

# 南方中证 2000 交易型开放式指数证券 投资基金 2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 31 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

## 目录

|                                              |    |
|----------------------------------------------|----|
| §1 重要提示及目录.....                              | 1  |
| 1.1 重要提示.....                                | 1  |
| 1.2 目录.....                                  | 2  |
| §2 基金简介.....                                 | 4  |
| 2.1 基金基本情况.....                              | 4  |
| 2.2 基金产品说明.....                              | 4  |
| 2.3 基金管理人和基金托管人.....                         | 4  |
| 2.4 信息披露方式.....                              | 5  |
| 2.5 其他相关资料.....                              | 5  |
| §3 主要财务指标和基金净值表现.....                        | 5  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                         | 5  |
| 3.2 基金净值表现.....                              | 6  |
| §4 管理人报告.....                                | 7  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况.....                        | 7  |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....              | 9  |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....                 | 9  |
| 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.....             | 10 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....             | 10 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....                | 11 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....                 | 11 |
| 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.....       | 11 |
| §5 托管人报告.....                                | 11 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....                  | 11 |
| 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..... | 12 |
| 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.....       | 12 |
| §6 中期财务会计报告（未经审计）.....                       | 12 |
| 6.1 资产负债表.....                               | 12 |
| 6.2 利润表.....                                 | 13 |
| 6.3 净资产变动表.....                              | 15 |
| 6.4 报表附注.....                                | 17 |
| §7 投资组合报告.....                               | 40 |
| 7.1 期末基金资产组合情况.....                          | 40 |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....                      | 40 |
| 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.....       | 41 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                     | 62 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                    | 63 |
| 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.....      | 64 |
| 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.....   | 64 |
| 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.....   | 64 |
| 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.....      | 64 |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....                     | 64 |

|                                          |    |
|------------------------------------------|----|
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....           | 64 |
| 7.12 投资组合报告附注.....                       | 65 |
| §8 基金份额持有人信息.....                        | 66 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....               | 66 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....            | 66 |
| 8.3 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.....    | 66 |
| §9 开放式基金份额变动.....                        | 66 |
| §10 重大事件揭示.....                          | 67 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议.....                    | 67 |
| 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.....    | 67 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....         | 67 |
| 10.4 基金投资策略的改变.....                      | 67 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....               | 67 |
| 10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况.....        | 67 |
| 10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况.....    | 67 |
| 10.8 其他重大事件.....                         | 69 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息.....                  | 70 |
| 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 ..... | 70 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....                 | 70 |
| §12 备查文件目录.....                          | 70 |
| 12.1 备查文件目录.....                         | 70 |
| 12.2 存放地点.....                           | 70 |
| 12.3 查阅方式.....                           | 70 |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|              |                          |
|--------------|--------------------------|
| 基金名称         | 南方中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金 |
| 基金简称         | 南方中证 2000ETF             |
| 场内简称         | 中证 2000ETF 南方            |
| 基金主代码        | 159531                   |
| 交易代码         | 159531                   |
| 基金运作方式       | 交易型开放式                   |
| 基金合同生效日      | 2023 年 9 月 7 日           |
| 基金管理人        | 南方基金管理股份有限公司             |
| 基金托管人        | 中国工商银行股份有限公司             |
| 报告期末基金份额总额   | 510,608,406.00 份         |
| 基金合同存续期      | 不定期                      |
| 基金份额上市的证券交易所 | 深圳证券交易所                  |
| 上市日期         | 2023 年 9 月 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   | 本基金主要采用完全复制策略、替代策略及其他适当的策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。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%。主要投资策略包括：完全复制策略、替代策略、金融衍生品投资策略、债券投资策略、可转换债券及可交换债券投资策略、资产支持证券投资策略、融资及转融通证券出借业务投资策略、存托凭证投资策略等以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。 |
| 业绩比较基准 | 本基金的业绩比较基准为标的指数收益率。本基金标的指数为中证 2000 指数。                                                                                                                                                             |
| 风险收益特征 | 本基金属股票型基金，一般而言，其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金通过跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的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      | 南方基金管理股份有限公司 | 中国工商银行股份有限公司             |
| 信息披露负责人 | 姓名           | 鲍文革                      |
|         | 联系电话         | 0755-82763888            |
|         | 电子邮箱         | managers@southernfund.cn |
|         |              | 郭明                       |
|         |              | (010) 66105799           |
|         |              | custody@icbc.com.cn      |

|        |                                      |               |                   |
|--------|--------------------------------------|---------------|-------------------|
|        |                                      | com           |                   |
| 客户服务电话 |                                      | 400-889-8899  | 95588             |
| 传真     |                                      | 0755-82763889 | (010) 66105798    |
| 注册地址   | 深圳市福田区莲花街道<br>益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼 |               | 北京市西城区复兴门内大街 55 号 |
| 办公地址   | 深圳市福田区莲花街道<br>益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼 |               | 北京市西城区复兴门内大街 55 号 |
| 邮政编码   | 518017                               |               | 100140            |
| 法定代表人  | 周易                                   |               | 廖林                |

## 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                                                      |
| 登载基金中期报告的管理人互联网网址 | <a href="http://www.nffund.com">http://www.nffund.com</a> |
| 基金中期报告置备地点        | 基金管理人、基金托管人的办公地址、基金上市交易的证券交易所（如有）                         |

## 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(2026 年 1 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日) |
| 本期已实现收益       | 137,404,844.19                        |
| 本期利润          | 96,063,770.45                         |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.1654                                |
| 本期加权平均净值利润率   | 10.88%                                |
| 本期基金份额净值增长率   | 11.62%                                |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2026 年 6 月 30 日)                 |
| 期末可供分配利润      | 283,397,647.79                        |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.5550                                |
| 期末基金资产净值      | 794,006,053.79                        |
| 期末基金份额净值      | 1.5550                                |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2026 年 6 月 30 日)                 |
| 基金份额累计净值增长率   | 55.50%                                |

注：基金业绩指标不包括持有人认（申）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；

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；

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<br>增长率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较<br>基准收益<br>率标准差<br>④ | ①-③   | ②-④    |
|----------------|--------------|---------------------|--------------------|---------------------------|-------|--------|
| 过去三个月          | 9.89%        | 1.66%               | 7.78%              | 1.62%                     | 2.11% | 0.04%  |
| 过去六个月          | 11.62%       | 1.71%               | 9.10%              | 1.68%                     | 2.52% | 0.03%  |
| 过去一年           | 32.92%       | 1.44%               | 29.14%             | 1.42%                     | 3.78% | 0.02%  |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 55.50%       | 1.90%               | 49.13%             | 1.91%                     | 6.37% | -0.01% |

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

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



## § 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

1998 年 3 月 6 日，经中国证监会批准，南方基金管理有限公司作为国内首批规范的基金管理公司正式成立，成为我国“新基金时代”的起始标志。

2018 年 1 月，公司整体变更设立为南方基金管理股份有限公司。目前，公司总部设在深圳，在北京、上海、深圳、南京、成都、合肥等地设有分公司，在香港和深圳前海设有子公司——南方东英资产管理有限公司（香港子公司）和南方资本管理有限公司（深圳子公司）。其中，南方东英是境内基金公司获批成立的第一家境外分支机构。

南方基金管理股份有限公司旗下管理公募基金、全国社保、基本养老保险、企业年金、职业年金和专户组合，已发展成为产品种类丰富、业务领域全面、经营业绩优秀、资产管理规模位居前列的基金管理公司之一。

#### 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 | 说明 |
|----|----|-----------------|------|----|
|----|----|-----------------|------|----|

|     |         | 任职日期           | 离任日期 | 年限   |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
|-----|---------|----------------|------|------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 李佳亮 | 本基金基金经理 | 2023 年 9 月 7 日 | -    | 13 年 | 中国国籍，美国南加州大学金融工程硕士，具有基金从业资格。2012 年 8 月加入南方基金，任数量化投资部研究员；2015 年 5 月 28 日至 2016 年 8 月 5 日，任投资经理助理；2017 年 4 月 13 日至 2018 年 9 月 4 日，任南方荣优基金经理；2016 年 8 月 5 日至 2019 年 1 月 18 日，任南方消费基金经理；2017 年 11 月 9 日至 2019 年 6 月 28 日，任大数据 100、大数据 300 基金经理；2016 年 11 月 23 日至 2021 年 11 月 12 日，任南方中证 500 增强基金经理；2017 年 11 月 9 日至 2021 年 11 月 12 日，任南方量化成长基金经理；2020 年 4 月 23 日至 2021 年 11 月 12 日，任南方上证 50 增强基金经理；2016 年 12 月 30 日至 2024 年 5 月 31 日，任南方绝对收益基金经理；2023 年 3 月 23 日至 2025 年 6 月 6 日，任南方标普 500ETF（QDII）基金经理；2022 年 12 月 16 日至 2025 年 6 月 6 日，任南方基金南方东英富时亚太低碳精选 ETF（QDII）基金经理；2024 年 5 月 21 日至 2025 年 6 月 6 日，任南方富时亚太低碳精选 ETF 发起联接（QDII）基金经理；2021 年 10 月 29 日至今，任南方 MSCI 中国 A50 互联互通 ETF 基金经理；2022 年 1 月 10 日至今，任南方 MSCI 中国 A50 互联互通 ETF 联接基金经理；2022 年 11 月 21 日至今，兼任投资经理；2022 年 12 月 23 日至今，任南方北证 50 成份指数发起基金经理；2023 年 3 月 3 日至今，任南方中证主要消费 ETF 基金经理；2023 年 4 月 13 日至今，任南方沪深 300ESG 基准 ETF 基金经理；2023 年 6 月 21 日至今，任南方中证国新央企科技引领 ETF 基金经理；2023 年 7 月 28 日至今，任南方中证通信服务 ETF 基金经理；2023 年 9 月 7 日至今，任南方中证 2000ETF 基金经理；2023 年 12 月 5 日至今，任南方中证电池主题 ETF 发起联接（原：南方中证电池主题指数发起）基金经理；2024 年 2 月 28 日至今，任南方中证国新央企科技引领 ETF 联接基金经 |

|     |           |                  |   |     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
|-----|-----------|------------------|---|-----|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |           |                  |   |     | 理 2024 年 3 月 19 日至今，任南方中证光伏产业指数发起基金经理；2024 年 3 月 29 日至今，任南方中证半导体产业指数发起基金经理；2024 年 4 月 15 日至今，任南方上证科创板芯片 ETF 基金经理；2024 年 5 月 14 日至今，任南方中证通信服务 ETF 发起联接基金经理；2024 年 7 月 8 日至今，任南方上证科创板芯片 ETF 发起联接基金经理；2025 年 9 月 16 日至今，任南方上证科创板人工智能 ETF 发起联接（原：南方上证科创板人工智能指数发起）基金经理；2026 年 1 月 14 日至今，任南方中证电池主题 ETF 基金经理；2026 年 1 月 16 日至今，任南方上证科创板人工智能 ETF 基金经理；2026 年 6 月 10 日至今，任南方中证稀有金属主题 ETF 基金经理。 |
| 游涛  | 本基金基金经理   | 2026 年 3 月 27 日  | - | 9 年 | 中国国籍，中央财经大学统计学博士，深圳证券交易所博士后，具有基金从业资格。曾先后就职于深圳证券交易所，博时基金管理有限公司，历任博士后研究员、高级人工智能研究员、高级量化研究员。2022 年 4 月加入南方基金数量化投资部，2024 年 12 月 6 日至今，任南方中证 500 量化增强股票发起基金经理；2026 年 3 月 27 日至今，任南方中证 2000ETF 基金经理。                                                                                                                                                                                         |
| 仇泽民 | 本基金基金经理助理 | 2025 年 10 月 17 日 | - | 5 年 | 中国国籍，清华大学金融硕士，具有基金从业资格。曾就职于中证指数有限公司，任研究开发部经理。2023 年 9 月加入南方基金，任指数投资部研究员；2025 年 10 月 17 日至今，任南方恒生生物科技 ETF（QDII）、南方中证 2000ETF、南方中证科创创业 50ETF 基金经理助理。                                                                                                                                                                                                                                     |

注：1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告（生效）日期；

2、证券从业年限计算标准遵从中国证监会《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券基金从业人员范围的相关规定。

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

| 姓名  | 产品类型 | 产品数量<br>(只) | 资产净值(元)         | 任职时间        |
|-----|------|-------------|-----------------|-------------|
| 李佳亮 | 公募基金 | 19          | 18,264,334,052. | 2016 年 08 月 |

|  |          |    |                   |                  |
|--|----------|----|-------------------|------------------|
|  |          |    | 28                | 05 日             |
|  | 私募资产管理计划 | 10 | 322,510,633.52    | 2024 年 06 月 28 日 |
|  | 其他组合     | -  | -                 | -                |
|  | 合计       | 29 | 18,586,844,685.80 | -                |

**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投资基金法》及其他有关法律法规的规定及本基金基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求利益。本报告期内，本基金运作整体合法合规，不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

**4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明**

**4.3.1 公平交易制度的执行情况**

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。公司每季度对旗下组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析。

本报告期内，两两组合间单日、3 日、5 日时间窗口内同向交易买入溢价率均值或卖出溢价率均值显著不为 0 的情况不存在，并且交易占比也没有明显异常，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

**4.3.2 异常交易行为的专项说明**

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易次数为 24 次，是由于指数投资组合的投资策略导致。

**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**

2026 上半年，市场稳步上涨，中证 2000 指数涨跌幅为 9.1%。

本产品跟踪中证 2000 指数，中证 2000 指数从沪深市场中选取市值规模较小且流动性较好的 2000 只（排除沪深 300，中证 500，中证 1000 的成分股，选取剩余股票中最大的 2000 只股票）证券作为指数样本，是 A 股微盘风格的代表性指数。

运作期间，我们通过自建的“指数化交易系统”、“日内择时交易模型”、“跟踪误差归因分析系统”、“现金流精算系统”等，将本基金的跟踪误差指标控制在较好水平，并通过严格的风险管理流程，确保了本基金的安全运作。我们对本基金报告期内跟踪误差归因分析如下：

（1）抽样复制策略带来的个股和行业偏离，我们通过严格的风险模型将偏离约束在一定范围之内；

（2）接受申购赎回所带来的仓位偏离，对此我们通过日内择时交易争取跟踪误差最小化；

（3）股指期货和现货之间的偏离带来的本基金与基准的偏离；

（4）新股上市初期涨幅较大的影响；

（5）基金调仓，事前我们制定了详细的调仓方案，在实施过程中引入多方校验机制防范风险发生，将跟踪误差控制在一定范围内。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.5550 元，报告期内，份额净值增长率为 11.62%，同期业绩基准增长率为 9.10%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

报告期内，国内经济复苏态势良好，A 股整体盈利状况企稳回升，中证 2000 指数震荡上行。十五五规划纲要明确产业升级主线，存量政策效能持续释放，小微科创配套增量政策陆续落地，市场交易活跃度维持高位，市场风险偏好稳步上行，成长与中小盘风格形成正向资金反馈。同时，国内外流动性宽松，资金有流向非美元资产的趋势，中证 2000 指数成分股聚集大量专精特新小微企业，受益于流动性宽松、产业政策扶持双重利好，可关注中证 2000 指数的投资机会。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术，建立了估值委员会，组成人员包括财务负责人、督察长、权益研究部总经理、固定收益研究部总经理、指数投资部总经理、指数研究部总经理、现金及债券指数投资部总经理、国际投资部总经理、风险管理部总经理及运作保障部总经理等。本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在 0.25%以上的，对所采用

的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规的规定和基金合同的约定，以及本基金的实际运作情况，本基金报告期末未进行利润分配。在符合分红条件的前提下，本基金已实现尚未分配的可供分配收益部分，将严格按照基金合同的约定适时向投资者予以分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金未出现连续二十个交易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

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

#### 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，本基金的管理人——南方基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人依法对南方基金管理股份有限公司编制和披露的本基金 2026 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

### § 6 中期财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：南方中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产        | 附注号     | 本期末 2026 年 6 月 30 日 | 上年度末 2025 年 12 月 31 日 |
|-----------|---------|---------------------|-----------------------|
| 资产：       |         |                     |                       |
| 货币资金      | 6.4.7.1 | 11,432,099.37       | 2,884,484.95          |
| 结算备付金     |         | 9,856,092.59        | 2,798,736.20          |
| 存出保证金     |         | 2,537,142.42        | 1,215,614.71          |
| 交易性金融资产   | 6.4.7.2 | 775,982,070.33      | 719,668,427.11        |
| 其中：股票投资   |         | 775,476,852.86      | 719,608,223.88        |
| 基金投资      |         | -                   | -                     |
| 债券投资      |         | 505,217.47          | 60,203.23             |
| 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      |         | -                   | -                     |
| 其中：债券投资   |         | -                   | -                     |
| 资产支持证券投资  |         | -                   | -                     |
| 其他投资      |         | -                   | -                     |
| 其他债权投资    |         | -                   | -                     |
| 其他权益工具投资  |         | -                   | -                     |
| 应收清算款     |         | 1,909,734.11        | 1,854,363.68          |
| 应收股利      |         | -                   | -                     |
| 应收申购款     |         | -                   | -                     |
| 递延所得税资产   |         | -                   | -                     |
| 其他资产      | 6.4.7.5 | -                   | -                     |
| 资产总计      |         | 801,717,138.82      | 728,421,626.65        |
| 负债和净资产    | 附注号     | 本期末 2026 年 6 月 30 日 | 上年度末 2025 年 12 月 31 日 |
| 负债：       |         |                     |                       |
| 短期借款      |         | -                   | -                     |
| 交易性金融负债   |         | -                   | -                     |
| 衍生金融负债    | 6.4.7.3 | -                   | -                     |
| 卖出回购金融资产款 |         | -                   | -                     |
| 应付清算款     |         | 75,701.59           | 2,123.08              |
| 应付赎回款     |         | -                   | -                     |
| 应付管理人报酬   |         | 108,543.09          | 86,715.75             |
| 应付托管费     |         | 36,181.03           | 28,905.27             |

|          |         |                |                |
|----------|---------|----------------|----------------|
| 应付销售服务费  |         | -              | -              |
| 应付投资顾问费  |         | -              | -              |
| 应交税费     |         | 47,872.30      | 1,425.08       |
| 应付利润     |         | -              | -              |
| 递延所得税负债  |         | -              | -              |
| 其他负债     | 6.4.7.6 | 7,442,787.02   | 3,058,581.28   |
| 负债合计     |         | 7,711,085.03   | 3,177,750.46   |
| 净资产：     |         |                |                |
| 实收基金     | 6.4.7.7 | 510,608,406.00 | 520,608,406.00 |
| 其他综合收益   |         | -              | -              |
| 未分配利润    | 6.4.7.8 | 283,397,647.79 | 204,635,470.19 |
| 净资产合计    |         | 794,006,053.79 | 725,243,876.19 |
| 负债和净资产总计 |         | 801,717,138.82 | 728,421,626.65 |

