

**光大保德信量化核心证券投资基金**  
**2022 年年度报告**  
**2022 年 12 月 31 日**

基金管理人：光大保德信基金管理有限公司

基金托管人：中国光大银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年三月三十一日

## §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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 3 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料已经审计。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b>	2
1.1 重要提示	2
<b>§2 基金简介</b>	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	9
2.4 信息披露方式	9
2.5 其他相关资料	9
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	10
3.1 主要会计数据和财务指标	10
3.2 基金净值表现	10
3.3 过去三年基金的利润分配情况	12
<b>§4 管理人报告</b>	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	16
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	16
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	18
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	19
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	19
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	20
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	21
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	21
<b>§5 托管人报告</b>	21
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	21
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	21
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	22
<b>§6 审计报告</b>	22
6.1 审计意见	22
6.2 形成审计意见的基础	22
6.3 其他信息	22
6.4 管理层和治理层对财务报表的责任	23
6.5 注册会计师对财务报表审计的责任	23
<b>§7 年度财务报表</b>	24
7.1 资产负债表	24
7.2 利润表	25
7.3 净资产（基金净值）变动表	27
7.4 报表附注	28
<b>§8 投资组合报告</b>	62
8.1 期末基金资产组合情况	62
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	63
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	64
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	74

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	77
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 .....	77
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 .....	77
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 .....	77
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 .....	77
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	77
8.12 投资组合报告附注 .....	78
<b>§9 基金份额持有人信息</b> .....	<b>78</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	78
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	79
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	79
<b>§10 开放式基金份额变动</b> .....	<b>79</b>
<b>§11 重大事件揭示</b> .....	<b>79</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	79
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 .....	80
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	80
11.4 基金投资策略的改变 .....	80
11.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件 .....	80
11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	80
11.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	80
11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	80
11.9 其他重大事件 .....	84
<b>12 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>85</b>
<b>§13 备查文件目录</b> .....	<b>86</b>
13.1 备查文件目录 .....	86
13.2 存放地点 .....	86
13.3 查阅方式 .....	86

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	光大保德信量化核心证券投资基金
基金简称	光大保德信量化股票
基金主代码	360001
交易代码	360001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004 年 8 月 27 日
基金管理人	光大保德信基金管理有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,316,317,459.35 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金追求长期持续稳定超出业绩比较基准的投资回报。
投资策略	<p>本基金借鉴了外方股东保德信投资的量化投资管理理念和长期经验，结合中国市场现行特点加以改进，形成光大保德信独特的量化投资策略；正常市场情况下不作主动资产配置，采用自下而上与自上而下相结合的方式选择股票；并通过投资组合优化器构建并动态优化投资组合，确保投资组合风险收益特征符合既定目标。</p> <p>本基金在正常市场情况下不作主动资产配置，股票及存托凭证资产的基准比例为基金资产净值的 90%，浮动范围为 85—95%；现金的基准比例为基金资产净值的 10%，浮动范围为 5—15%。</p> <p>本基金建仓时间为 6 个月，基金在合同生效后 6 个月内达到上述比例限制。</p> <p>针对开放式基金申购/赎回的异常流动性需求，资产配置可不受上述比例限制，但基金管理人将在合理期限内调整投资组合，使基金资产配置比例恢复至正常市场情况下的水平，上述合理期限指 10 个交易日，法律法规另有规定时，从其规定。</p>

本基金通过光大保德信特有的以量化投资为核心的多重优化保障体系构建处于或接近有效边际曲线的投资组合。该体系在构建投资组合时综合考量收益因素及风险因素，一方面通过光大保德信独特的多因素数量模型对所有股票的预期收益率进行估算，个股预期收益率的高低直接决定投资组合是否持有该股票；另一方面投资团队从风险控制的角度出发，重点关注数据以外的信息，通过行业分析和个股分析对多因素数量模型形成有效补充，由此形成的行业评级和个股评级将决定行业及个股权重相对业绩基准的偏离范围；然后由投资组合优化器通过一定的量化技术综合考虑个股预期收益率，行业评级和个股评级等参数，根据预先设定的风险目标构建投资组合，并对投资组合进行动态持续优化，使投资组合风险收益特征符合既定目标；最后由交易员根据具体投资方案进行交易。

#### 1. 多因素数量模型的运用

本基金借鉴保德信投资的量化投资管理经验，根据中国市场运行特征从股票估值，成长趋势及数据质量三方面选取对 A 股股价波动具有较强解释度的共同指标作为多因素数量模型的参数，通过一定的量化技术估算出共同指标的收益贡献率，并按一定权重加总得出个股预期收益率，作为投资组合构建的重要依据。估值类指标主要判断股票价格是否正确反映了公司基本面状况；趋势类指标说明股票现有估值是否能够持续；质量类指标判断是否存在暗示现行基本面趋势可能逆转的警戒信号。同时数量小组还将根据市场变化趋势定期或不定期地对模型参数及相关系数进行复核，并做相应调整以确保参数的有效性。

#### 2. 行业评级

行业评级首先根据行业特性的不同对行业进行划分，我们将行业划分为周期性行业，防御性行业及增长性行业，并根据行业动向和实际发展状况对行业划分进行动态调整；在此基础上通过行业景气定位图对行业的周期性变化特征进行分析，并判断每个行业目前所处的景气阶段；然后通过树状集群行业评价体系对行业进行系统性评价；最终确定行业评级及行业权重相对业绩基准的偏离范围，为投资组合优化提供行业层面的决策建议。

#### 3. 个股评级

研究团队采用定量分析与定性分析相结合的股票评估模型对上市公司进

行综合评级，为投资组合优化提供个股层面的决策建议。研究团队着重关注上市公司数据可靠性及消息面对股价的潜在影响，从财务评分模型及公司质量评分模型两方面着手对公司基本面进行全面系统的分析和判断，得出股票综合评级，并根据股票评级确定投资组合中单个股票相对业绩基准的偏离范围。

#### 4. 投资组合优化器的运用

投资组合优化器以风险收益配比原则为核心，通过一定的量化技术综合考虑个股预期收益率，行业评级和个股评级等参数，对投资组合进行前瞻性的风险配置，根据预先设定的风险目标构建符合参数设置并处于有效边际曲线上的投资组合，即一定风险水平下收益最高的投资组合。投资组合优化器还通过量化模型预测投资组合整体风险程度，对投资组合进行动态持续优化。如果由于股价波动等因素造成事前跟踪误差超出我们预先设定的风险区域，投资团队将在优化器中根据风险归因分析对边际风险贡献率最大的股票进行调整，以降低事前跟踪误差，使投资组合所承担的风险程度符合既定目标，并使风险尽量集中分布在投资团队对该风险因素的把握具有高置信度的区域。

#### 5. 权证的投资

##### (1) 权证的投资策略

在控制投资风险和保障基金财产安全的前提下，本公司对权证进行积极主动投资，获取较高的投资组合收益水平。权证投资策略主要包括以下几个方面：

A. 本公司主要采用 Black-Scholes 定价公式和二叉树模型对权证进行定价，并根据市场实际情况，调整权证定价模型及其参数，得到权证的理论价值，作为权证投资的价值基准。

B. 权证价格的对于决定其风险因素的敏感度，本基金通过风险参数的形式进行衡量。

C. 本基金通过权证与证券的组合投资，进行基金财产的止损保护。

D. 本基金通过采取现金套利（Cash extraction）策略，兑现投资收益，保留未来获利空间。

E. 同时，本基金还将采用二叉树模型对美式权证以及各类复杂型权证进

	<p>行理论定价。</p> <p>F. 基金经理通过对理论价格和隐含波动率的合理性分析，基于对证券价格的未来表现和预期波动率变化的分析判断，主动投资于价值被市场低估的权证品种。</p> <p>(2) 权证的投资决策流程</p> <p>A. 权证的投资研究过程</p> <p>研究人员对于基础股票进行深入的调研和分析，并将结果通过定量化模型，对股票进行估值；数量分析小组负责构建和维护权证定价模型，在股票估值的基础上，对于权证的价值进行分析。投资组合委员会在研究分析的基础上，结合基金的实际情况确定投资策略。风险分析小组则通过独立的系统，对权证的风险进行测算，在各种可能的情景下，对权证进行估价，从而确定权证的投资风险，为投资组合委员会的投资策略确定提供参考。</p> <p>B. 权证的投资决策过程</p> <p>a. 权证投资方案的制定</p> <p>投资组合委员会在研究人员和数量分析人员的工作基础上，结合基金的实际情况确定投资方案。</p> <p>b. 权证投资的授权和审批</p> <p>凡单个品种累计投资额度不超过基金资产净值的 5%（暂定）的权证投资，可由基金经理自主执行，并向投资总监备案。</p> <p>凡单个品种累计投资额度超过基金资产净值的 5%（暂定）的权证投资，由投资组合委员会向公司投资决策委员会申请审批。投资方案得到批准后，由基金经理在授权的范围内实施。</p> <p>c. 投资计划调整</p> <p>投资组合委员会根据市场变化、投资计划的实施情况和执行效果、投资分析报告（包括投资表现评估报告、风险分析报告）等，进一步分析判断，并据此进行调整。如果遇有重大变化需要修改投资方案，须按相应程序批准后方可实施。</p>
<p>业绩比较基准</p>	<p>90%×沪深 300 指数+10%×同业存款利率</p>
<p>风险收益特征</p>	<p>本基金为股票型基金，其预期收益和风险高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。按照风险收益配比原则对投资组合进行严格的风险管理，</p>



在风险限制范围内追求收益最大化。
------------------

### 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		光大保德信基金管理有限公司	中国光大银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	高顺平	石立平
	联系电话	(021) 80262888	010-63639180
	电子邮箱	epfservice@epf.com.cn	shiliping@cebbank.com
客户服务电话		4008-202-888	95595
传真		(021) 80262468	010-63639132
注册地址		上海市黄浦区中山东二路558号外滩金融中心1幢, 6层	北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心
办公地址		上海市黄浦区中山东二路558号外滩金融中心1幢(北区3号楼), 6-7层、10层	北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心
邮政编码		200010	100033
法定代表人		刘翔	王江

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.epf.com.cn
基金年度报告备置地点	光大保德信基金管理有限公司、中国光大银行股份有限公司的办公场所。

### 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)	上海市世纪大道100号环球金融中心50楼
注册登记机构	光大保德信基金管理有限公司	上海市黄浦区中山东二路558号外滩金融

		中心 1 幢（北区 3 号楼），6-7 层、10 层
--	--	----------------------------

### §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	2022 年	2021 年	2020 年
本期已实现收益	-415,335,171.86	379,554,965.86	957,889,195.94
本期利润	-452,473,974.14	58,677,325.36	1,094,351,682.62
加权平均基金份额本期利润	-0.3277	0.0370	0.3903
本期加权平均净值利润率	-29.66%	2.47%	32.69%
本期基金份额净值增长率	-25.27%	-0.20%	36.88%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
期末可供分配利润	685,111,265.08	1,237,166,286.04	1,571,970,451.96
期末可供分配基金份额利润	0.5205	0.9595	0.7632
期末基金资产净值	1,219,593,074.15	1,858,854,682.44	2,975,313,101.85
期末基金份额净值	0.9265	1.4417	1.4446
3.1.3 累计期末指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
基金份额累计净值增长率	378.65%	540.52%	541.81%

注：（1）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。

（2）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。

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

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标	①—③	②—④
----	----------	------------	------------	------------	-----	-----

		②		准差④		
过去三个月	-6.80%	1.06%	1.63%	1.16%	-8.43%	-0.10%
过去六个月	-17.39%	1.01%	-12.32%	1.00%	-5.07%	0.01%
过去一年	-25.27%	1.22%	-19.53%	1.15%	-5.74%	0.07%
过去三年	2.08%	1.27%	-4.31%	1.17%	6.39%	0.10%
过去五年	1.53%	1.24%	-2.41%	1.17%	3.94%	0.07%
自基金合同生效起至今	378.65%	1.60%	212.25%	1.47%	166.40%	0.13%

注：为更好地反映债券市场整体运行情况和本基金管理人旗下相关基金投资组合的运作情况，经与基金托管人中国光大银行股份有限公司协商一致，自 2014 年 4 月 1 日起，将本基金的业绩比较基准由原“90%×富时中国 A200 指数+10%×同业存款利率”变更为“90%×沪深 300 指数+10%×同业存款利率”，业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

