

---

# 华夏中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金

## 2024 年年度报告

### 2024 年 12 月 31 日

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：二〇二五年三月三十一日

## §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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 3 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。

本报告中的财务资料经审计，安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 .....	1
§2 基金简介 .....	3
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	4
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	4
3.2 基金净值表现.....	5
3.3 过去三年基金的利润分配情况 .....	6
§4 管理人报告 .....	6
§5 托管人报告 .....	14
§6 审计报告 .....	14
§7 年度财务报表 .....	16
7.1 资产负债表.....	16
7.2 利润表.....	18
7.3 净资产变动表.....	19
7.4 报表附注.....	20
§8 投资组合报告 .....	48
8.1 期末基金资产组合情况.....	48
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	49
8.3 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 .....	49
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	73
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	74
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	75
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	75
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	75
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	75
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	75
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	75
8.12 投资组合报告附注 .....	75
§9 基金份额持有人信息 .....	76
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	76
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	77
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	77
§10 开放式基金份额变动 .....	77
§11 重大事件揭示 .....	77
§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....	81
§13 备查文件目录 .....	82

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华夏中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华夏中证 1000ETF
场内简称	中证 1000ETF
基金主代码	159845
交易代码	159845
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 3 月 18 日
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	11,830,425,606.00 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	2021 年 3 月 31 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。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%。
投资策略	主要投资策略包括完全复制策略，替代性策略，存托凭证投资策略，债券投资策略，资产支持证券投资策略，股指期货投资策略，国债期货投资策略，股票期权投资策略，融资、转融通证券出借业务投资策略等。
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华夏基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李彬	张姗
	联系电话	400-818-6666	400-61-95555
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		400-818-6666	400-61-95555
传真		010-63136700	0755-83195201
注册地址		北京市顺义区安庆大街甲3号院	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址		北京市朝阳区北辰西路6号院 北辰中心C座5层	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码		100101	518040
法定代表人		张佑君	缪建民

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.ChinaAMC.com
基金年度报告备置地点	基金管理人和/或基金托管人的住所/办公地址

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2024 年	2023 年	2022 年
本期已实现收益	4,277,510,718.66	-828,145,375.97	-238,796,538.50
本期利润	6,514,832,094.44	-993,365,061.67	-442,760,465.18
加权平均基金份额本期利润	0.7537	-0.2633	-0.3296
本期加权平均净值利润率	34.29%	-10.59%	-19.83%
本期基金份额净值增长率	2.25%	-5.62%	-21.24%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末	2023 年末	2022 年末
期末可供分配利润	174,901,730.97	-448,941,057.17	-155,061,648.60
期末可供分配基金份额利润	0.0148	-0.1422	-0.0469
期末基金资产净值	28,713,821,892.90	7,494,764,190.19	6,210,607,585.16
期末基金份额净值	2.4271	2.3737	1.8803
3.1.3 累计期末指标	2024 年末	2023 年末	2022 年末
基金份额累计净值增长率	0.61%	-1.60%	4.26%

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

②本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	4.36%	2.39%	4.36%	2.40%	0.00%	-0.01%
过去六个月	21.99%	2.24%	21.69%	2.24%	0.30%	0.00%
过去一年	2.25%	2.11%	1.20%	2.12%	1.05%	-0.01%
过去三年	-23.99%	1.62%	-25.62%	1.62%	1.63%	0.00%
自基金合同生效起至今	0.61%	1.53%	-5.10%	1.53%	5.71%	0.00%

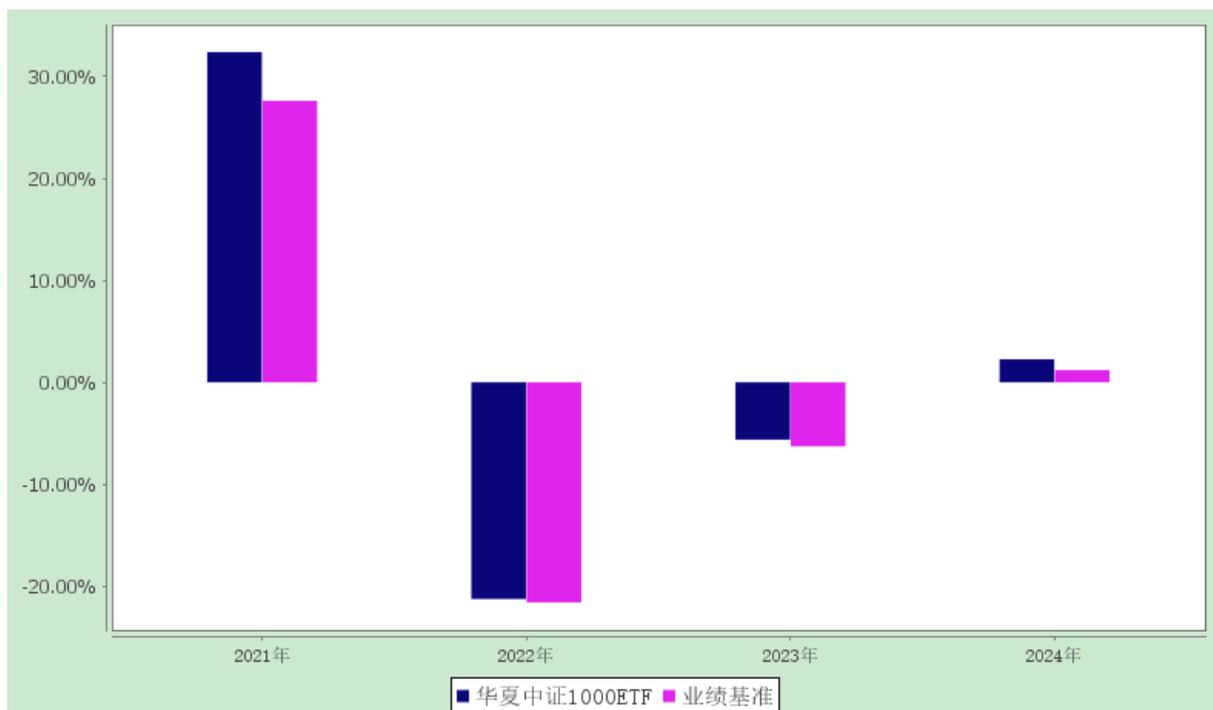
#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金  
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
 (2021 年 3 月 18 日至 2024 年 12 月 31 日)



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

华夏中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金  
 自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同于 2021 年 3 月 18 日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年无利润分配事项。

## §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

华夏基金管理有限公司成立于 1998 年 4 月 9 日，是经中国证监会批准成立的首批全国性基金管理公司之一。公司总部设在北京，在北京、上海、深圳、成都、南京、杭州、广州、青岛、武汉及沈阳设有分公司，在香港、深圳、上海、北京设有子公司。公司是首批全国社保基金管理人、首批企业年金基金管理人、境内首批 QDII 基金管理人、境内首只 ETF 基金管理人、境内首只沪港通 ETF 基金管理人、首批内地与香港基金互认基金管理人、首批基本养老保险基金投资管理人资格、首家加入联合国责任投资原则组织的公募基金公司、首批公募 FOF 基金管理人、首批公募养老目标基金管理人、首批个人养老金基金管理人、境内首批中日互通 ETF 基金管理人、首批商品期货 ETF 基金管理人、首批公募 MOM 基金管理人、首批纳入互联互通 ETF 基金管理人、首批北交所主题基金管理人以及特定客户资产管理人、保险资金投资管理人、公募 REITs 管理人，境内首家承诺“碳中和”具体目标和路径的公募基金公司，香港子公司是首批 RQFII 基金管理人。华夏基金是业务领域最广泛

的基金管理公司之一。

华夏基金是境内权益 ETF 管理规模最大的基金管理公司之一，在指数基金管理方面积累了丰富的经验，形成了覆盖宽基、港股、行业主题、策略、跨境、商品等较为完整的指数产品线。

华夏基金以深入的投资研究为基础，尽力捕捉市场机会，为投资人谋求良好的回报。根据银河证券基金研究中心《中国基金业绩评价报告》，截至 2024 年 12 月 31 日，华夏基金旗下多只产品近 1 年同类排名领先（基金排名不作为产品未来表现的保证），其中：

主动权益产品：在消费行业偏股型基金(A 类)中华夏消费臻选混合发起式(A 类)排名第 1/81；在新能源主题行业偏股型基金(A 类)中华夏清洁能源龙头混合发起式(A 类)排名第 1/27；在北交所主题偏股型基金(A 类)中华夏北交所创新中小企业精选两年定开混合发起式排名第 1/11；在标准股票型基金(A 类)中华夏优势精选股票排名第 2/336、华夏潜龙精选股票排名第 15/336、华夏创新前沿股票排名第 64/336；在汽车主题行业偏股型基金(A 类)中华夏新能源车龙头混合发起式(A 类)排名第 3/16；在港股通标准股票型基金(A 类)中华夏港股通精选股票（LOF）(A 类)排名第 3/14；在 QDII 混合基金(A 类)中华夏全球科技先锋混合（QDII）排名第 5/51；在偏股型基金(股票上限 80%)(A 类)中华夏经典混合排名第 5/148、华夏常阳三年定开混合排名第 19/148、华夏策略混合排名第 29/148；在 TMT 与信息技术行业偏股型基金(A 类)中华夏半导体龙头混合发起式(A 类)排名第 11/47；在医药医疗健康行业偏股型基金(A 类)中华夏乐享健康混合(A 类)排名第 13/78；在 QDII 股票型基金(A 类)中华夏全球股票（QDII）排名第 14/72；在偏股型基金(股票上下限 60%-95%)(A 类)中华夏见龙精选混合排名第 13/1719、华夏阿尔法精选混合(A 类)排名第 40/1719、华夏融盛可持续一年持有混合(A 类)排名第 101/1719、华夏远见成长一年持有混合(A 类)排名第 169/1719、华夏 ESG 可持续投资一年持有混合(A 类)排名第 177/1719、华夏先进制造龙头混合(A 类)排名第 184/1719、华夏行业景气混合排名第 214/1719、华夏景气成长一年持有混合发起式(A 类)排名第 257/1719、华夏科技前沿 6 个月定开混合(A 类)排名第 278/1719；在灵活配置型基金(基准股票比例 30%-60%)(A 类)中华夏磐晟混合（LOF）排名第 28/425、华夏高端制造混合(A 类)排名第 64/425、华夏新机遇混合(A 类)排名第 76/425；在偏股型基金(股票上限 95%)(A 类) 华夏新兴经济一年持有混合(A 类)排名第 34/221、华夏大盘精选混合(A 类)排名第 49/221。

固收与固收+产品：在信用债指数债券型基金(A 类)中华夏亚债中国指数(A 类)排名第 1/18；在普通债券型基金(可投转债)(A 类)中华夏双债债券(A 类)排名第 2/246；在定开纯债债券型基金(A 类)中华夏鼎华一年定开债券排名第 9/647、华夏鼎誉三个月定开债券(A 类)排名第 51/647；在定开普通债券型基金(二级)(A 类)中华夏卓信一年定开债券发起式排名第 11/24；在可转换债券型基金(A 类)中华夏可转债增强债券(A 类)排名第 12/38；在普通偏债型基金(股票上限不高于 30%)(A 类)中华夏磐泰

混合（LOF）（A 类）排名第 14/333；在中短期纯债债券型基金（A 类）中华夏中短债债券（A 类）排名第 15/165；在定开普通债券型基金（可投转债）（A 类）中华夏鼎禄三个月定开债券（A 类）排名第 22/157、华夏鼎福三个月定开债券（A 类）排名第 31/157；在长期纯债债券型基金（A 类）中华夏鼎茂债券（A 类）排名第 20/851、华夏鼎通债券（A 类）排名第 37/851；在普通债券型基金（二级）（A 类）中华夏稳享增利 6 个月债券（A 类）排名第 79/443。

指数产品：在标准策略指数股票型基金（A 类）中华夏上证 50AH 优选指数（LOF）（A 类）排名第 6/25；在策略指数股票 ETF 基金中华夏中证智选 300 价值稳健策略 ETF 排名第 8/48；在规模指数股票 ETF 基金中华夏 MSCI 中国 A50 互联互通 ETF 排名第 14/161、华夏中证沪港深 500ETF 排名第 20/161、华夏上证 50ETF 排名第 29/161；在行业指数股票 ETF 基金中华夏中证银行 ETF 排名第 5/72、华夏中证全指证券公司 ETF 排名第 15/72；在增强规模指数股票型基金（A 类）中华夏沪深 300 指数增强（A 类）排名第 5/191、华夏上证科创板 50 成份指数增强发起式（A 类）排名第 17/191；在主题指数股票 ETF 基金中华夏金融 ETF 发起式排名第 2/357、华夏国证半导体芯片 ETF 排名第 19/357、华夏中证金融科技主题 ETF 排名第 21/357、华夏中证 5G 通信主题 ETF 排名第 60/357、华夏中证人工智能主题 ETF 排名第 72/357、华夏中证云计算与大数据主题 ETF 排名第 83/357。

在客户服务方面，2024 年，华夏基金继续以客户需求为导向，努力提高客户使用的便利性和服务体验：（1）华夏基金直销渠道继续优化页面显示，升级搜索及查询功能，给客户更方便、直观的使用感受；（2）华夏基金管家客户端从客户需求出发持续优化操作页面，进一步提升操作体验；（3）与常熟农商银行、长春农商银行、贵文基金等代销机构合作，拓展更加丰富的客户理财渠道；（4）开展“送你长期主义的花朵”、“换个角度，世界可能不一样”、“聊聊新赛道”等活动，为客户提供了多样化的投资者教育和关怀服务。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
赵宗庭	本基金的基金经理	2021-03-18	-	16 年	硕士。曾任华夏基金管理有限公司研究发展部产品经理、数量投资部研究员，嘉实基金管理有限公司指数投资部基金经理助理，嘉实国际资产管理有限公司基金经理。2016 年 11 月加入华夏基金管理有限公司。历任华夏中

				<p>证四川国企改革交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理（2020 年 12 月 8 日至 2022 年 1 月 13 日期间）、华夏中证四川国企改革交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2020 年 12 月 8 日至 2022 年 1 月 13 日期间）、华夏中证浙江国资创新发展交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2020 年 12 月 8 日至 2022 年 1 月 13 日期间）、华夏中证浙江国资创新发展交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2020 年 12 月 8 日至 2022 年 1 月 13 日期间）、上证主要消费交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理（2020 年 2 月 12 日至 2022 年 8 月 22 日期间）、华夏中证大数据产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2021 年 2 月 9 日至 2022 年 8 月 22 日期间）、华夏中证新能源交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2021 年 3 月 9 日至 2022 年 8 月 22 日期间）、华夏中证新材料主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2021 年 8 月 4 日至 2023 年 3 月 27 日期间）、华夏中证石化产业交易型开放式指数证券投资基金基金经</p>
--	--	--	--	---

					理（2021 年 12 月 2 日至 2023 年 3 月 27 日期间）、华夏国证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2021 年 8 月 12 日至 2023 年 6 月 29 日期间）、华夏中证机器人交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2021 年 12 月 17 日至 2023 年 6 月 29 日期间）、华夏中证细分有色金属产业主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2021 年 6 月 9 日至 2023 年 12 月 28 日期间）、华夏中证细分有色金属产业主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理（2022 年 10 月 18 日至 2023 年 12 月 28 日期间）等。
--	--	--	--	--	--

注：①上述“任职日期”和“离任日期”为根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。首任基金经理的，其“任职日期”为基金合同生效日。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

#### 4.1.3 基金经理薪酬机制

本基金管理人旗下基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的，公司对其进行年度综合考核，考核结果作为确定其薪酬激励的重要参考因素之一。因此，基金经理个人薪酬激励与其管理的私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩表现不直接挂钩。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》等法律法规和基金合同，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损

害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《华夏基金管理有限公司公平交易制度》。公司通过科学、制衡的投资决策体系,加强交易分配环节的内部控制,并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时,通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督。

##### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合,制定并严格遵守相应的制度和流程,通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《华夏基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

###### 4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本基金管理人一贯严格执行公平交易原则,对兼任基金经理的交易情况进行持续监测。本年度所有相关组合的交易行为均符合法规、制度和流程要求,未发现违反公平交易原则的情况。本年度同一基金经理管理的不同组合在邻近交易日的同向和反向交易,交易时机和交易价差均可合理解释,未发现异常。

本基金管理人根据《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引(试行)》要求,针对同经理管理多个组合间的收益率差异进行归因分析,本年度各组合间收益率差异均属正常情况,主要原因为业绩基准不同、投资策略不同,收益率差异可以合理解释。

##### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内,本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共有 197 次,其中 1 次为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易,有关基金经理已根据公司管理要求提供决策依据;其余均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪的标的指数为中证 1000 指数,中证 1000 指数选取中证 800 指数样本以外的规模偏小且流动性好的 1000 只证券作为指数样本,与沪深 300 和中证 500 等指数形成互补。本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好地跟踪标的指数,实现基金投资目标。

2024 年，国际环境错综复杂，世界经济增长动能不足，地缘政治冲突加剧，贸易保护主义愈演愈烈；主要经济体表现分化，各国央行在应对通胀和促进经济增长之间艰难权衡，货币政策趋向差异明显。面对外部压力加大、内部困难增多的复杂严峻形势，我国经济运行稳中有进，高质量发展扎实推进。一揽子增量政策及时出台，有效提振了社会信心，促进经济回升向好；新质生产力稳步发展，传统动能焕新升级、新动能积厚成势，高质量发展取得新成效。

市场方面，A 股市场 2024 年走势跌宕起伏，全年主要涨幅由三季度末的快速上涨贡献，而这得益于一系列稳经济稳增长、呵护市场流动性、推动资本市场高质量发展举措的连续出台。从市场风格来看，高股息板块凭借其稳健属性成为资金避险的核心方向，全年涨幅领跑市场，大盘价值股整体表现显著优于小盘成长股。

基金投资运作方面，报告期内，本基金在做好跟踪标的指数的基础上，认真应对投资者日常申购、赎回和成份股调整等工作。

为促进本基金的市场流动性提高和平稳运行，经深圳证券交易所同意，部分证券公司被确认为本基金的流动性服务商。目前，本基金的流动性服务商包括东方证券股份有限公司、东海证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中国国际金融股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、华安证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、浙商证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、财通证券股份有限公司、长江证券股份有限公司等。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2024 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 2.4271 元，本报告期份额净值增长率为 2.25%，同期业绩比较基准增长率 1.20%。本基金本报告期跟踪偏离度为+1.05%，与业绩比较基准产生偏离的主要原因为成份股分红、日常运作费用、指数结构调整、申购赎回等产生的差异。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2025 年，全球经济有望延续温和复苏态势，但保护主义抬头、地缘政治局势动荡以及发达国家债务水平攀升三大不确定性风险，可能对复苏进程带来一些挑战。国内方面，2025 年是我国“十四五”规划的顺利收官之年，也是“十五五”规划的谋篇布局之年，可以预见外部环境变化带来的不利影响将会加深，但是我国经济长期向好的支撑条件和基本趋势没有改变；中央经济工作会议在部署 2025 年经济工作时，把扩大国内需求摆在首位，强调“大力提振消费、提高投资效益，全方位扩大国内需求”，凸显了扩大内需作为一项长期战略举措的重要性。

市场方面，2025 年 A 股市场在政策支持和经济复苏的背景下，有望延续上行态势，结构性机会

进一步增多，内需驱动和科技创新是两条确定性较高的投资主线。

本基金将会根据基金合同要求，在紧密跟踪标的的指数的基础上，做好相关投资工作。

珍惜基金份额持有人的每一分投资和每一份信任，本基金将继续奉行华夏基金管理有限公司“为信任奉献回报”的经营理念，规范运作，审慎投资，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求长期、稳定的回报。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人持续加强合规管理、风险控制和监察稽核工作。

在合规管理方面，公司通过合规审核、合规检查、合规咨询、合规宣传与合规培训等对合规风险进行管理，确保公司合规体系高效运行，合规风险有效控制。报告期内，公司不断加强合规制度建设，结合法律法规和业务实际，在廉洁从业风险防控、信息披露、洗钱风险管理等方面新增和修订多项管理制度，制度化水平显著提高。持续开展合规培训，在全员覆盖的基础上，着重加强投资研究和基金销售等重点业务领域的合规督导培训，强化员工主动合规意识和公募基金信息披露责任意识。持续优化合规管理的机制化和系统化，完善合规管理综合服务平台，提高合规管理效能。持续做好信息披露业务，通过流程优化、系统优化及强化培训持续保障信息披露的完整性、准确性、及时性。持续规范基金销售业务，通过严格审查宣传推介材料，认真开展投资者适当性管理工作等，确保基金销售业务依法合规。公司高度重视洗钱风险管理，深入实践风险为本方法，认真贯彻落实各项反洗钱监管要求，持续加强“风险评估+合规检查”双支柱管理框架，深入推进洗钱风险管理数字化转型，持续提升洗钱风险管理水平。

在风险控制方面，公司秉承数字化管理理念，持续完善内部风险管理系统建设，稳步夯实投资风险基础。紧密跟踪各项法律法规要求、加强风险研究，在严格管控基金日常投资运作风险的同时，持续完善风险管理制度建设，提升基金流动性风险、市场风险、合规风险、操作风险等关键风险的管控水平，努力保障各项风险管理措施落实到位。

在监察稽核方面，公司按照法规要求，做好日常合规监控，定期及不定期开展内部检查，排查业务风险隐患，促进公司整体业务合规运作、稳健经营。

报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将继续以风险控制为核心，坚持基金份额持有人利益优先的原则，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金合规稳健运作。

#### 4.7 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及基金合同约定，本基金管理人作为准确、及时进行基金估值和份额净值计价，制定了基金估值和份额净值计价的业务管理制度，建立了估值委员会，使用可靠的估值业

务系统，设有完善的风险监测、控制和报告机制。本基金托管人审阅本基金管理人采用的估值原则及技术，并复核、审查基金资产净值和基金份额申购、赎回价格。会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性发表专业意见。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

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

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：

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

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

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

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

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

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

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

## §6 审计报告

安永华明（2025）审字第 70035283\_A248 号

华夏中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人：

### 6.1 审计意见

我们审计了华夏中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金的财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的华夏中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了华夏中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。

## 6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于华夏中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

## 6.3 其他信息

华夏中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

## 6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，管理层负责评估华夏中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。

治理层负责监督华夏中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金的财务报告过程。

## 6.5 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来

可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对华夏中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致华夏中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金不能持续经营。

(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

蒋燕华 张晓阳

北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层

2025 年 3 月 27 日

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：华夏中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	182,323,359.40	35,342,119.11
结算备付金		103,438,789.17	36,235,392.64
存出保证金		41,510,331.39	7,595,207.51
交易性金融资产	7.4.7.2	28,401,449,959.68	7,445,232,204.31
其中：股票投资		28,401,449,959.68	7,443,229,666.23
基金投资		-	-
债券投资		-	2,002,538.08
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收清算款		105,843,691.28	83,661,050.71
应收股利		-	1,995.00
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	205,139.82
资产总计		28,834,566,130.92	7,608,273,109.10
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2023 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		97,694,618.23	73,054,151.67
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		3,860,432.48	2,881,023.84
应付托管费		1,286,810.82	576,204.74
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,701,570.52	14,988.44
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	16,200,805.97	36,982,550.22
负债合计		120,744,238.02	113,508,918.91
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	28,538,920,161.93	7,616,760,400.83
未分配利润	7.4.7.8	174,901,730.97	-121,996,210.64

净资产合计		28,713,821,892.90	7,494,764,190.19
负债和净资产总计		28,834,566,130.92	7,608,273,109.10

注：报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额净值 2.4271 元，基金份额总额 11,830,425,606.00 份。

## 7.2 利润表

会计主体：华夏中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		6,616,651,401.33	-936,482,457.62
1.利息收入		8,413,049.67	18,770,640.50
其中：存款利息收入	7.4.7.9	1,779,991.36	1,213,229.63
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		-	76,668.49
其他利息收入		6,633,058.31	17,480,742.38
2.投资收益（损失以“-”填列）		4,337,021,886.87	-824,324,600.33
其中：股票投资收益	7.4.7.10	4,053,828,885.25	-929,456,301.37
基金投资收益	7.4.7.11	-	-
债券投资收益	7.4.7.12	1,987,071.95	5,755,239.56
资产支持证券投资收益	7.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	54,378,008.70	-9,603,360.80
股利收益	7.4.7.16	226,827,920.97	108,979,822.28
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	2,237,321,375.78	-165,219,685.70
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	33,895,089.01	34,291,187.91
<b>减：二、营业总支出</b>		101,819,306.89	56,882,604.05
1.管理人报酬		83,925,064.76	47,166,879.32
2.托管费		17,477,001.65	9,433,375.79
3.销售服务费		-	-
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.信用减值损失	7.4.7.20	-	-
7.税金及附加		219,836.82	69,315.65
8.其他费用	7.4.7.21	197,403.66	213,033.29

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		6,514,832,094.44	-993,365,061.67
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		6,514,832,094.44	-993,365,061.67
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		6,514,832,094.44	-993,365,061.67

7.3 净资产变动表

会计主体：华夏中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	7,616,760,400.83	-121,996,210.64	7,494,764,190.19
二、本期期初净资产	7,616,760,400.83	-121,996,210.64	7,494,764,190.19
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	20,922,159,761.10	296,897,941.61	21,219,057,702.71
(一)、综合收益总额	-	6,514,832,094.44	6,514,832,094.44
(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)	20,922,159,761.10	-6,217,934,152.83	14,704,225,608.27
其中：1.基金申购款	78,540,721,490.45	-9,790,385,555.15	68,750,335,935.30
2.基金赎回款	-57,618,561,729.35	3,572,451,402.32	-54,046,110,327.03
(三)、本期向基金份 额持有人分配利润产 生的净资产变动(净 资产减少以“-”号 填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	28,538,920,161.93	174,901,730.97	28,713,821,892.90
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	5,957,200,491.96	253,407,093.20	6,210,607,585.16
二、本期期初净资产	5,957,200,491.96	253,407,093.20	6,210,607,585.16
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	1,659,559,908.87	-375,403,303.84	1,284,156,605.03
(一)、综合收益总额	-	-993,365,061.67	-993,365,061.67
(二)、本期基金份额 交易产生的净资产变 动数(净资产减少以	1,659,559,908.87	617,961,757.83	2,277,521,666.70

“-”号填列)			
其中：1.基金申购款	39,818,471,457.86	3,157,441,876.96	42,975,913,334.82
2.基金赎回款	-38,158,911,548.99	-2,539,480,119.13	-40,698,391,668.12
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	7,616,760,400.83	-121,996,210.64	7,494,764,190.19

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：张佑君，主管会计工作负责人：朱威，会计机构负责人：朱威

#### 7.4 报表附注

##### 7.4.1 基金基本情况

华夏中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）已获中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2020]3523 号《关于准予华夏中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》，由华夏基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《华夏中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规负责公开募集。本基金为交易型开放式，存续期限为不定期。本基金自 2021 年 3 月 4 日至 2021 年 3 月 12 日共募集 228,854,522.00 元（不含认购资金利息），业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2021）验字第 60739337\_A41 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2021 年 3 月 18 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 228,866,784.00 份基金份额。

根据《华夏中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》，基金管理人华夏基金管理有限公司确定 2021 年 3 月 22 日为基金份额折算日，折算后本基金基金份额净值与 2021 年 3 月 22 日中证 1000 指数收盘点位的万分之一基本一致。折算前基金份额总额为 228,866,784 份，本次基金份额折算比例为 1.573946543，折算后基金份额总额为 360,222,278 份。基金的基金管理人为华夏基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据基金合同、招募说明书（更新）及《华夏基金管理有限公司关于华夏中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金实施基金份额折算业务并调整最小申购、赎回单位的公告》等规定，华夏基金管理有限公司以 2022 年 8 月 1 日为权益登记日（折算当日），对该日在中国证券登记结算有限责任公司登记在册的本基金基金份额进行了份额折算。折算前基金份额总额为 6,350,222,278.00 份，折算

前基金份额净值为 0.7587 元；权益登记日（折算当日）本基金折算后基金份额总额为 2,237,023,910.00 份，折算后基金份额净值为 2.1537 元。

根据基金合同、招募说明书（更新）及《华夏基金管理有限公司关于华夏中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金基金份额折算结果的公告》等规定，华夏基金管理有限公司以 2023 年 2 月 28 日为权益登记日（折算当日），对该日在中国证券登记结算有限责任公司登记在册的本基金份额进行了份额折算。权益登记日（折算当日）本基金折算前基金份额总额为 2,265,023,910 份，折算前基金份额净值为 2.0800 元；权益登记日（折算当日）本基金折算后基金份额总额为 1,693,425,606 份，折算后基金份额净值为 2.7820 元。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和本基金基金合同的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，基金还可投资于非成份股（含中小板、创业板及其他中国证监会注册或核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、衍生品（包括股指期货、股票期权、国债期货）、资产支持证券、货币市场工具（含同业存单、债券回购等）、银行存款以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金可根据法律法规的规定参与融资、转融通证券出借业务。本基金投资范围中的股票包含存托凭证。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布和修订的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则（以下合称“企业会计准则”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会发布的《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〉》和中国证监会、中国基金业协会允许的如财务报表附注 7.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金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。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

##### 1、金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

##### (1) 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

##### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

##### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益。基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资、资产支持证券投资 and 基金投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

##### (2) 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

##### 2、金融负债的分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

### 3、衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。

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

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。

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

本基金对以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础，进行减值处理并确认损失准备。本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

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

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

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产。当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

1、存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

3、如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。对于曾经实施份额拆分或折算的基金，由于基金份额拆分或折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日

或基金份额折算日根据拆分前或折算前的基金份额数及确定的拆分或折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。对于已开放转换业务的基金，上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/（累计亏损）。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

境内基金投资在持有期间应取得的现金红利于除息日确认为投资收益；境外基金投资在持有期间应取得的基金分红收益扣除基金交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认投资收益。境内股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益；境外股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除股票交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。境内债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。境外债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在交易所在地适用的预缴所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

本基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司(以下简称“证金公司”)出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息确认为利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

针对基金合同约定费率和计算方法的费用，本基金在费用涵盖期间按合同约定进行确认。

其他以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。期末可供分配利润指期末资产负债表未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率达到 1%以上，方可进行收益分配。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

1、对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

2、对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》进行估值。

3、对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566 号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场交易的固定收益品种，按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 7.4.6 税项

根据财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103 号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[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[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]125 号《财政部、国家税务总局、证监会关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《财政部、国家税务总局关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《财政部、国家税务总局关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会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》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于增值税征收范围，不征收增值税。

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

(3) 基金买卖股票、债券的差价收入免征增值税，暂不征收企业所得税。

(4) 存款利息收入不征收增值税。

(5) 国债、地方政府债利息收入，金融同业往来利息收入免征增值税。

(6) 对基金取得的债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(7) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价

暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(8) 对基金在境内取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利收入时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。基金在境内从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，全额计入应纳税所得额，持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，减按 50% 计入应纳税所得额，持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。对香港市场投资者取得的股息、红利收入按照 10% 的税率代扣所得税。

(9) 基金在境内卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(10) 基金在境外证券交易所进行交易或取得的源自境外证券市场的收益，其涉及的税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行。

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

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	182,323,359.40	35,342,119.11
等于：本金	182,303,642.54	35,339,376.85
加：应计利息	19,716.86	2,742.26
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-

合计	182,323,359.40	35,342,119.11
----	----------------	---------------

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	26,503,804,182.66	-	28,401,449,959.68	1,897,645,777.02
贵金属投资- 金交所黄金 合约	-	-	-	-
债券	交易所市 场	-	-	-
	银行 间市 场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证 券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	26,503,804,182.66	-	28,401,449,959.68	1,897,645,777.02
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	7,796,034,824.99	-	7,443,229,666.23	-352,805,158.76
贵金属投资- 金交所黄金 合约	-	-	-	-
债券	交易所市 场	2,002,400.00	138.08	2,002,538.08
	银行 间市 场	-	-	-
	合计	2,002,400.00	138.08	2,002,538.08
资产支持证 券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	7,798,037,224.99	138.08	7,445,232,204.31	-352,805,158.76

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款的估值增值。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 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	319,092,280.00	-	-	-
其中：股指期货	319,092,280.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	319,092,280.00	-	-	-
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 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	41,056,120.00	-	-	-
其中：股指期货	41,056,120.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	41,056,120.00	-	-	-

7.4.7.3.2 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
IM2503	中证 1000 期货 IM2503 合约	260	305,832,800.00	-13,259,480.00
合计	-	-	-	-13,259,480.00
减：可抵销期货暂 收款	-	-	-	-13,259,480.00
净额				-

注：衍生金融资产项下的利率/权益/其他衍生工具为国债/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股指/商品/国债期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指/商品/国债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。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
应收利息	-	-
其他应收款	-	205,139.82
待摊费用	-	-
合计	-	205,139.82

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	4,214,009.88	2,663,804.82
其中：交易所市场	4,214,009.88	2,663,804.82
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	195,000.00	210,000.00
应退替代款	11,497,576.27	33,822,979.74
可退替代款	294,219.82	285,765.66
合计	16,200,805.97	36,982,550.22