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.5550 元，基金份额总额 510,608,406.00 份。

6.2 利润表

会计主体：南方中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目               | 附注号      | 本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|------------------|----------|------------------------------------|-----------------------------------------|
| 一、营业总收入          |          | 97,024,000.83                      | 138,848,998.22                          |
| 1.利息收入           |          | 28,858.26                          | 33,492.83                               |
| 其中：存款利息收入        | 6.4.7.9  | 28,858.26                          | 33,492.83                               |
| 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） |          | 135,790,017.13                     | 80,899,628.35                           |
| 其中：股票投资收益        | 6.4.7.10 | 129,612,476.65                     | 77,181,549.83                           |
| 基金投资收益           |          | -                                  | -                                       |
| 债券投资收益           | 6.4.7.11 | 436,353.21                         | 28,703.99                               |
| 资产支持证券投资         | 6.4.7.12 | -                                  | -                                       |
| 收益               |          | -                                  | -                                       |
| 贵金属投资收益          |          | -                                  | -                                       |
| 衍生工具收益           | 6.4.7.13 | 2,059,452.34                       | 450,003.23                              |

|                       |            |                |                |
|-----------------------|------------|----------------|----------------|
| 股利收益                  | 6.4.7.14   | 3,681,734.93   | 3,239,371.30   |
| 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） | 6.4.7.15   | -41,341,073.74 | 54,059,783.30  |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）     |            | -              | -              |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）     | 6.4.7.16   | 2,546,199.18   | 3,856,093.74   |
| 减：二、营业总支出             |            | 960,230.38     | 681,202.83     |
| 1.管理人报酬               | 6.4.10.2.1 | 654,895.06     | 449,690.55     |
| 其中：暂估管理人报酬            |            | -              | -              |
| 2.托管费                 | 6.4.10.2.2 | 218,298.34     | 149,896.86     |
| 3.销售服务费               | 6.4.10.2.3 | -              | -              |
| 4.投资顾问费               |            | -              | -              |
| 5.利息支出                |            | -              | -              |
| 其中：卖出回购金融资产支出         |            | -              | -              |
| 6.信用减值损失              | 6.4.7.17   | -              | -              |
| 7.税金及附加               |            | 7,418.82       | 1,998.26       |
| 8.其他费用                | 6.4.7.18   | 79,618.16      | 79,617.16      |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）   |            | 96,063,770.45  | 138,167,795.39 |
| 减：所得税费用               |            | -              | -              |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）     |            | 96,063,770.45  | 138,167,795.39 |
| 五、其他综合收益的税后净额         |            | -              | -              |
| 六、综合收益总额              |            | 96,063,770.45  | 138,167,795.39 |

### 6.3 净资产变动表

会计主体：南方中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目        | 本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 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 | 520,608,406.00                     | -      | 204,635,470.19 | 725,243,876.19 |
| 加：会计政策变更  | -                                  | -      | -              | -              |

|                                          |                                         |        |                 |                   |
|------------------------------------------|-----------------------------------------|--------|-----------------|-------------------|
| 前期差错更正                                   | -                                       | -      | -               | -                 |
| 其他                                       | -                                       | -      | -               | -                 |
| 二、本期期初净资产                                | 520,608,406.00                          | -      | 204,635,470.19  | 725,243,876.19    |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | -10,000,000.00                          | -      | 78,762,177.60   | 68,762,177.60     |
| （一）、综合收益总额                               | -                                       | -      | 96,063,770.45   | 96,063,770.45     |
| （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）      | -10,000,000.00                          | -      | -17,301,592.85  | -27,301,592.85    |
| 其中：1.基金申购款                               | 1,736,000,000.00                        | -      | 880,073,110.09  | 2,616,073,110.09  |
| 2.基金赎回款                                  | -1,746,000,000.00                       | -      | -897,374,702.94 | -2,643,374,702.94 |
| （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                                | 510,608,406.00                          | -      | 283,397,647.79  | 794,006,053.79    |
| 项目                                       | 上年度可比期间 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                                | 760,608,406.00                          | -      | 5,552,789.87    | 766,161,195.87    |
| 加：会计政策变更                                 | -                                       | -      | -               | -                 |
| 前期差错更正                                   | -                                       | -      | -               | -                 |
| 其他                                       | -                                       | -      | -               | -                 |
| 二、本期期初                                   | 760,608,406.00                          | -      | 5,552,789.87    | 766,161,195.87    |

|                                          |                       |   |                 |                       |
|------------------------------------------|-----------------------|---|-----------------|-----------------------|
| 净资产                                      |                       |   |                 |                       |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | -300,000,000.00       | - | 72,725,692.18   | -227,274,307.82       |
| （一）、综合收益总额                               | -                     | - | 138,167,795.39  | 138,167,795.39        |
| （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）      | -300,000,000.00       | - | -65,442,103.21  | -365,442,103.21       |
| 其中：1.基金申购款                               | 2,340,000,000.00      | - | 100,326,195.68  | 2,440,326,195.68      |
| 2.基金赎回款                                  | -<br>2,640,000,000.00 | - | -165,768,298.89 | -<br>2,805,768,298.89 |
| （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                                | 460,608,406.00        | - | 78,278,482.05   | 538,886,888.05        |

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：

\_\_\_\_杨小松\_\_\_\_      \_\_\_\_蔡忠评\_\_\_\_      \_\_\_\_徐超\_\_\_\_  
基金管理人负责人      主管会计工作负责人      会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

南方中证 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]1933 号《关于准予南方中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》注册，由南方基金管理股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方中证 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 260,604,000.00 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 0468 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《南方中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2023 年 9 月 7 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 260,608,406.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 4,406.00 份基金份额。本基金的基金管理人为南方基金管理股份有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2023]866 号核准，本基金 260,608,406.00 份基金份额于 2023 年 9 月 18 日在深交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资目标是紧密跟踪中证 2000 指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股(含存托凭证)。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股(包含主板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准或注册发行的股票)、衍生工具(股指期货、股票期权等)、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、政府机构债券、地方政府债券、次级债、可转换债券、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、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的相关规定)。本基金根据相关规定可参与融资、转融通证券出借业务。本基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产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%。每个交易日日终，在扣除金融衍生品合约需缴纳的交易保证金后，本基金应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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%。本基金的业绩比较基准为：中证 2000 指数收益率。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、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》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、《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〉》，中国证券投资基金业协会发布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号——年度报告和中期报告》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策，会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 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

本基金的主要税项列示如下：

##### (1) 增值税及附加

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定，资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人；自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税，公募证券投资基金（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、债券取得的收入及金融同业往来利息收入免征增值税，金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入；取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税。

根据财政部、税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》的规定，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债

券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按 7%、3%和 2%的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

#### （2）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《财政部国家税务总局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[2008]1 号《财政部国家税务总局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。

#### （3）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号《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《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《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。

#### （4）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‰，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、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。

#### （5）境外投资

本基金运作过程中如有涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、

财税[2016]127 号《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

#### 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 2026 年 6 月 30 日 |
|----------------|---------------------|
| 活期存款           | 11,432,099.37       |
| 等于：本金          | 11,431,498.22       |
| 加：应计利息         | 601.15              |
| 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             | 11,432,099.37       |

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            |       | 本期末 2026 年 6 月 30 日 |       |                |               |
|---------------|-------|---------------------|-------|----------------|---------------|
|               |       | 成本                  | 应计利息  | 公允价值           | 公允价值变动        |
| 股票            |       | 783,772,646.93      | -     | 775,476,852.86 | -8,295,794.07 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       | -                   | -     | -              | -             |
| 债券            | 交易所市场 | 505,200.00          | 17.47 | 505,217.47     | -             |
|               | 银行间市场 | -                   | -     | -              | -             |
|               | 合计    | 505,200.00          | 17.47 | 505,217.47     | -             |
| 资产支持证券        |       | -                   | -     | -              | -             |
| 基金            |       | -                   | -     | -              | -             |
| 其他            |       | -                   | -     | -              | -             |
| 合计            |       | 784,277,846.93      | 17.47 | 775,982,070.33 | -8,295,794.07 |

##### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

**6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额**

单位：人民币元

| 项目     | 本期末 2026 年 6 月 30 日 |      |    |    |
|--------|---------------------|------|----|----|
|        | 合同/名义金额             | 公允价值 |    | 备注 |
|        |                     | 资产   | 负债 |    |
| 利率衍生工具 | -                   | -    | -  | -  |
| 货币衍生工具 | -                   | -    | -  | -  |
| 权益衍生工具 | 14,932,880.00       | -    | -  | -  |
| -股指期货  | 14,932,880.00       | -    | -  | -  |
| 其他衍生工具 | -                   | -    | -  | -  |
| 合计     | 14,932,880.00       | -    | -  | -  |

**6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况**

单位：人民币元

| 代码         | 名称     | 持仓量（买/卖） | 合约市值          | 公允价值变动     |
|------------|--------|----------|---------------|------------|
| IM2609     | IM2609 | 9.00     | 15,273,000.00 | 340,120.00 |
| 合计         |        |          |               | 340,120.00 |
| 减：可抵销期货暂收款 |        |          |               | 340,120.00 |
| 净额         |        |          |               | 0.00       |

注：1、买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

2、衍生金融资产项下的利率/货币/权益/其他衍生工具为国债/外汇/股指/商品期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持国债/外汇/股指/商品期货投资合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的国债/外汇/股指/商品期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

**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**

无。

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

无。

**6.4.7.5 其他资产**

无。

**6.4.7.6 其他负债**

单位：人民币元

| 项目          | 本期末 2026 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    | 482,474.53   |
| 其中：交易所市场  | 482,474.53   |
| 银行间市场     | -            |
| 应付利息      | -            |
| 应退退补款     | 5,175,018.56 |
| 预提费用      | 79,343.16    |
| 应付指数使用费   | -            |
| 可退替代款     | 1,705,950.77 |
| 合计        | 7,442,787.02 |

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |                   |
|---------------|------------------------------------|-------------------|
|               | 基金份额（份）                            | 账面金额              |
| 上年度末          | 520,608,406.00                     | 520,608,406.00    |
| 本期申购          | 1,736,000,000.00                   | 1,736,000,000.00  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -1,746,000,000.00                  | -1,746,000,000.00 |
| 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           | 510,608,406.00                     | 510,608,406.00    |

注：本基金申购含红利再投份额（如有）、转换入份额（如有）；赎回含转出份额（如有）。

#### 6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分             | 未实现部分           | 未分配利润合计         |
|----------------|-------------------|-----------------|-----------------|
| 上年度末           | 393,932,878.28    | -189,297,408.09 | 204,635,470.19  |
| 加：会计政策变更       | -                 | -               | -               |
| 前期差错更正         | -                 | -               | -               |
| 其他             | -                 | -               | -               |
| 本期期初           | 393,932,878.28    | -189,297,408.09 | 204,635,470.19  |
| 本期利润           | 137,404,844.19    | -41,341,073.74  | 96,063,770.45   |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -17,929,723.22    | 628,130.37      | -17,301,592.85  |
| 其中：基金申购款       | 1,543,091,225.86  | -663,018,115.77 | 880,073,110.09  |
| 基金赎回款          | -1,561,020,949.08 | 663,646,246.14  | -897,374,702.94 |
| 本期已分配利润        | -                 | -               | -               |

|     |                |                 |                |
|-----|----------------|-----------------|----------------|
| 本期末 | 513,407,999.25 | -230,010,351.46 | 283,397,647.79 |
|-----|----------------|-----------------|----------------|

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|-----------|------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 12,517.51                          |
| 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 | 15,095.54                          |
| 其他        | 1,245.21                           |
| 合计        | 28,858.26                          |

#### 6.4.7.10 股票投资收益

##### 6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目               | 本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|------------------|------------------------------------|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | 101,722,686.61                     |
| 股票投资收益——赎回差价收入   | 27,889,790.04                      |
| 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               | 129,612,476.65                     |

##### 6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目         | 本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|------------|------------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 3,419,192,178.48                   |
| 减：卖出股票成本总额 | 3,314,612,817.86                   |
| 减：交易费用     | 2,856,674.01                       |
| 买卖股票差价收入   | 101,722,686.61                     |

注：上述交易费用（如有）包含股票买卖产生的交易费用。

##### 6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

| 项目          | 本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------------------|
| 赎回基金份额对价总额  | 2,643,374,702.94                   |
| 减：现金支付赎回款总额 | 705,976,214.94                     |
| 减：赎回股票成本总额  | 1,909,508,697.96                   |
| 减：交易费用      | -                                  |
| 赎回差价收入      | 27,889,790.04                      |

##### 6.4.7.10.4 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

**6.4.7.11 债券投资收益****6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

| 项目                           | 本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|------------------------------|------------------------------------|
| 债券投资收益——利息收入                 | 70.95                              |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 436,282.26                         |
| 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                           | 436,353.21                         |

**6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

| 项目                     | 本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|------------------------|------------------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 1,083,083.75                       |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 646,700.00                         |
| 减：应计利息总额               | 58.18                              |
| 减：交易费用                 | 43.31                              |
| 买卖债券差价收入               | 436,282.26                         |

注：上述交易费用（如有）包含债券买卖产生的交易费用。

**6.4.7.12 资产支持证券投资收益****6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入**

无。

**6.4.7.13 衍生工具收益****6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

无。

**6.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益**

单位：人民币元

| 项目        | 本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|-----------|------------------------------------|
| 股指期货-投资收益 | 2,059,452.34                       |

**6.4.7.14 股利收益**

单位：人民币元

| 项目            | 本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|---------------|------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 3,681,734.93                       |
| 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          | 3,681,734.93 |

#### 6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|------------------------|------------------------------------|
| 1.交易性金融资产              | -41,449,513.74                     |
| ——股票投资                 | -41,449,513.74                     |
| ——债券投资                 | -                                  |
| ——资产支持证券投资             | -                                  |
| ——贵金属投资                | -                                  |
| ——其他                   | -                                  |
| 2.衍生工具                 | 108,440.00                         |
| ——权证投资                 | -                                  |
| ——期货投资                 | 108,440.00                         |
| 3.其他                   | -                                  |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | -                                  |
| 合计                     | -41,341,073.74                     |

#### 6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|---------|------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | -                                  |
| 替代损益    | 2,546,199.18                       |
| 合计      | 2,546,199.18                       |

注 替代损益收入是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申购（赎回）本基金时，补入（卖出）被替代证券的实际买入成本（实际卖出金额）与申购（赎回）确认日估值的差额，或强制退款的被替代证券在强制退款计算日与申购（赎回）确认日估值的差额。

#### 6.4.7.17 信用减值损失

无。

#### 6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|---------|------------------------------------|
| 审计费用    | 19,835.79                          |
| 信息披露费   | 59,507.37                          |
| 证券出借违约金 | -                                  |
| 银行费用    | 275.00                             |
| 合计      | 79,618.16                          |

#### 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**

无。

**6.4.8.2 资产负债表日后事项**

截至财务报告批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

**6.4.9 关联方、关联关系**

**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**

无。

**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               |
|------------------------|-----------------------|
| 南方基金管理股份有限公司(“南方基金”)   | 基金管理人                 |
| 华泰联合证券有限责任公司("华泰联合")   | 基金管理人的股东华泰证券控制的公<br>司 |
| 华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)     | 基金管理人的股东、基金销售机构       |
| 中国工商银行股份有限公司("中国工商银行") | 基金托管人                 |

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年<br>6 月 30 日 |                      | 上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日<br>至 2025 年 6 月 30 日 |                      |
|-------|---------------------------------------|----------------------|---------------------------------------------|----------------------|
|       | 成交金额                                  | 占当期股票<br>成交总额的比<br>例 | 成交金额                                        | 占当期股票<br>成交总额的比<br>例 |
| 华泰证券  | 7,718,496.67                          | 0.11%                | 5,019,058.16                                | 0.21%                |

**6.4.10.1.2 债券交易**

无。

**6.4.10.1.3 债券回购交易**

无。

**6.4.10.1.4 基金交易**

无。

**6.4.10.1.5 权证交易**

无。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 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  | 694.38                                  | 0.10%      | -        | -            |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 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  | 451.72                                  | 0.19%      | 382.71   | 0.33%        |

注：1. 上述佣金费率参考市场价格确定。

2. 该类佣金协议的服务范围符合《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》（中国证券监督管理委员会公告〔2024〕3 号）相关规定。《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》生效后，被动股票型基金不再通过股票交易佣金支付研究服务等其他费用，其他类型基金可以通过股票交易佣金支付研究服务费用。

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 2026 年 1 月 1 日至<br>2026 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2025 年 1<br>月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|------------------|---------------------------------------|--------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 654,895.06                            | 449,690.55                                 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 55,270.65                             | 26,568.75                                  |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 599,624.41                            | 423,121.80                                 |

注：支付基金管理人南方基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.15% 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% \div \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期 2026 年 1 月 1 日至<br>2026 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2025 年 1<br>月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|----------------|---------------------------------------|--------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 218,298.34                            | 149,896.86                                 |

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.05%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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.05\% \div \text{当年天数}。$$

**6.4.10.2.3 销售服务费**

无。

**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**

无。

**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**

无。

**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**

无。

**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**

无。

**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 2026 年 6 月 30 日 |                  | 上年度末 2025 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 |
| 华泰证券股份有限公司 | 4,030,144.00        | 0.79%            | 3,499,954.00          | 0.67%            |

注：本基金其他关联方投资本基金适用的认（申）购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

**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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |           | 上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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    |
| 中国工商银行 | 11,432,099.37                      | 12,517.51 | 4,698,423.19                            | 21,253.10 |

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

单位：人民币元

| 本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 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                               | 603293 | 埃泰克  | 网下申购 | 716        | 23,978.84 |

| 上年度可比期间 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                                    | 301458 | 钧崴电子 | 网下申购 | 7,005      | 72,852.00 |
| 华泰联合                                    | 603014 | 威高血净 | 网下申购 | 2,045      | 54,192.50 |
| 华泰联合                                    | 688757 | 胜科纳米 | 网下申购 | 5,357      | 48,641.56 |

