,896.00	0.11
413	300095	华伍股份	204,900	2,122,764.00	0.11
414	003028	振邦智能	68,370	2,120,153.70	0.11
415	301007	德迈仕	68,400	2,119,716.00	0.11
416	002614	奥佳华	323,900	2,118,306.00	0.11
417	600405	动力源	372,000	2,116,680.00	0.11
418	300486	东杰智能	255,700	2,114,639.00	0.11
419	603703	盛洋科技	203,900	2,114,443.00	0.11
420	600769	祥龙电业	203,800	2,109,330.00	0.11
421	002480	新筑股份	341,900	2,106,104.00	0.11
422	301257	普蕊斯	68,370	2,105,796.00	0.11
423	002009	天奇股份	136,800	2,105,352.00	0.11
424	002522	浙江众成	410,200	2,104,326.00	0.11
425	002042	华孚时尚	460,800	2,101,248.00	0.11
426	300299	富春股份	273,500	2,100,480.00	0.11
426	300507	苏奥传感	273,500	2,100,480.00	0.11
427	300179	四方达	205,100	2,094,071.00	0.11
428	002406	远东传动	273,500	2,086,805.00	0.11
429	300441	鲍斯股份	255,700	2,086,512.00	0.11
430	000532	华金资本	136,400	2,082,828.00	0.10
431	300148	天舟文化	410,200	2,075,612.00	0.10
432	300721	怡达股份	136,800	2,075,256.00	0.10
433	002520	日发精机	323,600	2,067,804.00	0.10
434	300547	川环科技	68,400	2,067,048.00	0.10
435	002449	国星光电	204,900	2,065,392.00	0.10
436	000978	桂林旅游	336,300	2,061,519.00	0.10
437	300032	金龙机电	391,900	2,061,394.00	0.10
438	000906	浙商中拓	323,500	2,060,695.00	0.10

439	600868	梅雁吉祥	746,500	2,060,340.00	0.10
440	603590	康辰药业	65,500	2,059,320.00	0.10
441	000788	北大医药	323,600	2,054,860.00	0.10
442	002146	荣盛发展	1,499,500	2,054,315.00	0.10
443	603982	泉峰汽车	185,400	2,054,232.00	0.10
444	688560	明冠新材	135,400	2,054,018.00	0.10
445	688207	格灵深瞳	135,927	2,052,497.70	0.10
446	300439	美康生物	195,200	2,047,648.00	0.10
447	000505	京粮控股	323,400	2,047,122.00	0.10
448	002536	飞龙股份	136,800	2,046,528.00	0.10
449	300322	硕贝德	136,800	2,045,160.00	0.10
450	300881	盛德鑫泰	68,220	2,037,049.20	0.10
451	601518	吉林高速	743,300	2,036,642.00	0.10
452	002785	万里石	69,200	2,036,556.00	0.10
453	300662	科锐国际	68,400	2,032,164.00	0.10
454	300429	强力新材	136,600	2,028,510.00	0.10
455	300239	东宝生物	341,900	2,027,467.00	0.10
456	300420	五洋自控	588,700	2,025,128.00	0.10
457	002514	宝馨科技	323,900	2,021,136.00	0.10
458	002282	博深股份	269,900	2,016,153.00	0.10
459	603135	中重科技	203,200	2,015,744.00	0.10
460	300543	朗科智能	187,000	2,010,250.00	0.10
461	002067	景兴纸业	520,400	2,008,744.00	0.10
462	688022	瀚川智能	135,518	2,008,376.76	0.10
463	601002	晋亿实业	407,200	2,007,496.00	0.10
464	300795	米奥会展	134,910	2,003,413.50	0.10
465	002590	万安科技	136,800	2,002,752.00	0.10
466	300194	福安药业	473,300	2,002,059.00	0.10
467	301152	天力锂能	68,400	2,001,384.00	0.10
468	002638	勤上股份	759,300	1,996,959.00	0.10
469	600537	亿晶光电	678,700	1,995,378.00	0.10
470	300099	尤洛卡	271,800	1,995,012.00	0.10
471	603366	日出东方	197,995	1,991,829.70	0.10
472	600520	文一科技	68,000	1,986,280.00	0.10
473	605058	澳弘电子	64,900	1,983,344.00	0.10
474	002731	萃华珠宝	135,700	1,981,220.00	0.10
475	688365	光云科技	130,149	1,980,867.78	0.10
476	301060	兰卫医学	205,100	1,979,215.00	0.10
477	002676	顺威股份	273,700	1,978,851.00	0.10
478	002132	恒星科技	546,200	1,977,244.00	0.10
479	002246	北化股份	134,800	1,970,776.00	0.10
480	300756	金马游乐	68,300	1,959,527.00	0.10
481	000078	海王生物	808,600	1,956,812.00	0.10

