
华夏安泰对冲策略 3 个月定期开放灵活配置混
合型发起式证券投资基金

2023 年年度报告

2023 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：中国银行股份有限公司

送出日期：二〇二四年三月二十八日

§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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 3 月 26 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 2023 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	12
§6 审计报告	12
§7 年度财务报表	14
7.1 资产负债表.....	15
7.2 利润表.....	16
7.3 净资产变动表.....	17
7.4 报表附注.....	18
§8 投资组合报告	55
8.1 期末基金资产组合情况.....	55
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	55
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	56
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	72
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	103
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	103
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	104
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	104
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	104
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	104
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	104
8.12 市场中性策略执行情况	104
8.13 投资组合报告附注	105
§9 基金份额持有人信息	105
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	105
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	105
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	106
§10 开放式基金份额变动	106
§11 重大事件揭示	106
§12 影响投资者决策的其他重要信息	110
§13 备查文件目录	110

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏安泰对冲策略 3 个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金
基金简称	华夏安泰对冲策略 3 个月定开混合
基金主代码	008856
交易代码	008856
基金运作方式	契约型定期开放式
基金合同生效日	2020 年 6 月 5 日
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,424,591,416.46 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制系统性风险的基础上,运用量化模型建立投资组合,通过衍生工具对冲市场风险,力争实现长期稳健的绝对收益。
投资策略	主要投资策略包括资产配置策略、绝对收益策略、债券投资策略、股指期货和股票期权投资策略、国债期货投资策略、融资融券投资策略、存托凭证投资策略等。本基金所指的绝对收益策略包括 ALPHA 对冲策略、套利策略、衍生品交易策略、融资融券策略等。本基金以基金管理人自主开发的量化多因子模型为基础,灵活运用多种投资策略建立投资组合,在有效控制风险的前提下,通过金融衍生品工具对冲市场风险,力争实现长期稳健的绝对收益。
业绩比较基准	中国人民银行公布的同期一年期定期存款基准利率(税后)+2%。
风险收益特征	本基金为特殊的混合型基金,通过采用多种绝对收益策略剥离市场系统性风险,因此相对股票型基金和一般的混合型基金其预期风险较小。而相对其业绩比较基准,由于绝对收益策略投资结果的不确定性,因此不能保证一定能获得超越业绩比较基准的绝对收益。

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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李彬	许俊
	联系电话	400-818-6666	010-66596688
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		400-818-6666	95566
传真		010-63136700	010-66594942
注册地址		北京市顺义区安庆大街甲3号院	北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址		北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层	北京市西城区复兴门内大街1号

邮政编码	100033	100818
法定代表人	张佑君	葛海蛟

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.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	华夏基金管理有限公司	北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 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	2023 年	2022 年	2021 年
本期已实现收益	49,686,714.76	-16,916,081.76	32,965,601.13
本期利润	46,668,153.70	-5,815,630.88	27,246,003.25
加权平均基金份额本期利润	0.0680	-0.0254	0.0467
本期加权平均净值利润率	5.77%	-2.41%	4.42%
本期基金份额净值增长率	10.73%	1.84%	6.45%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
期末可供分配利润	243,860,670.95	3,015,651.69	37,375,374.36
期末可供分配基金份额利润	0.1712	0.0371	0.0602
期末基金资产净值	1,703,190,685.05	87,873,489.77	658,477,059.29
期末基金份额净值	1.1956	1.0797	1.0602
3.1.3 累计期末指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
基金份额累计净值增长率	19.56%	7.97%	6.02%

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	0.40%	0.21%	0.88%	0.00%	-0.48%	0.21%
过去六个月	2.36%	0.20%	1.76%	0.00%	0.60%	0.20%
过去一年	10.73%	0.24%	3.50%	0.00%	7.23%	0.24%
过去三年	20.04%	0.32%	10.50%	0.00%	9.54%	0.32%
自基金合同生效起至今	19.56%	0.32%	12.51%	0.00%	7.05%	0.32%

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

华夏安泰对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金

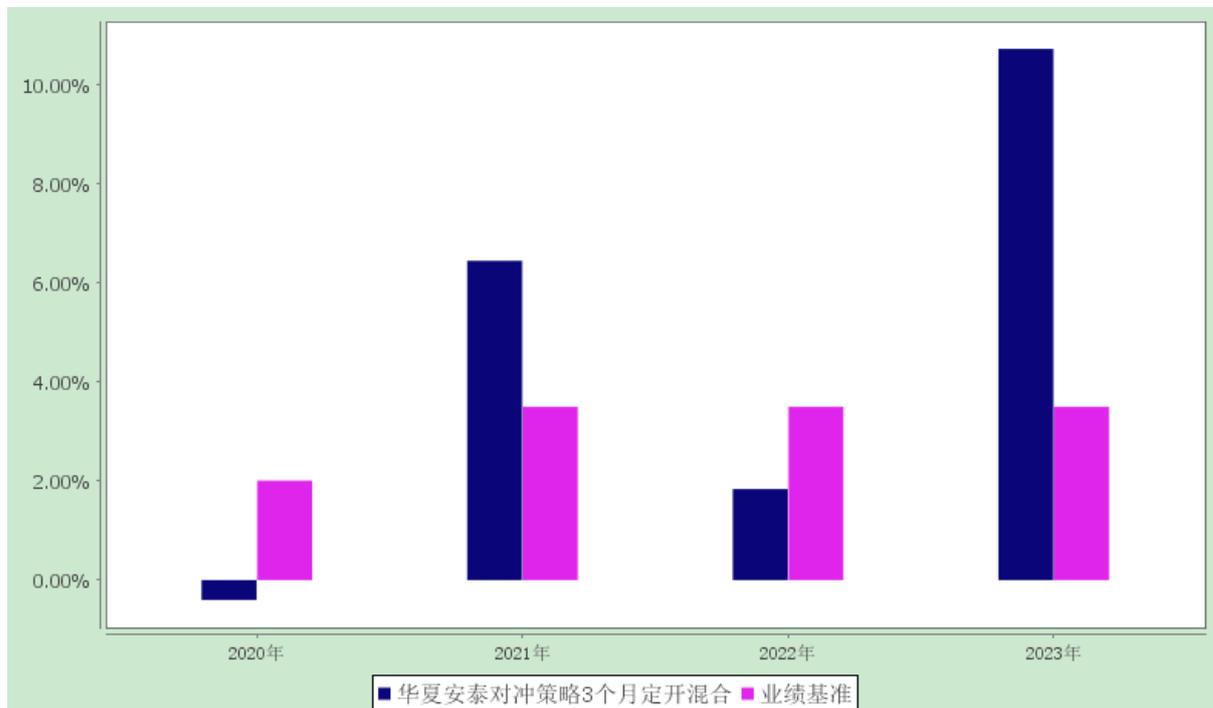
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2020年6月5日至2023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

华夏安泰对冲策略 3 个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金
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 2020 年 6 月 5 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，国内首家承诺“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 2023 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 1/10；在对冲策略绝对收益目标基金(A 类)中华夏安泰对冲策略 3 个月定开混合排名第 1/22；在消费行业偏股型基金(A 类)中华夏网购精选混合(A 类)排名第 2/68、华夏消费升级混合(A 类)排名第 11/68、华夏消费龙头混合(A 类)排名第 13/68、华夏新兴消费混合(A 类)排名第 21/68；在低碳环保行业股票型基金(A 类)中华夏节能环保股票(A 类)排名第 3/10；在增强规模指数股票型基金(A 类)中华夏中证 500 指数增强(A 类)排名第 3/145、华夏中证 500 指数智选增强(A 类)排名第 4/145、华夏中证 1000 指数增强(A 类)排名第 20/145；在 TMT 与信息技术行业偏股型基金(A 类)中华夏数字经济龙头混合发起式(A 类)排名第 4/30；在新能源主题股票型基金(A 类)中华夏能源革新股票(A 类)排名第 4/14；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 4/13；在灵活配置型基金(基准股票比例 30%-60%)(A 类)中华夏新锦绣混合(A 类)排名第 4/421、华夏稳增混合排名第 10/421；在偏股型基金(股票上限 95%)(A 类)中华夏磐锐一年定开混合(A 类)排名第 4/216、华夏磐利一年定开混合(A 类)排名第 21/216、华夏新兴经济一年持有混合(A 类)排名第 33/216；在标准股票型基金(A 类)中华夏智胜先锋股票（LOF）(A 类)排名第 8/326、华夏智胜价值成长股票(A 类)排名第 15/326。

固收与固收+产品：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 1/349、华夏稳福六个月持有混合(A 类)排名第 17/349、华夏睿磐泰兴混合(A 类)排名第 28/349；在长期纯债债券型基金(A 类)中华夏鼎成一年定开债券排名第 12/1340、华夏鼎航债券(A 类)排名第 14/1340；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 13/402、华夏鼎源债券(A 类)排名第 14/402、华夏卓信一年定开债券发起式排名第 25/402、华夏希望债券(A 类)排名第 32/402、华夏鼎泓债券(A 类)排名第 34/402、华夏卓享债券(A 类)排名第 38/402；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 34/137。

指数产品：在主题指数股票 ETF 基金中华夏中证动漫游戏 ETF 排名第 2/343、华夏中证 5G 通

信主题ETF排名第10/343、华夏中证云计算与大数据主题ETF排名第16/343、华夏中证人工智能主题ETF排名第20/343、华夏国证消费电子主题ETF排名第24/343、华夏中证智能汽车主题ETF排名第25/343、华夏中证金融科技主题ETF排名第28/343、华夏中证文化传媒ETF排名第31/343、华夏中证机器人ETF排名第39/343；在策略指数股票ETF基金中华夏中证智选500价值稳健策略ETF排名第6/37、华夏中证智选1000价值稳健策略ETF排名第10/37；在行业指数股票ETF基金中华夏中证全指证券公司ETF排名第10/66；在规模指数股票ETF基金中华夏中证1000ETF排名第17/146、华夏中证500ETF排名第26/146；在主题指数股票ETF联接基金(A类)中华夏中证动漫游戏ETF发起式联接(A类)排名第2/125、华夏中证5G通信主题ETF联接(A类)排名第6/125、华夏中证人工智能主题ETF联接(A类)排名第9/125、华夏中证央企ETF联接(A类)排名第25/125；在行业指数股票ETF联接基金(A类)中华夏中证全指证券公司ETF联接(A类)排名第6/36；在规模指数股票ETF联接基金(A类)中华夏中证1000ETF发起式联接(A类)排名第11/106、华夏中证500ETF联接(A类)排名第19/106；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5/16；在利率债指数债券型基金(A类)中华夏彭博政金债1-5年(A类)排名第13/115。

在《证券时报》主办的第十八届中国基金业“明星基金奖”评选活动上，华夏基金将两大奖项收入囊中：公司层面，华夏基金荣获“三年海外投资明星基金公司”；产品层面，华夏沪深300ETF荣获“三年持续回报指数型明星基金奖”。在《上海证券报》主办的第二十届“金基金”奖评选活动上，华夏基金荣膺三项大奖，公司层面获得“被动投资基金管理公司奖”，产品层面华夏创新前沿股票和华夏行业景气混合分别荣获股票型基金五年期奖和偏股混合型基金五年期奖。

在客户服务方面，2023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）华夏基金直销渠道优化页面显示，升级搜索及查询功能，让客户操作更加便利；（2）华夏基金管家客户端优化“忘记密码”功能及定投模块，上线亲子账户、资产诊断等功能，贴合客户投资需求，进一步提升使用体验；（3）与华润银行、贵州银行、武汉农商行等代销机构合作，拓展更加丰富的客户理财渠道；（4）开展“帮你问了ChatGPT”、“指数攻防值来啦！”、“华夏基金模拟投基大赛”、“煎熬的磨底期里找机会”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		
孙蒙	本基金的基金经理	2020-06-05	-	9年	硕士。曾任中信建投证券股份有限公司研究员、投资经理等。2017年7月加入华夏基金

					管理有限公司。历任数量投资部研究员、基金经理助理。
--	--	--	--	--	---------------------------

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 255 次，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

2023 年，国际格局复杂演变，地缘政治冲突频发，国际经济贸易投资放缓，通胀出现高位回落趋势，发达国家利率保持高位。国内方面，在外部环境更趋复杂严峻的情况下，我国经济呈现出回升向好、动力增强的态势，高质量发展扎实推进，但仍面临有效需求不足、部分行业产能过剩、社会预期偏弱等挑战；货币政策方面，面对发达经济体货币政策的外溢影响，央行两次下调政策利率和存款准备金率，保持了市场流动性的合理充裕。

市场方面，A 股市场上涨后震荡下跌，热点板块快速轮动。行业间表现差异比较大：通信、传媒、计算机等科技相关行业表现较好，而美容护理、商业贸易、房地产等消费行业表现较差。从量化角度看，低波、反转等因子表现持续较好，而盈利、成长等因子持续走弱，期间量化策略整体表现正常。

基金投资运作方面，股票端以多因子量化投资策略为主，对冲端通过股指期货对冲市场风险，力争获取绝对收益表现。我们在依据量化模型进行股票投资决策之外，还积极参与了科创板、创业板新股申购，获取较为确定性的收益增厚机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.1956 元，本报告期份额净值增长率为 10.73%，同期业绩比较基准增长率为 3.50%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2024 年政府预计设定较高经济增长目标，货币政策将继续保持宽松，而财政政策将发挥更大作用，A 股上市公司盈利预计温和增长。随着投资者悲观情绪逐渐修复，市场预计震荡上行；短期市场风格切换将发生，但长期市场风格维持轮动特征，建议均衡配置。

珍惜基金份额持有人的每一份投资和每一份信任，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，在信息披露、洗钱风险管理、关联交易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。积极优化合规管理的机制化和系统化，完善合规考核评价机制、子公司管理机制，大力推进合规管理综合服务、制度管理、知识搜索等系统化建设，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智化转型，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。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

本基金本报告期末进行利润分配，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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在华夏安泰对冲策略 3 个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

安永华明（2024）审字第 70035283_A85 号

华夏安泰对冲策略 3 个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

我们审计了华夏安泰对冲策略 3 个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金的财务报表，

包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的华夏安泰对冲策略 3 个月定期开放灵活配置混合型发起式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，公允反映了华夏安泰对冲策略 3 个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 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，我们独立于华夏安泰对冲策略 3 个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金，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

华夏安泰对冲策略 3 个月定期开放灵活配置混合型发起式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安泰对冲策略 3 个月定期开放灵活配置混合型发起式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安泰对冲策略 3 个月定期开放灵活配置混合型发起式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，就可能导致对华夏安泰对冲策略 3 个月定期开放灵活配置混合型发起式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安泰对冲策略 3 个月定期开放灵活配置混合型发起式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 王海彦

北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层

2024 年 3 月 26 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华夏安泰对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2023年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	6,059,476.75	5,413,009.93
结算备付金		213,071,920.46	6,819,388.70
存出保证金		150,328,847.78	8,073,026.92
交易性金融资产	7.4.7.2	1,336,364,171.48	68,085,424.81
其中：股票投资		1,335,831,136.43	68,064,423.06
基金投资		-	-
债券投资		533,035.05	21,001.75
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		157,413.58	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		1,705,981,830.05	88,390,850.36
负债和净资产	附注号	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
负债：			
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		-	-
应付管理人报酬		1,740,774.61	89,261.92
应付托管费		290,129.12	18,596.21
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		435,011.02	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	325,230.25	409,502.46

负债合计		2,791,145.00	517,360.59
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	1,424,591,416.46	81,388,980.02
未分配利润	7.4.7.8	278,599,268.59	6,484,509.75
净资产合计		1,703,190,685.05	87,873,489.77
负债和净资产总计		1,705,981,830.05	88,390,850.36

注：报告截止日2023年12月31日，基金份额净值1.1956元，基金份额总额1,424,591,416.46份。

7.2 利润表

会计主体：华夏安泰对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2023年1月1日至2023年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年1月1日至 2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至 2022年12月31日
一、营业总收入		58,199,233.60	-1,840,737.33
1.利息收入		1,614,669.97	461,252.38
其中：存款利息收入	7.4.7.9	1,614,669.97	423,406.05
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		-	37,846.33
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		57,643,025.55	-13,900,897.38
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-21,392,312.94	-57,336,920.03
基金投资收益	7.4.7.11	-	-
债券投资收益	7.4.7.12	240,199.94	26,423.97
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	62,923,471.43	40,888,408.31
股利收益	7.4.7.16	15,871,667.12	2,521,190.37
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	-3,018,561.06	11,100,450.88
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	1,960,099.14	498,456.79
减：二、营业总支出		11,531,079.90	3,974,893.55
1.管理人报酬		9,476,334.89	3,017,378.97
2.托管费		1,660,165.33	628,620.61
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		227,423.85	149,713.26
8.其他费用	7.4.7.21	167,155.83	179,180.71
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		46,668,153.70	-5,815,630.88
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		46,668,153.70	-5,815,630.88
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		46,668,153.70	-5,815,630.88

7.3 净资产变动表

会计主体：华夏安泰对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2023年1月1日至2023年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 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	81,388,980.02	6,484,509.75	87,873,489.77
二、本期期初净资产	81,388,980.02	6,484,509.75	87,873,489.77
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填列）	1,343,202,436.44	272,114,758.84	1,615,317,195.28
（一）、综合收益总额	-	46,668,153.70	46,668,153.70
（二）、本期基金份额 交易产生的净资产变 动数（净资产减少以 “-”号填列）	1,343,202,436.44	225,446,605.14	1,568,649,041.58
其中：1.基金申购款	1,965,527,165.97	337,163,083.80	2,302,690,249.77
2.基金赎回款	-622,324,729.53	-111,716,478.66	-734,041,208.19
（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	1,424,591,416.46	278,599,268.59	1,703,190,685.05
项目	上年度可比期间 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	621,101,684.93	37,375,374.36	658,477,059.29
二、本期期初净资产	621,101,684.93	37,375,374.36	658,477,059.29
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填列）	-539,712,704.91	-30,890,864.61	-570,603,569.52

(一)、综合收益总额	-	-5,815,630.88	-5,815,630.88
(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)	-539,712,704.91	-25,075,233.73	-564,787,938.64
其中: 1.基金申购款	1,009,944.82	53,660.99	1,063,605.81
2.基金赎回款	-540,722,649.73	-25,128,894.72	-565,851,544.45
(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	81,388,980.02	6,484,509.75	87,873,489.77

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

华夏安泰对冲策略 3 个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金（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[2019]2892 号《关于准予华夏安泰对冲策略 3 个月定期开放灵活配置混合型发起式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》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《华夏安泰对冲策略 3 个月定期开放灵活配置混合型发起式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。本基金为契约型定期开放式，存续期限为不定期。本基金于 2020 年 5 月 13 日至 2020 年 6 月 2 日募集 1,153,584,795.34 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（2020）验字第 60739337_A30 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏安泰对冲策略 3 个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》于 2020 年 6 月 5 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,154,005,597.33 份基金份额，其中认购资金利息折合 420,801.99 份基金份额。本基金的基金管理人为华夏基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

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：本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括创业板、中小板、存托凭证及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、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、次级债券、政府支持机构债券、

政府支持债券、地方政府债券、可转换公司债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、货币市场工具(含同业存单)、资产支持证券、股指期货、国债期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

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业务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为投资收益。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。

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，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红权益再投资日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。期末可供分配利润指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

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 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
活期存款	6,059,476.75	5,413,009.93
等于：本金	6,058,455.38	5,412,441.27
加：应计利息	1,021.37	568.66
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	6,059,476.75	5,413,009.93