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

注：本期无。本基金报告期后分红情况（如有）详见本报告“资产负债表日后事项”部分内容。

6.4.12 期末（2026 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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 |
| 301666               | 大普微  | 2026 年 4 月 8 日  | 6 个月 | 新股锁定期  | 46.08 | 463.33   | 1,220    | 56,217.60 | 565,262.60 | -  |
| 688808               | 联讯仪器 | 2026 年 4 月 16 日 | 6 个月 | 新股锁定期  | 81.88 | 1,584.33 | 163      | 13,346.44 | 258,245.79 | -  |
| 688820               | 盛合晶微 | 2026 年 4 月 13 日 | 6 个月 | 新股锁定期  | 19.68 | 141.49   | 1,189    | 23,399.52 | 168,231.61 | -  |

|        |      |                           |      |           |       |            |       |           |            |   |
|--------|------|---------------------------|------|-----------|-------|------------|-------|-----------|------------|---|
| 001399 | 惠科股份 | 2026<br>年 6 月<br>16 日     | 6 个月 | 新股锁<br>定期 | 10.12 | 27.73      | 4,587 | 46,420.44 | 127,197.51 | - |
| 688818 | 电科蓝天 | 2026<br>年 2 月<br>3 日      | 6 个月 | 新股锁<br>定期 | 9.47  | 70.14      | 1,717 | 16,259.99 | 120,430.38 | - |
| 688797 | 臻宝科技 | 2026<br>年 6 月<br>16 日     | 6 个月 | 新股锁<br>定期 | 44.56 | 468.6<br>7 | 207   | 9,223.92  | 97,014.69  | - |
| 688785 | 恒运昌  | 2026<br>年 1 月<br>20 日     | 6 个月 | 新股锁<br>定期 | 92.18 | 463.1<br>5 | 116   | 10,692.88 | 53,725.40  | - |
| 688813 | 泰金新能 | 2026<br>年 3 月<br>24 日     | 6 个月 | 新股锁<br>定期 | 26.28 | 172.0<br>9 | 234   | 6,149.52  | 40,269.06  | - |
| 688635 | 长进光子 | 2026<br>年 5 月<br>20 日     | 6 个月 | 新股锁<br>定期 | 40.98 | 308.1<br>9 | 128   | 5,245.44  | 39,448.32  | - |
| 603459 | 红板科技 | 2026<br>年 3 月<br>31 日     | 6 个月 | 新股锁<br>定期 | 17.70 | 84.32      | 330   | 5,841.00  | 27,825.60  | - |
| 001365 | 天海电子 | 2026<br>年 5 月<br>11 日     | 6 个月 | 新股锁<br>定期 | 27.19 | 31.31      | 719   | 19,549.61 | 22,511.89  | - |
| 688811 | 有研复材 | 2026<br>年 4 月<br>1 日      | 6 个月 | 新股锁<br>定期 | 6.41  | 24.13      | 834   | 5,345.94  | 20,124.42  | - |
| 301696 | 三瑞智能 | 2026<br>年 3 月<br>31 日     | 6 个月 | 新股锁<br>定期 | 24.68 | 86.80      | 216   | 5,330.88  | 18,748.80  | - |
| 001237 | 惠康科技 | 2026<br>年 5 月<br>15 日     | 6 个月 | 新股锁<br>定期 | 53.26 | 58.74      | 285   | 15,179.10 | 16,740.90  | - |
| 301669 | 高特电子 | 2026<br>年 6 月<br>2 日      | 6 个月 | 新股锁<br>定期 | 7.08  | 28.40      | 546   | 3,865.68  | 15,506.40  | - |
| 301687 | 新广益  | 2025<br>年 12<br>月 24<br>日 | 6 个月 | 新股锁<br>定期 | 21.93 | 77.78      | 195   | 4,276.35  | 15,167.10  | - |
| 001393 | 维通利  | 2026<br>年 5 月<br>8 日      | 6 个月 | 新股锁<br>定期 | 30.38 | 38.99      | 387   | 11,757.06 | 15,089.13  | - |
| 301531 | 春光集团 | 2026                      | 6 个月 | 新股锁       | 13.30 | 51.56      | 290   | 3,857.00  | 14,952.40  | - |

|        |      |                       |      |           |       |            |     |          |           |   |
|--------|------|-----------------------|------|-----------|-------|------------|-----|----------|-----------|---|
|        |      | 年 4 月<br>28 日         |      | 定期        |       |            |     |          |           |   |
| 301599 | 理奇智能 | 2026<br>年 4 月<br>22 日 | 6 个月 | 新股锁<br>定期 | 13.91 | 32.47      | 433 | 6,023.03 | 14,059.51 | - |
| 301683 | 慧谷新材 | 2026<br>年 3 月<br>24 日 | 6 个月 | 新股锁<br>定期 | 78.38 | 121.7<br>7 | 96  | 7,524.48 | 11,689.92 | - |
| 688781 | 视涯科技 | 2026<br>年 3 月<br>18 日 | 6 个月 | 新股锁<br>定期 | 22.68 | 47.61      | 217 | 4,921.56 | 10,331.37 | - |
| 688816 | 易思维  | 2026<br>年 2 月<br>4 日  | 6 个月 | 新股锁<br>定期 | 55.95 | 57.10      | 177 | 9,903.15 | 10,106.70 | - |
| 603407 | 长裕集团 | 2026<br>年 4 月<br>29 日 | 6 个月 | 新股锁<br>定期 | 13.86 | 73.46      | 137 | 1,898.82 | 10,064.02 | - |
| 688712 | 北芯生命 | 2026<br>年 1 月<br>28 日 | 6 个月 | 新股锁<br>定期 | 17.52 | 35.92      | 234 | 4,099.68 | 8,405.28  | - |
| 603435 | 嘉德利  | 2026<br>年 5 月<br>15 日 | 6 个月 | 新股锁<br>定期 | 15.76 | 46.71      | 104 | 1,639.04 | 4,857.84  | - |
| 603352 | 至信股份 | 2026<br>年 1 月<br>8 日  | 6 个月 | 新股锁<br>定期 | 21.88 | 25.52      | 112 | 2,450.56 | 2,858.24  | - |
| 603293 | 埃泰克  | 2026<br>年 4 月<br>9 日  | 6 个月 | 新股锁<br>定期 | 33.49 | 33.93      | 72  | 2,411.28 | 2,442.96  | - |
| 001312 | 福恩股份 | 2026<br>年 4 月<br>14 日 | 6 个月 | 新股锁<br>定期 | 18.38 | 16.78      | 134 | 2,462.92 | 2,248.52  | - |
| 001220 | 世盟股份 | 2026<br>年 1 月<br>27 日 | 6 个月 | 新股锁<br>定期 | 28.00 | 27.78      | 57  | 1,596.00 | 1,583.46  | - |

## 6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

| 证券代<br>码 | 证券名称   | 成功认<br>购日             | 受限期              | 流通受<br>限类型 | 认购<br>价格   | 期末<br>估值<br>单价 | 数量<br>(单<br>位：<br>张) | 期末成本总<br>额 | 期末估值总<br>额 | 备<br>注 |
|----------|--------|-----------------------|------------------|------------|------------|----------------|----------------------|------------|------------|--------|
| 123274   | 维科转债   | 2026<br>年 6 月<br>26 日 | 1 个月<br>内<br>(含) | 新债未<br>上市  | 100.0<br>0 | 100.0<br>0     | 4,242                | 424,200.00 | 424,209.30 | -      |
| 113703   | 翔 26 转 | 2026                  | 1 个月             | 新债未        | 100.0      | 100.0          | 810                  | 81,000.00  | 81,008.17  | -      |

|  |   |              |          |    |   |   |  |  |  |  |
|--|---|--------------|----------|----|---|---|--|--|--|--|
|  | 债 | 年 6 月<br>9 日 | 内<br>(含) | 上市 | 0 | 1 |  |  |  |  |
|--|---|--------------|----------|----|---|---|--|--|--|--|

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<br>估值<br>单价 | 复牌<br>日期       | 复牌开<br>盘单价 | 数量（股）   | 期末成本总额       | 期末估值总额     | 备注 |
|--------|------|-----------------|--------|----------------|----------------|------------|---------|--------------|------------|----|
| 300332 | 天壕能源 | 2026 年 6 月 26 日 | 重大事项停牌 | 4.30           | 2026 年 7 月 9 日 | 4.64       | 229,700 | 1,109,113.14 | 987,710.00 | -  |

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

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

本基金是被动式指数基金，其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。紧密跟踪中证 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。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。本基金采用完全复制法，跟踪中证 2000 指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代，力求与标的指数的跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，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、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规与风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽

核部和风险管理部负责,协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估,督察长负责组织指导监察稽核工作。

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大中型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。信用等级评估以内部信用评级为主,外部信用评级为辅。内部债券信用评级主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险,以及信用产品的条款和担保人的情况等。此外,本基金的基金管理人根据信用产品的内部评级,通过单只信用产品投资占基金净资产的比例及占发行量的比例进行控制,通过分散化投资以分散信用风险。

#### 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。本基金为履行与金融负债有关的义务而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,可能产生基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为目的进行期货投资,以对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等,主要采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金力争利用期货的杠杆作用,降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差,达到有效跟踪标的指数的目的。

于本期末,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。本基金赎回基金份额采用一篮子股票形式,流动性风险相对较低。

#### 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“期末本基金持有的流通受限证券”。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超过基金资产净值的 15%。于本期末,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该要求。

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。

本基金持有的利率敏感性资产存在相应的利率风险。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 2026<br>年 6 月 30 日 | 1 年以内         | 1-5 年 | 5 年以上      | 不计息            | 合计             |
|------------------------|---------------|-------|------------|----------------|----------------|
| 资产                     |               |       |            |                |                |
| 货币资金                   | 11,432,099.37 | -     | -          | -              | 11,432,099.37  |
| 结算备付金                  | 9,856,092.59  | -     | -          | -              | 9,856,092.59   |
| 存出保证金                  | 704,382.42    | -     | -          | 1,832,760.00   | 2,537,142.42   |
| 交易性金融资产                | -             | -     | 505,217.47 | 775,476,852.86 | 775,982,070.33 |
| 衍生金融资产                 | -             | -     | -          | -              | -              |
| 买入返售金融资产               | -             | -     | -          | -              | -              |
| 债权投资                   | -             | -     | -          | -              | -              |
| 其他债权投资                 | -             | -     | -          | -              | -              |
| 其他权益工具投资               | -             | -     | -          | -              | -              |
| 应收清算款                  | -             | -     | -          | 1,909,734.11   | 1,909,734.11   |
| 应收股利                   | -             | -     | -          | -              | -              |
| 应收申购款                  | -             | -     | -          | -              | -              |
| 递延所得税资产                | -             | -     | -          | -              | -              |
| 其他资产                   | -             | -     | -          | -              | -              |
| 资产总计                   | 21,992,574.38 | -     | 505,217.47 | 779,219,346.97 | 801,717,138.82 |
| 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                  | -             | -     | -          | 75,701.59      | 75,701.59      |
| 应付赎回款                  | -             | -     | -          | -              | -              |
| 应付管理人报酬                | -             | -     | -          | 108,543.09     | 108,543.09     |
| 应付托管费                  | -             | -     | -          | 36,181.03      | 36,181.03      |
| 应付销售服务费                | -             | -     | -          | -              | -              |
| 应付投资顾问费                | -             | -     | -          | -              | -              |

|                             |                   |       |            |                    |                    |
|-----------------------------|-------------------|-------|------------|--------------------|--------------------|
| 应交税费                        | -                 | -     | -          | 47,872.30          | 47,872.30          |
| 应付利润                        | -                 | -     | -          | -                  | -                  |
| 递延所得税<br>负债                 | -                 | -     | -          | -                  | -                  |
| 其他负债                        | -                 | -     | -          | 7,442,787.02       | 7,442,787.02       |
| 负债总计                        | -                 | -     | -          | 7,711,085.03       | 7,711,085.03       |
| 利率敏感度<br>缺口                 | 21,992,574.3<br>8 | -     | 505,217.47 | 771,508,261.<br>94 | 794,006,053.<br>79 |
| 上年度末<br>2025 年 12<br>月 31 日 | 1 年以内             | 1-5 年 | 5 年以上      | 不计息                | 合计                 |
| 资产                          |                   |       |            |                    |                    |
| 货币资金                        | 2,884,484.95      | -     | -          | -                  | 2,884,484.95       |
| 结算备付金                       | 2,798,736.20      | -     | -          | -                  | 2,798,736.20       |
| 存出保证金                       | 680,006.71        | -     | -          | 535,608.00         | 1,215,614.71       |
| 交易性金融<br>资产                 | -                 | -     | 60,203.23  | 719,608,223.<br>88 | 719,668,427.<br>11 |
| 衍生金融资<br>产                  | -                 | -     | -          | -                  | -                  |
| 买入返售金<br>融资产                | -                 | -     | -          | -                  | -                  |
| 债权投资                        | -                 | -     | -          | -                  | -                  |
| 其他债权投<br>资                  | -                 | -     | -          | -                  | -                  |
| 其他权益工<br>具投资                | -                 | -     | -          | -                  | -                  |
| 应收清算款                       | -                 | -     | -          | 1,854,363.68       | 1,854,363.68       |
| 应收股利                        | -                 | -     | -          | -                  | -                  |
| 应收申购款                       | -                 | -     | -          | -                  | -                  |
| 递延所得税<br>资产                 | -                 | -     | -          | -                  | -                  |
| 其他资产                        | -                 | -     | -          | -                  | -                  |
| 资产总计                        | 6,363,227.86      | -     | 60,203.23  | 721,998,195.<br>56 | 728,421,626.<br>65 |
| 负债                          |                   |       |            |                    |                    |
| 短期借款                        | -                 | -     | -          | -                  | -                  |
| 交易性金融<br>负债                 | -                 | -     | -          | -                  | -                  |
| 衍生金融负<br>债                  | -                 | -     | -          | -                  | -                  |
| 卖出回购金<br>融资产款               | -                 | -     | -          | -                  | -                  |
| 应付清算款                       | -                 | -     | -          | 2,123.08           | 2,123.08           |

|         |              |   |           |                |                |
|---------|--------------|---|-----------|----------------|----------------|
| 应付赎回款   | -            | - | -         | -              | -              |
| 应付管理人报酬 | -            | - | -         | 86,715.75      | 86,715.75      |
| 应付托管费   | -            | - | -         | 28,905.27      | 28,905.27      |
| 应付销售服务费 | -            | - | -         | -              | -              |
| 应付投资顾问费 | -            | - | -         | -              | -              |
| 应交税费    | -            | - | -         | 1,425.08       | 1,425.08       |
| 应付利润    | -            | - | -         | -              | -              |
| 递延所得税负债 | -            | - | -         | -              | -              |
| 其他负债    | -            | - | -         | 3,058,581.28   | 3,058,581.28   |
| 负债总计    | -            | - | -         | 3,177,750.46   | 3,177,750.46   |
| 利率敏感度缺口 | 6,363,227.86 | - | 60,203.23 | 718,820,445.10 | 725,243,876.19 |

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

| 假设 | 除市场利率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（ 2026 年 6 月 30 日 ）      | 上年度末（ 2025 年 12 月 31 日 ） |
|    | 1.市场利率平行上升 25 个基点  | 0.00                        | 0.00                     |
|    | 2.市场利率平行下降 25 个基点  | 0.00                        | 0.00                     |

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。本基金本期末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。本基金主要投资于股票，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。

本基金采用完全复制法，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，通过指数化分散投资降低其他价格风险。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，来测试本基金面临的潜在价格风险，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

单位：人民币元

| 项目            | 本期末 2026 年 6 月 30 日 |               | 上年度末 2025 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  | 775,476,852.86      | 97.67         | 719,608,223.88        | 99.22         |
| 交易性金融资产-基金投资  | -                   | -             | -                     | -             |
| 交易性金融资产-债券投资  | 505,217.47          | 0.06          | 60,203.23             | 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            | 775,982,070.33      | 97.73         | 719,668,427.11        | 99.23         |

注：1、交易性金融资产-债券投资项目仅包含可转换公司债券或可交换公司债券。

2、其他包含在期货交易所交易的期货投资（附注“衍生金融资产/负债”）。在当日无负债结算制度下，期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

#### 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（2026 年 6 月 30 日）        | 上年度末（2025 年 12 月 31 日） |
|    | 1.组合自身基准上升 5%        | 39,861,282.32               | 36,050,000.87          |
|    | 2.组合自身基准下降 5%        | -39,861,282.32              | -36,050,000.87         |

#### 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 2026 年 6 月 30 日 |
|---------------|---------------------|
| 第一层次          | 772,774,003.04      |
| 第二层次          | 1,492,927.47        |
| 第三层次          | 1,715,139.82        |
| 合计            | 775,982,070.33      |

##### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃、非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

##### 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

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   | 775,476,852.86 | 96.73         |
|    | 其中：股票  | 775,476,852.86 | 96.73         |
| 2  | 基金投资   | -              | -             |
| 3  | 固定收益投资 | 505,217.47     | 0.06          |
|    | 其中：债券  | 505,217.47     | 0.06          |
|    | 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      | 21,288,191.96  | 2.66   |
| 8 | 其他各项资产            | 4,446,876.53   | 0.55   |
| 9 | 合计                | 801,717,138.82 | 100.00 |

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而行业分类的合计项中不含可退替代款估值增值。

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 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         | 4,169,437.00   | 0.53         |
| B  | 采矿业              | 6,583,483.60   | 0.83         |
| C  | 制造业              | 587,688,769.76 | 74.02        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 11,819,025.30  | 1.49         |
| E  | 建筑业              | 8,299,146.00   | 1.05         |
| F  | 批发和零售业           | 28,431,139.60  | 3.58         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 4,479,142.00   | 0.56         |
| H  | 住宿和餐饮业           | 4,316,856.00   | 0.54         |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 64,236,911.49  | 8.09         |
| J  | 金融业              | -              | -            |
| K  | 房地产业             | 12,167,519.00  | 1.53         |
| L  | 租赁和商务服务业         | 9,601,502.00   | 1.21         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 13,635,031.95  | 1.72         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 12,240,468.32  | 1.54         |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -              | -            |
| P  | 教育               | -              | -            |
| Q  | 卫生和社会工作          | 2,445,886.12   | 0.31         |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | 3,646,346.64   | 0.46         |
| S  | 综合               | -              | -            |
|    | 合计               | 773,760,664.78 | 97.45        |

### 7.2.2 期末积极投资按行业分类境内股票投资组合

| 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              | 1,695,531.02 | 0.21 |
| 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      | 1,583.46     | 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         | -            | -    |
| M | 科学研究和技术服务业       | -            | -    |
| N | 水利、环境和公共设施管理业    | -            | -    |
| O | 居民服务、修理和其他服务业    | -            | -    |
| P | 教育               | -            | -    |
| Q | 卫生和社会工作          | -            | -    |
| R | 文化、体育和娱乐业        | -            | -    |
| S | 综合               | -            | -    |
|   | 合计               | 1,697,114.48 | 0.21 |