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,157,425,606.00	7,616,760,400.83
本期申购	32,558,000,000.00	78,540,721,490.45
本期赎回（以“-”号填列）	-23,885,000,000.00	-57,618,561,729.35
本期末	11,830,425,606.00	28,538,920,161.93

7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-448,941,057.17	326,944,846.53	-121,996,210.64
本期期初	-448,941,057.17	326,944,846.53	-121,996,210.64
本期利润	4,277,510,718.66	2,237,321,375.78	6,514,832,094.44

本期基金份额交易产生的变动数	-3,319,365,372.30	-2,898,568,780.53	-6,217,934,152.83
其中：基金申购款	-8,783,282,950.38	-1,007,102,604.77	-9,790,385,555.15
基金赎回款	5,463,917,578.08	-1,891,466,175.76	3,572,451,402.32
本期已分配利润	-	-	-
本期末	509,204,289.19	-334,302,558.22	174,901,730.97

#### 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	665,287.53	244,566.77
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	1,064,702.57	924,241.62
其他	50,001.26	44,421.24
合计	1,779,991.36	1,213,229.63

#### 7.4.7.10 股票投资收益

##### 7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	1,628,809,668.18	-617,445,690.09
股票投资收益——赎回差价收入	2,425,019,217.07	-312,010,611.28
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	4,053,828,885.25	-929,456,301.37

##### 7.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	35,737,934,686.26	24,251,159,297.32
减：卖出股票成本总额	34,075,228,684.28	24,835,323,107.41
减：交易费用	33,896,333.80	33,281,880.00
买卖股票差价收入	1,628,809,668.18	-617,445,690.09

7.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
赎回基金份额对价总额	54,046,110,327.03	40,698,391,668.12
减：现金支付赎回款总额	23,706,828,925.03	16,640,872,225.12
减：赎回股票成本总额	27,914,262,184.93	24,369,530,054.28
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	2,425,019,217.07	-312,010,611.28

7.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.10.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

7.4.7.11 基金投资收益

无。

7.4.7.12 债券投资收益

7.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
债券投资收益——利息收入	1,708.03	3,443.78
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,985,363.92	5,751,795.78
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	1,987,071.95	5,755,239.56

7.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	18,082,285.29	29,625,016.64
减：卖出债券（债转股及债券到	16,094,300.00	23,868,500.00

期兑付) 成本总额		
减: 应计利息总额	1,897.75	3,535.99
减: 交易费用	723.62	1,184.87
买卖债券差价收入	1,985,363.92	5,751,795.78

7.4.7.13 资产支持证券投资收益

无。

7.4.7.14 贵金属投资收益

无。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位: 人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年12月31日	2023年1月1日至2023年12月31日
股指期货投资收益	54,378,008.70	-9,603,360.80

7.4.7.16 股利收益

单位: 人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年12月31日	2023年1月1日至2023年12月31日
股票投资产生的股利收益	226,827,920.97	108,979,822.28
其中: 证券出借权益补偿收入	12,348,422.85	8,615,650.06
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	226,827,920.97	108,979,822.28

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位: 人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年12月31日	2023年1月1日至2023年12月31日
1. 交易性金融资产	2,250,450,935.78	-168,829,925.70
——股票投资	2,250,450,935.78	-168,829,925.70
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-

2.衍生工具	-13,129,560.00	3,610,240.00
——权证投资	-	-
——期货投资	-13,129,560.00	3,610,240.00
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	2,237,321,375.78	-165,219,685.70

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年12月31日	2023年1月1日至2023年12月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	33,895,013.19	34,268,740.91
其他	75.82	22,447.00
合计	33,895,089.01	34,291,187.91

7.4.7.19 持有基金产生的费用

无。

7.4.7.20 信用减值损失

无。

7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年12月31日	2023年1月1日至2023年12月31日
审计费用	75,000.00	90,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	2,403.66	3,033.29
合计	197,403.66	213,033.29

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华夏基金管理有限公司	基金管理人
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人
中信证券股份有限公司（“中信证券”）	基金管理人的股东
MACKENZIE FINANCIAL CORPORATION	基金管理人的股东
天津海鹏科技咨询有限公司	基金管理人的股东
华夏中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（“华夏中证 1000ETF 发起式联接”）	该基金是本基金的联接基金
华夏资本管理有限公司（“华夏资本”）	基金管理人的子公司
华夏股权投资基金管理（北京）有限公司	基金管理人的子公司
China Asset Management (Hong Kong) Limited（中文名：华夏基金(香港)有限公司）	基金管理人的子公司
上海华夏财富投资管理有限公司（“华夏财富”）	基金管理人的子公司
中信中证资本管理有限公司（“中信中证资本”）	基金管理人第一大股东的子公司

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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年12月31日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中信证券	24,282,098,719.24	30.69%	34,717,779,052.93	69.98%

###### 7.4.10.1.2 权证交易

无。

###### 7.4.10.1.3 债券交易

无。

###### 7.4.10.1.4 债券回购交易

无。

###### 7.4.10.1.5 基金交易

无。

###### 7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年12月31日

	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
中信证券	2,789,131.35	25.47%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
中信证券	3,315,681.37	33.84%	453,732.12	17.03%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。根据证监会公告[2024]3号《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自2024年7月1日起，针对被动股票型基金，不再通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用。针对其他类型基金，不再通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12 月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	83,925,064.76	47,166,879.32
其中：应支付销售机构的客户维护费	755.42	-
应支付基金管理人的净管理费	83,924,309.34	47,166,879.32

注：①支付基金管理人的基金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。

②基金管理人报酬计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×年费率/当年天数。

③客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算，从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

④根据2024年11月20日发布的《华夏基金管理有限公司关于调低旗下8只基金管理费率、托管费率并修订基金合同的公告》，自2024年11月20日起管理费率由0.50%调整为0.15%。因此，本基金2024年1月1日至2024年11月19日止期间的管理费率为0.50%，2024年11月20日至2024年12月31日的管理费率为0.15%。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	17,477,001.65	9,433,375.79

注：①支付基金托管人的基金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。

②基金托管费计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×年费率/当年天数。

③根据 2024 年 11 月 20 日发布的《华夏基金管理有限公司关于调低旗下 8 只基金管理费率、托管费率并修订基金合同的公告》，自 2024 年 11 月 20 日起托管费率由 0.10% 调整为 0.05%。因此，本基金 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 11 月 19 日止期间的托管费率为 0.10%，2024 年 11 月 20 日至 2024 年 12 月 31 日的托管费率为 0.05%。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

无。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

单位：人民币元

本期 2024年1月1日至2024年12月31日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
中信证券	-	-	-	-
上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
中信证券	673,680.00	519.84	-	-

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

单位：人民币元

本期 2024年1月1日至2024年12月31日
-----------------------------

关联方名称	交易金额	费率区间 (%)	加权平均 费率 (%)	利息收入	期末证券出借 业务余额	期末应收利息 余额
中信证券	7,466,258,760.35	0.75~5.20	1.14	2,813,552.68	-	-
上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日						
关联方名称	交易金额	费率区间 (%)	加权平均 费率 (%)	利息收入	期末证券出借 业务余额	期末应收利息 余额
中信证券	5,685,481,133.19	0.20~6.70	1.75	3,837,047.74	136,941,519.00	31,079.98

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024 年 12 月 31 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
中信中证资本	-	-	4,811,200.00	0.15%
华夏中证 1000ETF 发起式联接	87,181,194.00	0.74%	60,790,677.00	1.93%
中信证券	7,679,001.00	0.06%	304,130,132.00	9.63%

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的相关费用符合基金招募说明书、交易所、登记结算机构的有关规定。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年12月31日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行活期存款	182,323,359.40	665,287.53	35,342,119.11	244,566.77

注：本基金的活期银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率或约定利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
中信证券	688708	佳驰科技	新股发行	7,794	211,061.52
中信证券	601033	永兴股份	新股发行	12,577	203,747.40
中信证券	688584	上海合晶	新股发行	8,659	196,212.94
中信证券	001391	国货航	新股发行	46,851	107,757.30
中信证券	301613	新铝时代	新股发行	2,756	76,341.20
中信证券	001359	平安电工	新股发行	1,833	31,875.87
中信证券	603091	众鑫股份	新股发行	940	24,910.00
上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
中信证券	688563	航材股份	新股发行	15,010	1,185,639.90
中信证券	000049	德赛电池	配股发行	54,789	1,159,335.24
中信证券	688343	云天励飞	新股发行	24,961	1,096,287.12
中信证券	603296	华勤技术	新股发行	5,925	478,740.00
中信证券	688146	中船特气	新股发行	10,101	365,151.15
中信证券	001286	陕西能源	新股发行	37,667	361,603.20
中信证券	301559	中集环科	新股发行	13,144	318,347.68
中信证券	301371	敷尔佳	新股发行	5,637	313,868.16
中信证券	688581	安杰思	新股发行	1,629	204,928.20
中信证券	688539	高华科技	新股发行	5,334	203,865.48
中信证券	688522	纳睿雷达	新股发行	4,299	200,677.32
中信证券	301439	泓淋电力	新股发行	9,486	189,625.14
中信证券	688523	航天环宇	新股发行	4,717	103,113.62
中信证券	301293	三博脑科	新股发行	3,324	98,390.40
中信证券	301323	新莱福	新股发行	2,277	88,939.62
中信证券	688450	光格科技	新股发行	1,662	88,235.58
中信证券	688631	莱斯信息	新股发行	3,357	84,864.96
中信证券	301170	锡南科技	新股发行	2,496	84,864.00
中信证券	301157	华塑科技	新股发行	1,498	84,637.00
中信证券	601133	柏诚股份	新股发行	6,632	77,329.12
中信证券	301261	恒工精密	新股发行	1,973	72,803.70
中信证券	301517	陕西华达	新股发行	1,841	49,467.67
中信证券	603281	江瀚新材	新股发行	863	30,714.17
中信证券	001367	海森药业	新股发行	549	24,419.52
中信证券	001324	长青科技	新股发行	1,131	21,353.28
中信证券	603162	海通发展	新股发行	523	19,481.75

## 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

7.4.12 期末（2024 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 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
301626	苏州天脉	2024-10-17	6 个月	新发流通受限	21.23	65.78	957	20,317.11	62,951.46	-
688615	合合信息	2024-09-19	6 个月	新发流通受限	55.18	165.78	289	15,947.02	47,910.42	-
688708	佳驰科技	2024-11-27	6 个月	新发流通受限	27.08	48.95	780	21,122.40	38,181.00	-
688726	拉普拉斯	2024-10-22	6 个月	新发流通受限	17.58	33.06	979	17,210.82	32,365.74	-
001391	国货航	2024-12-23	6 个月	新发流通受限	2.30	6.80	4,686	10,777.80	31,864.80	-
301551	无线传媒	2024-09-19	6 个月	新发流通受限	9.40	43.23	652	6,128.80	28,185.96	-
603072	天和磁材	2024-12-24	1 个月内(含)	新发流通受限	12.30	12.30	2,029	24,956.70	24,956.70	-
301522	上大股份	2024-10-09	6 个月	新发流通受限	6.88	24.84	816	5,614.08	20,269.44	-
301556	托普云农	2024-10-10	6 个月	新发流通受限	14.50	59.05	267	3,871.50	15,766.35	-
301631	壹连科技	2024-11-12	6 个月	新发流通受限	72.99	101.96	153	11,167.47	15,599.88	-

301606	绿联科技	2024-07-17	6 个月	新发流通受限	21.21	36.49	396	8,399.16	14,450.04	-
301571	国科天成	2024-08-14	6 个月	新发流通受限	11.14	40.83	350	3,899.00	14,290.50	-
301622	英思特	2024-11-26	6 个月	新发流通受限	22.36	44.92	306	6,842.16	13,745.52	-
301608	博实结	2024-07-25	6 个月	新发流通受限	44.50	65.38	184	8,188.00	12,029.92	-
301613	新铝时代	2024-10-18	6 个月	新发流通受限	27.70	41.77	276	7,645.20	11,528.52	-
301586	佳力奇	2024-08-21	6 个月	新发流通受限	18.09	53.14	215	3,889.35	11,425.10	-
688710	益诺思	2024-08-27	6 个月	新发流通受限	19.06	33.58	332	6,327.92	11,148.56	-
301617	博苑股份	2024-12-03	6 个月	新发流通受限	27.76	39.79	253	7,023.28	10,066.87	-
301603	乔锋智能	2024-07-03	6 个月	新发流通受限	26.50	41.98	233	6,174.50	9,781.34	-
301607	富特科技	2024-08-28	6 个月	新发流通受限	14.00	36.14	257	3,598.00	9,287.98	-
603194	中力股份	2024-12-17	6 个月	新发流通受限	20.32	28.13	291	5,913.12	8,185.83	-
301552	科力装备	2024-07-15	6 个月	新发流通受限	30.00	56.87	143	4,290.00	8,132.41	-
001279	强邦新材	2024-09-27	6 个月	新发流通受限	9.68	27.91	265	2,565.20	7,396.15	-
603395	红四方	2024-11-19	6 个月	新发流通受限	7.98	35.77	154	1,228.92	5,508.58	-
603207	小方制药	2024-08-19	6 个月	新发流通受限	12.47	26.65	185	2,306.95	4,930.25	-

603310	巍华新材	2024-08-07	6 个月	新发流通受限	17.39	17.95	254	4,417.06	4,559.30	-
603091	众鑫股份	2024-09-10	6 个月	新发流通受限	26.50	44.43	94	2,491.00	4,176.42	-
603350	安乃达	2024-06-26	6 个月	新发流通受限	20.56	36.17	106	2,179.36	3,834.02	-
603285	键邦股份	2024-06-28	6 个月	新发流通受限	18.65	22.61	129	2,405.85	2,916.69	-
603072	天和磁材	2024-12-24	6 个月	新发流通受限	12.30	12.30	226	2,779.80	2,779.80	-

注：①根据中国证监会《上市公司证券发行注册管理办法》，基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

②基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

③根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

④基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的设定限售期的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688139	海尔生物	2024-12-23	重大事项	35.20	2025-01-07	30.60	831,818	27,074,295.28	29,279,993.60	-

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的风险管理政策是使基金投资风险可测、可控、可承担。本基金管理人建立了由风险管理委员会、督察长、法律部、合规部、稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的多层次风险管理架构体系。风险管理团队在识别、衡量投资风险后，通过正式报告的方式，将分析结果及时传达给基金经理、投资总监、投资决策委员会和风险管理委员会，协助制定风险控制决策，实现风险管理目标。

本基金管理人主要通过定性分析和定量分析的方法，估测各种金融工具风险可能产生的损失。本基金管理人从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重性；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的金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型和日常的量化报告，参考压力测试结果，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时对各种风险进行监督、检查和评估，并制定相应决策，将风险控制在预期可承受的范围内。

##### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指由于基金所投资债券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息，债券发行人信用评级降低导致债券价格下降，或基金在交易过程中发生交收违约，而造成基金资产损失的可能性。

本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。

##### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是在市场或持有资产流动性不足的情况下，基金管理人可能无法迅速、低成本地调整基金投资组合，从而对基金收益造成不利影响。

除在“7.4.12 期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制的情况外，本基金所投资的证券均能及时变现。

##### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

在日常运作中，本基金的流动性安排能够与基金合同约定的申购赎回安排以及投资者的申购赎回规律相匹配。

在资产端，本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股，如需对组合进行调整时，由于投资标的流动性较好，市场冲击成本较小，基金投资组合收益偏离投资目标收益的风险较小。基金管

理人持续监测本基金持有资产的市场交易量、交易集中度等涉及资产流动性水平的风险指标，并定期开展压力测试，详细评估在不同的压力情景下资产变现情况的变化。

在负债端，基金管理人持续监测本基金投资者历史申赎、投资者类型和结构变化等数据，审慎评估不同市场环境可能带来的投资者潜在赎回需求，当市场环境或投资者结构发生变化时，及时调整组合资产结构，预留充足现金头寸，保持基金资产可变现规模和期限与负债赎回规模和期限的匹配。

如遭遇极端市场情形或投资者非预期巨额赎回情形，基金管理人将采用本基金合同约定的赎回申请处理方式及其他各类流动性风险管理工具，控制极端情况下的潜在流动性风险。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指由于市场变化或波动所引起的资产损失的可能性，本基金管理人通过监测组合敏感性指标来衡量市场风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率变动引起组合中资产特别是债券投资的市场价格变动，从而影响基金投资收益的风险。

本基金为指数型基金，采用完全复制策略。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。因此，利率风险不是本基金的主要风险。

##### 7.4.13.4.2 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。本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

##### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素（单个证券发行主体自身经营情况或证券市场整体波动）发生变动时导致基金资产发生损失的风险。