482	002559	亚威股份	204,900	1,956,795.00	0.10
483	001215	千味央厨	68,395	1,948,573.55	0.10
484	300056	中创环保	136,100	1,946,230.00	0.10
485	000404	长虹华意	273,000	1,938,300.00	0.10
486	600279	重庆港	338,800	1,934,548.00	0.10
487	605128	上海沿浦	63,822	1,931,253.72	0.10
488	300111	向日葵	588,600	1,930,608.00	0.10
489	300619	金银河	68,426	1,926,876.16	0.10
490	003002	壶化股份	68,400	1,924,776.00	0.10
491	600668	尖峰集团	135,900	1,922,985.00	0.10
492	000713	丰乐种业	273,500	1,922,705.00	0.10
493	002552	宝鼎科技	135,300	1,917,201.00	0.10
494	002369	卓翼科技	205,100	1,909,481.00	0.10
495	002218	拓日新能	588,700	1,907,388.00	0.10
496	301011	华立科技	66,451	1,907,143.70	0.10
497	002632	道明光学	204,600	1,902,780.00	0.10
498	300396	迪瑞医疗	136,400	1,895,960.00	0.10
499	003029	吉大正元	59,600	1,895,280.00	0.10
500	002431	棕榈股份	799,000	1,893,630.00	0.10
501	000751	锌业股份	602,600	1,892,164.00	0.10
502	300681	英搏尔	68,400	1,891,944.00	0.10
503	300094	国联水产	520,300	1,888,689.00	0.10
504	002337	赛象科技	323,400	1,888,656.00	0.10
505	000520	凤凰航运	368,500	1,886,720.00	0.10
506	605305	中际联合	67,900	1,886,262.00	0.10
507	002196	方正电机	205,100	1,880,767.00	0.09
508	688509	正元地信	438,338	1,880,470.02	0.09
509	600658	电子城	407,800	1,875,880.00	0.09
510	600121	郑州煤电	475,800	1,874,652.00	0.09
511	601113	华鼎股份	473,700	1,871,115.00	0.09
512	000862	银星能源	341,900	1,870,193.00	0.09
513	002224	三力士	409,700	1,868,232.00	0.09
514	301302	华如科技	67,900	1,867,929.00	0.09
515	301226	祥明智能	68,100	1,864,578.00	0.09
516	600628	新世界	253,400	1,854,888.00	0.09
517	600336	澳柯玛	271,900	1,854,358.00	0.09
518	002348	高乐股份	451,700	1,851,970.00	0.09
519	600545	卓郎智能	820,300	1,845,675.00	0.09
520	002300	太阳电缆	269,300	1,844,705.00	0.09
521	600300	维维股份	542,100	1,843,140.00	0.09
522	688488	艾迪药业	132,975	1,841,703.75	0.09
523	301379	天山电子	68,400	1,841,328.00	0.09
524	000931	中 关 村	338,700	1,839,141.00	0.09

525	603333	尚纬股份	245,300	1,834,844.00	0.09
526	002365	永安药业	68,400	1,829,700.00	0.09
527	600698	湖南天雁	200,100	1,820,910.00	0.09
528	300632	光莆股份	136,300	1,819,605.00	0.09
529	600203	福日电子	194,200	1,817,712.00	0.09
530	603711	香飘飘	130,083	1,815,958.68	0.09
531	002769	普路通	186,900	1,809,192.00	0.09
532	300317	珈伟新能	436,900	1,808,766.00	0.09
533	300862	蓝盾光电	68,300	1,808,584.00	0.09
534	300161	华中数控	68,200	1,806,618.00	0.09
535	002094	青岛金王	204,900	1,803,120.00	0.09
536	300909	汇创达	68,200	1,801,162.00	0.09
537	002725	跃岭股份	136,200	1,795,116.00	0.09
538	300510	金冠股份	391,600	1,793,528.00	0.09
539	000852	石化机械	273,160	1,791,929.60	0.09
540	002321	华英农业	752,100	1,774,956.00	0.09
541	002655	共达电声	136,800	1,772,928.00	0.09
542	002184	海得控制	134,900	1,767,190.00	0.09
543	002112	三变科技	136,400	1,766,380.00	0.09
544	002587	奥拓电子	273,500	1,764,075.00	0.09
545	603380	易德龙	66,200	1,760,920.00	0.09
546	002033	丽江股份	201,800	1,759,696.00	0.09
547	300683	海特生物	68,400	1,757,880.00	0.09
548	603035	常熟汽饰	131,900	1,754,270.00	0.09
549	002350	北京科锐	255,600	1,753,416.00	0.09
550	300647	超频三	270,700	1,751,429.00	0.09
551	002923	润都股份	136,700	1,749,760.00	0.09
552	600620	天宸股份	320,300	1,748,838.00	0.09
553	300537	广信材料	68,200	1,747,966.00	0.09
554	601956	东贝集团	268,800	1,747,200.00	0.09
555	000610	西安旅游	136,800	1,745,568.00	0.09
556	300110	华仁药业	540,000	1,744,200.00	0.09
557	000882	华联股份	888,800	1,742,048.00	0.09
558	300345	华民股份	204,400	1,733,312.00	0.09
559	002766	索菱股份	323,400	1,730,190.00	0.09
560	603015	弘讯科技	136,000	1,728,560.00	0.09
561	600960	渤海汽车	319,900	1,727,460.00	0.09
562	300004	南风股份	205,100	1,724,891.00	0.09
563	300940	南极光	68,300	1,724,575.00	0.09
564	000421	南京公用	262,400	1,723,968.00	0.09
565	300404	博济医药	186,900	1,723,218.00	0.09
566	603315	福鞍股份	136,000	1,721,760.00	0.09
567	002876	三利谱	68,300	1,720,477.00	0.09