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

## 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  | 002079 | 苏州固锟 | 355,195 | 5,338,580.85 | 0.67         |
| 2  | 603061 | 金海通  | 8,475   | 4,256,314.50 | 0.54         |
| 3  | 002803 | 吉宏股份 | 156,200 | 4,036,208.00 | 0.51         |
| 4  | 002057 | 中钢天源 | 309,523 | 3,847,370.89 | 0.48         |
| 5  | 002955 | 鸿合科技 | 104,700 | 3,743,025.00 | 0.47         |
| 6  | 688653 | 康希通信 | 205,370 | 3,569,330.60 | 0.45         |
| 7  | 001314 | 亿道信息 | 54,800  | 3,386,640.00 | 0.43         |
| 8  | 300909 | 汇创达  | 58,100  | 3,382,582.00 | 0.43         |
| 9  | 300489 | 光智科技 | 10,700  | 3,337,865.00 | 0.42         |
| 10 | 300938 | 信测标准 | 64,920  | 3,238,209.60 | 0.41         |
| 11 | 000922 | 佳电股份 | 231,891 | 3,237,198.36 | 0.41         |
| 12 | 688378 | 奥来德  | 51,904  | 3,218,048.00 | 0.41         |

|    |        |      |           |              |      |
|----|--------|------|-----------|--------------|------|
| 13 | 301328 | 维峰电子 | 44,200    | 3,147,040.00 | 0.40 |
| 14 | 301086 | 鸿富瀚  | 14,600    | 3,055,488.00 | 0.38 |
| 15 | 300786 | 国林科技 | 120,600   | 3,023,442.00 | 0.38 |
| 16 | 300201 | 海伦哲  | 141,600   | 2,983,512.00 | 0.38 |
| 17 | 300151 | 昌红科技 | 118,600   | 2,959,070.00 | 0.37 |
| 18 | 300681 | 英搏尔  | 101,000   | 2,890,620.00 | 0.36 |
| 19 | 300790 | 宇瞳光学 | 109,720   | 2,864,789.20 | 0.36 |
| 20 | 002708 | 光洋股份 | 213,400   | 2,814,746.00 | 0.35 |
| 21 | 688386 | 泛亚微透 | 31,200    | 2,803,008.00 | 0.35 |
| 22 | 002491 | 通鼎互联 | 85,700    | 2,776,680.00 | 0.35 |
| 23 | 300485 | 赛升药业 | 286,100   | 2,720,811.00 | 0.34 |
| 24 | 300975 | 商络电子 | 52,100    | 2,696,175.00 | 0.34 |
| 25 | 301499 | 维科精密 | 91,600    | 2,672,888.00 | 0.34 |
| 26 | 300277 | 汽轮科技 | 176,730   | 2,658,019.20 | 0.33 |
| 27 | 000419 | 通程控股 | 585,700   | 2,641,507.00 | 0.33 |
| 28 | 603186 | 华正新材 | 11,600    | 2,613,480.00 | 0.33 |
| 29 | 300596 | 利安隆  | 49,214    | 2,582,750.72 | 0.33 |
| 30 | 688620 | 安凯微  | 157,796   | 2,556,295.20 | 0.32 |
| 31 | 300689 | 澄天伟业 | 35,900    | 2,519,462.00 | 0.32 |
| 32 | 603031 | 安孚科技 | 46,400    | 2,470,800.00 | 0.31 |
| 33 | 300835 | 龙磁科技 | 10,750    | 2,467,017.50 | 0.31 |
| 34 | 688518 | 联赢激光 | 78,034    | 2,411,250.60 | 0.30 |
| 35 | 002437 | 誉衡药业 | 887,567   | 2,396,430.90 | 0.30 |
| 36 | 603936 | 博敏电子 | 89,200    | 2,382,532.00 | 0.30 |
| 37 | 002899 | 英派斯  | 108,200   | 2,358,760.00 | 0.30 |
| 38 | 301073 | 君亭酒店 | 127,800   | 2,325,960.00 | 0.29 |
| 39 | 002975 | 博杰股份 | 16,320    | 2,317,440.00 | 0.29 |
| 40 | 000897 | 津滨发展 | 1,396,000 | 2,317,360.00 | 0.29 |
| 41 | 300263 | 隆华科技 | 141,900   | 2,312,970.00 | 0.29 |
| 42 | 300843 | 胜蓝股份 | 14,700    | 2,296,875.00 | 0.29 |
| 43 | 002438 | 江苏神通 | 153,600   | 2,293,248.00 | 0.29 |
| 44 | 688609 | 九联科技 | 205,618   | 2,263,854.18 | 0.29 |
| 45 | 301150 | 中一科技 | 35,520    | 2,241,667.20 | 0.28 |
| 46 | 002903 | 宇环数控 | 49,300    | 2,239,206.00 | 0.28 |
| 47 | 002649 | 博彦科技 | 274,700   | 2,236,058.00 | 0.28 |
| 48 | 003012 | 东鹏控股 | 509,400   | 2,220,984.00 | 0.28 |
| 49 | 301603 | 乔锋智能 | 15,100    | 2,171,380.00 | 0.27 |
| 50 | 002520 | 日发精机 | 313,100   | 2,163,521.00 | 0.27 |
| 51 | 605289 | 罗曼股份 | 14,860    | 2,154,700.00 | 0.27 |
| 52 | 002935 | 天奥电子 | 97,300    | 2,134,762.00 | 0.27 |
| 53 | 301305 | 朗坤科技 | 74,700    | 2,130,444.00 | 0.27 |
| 54 | 300302 | 同有科技 | 41,600    | 2,128,672.00 | 0.27 |
| 55 | 002398 | 垒知集团 | 557,900   | 2,092,125.00 | 0.26 |

|    |        |      |         |              |      |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 56 | 688257 | 新锐股份 | 20,451  | 2,083,956.90 | 0.26 |
| 57 | 002169 | 智光电气 | 142,200 | 2,081,808.00 | 0.26 |
| 58 | 002655 | 共达电声 | 45,100  | 2,074,600.00 | 0.26 |
| 59 | 002452 | 长高电气 | 161,900 | 2,067,463.00 | 0.26 |
| 60 | 301051 | 信濠光电 | 106,440 | 2,064,936.00 | 0.26 |
| 61 | 301021 | 英诺激光 | 16,900  | 2,060,110.00 | 0.26 |
| 62 | 688059 | 华锐精密 | 10,315  | 2,060,008.65 | 0.26 |
| 63 | 301280 | 珠城科技 | 39,808  | 2,013,090.56 | 0.25 |
| 64 | 000428 | 华天酒店 | 654,900 | 1,990,896.00 | 0.25 |
| 65 | 300740 | 水羊股份 | 108,000 | 1,988,280.00 | 0.25 |
| 66 | 301248 | 杰创智能 | 23,000  | 1,930,390.00 | 0.24 |
| 67 | 300400 | 劲拓股份 | 51,100  | 1,923,915.00 | 0.24 |
| 68 | 300041 | 回天新材 | 123,200 | 1,914,528.00 | 0.24 |
| 69 | 301251 | 威尔高  | 35,760  | 1,905,292.80 | 0.24 |
| 70 | 300700 | 岱勒新材 | 89,320  | 1,900,729.60 | 0.24 |
| 71 | 301252 | 同星科技 | 46,800  | 1,896,804.00 | 0.24 |
| 72 | 300079 | 数码视讯 | 445,800 | 1,872,360.00 | 0.24 |
| 73 | 300219 | 鸿利智汇 | 178,200 | 1,858,626.00 | 0.23 |
| 74 | 301093 | 华兰股份 | 13,700  | 1,858,131.00 | 0.23 |
| 75 | 300042 | 朗科科技 | 24,200  | 1,843,314.00 | 0.23 |
| 76 | 001311 | 多利科技 | 114,163 | 1,841,449.19 | 0.23 |
| 77 | 300149 | 睿智医药 | 192,900 | 1,840,266.00 | 0.23 |
| 78 | 605377 | 华旺科技 | 197,700 | 1,838,610.00 | 0.23 |
| 79 | 301568 | 思泰克  | 16,400  | 1,830,240.00 | 0.23 |
| 80 | 688233 | 神工股份 | 8,527   | 1,828,359.34 | 0.23 |
| 81 | 002284 | 亚太股份 | 192,400 | 1,825,876.00 | 0.23 |
| 82 | 002645 | 华宏科技 | 66,280  | 1,823,362.80 | 0.23 |
| 83 | 002022 | 科华生物 | 395,700 | 1,812,306.00 | 0.23 |
| 84 | 603738 | 泰晶科技 | 30,100  | 1,807,505.00 | 0.23 |
| 85 | 300921 | 南凌科技 | 88,800  | 1,803,528.00 | 0.23 |
| 86 | 301132 | 满坤科技 | 34,300  | 1,801,436.00 | 0.23 |
| 87 | 000822 | 山东海化 | 447,506 | 1,798,974.12 | 0.23 |
| 88 | 300852 | 四会富仕 | 25,900  | 1,793,316.00 | 0.23 |
| 89 | 603629 | 利通电子 | 10,000  | 1,788,100.00 | 0.23 |
| 90 | 002996 | 顺博合金 | 303,000 | 1,787,700.00 | 0.23 |
| 91 | 002391 | 长青股份 | 366,300 | 1,783,881.00 | 0.22 |
| 92 | 300248 | 新开普  | 230,800 | 1,779,468.00 | 0.22 |
| 93 | 002478 | 常宝股份 | 287,900 | 1,779,222.00 | 0.22 |
| 94 | 300606 | 金太阳  | 41,800  | 1,779,008.00 | 0.22 |
| 95 | 301013 | 利和兴  | 24,600  | 1,777,350.00 | 0.22 |
| 96 | 688135 | 利扬芯片 | 42,150  | 1,773,672.00 | 0.22 |
| 97 | 002274 | 华昌化工 | 381,400 | 1,765,882.00 | 0.22 |
| 98 | 300121 | 阳谷华泰 | 140,100 | 1,765,260.00 | 0.22 |

|     |        |      |         |              |      |
|-----|--------|------|---------|--------------|------|
| 99  | 002285 | 世联行  | 860,500 | 1,764,025.00 | 0.22 |
| 100 | 002111 | 威海广泰 | 195,720 | 1,761,480.00 | 0.22 |
| 101 | 688508 | 芯朋微  | 18,712  | 1,739,467.52 | 0.22 |
| 102 | 002616 | 长青集团 | 388,400 | 1,736,148.00 | 0.22 |
| 103 | 002988 | 豪美新材 | 78,400  | 1,729,504.00 | 0.22 |
| 104 | 301183 | 东田微  | 6,500   | 1,721,655.00 | 0.22 |
| 105 | 688275 | 万润新能 | 13,224  | 1,686,721.20 | 0.21 |
| 106 | 300563 | 神宇股份 | 59,300  | 1,683,527.00 | 0.21 |
| 107 | 300046 | 台基股份 | 46,000  | 1,681,760.00 | 0.21 |
| 108 | 002991 | 甘源食品 | 42,500  | 1,679,175.00 | 0.21 |
| 109 | 000797 | 中国武夷 | 761,100 | 1,666,809.00 | 0.21 |
| 110 | 002154 | 报喜鸟  | 467,800 | 1,665,368.00 | 0.21 |
| 111 | 000886 | 海南高速 | 407,300 | 1,661,784.00 | 0.21 |
| 112 | 688028 | 沃尔德  | 10,645  | 1,659,236.15 | 0.21 |
| 113 | 301162 | 国能日新 | 37,876  | 1,657,075.00 | 0.21 |
| 114 | 300039 | 上海凯宝 | 386,300 | 1,645,638.00 | 0.21 |
| 115 | 300733 | 西菱动力 | 136,720 | 1,633,804.00 | 0.21 |
| 116 | 300129 | 泰胜风能 | 191,000 | 1,633,050.00 | 0.21 |
| 117 | 002969 | 嘉美包装 | 115,400 | 1,624,832.00 | 0.20 |
| 118 | 002328 | 新朋股份 | 220,500 | 1,618,470.00 | 0.20 |
| 119 | 603150 | 万朗磁塑 | 22,700  | 1,607,160.00 | 0.20 |
| 120 | 300132 | 青松股份 | 279,800 | 1,589,264.00 | 0.20 |
| 121 | 301128 | 强瑞技术 | 10,180  | 1,587,062.00 | 0.20 |
| 122 | 002937 | 兴瑞科技 | 36,091  | 1,585,477.63 | 0.20 |
| 123 | 000968 | 蓝焰控股 | 264,600 | 1,584,954.00 | 0.20 |
| 124 | 002134 | 天津普林 | 51,900  | 1,578,798.00 | 0.20 |
| 125 | 301026 | 浩通科技 | 78,060  | 1,578,373.20 | 0.20 |
| 126 | 002448 | 中原内配 | 128,200 | 1,576,860.00 | 0.20 |
| 127 | 301003 | 江苏博云 | 29,433  | 1,574,665.50 | 0.20 |
| 128 | 002166 | 莱茵生物 | 250,310 | 1,571,946.80 | 0.20 |
| 129 | 601388 | 怡球资源 | 553,500 | 1,566,405.00 | 0.20 |
| 130 | 002796 | 世嘉科技 | 38,400  | 1,565,952.00 | 0.20 |
| 131 | 688305 | 科德数控 | 23,950  | 1,563,216.50 | 0.20 |
| 132 | 002293 | 罗莱生活 | 157,800 | 1,560,642.00 | 0.20 |
| 133 | 301529 | 福赛科技 | 16,060  | 1,547,541.60 | 0.19 |
| 134 | 300976 | 达瑞电子 | 19,361  | 1,542,103.65 | 0.19 |
| 135 | 001313 | 粤海饲料 | 217,400 | 1,541,366.00 | 0.19 |
| 136 | 000751 | 锌业股份 | 251,700 | 1,540,404.00 | 0.19 |
| 137 | 603990 | 麦迪科技 | 72,100  | 1,535,009.00 | 0.19 |
| 138 | 301265 | 华新科技 | 55,700  | 1,534,535.00 | 0.19 |
| 139 | 002986 | 宇新股份 | 129,400 | 1,530,802.00 | 0.19 |
| 140 | 300318 | 博晖创新 | 365,300 | 1,526,954.00 | 0.19 |
| 141 | 300179 | 四方达  | 25,600  | 1,521,408.00 | 0.19 |

|     |        |      |         |              |      |
|-----|--------|------|---------|--------------|------|
| 142 | 002283 | 天润工业 | 157,400 | 1,518,910.00 | 0.19 |
| 143 | 000949 | 新乡化纤 | 239,200 | 1,516,528.00 | 0.19 |
| 144 | 300222 | 科大智能 | 108,900 | 1,508,265.00 | 0.19 |
| 145 | 002034 | 旺能环境 | 99,546  | 1,508,121.90 | 0.19 |
| 146 | 603618 | 杭电股份 | 30,100  | 1,501,388.00 | 0.19 |
| 147 | 301123 | 奕东电子 | 12,400  | 1,496,928.00 | 0.19 |
| 148 | 600367 | 红星发展 | 23,700  | 1,491,441.00 | 0.19 |
| 149 | 603281 | 江瀚新材 | 36,700  | 1,491,121.00 | 0.19 |
| 150 | 002390 | 信邦制药 | 570,100 | 1,487,961.00 | 0.19 |
| 151 | 301367 | 瑞迈特  | 38,480  | 1,487,636.80 | 0.19 |
| 152 | 000735 | 罗牛山  | 310,900 | 1,476,775.00 | 0.19 |
| 153 | 002876 | 三利谱  | 41,900  | 1,475,299.00 | 0.19 |
| 154 | 688199 | 久日新材 | 42,671  | 1,473,429.63 | 0.19 |
| 155 | 688090 | 瑞松科技 | 13,794  | 1,468,371.30 | 0.18 |
| 156 | 002627 | 三峡旅游 | 257,000 | 1,467,470.00 | 0.18 |
| 157 | 300973 | 立高食品 | 59,300  | 1,457,001.00 | 0.18 |
| 158 | 300481 | 濮阳惠成 | 76,600  | 1,456,932.00 | 0.18 |
| 159 | 301566 | 达利凯普 | 38,800  | 1,438,704.00 | 0.18 |
| 160 | 002810 | 山东赫达 | 58,200  | 1,437,540.00 | 0.18 |
| 161 | 300467 | 迅游科技 | 38,620  | 1,435,891.60 | 0.18 |
| 162 | 301312 | 智立方  | 12,300  | 1,426,923.00 | 0.18 |
| 163 | 688456 | 有研粉材 | 10,221  | 1,426,851.60 | 0.18 |
| 164 | 688678 | 福立旺  | 58,945  | 1,424,700.65 | 0.18 |
| 165 | 300745 | 欣锐科技 | 33,500  | 1,414,370.00 | 0.18 |
| 166 | 301062 | 上海艾录 | 247,650 | 1,414,081.50 | 0.18 |
| 167 | 300275 | 梅安森  | 175,600 | 1,410,068.00 | 0.18 |
| 168 | 301257 | 普蕊斯  | 30,990  | 1,406,326.20 | 0.18 |
| 169 | 301535 | 浙江华远 | 104,400 | 1,401,048.00 | 0.18 |
| 170 | 300206 | 理邦仪器 | 114,400 | 1,399,112.00 | 0.18 |
| 171 | 600966 | 博汇纸业 | 292,500 | 1,398,150.00 | 0.18 |
| 172 | 002912 | 中新赛克 | 75,800  | 1,397,752.00 | 0.18 |
| 173 | 300005 | 探路者  | 61,500  | 1,389,900.00 | 0.18 |
| 174 | 301096 | 百诚医药 | 24,300  | 1,389,717.00 | 0.18 |
| 175 | 001338 | 永顺泰  | 165,600 | 1,389,384.00 | 0.17 |
| 176 | 300805 | 电声股份 | 190,200 | 1,378,950.00 | 0.17 |
| 177 | 301382 | 蜂助手  | 29,898  | 1,375,308.00 | 0.17 |
| 178 | 002264 | 新华都  | 243,300 | 1,372,212.00 | 0.17 |
| 179 | 002339 | 积成电子 | 197,700 | 1,370,061.00 | 0.17 |
| 180 | 301397 | 溯联股份 | 42,300  | 1,368,828.00 | 0.17 |
| 181 | 603683 | 晶华新材 | 44,400  | 1,368,408.00 | 0.17 |
| 182 | 300016 | 北陆药业 | 178,400 | 1,368,328.00 | 0.17 |
| 183 | 002772 | 众兴菌业 | 120,400 | 1,367,744.00 | 0.17 |
| 184 | 002361 | 神剑股份 | 90,800  | 1,366,540.00 | 0.17 |