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	1,362,270,546.93	-	1,335,831,136.43	-26,439,410.50	
贵金属投资- 金交所黄金 合约	-	-	-	-	
债券	交易所市 场	533,000.00	35.05	533,035.05	-
	银行 间市 场	-	-	-	-
	合计	533,000.00	35.05	533,035.05	-
资产支持证 券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	1,362,803,546.93	35.05	1,336,364,171.48	-26,439,410.50	
项目	上年度末 2022年12月31日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	69,527,256.67	-	68,064,423.06	-1,462,833.61	
贵金属投资-	-	-	-	-	

金交所黄金合约					
债券	交易所市场	21,000.00	1.75	21,001.75	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	21,000.00	1.75	21,001.75	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		69,548,256.67	1.75	68,085,424.81	-1,462,833.61

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 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	-1,273,807,000.00	-	-	-
其中：股指期货	-1,273,807,000.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-1,273,807,000.00	-	-	-
项目	上年度末 2022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	-65,867,224.17	-	-	-
其中：股指期货	-65,867,224.17	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-65,867,224.17	-	-	-

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
IM2401	中证1000期货 IM2401合约	-50	-58,880,000.00	1,008,680.00
IC2401	中证500期货	-64	-69,591,040.00	549,400.00

	IC2401 合约			
IF2401	沪深 300 期货 IF2401 合约	-111	-114,545,340.00	-634,920.00
IC2406	中证 500 期货 IC2406 合约	-111	-118,903,200.00	2,750,480.00
IM2403	中证 1000 期货 IM2403 合约	-108	-126,286,560.00	3,519,040.00
IM2406	中证 1000 期货 IM2406 合约	-115	-132,470,800.00	4,227,600.00
IC2403	中证 500 期货 IC2403 合约	-123	-133,199,160.00	3,319,320.00
IF2406	沪深 300 期货 IF2406 合约	-183	-189,580,680.00	2,649,600.00
IF2403	沪深 300 期货 IF2403 合约	-295	-305,838,300.00	7,122,720.00
合计	-	-	-	24,511,920.00
减：可抵销期货暂 收款	-	-	-	24,511,920.00
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

无。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 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	175,230.25	239,502.46
其中：交易所市场	175,230.25	239,502.46

银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	150,000.00	170,000.00
合计	325,230.25	409,502.46

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	81,388,980.02	81,388,980.02
本期申购	1,965,527,165.97	1,965,527,165.97
本期赎回（以“-”号填列）	-622,324,729.53	-622,324,729.53
本期末	1,424,591,416.46	1,424,591,416.46

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	3,015,651.69	3,468,858.06	6,484,509.75
本期期初	3,015,651.69	3,468,858.06	6,484,509.75
本期利润	49,686,714.76	-3,018,561.06	46,668,153.70
本期基金份额交易产生的变动数	191,158,304.50	34,288,300.64	225,446,605.14
其中：基金申购款	286,710,774.17	50,452,309.63	337,163,083.80
基金赎回款	-95,552,469.67	-16,164,008.99	-111,716,478.66
本期已分配利润	-	-	-
本期末	243,860,670.95	34,738,597.64	278,599,268.59

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
	活期存款利息收入	76,076.48
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	1,534,156.31	384,614.26
其他	4,437.18	2,549.07
合计	1,614,669.97	423,406.05

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	上年度可比期间
----	----	---------

	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-21,392,312.94	-57,336,920.03
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
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	-21,392,312.94	-57,336,920.03

7.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
卖出股票成交总额	3,054,760,391.57	1,614,894,317.13
减：卖出股票成本总额	3,072,361,987.28	1,669,131,810.70
减：交易费用	3,790,717.23	3,099,426.46
买卖股票差价收入	-21,392,312.94	-57,336,920.03

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 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
债券投资收益——利息收入	145.49	25.89
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	240,054.45	26,398.08
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	240,199.94	26,423.97

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 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
----	-----------------------------	----------------------------------

	日	日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,324,923.39	121,135.89
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,084,700.00	94,700.00
减：应计利息总额	115.93	34.46
减：交易费用	53.01	3.35
买卖债券差价收入	240,054.45	26,398.08

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 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
股指期货投资收益	62,923,471.43	40,888,408.31

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资产生的股利收益	15,871,667.12	2,521,190.37
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	15,871,667.12	2,521,190.37

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
1.交易性金融资产	-24,976,576.89	-2,903,813.40
——股票投资	-24,976,576.89	-2,894,880.20
——债券投资	-	-8,933.20

——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	21,958,015.83	14,004,264.28
——权证投资	-	-
——期货投资	21,958,015.83	14,004,264.28
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-3,018,561.06	11,100,450.88

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
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
基金赎回费收入	1,960,099.14	498,456.79
合计	1,960,099.14	498,456.79

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
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
审计费用	70,000.00	50,000.00
信息披露费	80,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	17,155.83	9,180.71
合计	167,155.83	179,180.71

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
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	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
天津海鹏科技咨询有限公司	基金管理人的股东
MACKENZIE FINANCIAL CORPORATION	基金管理人的股东
POWER CORPORATION OF CANADA	基金管理人的股东
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
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
华夏资本管理有限公司（“华夏资本”）	基金管理人的子公司

注：①根据华夏基金管理有限公司于2023年1月6日发布的公告，华夏基金管理有限公司股权结构变更为中信证券（出资比例62.2%）、MACKENZIE FINANCIAL CORPORATION（出资比例27.8%）、天津海鹏科技咨询有限公司（出资比例10%）。

②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 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	5,868,599,684.11	79.23%	922,662,989.61	32.82%

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
中信证券	1,255,773.58	94.78%	26,738.80	22.07%

7.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
中信证券	-	-	106,800,000.00	26.14%

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年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	540,899.16	44.91%	140,067.33	79.93%
关联方名称	上年度可比期间 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
中信证券	397,949.64	32.82%	10,350.79	4.32%

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 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	9,476,334.89	3,017,378.97
其中：应支付销售机构的客户维护费	3,523,587.99	427,307.31
应支付基金管理人的净管理费	5,952,746.90	2,590,071.66

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 1.20%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×1.20%/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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12 月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,660,165.33	628,620.61

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 0.20%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×0.20%/当年天数。

③根据 2023 年 7 月 8 日发布的《华夏基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，自 2023 年 7 月 10 日起托管费率由 0.25%调整为 0.20%。因此，本基金 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 7 月 9 日止期间的托管费率为 0.25%，2023 年 7 月 10 日至 2023 年 12 月 31 日的托管费率为 0.20%。

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

无。

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

无。

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

份额单位：份

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31 日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31 日
期初持有的基金份额	10,000,900.09	10,000,900.09
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	10,000,900.09	10,000,900.09

期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.70%	12.29%
-----------------------	-------	--------

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

无。

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 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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
中国银行活期存款	6,059,476.75	76,076.48	5,413,009.93	36,242.72

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国银行保管，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 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	6,004	474,255.96
中信证券	603296	华勤技术	新股发行	4,543	367,074.40
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	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	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	603162	海通发展	新股发行	523	19,481.75
上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	688223	晶科能源	新股发行	84,419	422,095.00
中信证券	301200	大族数控	新股发行	4,169	319,178.64
中信证券	688302	海创药业	新股发行	6,686	286,963.12
中信证券	688326	经纬恒润	新股发行	1,138	137,698.00
中信证券	301109	军信股份	新股发行	3,552	123,645.12
中信证券	688290	景业智能	新股发行	3,040	103,025.60

中信证券	688150	莱特光电	新股发行	4,461	98,365.05
中信证券	688380	中微半导	新股发行	2,766	85,358.76
中信证券	301302	华如科技	新股发行	1,638	85,225.14
中信证券	688426	康为世纪	新股发行	1,240	60,735.20
中信证券	688061	灿瑞科技	新股发行	529	59,613.01
中信证券	688370	丛麟科技	新股发行	976	58,325.76
中信证券	688432	有研硅	新股发行	4,770	47,270.70
中信证券	688252	天德钰	新股发行	2,117	45,896.56
中信证券	600938	中国海油	新股发行	3,000	32,400.00
中信证券	603235	天新药业	新股发行	572	21,095.36
中信证券	001330	博纳影业	新股发行	3,564	17,926.92
中信证券	603132	金徽股份	新股发行	1,342	14,493.60
中信证券	001339	智微智能	新股发行	812	13,690.32
中信证券	603191	望变电气	新股发行	1,149	13,627.14
中信证券	603209	兴通股份	新股发行	595	12,804.40
中信证券	603151	邦基科技	新股发行	535	9,603.25
中信证券	001266	宏英智能	新股发行	247	9,536.67
中信证券	001322	箭牌家居	新股发行	595	7,544.60
中信证券	603215	比依股份	新股发行	575	7,187.50
中信证券	603051	鹿山新材	新股发行	272	7,014.88

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期通过中信期货买卖期货成交额为 3,688,581,340.00 元（上年度可比期间：717,607,680.00 元），支付给中信期货的佣金为 87,382.37 元（上年度可比期间：17,000.16 元）。

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（2023 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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
688717	艾罗能源	2023-12-26	6 个月	新发流通	55.66	55.66	11,303	629,124.98	629,124.98	-

				受限						
688717	艾罗能源	2023-12-26	1个月内(含)	新发流通受限	55.66	55.66	4,844	269,617.04	269,617.04	-
688548	广钢气体	2023-08-08	6个月	新发流通受限	9.87	12.75	4,048	39,953.76	51,612.00	-
301526	国际复材	2023-12-19	6个月	新发流通受限	2.66	4.45	9,723	25,863.18	43,267.35	-
688563	航材股份	2023-07-12	6个月	新发流通受限	78.99	60.49	601	47,472.99	36,354.49	-
603296	华勤技术	2023-08-01	6个月	新发流通受限	80.80	77.75	455	36,764.00	35,376.25	-
301291	明阳电气	2023-06-21	6个月	新发流通受限	38.13	28.36	1,001	38,168.13	28,388.36	-
301348	蓝箭电子	2023-08-01	6个月	新发流通受限	18.08	44.57	613	11,083.04	27,321.41	-
688702	盛科	2023-	6个月	新	42.66	48.18	549	23,420.34	26,450.82	-

	通信	09-06		发 流 通 受 限						
688582	芯动 联科	2023- 06-21	6个月	新 发 流 通 受 限	26.74	38.67	648	17,327.52	25,058.16	-
301559	中集 环科	2023- 09-26	6个月	新 发 流 通 受 限	24.22	18.24	1,315	31,849.30	23,985.60	-
301486	致尚 科技	2023- 06-30	6个月	新 发 流 通 受 限	57.66	47.25	482	27,792.12	22,774.50	-
301511	德福 科技	2023- 08-08	6个月	新 发 流 通 受 限	28.00	22.67	982	27,496.00	22,261.94	-
688652	京仪 装备	2023- 11-22	6个月	新 发 流 通 受 限	31.95	52.25	416	13,291.20	21,736.00	-
301525	儒竞 科技	2023- 08-23	6个月	新 发 流 通 受 限	99.57	81.46	266	26,485.62	21,668.36	-
301498	乖宝 宠物	2023- 08-09	6个月	新 发 流 通	39.99	38.81	554	22,154.46	21,500.74	-

				受限						
301371	敷尔佳	2023-07-24	6个月	新发流通受限	55.68	37.58	564	31,403.52	21,195.12	-
301370	国科恒泰	2023-07-03	6个月	新发流通受限	13.39	16.01	1,240	16,603.60	19,852.40	-
688627	精智达	2023-07-11	6个月	新发流通受限	46.77	87.72	222	10,382.94	19,473.84	-
301488	豪恩汽电	2023-06-26	6个月	新发流通受限	39.78	69.09	262	10,422.36	18,101.58	-
301468	博盈特焊	2023-07-12	6个月	新发流通受限	47.58	30.22	598	28,452.84	18,071.56	-
301381	赛维时代	2023-07-05	6个月	新发流通受限	20.45	29.69	571	11,676.95	16,952.99	-
301172	君逸数码	2023-07-19	6个月	新发流通受限	31.33	38.16	438	13,722.54	16,714.08	-
301362	民爆	2023-	6个月	新	51.05	38.52	420	21,441.00	16,178.40	-

	光电	07-27		发 流 通 受 限						
688612	威迈斯	2023-07-19	6个月	新 发 流 通 受 限	47.29	37.97	422	19,956.38	16,023.34	-
601096	宏盛华源	2023-12-15	6个月	新 发 流 通 受 限	1.70	4.06	3,918	6,660.60	15,907.08	-
301393	昊帆生物	2023-07-05	6个月	新 发 流 通 受 限	67.68	59.37	260	17,596.80	15,436.20	-
688610	埃科光电	2023-07-10	6个月	新 发 流 通 受 限	73.33	51.00	275	20,165.75	14,025.00	-
601083	锦江航运	2023-11-28	6个月	新 发 流 通 受 限	11.25	11.07	1,263	14,208.75	13,981.41	-
301510	固高科技	2023-08-04	6个月	新 发 流 通 受 限	12.00	35.01	396	4,752.00	13,863.96	-
301210	金杨股份	2023-06-21	6个月	新 发 流 通	57.88	45.48	281	16,264.28	12,779.88	-

				受限						
301566	达利凯普	2023-12-22	6个月	新发流通受限	8.90	22.14	576	5,126.40	12,752.64	-
301456	盘古智能	2023-07-06	6个月	新发流通受限	37.96	30.39	407	15,449.72	12,368.73	-
688602	康鹏科技	2023-07-13	6个月	新发流通受限	8.66	11.06	1,066	9,231.56	11,789.96	-
688719	爱科赛博	2023-09-20	6个月	新发流通受限	69.98	60.10	194	13,576.12	11,659.40	-
301550	斯菱股份	2023-09-06	6个月	新发流通受限	37.56	43.57	260	9,765.60	11,328.20	-
301292	海科新源	2023-06-29	6个月	新发流通受限	19.99	19.35	583	11,654.17	11,281.05	-
301508	中机认检	2023-11-23	6个月	新发流通受限	16.82	26.68	419	7,047.58	11,178.92	-
688603	天承	2023-	6个月	新	55.00	74.14	140	7,700.00	10,379.60	-

	科技	06-30		发 流 通 受 限						
301528	多浦乐	2023-08-17	6个月	新发 流 通 受 限	71.80	68.91	148	10,626.40	10,198.68	-
301329	信音电子	2023-07-05	6个月	新发 流 通 受 限	21.00	22.23	458	9,618.00	10,181.34	-
301372	科净源	2023-08-03	6个月	新发 流 通 受 限	45.00	43.59	231	10,395.00	10,069.29	-
301261	恒工精密	2023-06-29	6个月	新发 流 通 受 限	36.90	50.85	198	7,306.20	10,068.30	-
301202	朗威股份	2023-06-28	6个月	新发 流 通 受 限	25.82	31.80	306	7,900.92	9,730.80	-
301395	仁信新材	2023-06-21	6个月	新发 流 通 受 限	26.68	18.69	520	13,873.60	9,718.80	-
688716	中研股份	2023-09-13	6个月	新发 流 通	29.66	36.39	267	7,919.22	9,716.13	-

				受限						
301413	安培龙	2023-12-11	6个月	新发流通受限	33.25	58.19	164	5,453.00	9,543.16	-
301500	飞南资源	2023-09-13	6个月	新发流通受限	23.97	20.89	455	10,906.35	9,504.95	-
301418	协昌科技	2023-08-10	6个月	新发流通受限	51.88	50.20	189	9,805.32	9,487.80	-
301516	中远通	2023-12-01	6个月	新发流通受限	6.87	15.51	604	4,149.48	9,368.04	-
301272	英华特	2023-07-06	6个月	新发流通受限	51.39	53.38	173	8,890.47	9,234.74	-
301469	恒达新材	2023-08-10	6个月	新发流通受限	36.58	33.09	275	10,059.50	9,099.75	-
301519	舜禹股份	2023-07-19	6个月	新发流通受限	20.93	20.21	442	9,251.06	8,932.82	-
301518	长华	2023-	6个月	新	25.75	23.01	385	9,913.75	8,858.85	-

	化学	07-26		发 流 通 受 限						
301568	思泰 克	2023- 11-21	6个月	新 发 流 通 受 限	23.23	35.58	246	5,714.58	8,752.68	-
301520	万邦 医药	2023- 09-18	6个月	新 发 流 通 受 限	67.88	52.74	160	10,860.80	8,438.40	-
688638	誉辰 智能	2023- 07-04	6个月	新 发 流 通 受 限	83.90	59.68	141	11,829.90	8,414.88	-
301459	丰茂 股份	2023- 12-06	6个月	新 发 流 通 受 限	31.90	39.84	208	6,635.20	8,286.72	-
688720	艾森 股份	2023- 11-29	6个月	新 发 流 通 受 限	28.03	49.84	165	4,624.95	8,223.60	-
301489	思泉 新材	2023- 10-16	6个月	新 发 流 通 受 限	41.66	64.11	128	5,332.48	8,206.08	-
688651	盛邦 安全	2023- 07-19	6个月	新 发 流 通	39.90	46.05	178	7,102.20	8,196.90	-

				受限						
301517	陕西华达	2023-10-09	6个月	新发流通受限	26.87	43.69	185	4,970.95	8,082.65	-
301578	辰奕智能	2023-12-21	6个月	新发流通受限	48.94	68.32	118	5,774.92	8,061.76	-
301548	崇德科技	2023-09-11	6个月	新发流通受限	66.80	58.99	136	9,084.80	8,022.64	-
688657	浩辰软件	2023-09-25	6个月	新发流通受限	103.40	78.23	101	10,443.40	7,901.23	-
688671	碧兴物联	2023-08-02	6个月	新发流通受限	36.12	34.30	226	8,163.12	7,751.80	-
688693	锆威特	2023-08-10	6个月	新发流通受限	40.83	43.41	178	7,267.74	7,726.98	-
603275	众辰科技	2023-08-16	6个月	新发流通受限	49.97	39.70	193	9,644.21	7,662.10	-
301533	威马	2023-	6个月	新	29.50	33.16	225	6,637.50	7,461.00	-

	农机	08-07		发 流 通 受 限						
603062	麦加 芯彩	2023- 10-31	6个月	新 发 流 通 受 限	58.08	57.81	126	7,318.08	7,284.06	-
301555	惠柏 新材	2023- 10-24	6个月	新 发 流 通 受 限	22.88	32.44	224	5,125.12	7,266.56	-
301505	苏州 规划	2023- 07-12	6个月	新 发 流 通 受 限	26.35	35.81	194	5,111.90	6,947.14	-
301529	福赛 科技	2023- 08-31	6个月	新 发 流 通 受 限	36.60	37.88	182	6,661.20	6,894.16	-
301515	港通 医疗	2023- 07-13	6个月	新 发 流 通 受 限	31.16	28.27	230	7,166.80	6,502.10	-
688648	中邮 科技	2023- 11-06	6个月	新 发 流 通 受 限	15.18	21.43	303	4,599.54	6,493.29	-
001378	德冠 新材	2023- 10-23	6个月	新 发 流 通	31.68	31.27	205	6,494.40	6,410.35	-

				受限						
688450	光格科技	2023-07-17	6个月	新发流通受限	53.09	36.42	167	8,866.03	6,082.14	-
603004	鼎龙科技	2023-12-20	6个月	新发流通受限	16.80	31.19	195	3,276.00	6,082.05	-
603119	浙江荣泰	2023-07-21	6个月	新发流通受限	15.32	23.87	226	3,462.32	5,394.62	-
001306	夏厦精密	2023-11-09	6个月	新发流通受限	53.63	75.36	64	3,432.32	4,823.04	-
603075	热威股份	2023-09-01	6个月	新发流通受限	23.10	23.31	182	4,204.20	4,242.42	-
001358	兴欣新材	2023-12-14	6个月	新发流通受限	41.00	44.16	87	3,567.00	3,841.92	-
001239	永达股份	2023-12-04	6个月	新发流通受限	12.05	19.92	189	2,277.45	3,764.88	-
603231	索宝	2023-	6个月	新	21.29	21.53	161	3,427.69	3,466.33	-