### 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

光大保德信量化核心证券投资基金

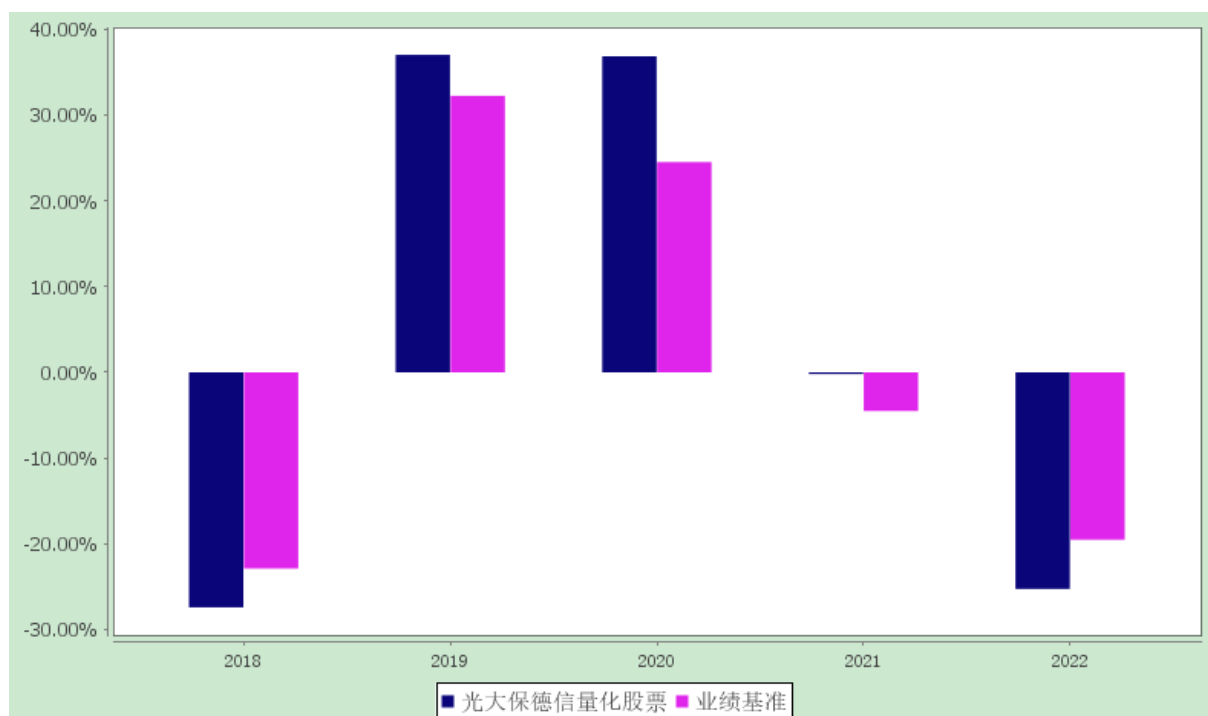
自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
(2004 年 8 月 27 日至 2022 年 12 月 31 日)



### 3.2.3 过去五年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

光大保德信量化核心证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金基金合同于 2004 年 8 月 27 日生效，合同生效当年净值收益率按实际存续期计算，未按整个自然年度折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2022	1.565	136,837,609.88	107,756,082.15	244,593,692.03	-
2021	-	-	-	-	-
2020	0.314	52,074,991.90	53,835,980.72	105,910,972.62	-
合计	1.879	188,912,601.78	161,592,062.87	350,504,664.65	-

## §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

光大保德信基金管理有限公司（以下简称“光大保德信”）成立于 2004 年 4 月，由中国光大集团控股的光大证券股份有限公司和美国保德信金融集团旗下的保德信投资管理有限公司共同创建，公司总部设在上海，注册资本为人民币 1.6 亿元人民币，两家股东分别持有 55%和 45%的股份。公司

主要从事基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务（涉及行政许可的凭许可证经营），今后，将在法律法规允许的范围内为各类投资者提供更多资产管理服务。

截至 2022 年 12 月 31 日，光大保德信旗下管理着 74 只开放式基金，即光大保德信量化核心证券投资基金、光大保德信货币市场基金、光大保德信红利混合型证券投资基金、光大保德信新增长混合型证券投资基金、光大保德信优势配置混合型证券投资基金、光大保德信增利收益债券型证券投资基金、光大保德信均衡精选混合型证券投资基金、光大保德信动态优选灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信中小盘混合型证券投资基金、光大保德信信用添益债券型证券投资基金、光大保德信行业轮动混合型证券投资基金、光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金、光大保德信现金宝货币市场基金、光大保德信银发商机主题混合型证券投资基金、光大保德信岁末红利纯债债券型证券投资基金、光大保德信国企改革主题股票型证券投资基金、光大保德信鼎鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信一带一路战略主题混合型证券投资基金、光大保德信耀钱包货币市场基金、光大保德信欣鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信睿鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信中国制造 2025 灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信风格轮动混合型证券投资基金、光大保德信产业新动力灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信永鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信吉鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信恒利纯债债券型证券投资基金、光大保德信铭鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信诚鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信安和债券型证券投资基金、光大保德信安祺债券型证券投资基金、光大保德信事件驱动灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信永利纯债债券型证券投资基金、光大保德信安诚债券型证券投资基金、光大保德信多策略智选 18 个月定期开放混合型证券投资基金、光大保德信尊盈半年定期开放债券型发起式证券投资基金、光大保德信中高等级债券型证券投资基金、光大保德信先进服务业灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信多策略优选一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信创业板量化优选股票型证券投资基金、光大保德信多策略精选 18 个月定期开放灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信超短债债券型证券投资基金、光大保德信晟利债券型证券投资基金、光大保德信安泽债券型证券投资基金、光大保德信尊丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、光大保德信景气先锋混合型证券投资基金、光大保德信尊泰三年定期开放债券型证券投资基金、光大保德信研究精选混合型证券投资基金、光大保德信消费主题股票型证券投资基金、光大保德信裕鑫混合型证券投资基金、光大保德信瑞和混合型证券投资基金、光大保德信尊合 87 个月定期开放债券型证券投资基金、光大保德信尊裕纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、光大保德信中债 1-5 年政策性金融债指数证券投资基金、光大保德信安瑞一年持有期债券型证券投资基金、光大保德信智能汽车主题股票型证券投资基金、光大保德信锦弘混合型证券投资

基金、光大保德信新机遇混合型证券投资基金、光大保德信安阳一年持有期混合型证券投资基金、光大保德信品质生活混合型证券投资基金、光大保德信健康优加混合型证券投资基金、光大保德信睿盈混合型证券投资基金、光大保德信中证 500 指数增强型证券投资基金、光大保德信创新生活混合型证券投资基金、光大保德信纯债债券型证券投资基金、光大保德信恒鑫混合型证券投资基金、光大保德信中短期利率债债券型证券投资基金、光大保德信核心资产混合型证券投资基金、光大保德信尊利纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、光大保德信汇佳混合型证券投资基金、光大保德信尊颐纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、光大保德信高端装备混合型证券投资基金、光大保德信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、光大保德信荣利纯债债券型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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		
赵大年	权益管理总部 量化投资团队 团队长、基金 经理	2021-11-20	-	15 年	赵大年先生，2004 年毕业于中国科学技术大学统计与金融系，2007 年获得中国科学院数学与系统科学研究院统计学专业的硕士学位。2007 年 6 月至 2007 年 10 月在申万巴黎基金管理有限公司任职产品设计经理；2007 年 10 月至 2009 年 4 月在钧锋投资咨询有限公司任职投资经理；2009 年 4 月加入光大保德信基金管理有限公司，先后担任风险管理部风险控制专员、风险控制高级经理、副总监、总监，2014 年 8 月至 2018 年 3 月担任量化投资部总监。2016 年 2 月至 2018 年 6 月担任光大保德信风格轮动混合型证券投资基金的基金经理，2016 年 4 月至 2018 年 3 月担任光大保德信量化核心证券投资基金的基金经理，2017 年 1 月至 2018 年 6 月担任光大保德信事件驱动灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 1 月至 2018 年 1 月担任光大保德信安祺债券型证券投资

					基金的基金经理，2018 年 2 月至 2018 年 6 月担任光大保德信创业板量化优选股票型证券投资基金的基金经理，2018 年 6 月起至 2021 年 11 月历任风险管理部副总监、总监，现任权益管理总部量化投资团队团队长，2021 年 11 月至今担任光大保德信量化核心证券投资基金、光大保德信锦弘混合型证券投资基金的基金经理，2021 年 12 月至今担任光大保德信多策略智选 18 个月定期开放混合型证券投资基金的基金经理，2023 年 1 月至今担任光大保德信风格轮动混合型证券投资基金、光大保德信睿鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信中证 500 指数增强型证券投资基金、光大保德信创业板量化优选股票型证券投资基金、光大保德信事件驱动灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信诚鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
翟云飞	基金经理	2016-12-09	2022-08-27	12 年	翟云飞先生，2005 年毕业于中国科学技术大学自动化系，2010 年获得中国科学技术大学统计与金融系博士学位。2010 年 6 月至 2014 年 3 月在大成基金管理有限公司任职，其中 2010 年 6 月至 2011 年 5 月任职金融工程师（负责量化投资研究），2011 年 5 月至 2012 年 7 月任职产品设计师，2012 年 7 月至 2014 年 3 月任职量化投资研究员、行业投资研究员；2014 年 4 月加入光大保德信基金管理有限公司，历任金融工程师（负责量化投资研究）、高级量化研究员、权益管理总部量化投资团队基金经理，2016 年 2 月至 2023 年 1 月担任光大保德信风格轮动混合型证券投资基金的基金经理，2016 年 12 月至 2022 年 8 月担任光大保德信量化核心证券投资基金的基金经理，2017 年 1 月至 2020 年 7 月担任光大保德信事件

					<p>驱动灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2018 年 2 月至 2023 年 1 月担任光大保德信创业板量化优选股票型证券投资基金的基金经理，2019 年 6 月至 2023 年 1 月担任光大保德信诚鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2019 年 7 月至 2023 年 1 月担任光大保德信睿鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2019 年 8 月至 2020 年 8 月担任光大保德信永鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2021 年 9 月至 2023 年 1 月担任光大保德信事件驱动灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2021 年 11 月至 2023 年 1 月担任光大保德信中证 500 指数增强型证券投资基金的基金经理，2021 年 11 月至 2022 年 12 月担任光大保德信恒鑫混合型证券投资基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	--	---

注：对基金的非首任基金经理，其任职日期和离任日期分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

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

无

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。报告期内未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

本基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法律法规，制定了《光大保德信基金管理有限公司公平交易制度》，并建立《投资研究管理制度》及细则、《集中交易管理制度》、《异常交易监控与报告制度》、《投资对象备选库建立与维护管理办法》等制度作为公平交易执行的制度保障。在投资管理活动中公平的对待公司管理包括开放式基金、特



定客户资产管理组合在内的所有组合，范围包括股票、债券等所有投资品种，以及一级市场申购、二级市场交易等所有投资活动，同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。实行事前控制、事中监控、事后分析的全过程控制，形成有效的公平交易体系。具体的控制方法包括：

事前控制：1、研究人员通过内部晨会、邮件和统一的研究报告平台系统发布投资建议，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和投资决策等方面均享有平等机会；2、各个投资主体有明确的职责和权限划分，投资组合经理在权限范围内自主决策，不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离；3、建立规范的一级市场股票债券询价申购和配售等审批流程、银行间债券价格公允性审批流程；建立和定期维护二级市场投资对象备选库和银行间市场交易对手库。

事中监控：1、主动管理型的基金，严禁同一投资组合或不同投资组合在同一交易日进行股票的反向交易，严禁不同投资组合在同一交易日进行债券的反向交易，确有需要进行日内反向交易的，需要进行严格的审批流程；2、交易环节中所有指令严格按照“时间优先、价格优先”的原则执行指令，交易所指令均需通过恒生系统公平交易模块进行分发和委托下单。

事后分析：对公平交易的事后分析主要集中在对同一投资组合或不同投资组合临近交易日的反向交易和不同投资组合临近交易日的同向交易，同时在每季度和每年度，对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3日内、5日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析。特别的，对同一投资组合经理管理的不同投资组合之间的同向交易和反向交易重点进行分析。若出现异常交易行为，则及时进行核查并在向中国证监会报送的监察稽核季度报告和年度报告中对此做专项说明。