|     |        |       |         |              |      |
|-----|--------|-------|---------|--------------|------|
| 185 | 300959 | 线上线下  | 9,200   | 1,359,852.00 | 0.17 |
| 186 | 301069 | 凯盛新材  | 67,800  | 1,358,712.00 | 0.17 |
| 187 | 301370 | 国科恒泰  | 167,300 | 1,353,457.00 | 0.17 |
| 188 | 000912 | 泸天化   | 421,200 | 1,352,052.00 | 0.17 |
| 189 | 300491 | 通合科技  | 35,400  | 1,351,926.00 | 0.17 |
| 190 | 603726 | 朗迪集团  | 39,400  | 1,349,450.00 | 0.17 |
| 191 | 300842 | 帝科股份  | 15,120  | 1,348,250.40 | 0.17 |
| 192 | 300499 | 高澜股份  | 34,800  | 1,346,760.00 | 0.17 |
| 193 | 300461 | 田中精机  | 36,300  | 1,344,552.00 | 0.17 |
| 194 | 002849 | 威星智能  | 79,290  | 1,341,586.80 | 0.17 |
| 195 | 688359 | 三孚新科  | 6,754   | 1,340,263.76 | 0.17 |
| 196 | 300424 | 航新科技  | 85,100  | 1,339,474.00 | 0.17 |
| 197 | 300291 | 百纳千成  | 277,208 | 1,338,914.64 | 0.17 |
| 198 | 300840 | 酷特智能  | 64,100  | 1,322,383.00 | 0.17 |
| 199 | 300048 | 合康新能  | 282,700 | 1,320,209.00 | 0.17 |
| 200 | 002297 | 博云新材  | 45,500  | 1,319,045.00 | 0.17 |
| 201 | 000888 | 峨眉山 A | 147,200 | 1,315,968.00 | 0.17 |
| 202 | 002943 | 宇晶股份  | 29,390  | 1,299,919.70 | 0.16 |
| 203 | 300980 | 祥源新材  | 44,100  | 1,296,981.00 | 0.16 |
| 204 | 002132 | 恒星科技  | 238,200 | 1,288,662.00 | 0.16 |
| 205 | 002016 | 世荣兆业  | 319,000 | 1,276,000.00 | 0.16 |
| 206 | 688383 | 新益昌   | 6,780   | 1,274,911.20 | 0.16 |
| 207 | 300513 | 恒实科技  | 175,800 | 1,272,792.00 | 0.16 |
| 208 | 002090 | 金智科技  | 143,300 | 1,266,772.00 | 0.16 |
| 209 | 300191 | 潜能恒信  | 45,800  | 1,266,370.00 | 0.16 |
| 210 | 300939 | 秋田微   | 18,300  | 1,266,360.00 | 0.16 |
| 211 | 002206 | 海利得   | 244,930 | 1,266,288.10 | 0.16 |
| 212 | 300731 | 科创新源  | 21,660  | 1,264,077.60 | 0.16 |
| 213 | 002997 | 瑞鹄模具  | 45,300  | 1,248,468.00 | 0.16 |
| 214 | 002980 | 华盛昌   | 10,700  | 1,246,978.00 | 0.16 |
| 215 | 300801 | 泰和科技  | 38,500  | 1,243,550.00 | 0.16 |
| 216 | 300856 | 科思股份  | 116,600 | 1,242,956.00 | 0.16 |
| 217 | 300996 | 普联软件  | 113,612 | 1,237,234.68 | 0.16 |
| 218 | 002956 | 西麦食品  | 59,220  | 1,229,407.20 | 0.15 |
| 219 | 301369 | 联动科技  | 5,010   | 1,227,450.00 | 0.15 |
| 220 | 000753 | 漳州发展  | 272,500 | 1,223,525.00 | 0.15 |
| 221 | 002805 | 丰元股份  | 42,700  | 1,220,793.00 | 0.15 |
| 222 | 300055 | 万邦达   | 189,800 | 1,220,414.00 | 0.15 |
| 223 | 002886 | 沃特股份  | 43,400  | 1,219,106.00 | 0.15 |
| 224 | 300139 | 晓程科技  | 33,300  | 1,217,115.00 | 0.15 |
| 225 | 000560 | 我爱我家  | 587,700 | 1,216,539.00 | 0.15 |
| 226 | 301393 | 昊帆生物  | 18,600  | 1,204,722.00 | 0.15 |
| 227 | 002440 | 闰土股份  | 117,400 | 1,203,350.00 | 0.15 |

|     |        |      |         |              |      |
|-----|--------|------|---------|--------------|------|
| 228 | 000607 | 华媒控股 | 389,900 | 1,196,993.00 | 0.15 |
| 229 | 301246 | 宏源药业 | 44,400  | 1,194,360.00 | 0.15 |
| 230 | 002752 | 昇兴股份 | 215,100 | 1,187,352.00 | 0.15 |
| 231 | 002579 | 中京电子 | 54,700  | 1,185,896.00 | 0.15 |
| 232 | 688173 | 希荻微  | 61,950  | 1,185,723.00 | 0.15 |
| 233 | 001360 | 南矿集团 | 66,500  | 1,176,385.00 | 0.15 |
| 234 | 688291 | 金橙子  | 20,095  | 1,175,155.60 | 0.15 |
| 235 | 603538 | 美诺华  | 35,900  | 1,168,545.00 | 0.15 |
| 236 | 002523 | 天桥起重 | 392,100 | 1,168,458.00 | 0.15 |
| 237 | 301360 | 荣旗科技 | 17,000  | 1,164,330.00 | 0.15 |
| 238 | 688628 | 优利德  | 11,738  | 1,161,357.72 | 0.15 |
| 239 | 300486 | 东杰智能 | 54,350  | 1,160,372.50 | 0.15 |
| 240 | 300922 | 天秦装备 | 76,500  | 1,158,975.00 | 0.15 |
| 241 | 300288 | 朗玛信息 | 130,200 | 1,158,780.00 | 0.15 |
| 242 | 002343 | 慈文传媒 | 264,800 | 1,154,528.00 | 0.15 |
| 243 | 002757 | 南兴股份 | 63,400  | 1,144,370.00 | 0.14 |
| 244 | 002543 | 万和电气 | 182,600 | 1,135,772.00 | 0.14 |
| 245 | 000593 | 德龙汇能 | 53,100  | 1,135,278.00 | 0.14 |
| 246 | 300164 | 通源石油 | 141,900 | 1,135,200.00 | 0.14 |
| 247 | 600396 | 华电辽能 | 75,800  | 1,133,968.00 | 0.14 |
| 248 | 300541 | 先进数通 | 117,500 | 1,133,875.00 | 0.14 |
| 249 | 603112 | 华翔股份 | 67,700  | 1,132,621.00 | 0.14 |
| 250 | 000948 | 南天信息 | 94,900  | 1,128,361.00 | 0.14 |
| 251 | 300943 | 春晖智控 | 25,100  | 1,128,245.00 | 0.14 |
| 252 | 000655 | 金岭矿业 | 176,935 | 1,125,306.60 | 0.14 |
| 253 | 002718 | 友邦吊顶 | 10,200  | 1,124,550.00 | 0.14 |
| 254 | 301518 | 长华化学 | 42,900  | 1,123,980.00 | 0.14 |
| 255 | 002562 | 兄弟科技 | 258,100 | 1,122,735.00 | 0.14 |
| 256 | 001376 | 百通能源 | 107,900 | 1,122,160.00 | 0.14 |
| 257 | 300739 | 明阳电路 | 31,900  | 1,120,966.00 | 0.14 |
| 258 | 002515 | 金字火腿 | 111,600 | 1,117,116.00 | 0.14 |
| 259 | 300991 | 创益通  | 31,600  | 1,112,636.00 | 0.14 |
| 260 | 301085 | 亚康股份 | 18,300  | 1,109,163.00 | 0.14 |
| 261 | 300696 | 爱乐达  | 42,500  | 1,106,275.00 | 0.14 |
| 262 | 301136 | 招标股份 | 100,700 | 1,105,686.00 | 0.14 |
| 263 | 603931 | 格林达  | 18,500  | 1,098,900.00 | 0.14 |
| 264 | 301239 | 普瑞眼科 | 36,000  | 1,096,200.00 | 0.14 |
| 265 | 002908 | 德生科技 | 172,800 | 1,093,824.00 | 0.14 |
| 266 | 300830 | 金现代  | 137,000 | 1,087,780.00 | 0.14 |
| 267 | 688035 | 德邦科技 | 11,812  | 1,084,341.60 | 0.14 |
| 268 | 002348 | 高乐股份 | 102,760 | 1,083,090.40 | 0.14 |
| 269 | 002860 | 星帅尔  | 74,100  | 1,081,119.00 | 0.14 |
| 270 | 002365 | 永安药业 | 106,700 | 1,079,804.00 | 0.14 |

|     |        |      |         |              |      |
|-----|--------|------|---------|--------------|------|
| 271 | 603985 | 恒润股份 | 44,900  | 1,078,498.00 | 0.14 |
| 272 | 688513 | 苑东生物 | 24,500  | 1,077,020.00 | 0.14 |
| 273 | 002117 | 东港股份 | 136,600 | 1,076,408.00 | 0.14 |
| 274 | 300756 | 金马游乐 | 32,520  | 1,074,786.00 | 0.14 |
| 275 | 300448 | 浩云科技 | 185,800 | 1,070,208.00 | 0.13 |
| 276 | 000700 | 模塑科技 | 72,300  | 1,067,148.00 | 0.13 |
| 277 | 603181 | 皇马科技 | 65,700  | 1,065,654.00 | 0.13 |
| 278 | 002957 | 科瑞技术 | 19,400  | 1,063,896.00 | 0.13 |
| 279 | 688663 | 新风光  | 12,006  | 1,062,050.76 | 0.13 |
| 280 | 002741 | 光华科技 | 29,701  | 1,061,513.74 | 0.13 |
| 281 | 300050 | 世纪鼎利 | 178,700 | 1,057,904.00 | 0.13 |
| 282 | 002476 | 新叶股份 | 217,200 | 1,055,592.00 | 0.13 |
| 283 | 688418 | 震有科技 | 21,894  | 1,052,663.52 | 0.13 |
| 284 | 301188 | 力诺药包 | 15,700  | 1,050,330.00 | 0.13 |
| 285 | 301178 | 天亿马  | 21,060  | 1,047,735.00 | 0.13 |
| 286 | 300662 | 科锐国际 | 61,600  | 1,045,968.00 | 0.13 |
| 287 | 002479 | 富春环保 | 246,900 | 1,039,449.00 | 0.13 |
| 288 | 002218 | 拓日新能 | 270,400 | 1,038,336.00 | 0.13 |
| 289 | 603115 | 海星股份 | 8,400   | 1,028,748.00 | 0.13 |
| 290 | 688416 | 恒烁股份 | 7,306   | 1,022,840.00 | 0.13 |
| 291 | 301439 | 泓淋电力 | 64,900  | 1,020,228.00 | 0.13 |
| 292 | 300138 | 晨光生物 | 113,200 | 1,018,800.00 | 0.13 |
| 293 | 300941 | 创识科技 | 74,000  | 1,016,020.00 | 0.13 |
| 294 | 688510 | 航亚科技 | 42,525  | 1,015,497.00 | 0.13 |
| 295 | 002519 | 银河电子 | 173,000 | 1,012,050.00 | 0.13 |
| 296 | 300824 | 北鼎股份 | 140,300 | 1,007,354.00 | 0.13 |
| 297 | 000731 | 四川美丰 | 196,500 | 1,004,115.00 | 0.13 |
| 298 | 002560 | 通达股份 | 134,100 | 997,704.00   | 0.13 |
| 299 | 002612 | 朗姿股份 | 88,700  | 994,327.00   | 0.13 |
| 300 | 000505 | 京粮控股 | 196,500 | 988,395.00   | 0.12 |
| 301 | 300332 | 天壕能源 | 229,700 | 987,710.00   | 0.12 |
| 302 | 688662 | 富信科技 | 5,873   | 986,664.00   | 0.12 |
| 303 | 688261 | 东微半导 | 9,340   | 980,046.20   | 0.12 |
| 304 | 688677 | 海泰新光 | 9,688   | 979,747.44   | 0.12 |
| 305 | 002376 | 新北洋  | 170,300 | 979,225.00   | 0.12 |
| 306 | 688181 | 八亿时空 | 15,633  | 978,625.80   | 0.12 |
| 307 | 002009 | 天奇股份 | 47,307  | 978,308.76   | 0.12 |
| 308 | 301067 | 显盈科技 | 25,860  | 978,025.20   | 0.12 |
| 309 | 688721 | 龙图光罩 | 16,742  | 977,397.96   | 0.12 |
| 310 | 603626 | 科森科技 | 52,600  | 973,100.00   | 0.12 |
| 311 | 002580 | 圣阳股份 | 48,000  | 967,680.00   | 0.12 |
| 312 | 002471 | 中超控股 | 160,100 | 965,403.00   | 0.12 |
| 313 | 002119 | 康强电子 | 24,100  | 962,072.00   | 0.12 |

|     |        |      |         |            |      |
|-----|--------|------|---------|------------|------|
| 314 | 002455 | 百川股份 | 133,600 | 961,920.00 | 0.12 |
| 315 | 300533 | 冰川网络 | 58,635  | 961,614.00 | 0.12 |
| 316 | 301338 | 凯格精机 | 5,900   | 961,051.00 | 0.12 |
| 317 | 301201 | 诚达药业 | 26,400  | 959,904.00 | 0.12 |
| 318 | 600714 | 金瑞矿业 | 46,500  | 954,645.00 | 0.12 |
| 319 | 000514 | 渝开发  | 266,400 | 953,712.00 | 0.12 |
| 320 | 002533 | 金杯电工 | 89,300  | 952,831.00 | 0.12 |
| 321 | 300540 | 蜀道装备 | 25,100  | 951,290.00 | 0.12 |
| 322 | 300071 | 福石控股 | 271,700 | 950,950.00 | 0.12 |
| 323 | 301210 | 金杨精密 | 31,486  | 944,580.00 | 0.12 |
| 324 | 300592 | 华凯易佰 | 53,340  | 944,118.00 | 0.12 |
| 325 | 002337 | 赛象科技 | 213,000 | 943,590.00 | 0.12 |
| 326 | 301613 | 新铝时代 | 25,900  | 943,537.00 | 0.12 |
| 327 | 000576 | 甘化科工 | 143,600 | 943,452.00 | 0.12 |
| 328 | 001317 | 三羊马  | 23,800  | 942,004.00 | 0.12 |
| 329 | 002228 | 合兴包装 | 320,400 | 941,976.00 | 0.12 |
| 330 | 002210 | 飞马国际 | 444,200 | 941,704.00 | 0.12 |
| 331 | 002787 | 华源控股 | 29,200  | 940,240.00 | 0.12 |
| 332 | 002923 | 润都股份 | 99,300  | 939,378.00 | 0.12 |
| 333 | 001212 | 中旗新材 | 19,785  | 937,413.30 | 0.12 |
| 334 | 300471 | 厚普股份 | 108,600 | 935,046.00 | 0.12 |
| 335 | 300752 | 隆利科技 | 69,400  | 934,818.00 | 0.12 |
| 336 | 002589 | 瑞康医药 | 379,700 | 934,062.00 | 0.12 |
| 337 | 001316 | 润贝航科 | 28,300  | 933,334.00 | 0.12 |
| 338 | 003040 | 楚天龙  | 87,600  | 930,312.00 | 0.12 |
| 339 | 301292 | 海科新源 | 11,600  | 924,868.00 | 0.12 |
| 340 | 002551 | 尚荣医疗 | 345,000 | 921,150.00 | 0.12 |
| 341 | 002578 | 闽发铝业 | 292,000 | 919,800.00 | 0.12 |
| 342 | 002885 | 京泉华  | 22,300  | 911,178.00 | 0.11 |
| 343 | 688787 | 海天瑞声 | 6,753   | 907,940.85 | 0.11 |
| 344 | 002350 | 北京科锐 | 67,100  | 906,521.00 | 0.11 |
| 345 | 300917 | 特发服务 | 37,100  | 904,498.00 | 0.11 |
| 346 | 002552 | 宝鼎科技 | 14,800  | 902,800.00 | 0.11 |
| 347 | 002769 | 普路通  | 138,200 | 902,446.00 | 0.11 |
| 348 | 301099 | 雅创电子 | 9,400   | 897,700.00 | 0.11 |
| 349 | 001208 | 华菱线缆 | 63,144  | 896,013.36 | 0.11 |
| 350 | 688758 | 赛分科技 | 40,693  | 895,652.93 | 0.11 |
| 351 | 002395 | 双象股份 | 74,800  | 894,608.00 | 0.11 |
| 352 | 301169 | 零点有数 | 12,600  | 890,316.00 | 0.11 |
| 353 | 301186 | 超达装备 | 21,700  | 889,700.00 | 0.11 |
| 354 | 300673 | 佩蒂股份 | 66,100  | 889,045.00 | 0.11 |
| 355 | 002866 | 传艺科技 | 54,300  | 887,805.00 | 0.11 |
| 356 | 001288 | 运机集团 | 37,300  | 887,367.00 | 0.11 |

|     |        |      |         |            |      |
|-----|--------|------|---------|------------|------|
| 357 | 300867 | 圣元环保 | 48,900  | 886,068.00 | 0.11 |
| 358 | 002783 | 凯龙股份 | 124,400 | 884,484.00 | 0.11 |
| 359 | 300335 | 迪森股份 | 181,400 | 883,418.00 | 0.11 |
| 360 | 301349 | 信德新材 | 12,000  | 883,200.00 | 0.11 |
| 361 | 300982 | 苏文电能 | 58,400  | 882,424.00 | 0.11 |
| 362 | 002540 | 亚太科技 | 187,600 | 876,092.00 | 0.11 |
| 363 | 301080 | 百普赛斯 | 18,230  | 875,040.00 | 0.11 |
| 364 | 603960 | 克来机电 | 50,200  | 873,982.00 | 0.11 |
| 365 | 300986 | 志特新材 | 50,960  | 873,964.00 | 0.11 |
| 366 | 300836 | 佰奥智能 | 11,800  | 873,082.00 | 0.11 |
| 367 | 300445 | 康斯特  | 41,900  | 872,358.00 | 0.11 |
| 368 | 002871 | 伟隆股份 | 39,000  | 870,090.00 | 0.11 |
| 369 | 603239 | 浙江仙通 | 58,700  | 869,347.00 | 0.11 |
| 370 | 300494 | 盛天网络 | 103,100 | 869,133.00 | 0.11 |
| 371 | 600397 | 江钨装备 | 31,900  | 868,637.00 | 0.11 |
| 372 | 300720 | 海川智能 | 9,000   | 865,800.00 | 0.11 |
| 373 | 301172 | 君逸数码 | 33,360  | 865,692.00 | 0.11 |
| 374 | 002375 | 亚厦股份 | 254,500 | 860,210.00 | 0.11 |
| 375 | 000554 | 泰山石油 | 153,000 | 858,330.00 | 0.11 |
| 376 | 688108 | 赛诺医疗 | 46,239  | 856,808.67 | 0.11 |
| 377 | 300879 | 大叶股份 | 54,600  | 856,128.00 | 0.11 |
| 378 | 300189 | 神农种业 | 197,600 | 853,632.00 | 0.11 |
| 379 | 300444 | 双杰电气 | 69,500  | 848,595.00 | 0.11 |
| 380 | 688268 | 华特气体 | 3,164   | 846,370.00 | 0.11 |
| 381 | 002135 | 东南网架 | 124,100 | 842,639.00 | 0.11 |
| 382 | 002788 | 鹭燕医药 | 83,300  | 835,499.00 | 0.11 |
| 383 | 300259 | 新天科技 | 125,900 | 834,717.00 | 0.11 |
| 384 | 600429 | 三元股份 | 206,000 | 832,240.00 | 0.10 |
| 385 | 601339 | 百隆东方 | 122,300 | 827,971.00 | 0.10 |
| 386 | 000905 | 厦门港务 | 106,615 | 827,332.40 | 0.10 |
| 387 | 301322 | 绿通科技 | 15,500  | 826,925.00 | 0.10 |
| 388 | 002824 | 和胜股份 | 23,900  | 826,462.00 | 0.10 |
| 389 | 688191 | 智洋创新 | 23,137  | 825,990.90 | 0.10 |
| 390 | 300697 | 电工合金 | 54,464  | 825,129.60 | 0.10 |
| 391 | 000026 | 飞亚达  | 38,200  | 822,828.00 | 0.10 |
| 392 | 002843 | 泰嘉股份 | 38,200  | 820,154.00 | 0.10 |
| 393 | 300905 | 宝丽迪  | 16,200  | 819,720.00 | 0.10 |
| 394 | 300587 | 天铁科技 | 212,800 | 819,280.00 | 0.10 |
| 395 | 300893 | 松原安全 | 50,400  | 816,480.00 | 0.10 |
| 396 | 300299 | 富春股份 | 166,600 | 816,340.00 | 0.10 |
| 397 | 300629 | 新劲刚  | 37,943  | 814,256.78 | 0.10 |
| 398 | 300145 | 南方泵业 | 149,390 | 814,175.50 | 0.10 |
| 399 | 300306 | 远方信息 | 83,200  | 807,040.00 | 0.10 |