本基金为指数型基金，采用完全复制策略。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。本基金管理人通常用敏感性指标来衡量市场价格风险。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)

交易性金融资产—股票投资	28,401,449,959.68	98.91	7,443,229,666.23	99.31
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	2,002,538.08	0.03
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	28,401,449,959.68	98.91	7,445,232,204.31	99.34

注：①本表中交易性金融资产-债券投资科目仅包含可转换公司债券和可交换公司债券等。

②由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证 1000 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	-5%	-1,445,334,369.43	-376,453,802.38
	+5%	1,445,334,369.43	376,453,802.38

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	28,371,681,740.53	7,425,952,575.79
第二层次	29,307,730.10	18,192,842.12
第三层次	460,489.05	1,086,786.40
合计	28,401,449,959.68	7,445,232,204.31

###### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内证券涨跌停等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，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。本基金政策以导致各层次之间转换的事项发生日作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

#### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

##### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	1,086,786.40	1,086,786.40
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	1,069,720.75	1,069,720.75
转出第三层次	-	1,957,220.30	1,957,220.30
当期利得或损失总额	-	261,202.20	261,202.20
其中：计入损益的利得或损失	-	261,202.20	261,202.20
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	460,489.05	460,489.05
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	258,548.02	258,548.02
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	1,680,491.49	1,680,491.49
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	2,755,174.56	2,755,174.56
转出第三层次	-	3,855,031.62	3,855,031.62
当期利得或损失总额	-	506,151.97	506,151.97
其中：计入损益的利得或损失	-	506,151.97	506,151.97
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-

(若有)			
期末余额	-	1,086,786.40	1,086,786.40
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	53,452.46	53,452.46

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

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	460,489.05	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	0.3423-5.7444	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	1,086,786.40	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	0.1462-2.1988	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

截至 2024 年 12 月 31 日止，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

7.4.15 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。

## §8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	28,401,449,959.68	98.50
	其中：股票	28,401,449,959.68	98.50
2	基金投资	-	-

3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	285,762,148.57	0.99
8	其他各项资产	147,354,022.67	0.51
9	合计	28,834,566,130.92	100.00

注：股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	185,745,896.86	0.65
B	采矿业	695,592,985.91	2.42
C	制造业	18,438,850,421.59	64.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	787,638,889.49	2.74
E	建筑业	486,370,715.70	1.69
F	批发和零售业	879,257,887.01	3.06
G	交通运输、仓储和邮政业	914,840,436.42	3.19
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,337,946,768.69	11.62
J	金融业	797,950,966.43	2.78
K	房地产业	459,208,963.97	1.60
L	租赁和商务服务业	543,114,497.55	1.89
M	科学研究和技术服务业	225,438,255.61	0.79
N	水利、环境和公共设施管理业	220,072,730.82	0.77
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	92,009,633.64	0.32
R	文化、体育和娱乐业	337,456,174.59	1.18
S	综合	-	-
	合计	28,401,495,224.28	98.91

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

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

					值比例(%)
1	002456	欧菲光	14,646,900	175,469,862.00	0.61
2	002851	麦格米特	1,938,157	119,119,129.22	0.41
3	002130	沃尔核材	4,463,400	112,700,850.00	0.39
4	300757	罗博特科	479,780	108,104,029.60	0.38
5	688608	恒玄科技	322,223	104,841,697.51	0.37
6	002405	四维图新	10,517,450	101,388,218.00	0.35
7	600171	上海贝岭	2,515,200	99,803,136.00	0.35
8	300346	南大光电	2,553,649	98,545,314.91	0.34
9	688027	国盾量子	287,651	85,823,552.36	0.30
10	000528	柳工	7,032,831	84,815,941.86	0.30
11	688235	百济神州	514,713	82,879,087.26	0.29
12	603005	晶方科技	2,890,104	81,645,438.00	0.28
13	002837	英维克	1,967,992	79,506,876.80	0.28
14	600363	联创光电	1,612,706	77,216,363.28	0.27
15	300458	全志科技	1,966,511	76,221,966.36	0.27
16	001696	宗申动力	3,044,900	75,818,010.00	0.26
17	002139	拓邦股份	5,521,884	75,152,841.24	0.26
18	002402	和而泰	4,099,044	74,233,686.84	0.26
19	300623	捷捷微电	2,172,722	74,220,183.52	0.26
20	600100	同方股份	10,392,600	73,891,386.00	0.26
21	002312	川发龙蟒	5,020,000	72,639,400.00	0.25
22	000415	渤海租赁	19,178,900	72,304,453.00	0.25
23	300085	银之杰	1,879,900	71,906,175.00	0.25
24	300459	汤姆猫	12,457,300	71,504,902.00	0.25
25	300088	长信科技	10,876,000	71,129,040.00	0.25
26	605589	圣泉集团	3,001,900	70,784,802.00	0.25
27	300857	协创数据	652,600	69,756,414.00	0.24
28	002126	银轮股份	3,682,968	68,945,160.96	0.24
29	002583	海能达	4,823,400	68,540,514.00	0.24
30	600559	老白干酒	3,240,800	68,024,392.00	0.24
31	300679	电连技术	1,126,150	67,231,155.00	0.23
32	000766	通化金马	4,278,900	67,178,730.00	0.23
33	688347	华虹公司	1,445,338	67,164,856.86	0.23
34	300315	掌趣科技	12,098,700	66,542,850.00	0.23
35	601677	明泰铝业	5,508,860	66,271,585.80	0.23
36	688018	乐鑫科技	301,165	65,653,970.00	0.23
37	000099	中信海直	2,406,500	63,435,340.00	0.22
38	300068	南都电源	3,864,424	62,371,803.36	0.22
39	002400	省广集团	7,719,789	61,681,114.11	0.21
40	300077	国民技术	2,580,800	61,526,272.00	0.21
41	688568	中科星图	1,203,755	61,427,617.65	0.21
42	601777	千里科技	8,013,288	61,301,653.20	0.21
43	300627	华测导航	1,454,250	60,787,650.00	0.21

44	002497	雅化集团	5,105,500	59,734,350.00	0.21
45	300779	惠城环保	608,200	59,360,320.00	0.21
46	688116	天奈科技	1,527,381	59,277,656.61	0.21
47	688037	芯源微	708,239	59,230,027.57	0.21
48	300762	上海瀚讯	2,780,732	58,478,793.96	0.20
49	300115	长盈精密	3,594,500	58,374,680.00	0.20
50	300568	星源材质	5,951,400	57,847,608.00	0.20
51	300296	利亚德	8,962,806	57,720,470.64	0.20
52	300666	江丰电子	825,321	57,318,543.45	0.20
53	300229	拓尔思	2,707,250	56,689,815.00	0.20
54	688019	安集科技	404,635	56,389,933.60	0.20
55	600072	中船科技	4,005,300	56,274,465.00	0.20
56	002176	江特电机	7,560,652	56,024,431.32	0.20
57	603236	移远通信	813,924	55,704,958.56	0.19
58	002389	航天彩虹	3,083,000	55,648,150.00	0.19
59	300253	卫宁健康	7,751,500	55,500,740.00	0.19
60	300182	捷成股份	9,442,300	55,426,301.00	0.19
61	002506	协鑫集成	20,736,000	55,365,120.00	0.19
62	600577	精达股份	7,514,200	54,778,518.00	0.19
63	688343	云天励飞	1,101,112	54,615,155.20	0.19
64	002245	蔚蓝锂芯	5,102,514	54,545,874.66	0.19
65	300170	汉得信息	4,360,200	54,066,480.00	0.19
66	002222	福晶科技	1,666,110	53,981,964.00	0.19
67	601975	招商南油	17,202,600	53,844,138.00	0.19
68	002416	爱施德	3,285,600	53,456,712.00	0.19
69	688050	爱博医疗	582,564	53,030,800.92	0.18
70	601375	中原证券	12,222,800	52,802,496.00	0.18
71	002617	露笑科技	6,813,834	52,125,830.10	0.18
72	601333	广深铁路	15,028,600	51,548,098.00	0.18
73	002003	伟星股份	3,626,800	51,391,756.00	0.18
74	300570	太辰光	705,600	51,297,120.00	0.18
75	600323	瀚蓝环境	2,166,500	51,172,730.00	0.18
76	002151	北斗星通	1,928,100	51,171,774.00	0.18
77	688266	泽璟制药	817,942	50,965,966.02	0.18
78	002145	中核钛白	12,000,420	50,881,780.80	0.18
79	000875	吉电股份	9,641,000	50,711,660.00	0.18
80	600446	金证股份	2,935,800	50,613,192.00	0.18
81	300432	富临精工	3,244,415	49,899,102.70	0.17
82	605111	新洁能	1,469,928	49,845,258.48	0.17
83	600388	龙净环保	3,938,700	49,824,555.00	0.17
84	300738	奥飞数据	3,418,861	49,573,484.50	0.17
85	000686	东北证券	6,220,600	49,391,564.00	0.17
86	300045	华力创通	2,349,200	49,074,788.00	0.17
87	601528	瑞丰银行	8,689,910	48,924,193.30	0.17

88	300674	宇信科技	2,497,340	48,748,076.80	0.17
89	600761	安徽合力	2,761,700	48,744,005.00	0.17
90	000628	高新发展	782,400	48,735,696.00	0.17
91	002075	沙钢股份	7,773,600	48,662,736.00	0.17
92	600601	方正科技	11,083,800	48,657,882.00	0.17
93	000581	威孚高科	2,559,300	48,319,584.00	0.17
94	603083	剑桥科技	1,188,100	48,236,860.00	0.17
95	600331	宏达股份	6,302,742	48,026,894.04	0.17
96	300083	创世纪	7,375,127	48,012,076.77	0.17
97	300181	佐力药业	3,109,200	47,757,312.00	0.17
98	300735	光弘科技	1,699,600	47,571,804.00	0.17
99	002807	江阴银行	10,904,432	47,434,279.20	0.17
100	600216	浙江医药	2,983,900	47,324,654.00	0.16
101	688208	道通科技	1,201,089	47,034,645.24	0.16
102	002484	江海股份	2,634,700	46,318,026.00	0.16
103	002698	博实股份	2,716,700	46,183,900.00	0.16
104	002936	郑州银行	21,925,965	46,044,526.50	0.16
105	600908	无锡银行	7,783,053	45,997,843.23	0.16
106	300035	中科电气	3,037,819	45,415,394.05	0.16
107	600718	东软集团	4,209,200	45,333,084.00	0.16
108	600186	莲花控股	7,951,200	45,321,840.00	0.16
109	000681	视觉中国	2,171,100	45,202,302.00	0.16
110	600667	太极实业	6,530,100	45,188,292.00	0.16
111	601222	林洋能源	6,391,001	45,184,377.07	0.16
112	600602	云赛智联	2,856,151	45,184,308.82	0.16
113	300672	国科微	674,300	45,009,525.00	0.16
114	002701	奥瑞金	7,936,200	44,998,254.00	0.16
115	000860	顺鑫农业	2,300,500	44,790,735.00	0.16
116	000970	中科三环	4,311,030	44,705,381.10	0.16
117	002036	联创电子	4,735,610	44,514,734.00	0.16
118	600285	羚锐制药	2,007,600	44,488,416.00	0.15
119	688327	云从科技	3,675,377	44,472,061.70	0.15
120	600728	佳都科技	9,499,500	44,457,660.00	0.15
121	000917	电广传媒	6,278,900	44,391,823.00	0.15
122	600133	东湖高新	4,725,900	44,187,165.00	0.15
123	000951	中国重汽	2,599,940	44,146,981.20	0.15
124	300777	中简科技	1,556,900	44,044,701.00	0.15
125	002249	大洋电机	7,494,300	43,991,541.00	0.15
126	300773	拉卡拉	2,482,900	43,947,330.00	0.15
127	600562	国睿科技	2,200,204	43,850,065.72	0.15
128	300438	鹏辉能源	1,559,400	43,834,734.00	0.15
129	002428	云南锗业	2,315,041	43,754,274.90	0.15
130	300101	振芯科技	2,009,700	43,530,102.00	0.15
131	688183	生益电子	1,105,374	43,396,983.24	0.15

132	600850	电科数字	1,815,272	43,385,000.80	0.15
133	300624	万兴科技	686,264	43,337,571.60	0.15
134	600452	涪陵电力	4,085,868	43,269,342.12	0.15
135	600338	西藏珠峰	4,051,300	43,227,371.00	0.15
136	000690	宝新能源	9,638,900	43,182,272.00	0.15
137	002747	埃斯顿	2,311,126	42,755,831.00	0.15
138	300303	聚飞光电	6,237,500	42,539,750.00	0.15
139	300133	华策影视	5,891,700	42,538,074.00	0.15
140	300775	三角防务	1,706,233	42,536,388.69	0.15
141	000422	湖北宜化	3,357,600	42,372,912.00	0.15
142	600120	浙江东方	9,079,471	42,310,334.86	0.15
143	600641	万业企业	2,886,800	42,205,016.00	0.15
144	601137	博威合金	2,076,700	42,157,010.00	0.15
145	688318	财富趋势	245,524	41,984,604.00	0.15
146	688676	金盘科技	1,012,207	41,925,613.94	0.15
147	000829	天音控股	3,177,000	41,872,860.00	0.15
148	603871	嘉友国际	2,163,728	41,868,136.80	0.15
149	300827	上能电气	953,418	41,855,050.20	0.15
150	300525	博思软件	2,678,774	41,735,298.92	0.15
151	600064	南京高科	5,364,080	41,678,901.60	0.15
152	600877	电科芯片	3,145,700	41,491,783.00	0.14
153	688408	中信博	575,534	41,438,448.00	0.14
154	603766	隆鑫通用	4,549,400	41,399,540.00	0.14
155	002335	科华数据	1,428,968	41,325,754.56	0.14
156	600206	有研新材	2,623,543	41,110,918.81	0.14
157	688088	虹软科技	1,065,809	41,097,595.04	0.14
158	688322	奥比中光	883,725	41,093,212.50	0.14
159	300348	长亮科技	2,864,944	40,968,699.20	0.14
160	300638	广和通	2,032,734	40,959,590.10	0.14
161	000627	天茂集团	8,757,000	40,895,190.00	0.14
162	600771	广誉远	2,167,800	40,884,708.00	0.14
163	688484	南芯科技	1,131,000	40,761,240.00	0.14
164	605090	九丰能源	1,425,620	40,672,938.60	0.14
165	300294	博雅生物	1,342,305	40,644,995.40	0.14
166	600864	哈投股份	5,529,600	40,642,560.00	0.14
167	000810	创维数字	2,548,400	40,570,528.00	0.14
168	600399	抚顺特钢	6,986,900	40,524,020.00	0.14
169	603300	海南华铁	6,986,633	40,382,738.74	0.14
170	603662	柯力传感	624,560	40,346,576.00	0.14
171	300811	铂科新材	747,662	40,306,458.42	0.14
172	002270	华明装备	2,382,800	40,245,492.00	0.14
173	002745	木林森	4,602,900	40,137,288.00	0.14
174	000620	新华联	18,213,700	39,888,003.00	0.14
175	002221	东华能源	4,190,800	39,770,692.00	0.14

176	000762	西藏矿业	1,848,474	39,742,191.00	0.14
177	000543	皖能电力	5,020,089	39,708,903.99	0.14
178	001301	尚太科技	578,100	39,628,755.00	0.14
179	688166	博瑞医药	1,310,557	39,578,821.40	0.14
180	002396	星网锐捷	2,083,800	39,571,362.00	0.14
181	600986	浙文互联	6,592,971	39,425,966.58	0.14
182	002354	天娱数科	7,327,900	39,350,823.00	0.14
183	600246	万通发展	5,280,000	39,336,000.00	0.14
184	300180	华峰超纤	6,241,000	39,318,300.00	0.14
185	300783	三只松鼠	1,065,000	39,266,550.00	0.14
186	603063	禾望电气	1,966,412	39,249,583.52	0.14
187	301050	雷电微力	760,850	39,244,643.00	0.14
188	300657	弘信电子	1,730,900	39,222,194.00	0.14
189	300456	赛微电子	2,270,100	39,000,318.00	0.14
190	002063	远光软件	6,750,949	38,885,466.24	0.14
191	000801	四川九洲	2,716,900	38,878,839.00	0.14
192	300409	道氏技术	2,856,500	38,876,965.00	0.14
193	600827	百联股份	3,555,800	38,864,894.00	0.14
194	600330	天通股份	5,468,379	38,825,490.90	0.14
195	002544	普天科技	1,809,860	38,785,299.80	0.14
196	600621	华鑫股份	2,351,050	38,745,304.00	0.13
197	000680	山推股份	3,987,900	38,682,630.00	0.13
198	300298	三诺生物	1,497,800	38,658,218.00	0.13
199	300776	帝尔激光	605,160	38,476,072.80	0.13
200	300319	麦捷科技	3,082,200	38,465,856.00	0.13
201	002123	梦网科技	3,547,100	38,344,151.00	0.13
202	002127	南极电商	8,701,700	38,287,480.00	0.13
203	600821	金开新能	7,077,000	38,215,800.00	0.13
204	600552	凯盛科技	3,347,600	38,196,116.00	0.13
205	000503	国新健康	3,477,820	38,186,463.60	0.13
206	000682	东方电子	3,565,168	38,182,949.28	0.13
207	600635	大众公用	8,574,100	38,154,745.00	0.13
208	300075	数字政通	2,200,180	38,063,114.00	0.13
209	301078	孩子王	3,343,300	38,046,754.00	0.13
210	688200	华峰测控	363,542	37,990,139.00	0.13
211	600750	江中药业	1,672,204	37,959,030.80	0.13
212	002174	游族网络	4,058,274	37,944,861.90	0.13
213	300166	东方国信	4,035,500	37,933,700.00	0.13
214	000676	智度股份	4,483,500	37,930,410.00	0.13
215	688333	铂力特	961,629	37,917,031.47	0.13
216	002839	张家港行	8,658,960	37,839,655.20	0.13
217	000035	中国天楹	7,757,844	37,780,700.28	0.13
218	300130	新国都	1,735,400	37,588,764.00	0.13
219	601126	四方股份	2,215,071	37,567,604.16	0.13