对于公平交易同向交易价差分析，具体的分析方法如下：第一步，在 A 组合买入或者卖出某只证券的当日（3 日、5 日）内，统计 A 组合在此期间的买入或者卖出该股票的均价，同时统计 B 组合在同期、同方向交易同一只证券的均价，然后比较两者的均价差异，其中买入溢价率 =  $(B \text{ 组合交易均价} / A \text{ 组合交易均价} - 1)$ ，卖出溢价率 =  $(A \text{ 组合交易均价} / B \text{ 组合交易均价} - 1)$ ；第二步，将发生的所有交易价差汇总进行 T 检验，置信区间 95%，得到交易价差是否趋近于 0 的判断结果，并计算 A 组合与 B 组合同向交易中占优次数的比例为占优比例，用溢价率乘以成交量较少方的成交量计算得到 B 组合对 A 组合溢价金额大小，将所有同向交易溢价金额求和，除以 A 组合平均资产净值来计算对 A 组合净值的影响，称为单位溢价率。判断同向交易价格是否有显著差异有以下四条标准：交易价差不趋向于零、样本数大于 30、单位溢价率大于 1%、占优比例不在 45%-55%之间。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，各项公平交易制度流程均得到良好地贯彻执行。在同向交易价差分析中，出现溢价率统计显著主要原因是市场交易价格波动较大且组合经理交易时机的选择不同，本基金管理人旗下所有投资组合从投资信息的获取、投资决策到交易执行的各个环节均按照公平交易制度的要求进行，未发现存在违反公平交易原则的现象。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本基金与本公司其他投资组合参与交易所公开竞价同日反向交易且成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的情况有两次，由投资组合策略不同导致，未发现利益输送或异常交易的问题。

### 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

宏观经济方面，上半年全国多地受外部因素影响使得供需两端遭遇限制，部分经济指标单月增速出现大幅下滑。下半年宏观经济总体较上半年有所回暖，多数指标均有所回升，但受内外因素综合影响，下半年经济基本面并没有出现明显好转，四季度更是较之前有所弱化，并且政策调整带来的利好相对低于预期，生产、消费和投资等指令整体偏弱。

股票市场方面，受宏观经济基本面的影响，股票资产价格全年出现普遍下跌，主要宽基股票指数调整幅度超过 20%。从结构上看，煤炭、交通运输、银行和房地产等低估值行业板块和个股表现较好，电子、计算机、传媒、新能源等成长板块调整幅度较大。从市场阶段性特征来看，成长风格在一季度调整幅度较大，同期价值风格股票的防御性明显。在 5 月至 8 月的市场修复阶段，小盘成长风格有较大涨幅，但在进入四季度之后，以白酒、医药为代表的消费板块有明显修复，价值风格重新取得优势。

在投资操作方面，光大量化核心基金以基本面量化模型为基础，保持行业配置相对均衡，并根据上市公司景气成长逻辑精选个股。由于 2022 年股票市场的风险偏好较差，降低了投资者对于成长预期较高个股与板块的定价，使得以景气投资逻辑为基础的量化模型组合的阶段性表现不尽理想。从全年结果来看，投资逻辑与量化模型在 2022 年受到一定挑战，基金收益率未能战胜业绩基准。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期内份额净值增长率为-25.27%，业绩比较基准收益率为-19.53%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2023 年，随着国内政策调整以及扩大内需战略的陆续出台，消费和地产板块有望企稳，叠加低基数和消费、基建对冲出口下行，2023 年国内经济有望有所好转。我们认为业绩复苏修复将成为 2023 年上市公司基本面的主要投资逻辑。同时，金融市场剩余流动性处于高位，而权益估值处于历史低位，因此对于 2023 年权益市场持乐观态度，预计市场总体风格上仍相对均衡，将呈现结构性投资机会。本基金将继续使用量化策略模型优选个股、均衡配置，力争基金资产的保值增值。

#### 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，本基金管理人在开展内部监察稽核工作时本着合规运作、防范风险、保障基金份额持有人利益的宗旨，由独立于各业务部门的督察长和监察稽核部、风险管理部对公司的经营管理、基金的投资运作、基金的销售等公司所有业务及员工行为规范等方面进行定期和不定期检查，及时发现问题并督促相关部门进行整改，并定期制作监察稽核报告报董事会和公司管理层。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核工作的重点包括以下几个方面：

督察长和监察稽核部督促、协助各业务部门按照法律法规和监管机构规定对相关制度的合法性、规范性和时效性完善各项内部管理制度和业务流程，明确风险控制职责并具体落实相应措施，提高全体员工的风险意识，有效保障基金份额持有人的利益。

督察长和监察稽核部、风险管理部针对各部门具体业务建立了相应的检查指标及检查重点，通过现场检查、电脑监控、人员询问、重点抽查等一系列方法，定期对公司和基金日常运作的各项业务进行合法合规检查，并对基金投资交易行为过程实施实时监控，督促业务部门不断改进内部控制和风险管理，并按规定定期出具合规风控工作情况报告报送董事会和公司管理层。

根据中国证监会的规定，督察长和监察稽核部及时准确地向监管机关报送各项报告，并对公司所有对外信息，包括基金法定信息披露、基金产品宣传推介材料等的合法合规情况进行事前审阅，确保其内容真实、准确、完整并符合中国证监会的相关规定。督察长和监察稽核部组织、协调各相关部门及时完成信息披露，确保公司的信息披露工作严格按照中国证监会规定的时间和方式进行。

在全公司范围内开展持续的学习和培训。督察长和监察稽核部先后组织了新员工入司培训，对相关人员进行了法律法规的专项培训和年度监察培训，并组织员工开展学习、讨论，提高和加深了

公司员工对基金法律法规的认识和理解，明确风险控制职责，树立全员内控意识。

根据董事会和管理层的要求，以及法规要求和公司业务发展需要，督察长和监察稽核部以风险为导向，年内计划并实施了数个内部专项审计项目，及时发现潜在的问题和风险，对公司重要业务环节剔除流程改进建议，促使公司规范运作。

通过上述工作，在本报告期内，本基金管理人对本基金的管理始均按照法律法规、基金合同、招募说明书和公司制度进行，充分维护和保障了基金持有人的合法权益。本基金管理人将一如既往地本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运用资金资产，以风险控制为核心，进一步提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金的估值业务严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》及监管机关有关规定和《光大保德信基金管理有限公司基金估值委员会工作制度》进行。日常估值由基金管理人和本基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计的财务核对同时进行。

报告期内，公司设立由负责运营的高管、运营部代表（包括基金会计）、投研部门代表、监察稽核部代表、IT 部代表、金融工程部门代表人员组成的估值委员会。公司估值委员会主要负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，选择基金估值模型及估值模型假设，定期评价现有估值政策和程序的适用性及对估值程序执行情况进行监督。基金估值政策的议定和修改采用集体决策机制，对需采用特别估值程序的证券，基金管理人及时启动特别估值程序，由公司估值委员会讨论议定特别估值方案并与托管行、审计师沟通后形成建议，经公司管理层批准后由运营部具体执行。估值委员会向公司管理层提交推荐建议前，应审慎平衡托管行、审计师和基金同业的意见，并必须获得估值委员会二分之一以上成员同意。

公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和长期相关工作经历，并具有广泛的代表性。

委员会对各相关部门和代表人员的分工如下：投资研究部和运营部共同负责关注相关投资品种的动态，评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种；运营部根据估值的专业技术对需要进行估值政策调整的品种提出初步意见提交估值

委员会讨论，负责执行基金估值政策进行日常估值业务，负责与托管行、审计师、基金同业、监管机关沟通估值调整事项；监察稽核部就估值程序的合法合规发表意见；金融工程负责估值政策调整对投资绩效的评估；IT 部就估值政策调整的技术实现进行评估。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；截止报告期末未与外部估值定价服务机构签约。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规、基金合同以及基金实际运作情况，2022 年 4 月 28 日本基金每 10 份份额派发红利 1.565 元。

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

本报告期内未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

### §5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国光大银行股份有限公司在光大保德信量化核心证券投资基金（以下称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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

本报告期内，中国光大银行股份有限公司依据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

### 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

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《光大保德信量化核心证券投资基金 2022 年年度报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确。

## §6 审计报告

安永华明（2023）审字第 60467078\_B03 号

光大保德信量化核心证券投资基金全体基金份额持有人：

### 6.1 审计意见

我们审计了光大保德信量化核心证券投资基金的财务报表，包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表，2022 年度的利润表、净资产（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的光大保德信量化核心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，公允反映了光大保德信量化核心证券投资基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净值变动情况。

### 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，我们独立于光大保德信量化核心证券投资基金，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

光大保德信量化核心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，管理层负责评估光大保德信量化核心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。

治理层负责监督光大保德信量化核心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，就可能导致对光大保德信量化核心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光大保德信量化核心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  
王珊珊 夏秉雯  
上海市世纪大道 100 号环球金融中心 50 楼  
2023 年 3 月 30 日

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：光大保德信量化核心证券投资基金

报告截止日：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	136,391,203.68	193,523,752.77
结算备付金		4,526,965.32	3,534,786.49
存出保证金		304,034.81	304,998.17
交易性金融资产	7.4.7.2	1,085,311,478.53	1,667,642,843.95
其中：股票投资		1,085,311,478.53	1,667,642,843.95
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		-	73,536.24
应收股利		-	-
应收申购款		18,899.17	22,029.12
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	40,507.13
资产总计		1,226,552,581.51	1,865,142,453.87
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2021 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		-	-
应付赎回款		172,730.92	797,861.78
应付管理人报酬		1,598,061.81	2,364,931.17
应付托管费		266,343.63	394,155.18
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	4,922,371.00	2,730,823.30
负债合计		6,959,507.36	6,287,771.43
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	481,690,610.96	471,836,524.76
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	737,902,463.19	1,387,018,157.68
净资产合计		1,219,593,074.15	1,858,854,682.44
负债和净资产总计		1,226,552,581.51	1,865,142,453.87

注：（1）报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.9265 元，基金份额总额 1,316,317,459.35 份。

（2）比较数据已根据本年《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>》中的资产负债表格式的要求进行列示：上年度末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，上年度末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

## 7.2 利润表

会计主体：光大保德信量化核心证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日 至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日 至 2021 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-425,449,237.75	131,081,084.81
1.利息收入		1,243,117.91	1,702,090.27

其中：存款利息收入	7.4.7.9	1,243,117.91	1,702,090.27
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-390,031,026.08	449,597,342.14
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-411,347,603.79	412,510,080.90
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.11	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.12	-	-
衍生工具收益	7.4.7.13	-	-
股利收益	7.4.7.14	21,316,577.71	37,087,261.24
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	-37,138,802.28	-320,877,640.50
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	477,472.70	659,292.90
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>27,024,736.39</b>	<b>72,403,759.45</b>
1. 管理人报酬	7.4.10.2	22,974,782.52	35,808,769.37
2. 托管费	7.4.10.2	3,829,130.35	5,968,128.21
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	7.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	7.4.7.18	220,823.52	30,626,861.87
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-452,473,974.14</b>	<b>58,677,325.36</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-452,473,974.14</b>	<b>58,677,325.36</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-452,473,974.14</b>	<b>58,677,325.36</b>

注：比较数据已根据本年《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>》中的利润表格式的要求进行列示：上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

### 7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：光大保德信量化核心证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 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（基金净值）	471,836,524.76	1,387,018,157.68	1,858,854,682.44
二、本期期初净资产（基金净值）	471,836,524.76	1,387,018,157.68	1,858,854,682.44
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	9,854,086.20	-649,115,694.49	639,261,608.29
（一）、综合收益总额	-	-452,473,974.14	452,473,974.14
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	9,854,086.20	47,951,971.68	57,806,057.88
其中：1.基金申购款	169,093,817.81	374,618,492.50	543,712,310.31
2.基金赎回款	-159,239,731.61	-326,666,520.82	485,906,252.43
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-244,593,692.03	244,593,692.03
四、本期期末净资产（基金净值）	481,690,610.96	737,902,463.19	1,219,593,074.15
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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	753,719,397.17	2,221,593,704.68	2,975,313,101.85

资产（基金净值）			1.85
二、本期期初净资产（基金净值）	753,719,397.17	2,221,593,704.68	2,975,313,101.85
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-281,882,872.41	-834,575,547.00	-1,116,458,419.41
（一）、综合收益总额	-	58,677,325.36	58,677,325.36
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-281,882,872.41	-893,252,872.36	-1,175,135,744.77
其中：1.基金申购款	48,073,528.80	146,449,191.51	194,522,720.31
2.基金赎回款	-329,956,401.21	-1,039,702,063.87	-1,369,658,465.08
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	471,836,524.76	1,387,018,157.68	1,858,854,682.44

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从 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：刘翔，主管会计工作负责人：贺敬哲，会计机构负责人：王永万

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

光大保德信量化核心证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监基金字[2004]85 号文《关于同意光大保德信量化核心证券投资基金设立的批复》的核准，由基金管理人光大保德信基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于 2004 年 8 月 27 日正式生效，首次设立募集规模为 2,544,287,215.94 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构为光大保德信基金管理有限公司，基金托管人