	蛋白	12-06		发 流 通 受 限						
603273	天元 智能	2023- 10-16	6个月	新 发 流 通 受 限	9.50	18.97	178	1,691.00	3,376.66	-
603276	恒兴 新材	2023- 09-18	6个月	新 发 流 通 受 限	25.73	24.88	134	3,447.82	3,333.92	-
603373	安邦 护卫	2023- 12-13	6个月	新 发 流 通 受 限	19.10	34.75	88	1,680.80	3,058.00	-

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券

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
113069	博 23 转 债	2023- 12-22	1个月 内 (含)	新 发 流 通 受 限	100.00	100.01	5,330	533,000.00	533,035.05	期 末 估 值 单 价 为 含 息 价 格

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

无。

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。

本基金管理人通过限制投资集中度来管理投资品种变现的流动性风险。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，本基金主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具。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开放期内投资者历史申赎、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及比例，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。

本基金管理人定期对组合中债券投资部分面临的利率风险进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

截至本期末，综合考虑利率债、信用债、同业存单、资产支持证券等资产占基金资产净值的比

例，利率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。

本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险。此外，本基金管理人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进行风险度量和分析，以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 2023年12月31日		上年度末 2022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	1,335,831,136.43	78.43	68,064,423.06	77.46
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	533,035.05	0.03	21,001.75	0.02
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	1,336,364,171.48	78.46	68,085,424.81	77.48

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	除沪深300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 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
	-5%	-54,965,492.53	-2,575,639.79
+5%	54,965,492.53	2,575,639.79	

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	1,333,889,402.98	68,052,073.06
第二层次	1,431,777.07	33,351.75
第三层次	1,042,991.43	-
合计	1,336,364,171.48	68,085,424.81

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 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	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	1,135,975.89	1,135,975.89
转出第三层次	-	155,266.25	155,266.25
当期利得或损失总额	-	62,281.79	62,281.79
其中：计入损益的利得或损失	-	62,281.79	62,281.79
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-

(若有)			
期末余额	-	1,042,991.43	1,042,991.43
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	-	70,403.55	70,403.55
项目	上年度可比期间 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	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失(若有)	-	-	-
期末余额	-	-	-
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	-	-	-

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	1,042,991.43	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	0.1462-2.1988	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	-	-	-	-	-

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2023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	1,335,831,136.43	78.30
	其中：股票	1,335,831,136.43	78.30
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	533,035.05	0.03
	其中：债券	533,035.05	0.03
	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	219,131,397.21	12.84
8	其他各项资产	150,486,261.36	8.82
9	合计	1,705,981,830.05	100.00

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	4,846,886.00	0.28
B	采矿业	74,871,530.82	4.40
C	制造业	817,789,999.87	48.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	43,123,501.08	2.53
E	建筑业	22,093,443.50	1.30
F	批发和零售业	8,682,848.39	0.51

G	交通运输、仓储和邮政业	31,835,123.41	1.87
H	住宿和餐饮业	50,830.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	99,085,731.60	5.82
J	金融业	156,953,070.19	9.22
K	房地产业	20,144,895.00	1.18
L	租赁和商务服务业	17,508,172.00	1.03
M	科学研究和技术服务业	25,235,312.46	1.48
N	水利、环境和公共设施管理业	5,249,402.11	0.31
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	15,820.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	8,344,570.00	0.49
S	综合	-	-
	合计	1,335,831,136.43	78.43

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	600519	贵州茅台	28,990	50,036,740.00	2.94
2	300750	宁德时代	169,200	27,623,592.00	1.62
3	601318	中国平安	658,722	26,546,496.60	1.56
4	000333	美的集团	384,400	20,999,772.00	1.23
5	601398	工商银行	3,732,700	17,842,306.00	1.05
6	000725	京东方 A	4,476,200	17,457,180.00	1.02
7	601288	农业银行	4,475,000	16,289,000.00	0.96
8	603259	药明康德	222,300	16,174,548.00	0.95
9	601328	交通银行	2,617,300	15,023,302.00	0.88
10	000338	潍柴动力	1,095,900	14,959,035.00	0.88
11	601138	工业富联	967,900	14,634,648.00	0.86
12	601857	中国石油	2,068,500	14,603,610.00	0.86
13	000858	五粮液	102,100	14,325,651.00	0.84
14	002594	比亚迪	68,800	13,622,400.00	0.80
15	600036	招商银行	448,235	12,469,897.70	0.73
16	601939	建设银行	1,909,231	12,429,093.81	0.73
17	600276	恒瑞医药	251,360	11,369,012.80	0.67
18	000100	TCL 科技	2,594,950	11,158,285.00	0.66
19	600900	长江电力	414,000	9,662,760.00	0.57
20	000425	徐工机械	1,700,400	9,284,184.00	0.55
21	000039	中集集团	1,187,351	9,083,235.15	0.53
22	000063	中兴通讯	334,300	8,852,264.00	0.52
23	601766	中国中车	1,641,934	8,636,572.84	0.51
24	000932	华菱钢铁	1,675,400	8,628,310.00	0.51

25	000651	格力电器	258,500	8,315,945.00	0.49
26	002252	上海莱士	1,028,200	8,225,600.00	0.48
27	600007	中国国贸	422,800	8,193,864.00	0.48
28	601985	中国核电	1,087,100	8,153,250.00	0.48
29	300122	智飞生物	127,800	7,809,858.00	0.46
30	601211	国泰君安	520,200	7,740,576.00	0.45
31	000157	中联重科	1,182,100	7,719,113.00	0.45
32	601728	中国电信	1,424,700	7,707,627.00	0.45
33	601898	中煤能源	788,200	7,637,658.00	0.45
34	600161	天坛生物	246,400	7,623,616.00	0.45
35	002415	海康威视	218,600	7,589,792.00	0.45
36	002027	分众传媒	1,189,600	7,518,272.00	0.44
37	601088	中国神华	236,600	7,417,410.00	0.44
38	000990	诚志股份	890,900	7,314,289.00	0.43
39	688981	中芯国际	135,900	7,205,418.00	0.42
40	600795	国电电力	1,663,900	6,921,824.00	0.41
41	600660	福耀玻璃	183,700	6,868,543.00	0.40
42	600941	中国移动	68,200	6,784,536.00	0.40
43	601628	中国人寿	232,400	6,588,540.00	0.39
44	003816	中国广核	2,112,500	6,569,875.00	0.39
45	601688	华泰证券	463,600	6,467,220.00	0.38
46	600971	恒源煤电	577,100	6,434,665.00	0.38
47	600989	宝丰能源	432,500	6,388,025.00	0.38
48	002399	海普瑞	530,058	6,217,580.34	0.37
49	600383	金地集团	1,388,700	6,054,732.00	0.36
50	688111	金山办公	19,000	6,007,800.00	0.35
51	300030	阳普医疗	768,900	5,958,975.00	0.35
52	601888	中国中免	68,800	5,757,872.00	0.34
53	688055	龙腾光电	1,178,100	5,749,128.00	0.34
54	002003	伟星股份	504,400	5,472,740.00	0.32
55	600816	建元信托	1,875,000	5,381,250.00	0.32
56	603993	洛阳钼业	1,001,800	5,209,360.00	0.31
57	603283	赛腾股份	70,300	5,100,968.00	0.30
58	601816	京沪高铁	1,035,000	5,092,200.00	0.30
59	300768	迪普科技	336,500	4,973,470.00	0.29
60	600746	江苏索普	667,700	4,887,564.00	0.29
61	002714	牧原股份	117,700	4,846,886.00	0.28
62	600029	南方航空	836,700	4,819,392.00	0.28
63	600312	平高电气	374,600	4,753,674.00	0.28
64	002461	珠江啤酒	598,900	4,731,310.00	0.28
65	000953	河化股份	861,900	4,714,593.00	0.28
66	601186	中国铁建	601,400	4,576,654.00	0.27
67	002130	沃尔核材	599,500	4,526,225.00	0.27
68	601699	潞安环能	205,002	4,491,593.82	0.26

69	002001	新和成	259,900	4,407,904.00	0.26
70	600028	中国石化	789,900	4,407,642.00	0.26
71	000513	丽珠集团	125,800	4,404,258.00	0.26
72	601018	宁波港	1,221,400	4,348,184.00	0.26
73	600967	内蒙一机	524,100	4,329,066.00	0.25
74	002171	楚江新材	573,100	4,286,788.00	0.25
75	000902	新洋丰	374,700	4,267,833.00	0.25
76	601899	紫金矿业	340,300	4,240,138.00	0.25
77	002724	海洋王	510,400	4,195,488.00	0.25
78	601006	大秦铁路	574,200	4,139,982.00	0.24
79	688661	和林微纳	89,900	4,119,218.00	0.24
80	688325	赛微微电	105,000	4,114,950.00	0.24
81	688235	百济神州	29,500	4,101,680.00	0.24
82	688100	威胜信息	140,900	4,074,828.00	0.24
83	603989	艾华集团	188,700	4,060,824.00	0.24
84	300323	华灿光电	553,500	4,051,620.00	0.24
85	600252	中恒集团	1,612,500	4,047,375.00	0.24
86	300625	三雄极光	271,400	4,022,148.00	0.24
87	601158	重庆水务	708,200	4,015,494.00	0.24
88	603113	金能科技	496,700	4,008,369.00	0.24
89	603530	神马电力	192,800	3,998,672.00	0.23
90	002032	苏泊尔	75,200	3,986,352.00	0.23
91	000597	东北制药	742,700	3,973,445.00	0.23
92	688128	中国电研	193,000	3,960,360.00	0.23
93	601918	新集能源	749,900	3,951,973.00	0.23
94	601137	博威合金	248,600	3,860,758.00	0.23
95	002153	石基信息	393,600	3,833,664.00	0.23
96	002283	天润工业	654,500	3,828,825.00	0.22
97	600737	中粮糖业	456,700	3,763,208.00	0.22
98	601811	新华文轩	268,800	3,671,808.00	0.22
99	603680	今创集团	386,100	3,648,645.00	0.21
100	002811	郑中设计	368,650	3,631,202.50	0.21
101	000061	农产品	551,800	3,570,146.00	0.21
102	000568	泸州老窖	19,600	3,516,632.00	0.21
103	002271	东方雨虹	182,900	3,511,680.00	0.21
104	000069	华侨城 A	1,123,500	3,494,085.00	0.21
105	600037	歌华有线	449,300	3,473,089.00	0.20
106	300893	松原股份	116,863	3,415,905.49	0.20
107	600612	老凤祥	48,848	3,370,512.00	0.20
108	600707	彩虹股份	496,800	3,353,400.00	0.20
109	600420	国药现代	337,600	3,305,104.00	0.19
110	688209	英集芯	184,008	3,286,382.88	0.19
111	603328	依顿电子	401,100	3,268,965.00	0.19
112	601668	中国建筑	675,000	3,246,750.00	0.19

113	600582	天地科技	586,281	3,189,368.64	0.19
114	601567	三星医疗	155,300	3,183,650.00	0.19
115	300150	世纪瑞尔	656,300	3,183,055.00	0.19
116	603511	爱慕股份	205,547	3,181,867.56	0.19
117	300639	凯普生物	334,800	3,127,032.00	0.18
118	002206	海利得	614,900	3,086,798.00	0.18
119	002950	奥美医疗	324,100	3,072,468.00	0.18
120	600901	江苏金租	630,240	3,050,361.60	0.18
121	601609	金田股份	443,300	3,001,141.00	0.18
122	002128	电投能源	209,400	2,988,138.00	0.18
123	603301	振德医疗	121,700	2,981,650.00	0.18
124	000062	深圳华强	261,800	2,950,486.00	0.17
125	301087	可孚医疗	77,820	2,949,378.00	0.17
126	002467	二六三	633,000	2,937,120.00	0.17
127	688109	品茗科技	104,181	2,934,778.77	0.17
128	000019	深粮控股	387,900	2,924,766.00	0.17
129	600050	中国联通	655,400	2,870,652.00	0.17
130	000598	兴蓉环境	500,500	2,847,845.00	0.17
131	002152	广电运通	230,600	2,827,156.00	0.17
132	300866	安克创新	31,800	2,817,480.00	0.17
133	000625	长安汽车	166,300	2,798,829.00	0.16
134	002410	广联达	161,940	2,775,651.60	0.16
135	600812	华北制药	483,900	2,758,230.00	0.16
136	601169	北京银行	599,900	2,717,547.00	0.16
137	603225	新凤鸣	186,900	2,653,980.00	0.16
138	002774	快意电梯	313,700	2,603,710.00	0.15
139	002646	天佑德酒	190,300	2,589,983.00	0.15
140	002212	天融信	262,500	2,567,250.00	0.15
141	000997	新大陆	130,400	2,557,144.00	0.15
142	600497	驰宏锌锗	504,500	2,547,725.00	0.15
143	002247	聚力文化	1,087,000	2,543,580.00	0.15
144	600066	宇通客车	190,400	2,522,800.00	0.15
145	300001	特锐德	124,400	2,500,440.00	0.15
146	002109	兴化股份	527,100	2,498,454.00	0.15
147	300009	安科生物	239,900	2,451,778.00	0.14
148	002138	顺络电子	89,400	2,414,694.00	0.14
149	300762	上海瀚讯	158,100	2,384,148.00	0.14
150	002444	巨星科技	104,100	2,344,332.00	0.14
151	000921	海信家电	114,700	2,339,880.00	0.14
152	600299	安迪苏	291,900	2,335,200.00	0.14
153	688127	蓝特光学	100,194	2,333,518.26	0.14
154	300286	安科瑞	89,700	2,325,921.00	0.14
155	600380	健康元	187,100	2,325,653.00	0.14
156	002851	麦格米特	94,500	2,324,700.00	0.14

157	000612	焦作万方	404,200	2,324,150.00	0.14
158	000089	深圳机场	359,400	2,310,942.00	0.14
159	600562	国睿科技	166,900	2,309,896.00	0.14
160	600019	宝钢股份	389,200	2,307,956.00	0.14
161	000503	国新健康	175,000	2,306,500.00	0.14
162	600552	凯盛科技	172,100	2,294,093.00	0.13
163	600406	国电南瑞	102,070	2,278,202.40	0.13
164	603920	世运电路	124,600	2,277,688.00	0.13
165	002832	比音勒芬	71,800	2,276,060.00	0.13
166	600403	大有能源	597,700	2,271,260.00	0.13
167	603737	三棵树	47,600	2,266,236.00	0.13
168	601989	中国重工	548,400	2,264,892.00	0.13
169	600919	江苏银行	337,700	2,259,213.00	0.13
170	002925	盈趣科技	115,170	2,242,359.90	0.13
171	603093	南华期货	185,300	2,223,600.00	0.13
172	002516	旷达科技	449,200	2,214,556.00	0.13
173	688586	江航装备	198,500	2,201,365.00	0.13
174	300440	运达科技	294,000	2,190,300.00	0.13
175	688578	艾力斯	52,100	2,170,486.00	0.13
176	002677	浙江美大	213,700	2,160,507.00	0.13
177	002215	诺普信	261,500	2,159,990.00	0.13
178	600959	江苏有线	687,200	2,157,808.00	0.13
179	600750	江中药业	103,300	2,156,904.00	0.13
180	300596	利安隆	72,900	2,154,924.00	0.13
181	605158	华达新材	283,300	2,153,080.00	0.13
182	002254	泰和新材	143,600	2,148,256.00	0.13
183	601333	广深铁路	827,800	2,144,002.00	0.13
184	000035	中国天楹	432,600	2,137,044.00	0.13
185	688707	振华新材	104,100	2,134,050.00	0.13
186	688315	诺禾致源	91,100	2,126,274.00	0.12
187	002498	汉缆股份	530,700	2,122,800.00	0.12
188	688660	电气风电	412,600	2,120,764.00	0.12
189	688681	科汇股份	136,900	2,115,105.00	0.12
190	002088	鲁阳节能	147,600	2,103,300.00	0.12
191	000559	万向钱潮	404,500	2,099,355.00	0.12
192	603132	金徽股份	153,000	2,093,040.00	0.12
193	600688	上海石化	730,100	2,088,086.00	0.12
194	688161	威高骨科	50,300	2,084,935.00	0.12
195	688105	诺唯赞	64,800	2,074,896.00	0.12
196	000930	中粮科技	311,800	2,070,352.00	0.12
197	002378	章源钨业	364,300	2,061,938.00	0.12
198	300271	华宇软件	251,700	2,061,423.00	0.12
199	600377	宁沪高速	200,400	2,054,100.00	0.12
200	003041	真爱美家	122,920	2,046,618.00	0.12

201	000650	仁和药业	307,700	2,040,051.00	0.12
202	605222	起帆电缆	105,800	2,039,824.00	0.12
203	603187	海容冷链	134,300	2,035,988.00	0.12
204	002534	西子洁能	162,900	2,034,621.00	0.12
205	002318	久立特材	101,500	2,017,820.00	0.12
206	000928	中钢国际	346,100	2,017,763.00	0.12
207	603444	吉比特	8,200	2,009,984.00	0.12
208	000951	中国重汽	150,400	2,009,344.00	0.12
209	002763	汇洁股份	238,790	2,008,223.90	0.12
210	000030	富奥股份	373,700	1,995,558.00	0.12
211	601019	山东出版	210,800	1,977,304.00	0.12
212	000630	铜陵有色	602,400	1,975,872.00	0.12
213	002991	甘源食品	27,300	1,950,858.00	0.11
214	688626	翔宇医疗	36,500	1,945,085.00	0.11
215	300183	东软载波	128,200	1,934,538.00	0.11
216	002718	友邦吊顶	113,700	1,934,037.00	0.11
217	688198	佰仁医疗	15,520	1,932,705.60	0.11
218	600997	开滦股份	252,900	1,929,627.00	0.11
219	300887	谱尼测试	163,200	1,927,392.00	0.11
220	003006	百亚股份	127,100	1,926,836.00	0.11
221	000553	安道麦A	277,200	1,923,768.00	0.11
222	600986	浙文互联	351,900	1,921,374.00	0.11
223	002191	劲嘉股份	357,700	1,920,849.00	0.11
224	002563	森马服饰	330,600	1,907,562.00	0.11
225	002249	大洋电机	383,500	1,905,995.00	0.11
226	000517	荣安地产	776,600	1,902,670.00	0.11
227	000761	本钢板材	531,700	1,898,169.00	0.11
228	601068	中铝国际	410,300	1,895,586.00	0.11
229	600120	浙江东方	528,000	1,895,520.00	0.11
230	002517	恺英网络	169,400	1,892,198.00	0.11
231	688568	中科星图	38,500	1,888,810.00	0.11
232	603321	梅轮电梯	220,000	1,878,800.00	0.11
233	002007	华兰生物	84,600	1,872,198.00	0.11
234	002891	中宠股份	70,800	1,865,580.00	0.11
235	600637	东方明珠	247,500	1,861,200.00	0.11
236	600398	海澜之家	249,100	1,848,322.00	0.11
237	688499	利元亨	47,700	1,816,416.00	0.11
238	002551	尚荣医疗	446,100	1,811,166.00	0.11
239	301046	能辉科技	66,500	1,803,480.00	0.11
240	600696	岩石股份	99,800	1,795,402.00	0.11
241	002643	万润股份	108,100	1,793,379.00	0.11
242	603277	银都股份	66,000	1,770,120.00	0.10
243	300069	金利华电	109,900	1,769,390.00	0.10
244	002085	万丰奥威	358,100	1,769,014.00	0.10