568	600629	华建集团	203,900	1,718,877.00	0.09
569	300565	科信技术	135,200	1,714,336.00	0.09
570	000151	中成股份	136,800	1,712,736.00	0.09
571	002178	延华智能	273,500	1,712,110.00	0.09
572	002599	盛通股份	205,100	1,708,483.00	0.09
573	603626	科森科技	202,600	1,705,892.00	0.09
574	002479	富春环保	340,100	1,703,901.00	0.09
575	605366	宏柏新材	271,900	1,702,094.00	0.09
576	603825	华扬联众	133,900	1,700,530.00	0.09
577	002469	三维化学	204,600	1,700,226.00	0.09
578	301248	杰创智能	68,300	1,699,304.00	0.09
579	601388	怡球资源	673,400	1,696,968.00	0.09
580	600824	益民集团	406,900	1,696,773.00	0.09
581	603867	新化股份	66,200	1,693,396.00	0.09
582	300221	银禧科技	204,000	1,693,200.00	0.09
583	000816	智慧农业	546,000	1,692,600.00	0.09
584	300411	金盾股份	136,600	1,689,742.00	0.09
585	000753	漳州发展	341,400	1,683,102.00	0.08
586	300631	久吾高科	68,400	1,679,904.00	0.08
587	300042	朗科科技	67,900	1,679,846.00	0.08
588	300520	科大国创	67,600	1,676,480.00	0.08
589	301282	金禄电子	67,600	1,675,804.00	0.08
590	603665	康隆达	67,500	1,672,650.00	0.08
591	000716	黑芝麻	271,200	1,670,592.00	0.08
592	688238	和元生物	269,204	1,669,064.80	0.08
593	000601	韶能股份	341,400	1,659,204.00	0.08
594	600807	济南高新	542,200	1,659,132.00	0.08
595	300900	广联航空	68,360	1,659,097.20	0.08
596	600630	龙头股份	202,200	1,658,040.00	0.08
597	002380	科远智慧	67,600	1,652,820.00	0.08
598	002269	美邦服饰	888,800	1,644,280.00	0.08
599	002331	皖通科技	204,100	1,643,005.00	0.08
600	300107	建新股份	205,100	1,642,851.00	0.08
601	000659	珠海中富	554,500	1,641,320.00	0.08
602	002297	博云新材	204,400	1,635,200.00	0.08
603	603601	再升科技	402,400	1,633,744.00	0.08
604	300684	中石科技	68,300	1,631,004.00	0.08
605	300018	中元股份	205,100	1,630,545.00	0.08
606	300164	通源石油	270,800	1,630,216.00	0.08
607	300791	仙乐健康	68,376	1,628,032.56	0.08
608	002869	金溢科技	68,000	1,627,240.00	0.08
609	002813	路畅科技	68,400	1,627,236.00	0.08
610	300542	新晨科技	67,900	1,611,946.00	0.08

611	300853	申昊科技	67,600	1,608,880.00	0.08
612	002560	通达股份	203,600	1,608,440.00	0.08
613	600512	腾达建设	709,000	1,602,340.00	0.08
614	600858	银座股份	267,400	1,601,726.00	0.08
615	002323	雅博股份	1,026,000	1,600,560.00	0.08
616	300611	美力科技	68,400	1,593,036.00	0.08
617	000812	陕西金叶	338,700	1,588,503.00	0.08
618	301118	恒光股份	67,900	1,586,823.00	0.08
619	300639	凯普生物	273,500	1,586,300.00	0.08
620	300247	融捷健康	406,000	1,583,400.00	0.08
621	300812	易天股份	68,400	1,580,724.00	0.08
622	002667	威领股份	134,900	1,576,981.00	0.08
623	002593	日上集团	323,400	1,574,958.00	0.08
624	300264	佳创视讯	246,800	1,574,584.00	0.08
625	600860	京城股份	136,000	1,573,520.00	0.08
626	002198	嘉应制药	255,600	1,571,940.00	0.08
627	300903	科翔股份	135,200	1,569,672.00	0.08
628	002022	科华生物	255,600	1,569,384.00	0.08
629	603628	清源股份	128,400	1,567,764.00	0.08
630	300963	中洲特材	68,400	1,566,360.00	0.08
631	000014	沙河股份	135,200	1,564,264.00	0.08
632	002134	天津普林	68,400	1,559,520.00	0.08
633	300162	雷曼光电	205,100	1,558,760.00	0.08
634	002445	中南文化	607,100	1,548,105.00	0.08
635	300603	立昂技术	136,800	1,545,840.00	0.08
636	000677	恒天海龙	273,500	1,545,275.00	0.08
637	002952	亚世光电	68,400	1,544,472.00	0.08
638	603818	曲美家居	299,600	1,539,944.00	0.08
639	002551	尚荣医疗	408,100	1,534,456.00	0.08
640	600379	宝光股份	132,138	1,531,479.42	0.08
641	600503	华丽家族	607,400	1,524,574.00	0.08
642	002296	辉煌科技	136,600	1,523,090.00	0.08
643	603629	利通电子	67,600	1,521,000.00	0.08
644	600665	天地源	453,800	1,520,230.00	0.08
645	002362	汉王科技	67,600	1,515,592.00	0.08
646	600758	辽宁能源	404,500	1,512,830.00	0.08
647	605166	聚合顺	135,100	1,511,769.00	0.08
648	300515	三德科技	67,600	1,510,860.00	0.08
649	603168	莎普爱思	203,900	1,506,821.00	0.08
650	603687	大胜达	202,500	1,504,575.00	0.08
651	601010	文峰股份	543,000	1,498,680.00	0.08
652	300066	三川智慧	338,500	1,496,170.00	0.08
653	300503	昊志机电	67,600	1,495,988.00	0.08