为中国光大银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括在国内依法公开发行上市的股票、存托凭证、法律法规及证监会允许基金投资的其它金融工具。其中股票投资对象重点为基本面良好且具有持续增长潜力，股价处于合理区间的优质股票。本基金在正常市场情况下不作主动资产配置，股票及存托凭证资产的基准比例为基金资产净值的 90%，浮动范围为 85-95%；现金的基准比例为基金资产净值的 10%，浮动范围为 5-15%。

本基金的业绩比较基准为： $90\% \times \text{沪深 300 指数} + 10\% \times \text{同业存款利率}$ 。

2007 年 5 月 8 日，本基金管理人光大保德信基金管理有限公司对本基金进行了基金份额拆分。拆分后基金份额面值为人民币 0.3618 元。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

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

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

##### (1) 金融资产分类

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

##### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

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

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

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单

项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

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

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

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

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

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

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

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

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

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

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

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。



#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

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

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

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

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

(6) 公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 基金收益分配的比例按有关规定制定；

(2) 本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，本基金默认的收益分配方式是现金分红。投资人可选择现金红利或将现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；

(3) 在符合基金分配条件的前提下，基金收益分配每年至少一次，但若基金合同生效不满 3 个月，收益可不分配，年度分配在基金会计年度结束后的 4 个月内完成；

(4) 基金当年收益须先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配；

(5) 如果基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；

(6) 每一基金份额享有同等收益分配权；

(7) 红利分配时所发生的银行转账或其他手续费用由基金份额持有人自行承担；

(8) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；

(9) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；

(2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；

(3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

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

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产

转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理。此外，本基金亦已执行财政部于 2022 年发布的《关于印发〈资产管理产品相关会计处理规定〉的通知》（财会[2022]14 号）。新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。根据新金融工具准则的衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与原准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。于首次执行日（2022 年 1 月 1 日），原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：以摊余成本计量的金融资产：银行存款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 193,523,752.77 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 38,779.33 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 193,562,532.10 元。结算备付金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 3,534,786.49 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 1,590.60 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 3,536,377.09 元。存出保证金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 304,998.17 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 137.20 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 305,135.37 元。应收利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 40,507.13 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 38,779.33 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 1,590.60 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 137.20 元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列

报。除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产和金融负债项目无影响。于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

#### 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

#### 7.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

#### 7.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债

券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

#### 7.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

#### 7.4.6.4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### 7.4.6.5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	136,391,203.68	193,523,752.77
等于：本金	136,364,081.02	193,523,752.77
加：应计利息	27,122.66	-
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	136,391,203.68	193,523,752.77

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2022 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		1,128,355,482.90	-	1,085,311,478.53	-43,044,004.37
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,128,355,482.90	-	1,085,311,478.53	-43,044,004.37
项目		上年度末 2021 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		1,673,548,046.04	-	1,667,642,843.95	-5,905,202.09
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-

资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,673,548,046.04	-	1,667,642,843.95	-5,905,202.09

### 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

本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债余额。

### 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

本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

### 7.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应收利息	-	40,507.13
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	40,507.13

### 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	52.18	77.84



应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	4,582,318.82	2,510,745.46
其中：交易所市场	4,582,318.82	2,510,745.46
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提审计费	100,000.00	100,000.00
预提信息披露费	240,000.00	120,000.00
合计	4,922,371.00	2,730,823.30

#### 7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,289,385,962.14	471,836,524.76
本期申购	462,096,233.11	169,093,817.81
本期赎回（以“-”号填列）	-435,164,735.90	-159,239,731.61
本期末	1,316,317,459.35	481,690,610.96

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 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	1,237,166,286.04	149,851,871.64	1,387,018,157.68
本期利润	-415,335,171.86	-37,138,802.28	-452,473,974.14
本期基金份额交易产生的变动数	107,873,842.93	-59,921,871.25	47,951,971.68
其中：基金申购款	383,915,281.40	-9,296,788.90	374,618,492.50

基金赎回款	-276,041,438.47	-50,625,082.35	-326,666,520.82
本期已分配利润	-244,593,692.03	-	-244,593,692.03
本期末	685,111,265.08	52,791,198.11	737,902,463.19

#### 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	1,158,636.47	1,574,249.46
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	79,445.10	118,692.47
其他	5,036.34	9,148.34
合计	1,243,117.91	1,702,090.27

#### 7.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	7,820,401,282.39	10,724,048,540.31
减：卖出股票成本总额	8,209,301,660.16	10,311,538,459.41
减：交易费用	22,447,226.02	-
买卖股票差价收入	-411,347,603.79	412,510,080.90

#### 7.4.7.11 债券投资收益

##### 7.4.7.11.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益。

##### 7.4.7.11.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.12 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.13 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

#### 7.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
股票投资产生的股利收益	21,316,577.71	37,087,261.24
合计	21,316,577.71	37,087,261.24

#### 7.4.7.15 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
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
1.交易性金融资产	-37,138,802.28	-320,877,640.50
——股票投资	-37,138,802.28	-320,877,640.50
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-37,138,802.28	-320,877,640.50

#### 7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
基金赎回费收入	476,924.58	640,125.03
转换费收入	548.12	19,167.87
合计	477,472.70	659,292.90

#### 7.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

#### 7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
审计费用	100,000.00	100,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费	823.52	4,348.57
交易费用	-	30,402,513.30
合计	220,823.52	30,626,861.87

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
光大保德信基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国光大银行股份有限公司（“光大银行”）	基金托管人、基金代销机构

光大证券股份有限公司（“光大证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
保德信投资管理有限公司	基金管理人的股东
光大保德信资产管理有限公司	基金管理人控制的子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 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 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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
光大证券	5,835,448,009.41	37.81%	6,534,050,992.05	32.34%

##### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

##### 7.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

##### 7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

##### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022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
光大证券	5,395,490.64	40.82%	1,680,620.84	36.68%
关联方名称	上年度可比期间			

	2021年1月1日至2021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
光大证券	6,032,714.10	33.95%	1,086,964.85	43.29%

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。

#### 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 2022年1月1日至2022年12 月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	22,974,782.52	35,808,769.37
其中：支付销售机构的客户维护费	6,541,374.83	8,749,395.56

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{基金管理费率} / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12 月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12 月31日
当期发生的基金应支付的托管费	3,829,130.35	5,968,128.21

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{基金托管费率} / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。

#### 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

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 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

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

##### 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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

#### 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		上年度可比期间	
	2022年1月1日至2022年12月31日		2021年1月1日至2021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
中国光大银行	136,391,203.68	1,158,636.47	193,523,752.77	1,574,249.46

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2022-04-28	-	2022-04-28	1.565	136,837,609.88	107,756,082.15	244,593,692.03	-
合计				1.565	136,837,609.88	107,756,082.15	244,593,692.03	-

#### 7.4.12 期末（2022 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
688271	联影医疗	2022-08-12	6 个月	新股锁定期内	109.88	171.68	7,365.00	809,266.20	1,264,423.20	-
688506	百利天恒	2022-12-28	1 个月以内	新股未上市	24.70	24.70	15,622.00	385,863.40	385,863.40	-
688410	山外山	2022-12-19	6 个月	新股锁定期内	32.30	23.79	4,853.00	156,751.90	115,452.87	-
301269	华大九天	2022-07-21	6 个月	新股锁定期内	32.69	87.94	1,168.00	38,181.92	102,713.92	-
688291	金橙子	2022-10-17	6 个月	新股锁定期内	26.77	24.11	3,961.00	106,035.97	95,499.71	-
688244	永信至诚	2022-10-12	6 个月	新股锁定期内	49.19	50.14	1,506.00	74,080.14	75,510.84	-



301267	华夏眼科	2022-10-26	6 个月	新股锁定期内	50.88	66.20	1,006.00	51,185.28	66,597.20	-
301095	广立微	2022-07-28	6 个月	新股锁定期内	58.00	86.49	740.00	42,920.00	64,002.60	-
301308	江波龙	2022-07-27	6 个月	新股锁定期内	55.67	56.72	819.00	45,593.73	46,453.68	-
301327	华宝新能	2022-09-08	6 个月	新股锁定期内	237.50	176.97	242.00	57,475.00	42,826.74	-
301239	普瑞眼科	2022-06-22	6 个月	新股锁定期内	33.65	69.68	575.00	19,348.75	40,066.00	-
301367	怡和嘉业	2022-10-21	6 个月	新股锁定期内	119.88	175.78	223.00	26,733.24	39,198.94	-
301165	锐捷网络	2022-11-14	6 个月	新股锁定期内	32.38	31.61	1,077.00	34,873.26	34,043.97	-
301356	天振股份	2022-11-03	6 个月	新股锁定期内	63.00	43.33	614.00	38,682.00	26,604.62	-
301195	北路智控	2022-07-25	6 个月	新股锁定期内	71.17	73.04	330.00	23,486.10	24,103.20	-
301389	隆扬电子	2022-10-18	6 个月	新股锁定期内	22.50	17.16	1,269.00	28,552.50	21,776.04	-
301330	熵基科技	2022-08-10	6 个月	新股锁定期内	43.32	31.31	694.00	30,064.08	21,729.14	-
301152	天力锂能	2022-08-19	6 个月	新股锁定期内	57.00	46.64	433.00	24,681.00	20,195.12	-
301391	卡莱特	2022-11-24	6 个月	新股锁定期内	96.00	80.97	247.00	23,712.00	19,999.59	-
301349	信德新材	2022-08-30	6 个月	新股锁定期内	138.88	103.52	180.00	24,998.40	18,633.60	-
301171	易点天下	2022-08-10	6 个月	新股锁定	18.18	17.72	985.00	17,907.30	17,454.20	-

				期内						
301363	美好医疗	2022-09-28	6 个月	新股锁定期内	30.66	37.85	445.00	13,643.70	16,843.25	-
301115	建科股份	2022-08-23	6 个月	新股锁定期内	42.05	24.04	685.00	28,804.25	16,467.40	-
301296	新巨丰	2022-08-26	6 个月	新股锁定期内	18.19	14.90	1,042.00	18,953.98	15,525.80	-
301223	中荣股份	2022-10-13	6 个月	新股锁定期内	26.28	18.13	815.00	21,418.20	14,775.95	-
301121	紫建电子	2022-08-01	6 个月	新股锁定期内	61.07	49.77	290.00	17,710.30	14,433.30	-
301139	元道通信	2022-06-30	6 个月	新股锁定期内	38.46	25.31	566.00	21,768.36	14,325.46	-
301335	天元宠物	2022-11-11	6 个月	新股锁定期内	49.98	33.82	420.00	20,991.60	14,204.40	-
301230	泓博医药	2022-10-21	6 个月	新股锁定期内	40.00	48.32	269.00	10,760.00	12,998.08	-
301396	宏景科技	2022-11-04	6 个月	新股锁定期内	40.13	31.90	396.00	15,891.48	12,632.40	-
301338	凯格精机	2022-08-08	6 个月	新股锁定期内	46.33	48.99	257.00	11,906.81	12,590.43	-
301280	珠城科技	2022-12-19	6 个月	新股锁定期内	67.40	44.80	279.00	18,804.60	12,499.20	-
301365	矩阵股份	2022-11-14	6 个月	新股锁定期内	34.72	23.87	516.00	17,915.52	12,316.92	-
301366	一博科技	2022-09-19	6 个月	新股锁定期内	65.35	45.09	268.00	17,513.80	12,084.12	-
301290	东星医疗	2022-11-23	6 个月	新股锁定期内	44.09	35.13	330.00	14,549.70	11,592.90	-
30113	满坤	2022-	6 个月	新股	26.80	24.48	468.00	12,542	11,456	-

2	科技	08-03		锁定期内				.40	.64	
301379	天山电子	2022-10-19	6 个月	新股锁定期内	31.51	24.63	449.00	14,147.99	11,058.87	-
301282	金禄电子	2022-08-18	6 个月	新股锁定期内	30.38	25.25	434.00	13,184.92	10,958.50	-
301361	众智科技	2022-11-08	6 个月	新股锁定期内	26.44	20.96	517.00	13,669.48	10,836.32	-
301306	西测测试	2022-07-19	6 个月	新股锁定期内	43.23	42.29	255.00	11,023.65	10,783.95	-
301273	瑞晨环保	2022-10-11	6 个月	新股锁定期内	37.89	37.79	277.00	10,495.53	10,467.83	-
301265	华新环保	2022-12-08	6 个月	新股锁定期内	13.28	11.40	819.00	10,876.32	9,336.60	-
301176	逸豪新材	2022-09-21	6 个月	新股锁定期内	23.88	16.89	544.00	12,990.72	9,188.16	-
301318	维海德	2022-08-03	6 个月	新股锁定期内	64.68	41.74	206.00	13,324.08	8,598.44	-
301227	森鹰窗业	2022-09-16	6 个月	新股锁定期内	38.25	29.49	284.00	10,863.00	8,375.16	-
301326	捷邦科技	2022-09-09	6 个月	新股锁定期内	51.72	36.62	227.00	11,740.44	8,312.74	-
301197	工大科雅	2022-07-29	6 个月	新股锁定期内	25.50	20.08	380.00	9,690.00	7,630.40	-
301161	唯万密封	2022-09-06	6 个月	新股锁定期内	18.66	21.73	346.00	6,456.36	7,518.58	-
301313	凡拓数创	2022-09-22	6 个月	新股锁定期内	25.25	29.14	247.00	6,236.75	7,197.58	-
301285	鸿日达	2022-09-21	6 个月	新股锁定期内	14.60	12.60	565.00	8,249.00	7,119.00	-