220	603920	世运电路	1,276,350	37,524,690.00	0.13
221	300379	东方通	2,473,580	37,326,322.20	0.13
222	300598	诚迈科技	770,841	37,308,704.40	0.13
223	600422	昆药集团	2,348,500	37,223,725.00	0.13
224	603678	火炬电子	1,219,300	37,188,650.00	0.13
225	300049	福瑞股份	1,178,702	37,176,261.08	0.13
226	600179	安通控股	13,129,200	37,155,636.00	0.13
227	600572	康恩贝	7,971,100	37,145,326.00	0.13
228	300036	超图软件	2,182,010	37,050,529.80	0.13
229	601860	紫金银行	12,981,300	36,996,705.00	0.13
230	300327	中颖电子	1,510,104	36,952,244.88	0.13
231	603283	赛腾股份	532,200	36,806,952.00	0.13
232	600596	新安股份	4,187,840	36,769,235.20	0.13
233	002317	众生药业	3,019,622	36,688,407.30	0.13
234	601020	华钰矿业	2,907,100	36,687,602.00	0.13
235	603306	华懋科技	1,157,120	36,576,563.20	0.13
236	603565	中谷物流	3,719,989	36,455,892.20	0.13
237	688596	正帆科技	1,023,784	36,395,521.20	0.13
238	688141	杰华特	1,188,426	36,377,719.86	0.13
239	002948	青岛银行	9,375,600	36,377,328.00	0.13
240	002654	万润科技	2,996,700	36,349,971.00	0.13
241	688016	心脉医疗	330,856	36,344,531.60	0.13
242	000969	安泰科技	3,256,900	36,314,435.00	0.13
243	300236	上海新阳	970,000	36,248,900.00	0.13
244	000902	新洋丰	2,778,120	36,226,684.80	0.13
245	000685	中山公用	3,920,200	36,183,446.00	0.13
246	600456	宝钛股份	1,271,425	36,172,041.25	0.13
247	300113	顺网科技	2,151,731	36,170,598.11	0.13
248	002183	怡亚通	8,054,200	36,163,358.00	0.13
249	600185	格力地产	5,010,199	36,023,330.81	0.13
250	603881	数据港	1,590,387	36,022,265.55	0.13
251	688498	源杰科技	267,626	35,915,409.20	0.13
252	600587	新华医疗	2,149,200	35,784,180.00	0.12
253	002239	奥特佳	11,727,700	35,769,485.00	0.12
254	002906	华阳集团	1,162,271	35,739,833.25	0.12
255	002675	东诚药业	2,923,100	35,720,282.00	0.12
256	601778	晶科科技	12,659,100	35,698,662.00	0.12
257	300576	容大感光	788,000	35,601,840.00	0.12
258	600210	紫江企业	5,373,200	35,516,852.00	0.12
259	688582	芯动联科	705,863	35,511,967.53	0.12
260	300663	科蓝软件	2,044,800	35,497,728.00	0.12
261	300185	通裕重工	13,812,300	35,497,611.00	0.12
262	600420	国药现代	2,972,410	35,490,575.40	0.12
263	600151	航天机电	4,447,439	35,490,563.22	0.12

264	301171	易点天下	1,255,200	35,384,088.00	0.12
265	600114	东睦股份	2,184,000	35,315,280.00	0.12
266	300026	红日药业	9,312,300	35,293,617.00	0.12
267	600633	浙数文化	3,370,700	35,257,522.00	0.12
268	600595	中孚实业	12,434,700	35,190,201.00	0.12
269	688289	圣湘生物	1,547,903	35,137,398.10	0.12
270	002315	焦点科技	840,200	35,019,536.00	0.12
271	002215	诺普信	3,114,060	34,970,893.80	0.12
272	688409	富创精密	677,999	34,964,408.43	0.12
273	600993	马应龙	1,338,900	34,958,679.00	0.12
274	002681	奋达科技	5,597,700	34,929,648.00	0.12
275	002332	仙琚制药	3,506,700	34,856,598.00	0.12
276	600269	赣粤高速	6,208,100	34,827,441.00	0.12
277	600428	中远海特	4,757,600	34,730,480.00	0.12
278	300475	香农芯创	1,217,000	34,672,330.00	0.12
279	300087	荃银高科	2,938,138	34,670,028.40	0.12
280	002182	宝武镁业	3,072,165	34,654,021.20	0.12
281	600320	振华重工	8,834,340	34,630,612.80	0.12
282	002597	金禾实业	1,513,100	34,544,073.00	0.12
283	603323	苏农银行	6,506,900	34,421,501.00	0.12
284	600273	嘉化能源	4,317,600	34,411,272.00	0.12
285	601678	滨化股份	9,119,400	34,288,944.00	0.12
286	300109	新开源	2,145,975	34,228,301.25	0.12
287	300079	数码视讯	6,324,600	34,216,086.00	0.12
288	002020	京新药业	2,668,380	34,155,264.00	0.12
289	688110	东芯股份	1,371,513	34,150,673.70	0.12
290	603393	新天然气	1,126,920	34,111,868.40	0.12
291	600201	生物股份	4,968,100	34,081,166.00	0.12
292	688029	南微医学	504,214	34,079,824.26	0.12
293	300284	苏交科	3,356,048	34,063,887.20	0.12
294	000429	粤高速 A	2,315,600	34,039,320.00	0.12
295	002292	奥飞娱乐	3,929,929	33,993,885.85	0.12
296	600123	兰花科创	3,947,830	33,793,424.80	0.12
297	603108	润达医疗	2,121,300	33,792,309.00	0.12
298	002212	天融信	5,225,400	33,703,830.00	0.12
299	002171	楚江新材	4,107,700	33,683,140.00	0.12
300	600461	洪城环境	3,382,500	33,655,875.00	0.12
301	002015	协鑫能科	4,318,099	33,508,448.24	0.12
302	000727	冠捷科技	12,040,500	33,472,590.00	0.12
303	600759	洲际油气	14,710,850	33,393,629.50	0.12
304	300678	中科信息	916,736	33,341,688.32	0.12
305	601718	际华集团	11,672,400	33,149,616.00	0.12
306	688503	聚和材料	746,936	33,081,795.44	0.12
307	300457	赢合科技	1,725,716	33,030,204.24	0.12

308	601187	厦门银行	5,847,700	32,981,028.00	0.11
309	002541	鸿路钢构	1,835,050	32,902,446.50	0.11
310	601519	大智慧	3,552,800	32,863,400.00	0.11
311	688279	峰昭科技	206,599	32,580,662.30	0.11
312	002351	漫步者	1,972,000	32,538,000.00	0.11
313	002832	比音勒芬	1,515,077	32,437,798.57	0.11
314	300618	寒锐钴业	958,200	32,358,414.00	0.11
315	002567	唐人神	6,343,100	32,349,810.00	0.11
316	002488	金固股份	3,088,700	32,246,028.00	0.11
317	002421	达实智能	9,391,500	32,212,845.00	0.11
318	300027	华谊兄弟	12,288,867	32,196,831.54	0.11
319	600037	歌华有线	4,314,400	32,185,424.00	0.11
320	300685	艾德生物	1,409,506	32,136,736.80	0.11
321	000012	南玻 A	6,085,898	32,133,541.44	0.11
322	600057	厦门象屿	4,950,400	32,128,096.00	0.11
323	603997	继峰股份	2,804,469	32,111,170.05	0.11
324	600916	中国黄金	3,724,800	32,107,776.00	0.11
325	300034	钢研高纳	2,057,820	32,101,992.00	0.11
326	600550	保变电气	4,080,600	32,032,710.00	0.11
327	600967	内蒙一机	3,768,100	32,028,850.00	0.11
328	600645	中源协和	1,658,200	32,003,260.00	0.11
329	002265	建设工业	1,373,800	31,968,326.00	0.11
330	301297	富乐德	751,199	31,925,957.50	0.11
331	002773	康弘药业	1,628,260	31,913,896.00	0.11
332	603505	金石资源	1,341,749	31,853,121.26	0.11
333	002004	华邦健康	7,018,687	31,724,465.24	0.11
334	002100	天康生物	4,840,500	31,705,275.00	0.11
335	002091	江苏国泰	4,329,600	31,692,672.00	0.11
336	002668	TCL 智家	2,402,100	31,515,552.00	0.11
337	300188	国投智能	2,284,600	31,504,634.00	0.11
338	000420	吉林化纤	8,716,000	31,464,760.00	0.11
339	002649	博彦科技	2,590,600	31,398,072.00	0.11
340	000089	深圳机场	4,542,400	31,297,136.00	0.11
341	600717	天津港	6,412,800	31,230,336.00	0.11
342	000062	深圳华强	1,392,500	31,192,000.00	0.11
343	601963	重庆银行	3,358,981	31,171,343.68	0.11
344	600267	海正药业	3,743,965	31,074,909.50	0.11
345	603398	沐邦高科	1,346,940	30,993,089.40	0.11
346	603220	中贝通信	1,347,960	30,962,641.20	0.11
347	688702	盛科通信	366,836	30,814,224.00	0.11
348	300910	瑞丰新材	646,932	30,787,493.88	0.11
349	600328	中盐化工	3,911,770	30,785,629.90	0.11
350	300655	晶瑞电材	3,284,324	30,741,272.64	0.11
351	002011	盾安环境	2,831,784	30,611,585.04	0.11

352	002706	良信股份	3,975,340	30,530,611.20	0.11
353	000758	中色股份	6,179,000	30,524,260.00	0.11
354	002276	万马股份	3,596,400	30,425,544.00	0.11
355	688362	甬矽电子	902,540	30,397,547.20	0.11
356	688063	派能科技	757,350	30,331,867.50	0.11
357	002847	盐津铺子	482,516	30,205,501.60	0.11
358	603690	至纯科技	1,198,500	30,094,335.00	0.10
359	688076	诺泰生物	578,926	30,057,837.92	0.10
360	000712	锦龙股份	1,987,100	30,044,952.00	0.10
361	600252	中恒集团	12,177,100	29,955,666.00	0.10
362	603699	纽威股份	1,350,478	29,940,097.26	0.10
363	600248	陕建股份	6,676,400	29,910,272.00	0.10
364	300613	富瀚微	510,718	29,877,003.00	0.10
365	300323	华灿光电	3,596,700	29,780,676.00	0.10
366	300693	盛弘股份	1,101,979	29,709,353.84	0.10
367	002643	万润股份	2,473,800	29,685,600.00	0.10
368	603308	应流股份	2,104,400	29,672,040.00	0.10
369	002716	湖南白银	8,751,500	29,667,585.00	0.10
370	600409	三友化工	5,486,100	29,624,940.00	0.10
371	600116	三峡水利	4,238,100	29,624,319.00	0.10
372	000156	华数传媒	4,105,500	29,559,600.00	0.10
373	300398	飞凯材料	1,875,200	29,553,152.00	0.10
374	002895	川恒股份	1,200,900	29,542,140.00	0.10
375	688548	广钢气体	2,924,120	29,445,888.40	0.10
376	002079	苏州固锝	2,864,035	29,413,639.45	0.10
377	300682	朗新集团	2,405,400	29,345,880.00	0.10
378	000795	英洛华	3,014,458	29,330,676.34	0.10
379	300641	正丹股份	1,180,100	29,313,684.00	0.10
380	002539	云图控股	3,747,200	29,303,104.00	0.10
381	688139	海尔生物	831,818	29,279,993.60	0.10
382	002192	融捷股份	917,863	29,279,829.70	0.10
383	300415	伊之密	1,456,101	29,209,386.06	0.10
384	603599	广信股份	2,421,287	29,176,508.35	0.10
385	301039	中集车辆	3,223,623	29,173,788.15	0.10
386	600556	天下秀	5,606,000	29,151,200.00	0.10
387	688798	艾为电子	416,349	29,069,487.18	0.10
388	000811	冰轮环境	2,368,617	29,039,244.42	0.10
389	000555	神州信息	2,590,600	29,014,720.00	0.10
390	688123	聚辰股份	492,972	28,848,721.44	0.10
391	688262	国芯科技	1,041,194	28,841,073.80	0.10
392	300747	锐科激光	1,499,250	28,725,630.00	0.10
393	300482	万孚生物	1,281,000	28,707,210.00	0.10
394	688766	普冉股份	283,474	28,704,577.24	0.10
395	000650	仁和药业	4,959,800	28,568,448.00	0.10

396	000657	中钨高新	3,095,958	28,513,773.18	0.10
397	001309	德明利	326,984	28,513,004.80	0.10
398	600729	重庆百货	974,400	28,501,200.00	0.10
399	300761	立华股份	1,464,180	28,492,942.80	0.10
400	300357	我武生物	1,394,200	28,330,144.00	0.10
401	603588	高能环境	5,402,000	28,306,480.00	0.10
402	600894	广日股份	1,938,200	28,297,720.00	0.10
403	603039	泛微网络	577,400	28,292,600.00	0.10
404	002458	益生股份	2,941,800	28,270,698.00	0.10
405	600055	万东医疗	1,870,600	28,246,060.00	0.10
406	600933	爱柯迪	1,732,400	28,238,120.00	0.10
407	002324	普利特	2,962,240	28,230,147.20	0.10
408	000927	中国铁物	10,720,900	28,195,967.00	0.10
409	002061	浙江交科	6,909,360	28,190,188.80	0.10
410	600266	城建发展	5,516,644	28,134,884.40	0.10
411	600158	中体产业	3,401,031	28,126,526.37	0.10
412	300633	开立医疗	956,650	28,115,943.50	0.10
413	000923	河钢资源	2,021,626	28,100,601.40	0.10
414	688332	中科蓝讯	215,280	28,094,040.00	0.10
415	002010	传化智联	6,174,600	27,970,938.00	0.10
416	600782	新钢股份	8,361,000	27,925,740.00	0.10
417	300470	中密控股	739,452	27,877,340.40	0.10
418	688083	中望软件	325,600	27,861,592.00	0.10
419	301029	怡合达	1,123,500	27,772,920.00	0.10
420	600459	贵研铂业	2,019,957	27,734,009.61	0.10
421	603619	中曼石油	1,431,300	27,709,968.00	0.10
422	301293	三博脑科	639,433	27,674,660.24	0.10
423	600664	哈药股份	6,699,653	27,669,566.89	0.10
424	603027	千禾味业	2,276,828	27,572,387.08	0.10
425	600509	天富能源	4,260,500	27,565,435.00	0.10
426	603218	日月股份	2,283,500	27,516,175.00	0.10
427	000821	京山轻机	2,206,800	27,474,660.00	0.10
428	002468	申通快递	2,711,300	27,465,469.00	0.10
429	603279	景津装备	1,530,815	27,370,972.20	0.10
430	600012	皖通高速	1,547,800	27,318,670.00	0.10
431	002048	宁波华翔	2,162,819	27,294,775.78	0.10
432	688629	华丰科技	813,922	27,258,247.78	0.09
433	000735	罗牛山	4,081,201	27,180,798.66	0.09
434	000901	航天科技	2,477,234	27,175,256.98	0.09
435	300352	北信源	5,138,400	27,130,752.00	0.09
436	600480	凌云股份	2,502,500	27,052,025.00	0.09
437	600575	淮河能源	6,791,400	26,961,858.00	0.09
438	603496	恒为科技	991,700	26,954,406.00	0.09
439	300031	宝通科技	1,470,497	26,939,505.04	0.09