654	002272	川润股份	135,200	1,495,312.00	0.08
655	688108	赛诺医疗	133,217	1,494,694.74	0.08
656	002148	北纬科技	205,100	1,493,128.00	0.08
657	300479	神思电子	67,600	1,491,932.00	0.08
658	000838	财信发展	573,100	1,490,060.00	0.08
659	300636	同和药业	193,600	1,486,848.00	0.07
660	603992	松霖科技	68,000	1,486,480.00	0.07
661	002546	新联电子	270,600	1,485,594.00	0.07
662	688579	山大地纬	132,549	1,483,223.31	0.07
663	301201	诚达药业	67,686	1,483,000.26	0.07
664	300629	新劲刚	68,300	1,481,427.00	0.07
665	601116	三江购物	135,800	1,478,862.00	0.07
666	301518	长华化学	68,300	1,477,329.00	0.07
667	300335	迪森股份	270,500	1,476,930.00	0.07
668	605066	天正电气	198,150	1,476,217.50	0.07
669	000911	广农糖业	203,000	1,475,810.00	0.07
670	600622	光大嘉宝	506,700	1,474,497.00	0.07
671	600616	金枫酒业	260,000	1,471,600.00	0.07
672	603706	东方环宇	68,000	1,464,720.00	0.07
673	603630	拉芳家化	64,994	1,457,165.48	0.07
674	002418	康盛股份	410,200	1,456,210.00	0.07
675	000797	中国武夷	541,000	1,455,290.00	0.07
676	600293	三峡新材	475,142	1,453,934.52	0.07
677	300467	迅游科技	67,600	1,451,372.00	0.07
678	603012	创力集团	262,200	1,449,966.00	0.07
679	300423	昇辉科技	205,100	1,443,904.00	0.07
680	301218	华是科技	67,600	1,441,232.00	0.07
681	000863	三湘印象	410,200	1,439,802.00	0.07
682	600237	铜峰电子	198,300	1,437,675.00	0.07
683	002902	铭普光磁	67,600	1,435,824.00	0.07
684	000533	顺钠股份	205,100	1,429,547.00	0.07
685	002553	南方精工	66,500	1,428,420.00	0.07
686	300466	赛摩智能	136,800	1,426,824.00	0.07
687	605186	健麾信息	68,000	1,423,920.00	0.07
688	300578	会畅通讯	67,900	1,423,863.00	0.07
689	600818	中路股份	126,400	1,422,000.00	0.07
690	300572	安车检测	67,600	1,419,600.00	0.07
691	600222	太龙药业	252,700	1,412,593.00	0.07
692	688609	九联科技	134,642	1,409,701.74	0.07
693	600189	泉阳泉	194,690	1,409,555.60	0.07
694	603611	诺力股份	65,400	1,408,716.00	0.07
695	300279	和晶科技	202,500	1,403,325.00	0.07
696	605266	健之佳	66,603	1,400,661.09	0.07

697	301120	新特电气	136,550	1,398,272.00	0.07
698	002208	合肥城建	199,300	1,395,100.00	0.07
699	603878	武进不锈	257,300	1,394,566.00	0.07
700	600501	航天晨光	68,000	1,393,320.00	0.07
701	600558	大西洋	267,359	1,390,266.80	0.07
702	300645	正元智慧	67,600	1,385,124.00	0.07
703	300375	鹏翎股份	270,600	1,382,766.00	0.07
704	002377	国创高新	465,400	1,382,238.00	0.07
705	300796	贝斯美	133,600	1,377,416.00	0.07
706	002666	德联集团	270,600	1,377,354.00	0.07
707	000510	新金路	270,500	1,376,845.00	0.07
708	300062	中能电气	255,400	1,374,052.00	0.07
709	600479	千金药业	132,000	1,372,800.00	0.07
710	002374	中锐股份	459,900	1,370,502.00	0.07
711	002659	凯文教育	271,800	1,369,872.00	0.07
712	603222	济民医疗	199,520	1,366,712.00	0.07
713	301012	扬电科技	68,380	1,360,762.00	0.07
714	002082	万邦德	202,900	1,359,430.00	0.07
715	300938	信测标准	64,467	1,354,451.67	0.07
716	000509	华塑控股	406,000	1,351,980.00	0.07
717	002584	西陇科学	136,600	1,348,242.00	0.07
718	600661	昂立教育	126,400	1,346,160.00	0.07
719	300556	丝路视觉	67,600	1,343,212.00	0.07
720	301046	能辉科技	67,543	1,340,728.55	0.07
721	300365	恒华科技	202,800	1,336,452.00	0.07
722	600830	香溢融通	131,302	1,328,776.24	0.07
723	300426	华智数媒	135,200	1,322,256.00	0.07
724	000639	西王食品	410,200	1,320,844.00	0.07
725	002686	亿利达	202,800	1,320,228.00	0.07
726	600327	大东方	271,400	1,316,290.00	0.07
727	300534	陇神戎发	135,900	1,312,794.00	0.07
728	600162	香江控股	804,000	1,310,520.00	0.07
729	002329	皇氏集团	372,200	1,310,144.00	0.07
730	300691	联合光电	68,400	1,309,860.00	0.07
731	002995	天地在线	67,600	1,308,060.00	0.07
732	002213	大为股份	67,600	1,305,356.00	0.07
733	002393	力生制药	68,300	1,301,798.00	0.07
734	002682	龙洲股份	271,700	1,301,443.00	0.07
735	002090	金智科技	135,300	1,296,174.00	0.07
736	002852	道道全	135,300	1,293,468.00	0.07
737	002264	新华都	202,900	1,288,415.00	0.06
738	300434	金石亚药	133,900	1,288,118.00	0.06
739	603518	锦泓集团	130,100	1,285,388.00	0.06