|     |        |      |         |            |      |
|-----|--------|------|---------|------------|------|
| 400 | 300512 | 中亚股份 | 118,100 | 805,442.00 | 0.10 |
| 401 | 002593 | 日上集团 | 201,800 | 805,182.00 | 0.10 |
| 402 | 603867 | 新化股份 | 24,000  | 803,760.00 | 0.10 |
| 403 | 000014 | 沙河股份 | 87,800  | 801,614.00 | 0.10 |
| 404 | 688480 | 赛恩斯  | 9,144   | 800,922.96 | 0.10 |
| 405 | 300952 | 恒辉安防 | 45,940  | 799,356.00 | 0.10 |
| 406 | 301307 | 美利信  | 10,600  | 798,074.00 | 0.10 |
| 407 | 000404 | 长虹华意 | 101,400 | 797,004.00 | 0.10 |
| 408 | 603977 | 国泰集团 | 48,100  | 794,131.00 | 0.10 |
| 409 | 002467 | 二六三  | 169,700 | 792,499.00 | 0.10 |
| 410 | 301190 | 善水科技 | 49,400  | 791,882.00 | 0.10 |
| 411 | 603938 | 三孚股份 | 11,000  | 788,150.00 | 0.10 |
| 412 | 002970 | 锐明技术 | 14,700  | 785,421.00 | 0.10 |
| 413 | 688710 | 益诺思  | 11,684  | 785,164.80 | 0.10 |
| 414 | 300862 | 蓝盾光电 | 37,400  | 779,416.00 | 0.10 |
| 415 | 603829 | 洛凯股份 | 47,600  | 779,212.00 | 0.10 |
| 416 | 688556 | 高测股份 | 58,381  | 775,299.68 | 0.10 |
| 417 | 002062 | 宏润建设 | 107,700 | 771,132.00 | 0.10 |
| 418 | 300195 | 长荣股份 | 130,500 | 766,035.00 | 0.10 |
| 419 | 301391 | 卡莱特  | 13,400  | 765,140.00 | 0.10 |
| 420 | 301181 | 标榜股份 | 32,970  | 762,925.80 | 0.10 |
| 421 | 300816 | 艾可蓝  | 10,400  | 761,280.00 | 0.10 |
| 422 | 000850 | 华茂股份 | 215,500 | 756,405.00 | 0.10 |
| 423 | 002875 | 安奈儿  | 50,900  | 756,374.00 | 0.10 |
| 424 | 001222 | 源飞宠物 | 56,900  | 755,632.00 | 0.10 |
| 425 | 301398 | 星源卓镁 | 21,500  | 754,865.00 | 0.10 |
| 426 | 603686 | 福龙马  | 58,400  | 754,528.00 | 0.10 |
| 427 | 002671 | 龙泉股份 | 203,000 | 753,130.00 | 0.09 |
| 428 | 300249 | 依米康  | 48,600  | 748,440.00 | 0.09 |
| 429 | 002300 | 太阳电缆 | 109,900 | 742,924.00 | 0.09 |
| 430 | 301229 | 纽泰格  | 61,188  | 741,598.56 | 0.09 |
| 431 | 301052 | 果麦文化 | 33,300  | 739,926.00 | 0.09 |
| 432 | 688239 | 航宇科技 | 12,335  | 738,003.05 | 0.09 |
| 433 | 300997 | 欢乐家  | 54,400  | 737,120.00 | 0.09 |
| 434 | 603989 | 艾华集团 | 14,000  | 735,000.00 | 0.09 |
| 435 | 002546 | 新联电子 | 100,900 | 734,552.00 | 0.09 |
| 436 | 002862 | 实丰文化 | 57,200  | 733,876.00 | 0.09 |
| 437 | 603823 | 百合花  | 13,400  | 731,238.00 | 0.09 |
| 438 | 300963 | 中洲特材 | 54,400  | 730,592.00 | 0.09 |
| 439 | 300286 | 安科瑞  | 30,200  | 729,330.00 | 0.09 |
| 440 | 688535 | 华海诚科 | 3,889   | 727,243.00 | 0.09 |
| 441 | 000601 | 韶能股份 | 124,000 | 725,400.00 | 0.09 |
| 442 | 600590 | 泰豪科技 | 71,300  | 720,130.00 | 0.09 |

|     |        |      |         |            |      |
|-----|--------|------|---------|------------|------|
| 443 | 688598 | 金博股份 | 14,527  | 718,360.15 | 0.09 |
| 444 | 002108 | 沧州明珠 | 173,000 | 716,220.00 | 0.09 |
| 445 | 000036 | 华联控股 | 163,600 | 714,932.00 | 0.09 |
| 446 | 688428 | 诺诚健华 | 25,108  | 714,824.76 | 0.09 |
| 447 | 000533 | 顺钠股份 | 75,000  | 713,250.00 | 0.09 |
| 448 | 300539 | 横河精密 | 35,000  | 712,950.00 | 0.09 |
| 449 | 002067 | 景兴纸业 | 192,743 | 709,294.24 | 0.09 |
| 450 | 300705 | 九典制药 | 72,500  | 709,050.00 | 0.09 |
| 451 | 301368 | 丰立智能 | 17,000  | 707,710.00 | 0.09 |
| 452 | 300043 | 星辉娱乐 | 162,300 | 706,005.00 | 0.09 |
| 453 | 003020 | 立方制药 | 47,660  | 705,844.60 | 0.09 |
| 454 | 300703 | 创源股份 | 55,100  | 703,627.00 | 0.09 |
| 455 | 003029 | 吉大正元 | 43,800  | 701,676.00 | 0.09 |
| 456 | 601218 | 吉鑫科技 | 162,400 | 698,320.00 | 0.09 |
| 457 | 300440 | 运达科技 | 32,700  | 697,491.00 | 0.09 |
| 458 | 002441 | 众业达  | 89,400  | 697,320.00 | 0.09 |
| 459 | 603507 | 振江股份 | 21,200  | 697,268.00 | 0.09 |
| 460 | 300695 | 兆丰股份 | 14,000  | 697,060.00 | 0.09 |
| 461 | 300480 | 光力科技 | 16,300  | 695,684.00 | 0.09 |
| 462 | 300619 | 金银河  | 22,343  | 695,090.73 | 0.09 |
| 463 | 002418 | 康盛股份 | 176,400 | 695,016.00 | 0.09 |
| 464 | 603078 | 江化微  | 14,000  | 691,880.00 | 0.09 |
| 465 | 605299 | 舒华体育 | 51,600  | 688,860.00 | 0.09 |
| 466 | 001298 | 好上好  | 33,160  | 688,070.00 | 0.09 |
| 467 | 300940 | 南极光  | 45,600  | 687,648.00 | 0.09 |
| 468 | 603216 | 梦天家居 | 33,400  | 687,038.00 | 0.09 |
| 469 | 000819 | 岳阳兴长 | 60,600  | 686,598.00 | 0.09 |
| 470 | 300434 | 金石亚药 | 60,700  | 681,661.00 | 0.09 |
| 471 | 300143 | 盈康生命 | 100,788 | 679,311.12 | 0.09 |
| 472 | 601226 | 华电科工 | 106,100 | 674,796.00 | 0.08 |
| 473 | 002394 | 联发股份 | 75,500  | 673,460.00 | 0.08 |
| 474 | 301559 | 中集环科 | 55,100  | 671,669.00 | 0.08 |
| 475 | 300547 | 川环科技 | 20,100  | 671,139.00 | 0.08 |
| 476 | 002219 | 新里程  | 387,500 | 670,375.00 | 0.08 |
| 477 | 688258 | 卓易信息 | 5,580   | 661,453.20 | 0.08 |
| 478 | 002255 | 海陆重工 | 67,200  | 659,904.00 | 0.08 |
| 479 | 002927 | 泰永长征 | 33,900  | 659,355.00 | 0.08 |
| 480 | 301628 | 强达电路 | 6,200   | 653,790.00 | 0.08 |
| 481 | 688312 | 燕麦科技 | 7,692   | 646,051.08 | 0.08 |
| 482 | 000096 | 广聚能源 | 92,100  | 641,937.00 | 0.08 |
| 483 | 300063 | 天龙集团 | 73,500  | 637,980.00 | 0.08 |
| 484 | 002666 | 德联集团 | 161,400 | 637,530.00 | 0.08 |
| 485 | 002730 | 电光科技 | 21,300  | 637,083.00 | 0.08 |

|     |        |      |         |            |      |
|-----|--------|------|---------|------------|------|
| 486 | 002103 | 广博股份 | 108,400 | 636,308.00 | 0.08 |
| 487 | 300709 | 精研科技 | 11,200  | 630,000.00 | 0.08 |
| 488 | 300388 | 节能国祯 | 102,100 | 629,957.00 | 0.08 |
| 489 | 002187 | 广百股份 | 134,300 | 628,524.00 | 0.08 |
| 490 | 301479 | 弘景光电 | 10,440  | 628,488.00 | 0.08 |
| 491 | 301176 | 逸豪新材 | 9,200   | 625,600.00 | 0.08 |
| 492 | 688286 | 敏芯股份 | 5,435   | 625,405.45 | 0.08 |
| 493 | 688335 | 复洁科技 | 25,927  | 623,285.08 | 0.08 |
| 494 | 300553 | 集智股份 | 10,140  | 622,494.60 | 0.08 |
| 495 | 002774 | 快意电梯 | 43,800  | 622,398.00 | 0.08 |
| 496 | 688757 | 胜科纳米 | 9,329   | 622,244.30 | 0.08 |
| 497 | 003019 | 宸展光电 | 19,100  | 621,705.00 | 0.08 |
| 498 | 300358 | 楚天科技 | 77,700  | 621,600.00 | 0.08 |
| 499 | 002331 | 皖通科技 | 84,000  | 620,760.00 | 0.08 |
| 500 | 002406 | 远东传动 | 94,600  | 620,576.00 | 0.08 |
| 501 | 300407 | 凯发电气 | 57,400  | 619,920.00 | 0.08 |
| 502 | 300984 | 金沃股份 | 11,520  | 618,969.60 | 0.08 |
| 503 | 300818 | 耐普矿机 | 32,648  | 617,047.20 | 0.08 |
| 504 | 688667 | 菱电电控 | 4,600   | 614,790.00 | 0.08 |
| 505 | 002445 | 中南文化 | 215,600 | 612,304.00 | 0.08 |
| 506 | 605100 | 华丰股份 | 15,100  | 610,342.00 | 0.08 |
| 507 | 603012 | 创力集团 | 74,300  | 609,260.00 | 0.08 |
| 508 | 002522 | 浙江众成 | 76,400  | 608,908.00 | 0.08 |
| 509 | 300465 | 高伟达  | 55,700  | 608,801.00 | 0.08 |
| 510 | 301179 | 泽宇智能 | 29,700  | 607,662.00 | 0.08 |
| 511 | 301362 | 民爆光电 | 3,300   | 606,936.00 | 0.08 |
| 512 | 301373 | 凌玮科技 | 3,900   | 606,450.00 | 0.08 |
| 513 | 300945 | 曼卡龙  | 55,500  | 601,065.00 | 0.08 |
| 514 | 688601 | 力芯微  | 9,921   | 600,716.55 | 0.08 |
| 515 | 002446 | 盛路通信 | 55,790  | 599,184.60 | 0.08 |
| 516 | 300174 | 元力股份 | 20,400  | 596,088.00 | 0.08 |
| 517 | 300918 | 南山智尚 | 55,600  | 596,032.00 | 0.08 |
| 518 | 301168 | 通灵股份 | 13,200  | 592,812.00 | 0.07 |
| 519 | 300798 | 锦鸡股份 | 90,600  | 591,618.00 | 0.07 |
| 520 | 301079 | 邵阳液压 | 17,500  | 588,700.00 | 0.07 |
| 521 | 001283 | 豪鹏科技 | 12,000  | 588,240.00 | 0.07 |
| 522 | 301122 | 采纳股份 | 20,000  | 588,200.00 | 0.07 |
| 523 | 300569 | 天能重工 | 121,500 | 585,630.00 | 0.07 |
| 524 | 300435 | 中泰股份 | 21,600  | 584,712.00 | 0.07 |
| 525 | 600973 | 宝胜股份 | 82,400  | 584,216.00 | 0.07 |
| 526 | 301226 | 祥明智能 | 17,600  | 584,144.00 | 0.07 |
| 527 | 301388 | 欣灵电气 | 24,300  | 566,676.00 | 0.07 |
| 528 | 002427 | 尤夫股份 | 112,400 | 566,496.00 | 0.07 |

|     |        |       |         |            |      |
|-----|--------|-------|---------|------------|------|
| 529 | 002695 | 煌上煌   | 55,800  | 566,370.00 | 0.07 |
| 530 | 003036 | 泰坦股份  | 6,100   | 564,189.00 | 0.07 |
| 531 | 002733 | 雄韬股份  | 18,200  | 563,836.00 | 0.07 |
| 532 | 301629 | 矽电股份  | 1,300   | 559,520.00 | 0.07 |
| 533 | 002628 | 成都路桥  | 104,500 | 559,075.00 | 0.07 |
| 534 | 301159 | 三维天地  | 19,200  | 558,720.00 | 0.07 |
| 535 | 600230 | 沧州大化  | 42,900  | 558,558.00 | 0.07 |
| 536 | 603286 | 日盈电子  | 12,200  | 556,686.00 | 0.07 |
| 537 | 301129 | 瑞纳智能  | 26,400  | 550,968.00 | 0.07 |
| 538 | 002148 | 北纬科技  | 93,900  | 545,559.00 | 0.07 |
| 539 | 688225 | 亚信安全  | 43,884  | 545,039.28 | 0.07 |
| 540 | 300447 | 全信股份  | 36,400  | 543,452.00 | 0.07 |
| 541 | 603110 | 东方材料  | 23,400  | 542,178.00 | 0.07 |
| 542 | 000570 | 苏常柴 A | 115,500 | 539,385.00 | 0.07 |
| 543 | 605287 | 德才股份  | 13,000  | 539,370.00 | 0.07 |
| 544 | 000531 | 穗恒运 A | 89,900  | 538,501.00 | 0.07 |
| 545 | 301083 | 百胜智能  | 40,800  | 537,336.00 | 0.07 |
| 546 | 002990 | 盛视科技  | 6,800   | 537,200.00 | 0.07 |
| 547 | 300882 | 万胜智能  | 32,300  | 535,534.00 | 0.07 |
| 548 | 300135 | 宝利国际  | 175,500 | 535,275.00 | 0.07 |
| 549 | 603121 | 华培动力  | 45,500  | 534,625.00 | 0.07 |
| 550 | 002162 | 悦心健康  | 157,820 | 533,431.60 | 0.07 |
| 551 | 300421 | 力星股份  | 28,800  | 533,088.00 | 0.07 |
| 552 | 002548 | 金新农   | 144,400 | 532,836.00 | 0.07 |
| 553 | 002919 | 名臣健康  | 28,000  | 531,720.00 | 0.07 |
| 554 | 600693 | 东百集团  | 67,800  | 531,552.00 | 0.07 |
| 555 | 688711 | 宏微科技  | 11,687  | 531,174.15 | 0.07 |
| 556 | 301256 | 华融化学  | 40,900  | 530,064.00 | 0.07 |
| 557 | 002930 | 宏川智慧  | 57,600  | 529,920.00 | 0.07 |
| 558 | 301357 | 北方长龙  | 6,700   | 529,903.00 | 0.07 |
| 559 | 300543 | 朗科智能  | 73,100  | 527,051.00 | 0.07 |
| 560 | 002115 | 三维通信  | 51,100  | 526,330.00 | 0.07 |
| 561 | 002094 | 青岛金王  | 119,400 | 522,972.00 | 0.07 |
| 562 | 002242 | 九阳股份  | 66,400  | 521,904.00 | 0.07 |
| 563 | 003001 | 中岩大地  | 40,100  | 519,295.00 | 0.07 |
| 564 | 301560 | 众捷汽车  | 19,400  | 518,562.00 | 0.07 |
| 565 | 301066 | 万事利   | 44,600  | 517,806.00 | 0.07 |
| 566 | 300508 | 维宏股份  | 9,000   | 516,870.00 | 0.07 |
| 567 | 603897 | 长城科技  | 15,900  | 516,114.00 | 0.07 |
| 568 | 605222 | 起帆电缆  | 22,100  | 515,372.00 | 0.06 |
| 569 | 002833 | 弘亚数控  | 26,700  | 515,043.00 | 0.06 |
| 570 | 688196 | 卓越新能  | 14,309  | 513,693.10 | 0.06 |
| 571 | 002357 | 富临运业  | 57,300  | 509,970.00 | 0.06 |