440	300593	新雷能	2,404,522	26,930,646.40	0.09
441	300224	正海磁材	2,179,300	26,827,183.00	0.09
442	300620	光库科技	551,800	26,817,480.00	0.09
443	688789	宏华数科	401,398	26,644,799.24	0.09
444	002023	海特高新	2,623,450	26,628,017.50	0.09
445	601369	陕鼓动力	3,060,400	26,625,480.00	0.09
446	002006	精工科技	1,610,600	26,574,900.00	0.09
447	002446	盛路通信	4,055,600	26,564,180.00	0.09
448	300232	洲明科技	3,865,800	26,558,046.00	0.09
449	002737	葵花药业	1,295,090	26,536,394.10	0.09
450	002726	龙大美食	3,345,268	26,494,522.56	0.09
451	600211	西藏药业	715,487	26,430,089.78	0.09
452	002043	兔宝宝	2,211,000	26,266,680.00	0.09
453	300123	亚光科技	4,525,700	26,249,060.00	0.09
454	600017	日照港	8,178,600	26,171,520.00	0.09
455	300634	彩讯股份	1,199,700	26,153,460.00	0.09
456	600006	东风股份	3,545,400	26,129,598.00	0.09
457	600063	皖维高新	6,530,200	26,120,800.00	0.09
458	600597	光明乳业	3,055,900	26,097,386.00	0.09
459	000552	甘肃能化	9,487,200	26,089,800.00	0.09
460	603358	华达科技	780,100	26,055,340.00	0.09
461	600138	中青旅	2,568,500	26,044,590.00	0.09
462	603267	鸿远电子	718,100	26,016,763.00	0.09
463	603337	杰克股份	853,500	25,997,610.00	0.09
464	600888	新疆众和	3,660,900	25,992,390.00	0.09
465	002099	海翔药业	5,019,200	25,899,072.00	0.09
466	601311	骆驼股份	3,121,400	25,876,406.00	0.09
467	605507	国邦医药	1,239,000	25,808,370.00	0.09
468	600757	长江传媒	2,687,200	25,716,504.00	0.09
469	002237	恒邦股份	2,545,600	25,710,560.00	0.09
470	600094	大名城	7,063,214	25,710,098.96	0.09
471	002326	永太科技	2,869,900	25,656,906.00	0.09
472	600835	上海机电	1,427,200	25,575,424.00	0.09
473	688352	颀中科技	2,108,313	25,573,836.69	0.09
474	600502	安徽建工	5,325,900	25,457,802.00	0.09
475	002226	江南化工	4,695,280	25,448,417.60	0.09
476	000913	钱江摩托	1,402,275	25,254,972.75	0.09
477	002761	浙江建投	2,874,500	25,238,110.00	0.09
478	000028	国药一致	862,680	25,233,390.00	0.09
479	002081	金螳螂	7,060,100	25,204,557.00	0.09
480	002254	泰和新材	2,675,410	25,148,854.00	0.09
481	600315	上海家化	1,487,100	25,146,861.00	0.09
482	300244	迪安诊断	2,214,300	25,132,305.00	0.09
483	301071	力量钻石	692,947	25,119,328.75	0.09

484	600059	古越龙山	2,827,000	25,103,760.00	0.09
485	300463	迈克生物	1,901,130	25,094,916.00	0.09
486	000848	承德露露	2,797,200	25,090,884.00	0.09
487	600366	宁波韵升	3,408,700	25,088,032.00	0.09
488	002993	奥海科技	611,662	25,078,142.00	0.09
489	600971	恒源煤电	2,656,643	24,999,010.63	0.09
490	002097	山河智能	3,331,600	24,987,000.00	0.09
491	600649	城投控股	5,603,164	24,934,079.80	0.09
492	600507	方大特钢	6,148,500	24,901,425.00	0.09
493	600586	金晶科技	4,430,200	24,897,724.00	0.09
494	603197	保隆科技	658,600	24,862,150.00	0.09
495	600259	广晟有色	892,100	24,809,301.00	0.09
496	300772	运达股份	1,866,914	24,717,941.36	0.09
497	300602	飞荣达	1,285,959	24,716,131.98	0.09
498	300446	航天智造	1,495,700	24,694,007.00	0.09
499	300770	新媒股份	609,300	24,621,813.00	0.09
500	600110	诺德股份	6,149,516	24,598,064.00	0.09
501	300451	创业慧康	5,488,610	24,588,972.80	0.09
502	600787	中储股份	3,853,500	24,585,330.00	0.09
503	603100	川仪股份	1,137,400	24,510,970.00	0.09
504	002163	海南发展	2,618,034	24,478,617.90	0.09
505	000737	北方铜业	3,138,100	24,477,180.00	0.09
506	002815	崇达技术	2,396,145	24,440,679.00	0.09
507	300260	新莱应材	900,736	24,400,938.24	0.08
508	002605	姚记科技	914,800	24,388,568.00	0.08
509	601200	上海环境	2,983,800	24,377,646.00	0.08
510	600478	科力远	5,900,306	24,368,263.78	0.08
511	601702	华峰铝业	1,329,100	24,349,112.00	0.08
512	002233	塔牌集团	3,167,200	24,292,424.00	0.08
513	301291	明阳电气	553,023	24,288,770.16	0.08
514	000928	中钢国际	3,811,600	24,279,892.00	0.08
515	600395	盘江股份	4,757,600	24,216,184.00	0.08
516	301035	润丰股份	496,700	24,199,224.00	0.08
517	603281	江瀚新材	991,080	24,182,352.00	0.08
518	688127	蓝特光学	890,864	24,142,414.40	0.08
519	300393	中来股份	3,860,460	24,127,875.00	0.08
520	600125	铁龙物流	4,049,800	24,015,314.00	0.08
521	300151	昌红科技	1,412,400	24,010,800.00	0.08
522	000049	德赛电池	1,021,080	24,005,590.80	0.08
523	000837	秦川机床	2,676,100	24,004,617.00	0.08
524	601900	南方传媒	1,586,600	23,973,526.00	0.08
525	688575	亚辉龙	1,516,759	23,964,792.20	0.08
526	601952	苏垦农发	2,438,900	23,876,831.00	0.08
527	000582	北部湾港	3,028,618	23,865,509.84	0.08

528	601028	玉龙股份	2,079,800	23,834,508.00	0.08
529	300725	药石科技	708,880	23,818,368.00	0.08
530	600866	星湖科技	3,677,900	23,796,013.00	0.08
531	000090	天健集团	5,789,700	23,795,667.00	0.08
532	002038	双鹭药业	3,183,000	23,777,010.00	0.08
533	002219	新里程	9,002,700	23,767,128.00	0.08
534	688739	成大生物	920,518	23,730,954.04	0.08
535	600776	东方通信	2,116,400	23,682,516.00	0.08
536	002214	大立科技	2,122,234	23,662,909.10	0.08
537	600033	福建高速	6,083,700	23,604,756.00	0.08
538	301219	腾远钴业	521,791	23,590,171.11	0.08
539	600305	恒顺醋业	2,949,118	23,533,961.64	0.08
540	688321	微芯生物	1,265,530	23,513,547.40	0.08
541	002390	信邦制药	5,166,300	23,506,665.00	0.08
542	688100	威胜信息	648,883	23,489,564.60	0.08
543	000915	华特达因	832,949	23,472,502.82	0.08
544	600623	华谊集团	3,346,100	23,422,700.00	0.08
545	600458	时代新材	1,827,600	23,411,556.00	0.08
546	003021	兆威机电	316,669	23,405,005.79	0.08
547	603866	桃李面包	3,545,300	23,398,980.00	0.08
548	300705	九典制药	1,302,880	23,386,696.00	0.08
549	600869	远东股份	4,914,804	23,345,319.00	0.08
550	688403	汇成股份	2,600,153	23,297,370.88	0.08
551	002891	中宠股份	652,200	23,283,540.00	0.08
552	002635	安洁科技	1,458,800	23,224,096.00	0.08
553	002518	科士达	1,030,500	23,217,165.00	0.08
554	603033	三维股份	1,828,759	23,206,951.71	0.08
555	601890	亚星锚链	2,976,846	23,189,630.34	0.08
556	300687	赛意信息	1,273,120	23,170,784.00	0.08
557	688270	臻镭科技	659,309	23,075,815.00	0.08
558	301095	广立微	442,300	23,030,561.00	0.08
559	600996	贵广网络	2,680,800	22,920,840.00	0.08
560	300363	博腾股份	1,452,901	22,912,248.77	0.08
561	600740	山西焦化	5,676,020	22,874,360.60	0.08
562	000930	中粮科技	4,119,900	22,865,445.00	0.08
563	300119	瑞普生物	1,239,177	22,763,681.49	0.08
564	300726	宏达电子	731,400	22,746,540.00	0.08
565	688779	五矿新能	4,275,245	22,744,303.40	0.08
566	600773	西藏城投	2,106,500	22,708,070.00	0.08
567	300841	康华生物	416,086	22,685,008.72	0.08
568	688192	迪哲医药	546,842	22,677,537.74	0.08
569	600976	健民集团	543,500	22,653,080.00	0.08
570	600313	农发种业	3,355,900	22,652,325.00	0.08
571	002077	大港股份	1,540,700	22,602,069.00	0.08

572	301316	慧博云通	883,359	22,587,489.63	0.08
573	600675	中华企业	8,037,400	22,585,094.00	0.08
574	688326	经纬恒润	268,363	22,569,328.30	0.08
575	300226	上海钢联	986,700	22,565,829.00	0.08
576	600490	鹏欣资源	6,858,700	22,565,123.00	0.08
577	601500	通用股份	4,227,500	22,532,575.00	0.08
578	300171	东富龙	1,696,100	22,524,208.00	0.08
579	688400	凌云光	1,025,760	22,484,659.20	0.08
580	688559	海目星	650,928	22,391,923.20	0.08
581	603128	华贸物流	3,480,700	22,380,901.00	0.08
582	688388	嘉元科技	1,511,205	22,260,049.65	0.08
583	600169	太原重工	8,934,700	22,247,403.00	0.08
584	603368	柳药集团	1,238,600	22,121,396.00	0.08
585	688091	上海谊众	552,294	22,047,576.48	0.08
586	600389	江山股份	1,524,725	22,032,276.25	0.08
587	603026	石大胜华	629,208	22,022,280.00	0.08
588	000603	盛达资源	1,835,200	22,004,048.00	0.08
589	000966	长源电力	4,627,000	21,978,250.00	0.08
590	002928	华夏航空	2,831,200	21,970,112.00	0.08
591	603713	密尔克卫	428,884	21,958,860.80	0.08
592	688612	威迈斯	930,600	21,906,324.00	0.08
593	688522	纳睿雷达	387,475	21,830,341.50	0.08
594	002777	久远银海	1,267,010	21,817,912.20	0.08
595	603328	依顿电子	2,211,300	21,803,418.00	0.08
596	688106	金宏气体	1,281,051	21,790,677.51	0.08
597	300596	利安隆	713,357	21,757,388.50	0.08
598	603305	旭升集团	1,653,400	21,742,210.00	0.08
599	000065	北方国际	2,219,513	21,706,837.14	0.08
600	600531	豫光金铅	3,381,100	21,706,662.00	0.08
601	600197	伊力特	1,255,950	21,665,137.50	0.08
602	688556	高测股份	1,937,637	21,662,781.66	0.08
603	300660	江苏雷利	565,800	21,624,876.00	0.08
604	002925	盈趣科技	1,379,800	21,607,668.00	0.08
605	300820	英杰电气	390,911	21,597,832.75	0.08
606	002243	力合科创	2,679,400	21,595,964.00	0.08
607	600710	苏美达	2,316,400	21,542,520.00	0.08
608	002705	新宝股份	1,436,011	21,540,165.00	0.08
609	000550	江铃汽车	917,700	21,520,065.00	0.07
610	688696	极米科技	219,207	21,486,670.14	0.07
611	601619	嘉泽新能	6,468,200	21,474,424.00	0.07
612	688062	迈威生物	1,061,594	21,444,198.80	0.07
613	688300	联瑞新材	332,382	21,405,400.80	0.07
614	002697	红旗连锁	3,615,700	21,368,787.00	0.07
615	601163	三角轮胎	1,415,100	21,325,557.00	0.07

616	688639	华恒生物	659,301	21,236,085.21	0.07
617	002967	广电计量	1,293,215	21,208,726.00	0.07
618	002108	沧州明珠	5,897,600	21,172,384.00	0.07
619	601326	秦港股份	6,319,000	21,168,650.00	0.07
620	000048	京基智农	1,175,600	21,160,800.00	0.07
621	002550	千红制药	3,401,626	21,090,081.20	0.07
622	000061	农产品	3,008,000	21,086,080.00	0.07
623	688007	光峰科技	1,423,889	21,059,318.31	0.07
624	600557	康缘药业	1,545,132	21,044,697.84	0.07
625	688366	昊海生科	347,245	21,036,102.10	0.07
626	002929	润建股份	624,752	21,004,162.24	0.07
627	601101	昊华能源	2,549,840	20,985,183.20	0.07
628	600751	海航科技	7,975,500	20,975,565.00	0.07
629	601208	东材科技	2,780,840	20,967,533.60	0.07
630	603583	捷昌驱动	846,765	20,923,563.15	0.07
631	002537	海联金汇	3,637,300	20,914,475.00	0.07
632	600775	南京熊猫	2,081,855	20,901,824.20	0.07
633	688372	伟测科技	356,477	20,861,034.04	0.07
634	000990	诚志股份	2,690,800	20,853,700.00	0.07
635	603612	索通发展	1,543,300	20,849,983.00	0.07
636	002068	黑猫股份	1,956,700	20,819,288.00	0.07
637	002291	遥望科技	3,296,900	20,803,439.00	0.07
638	002985	北摩高科	879,459	20,667,286.50	0.07
639	300821	东岳硅材	2,661,727	20,655,001.52	0.07
640	002727	一心堂	1,583,000	20,610,660.00	0.07
641	000950	重药控股	3,830,800	20,609,704.00	0.07
642	000719	中原传媒	1,813,900	20,605,904.00	0.07
643	688167	炬光科技	323,401	20,600,643.70	0.07
644	300455	航天智装	1,588,700	20,589,552.00	0.07
645	600163	中闽能源	3,372,300	20,537,307.00	0.07
646	603888	新华网	917,800	20,503,652.00	0.07
647	001287	中电港	1,008,400	20,480,604.00	0.07
648	603383	顶点软件	545,820	20,468,250.00	0.07
649	300261	雅本化学	2,988,000	20,467,800.00	0.07
650	301155	海力风电	383,455	20,441,986.05	0.07
651	300129	泰胜风能	2,899,200	20,439,360.00	0.07
652	002626	金达威	1,353,090	20,431,659.00	0.07
653	688630	芯碁微装	353,614	20,410,600.08	0.07
654	600682	南京新百	2,983,500	20,407,140.00	0.07
655	002194	武汉凡谷	1,817,206	20,389,051.32	0.07
656	000059	华锦股份	4,254,000	20,376,660.00	0.07
657	000756	新华制药	1,296,900	20,374,299.00	0.07
658	300580	贝斯特	887,411	20,366,082.45	0.07
659	688146	中船特气	699,515	20,313,915.60	0.07