301276	嘉曼服饰	2022-09-01	6 个月	新股锁定期内	40.66	22.61	303.00	12,319.98	6,850.83	-
301388	欣灵电气	2022-10-26	6 个月	新股锁定期内	25.88	21.60	292.00	7,556.96	6,307.20	-
301368	丰立智能	2022-12-07	6 个月	新股锁定期内	22.33	18.52	337.00	7,525.21	6,241.24	-
301300	远翔新材	2022-08-09	6 个月	新股锁定期内	36.15	29.37	211.00	7,627.65	6,197.07	-
301319	唯特偶	2022-09-22	6 个月	新股锁定期内	47.75	53.27	115.00	5,491.25	6,126.05	-
301270	汉仪股份	2022-08-19	6 个月	新股锁定期内	25.68	28.37	210.00	5,392.80	5,957.70	-
301231	荣信文化	2022-08-31	6 个月	新股锁定期内	25.49	20.38	275.00	7,009.75	5,604.50	-
301309	万得凯	2022-09-08	6 个月	新股锁定期内	39.00	24.46	228.00	8,892.00	5,576.88	-
301233	盛帮股份	2022-06-24	6 个月	新股锁定期内	41.52	34.30	158.00	6,560.16	5,419.40	-
301316	慧博云通	2022-09-29	6 个月	新股锁定期内	7.60	14.32	359.00	2,728.40	5,140.88	-

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 12 月 31 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 12 月 31 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出

回购金融资产款余额。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的融出证券。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。

本基金管理人制定了内部管理制度和流程来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人的风险管理体系包括三个层次：第一层次是基于自我评估和管理的业务/职能部门；第二层次是公司经营层的风险管理工作委员会；第三层次是董事会下设的风险管理委员会。

各业务/职能部门是公司风险管理工作最直接的实施者，负责根据公司风险管理政策和制度，制订本部门的风险管理计划、工作流程及相关管理责任，并报请风险管理工作委员会审议批准；对本部门的主要风险指标，以及相关的测量、管理方法提出建议，并及时更新，报请风险管理工作委员会审议批准；实施本部门的风险管理日常工作，定期进行自我评估，并向风险管理工作委员会报告评估情况。

风险管理工作委员会是公司经营层面负责风险管理的最高权力机构，根据公司董事会和风险管理工作委员会制订的风险管理政策和授权，负责公司日常的风险管理工作。

风险管理委员会是公司风险管理的最高权力机构，其机构组成、运行方式和相应职责应由董事会规定。

#### 7.4.13.2 信用风险

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

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

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

于 2022 年 12 月 31 日，本基金持有的除国债、地方政府债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.00%(2021 年 12 月 31 日：0.00%)。

### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

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

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

本基金本报告期末及上年度末均无重大流动性风险。

#### **7.4.13.4 市场风险**

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

##### **7.4.13.4.1 利率风险**

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为清算备付金、存出保证金及银行存款等。本基金通过监控组合的久期来评估基金面临的利率风险。

##### **7.4.13.4.1.1 利率风险敞口**

单位：人民币元

本期末 2022 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	136,391,203.68	-	-	-	-	-	136,391,203.68
结算备付金	4,526,965.32	-	-	-	-	-	4,526,965.32
存出保证金	304,034.81	-	-	-	-	-	304,034.81
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,085,311,478.53	1,085,311,478.53
应收申购款	-	-	-	-	-	18,899.17	18,899.17
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	141,222,203.81	-	-	-	-	1,085,330,377.70	1,226,552,581.51
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	172,730.92	172,730.92
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,598,061.81	1,598,061.81
应付托管费	-	-	-	-	-	266,343.63	266,343.63
其他负债	-	-	-	-	-	4,922,371.00	4,922,371.00
负债总计	-	-	-	-	-	6,959,507.36	6,959,507.36
利率敏感度缺口	141,222,203.81	-	-	-	-	1,078,370,870.34	1,219,593,074.15
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	193,523,752.77	-	-	-	-	-	193,523,752.77
结算备付金	3,534,786.49	-	-	-	-	-	3,534,786.49
存出保证金	304,998.17	-	-	-	-	-	304,998.17



交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,667,642,843.95	1,667,642,843.95
应收证券清算款	-	-	-	-	-	73,536.24	73,536.24
其他资产	-	-	-	-	-	40,507.13	40,507.13
应收申购款	-	-	-	-	-	22,029.12	22,029.12
资产总计	197,363,537.43	-	-	-	-	1,667,778,916.44	1,865,142,453.87
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	797,861.78	797,861.78
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,364,931.17	2,364,931.17
应付托管费	-	-	-	-	-	394,155.18	394,155.18
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	2,730,823.30	2,730,823.30
负债总计	-	-	-	-	-	6,287,771.43	6,287,771.43
利率敏感度缺口	197,363,537.43	-	-	-	-	1,661,491,145.01	1,858,854,682.44

注：上表统计了本基金交易的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本期末及上年度末持有的交易性固定收益类投资比例较低，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

本基金其他价格风险主要系市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投

资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金的基金管理人每日对投资组合的行业和个券的集中度进行监控，并定期分析其相对业绩比较基准的偏离度。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，通过压力测试来评估本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 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 2022 年 12 月 31 日		上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,085,311,478.53	88.99	1,667,642,843.95	89.71
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
合计	1,085,311,478.53	88.99	1,667,642,843.95	89.71

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	基金未来业绩表现相对业绩基准的波动性与其过去一年的整体水平保持一致。		
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 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 1%	增加约 11,215,877.90	增加约 19,949,580.92
	业绩比较基准下降 1%	减少约 11,215,877.90	减少约 19,949,580.92

注：上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

#### 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 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	1,082,376,779.82	1,665,111,160.37
第二层次	385,863.40	5,504.49
第三层次	2,548,835.31	2,526,179.09
合计	1,085,311,478.53	1,667,642,843.95

###### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

###### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

###### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	-	2,526,179.09	2,526,179.09
当期购买	-	2,161,755.87	2,161,755.87
当期出售/结算	-		-
转入第三层次	-		-

转出第三层次	-	2,427,833.62	2,427,833.62
当期利得或损失总额	-	288,733.97	288,733.97
其中：计入损益的利得或损失	-	288,733.97	288,733.97
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-		-
期末余额	-	2,548,835.31	2,548,835.31
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	-	387,079.44	387,079.44
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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	-	3,733,854.72	3,733,854.72
当期购买	-	1,589,348.43	1,589,348.43
当期出售/结算	-	1,270,972.69	1,270,972.69
转入第三层次	-		-
转出第三层次	-	2,478,128.68	2,478,128.68
当期利得或损失总额	-	952,077.31	952,077.31

其中：计入损益的利得或损失	-	952,077.31	952,077.31
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-		-
期末余额	-	2,526,179.09	2,526,179.09
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	-	936,830.66	936,830.66

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	2,548,835.31	平均价格亚式期权模型	股票在剩余限售期内的股价的预期年化波动率	0.1891-2.4756	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	2,526,179.09	平均价格亚式期权模型	股票在剩余限售期内的股价的预期年化波动率	0.2927-2.2471	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金

融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

##### 7.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

##### 7.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2023 年 3 月 30 日经本基金的基金管理人批准。

## §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	1,085,311,478.53	88.48
	其中：股票	1,085,311,478.53	88.48
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	140,918,169.00	11.49
8	其他各项资产	322,933.98	0.03
9	合计	1,226,552,581.51	100.00

## 8.2 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

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	8,965,988.00	0.74
B	采矿业	25,855,886.46	2.12
C	制造业	631,827,416.53	51.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	18,084,570.33	1.48
E	建筑业	17,732,998.50	1.45
F	批发和零售业	81,486,618.54	6.68
G	交通运输、仓储和邮政业	54,123,274.48	4.44
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	48,622,943.98	3.99
J	金融业	70,558,691.18	5.79
K	房地产业	34,447,789.58	2.82
L	租赁和商务服务业	10,404,780.50	0.85
M	科学研究和技术服务业	4,598,728.11	0.38
N	水利、环境和公共设施管理业	8,572,959.84	0.70
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	8,724,224.00	0.72
Q	卫生和社会工作	109,167.90	0.01
R	文化、体育和娱乐业	61,195,440.60	5.02
S	综合	-	-
	合计	1,085,311,478.53	88.99

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通股票。

## 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	000970	中科三环	696,700	9,502,988.00	0.78
2	603527	众源新材	671,000	9,447,680.00	0.77
3	002434	万里扬	1,158,300	9,324,315.00	0.76
4	603696	安记食品	860,800	9,313,856.00	0.76
5	002494	华斯股份	1,912,300	9,293,778.00	0.76
6	688070	纵横股份	219,391	9,273,657.57	0.76
7	600562	国睿科技	543,100	9,205,545.00	0.75
8	600865	百大集团	958,286	9,199,545.60	0.75
9	300481	濮阳惠成	343,800	9,189,774.00	0.75
10	600628	新世界	1,198,900	9,159,596.00	0.75
11	601318	中国平安	194,885	9,159,595.00	0.75
12	603081	大丰实业	731,900	9,119,474.00	0.75
13	600976	健民集团	182,980	9,092,276.20	0.75
14	002824	和胜股份	307,600	9,080,352.00	0.74
15	600936	广西广电	2,506,800	9,074,616.00	0.74
16	600824	益民集团	2,297,900	9,030,747.00	0.74
17	002633	申科股份	911,000	9,028,010.00	0.74
18	002996	顺博合金	688,800	8,975,064.00	0.74
19	600097	开创国际	835,600	8,965,988.00	0.74
20	300337	银邦股份	1,155,100	8,963,576.00	0.73
21	600697	欧亚集团	639,800	8,944,404.00	0.73
22	000501	鄂武商 A	798,100	8,938,720.00	0.73
23	600757	长江传媒	1,565,600	8,923,920.00	0.73
24	000429	粤高速 A	1,136,700	8,888,994.00	0.73
25	601900	南方传媒	1,067,191	8,868,357.21	0.73
26	300445	康斯特	725,000	8,845,000.00	0.73
27	603992	松霖科技	568,400	8,832,936.00	0.72
28	601595	上海电影	802,800	8,806,716.00	0.72
29	000601	韶能股份	1,870,500	8,791,350.00	0.72
30	603655	朗博科技	352,900	8,787,210.00	0.72
31	603988	中电电机	944,500	8,774,405.00	0.72
32	601000	唐山港	3,201,472	8,772,033.28	0.72
33	600373	中文传媒	916,200	8,768,034.00	0.72
34	000026	飞亚达	837,200	8,740,368.00	0.72
35	000700	模塑科技	1,882,800	8,736,192.00	0.72
36	000156	华数传媒	1,166,195	8,734,800.55	0.72
37	601518	吉林高速	2,999,300	8,727,963.00	0.72
38	603377	东方时尚	1,356,800	8,724,224.00	0.72