|     |        |       |         |            |      |
|-----|--------|-------|---------|------------|------|
| 572 | 688719 | 爱科赛博  | 6,581   | 506,737.00 | 0.06 |
| 573 | 003041 | 真爱美家  | 11,600  | 506,340.00 | 0.06 |
| 574 | 300658 | 延江股份  | 44,000  | 502,920.00 | 0.06 |
| 575 | 001379 | 腾达科技  | 31,800  | 499,260.00 | 0.06 |
| 576 | 301608 | 博实结   | 9,927   | 498,931.02 | 0.06 |
| 577 | 688319 | 欧林生物  | 11,311  | 497,457.78 | 0.06 |
| 578 | 002931 | 锋龙股份  | 7,200   | 496,656.00 | 0.06 |
| 579 | 688136 | 科兴制药  | 23,757  | 492,007.47 | 0.06 |
| 580 | 002703 | 浙江世宝  | 34,400  | 489,512.00 | 0.06 |
| 581 | 002235 | 安妮股份  | 63,000  | 488,250.00 | 0.06 |
| 582 | 000701 | 厦门信达  | 109,700 | 485,971.00 | 0.06 |
| 583 | 300817 | 双飞集团  | 31,100  | 485,160.00 | 0.06 |
| 584 | 301110 | 青木科技  | 12,780  | 483,850.80 | 0.06 |
| 585 | 688499 | 利元亨   | 9,173   | 482,041.15 | 0.06 |
| 586 | 300516 | 久之洋   | 14,700  | 481,572.00 | 0.06 |
| 587 | 002728 | 特一药业  | 52,600  | 481,290.00 | 0.06 |
| 588 | 600903 | 贵州燃气  | 72,400  | 480,736.00 | 0.06 |
| 589 | 002782 | 可立克   | 22,800  | 479,940.00 | 0.06 |
| 590 | 688325 | 赛微微电  | 3,665   | 477,952.65 | 0.06 |
| 591 | 300792 | 壹网壹创  | 18,300  | 474,702.00 | 0.06 |
| 592 | 300575 | 中旗股份  | 96,400  | 474,288.00 | 0.06 |
| 593 | 002483 | 润邦股份  | 95,200  | 470,288.00 | 0.06 |
| 594 | 301319 | 唯特偶   | 2,800   | 468,524.00 | 0.06 |
| 595 | 301517 | 陕西华达  | 9,400   | 466,522.00 | 0.06 |
| 596 | 002553 | 南方精工  | 29,000  | 463,710.00 | 0.06 |
| 597 | 000017 | 深中华 A | 75,600  | 462,672.00 | 0.06 |
| 598 | 001217 | 华尔泰   | 54,800  | 461,964.00 | 0.06 |
| 599 | 688398 | 赛特新材  | 17,756  | 460,057.96 | 0.06 |
| 600 | 600284 | 浦东建设  | 94,500  | 459,270.00 | 0.06 |
| 601 | 600855 | 航天长峰  | 33,000  | 459,030.00 | 0.06 |
| 602 | 300586 | 美联新材  | 29,300  | 458,252.00 | 0.06 |
| 603 | 300350 | 华鹏飞   | 115,300 | 457,741.00 | 0.06 |
| 604 | 605060 | 联德股份  | 8,000   | 453,920.00 | 0.06 |
| 605 | 301117 | 佳缘科技  | 19,276  | 450,094.60 | 0.06 |
| 606 | 002724 | 海洋王   | 91,600  | 444,260.00 | 0.06 |
| 607 | 002632 | 道明光学  | 49,200  | 443,292.00 | 0.06 |
| 608 | 600477 | 杭萧钢构  | 191,800 | 443,058.00 | 0.06 |
| 609 | 001266 | 宏英智能  | 9,000   | 441,900.00 | 0.06 |
| 610 | 300785 | 值得买   | 12,000  | 440,040.00 | 0.06 |
| 611 | 301315 | 威士顿   | 11,500  | 439,070.00 | 0.06 |
| 612 | 301082 | 久盛电气  | 48,870  | 437,875.20 | 0.06 |
| 613 | 003043 | 华亚智能  | 4,400   | 437,316.00 | 0.06 |
| 614 | 603817 | 海峡环保  | 85,300  | 435,883.00 | 0.05 |

|     |        |       |         |            |      |
|-----|--------|-------|---------|------------|------|
| 615 | 601133 | 柏诚股份  | 9,700   | 427,188.00 | 0.05 |
| 616 | 688210 | 统联精密  | 10,478  | 424,463.78 | 0.05 |
| 617 | 301258 | 富士莱   | 18,600  | 423,522.00 | 0.05 |
| 618 | 688226 | 威腾电气  | 9,884   | 423,331.72 | 0.05 |
| 619 | 300590 | 移为通信  | 29,400  | 421,890.00 | 0.05 |
| 620 | 000803 | 山高环能  | 62,140  | 421,309.20 | 0.05 |
| 621 | 688231 | 隆达股份  | 11,466  | 421,146.18 | 0.05 |
| 622 | 002150 | 正泰电源  | 16,600  | 419,814.00 | 0.05 |
| 623 | 600513 | 联环药业  | 28,800  | 418,752.00 | 0.05 |
| 624 | 002811 | 郑中设计  | 37,300  | 417,387.00 | 0.05 |
| 625 | 002189 | 中光学   | 18,600  | 415,896.00 | 0.05 |
| 626 | 603095 | 越剑智能  | 29,000  | 415,280.00 | 0.05 |
| 627 | 002707 | 众信旅游  | 85,200  | 408,960.00 | 0.05 |
| 628 | 000565 | 渝三峡 A | 71,900  | 408,392.00 | 0.05 |
| 629 | 605136 | 丽人丽妆  | 57,000  | 406,410.00 | 0.05 |
| 630 | 688636 | 智明达   | 11,165  | 404,507.95 | 0.05 |
| 631 | 300617 | 安靠智电  | 7,600   | 402,724.00 | 0.05 |
| 632 | 603980 | 吉华集团  | 60,200  | 399,728.00 | 0.05 |
| 633 | 300217 | 东方电热  | 92,300  | 394,121.00 | 0.05 |
| 634 | 300067 | 安诺其   | 72,100  | 390,782.00 | 0.05 |
| 635 | 300473 | 德尔股份  | 12,700  | 386,080.00 | 0.05 |
| 636 | 000798 | 中水渔业  | 54,500  | 384,770.00 | 0.05 |
| 637 | 300401 | 花园生物  | 17,500  | 383,075.00 | 0.05 |
| 638 | 603367 | 辰欣药业  | 29,700  | 381,051.00 | 0.05 |
| 639 | 600510 | 黑牡丹   | 51,000  | 380,460.00 | 0.05 |
| 640 | 600828 | 茂业商业  | 106,000 | 379,480.00 | 0.05 |
| 641 | 003005 | 竞业达   | 28,600  | 378,664.00 | 0.05 |
| 642 | 000407 | 胜利股份  | 102,082 | 377,703.40 | 0.05 |
| 643 | 002940 | 昂利康   | 14,300  | 377,663.00 | 0.05 |
| 644 | 300523 | 辰安科技  | 20,500  | 376,790.00 | 0.05 |
| 645 | 600865 | 百大集团  | 45,900  | 375,921.00 | 0.05 |
| 646 | 301012 | 扬电科技  | 15,900  | 373,491.00 | 0.05 |
| 647 | 002777 | 久远银海  | 31,000  | 372,930.00 | 0.05 |
| 648 | 301365 | 矩阵股份  | 9,700   | 367,727.00 | 0.05 |
| 649 | 300004 | 南风股份  | 36,100  | 364,610.00 | 0.05 |
| 650 | 300215 | 电科院   | 55,200  | 363,768.00 | 0.05 |
| 651 | 300380 | 安硕信息  | 11,800  | 363,086.00 | 0.05 |
| 652 | 300711 | 广哈通信  | 22,000  | 360,800.00 | 0.05 |
| 653 | 002066 | 瑞泰科技  | 17,300  | 360,359.00 | 0.05 |
| 654 | 688010 | 福光股份  | 7,409   | 360,299.67 | 0.05 |
| 655 | 301016 | 雷尔伟   | 25,600  | 357,632.00 | 0.05 |
| 656 | 003016 | 欣贺股份  | 57,900  | 354,927.00 | 0.04 |
| 657 | 300722 | 新余国科  | 15,900  | 354,570.00 | 0.04 |

|     |        |      |        |            |      |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 658 | 688679 | 通源环境 | 8,424  | 354,566.16 | 0.04 |
| 659 | 002322 | 理工能科 | 36,500 | 354,050.00 | 0.04 |
| 660 | 301137 | 哈焊华通 | 10,300 | 353,908.00 | 0.04 |
| 661 | 002606 | 大连电瓷 | 26,200 | 351,342.00 | 0.04 |
| 662 | 300490 | 华自科技 | 26,500 | 350,595.00 | 0.04 |
| 663 | 002662 | 峰璟股份 | 94,600 | 350,020.00 | 0.04 |
| 664 | 300062 | 中能电气 | 62,200 | 348,942.00 | 0.04 |
| 665 | 688376 | 美埃科技 | 3,000  | 348,900.00 | 0.04 |
| 666 | 300213 | 佳讯飞鸿 | 57,400 | 347,844.00 | 0.04 |
| 667 | 002599 | 盛通股份 | 68,200 | 347,820.00 | 0.04 |
| 668 | 688109 | 品茗科技 | 4,563  | 345,419.10 | 0.04 |
| 669 | 000957 | 中通客车 | 36,500 | 341,640.00 | 0.04 |
| 670 | 600846 | 同济科技 | 33,800 | 338,000.00 | 0.04 |
| 671 | 301008 | 宏昌科技 | 13,000 | 332,800.00 | 0.04 |
| 672 | 002443 | 金洲管道 | 34,800 | 331,644.00 | 0.04 |
| 673 | 300550 | 和仁科技 | 24,700 | 329,251.00 | 0.04 |
| 674 | 300994 | 久祺股份 | 30,700 | 327,569.00 | 0.04 |
| 675 | 688246 | 嘉和美康 | 15,931 | 327,382.05 | 0.04 |
| 676 | 603020 | 爱普股份 | 23,200 | 327,120.00 | 0.04 |
| 677 | 688699 | 明微电子 | 3,939  | 322,801.05 | 0.04 |
| 678 | 301152 | 天力锂能 | 13,400 | 317,178.00 | 0.04 |
| 679 | 603002 | 宏昌电子 | 13,100 | 316,627.00 | 0.04 |
| 680 | 002664 | 信质集团 | 18,200 | 314,678.00 | 0.04 |
| 681 | 301595 | 太力科技 | 7,900  | 312,840.00 | 0.04 |
| 682 | 300895 | 铜牛信息 | 6,000  | 312,240.00 | 0.04 |
| 683 | 301538 | 骏鼎达  | 6,180  | 311,286.60 | 0.04 |
| 684 | 300787 | 海能实业 | 34,000 | 310,080.00 | 0.04 |
| 685 | 300947 | 德必集团 | 24,300 | 309,825.00 | 0.04 |
| 686 | 688410 | 山外山  | 21,501 | 308,754.36 | 0.04 |
| 687 | 603016 | 新宏泰  | 9,100  | 307,216.00 | 0.04 |
| 688 | 301191 | 菲菱科思 | 2,700  | 306,585.00 | 0.04 |
| 689 | 603312 | 西典新能 | 9,000  | 305,820.00 | 0.04 |
| 690 | 002451 | 摩恩电气 | 43,049 | 303,064.96 | 0.04 |
| 691 | 000862 | 银星能源 | 62,500 | 301,250.00 | 0.04 |
| 692 | 603701 | 德宏股份 | 13,500 | 296,730.00 | 0.04 |
| 693 | 603815 | 交建股份 | 56,400 | 293,280.00 | 0.04 |
| 694 | 002900 | 哈三联  | 31,600 | 290,088.00 | 0.04 |
| 695 | 688611 | 杭州柯林 | 4,053  | 289,586.85 | 0.04 |
| 696 | 002953 | 日丰股份 | 32,900 | 286,888.00 | 0.04 |
| 697 | 000520 | 凤凰航运 | 76,100 | 283,853.00 | 0.04 |
| 698 | 300781 | 因赛集团 | 10,600 | 279,416.00 | 0.04 |
| 699 | 605277 | 新亚电子 | 14,600 | 278,276.00 | 0.04 |
| 700 | 301259 | 艾布鲁  | 10,600 | 278,250.00 | 0.04 |

|     |        |      |        |            |      |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 701 | 002054 | 德美化工 | 41,500 | 275,975.00 | 0.03 |
| 702 | 603757 | 大元泵业 | 3,600  | 272,736.00 | 0.03 |
| 703 | 301408 | 华人健康 | 18,890 | 271,638.20 | 0.03 |
| 704 | 688682 | 霍莱沃  | 6,974  | 271,288.60 | 0.03 |
| 705 | 002686 | 亿利达  | 52,100 | 268,315.00 | 0.03 |
| 706 | 603668 | 天马科技 | 21,060 | 266,619.60 | 0.03 |
| 707 | 688419 | 耐科装备 | 3,377  | 265,601.05 | 0.03 |
| 708 | 002765 | 蓝黛科技 | 38,100 | 265,176.00 | 0.03 |
| 709 | 301548 | 崇德科技 | 2,965  | 263,203.05 | 0.03 |
| 710 | 301333 | 诺思格  | 5,100  | 255,459.00 | 0.03 |
| 711 | 688212 | 澳华内镜 | 8,667  | 254,809.80 | 0.03 |
| 712 | 301387 | 光大同创 | 2,700  | 249,534.00 | 0.03 |
| 713 | 688553 | 汇宇制药 | 23,464 | 249,422.32 | 0.03 |
| 714 | 688339 | 亿华通  | 13,195 | 246,746.50 | 0.03 |
| 715 | 603050 | 科林电气 | 12,600 | 246,456.00 | 0.03 |
| 716 | 605056 | 咸亨国际 | 15,300 | 244,800.00 | 0.03 |
| 717 | 003018 | 金富科技 | 3,200  | 243,936.00 | 0.03 |
| 718 | 603878 | 武进不锈 | 46,800 | 240,552.00 | 0.03 |
| 719 | 301211 | 亨迪药业 | 21,200 | 239,984.00 | 0.03 |
| 720 | 002035 | 华帝股份 | 53,000 | 239,560.00 | 0.03 |
| 721 | 605298 | 必得科技 | 4,600  | 238,970.00 | 0.03 |
| 722 | 300819 | 聚杰微纤 | 3,200  | 236,864.00 | 0.03 |
| 723 | 301636 | 泽润新能 | 5,600  | 235,816.00 | 0.03 |
| 724 | 603336 | 宏辉果蔬 | 29,600 | 234,432.00 | 0.03 |
| 725 | 002879 | 长缆科技 | 17,700 | 232,401.00 | 0.03 |
| 726 | 603122 | 合富中国 | 21,100 | 231,256.00 | 0.03 |
| 727 | 603058 | 永吉股份 | 25,700 | 223,847.00 | 0.03 |
| 728 | 301076 | 新瀚新材 | 8,550  | 223,839.00 | 0.03 |
| 729 | 688228 | 开普云  | 2,878  | 222,584.52 | 0.03 |
| 730 | 600103 | 青山纸业 | 70,400 | 216,128.00 | 0.03 |
| 731 | 600724 | 宁波富达 | 42,500 | 215,475.00 | 0.03 |
| 732 | 300488 | 恒锋工具 | 4,600  | 215,418.00 | 0.03 |
| 733 | 300788 | 中信出版 | 9,400  | 211,218.00 | 0.03 |
| 734 | 600851 | 海欣股份 | 23,400 | 210,834.00 | 0.03 |
| 735 | 002140 | 东华科技 | 22,800 | 209,076.00 | 0.03 |
| 736 | 300937 | 药易购  | 10,800 | 208,332.00 | 0.03 |
| 737 | 301501 | 恒鑫生活 | 7,900  | 205,558.00 | 0.03 |
| 738 | 300964 | 本川智能 | 2,380  | 205,084.60 | 0.03 |
| 739 | 001258 | 立新能源 | 29,600 | 204,832.00 | 0.03 |
| 740 | 688648 | 中邮科技 | 5,553  | 202,962.15 | 0.03 |
| 741 | 601330 | 绿色动力 | 29,000 | 202,130.00 | 0.03 |
| 742 | 301025 | 读客文化 | 26,000 | 201,760.00 | 0.03 |
| 743 | 603988 | 中电电机 | 12,400 | 201,128.00 | 0.03 |

|     |        |      |        |            |      |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 744 | 301468 | 博盈特焊 | 4,800  | 200,208.00 | 0.03 |
| 745 | 601579 | 会稽山  | 13,600 | 199,784.00 | 0.03 |
| 746 | 002278 | 神开股份 | 26,400 | 199,056.00 | 0.03 |
| 747 | 688345 | 博力威  | 3,387  | 196,716.96 | 0.02 |
| 748 | 603229 | 奥翔药业 | 25,100 | 194,274.00 | 0.02 |
| 749 | 605365 | 立达信  | 13,500 | 194,130.00 | 0.02 |
| 750 | 300960 | 通业科技 | 12,400 | 192,820.00 | 0.02 |
| 751 | 002971 | 和远气体 | 3,100  | 192,200.00 | 0.02 |
| 752 | 300892 | 品渥食品 | 10,200 | 191,556.00 | 0.02 |
| 753 | 002454 | 松芝股份 | 40,000 | 191,200.00 | 0.02 |
| 754 | 600501 | 航天晨光 | 12,100 | 190,333.00 | 0.02 |
| 755 | 300871 | 回盛生物 | 8,600  | 189,716.00 | 0.02 |
| 756 | 600982 | 宁波能源 | 39,700 | 188,972.00 | 0.02 |
| 757 | 300355 | 蒙草生态 | 68,600 | 188,650.00 | 0.02 |
| 758 | 301202 | 朗威股份 | 5,600  | 186,648.00 | 0.02 |
| 759 | 603151 | 邦基科技 | 16,600 | 182,434.00 | 0.02 |
| 760 | 300978 | 东箭科技 | 22,400 | 181,664.00 | 0.02 |
| 761 | 603135 | 中重科技 | 14,800 | 179,080.00 | 0.02 |
| 762 | 601116 | 三江购物 | 18,000 | 177,660.00 | 0.02 |
| 763 | 001332 | 锡装股份 | 4,517  | 177,382.59 | 0.02 |
| 764 | 301046 | 能辉科技 | 6,900  | 177,054.00 | 0.02 |
| 765 | 301281 | 科源制药 | 3,500  | 172,550.00 | 0.02 |
| 766 | 301299 | 卓创资讯 | 3,900  | 171,834.00 | 0.02 |
| 767 | 600684 | 珠江股份 | 57,000 | 171,570.00 | 0.02 |
| 768 | 603105 | 芯能科技 | 25,100 | 170,931.00 | 0.02 |
| 769 | 003002 | 壶化股份 | 9,700  | 168,683.00 | 0.02 |
| 770 | 603090 | 宏盛股份 | 3,300  | 168,498.00 | 0.02 |
| 771 | 603101 | 汇嘉时代 | 26,600 | 165,984.00 | 0.02 |
| 772 | 600722 | 金牛化工 | 20,400 | 165,648.00 | 0.02 |
| 773 | 002386 | 天原股份 | 26,700 | 165,540.00 | 0.02 |
| 774 | 603776 | 永安行  | 7,900  | 164,873.00 | 0.02 |
| 775 | 300774 | 倍杰特  | 15,300 | 164,475.00 | 0.02 |
| 776 | 002392 | 北京利尔 | 20,100 | 162,207.00 | 0.02 |
| 777 | 002826 | 易明医药 | 10,600 | 159,318.00 | 0.02 |
| 778 | 300920 | 润阳科技 | 4,500  | 155,475.00 | 0.02 |
| 779 | 000925 | 众合科技 | 16,500 | 154,110.00 | 0.02 |
| 780 | 002380 | 科远智慧 | 4,500  | 153,810.00 | 0.02 |
| 781 | 002363 | 隆基机械 | 25,300 | 152,306.00 | 0.02 |
| 782 | 002334 | 英威腾  | 21,100 | 149,599.00 | 0.02 |
| 783 | 603890 | 春秋电子 | 5,400  | 149,148.00 | 0.02 |
| 784 | 301533 | 威马农机 | 6,300  | 149,058.00 | 0.02 |
| 785 | 605338 | 巴比食品 | 8,300  | 148,570.00 | 0.02 |
| 786 | 603315 | 福鞍股份 | 9,900  | 148,302.00 | 0.02 |