660	600882	妙可蓝多	1,134,400	20,305,760.00	0.07
661	600073	光明肉业	2,909,065	20,188,911.10	0.07
662	605376	博迁新材	696,631	20,167,467.45	0.07
663	000557	西部创业	3,875,800	20,115,402.00	0.07
664	300039	上海凯宝	3,247,600	20,070,168.00	0.07
665	603477	巨星农牧	1,129,900	20,055,725.00	0.07
666	300366	创意信息	2,152,068	20,014,232.40	0.07
667	002498	汉缆股份	5,897,100	19,991,169.00	0.07
668	002154	报喜鸟	4,524,900	19,954,809.00	0.07
669	300134	大富科技	1,699,900	19,939,827.00	0.07
670	001914	招商积余	1,880,300	19,874,771.00	0.07
671	600963	岳阳林纸	3,911,100	19,868,388.00	0.07
672	688131	皓元医药	555,169	19,819,533.30	0.07
673	300183	东软载波	1,023,416	19,803,099.60	0.07
674	002859	洁美科技	952,666	19,767,819.50	0.07
675	688190	云路股份	214,734	19,755,528.00	0.07
676	300443	金雷股份	991,300	19,746,696.00	0.07
677	600075	新疆天业	4,538,800	19,743,780.00	0.07
678	600648	外高桥	1,656,300	19,726,533.00	0.07
679	603533	掌阅科技	970,700	19,714,917.00	0.07
680	300913	兆龙互连	342,800	19,714,428.00	0.07
681	603008	喜临门	1,175,807	19,706,525.32	0.07
682	000828	东莞控股	1,843,324	19,705,133.56	0.07
683	002274	华昌化工	2,533,900	19,688,403.00	0.07
684	601595	上海电影	796,500	19,673,550.00	0.07
685	600812	华北制药	3,799,300	19,642,381.00	0.07
686	601908	京运通	6,420,700	19,583,135.00	0.07
687	002987	京北方	1,373,997	19,551,977.31	0.07
688	002511	中顺洁柔	2,865,500	19,514,055.00	0.07
689	600217	中再资环	3,674,900	19,476,970.00	0.07
690	002320	海峡股份	2,962,900	19,406,995.00	0.07
691	600861	北京人力	1,002,000	19,388,700.00	0.07
692	002545	东方铁塔	2,754,700	19,365,541.00	0.07
693	002461	珠江啤酒	1,957,900	19,363,631.00	0.07
694	603567	珍宝岛	1,667,600	19,344,160.00	0.07
695	688700	东威科技	656,466	19,339,488.36	0.07
696	002349	精华制药	2,526,877	19,330,609.05	0.07
697	601609	金田股份	3,275,000	19,322,500.00	0.07
698	603733	仙鹤股份	936,500	19,319,995.00	0.07
699	002960	青鸟消防	1,648,161	19,234,038.87	0.07
700	601969	海南矿业	2,705,100	19,179,159.00	0.07
701	300855	图南股份	874,012	19,158,343.04	0.07
702	600449	宁夏建材	1,272,532	19,113,430.64	0.07
703	688631	莱斯信息	219,391	19,106,762.19	0.07

704	688006	杭可科技	1,069,239	19,096,608.54	0.07
705	601801	皖新传媒	2,600,238	19,085,746.92	0.07
706	600301	华锡有色	1,120,900	19,066,509.00	0.07
707	601827	三峰环境	2,221,900	19,063,902.00	0.07
708	688502	茂莱光学	94,483	19,028,876.20	0.07
709	600997	开滦股份	2,813,800	19,021,288.00	0.07
710	688598	金博股份	902,324	19,002,943.44	0.07
711	605333	沪光股份	580,700	18,948,241.00	0.07
712	002191	劲嘉股份	4,501,490	18,906,258.00	0.07
713	600477	杭萧钢构	7,347,035	18,881,879.95	0.07
714	601606	长城军工	1,603,447	18,856,536.72	0.07
715	688066	航天宏图	924,082	18,851,272.80	0.07
716	603317	天味食品	1,412,900	18,848,086.00	0.07
717	603638	艾迪精密	1,114,160	18,818,162.40	0.07
718	002588	史丹利	2,548,600	18,808,668.00	0.07
719	300579	数字认证	598,200	18,795,444.00	0.07
720	688432	有研硅	1,658,033	18,735,772.90	0.07
721	600961	株冶集团	2,377,800	18,713,286.00	0.07
722	002216	三全食品	1,556,160	18,673,920.00	0.07
723	603118	共进股份	2,091,200	18,611,680.00	0.06
724	000488	ST 晨鸣	6,101,700	18,610,185.00	0.06
725	301510	固高科技	710,200	18,536,220.00	0.06
726	300416	苏试试验	1,575,770	18,531,055.20	0.06
727	301031	中熔电气	177,870	18,502,037.40	0.06
728	000881	中广核技	2,509,700	18,396,101.00	0.06
729	600651	飞乐音响	4,442,200	18,390,708.00	0.06
730	603229	奥翔药业	1,839,595	18,377,554.05	0.06
731	688439	振华风光	357,889	18,356,126.81	0.06
732	600966	博汇纸业	3,555,300	18,345,348.00	0.06
733	003006	百亚股份	762,700	18,297,173.00	0.06
734	300428	立中集团	1,122,100	18,290,230.00	0.06
735	002060	广东建工	4,988,200	18,256,812.00	0.06
736	600643	爱建集团	3,530,600	18,253,202.00	0.06
737	300850	新强联	951,700	18,186,987.00	0.06
738	601949	中国出版	2,527,800	18,149,604.00	0.06
739	000600	建投能源	3,203,400	18,131,244.00	0.06
740	002434	万里扬	2,908,000	18,029,600.00	0.06
741	605368	蓝天燃气	1,571,000	17,956,530.00	0.06
742	002051	中工国际	2,191,850	17,885,496.00	0.06
743	000029	深深房 A	1,185,500	17,853,630.00	0.06
744	000567	海德股份	2,600,852	17,763,819.16	0.06
745	603995	甬金股份	970,350	17,747,701.50	0.06
746	688515	裕太微	178,945	17,715,555.00	0.06
747	002399	海普瑞	1,657,000	17,713,330.00	0.06

748	000688	国城矿业	1,488,017	17,692,522.13	0.06
749	002101	广东鸿图	1,475,500	17,676,490.00	0.06
750	301175	中科环保	3,264,298	17,627,209.20	0.06
751	002258	利尔化学	2,126,060	17,582,516.20	0.06
752	603919	金徽酒	896,700	17,575,320.00	0.06
753	301205	联特科技	232,140	17,570,676.60	0.06
754	301511	德福科技	1,398,500	17,565,160.00	0.06
755	002158	汉钟精机	945,700	17,514,364.00	0.06
756	301363	美好医疗	540,164	17,512,116.88	0.06
757	603876	鼎胜新材	1,972,326	17,455,085.10	0.06
758	001270	铖昌科技	457,872	17,444,923.20	0.06
759	300406	九强生物	1,304,812	17,432,288.32	0.06
760	301487	盟固利	816,900	17,375,463.00	0.06
761	002840	华统股份	1,376,300	17,355,143.00	0.06
762	688707	振华新材	1,578,545	17,285,067.75	0.06
763	000767	晋控电力	6,815,808	17,243,994.24	0.06
764	300527	中船应急	2,132,189	17,206,765.23	0.06
765	600548	深高速	1,271,400	17,138,472.00	0.06
766	301325	曼恩斯特	316,158	17,132,602.02	0.06
767	002204	大连重工	3,422,500	17,044,050.00	0.06
768	600223	福瑞达	2,251,900	17,024,364.00	0.06
769	300861	美畅股份	853,300	17,023,335.00	0.06
770	600508	上海能源	1,282,255	16,964,233.65	0.06
771	002041	登海种业	1,557,600	16,962,264.00	0.06
772	688389	普门科技	1,139,001	16,959,724.89	0.06
773	301015	百洋医药	699,819	16,942,617.99	0.06
774	600640	国脉文化	1,412,900	16,870,026.00	0.06
775	002125	湘潭电化	1,672,849	16,862,317.92	0.06
776	000088	盐田港	3,455,500	16,828,285.00	0.06
777	600020	中原高速	3,983,085	16,808,618.70	0.06
778	688232	新点软件	579,517	16,800,197.83	0.06
779	603043	广州酒家	1,006,811	16,743,266.93	0.06
780	605168	三人行	466,089	16,741,916.88	0.06
781	688549	中巨芯	1,964,634	16,738,681.68	0.06
782	600783	鲁信创投	1,321,000	16,737,070.00	0.06
783	600639	浦东金桥	1,505,000	16,705,500.00	0.06
784	000597	东北制药	3,162,930	16,668,641.10	0.06
785	002267	陕天然气	1,967,600	16,626,220.00	0.06
786	002516	旷达科技	3,256,400	16,509,948.00	0.06
787	600335	国机汽车	2,649,100	16,503,893.00	0.06
788	603171	税友股份	540,400	16,482,200.00	0.06
789	000498	山东路桥	2,765,300	16,453,535.00	0.06
790	002327	富安娜	1,859,300	16,436,212.00	0.06
791	600929	雪天盐业	2,940,000	16,434,600.00	0.06

792	001213	中铁特货	3,937,300	16,418,541.00	0.06
793	000672	上峰水泥	2,145,939	16,416,433.35	0.06
794	002585	双星新材	3,065,500	16,369,770.00	0.06
795	301087	可孚医疗	462,148	16,341,553.28	0.06
796	600874	创业环保	2,724,700	16,266,459.00	0.06
797	601515	东峰集团	4,083,840	16,253,683.20	0.06
798	688147	微导纳米	603,243	16,221,204.27	0.06
799	688443	智翔金泰	645,154	16,186,913.86	0.06
800	603636	南威软件	1,541,300	16,183,650.00	0.06
801	601869	长飞光纤	539,800	16,134,622.00	0.06
802	688380	中微半导	537,324	16,065,987.60	0.06
803	300257	开山股份	1,761,300	16,063,056.00	0.06
804	002612	朗姿股份	978,300	16,004,988.00	0.06
805	688150	莱特光电	709,140	15,969,832.80	0.06
806	002941	新疆交建	1,426,200	15,930,654.00	0.06
807	688107	安路科技	537,974	15,913,270.92	0.06
808	688298	东方生物	541,128	15,871,284.24	0.06
809	000718	苏宁环球	6,720,700	15,860,852.00	0.06
810	002833	弘亚数控	937,700	15,781,491.00	0.05
811	603169	兰石重装	2,894,423	15,774,605.35	0.05
812	600657	信达地产	3,789,000	15,762,240.00	0.05
813	688690	纳微科技	892,256	15,703,705.60	0.05
814	600987	航民股份	2,261,400	15,694,116.00	0.05
815	002755	奥赛康	1,234,500	15,690,495.00	0.05
816	605599	菜百股份	1,380,300	15,666,405.00	0.05
817	002991	甘源食品	166,814	15,600,445.28	0.05
818	001337	四川黄金	746,000	15,576,480.00	0.05
819	002489	浙江永强	4,800,400	15,553,296.00	0.05
820	000791	甘肃能源	2,574,400	15,523,632.00	0.05
821	002581	未名医药	1,458,900	15,522,696.00	0.05
822	601921	浙版传媒	1,966,300	15,494,444.00	0.05
823	603299	苏盐井神	1,387,748	15,459,512.72	0.05
824	601096	宏盛华源	3,551,818	15,450,408.30	0.05
825	688097	博众精工	588,439	15,446,523.75	0.05
826	301239	普瑞眼科	329,116	15,435,540.40	0.05
827	300856	科思股份	601,902	15,420,729.24	0.05
828	002190	成飞集成	796,700	15,408,178.00	0.05
829	688048	长光华芯	394,304	15,373,912.96	0.05
830	600662	外服控股	3,031,626	15,370,343.82	0.05
831	600475	华光环能	1,694,100	15,263,841.00	0.05
832	601882	海天精工	695,030	15,242,007.90	0.05
833	301238	瑞泰新材	973,000	15,237,180.00	0.05
834	600195	中牧股份	2,262,100	15,178,691.00	0.05
835	301536	星辰科技	188,369	15,050,683.10	0.05

836	601107	四川成渝	2,875,100	15,036,773.00	0.05
837	000813	德展健康	4,797,300	15,015,549.00	0.05
838	300768	迪普科技	857,950	15,014,125.00	0.05
839	603025	大豪科技	981,380	14,966,045.00	0.05
840	300737	科顺股份	2,951,380	14,963,496.60	0.05
841	000885	城发环境	1,137,734	14,915,692.74	0.05
842	603801	志邦家居	1,160,608	14,867,388.48	0.05
843	600604	市北高新	3,120,700	14,854,532.00	0.05
844	603466	风语筑	1,580,018	14,725,767.76	0.05
845	002302	西部建设	2,236,100	14,713,538.00	0.05
846	000935	四川双马	1,013,400	14,674,032.00	0.05
847	688531	日联科技	307,349	14,639,032.87	0.05
848	002034	旺能环境	941,971	14,600,550.50	0.05
849	300973	立高食品	373,199	14,565,956.97	0.05
850	600810	神马股份	1,799,981	14,561,846.29	0.05
851	300080	易成新能	3,319,200	14,504,904.00	0.05
852	000025	特力 A	872,880	14,419,977.60	0.05
853	301589	诺瓦星云	82,680	14,353,248.00	0.05
854	601038	一拖股份	971,037	14,351,926.86	0.05
855	688658	悦康药业	995,563	14,346,062.83	0.05
856	600780	通宝能源	2,542,500	14,314,275.00	0.05
857	605123	派克新材	265,500	14,273,280.00	0.05
858	603123	翠微股份	1,770,100	14,249,305.00	0.05
859	000968	蓝焰控股	2,141,700	14,242,305.00	0.05
860	000736	中交地产	1,654,300	14,226,980.00	0.05
861	000869	张裕 A	611,472	14,180,035.68	0.05
862	002242	九阳股份	1,361,100	14,100,996.00	0.05
863	603609	禾丰股份	1,628,800	14,040,256.00	0.05
864	301207	华兰疫苗	801,000	14,025,510.00	0.05
865	603297	永新光学	149,147	13,992,971.54	0.05
866	301216	万凯新材	1,371,350	13,987,770.00	0.05
867	601069	西部黄金	1,220,600	13,975,870.00	0.05
868	002053	云南能投	1,224,500	13,959,300.00	0.05
869	688261	东微半导	328,895	13,810,301.05	0.05
870	002378	章源钨业	2,127,060	13,762,078.20	0.05
871	003012	东鹏控股	2,076,600	13,726,326.00	0.05
872	300492	华图山鼎	188,500	13,722,800.00	0.05
873	603915	国茂股份	1,168,380	13,693,413.60	0.05
874	300723	一品红	802,626	13,692,799.56	0.05
875	603566	普莱柯	1,072,719	13,687,894.44	0.05
876	605020	永和股份	672,932	13,680,707.56	0.05
877	688348	昱能科技	279,650	13,646,920.00	0.05
878	301348	蓝箭电子	531,200	13,609,344.00	0.05
879	688337	普源精电	347,339	13,546,221.00	0.05

880	600058	五矿发展	1,901,600	13,539,392.00	0.05
881	301047	义翘神州	217,629	13,460,353.65	0.05
882	688586	江航装备	1,402,079	13,417,896.03	0.05
883	688209	英集芯	757,099	13,377,939.33	0.05
884	003040	楚天龙	1,020,300	13,335,321.00	0.05
885	001323	慕思股份	352,294	13,320,236.14	0.05
886	002959	小熊电器	275,390	13,193,934.90	0.05
887	603730	岱美股份	1,462,259	13,145,708.41	0.05
888	603055	台华新材	1,183,800	13,116,504.00	0.05
889	002096	易普力	1,098,700	13,052,556.00	0.05
890	603301	振德医疗	590,500	12,985,095.00	0.05
891	301153	中科江南	464,059	12,965,808.46	0.05
892	603348	文灿股份	546,200	12,923,092.00	0.05
893	301327	华宝新能	167,456	12,845,549.76	0.04
894	688185	康希诺	205,391	12,539,120.55	0.04
895	688686	奥普特	164,050	12,403,820.50	0.04
896	301526	国际复材	3,345,423	12,378,065.10	0.04
897	301217	铜冠铜箔	1,101,411	12,203,633.88	0.04
898	601015	陕西黑猫	3,621,900	12,097,146.00	0.04
899	603327	福蓉科技	989,510	12,012,651.40	0.04
900	688105	诺唯赞	539,698	11,965,104.66	0.04
901	600903	贵州燃气	1,525,680	11,900,304.00	0.04
902	603439	贵州三力	911,100	11,844,300.00	0.04
903	300926	博俊科技	537,500	11,830,375.00	0.04
904	688336	三生国健	551,852	11,820,669.84	0.04
905	688351	微电生理	620,585	11,815,938.40	0.04
906	002275	桂林三金	782,900	11,813,961.00	0.04
907	301268	铭利达	710,209	11,775,265.22	0.04
908	002088	鲁阳节能	904,731	11,571,509.49	0.04
909	601033	永兴股份	799,760	11,564,529.60	0.04
910	000030	富奥股份	2,250,900	11,547,117.00	0.04
911	603355	莱克电气	507,680	11,498,952.00	0.04
912	002314	南山控股	4,800,600	11,425,428.00	0.04
913	603983	丸美生物	353,300	11,397,458.00	0.04
914	605116	奥锐特	539,600	11,396,352.00	0.04
915	603985	恒润股份	975,100	11,389,168.00	0.04
916	000899	赣能股份	1,298,200	11,307,322.00	0.04
917	002901	大博医疗	364,800	11,250,432.00	0.04
918	603162	海通发展	1,219,550	11,219,860.00	0.04
919	301339	通行宝	550,700	11,201,238.00	0.04
920	002946	新乳业	764,377	11,091,110.27	0.04
921	301069	凯盛新材	747,000	11,070,540.00	0.04
922	601083	锦江航运	1,146,863	10,918,135.76	0.04
923	002534	西子洁能	980,836	10,897,087.96	0.04