245	600183	生益科技	95,900	1,755,929.00	0.10
246	600369	西南证券	428,600	1,752,974.00	0.10
247	603766	隆鑫通用	339,200	1,750,272.00	0.10
248	300702	天宇股份	79,900	1,734,629.00	0.10
249	002900	哈三联	126,200	1,722,630.00	0.10
250	688163	赛伦生物	85,500	1,709,145.00	0.10
251	000869	张裕 A	69,700	1,682,558.00	0.10
252	000728	国元证券	242,500	1,656,275.00	0.10
253	600216	浙江医药	153,700	1,649,201.00	0.10
254	000791	甘肃能源	295,200	1,644,264.00	0.10
255	601098	中南传媒	161,600	1,643,472.00	0.10
256	601101	昊华能源	259,500	1,640,040.00	0.10
257	688616	西力科技	120,200	1,639,528.00	0.10
258	300296	利亚德	270,100	1,620,600.00	0.10
259	600363	联创光电	47,500	1,615,000.00	0.09
260	688232	新点软件	43,800	1,585,560.00	0.09
261	000967	盈峰环境	329,900	1,567,025.00	0.09
262	002381	双箭股份	203,600	1,543,288.00	0.09
263	000060	中金岭南	355,923	1,537,587.36	0.09
264	601808	中海油服	101,800	1,488,316.00	0.09
265	300412	迦南科技	254,600	1,448,674.00	0.09
266	688639	华恒生物	11,100	1,397,490.00	0.08
267	601163	三角轮胎	96,671	1,393,029.11	0.08
268	000050	深天马 A	130,800	1,393,020.00	0.08
269	600718	东软集团	150,000	1,387,500.00	0.08
270	601618	中国中冶	450,800	1,379,448.00	0.08
271	601818	光大银行	469,600	1,361,840.00	0.08
272	300123	亚光科技	185,600	1,360,448.00	0.08
273	002709	天赐材料	54,100	1,356,828.00	0.08
274	000987	越秀资本	225,300	1,356,306.00	0.08
275	002394	联发股份	163,000	1,354,530.00	0.08
276	603298	杭叉集团	54,400	1,353,472.00	0.08
277	600025	华能水电	153,716	1,326,569.08	0.08
278	688169	石头科技	4,665	1,319,961.75	0.08
279	002048	宁波华翔	101,400	1,319,214.00	0.08
280	600016	民生银行	349,000	1,305,260.00	0.08
281	600201	生物股份	120,600	1,298,862.00	0.08
282	000528	柳工	192,300	1,296,102.00	0.08
283	601126	四方股份	90,700	1,284,312.00	0.08
284	601601	中国太保	53,700	1,276,986.00	0.07
285	002063	远光软件	205,460	1,269,742.80	0.07
286	002803	吉宏股份	61,300	1,260,328.00	0.07
287	002020	京新药业	97,800	1,244,016.00	0.07
288	688308	欧科亿	43,900	1,224,810.00	0.07

289	002636	金安国纪	136,900	1,219,779.00	0.07
290	002078	太阳纸业	99,400	1,209,698.00	0.07
291	002163	海南发展	132,700	1,204,916.00	0.07
292	603279	景津装备	54,300	1,200,573.00	0.07
293	600480	凌云股份	131,300	1,196,143.00	0.07
294	002946	新乳业	103,900	1,192,772.00	0.07
295	300497	富祥药业	125,900	1,178,424.00	0.07
296	601700	风范股份	234,300	1,173,843.00	0.07
297	601633	长城汽车	46,400	1,170,208.00	0.07
298	601390	中国中铁	205,900	1,169,512.00	0.07
299	601298	青岛港	189,200	1,169,256.00	0.07
300	603659	璞泰来	55,700	1,165,801.00	0.07
301	603100	川仪股份	42,000	1,164,240.00	0.07
302	600055	万东医疗	67,900	1,159,732.00	0.07
303	000166	申万宏源	258,300	1,146,852.00	0.07
304	600797	浙大网新	174,500	1,144,720.00	0.07
305	603568	伟明环保	71,400	1,142,400.00	0.07
306	601369	陕鼓动力	142,400	1,136,352.00	0.07
307	301033	迈普医学	26,000	1,132,040.00	0.07
308	002421	达实智能	348,700	1,122,814.00	0.07
309	600908	无锡银行	219,500	1,108,475.00	0.07
310	002267	陕天然气	150,900	1,106,097.00	0.06
311	603718	海利生物	102,400	1,096,704.00	0.06
312	002959	小熊电器	21,100	1,095,723.00	0.06
313	300215	电科院	206,200	1,090,798.00	0.06
314	601963	重庆银行	156,388	1,088,460.48	0.06
315	601231	环旭电子	72,000	1,087,920.00	0.06
316	300800	力合科技	79,400	1,085,398.00	0.06
317	603928	兴业股份	81,000	1,082,970.00	0.06
318	002214	大立科技	94,100	1,079,327.00	0.06
319	600458	时代新材	115,900	1,067,439.00	0.06
320	600691	阳煤化工	329,400	1,057,374.00	0.06
321	002651	利君股份	151,600	1,049,072.00	0.06
322	688567	孚能科技	64,300	1,048,733.00	0.06
323	688350	富淼科技	63,400	1,048,002.00	0.06
324	600063	皖维高新	243,100	1,045,330.00	0.06
325	300696	爱乐达	59,800	1,041,118.00	0.06
326	300411	金盾股份	148,800	1,040,112.00	0.06
327	605369	拱东医疗	18,600	1,038,252.00	0.06
328	600623	华谊集团	160,600	1,034,264.00	0.06
329	601608	中信重工	265,200	1,023,672.00	0.06
330	300741	华宝股份	47,300	1,012,693.00	0.06
331	603098	森特股份	74,400	1,012,584.00	0.06
332	002287	奇正藏药	44,930	1,010,475.70	0.06

333	300595	欧普康视	44,654	1,008,287.32	0.06
334	603368	柳药集团	53,200	1,006,544.00	0.06
335	600529	山东药玻	39,200	1,003,520.00	0.06
336	600690	海尔智家	47,300	993,300.00	0.06
337	000969	安泰科技	109,300	982,607.00	0.06
338	300698	万马科技	26,700	974,550.00	0.06
339	605009	豪悦护理	25,400	969,518.00	0.06
340	000636	风华高科	70,800	967,128.00	0.06
341	600741	华域汽车	58,600	954,008.00	0.06
342	600231	凌钢股份	438,500	942,775.00	0.06
343	300860	锋尚文化	17,200	939,636.00	0.06
344	601336	新华保险	29,900	930,787.00	0.05
345	600717	天津港	226,300	930,093.00	0.05
346	300760	迈瑞医疗	3,200	929,920.00	0.05
347	000090	天健集团	201,600	927,360.00	0.05
348	002320	海峡股份	157,600	918,808.00	0.05
349	603927	中科软	30,400	911,392.00	0.05
350	688717	艾罗能源	16,147	898,742.02	0.05
351	600018	上港集团	183,400	898,660.00	0.05
352	000901	航天科技	93,900	875,148.00	0.05
353	300383	光环新网	88,400	859,248.00	0.05
354	301077	星华新材	42,200	857,926.00	0.05
355	301200	大族数控	22,700	857,379.00	0.05
356	300527	中船应急	112,500	857,250.00	0.05
357	600643	爱建集团	166,900	851,190.00	0.05
358	002065	东华软件	137,900	850,843.00	0.05
359	688355	明志科技	42,700	849,730.00	0.05
360	002111	威海广泰	93,200	844,392.00	0.05
361	688768	容知日新	22,800	839,268.00	0.05
362	603699	纽威股份	60,500	838,530.00	0.05
363	300851	交大思诺	26,700	832,239.00	0.05
364	688622	禾信仪器	23,142	831,954.90	0.05
365	601319	中国人保	171,000	827,640.00	0.05
366	688045	必易微	19,100	818,053.00	0.05
367	600285	羚锐制药	47,600	814,436.00	0.05
368	000733	振华科技	13,800	811,992.00	0.05
369	603858	步长制药	47,700	811,377.00	0.05
370	002296	辉煌科技	96,800	798,600.00	0.05
371	002373	千方科技	71,000	795,910.00	0.05
372	601886	江河集团	117,100	779,886.00	0.05
373	688329	艾隆科技	30,900	768,174.00	0.05
374	601717	郑煤机	60,400	764,060.00	0.04
375	603813	原尚股份	47,200	762,280.00	0.04
376	002841	视源股份	16,300	745,888.00	0.04

377	001872	招商港口	45,700	729,372.00	0.04
378	300386	飞天诚信	66,300	711,399.00	0.04
379	600968	海油发展	249,000	709,650.00	0.04
380	688244	永信至诚	12,700	708,533.00	0.04
381	002545	东方铁塔	98,400	703,560.00	0.04
382	002242	九阳股份	55,000	699,050.00	0.04
383	603669	灵康药业	125,600	694,568.00	0.04
384	301037	保立佳	34,700	691,571.00	0.04
385	600400	红豆股份	244,100	681,039.00	0.04
386	301180	万祥科技	37,200	672,948.00	0.04
387	600261	阳光照明	202,800	663,156.00	0.04
388	603515	欧普照明	38,009	660,596.42	0.04
389	002705	新宝股份	44,400	646,908.00	0.04
390	300319	麦捷科技	66,200	638,168.00	0.04
391	600885	宏发股份	22,900	632,956.00	0.04
392	600867	通化东宝	58,200	630,306.00	0.04
393	300348	长亮科技	61,000	628,910.00	0.04
394	002412	汉森制药	91,600	621,048.00	0.04
395	603590	康辰药业	16,300	620,704.00	0.04
396	000550	江铃汽车	32,600	620,378.00	0.04
397	300274	阳光电源	7,000	613,130.00	0.04
398	600012	皖通高速	55,100	607,202.00	0.04
399	603801	志邦家居	35,900	602,043.00	0.04
400	600938	中国海油	28,400	595,548.00	0.03
401	300119	瑞普生物	36,100	591,679.00	0.03
402	002277	友阿股份	146,000	588,380.00	0.03
403	600535	天士力	34,400	585,488.00	0.03
404	600489	中金黄金	57,800	575,688.00	0.03
405	600618	氯碱化工	62,300	566,930.00	0.03
406	601658	邮储银行	130,300	566,805.00	0.03
407	300551	古鳌科技	32,400	563,760.00	0.03
408	002131	利欧股份	244,900	558,372.00	0.03
409	600126	杭钢股份	103,900	553,787.00	0.03
410	300451	创业慧康	84,100	550,855.00	0.03
411	300717	华信新材	32,500	545,675.00	0.03
412	600876	凯盛新能	38,100	534,543.00	0.03
413	002436	兴森科技	35,700	525,861.00	0.03
414	603898	好莱客	47,200	517,784.00	0.03
415	601607	上海医药	30,900	516,957.00	0.03
416	000785	居然之家	156,600	516,780.00	0.03
417	300433	蓝思科技	38,900	513,480.00	0.03
418	000795	英洛华	81,300	506,499.00	0.03
419	601577	长沙银行	74,000	504,680.00	0.03
420	002555	三七互娱	26,600	500,346.00	0.03

421	300155	安居宝	83,800	496,096.00	0.03
422	300059	东方财富	35,000	491,400.00	0.03
423	000848	承德露露	61,800	485,130.00	0.03
424	601228	广州港	154,400	483,272.00	0.03
425	002139	拓邦股份	49,000	478,240.00	0.03
426	603678	火炬电子	17,800	471,166.00	0.03
427	002706	良信股份	52,100	460,043.00	0.03
428	300685	艾德生物	20,500	450,590.00	0.03
429	600837	海通证券	48,000	449,760.00	0.03
430	000031	大悦城	146,700	435,699.00	0.03
431	000623	吉林敖东	28,500	431,490.00	0.03
432	300769	德方纳米	6,800	415,004.00	0.02
433	600060	海信视像	19,600	409,640.00	0.02
434	002683	广东宏大	20,000	401,600.00	0.02
435	600528	中铁工业	52,300	389,112.00	0.02
436	600966	博汇纸业	62,100	385,641.00	0.02
437	002179	中航光电	9,800	382,200.00	0.02
438	000738	航发控制	18,900	376,110.00	0.02
439	600177	雅戈尔	56,300	368,765.00	0.02
440	601600	中国铝业	63,700	359,268.00	0.02
441	000933	神火股份	20,500	344,400.00	0.02
442	002053	云南能投	35,100	337,662.00	0.02
443	600167	联美控股	58,600	332,262.00	0.02
444	000913	钱江摩托	24,600	306,762.00	0.02
445	603071	物产环能	19,800	300,960.00	0.02
446	600809	山西汾酒	1,300	299,949.00	0.02
447	000627	天茂集团	105,500	299,620.00	0.02
448	000682	东方电子	36,800	296,240.00	0.02
449	688002	睿创微纳	6,300	278,586.00	0.02
450	002550	千红制药	46,700	274,596.00	0.02
451	688619	罗普特	19,100	268,546.00	0.02
452	688067	爱威科技	11,100	264,291.00	0.02
453	603228	景旺电子	11,600	261,696.00	0.02
454	600863	内蒙华电	66,400	258,960.00	0.02
455	600828	茂业商业	70,800	258,420.00	0.02
456	688132	邦彦技术	11,900	255,017.00	0.01
457	603439	贵州三力	12,700	239,776.00	0.01
458	603871	嘉友国际	14,100	223,626.00	0.01
459	002673	西部证券	33,300	212,121.00	0.01
460	600123	兰花科创	18,900	208,656.00	0.01
461	002595	豪迈科技	7,000	208,390.00	0.01
462	601198	东兴证券	25,300	208,219.00	0.01
463	002960	青鸟消防	14,400	199,296.00	0.01
464	601330	绿色动力	29,900	198,536.00	0.01

465	002690	美亚光电	10,100	198,364.00	0.01
466	300535	达威股份	11,300	197,863.00	0.01
467	601702	华峰铝业	10,800	193,860.00	0.01
468	603979	金诚信	5,100	192,576.00	0.01
469	002097	山河智能	30,100	184,513.00	0.01
470	603556	海兴电力	6,200	179,986.00	0.01
471	002645	华宏科技	15,800	178,540.00	0.01
472	002566	益盛药业	19,900	177,309.00	0.01
473	601969	海南矿业	26,600	175,294.00	0.01
474	002581	未名医药	12,000	175,200.00	0.01
475	600475	华光环能	16,300	169,520.00	0.01
476	603055	台华新材	14,000	168,560.00	0.01
477	601108	财通证券	21,600	167,616.00	0.01
478	601001	晋控煤业	13,400	165,222.00	0.01
479	000596	古井贡酒	700	162,960.00	0.01
480	300621	维业股份	14,000	160,860.00	0.01
481	002948	青岛银行	52,000	158,600.00	0.01
482	000639	西王食品	34,500	152,490.00	0.01
483	002182	宝武镁业	7,700	151,382.00	0.01
484	605338	巴比食品	6,900	148,212.00	0.01
485	600760	中航沈飞	3,500	147,630.00	0.01
486	002608	江苏国信	22,100	145,197.00	0.01
487	603609	禾丰股份	16,500	141,240.00	0.01
488	600674	川投能源	9,200	139,104.00	0.01
489	601225	陕西煤业	6,400	133,696.00	0.01
490	300502	新易盛	2,700	133,164.00	0.01
491	000786	北新建材	5,700	133,152.00	0.01
492	002859	洁美科技	5,200	129,740.00	0.01
493	600391	航发科技	6,500	124,280.00	0.01
494	000686	东北证券	17,000	120,700.00	0.01
495	002105	信隆健康	18,200	117,936.00	0.01
496	002158	汉钟精机	5,100	113,526.00	0.01
497	688326	经纬恒润	900	104,445.00	0.01
498	000923	河钢资源	6,100	102,480.00	0.01
499	003012	东鹏控股	12,400	102,300.00	0.01
500	002273	水晶光电	7,400	100,196.00	0.01
501	601966	玲珑轮胎	4,900	94,227.00	0.01
502	601000	唐山港	26,800	93,800.00	0.01
503	600873	梅花生物	9,800	93,590.00	0.01
504	300470	中密控股	2,460	92,988.00	0.01
505	601311	骆驼股份	11,500	92,115.00	0.01
506	600348	华阳股份	9,200	89,792.00	0.01
507	600182	S佳通	5,800	85,956.00	0.01
508	002028	思源电气	1,600	83,264.00	0.00

509	600977	中国电影	6,700	82,008.00	0.00
510	688183	生益电子	7,200	81,864.00	0.00
511	300126	锐奇股份	11,200	80,080.00	0.00
512	603900	莱绅通灵	11,900	79,492.00	0.00
513	300618	寒锐钴业	2,800	79,212.00	0.00
514	600415	小商品城	10,700	78,324.00	0.00
515	000959	首钢股份	22,000	76,120.00	0.00
516	601555	东吴证券	10,400	76,024.00	0.00
517	000975	银泰黄金	5,000	75,000.00	0.00
518	300418	昆仑万维	2,000	74,800.00	0.00
519	603105	芯能科技	6,200	71,796.00	0.00
520	600606	绿地控股	29,400	67,620.00	0.00
521	603195	公牛集团	700	66,955.00	0.00
522	600999	招商证券	4,900	66,836.00	0.00
523	600510	黑牡丹	11,300	63,845.00	0.00
524	002867	周大生	4,200	63,756.00	0.00
525	600138	中青旅	6,000	63,720.00	0.00
526	301135	瑞德智能	2,500	62,050.00	0.00
527	002649	博彦科技	4,900	60,123.00	0.00
528	000988	华工科技	2,000	59,520.00	0.00
529	600079	人福医药	2,300	57,178.00	0.00
530	000989	九芝堂	5,400	54,648.00	0.00
531	300726	宏达电子	1,800	54,342.00	0.00
532	688366	昊海生科	500	54,145.00	0.00
533	002463	沪电股份	2,400	53,088.00	0.00
534	002025	航天电器	1,100	52,822.00	0.00
535	300281	金明精机	8,800	52,712.00	0.00
536	688548	广钢气体	4,048	51,612.00	0.00
537	600754	锦江酒店	1,700	50,830.00	0.00
538	600418	江淮汽车	3,000	48,450.00	0.00
539	000582	北部湾港	6,400	48,064.00	0.00
540	603303	得邦照明	3,680	47,288.00	0.00
541	002114	罗平锌电	6,300	47,124.00	0.00
542	688278	特宝生物	900	47,115.00	0.00
543	605007	五洲特纸	3,200	47,072.00	0.00
544	000016	深康佳 A	10,600	44,202.00	0.00
545	301526	国际复材	9,723	43,267.35	0.00
546	300931	通用电梯	4,900	41,356.00	0.00
547	000708	中信特钢	2,700	37,908.00	0.00
548	601890	亚星锚链	3,800	37,620.00	0.00
549	002695	煌上煌	3,500	36,645.00	0.00
550	688563	航材股份	601	36,354.49	0.00
551	603296	华勤技术	455	35,376.25	0.00
552	002340	格林美	6,200	33,852.00	0.00