39	600548	深高速	971,400	8,723,172.00	0.72
40	600057	厦门象屿	848,900	8,718,203.00	0.71
41	603088	宁波精达	1,210,792	8,717,702.40	0.71
42	600966	博汇纸业	980,300	8,714,867.00	0.71
43	300713	英可瑞	687,100	8,698,686.00	0.71
44	000655	金岭矿业	1,313,100	8,692,722.00	0.71
45	600901	江苏租赁	1,583,000	8,674,840.00	0.71
46	002879	长缆科技	629,040	8,674,461.60	0.71
47	301302	华如科技	135,439	8,672,159.17	0.71
48	000565	渝三峡 A	1,476,389	8,666,403.43	0.71
49	000922	佳电股份	965,900	8,664,123.00	0.71
50	300231	银信科技	1,187,200	8,654,688.00	0.71
51	300691	联合光电	696,100	8,652,523.00	0.71
52	688030	山石网科	443,800	8,636,348.00	0.71
53	002902	铭普光磁	686,600	8,630,562.00	0.71
54	600551	时代出版	846,300	8,615,334.00	0.71
55	603697	有友食品	692,200	8,610,968.00	0.71
56	600337	美克家居	3,052,900	8,609,178.00	0.71
57	002333	罗普斯金	1,580,100	8,595,744.00	0.70
58	603316	诚邦股份	1,504,900	8,577,930.00	0.70
59	600617	国新能源	2,115,946	8,569,581.30	0.70
60	600897	厦门空港	511,600	8,569,300.00	0.70
61	002887	绿茵生态	1,010,400	8,568,192.00	0.70
62	600519	贵州茅台	4,960	8,565,920.00	0.70
63	600755	厦门国贸	1,198,900	8,560,146.00	0.70
64	300930	屹通新材	354,700	8,555,364.00	0.70
65	300645	正元智慧	339,700	8,553,646.00	0.70
66	300270	中威电子	1,615,900	8,548,111.00	0.70
67	002892	科力尔	779,900	8,539,905.00	0.70
68	688313	仕佳光子	942,537	8,529,959.85	0.70
69	002753	永东股份	1,018,800	8,517,168.00	0.70
70	300980	祥源新材	485,650	8,513,444.50	0.70
71	300978	东箭科技	761,900	8,502,804.00	0.70
72	000563	陕国投 A	2,802,659	8,492,056.77	0.70
73	601512	中新集团	1,061,900	8,484,581.00	0.70
74	002026	山东威达	894,200	8,477,016.00	0.70
75	600281	华阳新材	1,912,300	8,471,489.00	0.69
76	601999	出版传媒	1,293,200	8,470,460.00	0.69
77	600398	海澜之家	1,597,800	8,468,340.00	0.69
78	600156	华升股份	1,784,601	8,459,008.74	0.69
79	603269	海鸥股份	684,900	8,458,515.00	0.69
80	300733	西菱动力	409,000	8,458,120.00	0.69
81	603926	铁流股份	932,208	8,445,804.48	0.69
82	605086	龙高股份	439,000	8,437,580.00	0.69

83	603389	亚振家居	1,625,100	8,434,269.00	0.69
84	603221	爱丽家居	1,046,300	8,433,178.00	0.69
85	002811	郑中设计	1,167,800	8,431,516.00	0.69
86	605158	华达新材	1,315,120	8,416,768.00	0.69
87	600638	新黄浦	1,489,162	8,413,765.30	0.69
88	000910	大亚圣象	985,900	8,399,868.00	0.69
89	600064	南京高科	1,270,200	8,396,022.00	0.69
90	002577	雷柏科技	749,200	8,391,040.00	0.69
91	300403	汉宇集团	1,417,600	8,363,840.00	0.69
92	603528	多伦科技	1,295,200	8,354,040.00	0.68
93	002787	华源控股	1,383,166	8,340,490.98	0.68
94	603790	雅运股份	829,890	8,307,198.90	0.68
95	603838	四通股份	1,424,700	8,277,507.00	0.68
96	301005	超捷股份	325,336	8,227,747.44	0.67
97	600889	南京化纤	1,650,200	8,217,996.00	0.67
98	600724	宁波富达	2,243,600	8,189,140.00	0.67
99	002481	双塔食品	1,305,100	8,169,926.00	0.67
100	600895	张江高科	715,900	8,118,306.00	0.67
101	603055	台华新材	801,900	8,099,190.00	0.66
102	601816	京沪高铁	1,610,300	7,922,676.00	0.65
103	000651	格力电器	234,500	7,579,040.00	0.62
104	600030	中信证券	359,710	7,161,826.10	0.59
105	600919	江苏银行	961,102	7,006,433.58	0.57
106	601138	工业富联	746,900	6,856,542.00	0.56
107	603288	海天味业	71,880	5,721,648.00	0.47
108	300750	宁德时代	14,300	5,625,906.00	0.46
109	601328	交通银行	1,141,600	5,411,184.00	0.44
110	603326	我乐家居	624,392	4,982,648.16	0.41
111	600309	万华化学	53,077	4,917,584.05	0.40
112	000425	徐工机械	960,400	4,869,228.00	0.40
113	002812	恩捷股份	36,800	4,831,472.00	0.40
114	600741	华域汽车	273,300	4,736,289.00	0.39
115	300124	汇川技术	65,900	4,580,050.00	0.38
116	603259	药明康德	55,992	4,535,352.00	0.37
117	600276	恒瑞医药	114,700	4,419,391.00	0.36
118	600015	华夏银行	811,200	4,210,128.00	0.35
119	601169	北京银行	886,000	3,818,660.00	0.31
120	000895	双汇发展	147,230	3,817,673.90	0.31
121	000858	五粮液	20,230	3,655,358.70	0.30
122	603185	上机数控	33,100	3,503,635.00	0.29
123	601377	兴业证券	589,400	3,383,156.00	0.28
124	600019	宝钢股份	586,500	3,278,535.00	0.27
125	688008	澜起科技	50,900	3,186,340.00	0.26
126	601899	紫金矿业	314,000	3,140,000.00	0.26

127	601838	成都银行	202,100	3,092,130.00	0.25
128	601728	中国电信	733,600	3,073,784.00	0.25
129	600104	上汽集团	213,100	3,070,771.00	0.25
130	601601	中国太保	123,557	3,029,617.64	0.25
131	600547	山东黄金	155,500	2,979,380.00	0.24
132	603806	福斯特	44,800	2,976,512.00	0.24
133	000338	潍柴动力	269,800	2,746,564.00	0.23
134	601166	兴业银行	151,000	2,656,090.00	0.22
135	002938	鹏鼎控股	91,798	2,518,937.12	0.21
136	002352	顺丰控股	43,500	2,512,560.00	0.21
137	300595	欧普康视	64,300	2,295,510.00	0.19
138	000708	中信特钢	133,200	2,285,712.00	0.19
139	600887	伊利股份	72,508	2,247,748.00	0.18
140	600690	海尔智家	84,627	2,069,976.42	0.17
141	000938	紫光股份	102,660	2,002,896.60	0.16
142	600176	中国巨石	143,575	1,968,413.25	0.16
143	605117	德业股份	5,800	1,920,960.00	0.16
144	600036	招商银行	50,335	1,875,482.10	0.15
145	600183	生益科技	126,900	1,828,629.00	0.15
146	601888	中国中免	7,800	1,685,034.00	0.14
147	603501	韦尔股份	21,600	1,665,144.00	0.14
148	301180	万祥科技	101,154	1,663,983.30	0.14
149	600028	中国石化	344,100	1,500,276.00	0.12
150	000063	中兴通讯	51,500	1,331,790.00	0.11
151	600426	华鲁恒升	40,139	1,330,607.85	0.11
152	688271	联影医疗	7,365	1,264,423.20	0.10
153	002236	大华股份	111,200	1,257,672.00	0.10
154	000963	华东医药	25,600	1,198,080.00	0.10
155	600346	恒力石化	73,600	1,143,008.00	0.09
156	300496	中科创达	11,300	1,133,390.00	0.09
157	600188	兖矿能源	32,856	1,103,304.48	0.09
158	002050	三花智控	51,000	1,082,220.00	0.09
159	601998	中信银行	211,240	1,051,975.20	0.09
160	000069	华侨城 A	193,700	1,032,421.00	0.08
161	600362	江西铜业	58,372	1,017,423.96	0.08
162	002049	紫光国微	7,171	945,281.22	0.08
163	603369	今世缘	16,247	826,972.30	0.07
164	601688	华泰证券	63,800	812,812.00	0.07
165	301023	江南奕帆	20,855	747,651.75	0.06
166	688599	天合光能	11,700	745,992.00	0.06
167	300408	三环集团	24,200	743,182.00	0.06
168	601668	中国建筑	133,200	723,276.00	0.06
169	600660	福耀玻璃	20,500	718,935.00	0.06
170	600900	长江电力	34,200	718,200.00	0.06

171	002802	洪汇新材	46,040	665,738.40	0.05
172	601336	新华保险	21,100	634,688.00	0.05
173	002415	海康威视	18,300	634,644.00	0.05
174	600219	南山铝业	189,800	620,646.00	0.05
175	601100	恒立液压	9,400	593,610.00	0.05
176	300274	阳光电源	5,200	581,360.00	0.05
177	688475	萤石网络	20,526	532,239.18	0.04
178	000661	长春高新	2,900	482,705.00	0.04
179	002594	比亚迪	1,800	462,546.00	0.04
180	688506	百利天恒	15,622	385,863.40	0.03
181	600845	宝信软件	8,048	360,550.40	0.03
182	688617	惠泰医疗	991	304,167.63	0.02
183	300896	爱美客	480	271,848.00	0.02
184	600585	海螺水泥	8,700	238,206.00	0.02
185	002653	海思科	10,237	227,773.25	0.02
186	600600	青岛啤酒	1,580	169,850.00	0.01
187	688639	华恒生物	854	132,583.50	0.01
188	301280	珠城科技	2,783	132,065.20	0.01
189	688410	山外山	4,853	115,452.87	0.01
190	000568	泸州老窖	488	109,448.64	0.01
191	301269	华大九天	1,168	102,713.92	0.01
192	688112	鼎阳科技	1,033	96,327.25	0.01
193	688291	金橙子	3,961	95,499.71	0.01
194	601136	首创证券	4,739	82,553.38	0.01
195	688244	永信至诚	1,506	75,510.84	0.01
196	688525	佰维存储	4,614	74,100.84	0.01
197	688012	中微公司	754	73,899.54	0.01
198	001301	尚太科技	1,164	68,722.56	0.01
199	301267	华夏眼科	1,006	66,597.20	0.01
200	301095	广立微	740	64,002.60	0.01
201	688005	容百科技	894	61,462.50	0.01
202	300260	新莱应材	889	59,651.90	0.00
203	301327	华宝新能	317	56,945.49	0.00
204	688082	盛美上海	670	53,533.00	0.00
205	301308	江波龙	819	46,453.68	0.00
206	688295	中复神鹰	1,019	43,990.23	0.00
207	301165	锐捷网络	1,269	40,593.09	0.00
208	301367	怡和嘉业	229	40,516.36	0.00
209	301239	普瑞眼科	575	40,066.00	0.00
210	300751	迈为股份	80	32,947.20	0.00
211	002460	赣锋锂业	456	31,696.56	0.00
212	301391	卡莱特	370	30,516.09	0.00
213	301356	天振股份	614	26,604.62	0.00
214	688385	复旦微电	363	25,341.03	0.00

215	301152	天力锂能	526	24,677.72	0.00
216	002821	凯莱英	165	24,420.00	0.00
217	301195	北路智控	330	24,103.20	0.00
218	301330	熵基科技	737	23,115.03	0.00
219	002831	裕同科技	672	22,223.04	0.00
220	301389	隆扬电子	1,290	22,160.34	0.00
221	002459	晶澳科技	368	22,113.12	0.00
222	301349	信德新材	198	20,621.88	0.00
223	600809	山西汾酒	71	20,234.29	0.00
224	000408	藏格矿业	778	20,204.66	0.00
225	301171	易点天下	1,045	18,576.80	0.00
226	301115	建科股份	750	18,081.35	0.00
227	688126	沪硅产业	966	17,011.26	0.00
228	301363	美好医疗	447	16,927.07	0.00
229	301296	新巨丰	1,111	16,591.85	0.00
230	688123	聚辰股份	158	15,989.60	0.00
231	301365	矩阵股份	660	15,954.36	0.00
232	301223	中荣股份	848	15,396.35	0.00
233	601012	隆基绿能	352	14,875.52	0.00
234	301121	紫建电子	290	14,433.30	0.00
235	301139	元道通信	566	14,325.46	0.00
236	301335	天元宠物	420	14,204.40	0.00
237	301230	泓博医药	287	13,959.64	0.00
238	301273	瑞晨环保	361	13,917.71	0.00
239	301282	金禄电子	533	13,559.23	0.00
240	688303	大全能源	282	13,445.76	0.00
241	301338	凯格精机	268	13,150.99	0.00
242	300452	山河药辅	750	13,140.00	0.00
243	301396	宏景科技	396	12,632.40	0.00
244	301366	一博科技	272	12,271.72	0.00
245	301379	天山电子	481	11,878.07	0.00
246	301290	东星医疗	330	11,592.90	0.00
247	688686	奥普特	87	11,484.00	0.00
248	301132	满坤科技	468	11,456.64	0.00
249	300502	新易盛	461	10,948.75	0.00
250	688559	海目星	188	10,873.92	0.00
251	301361	众智科技	517	10,836.32	0.00
252	301306	西测测试	255	10,783.95	0.00
253	301176	逸豪新材	631	10,709.79	0.00
254	603019	中科曙光	479	10,605.06	0.00
255	301227	森鹰窗业	340	10,097.16	0.00
256	603833	欧派家居	82	9,965.46	0.00
257	301326	捷邦科技	264	9,742.05	0.00
258	301265	华新环保	819	9,336.60	0.00