740	002757	南兴股份	67,600	1,281,696.00	0.06
741	300501	海顺新材	67,600	1,278,992.00	0.06
742	300505	川金诺	68,300	1,277,210.00	0.06
743	002688	金河生物	205,100	1,273,671.00	0.06
744	002420	毅昌科技	203,000	1,266,720.00	0.06
745	000153	丰原药业	204,900	1,264,233.00	0.06
746	603117	ST 万林	203,300	1,260,460.00	0.06
747	600513	联环药业	125,500	1,258,765.00	0.06
748	002866	传艺科技	68,400	1,257,876.00	0.06
749	002687	乔治白	270,482	1,255,036.48	0.06
750	603656	泰禾智能	68,000	1,254,600.00	0.06
751	002734	利民股份	68,400	1,251,720.00	0.06
752	603429	集友股份	133,300	1,249,021.00	0.06
753	600730	中国高科	199,600	1,247,500.00	0.06
754	002786	银宝山新	135,300	1,247,466.00	0.06
755	002037	保利联合	136,300	1,245,782.00	0.06
756	300713	英可瑞	67,600	1,239,784.00	0.06
757	600354	敦煌种业	200,000	1,238,000.00	0.06
758	603178	圣龙股份	67,100	1,229,943.00	0.06
759	002441	众业达	135,300	1,227,171.00	0.06
760	301305	朗坤科技	68,300	1,225,985.00	0.06
761	300259	新天科技	341,400	1,211,970.00	0.06
762	002343	慈文传媒	136,400	1,201,684.00	0.06
763	600853	龙建股份	339,400	1,201,476.00	0.06
764	603916	苏博特	132,500	1,200,450.00	0.06
765	000635	英力特	135,200	1,199,224.00	0.06
766	605068	明新旭腾	66,700	1,198,599.00	0.06
767	002395	双象股份	67,600	1,196,520.00	0.06
768	000530	冰山冷热	202,200	1,195,002.00	0.06
769	002248	华东数控	136,300	1,192,625.00	0.06
770	600218	全柴动力	132,800	1,191,216.00	0.06
771	000570	苏常柴 A	204,400	1,183,476.00	0.06
772	600439	瑞贝卡	331,000	1,181,670.00	0.06
773	300583	赛托生物	68,400	1,179,216.00	0.06
774	002712	思美传媒	200,200	1,175,174.00	0.06
775	002799	环球印务	135,200	1,165,424.00	0.06
776	000721	西安饮食	135,300	1,164,933.00	0.06
777	603036	如通股份	68,000	1,164,840.00	0.06
778	000010	美丽生态	384,900	1,158,549.00	0.06
779	000037	深南电 A	135,200	1,157,312.00	0.06
780	600249	两面针	199,500	1,153,110.00	0.06
781	301013	利和兴	67,900	1,150,905.00	0.06
782	000159	国际实业	202,800	1,147,848.00	0.06