553	605003	众望布艺	1,600	31,584.00	0.00
554	300509	新美星	4,300	31,089.00	0.00
555	600158	中体产业	3,900	30,342.00	0.00
556	600558	大西洋	7,300	29,711.00	0.00
557	301291	明阳电气	1,001	28,388.36	0.00
558	301348	蓝箭电子	613	27,321.41	0.00
559	601598	中国外运	5,200	27,248.00	0.00
560	688702	盛科通信	549	26,450.82	0.00
561	688582	芯动联科	648	25,058.16	0.00
562	600835	上海机电	2,100	24,927.00	0.00
563	603013	亚普股份	1,400	24,192.00	0.00
563	688078	龙软科技	600	24,192.00	0.00
565	301559	中集环科	1,315	23,985.60	0.00
566	600583	海油工程	4,000	23,760.00	0.00
567	603828	柯利达	6,100	23,302.00	0.00
568	301486	致尚科技	482	22,774.50	0.00
569	688138	清溢光电	1,000	22,620.00	0.00
570	688669	聚石化学	1,200	22,488.00	0.00
571	301511	德福科技	982	22,261.94	0.00
572	002633	申科股份	1,900	22,211.00	0.00
573	688023	安恒信息	200	22,178.00	0.00
574	688652	京仪装备	416	21,736.00	0.00
575	301525	儒竞科技	266	21,668.36	0.00
576	301498	乖宝宠物	554	21,500.74	0.00
577	301371	敷尔佳	564	21,195.12	0.00
578	603160	汇顶科技	300	20,730.00	0.00
579	301370	国科恒泰	1,240	19,852.40	0.00
580	601233	桐昆股份	1,300	19,669.00	0.00
581	688627	精智达	222	19,473.84	0.00
582	600566	济川药业	600	18,858.00	0.00
583	605288	凯迪股份	400	18,848.00	0.00
584	000800	一汽解放	2,200	18,700.00	0.00
585	300394	天孚通信	200	18,304.00	0.00
586	002539	云图控股	2,200	18,150.00	0.00
587	301488	豪恩汽电	262	18,101.58	0.00
588	301468	博盈特焊	598	18,071.56	0.00
589	301381	赛维时代	571	16,952.99	0.00
590	603421	鼎信通讯	1,800	16,920.00	0.00
591	301172	君逸数码	438	16,714.08	0.00
592	600935	华塑股份	4,900	16,513.00	0.00
593	301362	民爆光电	420	16,178.40	0.00
594	600628	新世界	2,300	16,123.00	0.00
595	600085	同仁堂	300	16,110.00	0.00
596	688612	威迈斯	422	16,023.34	0.00

597	600271	航天信息	1,500	15,960.00	0.00
598	601096	宏盛华源	3,918	15,907.08	0.00
599	300103	达刚控股	2,500	15,875.00	0.00
600	300015	爱尔眼科	1,000	15,820.00	0.00
601	688389	普门科技	700	15,757.00	0.00
602	301393	昊帆生物	260	15,436.20	0.00
603	600438	通威股份	600	15,018.00	0.00
604	688610	埃科光电	275	14,025.00	0.00
605	601083	锦江航运	1,263	13,981.41	0.00
606	301510	固高科技	396	13,863.96	0.00
607	000729	燕京啤酒	1,600	13,808.00	0.00
608	300843	胜蓝股份	600	13,788.00	0.00
609	601568	北元集团	2,800	13,272.00	0.00
610	601799	星宇股份	100	13,111.00	0.00
611	300272	开能健康	2,100	13,020.00	0.00
612	603337	杰克股份	600	12,960.00	0.00
613	000020	深华发 A	1,000	12,950.00	0.00
614	300358	楚天科技	1,200	12,840.00	0.00
615	301210	金杨股份	281	12,779.88	0.00
616	301566	达利凯普	576	12,752.64	0.00
617	300124	汇川技术	200	12,628.00	0.00
618	301456	盘古智能	407	12,368.73	0.00
619	688655	迅捷兴	795	12,004.50	0.00
620	603317	天味食品	900	11,961.00	0.00
621	688602	康鹏科技	1,066	11,789.96	0.00
622	688719	爱科赛博	194	11,659.40	0.00
623	603079	圣达生物	800	11,656.00	0.00
624	300012	华测检测	800	11,360.00	0.00
625	301550	斯菱股份	260	11,328.20	0.00
626	301292	海科新源	583	11,281.05	0.00
627	300206	理邦仪器	1,100	11,231.00	0.00
628	301508	中机认检	419	11,178.92	0.00
629	002204	大连重工	2,400	10,968.00	0.00
630	600761	安徽合力	600	10,926.00	0.00
631	002582	好想你	1,400	10,738.00	0.00
632	688559	海目星	300	10,710.00	0.00
633	601077	渝农商行	2,600	10,608.00	0.00
634	601866	中远海发	4,500	10,530.00	0.00
635	688603	天承科技	140	10,379.60	0.00
636	002019	亿帆医药	700	10,346.00	0.00
637	301528	多浦乐	148	10,198.68	0.00
638	301329	信音电子	458	10,181.34	0.00
639	603056	德邦股份	700	10,129.00	0.00
640	301372	科净源	231	10,069.29	0.00

641	301261	恒工精密	198	10,068.30	0.00
642	002423	中粮资本	1,500	10,020.00	0.00
643	600160	巨化股份	600	9,894.00	0.00
644	301202	朗威股份	306	9,730.80	0.00
645	605189	富春染织	600	9,720.00	0.00
646	301395	仁信新材	520	9,718.80	0.00
647	688716	中研股份	267	9,716.13	0.00
648	002939	长城证券	1,200	9,600.00	0.00
649	301413	安培龙	164	9,543.16	0.00
650	301500	飞南资源	455	9,504.95	0.00
651	301418	协昌科技	189	9,487.80	0.00
652	301516	中远通	604	9,368.04	0.00
653	301272	英华特	173	9,234.74	0.00
654	301469	恒达新材	275	9,099.75	0.00
655	301519	舜禹股份	442	8,932.82	0.00
656	301518	长华化学	385	8,858.85	0.00
657	301568	思泰克	246	8,752.68	0.00
658	600879	航天电子	1,100	8,481.00	0.00
659	301520	万邦医药	160	8,438.40	0.00
660	688638	誉辰智能	141	8,414.88	0.00
661	301459	丰茂股份	208	8,286.72	0.00
662	688720	艾森股份	165	8,223.60	0.00
663	301489	思泉新材	128	8,206.08	0.00
664	688651	盛邦安全	178	8,196.90	0.00
665	301517	陕西华达	185	8,082.65	0.00
666	301578	辰奕智能	118	8,061.76	0.00
667	002142	宁波银行	400	8,044.00	0.00
668	301548	崇德科技	136	8,022.64	0.00
669	688657	浩辰软件	101	7,901.23	0.00
670	688671	碧兴物联	226	7,751.80	0.00
671	688693	锆威特	178	7,726.98	0.00
672	603275	众辰科技	193	7,662.10	0.00
673	301533	威马农机	225	7,461.00	0.00
674	603062	麦加芯彩	126	7,284.06	0.00
675	301555	惠柏新材	224	7,266.56	0.00
676	301505	苏州规划	194	6,947.14	0.00
677	301529	福赛科技	182	6,894.16	0.00
678	301515	港通医疗	230	6,502.10	0.00
679	688648	中邮科技	303	6,493.29	0.00
680	001378	德冠新材	205	6,410.35	0.00
681	688450	光格科技	167	6,082.14	0.00
682	603004	鼎龙科技	195	6,082.05	0.00
683	002384	东山精密	300	5,454.00	0.00
684	600109	国金证券	600	5,448.00	0.00

685	603119	浙江荣泰	226	5,394.62	0.00
686	001306	夏厦精密	64	4,823.04	0.00
687	603075	热威股份	182	4,242.42	0.00
688	002091	江苏国泰	500	3,915.00	0.00
689	001358	兴欣新材	87	3,841.92	0.00
690	001239	永达股份	189	3,764.88	0.00
691	600577	精达股份	900	3,726.00	0.00
692	603231	索宝蛋白	161	3,466.33	0.00
693	603273	天元智能	178	3,376.66	0.00
694	603276	恒兴新材	134	3,333.92	0.00
695	603373	安邦护卫	88	3,058.00	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	52,414,030.00	59.65
2	300750	宁德时代	37,662,964.60	42.86
3	000333	美的集团	33,954,068.00	38.64
4	601318	中国平安	33,199,899.00	37.78
5	601138	工业富联	24,881,677.00	28.32
6	000725	京东方 A	24,345,097.00	27.70
7	000858	五粮液	24,107,958.00	27.43
8	600276	恒瑞医药	24,093,193.80	27.42
9	601328	交通银行	23,332,398.00	26.55
10	002594	比亚迪	22,391,122.00	25.48
11	000338	潍柴动力	22,373,765.00	25.46
12	601398	工商银行	22,314,937.00	25.39
13	601857	中国石油	20,708,582.00	23.57
14	601888	中国中免	20,055,289.00	22.82
15	601939	建设银行	19,928,733.00	22.68
16	601288	农业银行	19,575,844.00	22.28
17	601766	中国中车	19,010,836.78	21.63
18	600036	招商银行	18,474,095.00	21.02
19	300760	迈瑞医疗	18,308,694.00	20.84
20	688981	中芯国际	17,645,081.39	20.08
21	603259	药明康德	17,425,116.00	19.83
22	002415	海康威视	16,904,805.00	19.24
23	600900	长江电力	16,691,206.00	18.99
24	601816	京沪高铁	16,209,485.00	18.45
25	000100	TCL 科技	15,795,943.50	17.98

26	000157	中联重科	15,174,059.00	17.27
27	000063	中兴通讯	15,075,375.00	17.16
28	601728	中国电信	14,843,650.00	16.89
29	600028	中国石化	14,467,256.25	16.46
30	000513	丽珠集团	14,428,411.00	16.42
31	300767	震安科技	14,382,839.20	16.37
32	002811	郑中设计	13,869,995.50	15.78
33	000932	华菱钢铁	13,669,282.00	15.56
34	002027	分众传媒	12,999,197.00	14.79
35	601006	大秦铁路	12,604,563.00	14.34
36	002563	森马服饰	12,595,020.00	14.33
37	002001	新和成	12,216,251.00	13.90
38	000761	本钢板材	11,975,709.00	13.63
39	601088	中国神华	11,885,068.00	13.53
40	688111	金山办公	11,871,906.71	13.51
41	002410	广联达	11,794,983.80	13.42
42	000039	中集集团	11,580,685.55	13.18
43	601899	紫金矿业	11,542,962.00	13.14
44	601158	重庆水务	11,501,877.00	13.09
45	000030	富奥股份	11,353,167.00	12.92
46	003816	中国广核	11,328,771.00	12.89
47	600837	海通证券	11,229,714.00	12.78
48	601336	新华保险	11,174,161.00	12.72
49	002461	珠江啤酒	11,149,328.00	12.69
50	601688	华泰证券	11,135,274.00	12.67
51	600161	天坛生物	11,033,429.60	12.56
52	688100	威胜信息	10,923,386.63	12.43
53	688256	寒武纪	10,848,005.66	12.35
54	688661	和林微纳	10,808,369.50	12.30
55	600007	中国国贸	10,754,154.00	12.24
56	603444	吉比特	10,579,957.00	12.04
57	600582	天地科技	10,542,067.63	12.00
58	000425	徐工机械	10,480,743.00	11.93
59	601169	北京银行	10,336,433.00	11.76
60	600901	江苏金租	10,145,758.60	11.55
61	601577	长沙银行	10,106,982.00	11.50
62	002152	广电运通	10,104,059.00	11.50
63	300502	新易盛	10,097,021.00	11.49
64	600971	恒源煤电	10,028,422.85	11.41
65	600941	中国移动	9,901,513.00	11.27
66	000811	冰轮环境	9,677,738.00	11.01
67	002990	盛视科技	9,611,719.00	10.94
68	600696	岩石股份	9,605,408.97	10.93
69	600312	平高电气	9,581,638.00	10.90

70	002399	海普瑞	9,478,747.54	10.79
71	002683	广东宏大	9,440,252.00	10.74
72	601567	三星医疗	9,429,403.00	10.73
73	688315	诺禾致源	9,371,823.07	10.67
74	601211	国泰君安	9,315,666.00	10.60
75	600660	福耀玻璃	9,256,299.00	10.53
76	601186	中国铁建	9,031,515.00	10.28
77	688819	天能股份	9,013,533.11	10.26
78	002920	德赛西威	9,011,852.00	10.26
79	600120	浙江东方	8,939,741.00	10.17
80	600746	江苏索普	8,852,115.00	10.07
81	600025	华能水电	8,834,380.48	10.05
82	002605	姚记科技	8,828,082.00	10.05
83	600016	民生银行	8,827,527.00	10.05
84	000559	万向钱潮	8,748,806.00	9.96
85	601012	隆基绿能	8,711,282.23	9.91
86	000651	格力电器	8,704,603.00	9.91
87	000028	国药一致	8,665,341.40	9.86
88	000568	泸州老窖	8,661,318.00	9.86
89	688678	福立旺	8,648,279.95	9.84
90	688616	西力科技	8,620,614.96	9.81
91	002252	上海莱士	8,544,751.00	9.72
92	603766	隆鑫通用	8,472,096.00	9.64
93	002595	豪迈科技	8,419,353.00	9.58
94	002724	海洋王	8,418,023.00	9.58
95	600406	国电南瑞	8,408,898.94	9.57
96	601607	上海医药	8,397,053.00	9.56
97	601985	中国核电	8,379,379.00	9.54
98	601019	山东出版	8,352,196.00	9.50
99	300866	安克创新	8,345,948.00	9.50
100	002236	大华股份	8,305,078.00	9.45
101	600066	宇通客车	8,299,751.00	9.45
102	601898	中煤能源	8,293,970.00	9.44
103	300896	爱美客	8,222,266.00	9.36
104	601963	重庆银行	8,204,124.96	9.34
105	000990	诚志股份	8,171,746.00	9.30
106	601668	中国建筑	8,133,160.00	9.26
107	600841	动力新科	8,061,216.00	9.17
108	601628	中国人寿	8,041,041.00	9.15
109	301028	东亚机械	8,033,945.00	9.14
110	603839	安正时尚	7,965,380.60	9.06
111	300347	泰格医药	7,958,631.20	9.06
112	600370	三房巷	7,948,808.00	9.05
113	002950	奥美医疗	7,929,221.00	9.02

114	300418	昆仑万维	7,920,519.00	9.01
115	601333	广深铁路	7,915,787.00	9.01
116	002007	华兰生物	7,855,441.00	8.94
117	002003	伟星股份	7,814,897.00	8.89
118	300122	智飞生物	7,814,074.00	8.89
119	300768	迪普科技	7,811,781.00	8.89
120	603515	欧普照明	7,772,894.35	8.85
121	688012	中微公司	7,734,076.39	8.80
122	000598	兴蓉环境	7,710,611.00	8.77
123	600420	国药现代	7,700,594.00	8.76
124	601139	深圳燃气	7,688,324.00	8.75
125	603053	成都燃气	7,681,909.00	8.74
126	002206	海利得	7,638,462.00	8.69
127	000997	新大陆	7,577,396.00	8.62
128	300587	天铁股份	7,549,270.00	8.59
129	002651	利君股份	7,543,153.00	8.58
130	003006	百亚股份	7,542,415.08	8.58
131	600989	宝丰能源	7,540,050.00	8.58
132	301087	可孚医疗	7,523,994.00	8.56
133	000062	深圳华强	7,466,782.00	8.50
134	600383	金地集团	7,411,820.00	8.43
135	601699	潞安环能	7,401,732.88	8.42
136	600795	国电电力	7,385,367.00	8.40
137	300981	中红医疗	7,282,938.66	8.29
138	601601	中国太保	7,281,013.00	8.29
139	000517	荣安地产	7,276,749.00	8.28
140	601989	中国重工	7,176,658.00	8.17
141	002130	沃尔核材	7,148,467.00	8.13
142	605158	华达新材	7,128,680.80	8.11
143	000686	东北证券	7,100,652.00	8.08
144	600674	川投能源	7,088,173.00	8.07
145	002233	塔牌集团	7,046,967.00	8.02
146	603551	奥普家居	7,030,402.00	8.00
147	002215	诺普信	6,901,491.00	7.85
148	000612	焦作万方	6,842,877.60	7.79
149	002558	巨人网络	6,800,501.00	7.74
150	603303	得邦照明	6,726,637.80	7.65
151	688235	百济神州	6,692,552.21	7.62
152	002318	久立特材	6,659,239.50	7.58
153	600967	内蒙一机	6,646,035.00	7.56
154	000060	中金岭南	6,632,257.83	7.55
155	000800	一汽解放	6,613,218.00	7.53
156	300030	阳普医疗	6,603,106.00	7.51
157	002677	浙江美大	6,594,664.00	7.50

158	003041	真爱美家	6,540,778.60	7.44
159	601319	中国人保	6,534,179.00	7.44
160	002249	大洋电机	6,532,226.00	7.43
161	600380	健康元	6,522,732.00	7.42
162	605009	豪悦护理	6,520,670.00	7.42
163	002088	鲁阳节能	6,501,386.00	7.40
164	600583	海油工程	6,494,199.00	7.39
165	600489	中金黄金	6,419,687.00	7.31
166	002516	旷达科技	6,404,480.00	7.29
167	002032	苏泊尔	6,393,363.00	7.28
168	603989	艾华集团	6,392,455.00	7.27
169	600771	广誉远	6,369,691.00	7.25
170	000980	众泰汽车	6,358,404.00	7.24
171	002287	奇正藏药	6,334,464.10	7.21
172	002247	聚力文化	6,334,405.00	7.21
173	600167	联美控股	6,277,216.00	7.14
174	601225	陕西煤业	6,276,260.00	7.14
175	600662	外服控股	6,260,824.00	7.12
176	301046	能辉科技	6,258,341.85	7.12
177	600308	华泰股份	6,251,859.40	7.11
178	600085	同仁堂	6,244,756.00	7.11
179	000019	深粮控股	6,240,405.00	7.10
180	002283	天润工业	6,230,498.00	7.09
181	002128	电投能源	6,214,542.00	7.07
182	002028	思源电气	6,187,949.00	7.04
183	600612	老凤祥	6,182,809.72	7.04
184	603530	神马电力	6,152,963.00	7.00
185	300003	乐普医疗	6,135,895.00	6.98
186	000623	吉林敖东	6,096,094.00	6.94
187	600761	安徽合力	6,085,123.00	6.92
188	601137	博威合金	6,060,642.00	6.90
189	688072	拓荆科技	6,043,885.80	6.88
190	601018	宁波港	6,031,934.00	6.86
191	300206	理邦仪器	6,007,007.00	6.84
192	000061	农产品	6,005,270.00	6.83
193	600363	联创光电	5,993,833.00	6.82
194	000035	中国天楹	5,951,799.00	6.77
195	600252	中恒集团	5,925,674.00	6.74
196	300001	特锐德	5,911,028.00	6.73
197	000528	柳工	5,882,116.00	6.69
198	002153	石基信息	5,854,213.00	6.66
199	601658	邮储银行	5,848,761.00	6.66
200	002774	快意电梯	5,824,183.00	6.63
201	600919	江苏银行	5,817,265.00	6.62