924	605009	豪悦护理	272,260	10,879,509.60	0.04
925	601886	江河集团	2,005,400	10,829,160.00	0.04
926	688206	概伦电子	571,202	10,801,429.82	0.04
927	688177	百奥泰	555,730	10,770,047.40	0.04
928	603989	艾华集团	712,300	10,741,484.00	0.04
929	688001	华兴源创	395,454	10,716,803.40	0.04
930	003009	中天火箭	272,400	10,623,600.00	0.04
931	000058	深赛格	1,310,400	10,522,512.00	0.04
932	000761	本钢板材	3,284,200	10,509,440.00	0.04
933	688392	骄成超声	256,785	10,476,828.00	0.04
934	300702	天宇股份	616,940	10,278,220.40	0.04
935	603013	亚普股份	682,429	10,222,786.42	0.04
936	301376	致欧科技	533,220	10,195,166.40	0.04
937	002913	奥士康	420,256	10,132,372.16	0.04
938	603719	良品铺子	712,100	10,118,941.00	0.04
939	002911	佛燃能源	800,158	10,113,997.12	0.04
940	301367	怡和嘉业	160,352	10,102,176.00	0.04
941	002651	利君股份	1,375,000	10,078,750.00	0.04
942	002978	安宁股份	353,200	10,037,944.00	0.03
943	001308	康冠科技	362,727	9,974,992.50	0.03
944	300869	康泰医学	713,400	9,944,796.00	0.03
945	301371	敷尔佳	262,800	9,931,212.00	0.03
946	300894	火星人	724,000	9,918,800.00	0.03
947	688268	华特气体	215,423	9,892,224.16	0.03
948	001258	立新能源	1,241,200	9,879,952.00	0.03
949	300755	华致酒行	553,662	9,877,330.08	0.03
950	600618	氯碱化工	1,000,385	9,863,796.10	0.03
951	001236	弘业期货	1,006,200	9,699,768.00	0.03
952	000019	深粮控股	1,466,120	9,632,408.40	0.03
953	603093	南华期货	807,807	9,612,903.30	0.03
954	301246	宏源药业	710,200	9,609,006.00	0.03
955	300741	华宝股份	545,400	9,484,506.00	0.03
956	000517	荣安地产	4,233,880	9,441,552.40	0.03
957	603530	神马电力	381,300	9,421,923.00	0.03
958	603877	太平鸟	630,400	9,329,920.00	0.03
959	601022	宁波远洋	1,159,832	9,313,450.96	0.03
960	688776	国光电气	193,946	9,179,464.18	0.03
961	301558	三态股份	1,047,300	9,174,348.00	0.03
962	688315	诺禾致源	733,767	9,172,087.50	0.03
963	605296	神农集团	323,200	8,952,640.00	0.03
964	688526	科前生物	614,583	8,782,391.07	0.03
965	688433	华曙高科	370,566	8,649,010.44	0.03
966	001389	广合科技	171,200	8,611,360.00	0.03
967	605577	龙版传媒	591,000	8,587,230.00	0.03

968	605222	起帆电缆	555,700	8,557,780.00	0.03
969	601811	新华文轩	525,900	8,335,515.00	0.03
970	688383	新益昌	182,763	8,200,575.81	0.03
971	001311	多利科技	314,881	8,120,780.99	0.03
972	301381	赛维时代	352,243	8,017,050.68	0.03
973	002990	盛视科技	337,959	7,830,510.03	0.03
974	603693	江苏新能	792,100	7,802,185.00	0.03
975	688128	中国电研	361,915	7,603,834.15	0.03
976	605011	杭州热电	352,500	7,550,550.00	0.03
977	603489	八方股份	309,936	7,382,675.52	0.03
978	001269	欧晶科技	258,200	7,356,118.00	0.03
979	603057	紫燕食品	365,100	7,334,859.00	0.03
980	688523	航天环宇	364,045	7,280,900.00	0.03
981	003039	顺控发展	546,891	7,153,334.28	0.02
982	603219	富佳股份	496,800	7,039,656.00	0.02
983	605365	立达信	443,700	6,966,090.00	0.02
984	001322	箭牌家居	861,000	6,965,490.00	0.02
985	301090	华润材料	991,300	6,879,622.00	0.02
986	301508	中机认检	202,300	6,878,200.00	0.02
987	301500	飞南资源	354,200	6,375,600.00	0.02
988	600403	大有能源	2,122,600	6,240,444.00	0.02
989	301559	中集环科	397,015	6,094,180.25	0.02
990	601068	中铝国际	1,377,400	6,074,334.00	0.02
991	301565	中仑新材	262,811	5,624,155.40	0.02
992	301606	绿联科技	148,496	5,612,630.04	0.02
993	601279	英利汽车	1,402,800	5,372,724.00	0.02
994	603132	金徽股份	475,784	5,343,054.32	0.02
995	603103	横店影视	335,000	4,820,650.00	0.02
996	301262	海看股份	186,592	4,640,543.04	0.02
997	301177	迪阿股份	196,858	4,496,236.72	0.02
998	301180	万祥科技	262,800	4,065,516.00	0.01
999	603075	热威股份	180,100	3,355,263.00	0.01
1,000	001376	百通能源	206,200	3,014,644.00	0.01
1,001	301626	苏州天脉	957	62,951.46	0.00
1,002	688615	合合信息	289	47,910.42	0.00
1,003	688708	佳驰科技	780	38,181.00	0.00
1,004	688726	拉普拉斯	979	32,365.74	0.00
1,005	001391	国货航	4,686	31,864.80	0.00
1,006	301551	无线传媒	652	28,185.96	0.00
1,007	603072	天和磁材	2,255	27,736.50	0.00
1,008	301522	上大股份	816	20,269.44	0.00
1,009	301556	托普云农	267	15,766.35	0.00
1,010	301631	壹连科技	153	15,599.88	0.00
1,011	301571	国科天成	350	14,290.50	0.00

1,012	301622	英思特	306	13,745.52	0.00
1,013	301608	博实结	184	12,029.92	0.00
1,014	301613	新铝时代	276	11,528.52	0.00
1,015	301586	佳力奇	215	11,425.10	0.00
1,016	688710	益诺思	332	11,148.56	0.00
1,017	301617	博苑股份	253	10,066.87	0.00
1,018	301603	乔锋智能	233	9,781.34	0.00
1,019	301607	富特科技	257	9,287.98	0.00
1,020	603194	中力股份	291	8,185.83	0.00
1,021	301552	科力装备	143	8,132.41	0.00
1,022	001279	强邦新材	265	7,396.15	0.00
1,023	688530	欧莱新材	344	6,370.88	0.00
1,024	603395	红四方	154	5,508.58	0.00
1,025	603207	小方制药	185	4,930.25	0.00
1,026	603310	巍华新材	254	4,559.30	0.00
1,027	603091	众鑫股份	94	4,176.42	0.00
1,028	603350	安乃达	106	3,834.02	0.00
1,029	603285	键邦股份	129	2,916.69	0.00

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	688050	爱博医疗	354,262,794.32	4.73
2	601099	太平洋	315,842,309.96	4.21
3	688235	百济神州	231,772,865.38	3.09
4	603129	春风动力	231,122,085.24	3.08
5	688278	特宝生物	215,450,933.18	2.87
6	688266	泽璟制药	196,513,251.56	2.62
7	600559	老白干酒	193,100,733.12	2.58
8	601677	明泰铝业	191,458,287.06	2.55
9	600100	同方股份	185,191,031.15	2.47
10	600312	平高电气	180,052,762.91	2.40
11	605589	圣泉集团	179,492,929.00	2.39
12	688037	芯源微	176,210,673.11	2.35
13	688578	艾力斯	169,866,800.53	2.27
14	603005	晶方科技	168,802,681.60	2.25
15	601001	晋控煤业	167,005,906.23	2.23
16	601975	招商南油	165,799,790.60	2.21
17	688076	诺泰生物	165,614,848.61	2.21
18	601918	新集能源	159,077,276.77	2.12

19	600363	联创光电	157,709,171.60	2.10
20	600761	安徽合力	152,514,937.96	2.03
21	688333	铂力特	150,806,784.64	2.01

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

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 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	601099	太平洋	395,923,321.30	5.28
2	688050	爱博医疗	323,472,145.87	4.32
3	603129	春风动力	254,193,583.76	3.39
4	688278	特宝生物	238,022,799.45	3.18
5	300339	润和软件	233,321,359.24	3.11
6	600312	平高电气	200,996,501.32	2.68
7	688578	艾力斯	199,083,778.46	2.66
8	688235	百济神州	183,721,601.13	2.45
9	601001	晋控煤业	183,348,837.83	2.45
10	601918	新集能源	175,693,611.49	2.34
11	688266	泽璟制药	166,240,121.67	2.22
12	600100	同方股份	155,112,121.43	2.07
13	600559	老白干酒	154,841,663.26	2.07
14	600685	中船防务	145,558,476.13	1.94
15	603556	海兴电力	145,102,144.13	1.94
16	688037	芯源微	144,347,276.36	1.93
17	601677	明泰铝业	142,427,392.42	1.90
18	605589	圣泉集团	141,281,766.23	1.89
19	601567	三星医疗	139,997,930.15	1.87
20	603005	晶方科技	139,940,191.87	1.87

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	43,379,468,575.32
卖出股票收入（成交）总额	35,737,934,686.26

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。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金为指数型基金，主要投资标的为指数成份股和备选成份股。基金留存的现金头寸根据基金合同规定，投资于以标的指数或与标的指数相关性较高的其他指数为基础资产的股指期货，旨在配合基金日常投资管理需要，更有效地进行流动性管理，以更好地跟踪标的指数，实现投资目标。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期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。

8.12.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	41,510,331.39
2	应收清算款	105,843,691.28
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	147,354,022.67
---	----	----------------

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		华夏中证 1000ETF 发起式联接	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
20,058	589,810.83	11,310,313,406.00	95.60%	432,931,006.00	3.66%	87,181,194.00	0.74%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例
1	中央汇金资产管理有限责任公司	5,123,275,630.00	43.31%
2	中央汇金投资有限责任公司	4,797,801,550.00	40.55%
3	银华基金－中国人寿保险股份有限公司－传统险－银华基金国寿股份均衡股票传统可供出售单一资产管理计划	116,184,615.00	0.98%
4	银华基金－中国人寿保险股份有限公司－分红险－银华基金国寿股份均衡股票型组合单一资产管理计划（可供出售）	115,399,909.00	0.98%
5	中国平安人寿保险股份有限公司－自有资金	62,570,090.00	0.53%
6	海港人寿保险股份有限公司－传统 2	58,920,000.00	0.50%
7	中国平安人寿保险股份有限公司－分红－一个险分红	53,622,800.00	0.45%
8	中国平安人寿保险股份有限公司－万能－一个险万能	52,258,574.00	0.44%
9	瑞众人寿保险有限责任公司－分红产品	44,474,300.00	0.38%

10	中国平安人寿保险股份有限公司－寿 险传统低－自主	40,241,400.00	0.34%
11	招商银行股份有限公司－华夏中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金 发起式联接基金	87,181,194.00	0.74%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2021 年 3 月 18 日）基金份额总额	228,866,784.00
本报告期期初基金份额总额	3,157,425,606.00
本报告期基金总申购份额	32,558,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	23,885,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	11,830,425,606.00

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金提供审计服务的会计师事务所由普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）更换为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）。本基金本报告期应支付给安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 75,000.00 元人民币。本基金本报告期内选聘安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）提供首年审计服务。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人
受到稽查或处罚等措施的时间	2024-07-05
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证监会北京监管局
受到的具体措施类型	责令改正并暂停办理相关业务行政监管措施
受到稽查或处罚等措施的原因	部分制度不健全或执行不到位，部分业务管控不严
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	基金管理人高度重视，已按要求完成了整改，并已将整改落实情况报送监管机构
其他	无
措施 2	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	高级管理人员
受到稽查或处罚等措施的时间	2024-08-16
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证监会北京监管局
受到的具体措施类型	警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	部分制度不健全或执行不到位，部分业务管控不严
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	不适用
其他	无

#### 11.6.1 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券	11	24,282,098,719.24	30.69%	2,789,131.35	25.47%	-
广发证券	2	12,576,100,878.95	15.90%	1,206,019.83	11.01%	-
中信建投证券	3	11,238,359,541.42	14.21%	2,750,248.75	25.11%	-
国泰君安证券	2	9,432,864,547.98	11.92%	1,049,002.78	9.58%	-

招商证券	6	8,229,321,243.44	10.40%	789,172.95	7.21%	-
中金公司	6	4,061,458,321.50	5.13%	1,049,922.31	9.59%	-
国金证券	1	3,040,454,143.08	3.84%	291,601.10	2.66%	-
平安证券	1	1,851,178,215.19	2.34%	177,515.72	1.62%	-
兴业证券	1	1,564,470,964.63	1.98%	367,811.47	3.36%	-
财通证券	2	1,243,539,370.08	1.57%	119,187.00	1.09%	-
中泰证券	1	653,251,265.71	0.83%	62,657.30	0.57%	-
西部证券	1	595,279,082.55	0.75%	265,441.09	2.42%	-
方正证券	2	345,435,412.96	0.44%	33,127.14	0.30%	-

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择研究服务证券公司的标准，即：

i 投研部门根据证券公司的总体资质情况、财务状况、研究服务能力、经营行为及风控合规能力等情况，选择证券公司进入交易合作库，并进行跟踪评估，对合作库证券公司进行调整。

ii 投研部门牵头制定证券公司研究服务评价制度，建立健全对证券公司研究服务的定期评价机制。评价指标包括但不限于：业绩贡献、反馈速度、观点或数据质量等。

②为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择交易服务证券公司的标准，即：

i 投资部门根据证券公司的总体资质、财务状况、经营行为和合规风控能力、交易服务能力等情况，选择证券公司进入交易合作库，并进行跟踪监控，对合作库证券公司进行调整。

ii 投资部门牵头制定证券公司交易服务评价制度，建立健全对证券公司交易服务的定期评价机制。

iii 投资部门定期对证券公司的交易服务开展评价，评价指标包括但不限于：交易服务成本、交易服务能力、交易系统稳定性、交易系统支持能力、应急交易能力等。

③证券公司专用交易单元选择程序：

i 投资、研究部门牵头制定规范、合理的合作证券公司管理制度，明确证券公司准入标准、退出程序等。合规管理部门对合作证券公司管理制度进行合规性审查。

ii 投资、研究部门根据上述标准进行评估并确定选用的证券公司。

iii 本基金管理人与被选择的证券公司签订交易单元租用协议/证券经纪服务协议。

④除本表列示外，本基金还选择了长江证券、第一创业证券、东北证券、东吴证券、光大证券、国联证券、国信证券、华泰证券、华西证券、江海证券、金元证券、联储证券、上海证券、申万宏源证券的交易单元作为本基金交易单元，本报告期无股票交易及应付佣金。

⑤在上述租用的券商交易单元中，财通证券、方正证券、招商证券、中金公司的部分交易单元、广发证券、国金证券、国信证券、中泰证券的交易单元为本基金本期新增的交易单元，中银国际证券的交易单元为本期剔除的交易单元。

⑥本部分的数据统计时间区间与本报告的报告期一致；本公司网站披露的《华夏基金管理有限

公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）》的报告期为 2024 年 7 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日。敬请投资者关注上述报告统计时间区间的口径差异。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	5,333,948.15	29.50%	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	1,180,996.31	6.53%	-	-	-	-	-	-
招商证券	8,529,272.77	47.17%	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	607,586.10	3.36%	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	2,430,481.96	13.44%	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-01-13
2	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-02-03
3	华夏基金管理有限公司关于调整华夏中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金最小申购、赎回单位的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-02-08
4	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-03-21
5	关于指定证券投资基金主流流动性服务商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-04-26
6	华夏基金管理有限公司关于华夏中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金所持停牌股票	中国证监会规定报刊及网站	2024-06-20

	估值调整情况的公告		
7	华夏基金管理有限公司关于华夏中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-08-02
8	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-09-12
9	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-10-19
10	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-11-29
11	华夏基金管理有限公司关于旗下 102 只基金改聘会计师事务所公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-12-03
12	华夏基金管理有限公司关于华夏中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商终止的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-12-04
13	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-12-25

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2024-02-06 至 2024-12-31	-	4,797,801,550.00	-	4,797,801,550.00	40.55%
	2	2024-07-17 至 2024-12-31	-	5,123,275,630.00	-	5,123,275,630.00	43.31%

#### 产品特有风险

本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额20%的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产，有可能对基金净值产生一定的影响，甚至可能引发基金的流动性风险。在特定情况下，若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平，面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

## §13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金注册的文件；
- 2、基金合同；
- 3、托管协议；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照。

### 13.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

### 13.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

华夏基金管理有限公司

二〇二五年三月三十一日