783	002561	徐家汇	134,800	1,139,060.00	0.06
784	002771	真视通	68,300	1,137,878.00	0.06
785	600653	中华控股	600,500	1,128,940.00	0.06
786	300650	太龙股份	67,600	1,128,920.00	0.06
787	300540	蜀道装备	68,380	1,122,799.60	0.06
788	603499	翔港科技	68,000	1,121,320.00	0.06
789	600239	ST 云城	473,700	1,117,932.00	0.06
790	603110	东方材料	68,000	1,107,040.00	0.06
791	002021	中捷资源	478,600	1,105,566.00	0.06
792	600159	大龙地产	398,800	1,096,700.00	0.06
793	600560	金自天正	67,000	1,084,060.00	0.05
794	600838	上海九百	133,800	1,082,442.00	0.05
795	300538	同益股份	68,200	1,078,924.00	0.05
796	300667	必创科技	68,300	1,078,457.00	0.05
797	300504	天邑股份	68,300	1,077,774.00	0.05
798	300374	中铁装配	67,300	1,070,070.00	0.05
799	300730	科创信息	67,600	1,068,756.00	0.05
800	601798	蓝科高新	133,700	1,064,252.00	0.05
801	002875	安奈儿	68,300	1,060,016.00	0.05
802	300786	国林科技	68,100	1,056,231.00	0.05
803	002772	众兴菌业	135,200	1,055,912.00	0.05
804	002849	威星智能	67,600	1,054,560.00	0.05
805	300412	迦南科技	204,400	1,038,352.00	0.05
806	002548	金新农	271,800	1,032,840.00	0.05
807	002363	隆基机械	135,300	1,029,633.00	0.05
808	300933	中辰股份	135,400	1,027,686.00	0.05
809	300612	宣亚国际	67,700	1,022,270.00	0.05
810	000782	恒申新材	202,800	1,016,028.00	0.05
811	002735	王子新材	68,400	1,013,004.00	0.05
812	000698	沈阳化工	265,600	1,011,936.00	0.05
813	600215	派斯林	132,400	1,003,592.00	0.05
814	600540	新赛股份	196,200	981,000.00	0.05
815	600257	大湖股份	189,900	979,884.00	0.05
816	600280	中央商场	269,500	975,590.00	0.05
817	002805	丰元股份	67,900	957,390.00	0.05
818	002729	好利科技	68,300	956,200.00	0.05
819	000955	欣龙控股	201,700	947,990.00	0.05
820	300707	威唐工业	68,100	940,461.00	0.05
821	002451	摩恩电气	135,300	937,629.00	0.05
822	600721	百花医药	128,700	935,649.00	0.05
823	001219	青岛食品	68,320	930,518.40	0.05
824	300249	依米康	67,900	926,156.00	0.05
825	000514	渝 开 发	202,800	918,684.00	0.05

826	000850	华茂股份	204,900	913,854.00	0.05
827	300560	中富通	67,600	913,276.00	0.05
828	300884	狄耐克	67,600	907,192.00	0.05
829	300275	梅安森	68,400	904,248.00	0.05
830	000428	华天酒店	268,800	892,416.00	0.04
831	603330	天洋新材	130,300	883,434.00	0.04
832	300277	海联讯	68,434	877,323.88	0.04
833	300778	新城市	67,600	863,928.00	0.04
834	300986	志特新材	68,400	861,840.00	0.04
835	603999	读者传媒	130,300	861,283.00	0.04
836	002702	海欣食品	205,100	857,318.00	0.04
837	000926	福星股份	398,600	853,004.00	0.04
838	600613	神奇制药	131,700	850,782.00	0.04
839	603318	水发燃气	128,100	844,179.00	0.04
840	600573	惠泉啤酒	67,300	822,406.00	0.04
841	002796	世嘉科技	68,400	807,120.00	0.04
842	603917	合力科技	59,500	805,630.00	0.04
843	000790	华神科技	202,000	783,760.00	0.04
844	002286	保龄宝	68,400	774,972.00	0.04
845	600785	新华百货	65,900	773,007.00	0.04
846	000715	中兴商业	134,840	772,633.20	0.04
847	600683	京投发展	194,100	747,285.00	0.04
848	603165	荣晟环保	65,600	740,624.00	0.04
849	300086	康芝药业	135,300	734,679.00	0.04
850	002968	新大正	68,300	704,856.00	0.04
851	603778	乾景园林	191,400	643,104.00	0.03
852	002873	新天药业	68,400	638,856.00	0.03
853	300437	清水源	68,400	620,388.00	0.03
854	603017	中衡设计	61,500	597,165.00	0.03
855	603779	威龙股份	62,700	465,861.00	0.02

注：上述股票价值不包括可退替代估增。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300225	*ST 金泰	267,700	1,129,694.00	0.06
2	300280	*ST 紫天	103,800	907,212.00	0.05
3	688775	影石创新	573	71,143.68	0.00
4	688411	海博思创	560	46,754.40	0.00
5	001391	国货航	4,686	31,536.78	0.00
6	688545	兴福电子	994	26,788.30	0.00
7	301458	钧崴电子	701	23,911.11	0.00
8	301275	汉朔科技	397	22,307.43	0.00

9	688583	思看科技	227	18,087.36	0.00
10	301678	新恒汇	382	17,014.28	0.00
11	301602	超研股份	658	16,318.40	0.00
12	301501	恒鑫生活	349	15,781.78	0.00
13	001388	信通电子	937	15,385.54	0.00
14	603202	天有为	166	15,049.56	0.00
15	301479	弘景光电	182	14,172.34	0.00
16	301535	浙江华远	734	13,938.66	0.00
17	688757	胜科纳米	536	13,903.84	0.00
18	688758	赛分科技	777	13,185.69	0.00
19	603072	天和磁材	226	12,305.70	0.00
20	301662	宏工科技	143	11,797.50	0.00
21	301601	惠通科技	342	11,576.70	0.00
22	001356	富岭股份	709	10,237.96	0.00
23	301590	优优绿能	73	10,182.04	0.00
24	301658	首航新能	437	10,042.26	0.00
25	301665	泰禾股份	393	8,799.27	0.00
26	688755	汉邦科技	203	7,983.99	0.00
27	301173	毓恬冠佳	173	7,781.54	0.00
28	001382	新亚电缆	366	7,396.86	0.00
29	603014	威高血净	205	6,699.40	0.00
30	301636	泽润新能	128	6,074.88	0.00
31	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
32	301560	众捷汽车	190	5,215.50	0.00
33	603210	泰鸿万立	286	4,464.46	0.00
34	603271	永杰新材	126	4,420.08	0.00
35	603124	江南新材	88	4,075.28	0.00
36	001395	亚联机械	80	3,780.00	0.00
37	603409	汇通控股	100	3,332.00	0.00
38	001390	古麒绒材	178	3,225.36	0.00
39	603257	中国瑞林	78	2,922.66	0.00
40	603400	华之杰	57	2,497.17	0.00
41	603382	海阳科技	105	2,350.95	0.00
42	001335	信凯科技	80	2,244.00	0.00
43	603120	肯特催化	65	2,172.95	0.00