202	600816	建元信托	5,814,416.00	6.62
203	603328	依顿电子	5,790,616.00	6.59
204	000921	海信家电	5,779,672.00	6.58
205	605179	一鸣食品	5,775,745.00	6.57
206	301071	力量钻石	5,759,647.36	6.55
207	688718	唯赛勃	5,689,030.43	6.47
208	000959	首钢股份	5,676,425.00	6.46
209	600562	国睿科技	5,617,727.00	6.39
210	688161	威高骨科	5,615,081.27	6.39
211	002641	公元股份	5,612,255.00	6.39
212	688055	龙腾光电	5,610,341.40	6.38
213	301280	珠城科技	5,601,880.50	6.37
214	002745	木林森	5,588,770.04	6.36
215	600029	南方航空	5,587,548.00	6.36
216	000089	深圳机场	5,587,168.00	6.36
217	301180	万祥科技	5,581,865.87	6.35
218	000020	深华发 A	5,567,040.00	6.34
219	000923	河钢资源	5,566,199.00	6.33
220	000783	长江证券	5,559,135.00	6.33
221	002636	金安国纪	5,548,907.00	6.31
222	002611	东方精工	5,547,265.00	6.31
223	688198	佰仁医疗	5,530,864.99	6.29
224	002925	盈趣科技	5,514,745.80	6.28
225	000902	新洋丰	5,509,612.91	6.27
226	000597	东北制药	5,507,988.00	6.27
227	688046	药康生物	5,489,582.38	6.25
228	603993	洛阳钼业	5,460,685.00	6.21
229	600104	上汽集团	5,442,439.00	6.19
230	002017	东信和平	5,441,527.00	6.19
231	000415	渤海租赁	5,421,139.00	6.17
232	600039	四川路桥	5,402,080.00	6.15
233	600548	深高速	5,401,581.00	6.15
234	002555	三七互娱	5,395,490.00	6.14
235	600998	九州通	5,379,371.94	6.12
236	603013	亚普股份	5,345,231.00	6.08
237	688499	利元亨	5,301,525.86	6.03
238	601618	中国中冶	5,279,324.00	6.01
239	301019	宁波色母	5,268,587.00	6.00
240	000557	西部创业	5,266,496.00	5.99
241	300232	洲明科技	5,261,165.00	5.99
242	600058	五矿发展	5,258,220.84	5.98
243	603511	爱慕股份	5,250,595.09	5.98
244	002832	比音勒芬	5,250,214.00	5.97
245	601918	新集能源	5,248,948.00	5.97

246	688128	中国电研	5,241,551.84	5.96
247	600458	时代新材	5,238,066.00	5.96
248	601609	金田股份	5,223,162.00	5.94
249	000953	河化股份	5,206,733.00	5.93
250	688586	中航装备	5,169,689.31	5.88
251	601686	友发集团	5,167,528.00	5.88
252	002271	东方雨虹	5,165,549.00	5.88
253	603283	赛腾股份	5,161,249.00	5.87
254	601886	江河集团	5,159,057.00	5.87
255	300183	东软载波	5,131,330.00	5.84
256	002412	汉森制药	5,105,236.00	5.81
257	600908	无锡银行	5,103,508.00	5.81
258	600729	重庆百货	5,094,352.00	5.80
259	688105	诺唯赞	5,076,249.65	5.78
260	600517	国网英大	5,068,069.00	5.77
261	600812	华北制药	5,055,620.00	5.75
262	000791	甘肃能源	4,991,928.00	5.68
263	603877	太平鸟	4,990,437.00	5.68
264	688560	明冠新材	4,988,656.68	5.68
265	002517	恺英网络	4,956,937.00	5.64
266	002991	甘源食品	4,935,531.00	5.62
267	601068	中铝国际	4,934,416.00	5.62
268	600362	江西铜业	4,931,725.00	5.61
269	002171	楚江新材	4,921,180.00	5.60
270	603113	金能科技	4,901,651.00	5.58
271	600999	招商证券	4,901,377.40	5.58
272	600050	中国联通	4,893,010.00	5.57
273	688013	天臣医疗	4,887,011.14	5.56
274	603298	杭叉集团	4,854,235.00	5.52
275	002714	牧原股份	4,851,971.00	5.52
276	603225	新凤鸣	4,851,605.00	5.52
277	688519	南亚新材	4,850,041.78	5.52
278	600955	维远股份	4,849,608.00	5.52
279	300639	凯普生物	4,830,353.00	5.50
280	603489	八方股份	4,828,266.00	5.49
281	688520	神州细胞	4,828,033.99	5.49
282	600830	香溢融通	4,823,687.00	5.49
283	002267	陕天然气	4,819,774.00	5.48
284	300323	华灿光电	4,816,980.00	5.48
285	002109	兴化股份	4,808,415.00	5.47
286	002381	双箭股份	4,798,935.00	5.46
287	688169	石头科技	4,791,729.14	5.45
288	688336	三生国健	4,790,951.10	5.45
289	300497	富祥药业	4,782,202.00	5.44

290	688448	磁谷科技	4,781,592.67	5.44
291	600635	大众公用	4,781,232.00	5.44
292	688032	禾迈股份	4,763,484.53	5.42
293	002191	劲嘉股份	4,759,765.00	5.42
294	605369	拱东医疗	4,731,452.00	5.38
295	002203	海亮股份	4,730,205.00	5.38
296	300470	中密控股	4,728,640.40	5.38
297	002367	康力电梯	4,725,254.00	5.38
298	002285	世联行	4,721,027.00	5.37
299	600037	歌华有线	4,720,283.00	5.37
300	000709	河钢股份	4,718,273.00	5.37
301	600643	爱建集团	4,712,865.00	5.36
302	002065	东华软件	4,712,010.00	5.36
303	300412	迦南科技	4,689,648.20	5.34
304	301359	东南电子	4,687,662.00	5.33
305	000869	张裕 A	4,687,124.00	5.33
306	000031	大悦城	4,675,606.00	5.32
307	600935	华塑股份	4,670,950.00	5.32
308	601808	中海油服	4,666,130.00	5.31
309	600377	宁沪高速	4,664,523.00	5.31
310	002979	雷赛智能	4,641,298.00	5.28
311	300308	中际旭创	4,622,568.00	5.26
312	603429	集友股份	4,584,317.00	5.22
313	600295	鄂尔多斯	4,571,730.48	5.20
314	600835	上海机电	4,565,668.00	5.20
315	300900	广联航空	4,560,482.00	5.19
316	603393	新天然气	4,558,566.00	5.19
317	002351	漫步者	4,557,881.00	5.19
318	002695	煌上煌	4,557,298.00	5.19
319	600839	四川长虹	4,537,413.00	5.16
320	688578	艾力斯	4,531,945.46	5.16
321	603983	丸美股份	4,531,371.00	5.16
322	603466	风语筑	4,513,700.00	5.14
323	300271	华宇软件	4,503,363.00	5.12
324	600184	光电股份	4,494,271.00	5.11
325	600871	石化油服	4,491,299.00	5.11
326	601811	新华文轩	4,488,625.00	5.11
327	002266	浙富控股	4,485,483.00	5.10
328	600261	阳光照明	4,480,167.00	5.10
329	000951	中国重汽	4,474,360.00	5.09
330	002815	崇达技术	4,473,978.00	5.09
331	600845	宝信软件	4,470,792.00	5.09
332	600285	羚锐制药	4,456,894.00	5.07
333	688619	罗普特	4,438,764.10	5.05

334	688209	英集芯	4,413,239.59	5.02
335	600737	中粮糖业	4,383,980.00	4.99
336	002467	二六三	4,359,470.00	4.96
337	002138	顺络电子	4,352,481.00	4.95
338	603680	今创集团	4,351,894.00	4.95
339	603898	好莱客	4,349,323.00	4.95
340	601126	四方股份	4,299,331.00	4.89
341	000685	中山公用	4,298,284.00	4.89
342	688707	振华新材	4,292,872.32	4.89
343	002571	德力股份	4,265,678.99	4.85
344	000913	钱江摩托	4,260,254.00	4.85
345	002868	绿康生化	4,254,532.00	4.84
346	600724	宁波富达	4,249,805.00	4.84
347	605388	均瑶健康	4,247,894.00	4.83
348	002646	天佑德酒	4,232,834.00	4.82
349	605365	立达信	4,232,226.00	4.82
350	300596	利安隆	4,218,192.50	4.80
351	002749	国光股份	4,185,690.00	4.76
352	600299	安迪苏	4,179,108.00	4.76
353	688505	复旦张江	4,169,636.50	4.75
354	688325	赛微微电	4,167,512.26	4.74
355	600598	北大荒	4,163,215.00	4.74
356	002110	三钢闽光	4,140,183.00	4.71
357	000032	深桑达 A	4,133,711.00	4.70
358	688435	英方软件	4,130,698.62	4.70
359	300143	盈康生命	4,130,032.00	4.70
360	002928	华夏航空	4,113,282.00	4.68
361	688188	柏楚电子	4,109,889.50	4.68
362	603301	振德医疗	4,109,700.00	4.68
363	600060	海信视像	4,069,843.00	4.63
364	603595	东尼电子	4,060,248.00	4.62
365	600739	辽宁成大	4,043,435.00	4.60
366	688109	品茗科技	4,025,146.15	4.58
367	000627	天茂集团	3,995,171.00	4.55
368	003030	祖名股份	3,967,346.00	4.51
369	688148	芳源股份	3,963,641.78	4.51
370	600897	厦门空港	3,932,362.00	4.48
371	300296	利亚德	3,919,146.00	4.46
372	688660	电气风电	3,907,445.22	4.45
373	688496	清越科技	3,900,243.24	4.44
374	600572	康恩贝	3,893,587.00	4.43
375	600126	杭钢股份	3,885,674.00	4.42
376	002645	华宏科技	3,871,939.00	4.41
377	600707	彩虹股份	3,853,231.00	4.38

378	300625	三雄极光	3,849,213.00	4.38
379	000987	越秀资本	3,848,642.00	4.38
380	600847	万里股份	3,837,208.00	4.37
381	600398	海澜之家	3,833,304.00	4.36
382	000166	申万宏源	3,822,991.00	4.35
383	600876	凯盛新能	3,818,584.00	4.35
384	601021	春秋航空	3,807,717.00	4.33
385	601700	风范股份	3,800,604.00	4.33
386	688513	苑东生物	3,783,518.65	4.31
387	000933	神火股份	3,774,759.00	4.30
388	300702	天宇股份	3,772,452.00	4.29
389	000630	铜陵有色	3,765,121.00	4.28
390	603279	景津装备	3,765,012.00	4.28
391	601818	光大银行	3,733,642.00	4.25
392	002763	汇洁股份	3,725,223.30	4.24
393	600618	氯碱化工	3,713,542.00	4.23
394	601390	中国中铁	3,699,210.00	4.21
395	600717	天津港	3,692,202.00	4.20
396	601298	青岛港	3,689,550.00	4.20
397	601101	昊华能源	3,688,965.00	4.20
398	000801	四川九洲	3,686,918.00	4.20
399	002174	游族网络	3,673,736.00	4.18
400	000069	华侨城 A	3,657,817.00	4.16
401	600750	江中药业	3,651,347.00	4.16
402	002465	海格通信	3,647,191.00	4.15
403	600968	海油发展	3,645,377.00	4.15
404	000001	平安银行	3,635,425.00	4.14
405	300009	安科生物	3,634,560.00	4.14
406	603268	松发股份	3,630,134.00	4.13
407	301177	迪阿股份	3,594,535.00	4.09
408	600100	同方股份	3,580,674.00	4.07
409	300887	谱尼测试	3,565,642.00	4.06
410	603118	共进股份	3,543,681.50	4.03
411	601077	渝农商行	3,537,594.00	4.03
412	300626	华瑞股份	3,522,758.00	4.01
413	601200	上海环境	3,478,707.00	3.96
414	600019	宝钢股份	3,473,226.00	3.95
415	600797	浙大网新	3,461,072.00	3.94
416	300059	东方财富	3,459,037.00	3.94
417	600688	上海石化	3,458,103.00	3.94
418	600497	驰宏锌锗	3,440,517.64	3.92
419	000553	安道麦 A	3,427,927.00	3.90
420	301077	星华新材	3,379,833.00	3.85
421	002051	中工国际	3,369,854.00	3.83

422	300749	顶固集创	3,358,047.00	3.82
423	301039	中集车辆	3,356,662.00	3.82
424	603093	南华期货	3,355,093.25	3.82
425	002212	天融信	3,353,650.00	3.82
426	000728	国元证券	3,352,288.00	3.81
427	300332	天壕能源	3,345,961.00	3.81
428	300150	世纪瑞尔	3,342,855.00	3.80
429	000977	浪潮信息	3,336,179.00	3.80
430	003012	东鹏控股	3,331,711.00	3.79
431	601098	中南传媒	3,327,628.00	3.79
432	688681	科汇股份	3,324,547.70	3.78
433	601665	齐鲁银行	3,317,689.00	3.78
434	002019	亿帆医药	3,313,776.00	3.77
435	600741	华域汽车	3,311,815.00	3.77
436	603277	银都股份	3,304,674.00	3.76
437	300893	松原股份	3,296,972.28	3.75
438	688568	中科星图	3,282,795.75	3.74
439	688091	上海谊众	3,279,456.47	3.73
440	603098	森特股份	3,261,097.00	3.71
441	301090	华润材料	3,242,153.00	3.69
442	002158	汉钟精机	3,240,394.00	3.69
443	600170	上海建工	3,236,131.16	3.68
444	002900	哈三联	3,230,098.00	3.68
445	002930	宏川智慧	3,229,524.00	3.68
446	688521	芯原股份	3,206,786.95	3.65
447	300124	汇川技术	3,206,590.00	3.65
448	600511	国药股份	3,199,922.00	3.64
449	601689	拓普集团	3,197,099.00	3.64
450	002635	安洁科技	3,190,455.00	3.63
451	688366	昊海生科	3,176,652.00	3.62
452	688567	孚能科技	3,173,090.30	3.61
453	002891	中宠股份	3,171,413.00	3.61
454	603630	拉芳家化	3,170,597.00	3.61
455	603950	长源东谷	3,167,696.80	3.60
456	600886	国投电力	3,156,580.00	3.59
457	000930	中粮科技	3,143,675.00	3.58
458	300667	必创科技	3,132,051.00	3.56
459	601279	英利汽车	3,129,424.00	3.56
460	688127	蓝特光学	3,123,745.20	3.55
461	300723	一品红	3,111,013.93	3.54
462	688528	秦川物联	3,107,201.72	3.54
463	688002	睿创微纳	3,093,724.51	3.52
464	002568	百润股份	3,056,010.00	3.48
465	601991	大唐发电	3,053,865.00	3.48

466	002732	燕塘乳业	3,052,052.00	3.47
467	000426	兴业银锡	3,050,699.00	3.47
468	301198	喜悦智行	3,038,956.00	3.46
469	603861	白云电器	3,030,526.00	3.45
470	300762	上海瀚讯	3,021,003.00	3.44
471	300226	上海钢联	3,013,804.80	3.43
472	600959	江苏有线	3,013,613.00	3.43
473	300451	创业慧康	3,010,430.00	3.43
474	002534	西子洁能	3,009,176.00	3.42
475	300033	同花顺	3,008,096.00	3.42
476	688655	迅捷兴	2,996,662.25	3.41
477	300527	中船应急	2,995,753.00	3.41
478	600215	派斯林	2,988,310.00	3.40
479	600966	博汇纸业	2,985,881.00	3.40
480	300109	新开源	2,980,534.00	3.39
481	600369	西南证券	2,974,338.00	3.38
482	600600	青岛啤酒	2,973,438.00	3.38
483	603628	清源股份	2,966,642.00	3.38
484	603801	志邦家居	2,963,858.00	3.37
485	603221	爱丽家居	2,963,504.00	3.37
486	002978	安宁股份	2,962,096.00	3.37
487	603556	海兴电力	2,957,178.00	3.37
488	601866	中远海发	2,952,940.00	3.36
489	688639	华恒生物	2,950,253.57	3.36
490	000928	中钢国际	2,947,008.00	3.35
491	000988	华工科技	2,941,761.00	3.35
492	002320	海峡股份	2,937,168.00	3.34
493	688356	键凯科技	2,924,987.59	3.33
494	002254	泰和新材	2,922,806.00	3.33
495	603355	莱克电气	2,910,686.00	3.31
496	002929	润建股份	2,901,755.00	3.30
497	601228	广州港	2,900,626.00	3.30
498	603071	物产环能	2,879,656.00	3.28
499	002851	麦格米特	2,868,377.00	3.26
500	688202	美迪西	2,865,308.27	3.26
501	600879	航天电子	2,863,951.00	3.26
502	301200	大族数控	2,857,810.00	3.25
503	300741	华宝股份	2,855,948.00	3.25
504	000625	长安汽车	2,850,901.00	3.24
505	000969	安泰科技	2,839,317.00	3.23
506	000967	盈峰环境	2,827,253.00	3.22
507	600623	华谊集团	2,825,260.00	3.22
508	600210	紫江企业	2,824,068.00	3.21
509	300808	久量股份	2,817,587.00	3.21

510	003031	中瓷电子	2,815,998.00	3.20
511	603808	歌力思	2,814,575.80	3.20
512	300130	新国都	2,812,813.00	3.20
513	600063	皖维高新	2,810,306.00	3.20
514	300394	天孚通信	2,806,384.00	3.19
515	603915	国茂股份	2,794,461.00	3.18
516	600808	马钢股份	2,776,648.00	3.16
517	300696	爱乐达	2,761,899.00	3.14
518	600710	苏美达	2,749,120.72	3.13
519	688699	明微电子	2,732,898.01	3.11
520	000096	广聚能源	2,730,938.00	3.11
521	300770	新媒股份	2,728,477.00	3.11
522	601330	绿色动力	2,725,129.00	3.10
523	002378	章源钨业	2,715,838.00	3.09
524	688173	希荻微	2,712,758.31	3.09
525	603508	思维列控	2,700,529.00	3.07
526	002163	海南发展	2,691,419.00	3.06
527	603833	欧派家居	2,673,379.12	3.04
528	688389	普门科技	2,672,953.57	3.04
529	002706	良信股份	2,669,769.00	3.04
530	603187	海容冷链	2,669,610.00	3.04
531	688670	金迪克	2,669,063.14	3.04
532	688106	金宏气体	2,668,968.53	3.04
533	002718	友邦吊顶	2,667,442.00	3.04
534	603321	梅轮电梯	2,666,799.00	3.03
535	600628	新世界	2,666,272.00	3.03
536	002589	瑞康医药	2,666,072.00	3.03
537	002242	九阳股份	2,665,861.00	3.03
538	600169	太原重工	2,652,949.00	3.02
539	002643	万润股份	2,643,806.00	3.01
540	300031	宝通科技	2,641,908.00	3.01
541	600403	大有能源	2,640,883.00	3.01
542	600315	上海家化	2,632,506.11	3.00
543	605378	野马电池	2,631,138.00	2.99
544	600129	太极集团	2,626,876.00	2.99
545	605288	凯迪股份	2,623,660.00	2.99
546	002274	华昌化工	2,622,763.00	2.98
547	605499	东鹏饮料	2,616,215.40	2.98
548	601969	海南矿业	2,599,971.00	2.96
549	600339	中油工程	2,591,017.00	2.95
550	688290	景业智能	2,588,416.00	2.95
551	601717	郑煤机	2,585,710.00	2.94
552	002698	博实股份	2,584,652.00	2.94
553	603043	广州酒家	2,574,387.00	2.93