259	301300	远翔新材	307	9,108.75	0.00
260	688363	华熙生物	65	8,793.20	0.00
261	301318	维海德	206	8,598.44	0.00
262	301270	汉仪股份	295	8,524.70	0.00
263	688218	江苏北人	554	8,243.52	0.00
264	301285	鸿日达	643	8,145.48	0.00
265	688122	西部超导	86	8,143.34	0.00
266	301319	唯特偶	149	8,103.15	0.00
267	300672	国科微	93	7,909.65	0.00
268	301161	唯万密封	360	7,847.58	0.00
269	301313	凡拓数创	264	7,752.97	0.00
270	301197	工大科雅	380	7,630.40	0.00
271	300861	美畅股份	151	7,423.16	0.00
272	301276	嘉曼服饰	326	7,386.50	0.00
273	603688	石英股份	56	7,353.92	0.00
274	301231	荣信文化	344	7,052.12	0.00
275	301309	万得凯	271	6,652.74	0.00
276	301388	欣灵电气	292	6,307.20	0.00
277	301368	丰立智能	337	6,241.24	0.00
278	603986	兆易创新	60	6,148.20	0.00
279	688037	芯源微	39	6,103.50	0.00
280	301316	慧博云通	384	5,620.63	0.00
281	300438	鹏辉能源	72	5,615.28	0.00
282	603392	万泰生物	44	5,574.80	0.00
283	301233	盛帮股份	158	5,419.40	0.00
284	002916	深南电路	72	5,194.80	0.00
285	002304	洋河股份	32	5,136.00	0.00
286	300661	圣邦股份	29	5,005.40	0.00
287	001269	欧晶科技	46	4,565.04	0.00
288	002410	广联达	76	4,556.20	0.00
289	300613	富瀚微	88	4,411.44	0.00
290	002518	科士达	76	4,377.60	0.00
291	300735	光弘科技	460	4,084.80	0.00
292	603255	鼎际得	89	3,996.10	0.00
293	301258	富士莱	95	3,728.75	0.00
294	001333	光华股份	126	3,647.70	0.00
295	301179	泽宇智能	95	3,626.15	0.00
296	301099	雅创电子	51	3,515.43	0.00
297	603209	兴通股份	95	3,450.40	0.00
298	300604	长川科技	75	3,343.50	0.00
299	688386	泛亚微透	59	3,271.55	0.00
300	688489	三未信安	32	3,242.56	0.00
301	301193	家联科技	97	3,211.67	0.00
302	300482	万孚生物	99	3,155.13	0.00

303	001338	永顺泰	149	3,146.88	0.00
304	688503	聚和材料	21	3,131.31	0.00
305	301207	华兰疫苗	69	3,076.02	0.00
306	301162	国能日新	34	2,985.88	0.00
307	002555	三七互娱	162	2,932.20	0.00
308	603819	神力股份	184	2,782.08	0.00
309	603899	晨光股份	50	2,749.00	0.00
310	301108	洁雅股份	80	2,700.80	0.00
311	301263	泰恩康	82	2,665.00	0.00
312	603613	国联股份	30	2,653.20	0.00
313	300856	科思股份	50	2,607.50	0.00
314	688189	南新制药	148	2,554.48	0.00
315	001331	胜通能源	85	2,501.55	0.00
316	601022	宁波远洋	183	2,470.50	0.00
317	301166	优宁维	53	2,423.69	0.00
318	603233	大参林	60	2,376.00	0.00
319	301219	腾远钴业	34	2,343.62	0.00
320	301021	英诺激光	90	2,321.10	0.00
321	600926	杭州银行	171	2,236.68	0.00
322	301200	大族数控	57	2,234.40	0.00
323	301248	杰创智能	72	2,194.56	0.00
324	001238	浙江正特	74	2,136.38	0.00
325	301279	金道科技	96	2,113.92	0.00
326	301168	通灵股份	29	2,098.73	0.00
327	688981	中芯国际	51	2,098.14	0.00
328	301268	铭利达	41	2,058.61	0.00
329	300327	中颖电子	58	2,051.46	0.00
330	301181	标榜股份	57	2,038.32	0.00
331	301163	宏德股份	77	2,024.33	0.00
332	301049	超越科技	96	2,022.72	0.00
333	603087	甘李药业	60	1,954.80	0.00
334	600639	浦东金桥	174	1,931.40	0.00
335	301091	深城交	81	1,927.80	0.00
336	002179	中航光电	32	1,848.32	0.00
337	301133	金钟股份	86	1,800.84	0.00
338	301182	凯旺科技	94	1,769.08	0.00
339	301206	三元生物	45	1,755.00	0.00
340	688330	宏力达	27	1,719.36	0.00
341	301060	兰卫医学	87	1,706.07	0.00
342	301072	中捷精工	81	1,660.50	0.00
343	603317	天味食品	60	1,648.80	0.00
344	605123	派克新材	12	1,594.80	0.00
345	002920	德赛西威	15	1,580.10	0.00
346	301259	艾布鲁	83	1,577.00	0.00

347	002057	中钢天源	150	1,575.00	0.00
348	300775	三角防务	41	1,558.00	0.00
349	301111	粤万年青	79	1,549.98	0.00
350	301102	兆讯传媒	42	1,543.50	0.00
351	301050	雷电微力	20	1,543.40	0.00
352	603057	紫燕食品	49	1,542.03	0.00
353	001299	美能能源	76	1,535.20	0.00
354	688707	振华新材	34	1,528.30	0.00
355	301016	雷尔伟	75	1,479.00	0.00
356	301015	百洋医药	62	1,478.08	0.00
357	603599	广信股份	50	1,470.00	0.00
358	601088	中国神华	53	1,463.86	0.00
359	001322	箭牌家居	95	1,444.00	0.00
360	301089	拓新药业	20	1,440.00	0.00
361	688022	瀚川智能	28	1,355.20	0.00
362	301190	善水科技	75	1,348.50	0.00
363	001236	弘业期货	99	1,341.45	0.00
364	002738	中矿资源	20	1,333.20	0.00
365	603150	万朗磁塑	51	1,324.47	0.00
366	603097	江苏华辰	77	1,315.93	0.00
367	301058	中粮工科	86	1,285.70	0.00
368	001229	魅视科技	47	1,261.48	0.00
369	001231	农心科技	55	1,245.20	0.00
370	300570	太辰光	85	1,229.10	0.00
371	600596	新安股份	80	1,211.20	0.00
372	301185	鸥玛软件	78	1,187.16	0.00
373	603237	五芳斋	25	1,178.75	0.00
374	301027	华蓝集团	86	1,161.00	0.00
375	601001	晋控煤业	97	1,160.12	0.00
376	301053	远信工业	55	1,115.95	0.00
377	603387	基蛋生物	88	1,100.00	0.00
378	603211	晋拓股份	87	1,092.72	0.00
379	301059	金三江	59	1,091.50	0.00
380	301236	软通动力	31	1,090.58	0.00
381	603191	望变电气	49	1,088.78	0.00
382	301130	西点药业	37	1,068.19	0.00
383	603612	索通发展	41	1,066.82	0.00
384	301189	奥尼电子	35	1,000.30	0.00
385	001300	三柏硕	63	976.50	0.00
386	301126	达嘉维康	62	923.18	0.00
387	001258	立新能源	88	920.48	0.00
388	603529	爱玛科技	20	917.40	0.00
389	601878	浙商证券	91	903.63	0.00
390	688556	高测股份	12	900.24	0.00



391	002497	雅化集团	38	883.50	0.00
392	301288	清研环境	52	865.80	0.00
393	301048	金鹰重工	99	843.48	0.00
394	301055	张小泉	55	837.10	0.00
395	603182	嘉华股份	46	823.86	0.00
396	001330	博纳影业	64	766.72	0.00
397	600848	上海临港	64	762.88	0.00
398	688268	华特气体	10	742.50	0.00
399	603272	联翔股份	43	742.18	0.00
400	603151	邦基科技	35	736.40	0.00
401	301079	邵阳液压	40	732.40	0.00
402	688561	奇安信	11	723.47	0.00
403	688143	长盈通	15	699.30	0.00
404	600096	云天化	33	694.32	0.00
405	600328	中盐化工	45	661.05	0.00
406	301090	华润材料	64	643.84	0.00
407	301188	力诺特玻	47	640.14	0.00
408	301092	争光股份	23	619.62	0.00
409	688516	奥特维	3	603.00	0.00
410	301109	军信股份	38	601.16	0.00
411	301120	新特电气	32	595.52	0.00
412	301137	哈焊华通	44	585.64	0.00
413	300244	迪安诊断	23	577.99	0.00
414	002258	利尔化学	32	574.72	0.00
415	301216	万凯新材	20	573.60	0.00
416	601881	中国银河	61	566.69	0.00
417	601919	中远海控	55	565.95	0.00
418	301056	森赫股份	72	547.92	0.00
419	301212	联盛化学	16	531.68	0.00
420	601615	明阳智能	21	530.46	0.00
421	603227	雪峰科技	60	497.40	0.00
422	600025	华能水电	73	481.80	0.00
423	688498	源杰科技	4	478.12	0.00
424	002825	纳尔股份	40	476.80	0.00
425	301118	恒光股份	15	453.15	0.00
426	301039	中集车辆	51	406.47	0.00
427	601677	明泰铝业	22	399.08	0.00
428	301057	汇隆新材	18	362.34	0.00
429	688191	智洋创新	28	355.04	0.00
430	301020	密封科技	21	350.49	0.00
431	301148	嘉戎技术	16	345.76	0.00
432	600360	华微电子	50	329.50	0.00
433	002645	华宏科技	21	313.11	0.00
434	301237	和顺科技	10	295.30	0.00

435	300932	三友联众	20	287.00	0.00
436	301256	华融化学	31	276.52	0.00
437	301150	中一科技	4	258.04	0.00
438	600218	全柴动力	29	251.72	0.00
439	000625	长安汽车	20	246.20	0.00
440	001339	智微智能	12	244.08	0.00
441	301082	久盛电气	15	231.60	0.00
442	301093	华兰股份	9	228.60	0.00
443	301215	中汽股份	43	222.31	0.00
444	688480	赛恩斯	10	221.20	0.00
445	301103	何氏眼科	7	220.64	0.00
446	601916	浙商银行	74	217.56	0.00
447	688009	中国通号	42	201.18	0.00
448	000001	平安银行	15	197.40	0.00
449	301062	上海艾录	23	179.40	0.00
450	301083	百胜智能	16	176.64	0.00
451	000553	安道麦 A	19	171.95	0.00
452	603176	汇通集团	24	166.32	0.00
453	603327	福蓉科技	10	160.90	0.00
454	002953	日丰股份	11	156.97	0.00
455	603206	嘉环科技	10	152.90	0.00
456	301149	隆华新材	14	152.60	0.00
457	301098	金埔园林	7	110.18	0.00
458	001298	好上好	3	107.04	0.00
459	600873	梅花生物	10	101.80	0.00
460	603535	嘉诚国际	5	89.35	0.00
461	301088	戎美股份	4	69.32	0.00
462	301013	利和兴	7	61.67	0.00
463	300596	利安隆	1	54.57	0.00
464	300405	科隆股份	10	53.50	0.00
465	603086	先达股份	4	52.36	0.00
466	601678	滨化股份	10	51.40	0.00
467	301151	冠龙节能	3	51.03	0.00
468	301199	迈赫股份	2	39.82	0.00
469	301081	严牌股份	3	34.62	0.00
470	300998	宁波方正	1	25.32	0.00
471	300322	硕贝德	2	14.38	0.00
472	002284	亚太股份	2	14.16	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	600519	贵州茅台	113,704,456.86	6.12
2	002460	赣锋锂业	69,792,697.06	3.75
3	600919	江苏银行	63,066,120.10	3.39
4	600030	中信证券	60,108,874.34	3.23
5	601319	中国人保	59,339,962.08	3.19
6	002008	大族激光	57,405,972.11	3.09
7	002821	凯莱英	57,262,354.84	3.08
8	002594	比亚迪	54,172,602.54	2.91
9	300481	濮阳惠成	53,910,177.00	2.90
10	300316	晶盛机电	49,023,239.44	2.64
11	002352	顺丰控股	48,650,967.49	2.62
12	002812	恩捷股份	48,450,413.17	2.61
13	600900	长江电力	46,034,893.00	2.48
14	688012	中微公司	45,413,538.47	2.44
15	688303	大全能源	45,331,338.83	2.44
16	601318	中国平安	45,065,450.61	2.42
17	601166	兴业银行	42,236,461.51	2.27
18	002466	天齐锂业	42,188,974.64	2.27
19	603392	万泰生物	41,628,312.74	2.24
20	601615	明阳智能	41,626,279.28	2.24
21	002085	万丰奥威	40,891,535.80	2.20
22	600176	中国巨石	40,414,626.25	2.17
23	603086	先达股份	40,407,282.66	2.17
24	688122	西部超导	40,316,559.66	2.17
25	002304	洋河股份	40,301,587.40	2.17
26	601881	中国银河	40,281,907.48	2.17
27	603259	药明康德	40,169,407.83	2.16
28	600328	中盐化工	38,901,644.25	2.09
29	002049	紫光国微	37,797,453.82	2.03
30	300260	新莱应材	37,190,214.87	2.00