注：上述股票价值不包括可退替代估增。

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	300718	长盛轴承	43,422,482.55	1.48
2	002031	巨轮智能	35,899,169.00	1.23

3	300355	蒙草生态	34,071,178.80	1.16
4	002970	锐明技术	32,291,869.51	1.10
5	300815	玉禾田	32,259,028.79	1.10
6	300969	恒帅股份	31,821,913.02	1.09
7	301101	明月镜片	31,079,462.50	1.06
8	003000	劲仔食品	30,427,818.07	1.04
9	300622	博士眼镜	30,139,163.12	1.03
10	300842	帝科股份	28,729,791.42	0.98
11	300444	双杰电气	27,596,180.64	0.94
12	000521	长虹美菱	26,505,157.61	0.90
13	002301	齐心集团	26,142,516.00	0.89
14	300349	金卡智能	25,962,255.36	0.89
15	000589	贵州轮胎	25,563,611.00	0.87
16	003038	鑫铂股份	25,203,400.98	0.86
17	300377	赢时胜	25,087,603.00	0.86
18	300592	华凯易佰	24,898,477.43	0.85
19	300421	力星股份	23,752,344.40	0.81
20	300766	每日互动	23,343,783.00	0.80

注：不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300718	长盛轴承	63,826,408.36	2.18
2	002031	巨轮智能	51,026,636.00	1.74
3	300815	玉禾田	42,796,237.65	1.46
4	300355	蒙草生态	42,456,526.00	1.45
5	002970	锐明技术	41,217,667.00	1.41
6	301101	明月镜片	39,994,389.50	1.37
7	300622	博士眼镜	38,945,618.00	1.33
8	003000	劲仔食品	36,381,829.00	1.24
9	000589	贵州轮胎	35,866,464.26	1.22
10	300377	赢时胜	34,746,679.28	1.19
11	300842	帝科股份	34,065,387.86	1.16
12	300969	恒帅股份	34,053,784.54	1.16
13	300444	双杰电气	34,042,510.82	1.16
14	002301	齐心集团	33,397,060.50	1.14
15	002896	中大力德	33,358,061.29	1.14
16	301061	匠心家居	33,132,138.48	1.13
17	000521	长虹美菱	30,888,323.00	1.05
18	003038	鑫铂股份	30,606,770.96	1.04
19	300592	华凯易佰	30,076,375.28	1.03
20	002947	恒铭达	29,971,459.73	1.02

注：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	6,756,139,934.16
卖出股票收入（成交）总额	7,349,221,551.58

注：“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（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

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

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

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情形。

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	3,815,984.41
2	应收清算款	3,838,659.68
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	7,654,644.09

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688313	仕佳光子	7,674,342.55	0.39	重大事项停牌

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	300225	*ST 金泰	1,129,694.00	0.06	重大事项停牌
2	300280	*ST 紫天	907,212.00	0.05	重大事项停牌
3	688775	影石创新	71,143.68	0.00	新股锁定期内
4	688411	海博思创	46,754.40	0.00	新股锁定期内

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有	户均持有	持有人结构
----	------	-------

人户 数 (户)	的基金份 额	机构投资者		个人投资者		华泰柏瑞中证 2000 交 易型开放式指数证券 投资基金发起式联接 基金	
		持有份额	占总 份额 比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
17,358	98,869.34	970,108,592.00	56.53	718,376,008.00	41.86	27,689,400.00	1.61

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	中国人寿保险股份有 限公司	187,473,800.00	10.92
2	国泰海通证券股份有 限公司	79,089,299.00	4.61
3	北京诚通金控投资有 限公司	52,218,300.00	3.04
4	长江养老保险股份有 限公司—自有资金	35,000,000.00	2.04
5	中国平安人寿保险股 份有限公司—万能一 个险万能	19,624,800.00	1.14
6	中国人民保险集团股 份有限公司企业年金 计划—中国建设银行 股份有限公司	14,645,000.00	0.85
7	UBS AG	14,507,064.00	0.85
8	杨欢	13,254,100.00	0.77
9	泰康人寿保险股份有 限公司—分红—团体 分红—019L—FH001 沪	12,913,400.00	0.75
10	中国平安人寿保险股 份有限公司—自有资 金	12,449,370.00	0.73
11	华泰柏瑞中证 2000 交 易型开放式指数证券 投资基金发起式联接 基金	27,689,400.00	1.61

注：前十名持有人为除本基金的联接基金之外的前十名持有人。

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 6 日）基金份额总额	588,674,000.00
本报告期期初基金份额总额	2,883,674,000.00
本报告期基金总申购份额	8,537,500,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	9,705,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,716,174,000.00