554	002701	奥瑞金	2,569,389.87	2.92
555	300396	迪瑞医疗	2,568,618.00	2.92
556	002948	青岛银行	2,568,318.00	2.92
557	600782	新钢股份	2,561,246.00	2.91
558	688168	安博通	2,552,961.10	2.91
559	603132	金徽股份	2,549,149.00	2.90
560	600986	浙文互联	2,536,163.00	2.89
561	688510	航亚科技	2,521,619.89	2.87
562	000718	苏宁环球	2,520,670.83	2.87
563	300316	晶盛机电	2,517,346.00	2.86
564	002131	利欧股份	2,517,256.00	2.86
565	603288	海天味业	2,513,144.00	2.86
566	002085	万丰奥威	2,505,929.00	2.85
567	688296	和达科技	2,503,656.92	2.85
568	002106	莱宝高科	2,495,075.00	2.84
569	600480	凌云股份	2,485,754.00	2.83
570	688617	惠泰医疗	2,485,184.12	2.83
571	605376	博迁新材	2,480,212.00	2.82
572	600015	华夏银行	2,476,347.00	2.82
573	002551	尚荣医疗	2,474,382.00	2.82
574	688390	固德威	2,467,469.24	2.81
575	300329	海伦钢琴	2,456,750.00	2.80
576	601326	秦港股份	2,456,574.00	2.80
577	002741	光华科技	2,450,869.00	2.79
578	688085	三友医疗	2,449,805.16	2.79
579	301032	新柴股份	2,438,014.00	2.77
580	603855	华荣股份	2,433,348.00	2.77
581	601869	长飞光纤	2,427,357.00	2.76
582	300687	赛意信息	2,425,623.00	2.76
583	603060	国检集团	2,420,819.00	2.75
584	688777	中控技术	2,420,079.84	2.75
585	300894	火星人	2,414,402.00	2.75
586	300440	运达科技	2,412,110.00	2.74
587	002475	立讯精密	2,409,668.00	2.74
588	300286	安科瑞	2,406,068.00	2.74
589	300856	科思股份	2,405,028.00	2.74
590	688139	海尔生物	2,401,784.19	2.73
591	000818	航锦科技	2,398,890.00	2.73
592	600637	东方明珠	2,392,314.00	2.72
593	688686	奥普特	2,386,355.59	2.72
594	301015	百洋医药	2,380,164.00	2.71
595	600990	四创电子	2,369,933.00	2.70
596	002855	捷荣技术	2,368,760.00	2.70
597	603920	世运电路	2,364,102.00	2.69

598	002092	中泰化学	2,363,798.00	2.69
599	600098	广州发展	2,360,404.00	2.69
600	002230	科大讯飞	2,360,053.00	2.69
601	002444	巨星科技	2,351,047.00	2.68
602	301078	孩子王	2,350,331.00	2.67
603	600552	凯盛科技	2,348,747.00	2.67
604	688073	毕得医药	2,346,617.84	2.67
605	600997	开滦股份	2,346,128.00	2.67
606	603737	三棵树	2,344,272.00	2.67
607	600201	生物股份	2,324,187.00	2.64
608	603488	展鹏科技	2,315,434.00	2.63
609	688680	海优新材	2,311,942.72	2.63
610	600985	淮北矿业	2,310,500.00	2.63
611	002664	信质集团	2,309,423.00	2.63
612	603100	川仪股份	2,303,513.00	2.62
613	002500	山西证券	2,302,222.00	2.62
614	600064	南京高科	2,298,954.00	2.62
615	300203	聚光科技	2,298,873.00	2.62
616	002223	鱼跃医疗	2,289,784.00	2.61
617	603730	岱美股份	2,287,347.50	2.60
618	601163	三角轮胎	2,284,263.58	2.60
619	002958	青农商行	2,277,832.00	2.59
620	300162	雷曼光电	2,274,509.00	2.59
621	688052	纳芯微	2,274,186.44	2.59
622	002063	远光软件	2,271,405.20	2.58
623	000582	北部湾港	2,264,498.00	2.58
624	603387	基蛋生物	2,262,380.48	2.57
625	688733	壹石通	2,259,186.80	2.57
626	000027	深圳能源	2,257,860.00	2.57
627	300849	锦盛新材	2,256,874.00	2.57
628	688350	富淼科技	2,246,710.05	2.56
629	002459	晶澳科技	2,246,418.40	2.56
630	002498	汉缆股份	2,242,597.00	2.55
631	603226	菲林格尔	2,230,690.18	2.54
632	600331	宏达股份	2,226,245.00	2.53
633	002544	普天科技	2,224,476.00	2.53
634	300146	汤臣倍健	2,221,365.00	2.53
635	601633	长城汽车	2,221,342.00	2.53
636	000825	太钢不锈	2,218,418.00	2.52
637	301171	易点天下	2,217,174.00	2.52
638	603368	柳药集团	2,213,341.00	2.52
639	600864	哈投股份	2,206,369.00	2.51
640	603019	中科曙光	2,201,859.00	2.51
641	002291	遥望科技	2,198,260.00	2.50

642	688210	统联精密	2,195,393.63	2.50
643	603615	茶花股份	2,193,694.00	2.50
644	300133	华策影视	2,189,792.00	2.49
645	300791	仙乐健康	2,183,734.00	2.49
646	603032	德新科技	2,179,317.00	2.48
647	000650	仁和药业	2,167,144.00	2.47
648	300671	富满微	2,161,555.00	2.46
649	600216	浙江医药	2,151,609.00	2.45
650	002946	新乳业	2,147,871.00	2.44
651	000503	国新健康	2,143,212.00	2.44
652	688167	炬光科技	2,142,431.95	2.44
653	688696	极米科技	2,139,692.92	2.43
654	002895	川恒股份	2,137,563.00	2.43
655	000065	北方国际	2,135,039.00	2.43
656	600055	万东医疗	2,127,769.00	2.42
657	605289	罗曼股份	2,120,693.00	2.41
658	300065	海兰信	2,116,867.00	2.41
659	600751	海航科技	2,113,062.00	2.40
660	688203	海正生材	2,109,022.14	2.40
661	002841	视源股份	2,106,938.00	2.40
662	605222	起帆电缆	2,106,508.00	2.40
663	603171	税友股份	2,105,840.00	2.40
664	601919	中远海控	2,104,777.00	2.40
665	002649	博彦科技	2,104,658.00	2.40
666	688337	普源精电	2,101,162.77	2.39
667	688004	博汇科技	2,098,202.77	2.39
668	300920	润阳科技	2,085,913.00	2.37
669	600248	陕建股份	2,082,643.00	2.37
670	688131	皓元医药	2,078,470.00	2.37
671	603567	珍宝岛	2,076,167.00	2.36
672	600523	贵航股份	2,073,698.00	2.36
673	000567	海德股份	2,073,332.00	2.36
674	300185	通裕重工	2,072,862.00	2.36
675	002956	西麦食品	2,068,522.00	2.35
676	603758	秦安股份	2,065,223.00	2.35
677	002726	龙大美食	2,062,681.00	2.35
678	300850	新强联	2,051,640.00	2.33
679	300822	贝仕达克	2,051,614.00	2.33
680	603916	苏博特	2,050,753.00	2.33
681	603995	甬金股份	2,047,403.00	2.33
682	002068	黑猫股份	2,041,196.00	2.32
683	688626	翔宇医疗	2,039,663.72	2.32
684	600755	厦门国贸	2,038,631.00	2.32
685	300188	国投智能	2,038,546.00	2.32

686	301060	兰卫医学	2,037,666.00	2.32
687	603236	移远通信	2,034,083.00	2.31
688	002960	青鸟消防	2,033,919.50	2.31
689	603055	台华新材	2,025,011.00	2.30
690	301312	智立方	2,022,215.00	2.30
691	600873	梅花生物	2,019,198.00	2.30
692	688330	宏力达	2,017,796.23	2.30
693	603208	江山欧派	2,016,925.00	2.30
694	688163	赛伦生物	2,005,314.26	2.28
695	600604	市北高新	1,996,378.00	2.27
696	600718	东软集团	1,986,446.00	2.26
697	002176	江特电机	1,974,432.00	2.25
698	000915	华特达因	1,967,317.00	2.24
699	600508	上海能源	1,956,266.00	2.23
700	603127	昭衍新药	1,955,548.00	2.23
701	000917	电广传媒	1,955,046.00	2.22
702	002111	威海广泰	1,939,446.00	2.21
703	688378	奥来德	1,937,809.43	2.21
704	603267	鸿远电子	1,934,444.00	2.20
705	688370	丛麟科技	1,923,569.28	2.19
706	603613	国联股份	1,922,624.00	2.19
707	600606	绿地控股	1,914,967.00	2.18
708	600267	海正药业	1,911,156.00	2.17
709	300294	博雅生物	1,902,201.00	2.16
710	600273	嘉化能源	1,901,900.00	2.16
711	002435	长江健康	1,888,766.00	2.15
712	601212	白银有色	1,866,626.00	2.12
713	600578	京能电力	1,866,011.00	2.12
714	603228	景旺电子	1,865,908.00	2.12
715	300653	正海生物	1,862,415.00	2.12
716	300069	金利华电	1,852,284.00	2.11
717	300677	英科医疗	1,842,122.00	2.10
718	300973	立高食品	1,839,085.00	2.09
719	600820	隧道股份	1,838,873.00	2.09
720	600580	卧龙电驱	1,837,119.00	2.09
721	601588	北辰实业	1,836,970.00	2.09
722	605268	王力安防	1,834,314.00	2.09
723	603056	德邦股份	1,819,400.00	2.07
724	603928	兴业股份	1,814,466.00	2.06
725	603320	迪贝电气	1,809,559.00	2.06
726	600528	中铁工业	1,806,823.00	2.06
727	603709	中源家居	1,779,841.80	2.03
728	688228	开普云	1,773,577.31	2.02
729	688391	钜泉科技	1,767,214.85	2.01

730	300624	万兴科技	1,760,187.00	2.00
731	300607	拓斯达	1,758,693.00	2.00

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	300760	迈瑞医疗	16,946,004.00	19.28
2	000333	美的集团	14,427,405.00	16.42
3	601888	中国中免	13,539,883.84	15.41
4	300767	震安科技	13,042,474.78	14.84
5	600276	恒瑞医药	12,258,371.00	13.95
6	600028	中国石化	11,514,447.30	13.10
7	300502	新易盛	11,068,586.20	12.60
8	600837	海通证券	10,547,581.00	12.00
9	601816	京沪高铁	10,528,931.00	11.98
10	688981	中芯国际	10,504,382.86	11.95
11	000811	冰轮环境	10,449,204.62	11.89
12	000030	富奥股份	10,404,026.00	11.84
13	002811	郑中设计	10,200,379.00	11.61
14	002563	森马服饰	10,108,229.00	11.50
15	601138	工业富联	9,934,474.00	11.31
16	601336	新华保险	9,928,236.00	11.30
17	002594	比亚迪	9,808,588.00	11.16
18	601012	隆基绿能	9,808,516.00	11.16
19	002920	德赛西威	9,718,431.00	11.06
20	688256	寒武纪	9,630,995.71	10.96
21	000761	本钢板材	9,529,126.00	10.84
22	000513	丽珠集团	9,475,639.00	10.78
23	601766	中国中车	9,149,452.00	10.41
24	000858	五粮液	9,037,547.00	10.28
25	601577	长沙银行	8,972,741.00	10.21
26	002415	海康威视	8,947,169.00	10.18
27	002605	姚记科技	8,941,419.00	10.18
28	601328	交通银行	8,914,966.00	10.15
29	002236	大华股份	8,892,326.00	10.12
30	002990	盛视科技	8,846,338.00	10.07
31	688678	福立旺	8,574,706.06	9.76
32	601006	大秦铁路	8,530,726.00	9.71
33	601939	建设银行	8,467,953.00	9.64
34	600841	动力新科	8,367,085.00	9.52

35	603839	安正时尚	8,305,708.00	9.45
36	300896	爱美客	8,283,093.00	9.43
37	301028	东亚机械	8,177,907.00	9.31
38	601899	紫金矿业	8,163,452.00	9.29
39	002001	新和成	8,151,070.00	9.28
40	300418	昆仑万维	8,144,107.83	9.27
41	002683	广东宏大	8,085,208.00	9.20
42	688819	天能股份	7,974,523.28	9.08
43	600370	三房巷	7,941,425.00	9.04
44	603053	成都燃气	7,927,700.00	9.02
45	300347	泰格医药	7,925,463.48	9.02
46	600901	江苏金租	7,919,683.00	9.01
47	600025	华能水电	7,827,107.00	8.91
48	002595	豪迈科技	7,804,731.00	8.88
49	688012	中微公司	7,782,256.00	8.86
50	603444	吉比特	7,618,140.00	8.67
51	000028	国药一致	7,549,208.10	8.59
52	601169	北京银行	7,529,023.00	8.57
53	600016	民生银行	7,520,891.00	8.56
54	601567	三星医疗	7,470,416.00	8.50
55	601139	深圳燃气	7,463,039.85	8.49
56	300981	中红医疗	7,451,065.45	8.48
57	600582	天地科技	7,406,158.00	8.43
58	300587	天铁股份	7,362,946.29	8.38
59	600900	长江电力	7,266,394.00	8.27
60	000157	中联重科	7,265,413.00	8.27
61	601728	中国电信	7,246,140.00	8.25
62	688616	西力科技	7,229,775.17	8.23
63	601158	重庆水务	7,205,749.00	8.20
64	000338	潍柴动力	7,167,612.00	8.16
65	600761	安徽合力	7,137,448.00	8.12
66	300750	宁德时代	7,116,137.36	8.10
67	002152	广电运通	7,043,611.00	8.02
68	688315	诺禾致源	7,040,007.77	8.01
69	600674	川投能源	7,026,200.00	8.00
70	601019	山东出版	7,002,348.00	7.97
71	000800	一汽解放	6,965,700.00	7.93
72	002558	巨人网络	6,903,560.00	7.86
73	603551	奥普家居	6,875,044.00	7.82
74	002233	塔牌集团	6,838,758.00	7.78
75	603766	隆鑫通用	6,705,863.00	7.63
76	603515	欧普照明	6,696,746.00	7.62
77	000725	京东方A	6,688,767.00	7.61
78	601963	重庆银行	6,602,616.00	7.51

79	600771	广誉远	6,558,614.00	7.46
80	000559	万向钱潮	6,509,954.00	7.41
81	688661	和林微纳	6,509,923.68	7.41
82	600120	浙江东方	6,499,620.00	7.40
83	000686	东北证券	6,476,351.00	7.37
84	605365	立达信	6,471,126.00	7.36
85	688100	威胜信息	6,446,026.48	7.34
86	603303	得邦照明	6,437,971.00	7.33
87	002028	思源电气	6,419,214.00	7.31
88	601225	陕西煤业	6,362,425.00	7.24
89	601319	中国人保	6,334,227.00	7.21
90	600406	国电南瑞	6,297,302.76	7.17
91	002651	利君股份	6,279,657.00	7.15
92	002410	广联达	6,273,113.00	7.14
93	600583	海油工程	6,211,471.00	7.07
94	600696	岩石股份	6,209,811.00	7.07
95	601857	中国石油	6,207,434.00	7.06
96	601607	上海医药	6,179,717.00	7.03
97	600308	华泰股份	6,128,572.00	6.97
98	600085	同仁堂	6,077,785.00	6.92
99	600036	招商银行	6,071,196.00	6.91
100	000980	众泰汽车	6,062,693.00	6.90
101	000923	河钢资源	5,999,416.00	6.83
102	605179	一鸣食品	5,982,365.00	6.81
103	688111	金山办公	5,967,917.46	6.79
104	600662	外服控股	5,955,668.00	6.78
105	601601	中国太保	5,922,883.00	6.74
106	600066	宇通客车	5,859,942.00	6.67
107	603013	亚普股份	5,837,413.00	6.64
108	688448	磁谷科技	5,810,123.52	6.61
109	600489	中金黄金	5,803,417.00	6.60
110	600519	贵州茅台	5,798,458.00	6.60
111	688336	三生国健	5,796,650.44	6.60
112	600548	深高速	5,778,414.00	6.58
113	688072	拓荆科技	5,767,729.97	6.56
114	002745	木林森	5,729,089.58	6.52
115	601398	工商银行	5,712,346.00	6.50
116	301019	宁波色母	5,680,686.00	6.46
117	600729	重庆百货	5,659,305.00	6.44
118	000020	深华发 A	5,649,782.00	6.43
119	300866	安克创新	5,643,319.00	6.42
120	002007	华兰生物	5,639,526.00	6.42
121	601668	中国建筑	5,609,288.00	6.38
122	000783	长江证券	5,584,326.00	6.35

123	002461	珠江啤酒	5,576,045.00	6.35
124	688046	药康生物	5,565,278.66	6.33
125	301071	力量钻石	5,559,433.30	6.33
126	000959	首钢股份	5,553,795.23	6.32
127	601333	广深铁路	5,516,474.00	6.28
128	600998	九州通	5,486,850.92	6.24
129	600058	五矿发展	5,468,204.72	6.22
130	601658	邮储银行	5,421,577.00	6.17
131	688520	神州细胞	5,359,188.57	6.10
132	301280	珠城科技	5,358,797.50	6.10
133	600167	联美控股	5,341,486.00	6.08
134	000557	西部创业	5,340,517.00	6.08
135	000568	泸州老窖	5,338,044.00	6.07
136	000623	吉林敖东	5,329,497.00	6.06
137	600312	平高电气	5,327,988.00	6.06
138	300003	乐普医疗	5,305,812.00	6.04
139	002017	东信和平	5,296,207.00	6.03
140	002611	东方精工	5,290,011.00	6.02
141	603489	八方股份	5,269,996.40	6.00
142	688718	唯赛勃	5,268,697.16	6.00
143	000415	渤海租赁	5,261,690.00	5.99
144	002641	公元股份	5,253,835.00	5.98
145	601318	中国平安	5,214,931.00	5.93
146	600839	四川长虹	5,213,347.10	5.93
147	002215	诺普信	5,174,383.00	5.89
148	000517	荣安地产	5,168,401.46	5.88
149	605009	豪悦护理	5,165,393.00	5.88
150	600104	上汽集团	5,163,596.00	5.88
151	300206	理邦仪器	5,137,170.00	5.85
152	688435	英方软件	5,119,077.57	5.83
153	002318	久立特材	5,108,103.00	5.81
154	000997	新大陆	5,053,584.00	5.75
155	601686	友发集团	5,033,533.00	5.73
156	300308	中际旭创	5,027,207.00	5.72
157	301180	万祥科技	5,014,316.43	5.71
158	002979	雷赛智能	4,972,828.00	5.66
159	601288	农业银行	4,967,614.00	5.65
160	601989	中国重工	4,951,182.00	5.63
161	600517	国网英大	4,941,350.00	5.62
162	000598	兴蓉环境	4,934,113.00	5.62
163	000060	中金岭南	4,933,544.50	5.61
164	603393	新天然气	4,908,251.40	5.59
165	002285	世联行	4,905,752.00	5.58
166	003006	百亚股份	4,882,302.24	5.56

167	605158	华达新材	4,871,189.00	5.54
168	603429	集友股份	4,869,381.60	5.54
169	603877	太平鸟	4,813,234.00	5.48
170	000100	TCL 科技	4,801,576.00	5.46
171	002287	奇正藏药	4,798,855.00	5.46
172	300232	洲明科技	4,796,915.00	5.46
173	600295	鄂尔多斯	4,795,195.56	5.46
174	603118	共进股份	4,763,801.00	5.42
175	003816	中国广核	4,748,225.00	5.40
176	002555	三七互娱	4,729,979.00	5.38
177	600999	招商证券	4,727,557.00	5.38
178	002412	汉森制药	4,686,370.00	5.33
179	688032	禾迈股份	4,661,912.01	5.31
180	600835	上海机电	4,652,322.00	5.29
181	603983	丸美股份	4,638,713.00	5.28
182	002027	分众传媒	4,629,845.00	5.27
183	688519	南亚新材	4,617,358.65	5.25
184	600039	四川路桥	4,608,086.20	5.24
185	600955	维远股份	4,591,076.00	5.22
186	601088	中国神华	4,584,581.00	5.22
187	600830	香溢融通	4,581,409.00	5.21
188	600935	华塑股份	4,579,436.00	5.21
189	600362	江西铜业	4,577,873.31	5.21
190	688560	明冠新材	4,577,845.21	5.21
191	688013	天臣医疗	4,563,131.61	5.19
192	003041	真爱美家	4,556,941.40	5.19
193	000612	焦作万方	4,554,421.00	5.18
194	002367	康力电梯	4,549,164.00	5.18
195	002351	漫步者	4,539,708.00	5.17
196	600363	联创光电	4,528,260.00	5.15
197	301359	东南电子	4,527,801.00	5.15
198	000709	河钢股份	4,525,590.00	5.15
199	605388	均瑶健康	4,517,857.00	5.14
200	600845	宝信软件	4,506,304.80	5.13
201	600635	大众公用	4,503,446.00	5.12
202	002868	绿康生化	4,494,269.39	5.11
203	301046	能辉科技	4,428,619.00	5.04
204	000528	柳工	4,426,563.00	5.04
205	000063	中兴通讯	4,421,398.00	5.03
206	600184	光电股份	4,418,902.00	5.03
207	002571	德力股份	4,415,889.00	5.03
208	002695	煌上煌	4,397,713.00	5.00
209	002203	海亮股份	4,380,646.00	4.99
210	601886	江河集团	4,375,725.00	4.98