8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	105,306,325.34	5.67

2	600438	通威股份	102,772,248.38	5.53
3	600030	中信证券	87,346,264.27	4.70
4	300750	宁德时代	82,960,221.38	4.46
5	600690	海尔智家	73,282,794.57	3.94
6	000725	京东方 A	65,721,672.00	3.54
7	600426	华鲁恒升	64,956,720.66	3.49
8	601319	中国人保	63,632,391.00	3.42
9	600919	江苏银行	63,417,273.50	3.41
10	002460	赣锋锂业	63,182,548.14	3.40
11	600176	中国巨石	62,692,818.70	3.37
12	300316	晶盛机电	54,363,794.64	2.92
13	600132	重庆啤酒	52,033,829.22	2.80
14	300260	新莱应材	51,487,746.78	2.77
15	000568	泸州老窖	51,417,268.01	2.77
16	688122	西部超导	50,519,406.84	2.72
17	000063	中兴通讯	50,191,105.33	2.70
18	002594	比亚迪	49,453,691.00	2.66
19	601658	邮储银行	49,374,577.00	2.66
20	688111	金山办公	48,904,647.43	2.63
21	601615	明阳智能	48,540,323.98	2.61
22	002821	凯莱英	48,324,012.64	2.60
23	002709	天赐材料	47,291,774.88	2.54
24	688303	大全能源	46,762,113.37	2.52
25	603086	先达股份	46,519,836.00	2.50
26	601939	建设银行	46,049,371.00	2.48
27	002410	广联达	45,973,121.83	2.47
28	002352	顺丰控股	45,605,497.47	2.45
29	601088	中国神华	43,652,347.32	2.35
30	603986	兆易创新	43,378,470.58	2.33
31	688981	中芯国际	43,171,628.46	2.32
32	600900	长江电力	43,111,148.92	2.32
33	002008	大族激光	41,449,753.62	2.23
34	601919	中远海控	40,883,899.10	2.20
35	002466	天齐锂业	40,760,545.80	2.19
36	603392	万泰生物	40,353,533.14	2.17
37	002518	科士达	40,290,350.00	2.17
38	002304	洋河股份	39,992,260.00	2.15
39	600328	中盐化工	39,904,346.49	2.15
40	688012	中微公司	39,416,513.40	2.12
41	600036	招商银行	38,689,136.80	2.08
42	603688	石英股份	38,127,393.02	2.05
43	601398	工商银行	37,726,690.00	2.03
44	600809	山西汾酒	37,693,683.19	2.03
45	002085	万丰奥威	37,598,423.00	2.02

46	002850	科达利	37,350,378.25	2.01
47	300481	濮阳惠成	37,252,485.00	2.00
48	002812	恩捷股份	37,195,770.50	2.00

#### 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

买入股票的成本（成交）总额	7,664,109,097.02
卖出股票的收入（成交）总额	7,820,401,282.39

注：8.4.1 项“买入金额”、8.4.2 项“卖出金额”及 8.4.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.5 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投资贵金属。

#### 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

根据本基金基金合同，本基金不能投资于股指期货。

#### 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

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

##### 8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金本报告期末投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到证监会、证券交易所公开谴责、处罚的情况。

8.12.2 本基金未投资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	304,034.81
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	18,899.17
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	322,933.98

### 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的情况。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
80,746	16,301.95	196,525,745.59	14.93%	1,119,791,713.76	85.07%

### 9.2 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	498,646.11	0.04%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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	10~50

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人均未持有本基金的份额。

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2004年8月27日)基金份额总额	2,544,287,215.94
本报告期期初基金份额总额	1,289,385,962.14
本报告期基金总申购份额	462,096,233.11
减：本报告期基金总赎回份额	435,164,735.90
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,316,317,459.35

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

## 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，经公司十一届五次董事会会议审议通过，自 2022 年 11 月 1 日起，翟昱磊女士正式离任公司首席市场总监；经公司十一届六次董事会会议审议通过，自 2022 年 12 月 20 日起，盛松先生正式离任公司副总经理。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

## 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

## 11.4 基金投资策略的改变

本基金在本报告期内的投资策略未发生改变。

## 11.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本基金报告期内未持有基金。

## 11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未发生改聘为其审计的会计师事务所情况。报告年度应支付给聘任安永华明会计师事务所的报酬为 10 万元，目前该审计机构已提供审计服务的连续年限为 18 年。

## 11.7 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	光大保德信基金管理有限公司
受到稽查或处罚等措施的时间	2022-01-13
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会上海监管局
受到的具体措施类型	管理人及相关人员收到责令改正、警示函的行政监管措施
受到稽查或处罚等措施的原因	个别产品定位待进一步明确、相关流程待改进
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司全面梳理及完善管控机制、优化相关流程，已落实整改方案并通过验收。
其他	-

### 11.7.1 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，本基金托管人的托管业务部门及其高级管理人员未有受监管部门稽查或处罚的情形发生。

## 11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.8.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

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



	单元数量	成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中国银河证券股份有限公司	2	651,527.07	0.00%	606.71	0.00%	-
平安证券股份有限公司	1	5,844,262.75	0.04%	5,326.05	0.04%	-
广发证券公司	1	373,701,872.42	2.42%	340,579.06	2.58%	-
兴业证券	1	485,384,754.17	3.14%	454,460.26	3.44%	-
申万宏源证券有限公司	2	562,530,144.90	3.64%	293,260.36	2.22%	-
长江证券股份有限公司	1	576,869,479.07	3.74%	537,244.43	4.06%	-
中信建投证券股份有限公司	3	749,424,866.55	4.86%	383,183.66	2.90%	-
恒泰证券	1	1,123,505,016.28	7.28%	803,848.77	6.08%	-
海通证券	1	1,322,072,215.10	8.57%	1,217,350.53	9.21%	-
中泰证券股份有限公司	1	1,367,345,548.75	8.86%	1,273,425.95	9.63%	-
信达证券	1	1,394,091,119.45	9.03%	1,003,143.65	7.59%	-
国信证券股份有限公司	1	1,637,691,310.10	10.61%	1,508,814.01	11.42%	-
光大证券	3	5,835,448,009.41	37.81%	5,395,490.64	40.82%	-
国泰君安证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
财富证券	1	-	-	-	-	-
中银国际证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	1	-	-	-	-	-

注：（1）报告期内租用证券公司交易单元变更情况

报告期内本基金新增租用恒泰证券交易单元1个、信达证券交易单元1个；无停止租用交易单

元。

### (2) 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的选择标准

基金管理人选择证券经营机构，并选用其交易单元供本基金买卖证券专用，应本着安全、高效、低成本，能够为本基金提供高质量增值研究服务的原则，对该证券经营机构的经营情况、治理情况、研究实力等进行综合考量。

基本选择标准如下：

实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于3亿元人民币；

财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；

经营行为规范，近两年未发生重大违规行为而受到证监会处罚；

内部管理规范、严格，具备健全的内部控制制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设备符合代理本基金进行证券交易的要求，并能为本基金提供全面的信息服务；

研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务；

对于某一领域的研究实力超群，或是能够提供全方面，高质量的服务。

### (3) 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的程序

投资研究团队按照（2）中列出的有关经营情况、治理情况的选择标准，对备选的证券经营机构进行初步筛选；

对通过初选的各证券经营机构，投资研究团队各成员在其分管行业或领域的范围内，对该机构所提供的研究报告和信息资讯进行评分。

根据各成员评分，得出各证券经营机构的综合评分。

投资研究团队根据各机构的得分排名，拟定要选用其专用交易单元的证券经营机构。

董事会已做出决议，授权总经理依照公司对各券商的评价结果全权处理并决定公司旗下基金租用专用交易席位的事宜。

## 11.8.2 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		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期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

中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
中银国际证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期内未通过租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

## 11.9 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	光大保德信基金管理有限公司关于旗下基金执行新金融工具相关会计准则的公告	基金管理人公司网站、中国证监会基金电子披露网站及本基金选定的信息披露报纸	2022-01-01
2	光大保德信基金管理有限公司旗下基金 2021 年 12 月 31 日基金份额净值及累计净值公告	同上	2022-01-01
3	光大保德信量化核心证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	同上	2022-01-24
4	光大保德信量化核心证券投资基金基金产品资料概要更新	同上	2022-03-28
5	光大保德信量化核心证券投资基金招募说明书（更新）	同上	2022-03-28
6	光大保德信量化核心证券投资基金 2021 年年度报告	同上	2022-03-31
7	光大保德信量化核心证券投资基金暂停机构投资者大额申购、转换转入、定期定额投资的公告	同上	2022-03-31
8	光大保德信量化核心证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	同上	2022-04-22
9	光大保德信量化核心证券投资基金分红公告	同上	2022-04-26
10	光大保德信量化核心证券投资基金恢复机构投资者大额申购、转换转入、定期定额投资的公告	同上	2022-04-27
11	光大保德信基金管理有限公司关于终止与北京植信基金销售有限公司销售合作关系的公告	同上	2022-06-11
12	光大保德信基金管理有限公司旗下基金 2022 年 6 月 30 日基金份额净值及累计净值公告	同上	2022-07-01
13	光大保德信量化核心证券投资基金 2022 年第 2 季度报告	同上	2022-07-21
14	光大保德信基金管理有限公司关于暂停与深圳市金海九州基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	同上	2022-08-12
15	关于微信公众号直销交易升级维护公告	同上	2022-08-18
16	光大保德信基金管理有限公司关于旗下基金参与中信建投证券股份有限公司费率优惠活动的公告	同上	2022-08-18
17	光大保德信基金管理有限公司关于警惕不法分子冒用本公司名义进行诈骗活动的提示公告	同上	2022-08-24
18	光大保德信量化核心证券投资基金基金经理	同上	2022-08-27

	变更公告		
19	光大保德信量化核心证券投资基金 2022 年中期报告	同上	2022-08-31
20	光大保德信量化核心证券投资基金基金产品资料概要更新	同上	2022-08-31
21	光大保德信量化核心证券投资基金招募说明书（更新）	同上	2022-08-31
22	光大保德信量化核心证券投资基金 2022 年第 3 季度报告	同上	2022-10-26
23	光大保德信基金管理有限公司高级管理人员变更公告	同上	2022-11-03
24	光大保德信基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金投资北交所上市股票的风险提示性公告	同上	2022-12-06
25	光大保德信基金管理有限公司高级管理人员变更公告	同上	2022-12-22

## 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	20220401-20220505	0.00	321,405,866.13	321,405,866.13	0.00	0.00%
产品特有风险							
<p>本基金本报告期存在单一投资者持有基金份额比例超过20%的情形，可能面临单一投资者集中赎回的情况，从而：</p> <p>（1）对基金的流动性造成冲击，存在对剩余投资者的赎回办理造成影响的风险。</p> <p>（2）基金管理人因基金赎回的流动性要求致使部分投资受到限制，或因赎回费归入基金资产等原因，而导致基金资产净值波动的风险，影响基金的投资运作和收益水平。</p> <p>（3）因基金资产规模过小，而导致部分投资不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略，或导致基金不能满足存续条件的风险。</p> <p>本管理人将审慎评估大额申购对基金持有集中度的影响，在运作中保持合适的流动性水平，保护持有人利益。</p>							

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准光大保德信量化核心证券投资基金设立的文件
- 2、光大保德信量化核心证券投资基金基金合同
- 3、光大保德信量化核心证券投资基金招募说明书
- 4、光大保德信量化核心证券投资基金托管协议
- 5、光大保德信量化核心证券投资基金法律意见书
- 6、报告期内光大保德信量化核心证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告
- 7、基金管理人业务资格批件、营业执照、公司章程
- 8、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 9、中国证监会要求的其他文件

### 13.2 存放地点

上海市黄浦区中山东二路 558 号外滩金融中心 1 幢（北区 3 号楼），6-7 层、10 层本基金管理人办公地址。

### 13.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人。客户服务中心电话：4008-202-888，021-80262888。公司网址：[www.epf.com.cn](http://www.epf.com.cn)。

光大保德信基金管理有限公司

二〇二三年三月三十一日