§ 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

基金管理人重大人事变动：

经公司董事会审议通过，田汉卿女士于 2025 年 4 月 30 日起，不再担任公司副总经理。

经公司董事会审议通过，韩勇先生于 2025 年 5 月 9 日起不再担任公司总经理，董事长贾波先生代为履行总经理职责。

经公司股东会书面决定，韩勇先生于 2025 年 5 月 9 日起不再担任公司董事。

上述人事变动已按相关规定备案、报告。

报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：报告期内基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：报告期内基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

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 (%)	
华泰证券	6	3,897,296,423.33	27.63	779,570.45	27.63	-
招商证券	2	3,673,692,142.35	26.05	734,828.65	26.05	-
方正证券	4	2,160,494,737.55	15.32	432,150.56	15.32	-
广发证券	2	2,140,977,965.87	15.18	428,250.08	15.18	-
银河证券	2	1,972,257,352.93	13.98	394,504.97	13.98	-
平安证券	2	258,640,039.79	1.83	51,734.54	1.83	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国泰海通证券	2	-	-	-	-	-
上海证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

注：1、选择证券公司参与证券交易的标准

公司选择财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强的证券

公司租用基金专用交易席位。公司选择的提供交易单元的券商应当综合考虑下列因素：

- (1) 具有相应的业务经营资格；
- (2) 具备研究实力，有固定的研究机构和充足的研究人员，或者获得过知名金融媒体奖项，能及时为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、股票分析的研究报告，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告和特色研究服务等；
- (3) 诚信记录良好，最近两年券商研究、交易业务无重大违法违规行为，未受监管机构重大处罚；
- (4) 财务状况良好，信誉良好，内部管理规范、严格，风控合规管理人员充足，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需
要；
- (6) 被动股票型基金选择的提供交易单元的券商需综合考虑上述(1)、(3)、(4)和(5)基本条件，在此基础上可以设置指标进行评价，对相关未公开数据、证券公司内部业务流程及其他适用并纳入评价标准的相关信息，公司相关部门发送《尽职调查函》至各证券公司详询。

根据上述条件标准，公司建立被动股票型基金和其他类型基金证券公司白名单。

证券公司白名单进行定期或不定期更新，每年更新不得少于一次。

2、选择证券公司参与证券交易的程序

公司选择证券公司租用基金专用交易席位，应遵循以下程序：

(1) 公司投研部门根据拟合作的证券公司名单，负责安排与券商签订经公司合规法律部审核的《证券研究服务协议》，协议需约定双方的权利义务，明确服务内容、收取交易佣金的价格标准与计算方式。

(2) 基金事务部依据公司相关部门对券商的综合评价，根据基金运作需要，与券商签署《证券交易单元租用协议》。

(3) 如因业务需要，公司需新增租用已合作券商的交易单元，基金事务部应提出申请，与券商签订《证券交易单元租用协议》。

公司选择代理证券买卖的证券经营机构的程序：

基金管理人根据业务需要与被选择的证券经营机构签订证券经纪服务协议。

3、本报告期内，基金租用券商交易单元新增申万宏源证券、国泰海通证券。

4、国泰君安证券股份有限公司吸收合并海通证券股份有限公司。根据《国泰海通证券股份有限公司关于完成公司名称变更、注册资本变更、公司章程修订及相应市场主体变更登记的公告》，

自 2025 年 4 月 3 日起,国泰君安证券股份有限公司中文名称变更为“国泰海通证券股份有限公司”。

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 (%)
华泰证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	629,214.33	36.97	-	-	-	-
方正证券	996,795.45	58.57	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	75,749.09	4.45	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
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	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金标的指数纳入北京证券交易所股票并修订基金合同和托管协议的公告	证监会规定报刊和网站	2025 年 06 月 17 日
2	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金标的指数纳入北京证券交易所股票并修订招募说明书的公告	证监会规定报刊和网站	2025 年 06 月 16 日
3	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金持有停牌证券估值调整的提示性公告	证监会规定报刊和网站	2025 年 06 月 04 日
4	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止民商基金销售(上海)有限公司办理旗下基金相关业务公告	证监会规定报刊和网站	2025 年 05 月 24 日
5	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金参加中国邮政储蓄银行股份有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2025 年 05 月 14 日

6	华泰柏瑞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	证监会规定报刊和网站	2025 年 05 月 14 日
7	华泰柏瑞基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证监会规定报刊和网站	2025 年 05 月 10 日
8	华泰柏瑞基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证监会规定报刊和网站	2025 年 05 月 01 日
9	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销可转换公司债券的关联交易公告	证监会规定报刊和网站	2025 年 04 月 11 日
10	华泰柏瑞基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况(2024 年度)	证监会规定报刊和网站	2025 年 3 月 31 日
11	华泰柏瑞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	证监会规定报刊和网站	2025 年 03 月 19 日
12	华泰柏瑞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	证监会规定报刊和网站	2025 年 01 月 03 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本报告期内未有单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、本基金的中国证监会批准募集文件
- 2、本基金的《基金合同》
- 3、本基金的《招募说明书》
- 4、本基金的《托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、本基金的公告

12.2 存放地点

上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

托管人住所

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。 投资者对本报告如有疑问，可咨询基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司。 客户服务热线：400-888-0001（免长途费）021-3878 4638 公司网址：www.huatai-pb.com

华泰柏瑞基金管理有限公司

2025 年 8 月 30 日