|     |        |      |        |            |      |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 787 | 603630 | 拉芳家化 | 11,600 | 148,248.00 | 0.02 |
| 788 | 301121 | 紫建电子 | 4,600  | 147,292.00 | 0.02 |
| 789 | 300399 | 天利科技 | 7,600  | 145,008.00 | 0.02 |
| 790 | 301120 | 新特电气 | 8,700  | 144,681.00 | 0.02 |
| 791 | 603158 | 腾龙股份 | 11,700 | 143,091.00 | 0.02 |
| 792 | 002758 | 浙农股份 | 18,100 | 142,990.00 | 0.02 |
| 793 | 002846 | 英联股份 | 13,200 | 139,788.00 | 0.02 |
| 794 | 688084 | 晶品特装 | 2,684  | 134,951.52 | 0.02 |
| 795 | 688337 | 普源精电 | 1,800  | 134,874.00 | 0.02 |
| 796 | 300025 | 华星创业 | 32,100 | 134,820.00 | 0.02 |
| 797 | 300279 | 和晶科技 | 22,200 | 134,310.00 | 0.02 |
| 798 | 300639 | 凯普生物 | 26,500 | 131,705.00 | 0.02 |
| 799 | 605168 | 三人行  | 2,600  | 131,664.00 | 0.02 |
| 800 | 601121 | 宝地矿业 | 23,000 | 129,720.00 | 0.02 |
| 801 | 300150 | 世纪瑞尔 | 32,100 | 127,437.00 | 0.02 |
| 802 | 603966 | 法兰泰克 | 15,600 | 127,140.00 | 0.02 |
| 803 | 603416 | 信捷电气 | 2,400  | 126,888.00 | 0.02 |
| 804 | 300483 | 首华燃气 | 7,100  | 124,818.00 | 0.02 |
| 805 | 688603 | 天承科技 | 600    | 124,770.00 | 0.02 |
| 806 | 600433 | 冠豪高新 | 36,300 | 116,523.00 | 0.01 |
| 807 | 301310 | 鑫宏业  | 2,100  | 116,004.00 | 0.01 |
| 808 | 300534 | 陇神戎发 | 16,000 | 113,280.00 | 0.01 |
| 809 | 300032 | 金龙机电 | 29,500 | 112,100.00 | 0.01 |
| 810 | 600203 | 福日电子 | 9,200  | 111,780.00 | 0.01 |
| 811 | 601789 | 宁波建工 | 27,200 | 109,072.00 | 0.01 |
| 812 | 688365 | 光云科技 | 6,877  | 108,450.29 | 0.01 |
| 813 | 300746 | 汉嘉数智 | 10,000 | 108,100.00 | 0.01 |
| 814 | 300988 | 津荣天宇 | 6,840  | 106,909.20 | 0.01 |
| 815 | 300501 | 海顺新材 | 8,300  | 105,410.00 | 0.01 |
| 816 | 688186 | 广大特材 | 6,606  | 100,080.90 | 0.01 |
| 817 | 688179 | 阿拉丁  | 3,600  | 99,756.00  | 0.01 |
| 818 | 301456 | 盘古智能 | 4,400  | 99,352.00  | 0.01 |
| 819 | 688143 | 长盈通  | 563    | 99,020.44  | 0.01 |
| 820 | 688215 | 瑞晟智能 | 2,454  | 98,552.64  | 0.01 |
| 821 | 301282 | 金禄电子 | 3,300  | 97,317.00  | 0.01 |
| 822 | 301149 | 隆华新材 | 9,100  | 96,278.00  | 0.01 |
| 823 | 002040 | 南京港  | 12,600 | 93,870.00  | 0.01 |
| 824 | 301160 | 翔楼新材 | 2,000  | 93,300.00  | 0.01 |
| 825 | 300092 | 科新机电 | 8,000  | 92,320.00  | 0.01 |
| 826 | 000852 | 石化机械 | 18,300 | 90,768.00  | 0.01 |
| 827 | 300698 | 万马科技 | 3,200  | 87,040.00  | 0.01 |
| 828 | 300511 | 雪榕生物 | 17,200 | 86,516.00  | 0.01 |
| 829 | 000936 | 华西股份 | 16,200 | 85,860.00  | 0.01 |

|     |        |      |       |           |      |
|-----|--------|------|-------|-----------|------|
| 830 | 688621 | 阳光诺和 | 1,555 | 85,385.05 | 0.01 |
| 831 | 001300 | 三柏硕  | 7,400 | 83,620.00 | 0.01 |
| 832 | 605286 | 同力天启 | 3,200 | 81,568.00 | 0.01 |
| 833 | 603052 | 可川科技 | 1,000 | 80,990.00 | 0.01 |
| 834 | 300018 | 中元股份 | 6,200 | 76,570.00 | 0.01 |
| 835 | 301687 | 新广益  | 195   | 15,167.10 | 0.00 |
| 836 | 603352 | 至信股份 | 112   | 2,858.24  | 0.00 |

### 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  | 301666 | 大普微  | 1,220 | 565,262.60 | 0.07         |
| 2  | 688808 | 联讯仪器 | 163   | 258,245.79 | 0.03         |
| 3  | 688820 | 盛合晶微 | 1,189 | 168,231.61 | 0.02         |
| 4  | 001399 | 惠科股份 | 4,587 | 127,197.51 | 0.02         |
| 5  | 688818 | 电科蓝天 | 1,717 | 120,430.38 | 0.02         |
| 6  | 688797 | 臻宝科技 | 207   | 97,014.69  | 0.01         |
| 7  | 688785 | 恒运昌  | 116   | 53,725.40  | 0.01         |
| 8  | 688813 | 泰金新能 | 234   | 40,269.06  | 0.01         |
| 9  | 688635 | 长进光子 | 128   | 39,448.32  | 0.00         |
| 10 | 603459 | 红板科技 | 330   | 27,825.60  | 0.00         |
| 11 | 001365 | 天海电子 | 719   | 22,511.89  | 0.00         |
| 12 | 688811 | 有研复材 | 834   | 20,124.42  | 0.00         |
| 13 | 301696 | 三瑞智能 | 216   | 18,748.80  | 0.00         |
| 14 | 001237 | 惠康科技 | 285   | 16,740.90  | 0.00         |
| 15 | 301669 | 高特电子 | 546   | 15,506.40  | 0.00         |
| 16 | 001393 | 维通利  | 387   | 15,089.13  | 0.00         |
| 17 | 301531 | 春光集团 | 290   | 14,952.40  | 0.00         |
| 18 | 301599 | 理奇智能 | 433   | 14,059.51  | 0.00         |
| 19 | 301683 | 慧谷新材 | 96    | 11,689.92  | 0.00         |
| 20 | 688781 | 视涯科技 | 217   | 10,331.37  | 0.00         |
| 21 | 688816 | 易思维  | 177   | 10,106.70  | 0.00         |
| 22 | 603407 | 长裕集团 | 137   | 10,064.02  | 0.00         |
| 23 | 688712 | 北芯生命 | 234   | 8,405.28   | 0.00         |
| 24 | 603435 | 嘉德利  | 104   | 4,857.84   | 0.00         |
| 25 | 603293 | 埃泰克  | 72    | 2,442.96   | 0.00         |
| 26 | 001312 | 福恩股份 | 134   | 2,248.52   | 0.00         |
| 27 | 001220 | 世盟股份 | 57    | 1,583.46   | 0.00         |

## 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  | 688257 | 新锐股份 | 10,155,656.36 | 1.40           |
| 2  | 688195 | 腾景科技 | 10,037,320.40 | 1.38           |
| 3  | 603929 | 亚翔集成 | 9,760,360.00  | 1.35           |
| 4  | 603186 | 华正新材 | 9,178,015.75  | 1.27           |
| 5  | 601388 | 怡球资源 | 9,003,379.00  | 1.24           |
| 6  | 603629 | 利通电子 | 8,826,871.00  | 1.22           |
| 7  | 688388 | 嘉元科技 | 8,693,943.72  | 1.20           |
| 8  | 688239 | 航宇科技 | 8,203,828.80  | 1.13           |
| 9  | 688378 | 奥来德  | 7,939,788.68  | 1.09           |
| 10 | 688508 | 芯朋微  | 7,837,692.58  | 1.08           |
| 11 | 603031 | 安孚科技 | 7,720,379.90  | 1.06           |
| 12 | 002057 | 中钢天源 | 7,537,083.00  | 1.04           |
| 13 | 002039 | 黔源电力 | 7,513,414.00  | 1.04           |
| 14 | 688518 | 联赢激光 | 7,472,810.50  | 1.03           |
| 15 | 688668 | 鼎通科技 | 7,273,183.42  | 1.00           |
| 16 | 001314 | 亿道信息 | 7,064,376.07  | 0.97           |
| 17 | 688135 | 利扬芯片 | 7,042,498.28  | 0.97           |
| 18 | 688046 | 药康生物 | 7,022,645.75  | 0.97           |
| 19 | 000922 | 佳电股份 | 7,018,325.40  | 0.97           |
| 20 | 688428 | 诺诚健华 | 6,844,799.58  | 0.94           |

注：买入包括二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，买入金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计卖出金额      | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------------|----------------|
| 1  | 688195 | 腾景科技 | 12,765,471.19 | 1.76           |
| 2  | 603929 | 亚翔集成 | 12,549,137.46 | 1.73           |
| 3  | 688257 | 新锐股份 | 11,095,746.63 | 1.53           |
| 4  | 688668 | 鼎通科技 | 10,857,939.77 | 1.50           |
| 5  | 688388 | 嘉元科技 | 10,207,396.75 | 1.41           |
| 6  | 688167 | 炬光科技 | 10,132,558.55 | 1.40           |
| 7  | 603629 | 利通电子 | 9,969,523.00  | 1.37           |
| 8  | 603186 | 华正新材 | 9,324,078.00  | 1.29           |
| 9  | 688239 | 航宇科技 | 8,414,462.24  | 1.16           |
| 10 | 002039 | 黔源电力 | 7,791,851.20  | 1.07           |
| 11 | 605196 | 华通线缆 | 7,783,082.00  | 1.07           |
| 12 | 601388 | 怡球资源 | 7,340,974.00  | 1.01           |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 13 | 688627 | 精智达  | 7,275,778.02 | 1.00 |
| 14 | 688531 | 日联科技 | 7,184,875.64 | 0.99 |
| 15 | 688508 | 芯朋微  | 7,124,596.12 | 0.98 |
| 16 | 603067 | 振华股份 | 7,093,948.57 | 0.98 |
| 17 | 688719 | 爱科赛博 | 7,023,503.79 | 0.97 |
| 18 | 688428 | 诺诚健华 | 6,929,243.79 | 0.96 |
| 19 | 603301 | 振德医疗 | 6,839,884.00 | 0.94 |
| 20 | 688499 | 利元亨  | 6,822,348.74 | 0.94 |

注：卖出包括二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，卖出金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

|              |                  |
|--------------|------------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 3,569,339,726.96 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 3,419,192,178.48 |

注：买入股票成本、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

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） | 505,217.47 | 0.06         |
| 8  | 同业存单      | -          | -            |
| 9  | 其他        | -          | -            |
| 10 | 合计        | 505,217.47 | 0.06         |

### 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

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（元）    | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|---------|-------|------------|--------------|
| 1  | 123274 | 维科转债    | 4,242 | 424,209.30 | 0.05         |
| 2  | 113703 | 翔 26 转债 | 810   | 81,008.17  | 0.01         |

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

### 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

无。

### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

### 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

无。

#### 7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

### 7.12 投资组合报告附注

#### 7.12.1 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。如是，还应对相关证券的投资决策程序做出说明

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

#### 7.12.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库。如是，还应对相关股票的投资决策程序做出说明。

本基金投资的前十名股票（如有）没有超出基金合同约定的备选股票库，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

### 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（元）        |
|----|-------|--------------|
| 1  | 存出保证金 | 2,537,142.42 |
| 2  | 应收清算款 | 1,909,734.11 |
| 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    | 4,446,876.53 |

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 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

无。

#### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|----------------|--------------|----------|
| 1  | 301666 | 大普微  | 565,262.60     | 0.07         | 新股锁定期    |
| 2  | 688808 | 联讯仪器 | 258,245.79     | 0.03         | 新股锁定期    |
| 3  | 688820 | 盛合晶微 | 168,231.61     | 0.02         | 新股锁定期    |
| 4  | 001399 | 惠科股份 | 127,197.51     | 0.02         | 新股锁定期    |
| 5  | 688818 | 电科蓝天 | 120,430.38     | 0.02         | 新股锁定期    |

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数（户） | 户均持有的基金份额 | 持有人结构          |        |                |        |
|----------|-----------|----------------|--------|----------------|--------|
|          |           | 机构投资者          |        | 个人投资者          |        |
|          |           | 持有份额           | 占总份额比例 | 持有份额           | 占总份额比例 |
| 10,65    | 47,912.96 | 203,125,669.00 | 39.78  | 307,482,737.00 | 60.22  |

|   |  |  |   |  |   |
|---|--|--|---|--|---|
| 7 |  |  | % |  | % |
|---|--|--|---|--|---|

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本公司的所有从业人员(包含高级管理人员、基金投资和研究部门负责人和本基金基金经理)均未持有本基金份额。

8.3 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

本公司的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人和本基金基金经理均未持有本基金份额。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                               |                  |
|-------------------------------|------------------|
| 基金合同生效日(2023 年 9 月 7 日)基金份额总额 | 260,608,406.00   |
| 本报告期期初基金份额总额                  | 520,608,406.00   |
| 本报告期基金总申购份额                   | 1,736,000,000.00 |
| 减：本报告期基金总赎回份额                 | 1,746,000,000.00 |
| 本报告期基金拆分变动份额                  | -                |
| 本报告期期末基金份额总额                  | 510,608,406.00   |

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期本基金无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金的基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期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，无涉及基金管理人主营业务的诉讼。

本报告期内无涉及基金财产的诉讼事项。

本报告期，无基金托管业务需要承担民事或刑事责任的诉讼事项。

#### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

#### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

#### 10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

##### 10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

无。

##### 10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

无。

##### 10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内托管人无重大受调查或处罚等情况。

##### 10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内托管人相关从业人员无重大受调查或处罚等情况。

#### 10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

##### 10.7.1 基金租用或者通过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<br>单元<br>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<br>票成交总<br>额的比例 | 佣金         | 占当期佣金<br>总量的比例 |    |
| 招商证券 | 1              | 3,950,250,373.37 | 56.54%               | 394,697.39 | 56.56%         | -  |
| 中信证券 | 2              | 1,566,927,262.80 | 22.43%               | 156,531.79 | 22.43%         | -  |
| 国泰海通 | 4              | 1,461,717,847.16 | 20.92%               | 145,964.79 | 20.92%         | -  |
| 华泰证券 | 2              | 7,718,496.67     | 0.11%                | 694.38     | 0.10%          | -  |
| 广发证券 | 2              | -                | -                    | -          | -              | -  |
| 国金证券 | 1              | -                | -                    | -          | -              | -  |
| 兴业证券 | 1              | -                | -                    | -          | -              | -  |

注：根据 2024 年 7 月 1 日起施行的《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》（证监会公告〔2024〕3 号），基金管理人制定了证券公司交易单元的选择标准和程序：

1、选择标准

基金管理人建立了选择机制，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参与证券交易，并制定了定性与定量相结合的具体标准。

## 2、选择程序

(1) 基金管理人根据上述标准对证券公司进行评估，与符合标准的证券公司签订证券综合研究服务协议后将其入库，并对入库的证券公司开展动态管理，定期检视其是否持续符合选择标准；

(2) 基金管理人根据其建立的服务评价及交易量分配机制，定期对证券公司开展评价后，根据评价结果进行交易量的分配。

3、报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：新增交易单元：无；减少交易单元：无。

## 10.7.2 基金租用或者通过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 |
| 招商证券 | 726,025.37 | 67.03%       | -      | -              | -    | -            |
| 中信证券 | 60,969.48  | 5.63%        | -      | -              | -    | -            |
| 国泰海通 | 296,088.90 | 27.34%       | -      | -              | -    | -            |
| 华泰证券 | -          | -            | -      | -              | -    | -            |
| 广发证券 | -          | -            | -      | -              | -    | -            |
| 国金证券 | -          | -            | -      | -              | -    | -            |
| 兴业证券 | -          | -            | -      | -              | -    | -            |

## 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  | 南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加世纪证券为一级交易商的公告 | 证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2026-01-13 |
| 2  | 关于南方中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金更换复制方法的公告  | 证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2026-03-14 |
| 3  | 关于南方中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金变更场内简称的公告  | 证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2026-03-20 |
| 4  | 关于南方中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金变更基金经理的公告  | 证券时报、基金管理人网站、中国证监会         | 2026-03-28 |

|    |                                              |                            |            |
|----|----------------------------------------------|----------------------------|------------|
|    |                                              | 基金电子披露网站                   |            |
| 5  | 南方基金管理股份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（2025 年度） | 证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2026-03-31 |
| 6  | 南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告           | 证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2026-04-11 |
| 7  | 关于南方中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金调整最小申购、赎回单位的公告     | 证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2026-04-17 |
| 8  | 2025 年度公募基金管理人以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露    | 证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2026-04-24 |
| 9  | 南方基金管理股份有限公司成都分公司工商注册信息变更公告                  | 证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2026-04-28 |
| 10 | 南方基金管理股份有限公司关于指定证券投资基金主流动性服务商的公告             | 证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2026-05-28 |
| 11 | 南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加金融街证券为一级交易商的公告        | 证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2026-06-03 |
| 12 | 南方基金管理股份有限公司关于旗下部分基金新增流动性服务商的公告              | 证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2026-06-22 |
| 13 | 南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加东北证券为一级交易商的公告         | 证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2026-06-23 |
| 14 | 南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加华源证券为一级交易商的公告         | 证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2026-06-30 |

## § 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

报告期内单一投资者持有基金份额比例不存在达到或超过 20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立南方中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金的文件；
- 2、《南方中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《南方中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告；
- 6、《南方中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金 2026 年中期报告》原文。

### 12.2 存放地点

深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼。

### 12.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>