211	002950	奥美医疗	4,365,290.00	4.97
212	002266	浙富控股	4,318,560.00	4.91
213	688496	清越科技	4,306,972.70	4.90
214	000062	深圳华强	4,298,752.00	4.89
215	600871	石化油服	4,298,425.00	4.89
216	002815	崇达技术	4,279,470.00	4.87
217	002249	大洋电机	4,263,546.00	4.85
218	600724	宁波富达	4,257,524.00	4.85
219	002855	捷荣技术	4,256,950.00	4.84
220	002749	国光股份	4,248,476.00	4.83
221	002928	华夏航空	4,220,104.00	4.80
222	600380	健康元	4,208,184.00	4.79
223	002516	旷达科技	4,207,678.00	4.79
224	300470	中密控股	4,205,440.00	4.79
225	000913	钱江摩托	4,193,281.00	4.77
226	300900	广联航空	4,179,567.00	4.76
227	002206	海利得	4,177,099.00	4.75
228	688188	柏楚电子	4,164,018.68	4.74
229	002110	三钢闽光	4,163,293.00	4.74
230	601688	华泰证券	4,155,411.00	4.73
231	688505	复旦张江	4,148,563.96	4.72
232	603595	东尼电子	4,136,227.00	4.71
233	000685	中山公用	4,132,203.00	4.70
234	688619	罗普特	4,126,893.81	4.70
235	301087	可孚医疗	4,119,719.75	4.69
236	603466	风语筑	4,102,186.00	4.67
237	300143	盈康生命	4,085,959.00	4.65
238	002677	浙江美大	4,061,615.00	4.62
239	600919	江苏银行	4,030,168.00	4.59
240	002247	聚力文化	4,023,130.00	4.58
241	002636	金安国纪	4,012,857.00	4.57
242	601021	春秋航空	3,989,681.00	4.54
243	000977	浪潮信息	3,983,213.00	4.53
244	002724	海洋王	3,980,449.00	4.53
245	000801	四川九洲	3,954,420.00	4.50
246	002465	海格通信	3,893,564.00	4.43
247	600060	海信视像	3,889,601.18	4.43
248	600746	江苏索普	3,882,496.00	4.42
249	000032	深桑达 A	3,877,345.00	4.41
250	688148	芳源股份	3,874,348.04	4.41
251	600598	北大荒	3,868,178.00	4.40
252	688513	苑东生物	3,846,706.56	4.38
253	002174	游族网络	3,844,200.00	4.37
254	002517	恺英网络	3,835,985.00	4.37

255	600971	恒源煤电	3,830,907.00	4.36
256	601186	中国铁建	3,830,080.00	4.36
257	600285	羚锐制药	3,825,807.00	4.35
258	003030	祖名股份	3,815,810.00	4.34
259	002645	华宏科技	3,807,535.00	4.33
260	600126	杭钢股份	3,796,953.00	4.32
261	603898	好莱客	3,777,024.00	4.30
262	600100	同方股份	3,770,516.16	4.29
263	600643	爱建集团	3,764,578.00	4.28
264	600897	厦门空港	3,759,730.40	4.28
265	000627	天茂集团	3,731,781.00	4.25
266	600572	康恩贝	3,709,084.00	4.22
267	688655	迅捷兴	3,705,185.92	4.22
268	000933	神火股份	3,699,051.00	4.21
269	000089	深圳机场	3,692,072.00	4.20
270	002267	陕天然气	3,667,954.00	4.17
271	000932	华菱钢铁	3,661,117.00	4.17
272	300001	特锐德	3,656,196.00	4.16
273	002019	亿帆医药	3,632,786.00	4.13
274	600908	无锡银行	3,631,041.00	4.13
275	600739	辽宁成大	3,624,715.00	4.12
276	600941	中国移动	3,604,761.00	4.10
277	603268	松发股份	3,600,327.80	4.10
278	605369	拱东医疗	3,598,800.00	4.10
279	300626	华瑞股份	3,594,687.00	4.09
280	600420	国药现代	3,592,375.00	4.09
281	688161	威高骨科	3,586,922.56	4.08
282	600458	时代新材	3,567,117.00	4.06
283	600847	万里股份	3,564,112.00	4.06
284	688366	昊海生科	3,550,163.21	4.04
285	688390	固德威	3,540,983.85	4.03
286	003012	东鹏控股	3,536,606.00	4.02
287	600261	阳光照明	3,523,112.00	4.01
288	601077	渝农商行	3,510,958.00	4.00
289	600377	宁沪高速	3,503,492.00	3.99
290	002065	东华软件	3,498,837.00	3.98
291	688169	石头科技	3,488,287.02	3.97
292	002088	鲁阳节能	3,480,298.00	3.96
293	300749	顶固集创	3,472,207.00	3.95
294	000921	海信家电	3,463,940.55	3.94
295	002774	快意电梯	3,455,014.00	3.93
296	601279	英利汽车	3,442,364.00	3.92
297	002051	中工国际	3,442,093.00	3.92
298	603630	拉芳家化	3,433,799.00	3.91

299	600161	天坛生物	3,433,518.40	3.91
300	301177	迪阿股份	3,432,260.00	3.91
301	000031	大悦城	3,416,141.00	3.89
302	002128	电投能源	3,415,958.00	3.89
303	603221	爱丽家居	3,413,970.00	3.89
304	300667	必创科技	3,413,746.00	3.88
305	300497	富祥药业	3,397,605.00	3.87
306	002925	盈趣科技	3,386,705.00	3.85
307	002635	安洁科技	3,385,757.00	3.85
308	601618	中国中冶	3,376,558.00	3.84
309	000001	平安银行	3,370,396.00	3.84
310	000019	深粮控股	3,364,232.00	3.83
311	601200	上海环境	3,364,155.00	3.83
312	688356	键凯科技	3,364,117.91	3.83
313	300394	天孚通信	3,361,295.01	3.83
314	300033	同花顺	3,359,936.00	3.82
315	000791	甘肃能源	3,327,153.00	3.79
316	603298	杭叉集团	3,324,619.00	3.78
317	688499	利元亨	3,310,732.00	3.77
318	300412	迦南科技	3,298,752.00	3.75
319	002381	双箭股份	3,291,593.00	3.75
320	688733	壹石通	3,280,296.83	3.73
321	000035	中国天楹	3,271,543.00	3.72
322	603861	白云电器	3,270,651.00	3.72
323	600600	青岛啤酒	3,268,596.00	3.72
324	300226	上海钢联	3,245,469.00	3.69
325	600876	凯盛新能	3,234,489.00	3.68
326	688105	诺唯赞	3,231,639.12	3.68
327	000426	兴业银锡	3,221,836.00	3.67
328	688091	上海谊众	3,215,692.42	3.66
329	301090	华润材料	3,199,799.00	3.64
330	002930	宏川智慧	3,181,553.00	3.62
331	688198	佰仁医疗	3,172,442.57	3.61
332	601298	青岛港	3,170,238.00	3.61
333	601808	中海油服	3,157,518.00	3.59
334	002399	海普瑞	3,153,759.00	3.59
335	300183	东软载波	3,152,806.00	3.59
336	603530	神马电力	3,143,857.00	3.58
337	002929	润建股份	3,130,772.00	3.56
338	002732	燕塘乳业	3,130,498.00	3.56
339	002158	汉钟精机	3,119,233.00	3.55
340	301039	中集车辆	3,110,082.44	3.54
341	601665	齐鲁银行	3,101,520.00	3.53
342	300723	一品红	3,094,424.07	3.52

343	300332	天壕能源	3,093,450.00	3.52
344	600215	派斯林	3,075,740.00	3.50
345	601866	中远海发	3,059,135.00	3.48
346	600886	国投电力	3,039,207.00	3.46
347	000988	华工科技	3,033,252.00	3.45
348	688586	江航装备	3,032,186.63	3.45
349	688699	明微电子	3,027,033.52	3.44
350	600618	氯碱化工	3,013,910.00	3.43
351	601126	四方股份	3,008,219.00	3.42
352	600170	上海建工	3,004,944.50	3.42
353	688202	美迪西	3,003,248.86	3.42
354	601689	拓普集团	2,995,904.00	3.41
355	003031	中瓷电子	2,994,102.00	3.41
356	002991	甘源食品	2,993,912.00	3.41
357	002698	博实股份	2,993,040.00	3.41
358	002978	安宁股份	2,990,893.00	3.40
359	300059	东方财富	2,980,975.00	3.39
360	688528	秦川物联	2,978,155.41	3.39
361	002130	沃尔核材	2,948,374.00	3.36
362	300124	汇川技术	2,941,472.00	3.35
363	601991	大唐发电	2,939,976.00	3.35
364	603915	国茂股份	2,936,444.00	3.34
365	600562	国睿科技	2,933,549.00	3.34
366	603556	海兴电力	2,908,293.00	3.31
367	601699	潞安环能	2,906,706.00	3.31
368	688521	芯原股份	2,903,770.50	3.30
369	605499	东鹏饮料	2,884,341.52	3.28
370	603488	展鹏科技	2,866,451.00	3.26
371	600612	老凤祥	2,862,772.00	3.26
372	603950	长源东谷	2,856,555.40	3.25
373	603328	依顿电子	2,852,237.00	3.25
374	601068	中铝国际	2,851,330.00	3.24
375	002106	莱宝高科	2,850,302.00	3.24
376	301198	喜悦智行	2,849,763.00	3.24
377	300808	久量股份	2,815,535.00	3.20
378	002832	比音勒芬	2,814,158.00	3.20
379	300109	新开源	2,813,093.00	3.20
380	600210	紫江企业	2,808,375.84	3.20
381	300130	新国都	2,805,506.00	3.19
382	600710	苏美达	2,797,594.44	3.18
383	300396	迪瑞医疗	2,783,216.00	3.17
384	605376	博迁新材	2,768,030.00	3.15
385	000096	广聚能源	2,756,686.00	3.14
386	688617	惠泰医疗	2,754,050.88	3.13

387	688290	景业智能	2,732,877.62	3.11
388	600808	马钢股份	2,727,995.00	3.10
389	600879	航天电子	2,726,004.00	3.10
390	300687	赛意信息	2,723,147.00	3.10
391	605378	野马电池	2,719,919.00	3.10
392	603355	莱克电气	2,704,611.00	3.08
393	002664	信质集团	2,694,883.00	3.07
394	688670	金迪克	2,685,778.09	3.06
395	600968	海油发展	2,675,127.00	3.04
396	688173	希荻微	2,672,967.01	3.04
397	600007	中国国贸	2,662,196.00	3.03
398	688686	奥普特	2,661,861.78	3.03
399	688002	睿创微纳	2,657,104.42	3.02
400	600015	华夏银行	2,653,879.00	3.02
401	603833	欧派家居	2,642,320.30	3.01
402	688106	金宏气体	2,641,874.03	3.01
403	600966	博汇纸业	2,638,631.00	3.00
404	601700	风范股份	2,638,503.00	3.00
405	002741	光华科技	2,635,089.00	3.00
406	002589	瑞康医药	2,620,198.00	2.98
407	002274	华昌化工	2,614,406.00	2.98
408	000166	申万宏源	2,608,011.00	2.97
409	000039	中集集团	2,606,981.00	2.97
410	688073	毕得医药	2,596,856.03	2.96
411	600717	天津港	2,587,854.00	2.94
412	603628	清源股份	2,584,649.00	2.94
413	300031	宝通科技	2,576,173.00	2.93
414	600169	太原重工	2,570,475.00	2.93
415	002568	百润股份	2,567,351.53	2.92
416	603730	岱美股份	2,563,716.13	2.92
417	002003	伟星股份	2,558,913.10	2.91
418	300451	创业慧康	2,557,402.00	2.91
419	688389	普门科技	2,556,756.96	2.91
420	002191	劲嘉股份	2,548,181.00	2.90
421	600511	国药股份	2,539,611.16	2.89
422	603071	物产环能	2,536,735.00	2.89
423	605288	凯迪股份	2,505,972.00	2.85
424	002701	奥瑞金	2,500,622.50	2.85
425	301032	新柴股份	2,497,037.00	2.84
426	600660	福耀玻璃	2,495,838.00	2.84
427	002475	立讯精密	2,489,003.00	2.83
428	603801	志邦家居	2,479,850.80	2.82
429	000718	苏宁环球	2,479,483.40	2.82
430	300203	聚光科技	2,479,174.00	2.82

431	603279	景津装备	2,457,058.00	2.80
432	300770	新媒股份	2,455,387.00	2.79
433	601390	中国中铁	2,455,138.00	2.79
434	002092	中泰化学	2,454,441.00	2.79
435	300329	海伦钢琴	2,453,362.00	2.79
436	600628	新世界	2,447,326.00	2.79
437	600129	太极集团	2,437,644.00	2.77
438	300822	贝仕达克	2,436,003.00	2.77
439	603808	歌力思	2,433,559.30	2.77
440	600331	宏达股份	2,433,443.00	2.77
441	603225	新凤鸣	2,413,443.00	2.75
442	601330	绿色动力	2,404,076.00	2.74
443	688167	炬光科技	2,399,174.84	2.73
444	688228	开普云	2,391,328.94	2.72
445	688168	安博通	2,388,929.61	2.72
446	002500	山西证券	2,383,747.16	2.71
447	688378	奥来德	2,382,528.71	2.71
448	600602	云赛智联	2,382,402.00	2.71
449	301078	孩子王	2,381,388.62	2.71
450	688510	航亚科技	2,381,106.54	2.71
451	002459	晶澳科技	2,376,821.00	2.70
452	000869	张裕A	2,374,801.00	2.70
453	600782	新钢股份	2,372,578.00	2.70
454	000061	农产品	2,364,520.00	2.69
455	600864	哈投股份	2,360,370.00	2.69
456	300162	雷曼光电	2,355,968.34	2.68
457	688235	百济神州	2,350,430.18	2.67
458	603226	菲林格尔	2,343,143.59	2.67
459	002068	黑猫股份	2,339,331.00	2.66
460	300849	锦盛新材	2,336,198.00	2.66
461	002032	苏泊尔	2,320,824.00	2.64
462	600339	中油工程	2,318,682.00	2.64
463	688139	海尔生物	2,316,841.51	2.64
464	601228	广州港	2,314,900.00	2.63
465	301312	智立方	2,313,798.00	2.63
466	300316	晶盛机电	2,312,523.00	2.63
467	600315	上海家化	2,310,828.22	2.63
468	603387	基蛋生物	2,308,875.00	2.63
469	688004	博汇科技	2,305,791.37	2.62
470	600751	海航科技	2,305,062.00	2.62
471	301077	星华新材	2,299,787.00	2.62
472	300271	华宇软件	2,299,569.00	2.62
473	603511	爱慕股份	2,297,343.00	2.61
474	300768	迪普科技	2,297,255.00	2.61

475	601326	秦港股份	2,296,432.00	2.61
476	300188	国投智能	2,295,165.00	2.61
477	600797	浙大网新	2,293,569.00	2.61
478	605289	罗曼股份	2,286,472.00	2.60
479	603288	海天味业	2,279,413.00	2.59
480	600812	华北制药	2,279,312.00	2.59
481	000987	越秀资本	2,276,650.23	2.59
482	300920	润阳科技	2,276,333.00	2.59
483	601969	海南矿业	2,275,717.00	2.59
484	002291	遥望科技	2,274,328.00	2.59
485	300894	火星人	2,269,490.00	2.58
486	300065	海兰信	2,268,227.00	2.58
487	601869	长飞光纤	2,267,857.00	2.58
488	000818	航锦科技	2,263,323.00	2.58
489	601818	光大银行	2,263,166.00	2.58
490	603995	甬金股份	2,260,399.00	2.57
491	688777	中控技术	2,257,074.74	2.57
492	002109	兴化股份	2,252,526.00	2.56
493	603758	秦安股份	2,250,801.00	2.56
494	603855	华荣股份	2,248,754.00	2.56
495	600990	四创电子	2,240,486.50	2.55
496	603060	国检集团	2,238,405.00	2.55
497	600985	淮北矿业	2,230,211.00	2.54
498	688085	三友医疗	2,229,141.82	2.54
499	002948	青岛银行	2,228,778.00	2.54
500	002283	天润工业	2,226,355.00	2.53
501	002223	鱼跃医疗	2,223,288.00	2.53
502	603043	广州酒家	2,221,869.00	2.53
503	000915	华特达因	2,218,961.00	2.53
504	300850	新强联	2,216,243.00	2.52
505	601137	博威合金	2,208,667.00	2.51
506	301015	百洋医药	2,205,497.00	2.51
507	600098	广州发展	2,198,832.00	2.50
508	002958	青农商行	2,192,440.00	2.49
509	688052	纳芯微	2,191,165.41	2.49
510	000065	北方国际	2,187,194.00	2.49
511	300856	科思股份	2,185,397.00	2.49
512	002230	科大讯飞	2,183,303.00	2.48
513	688696	极米科技	2,178,446.95	2.48
514	600064	南京高科	2,175,382.00	2.48
515	603208	江山欧派	2,169,179.17	2.47
516	000027	深圳能源	2,160,162.00	2.46
517	603508	思维列控	2,156,684.60	2.45
518	688296	和达科技	2,154,655.75	2.45

519	603032	德新科技	2,154,544.60	2.45
520	603615	茶花股份	2,139,024.00	2.43
521	688210	统联精密	2,134,272.90	2.43
522	300973	立高食品	2,132,291.00	2.43
523	300791	仙乐健康	2,131,913.00	2.43
524	002544	普天科技	2,131,815.00	2.43
525	603989	艾华集团	2,121,439.00	2.41
526	601609	金田股份	2,107,718.00	2.40
527	002706	良信股份	2,096,671.00	2.39
528	603320	迪贝电气	2,096,322.00	2.39
529	603019	中科曙光	2,095,892.00	2.39
530	300527	中船应急	2,091,173.00	2.38
531	600741	华域汽车	2,087,812.00	2.38
532	301060	兰卫医学	2,085,798.00	2.37
533	300671	富满微	2,083,185.00	2.37
534	301200	大族数控	2,080,783.00	2.37
535	601919	中远海控	2,075,170.40	2.36
536	688203	海正生材	2,074,885.07	2.36
537	002895	川恒股份	2,064,904.00	2.35
538	600248	陕建股份	2,064,410.00	2.35
539	603171	税友股份	2,059,593.00	2.34
540	000825	太钢不锈	2,058,223.00	2.34
541	688131	皓元医药	2,050,224.59	2.33
542	600755	厦门国贸	2,049,079.25	2.33
543	000917	电广传媒	2,048,740.00	2.33
544	688680	海优新材	2,047,563.12	2.33
545	300185	通裕重工	2,046,719.00	2.33
546	000582	北部湾港	2,044,272.00	2.33
547	688337	普源精电	2,040,892.98	2.32
548	600398	海澜之家	2,039,565.64	2.32
549	002649	博彦科技	2,031,513.00	2.31
550	300296	利亚德	2,027,684.00	2.31
551	603127	昭衍新药	2,021,542.00	2.30
552	601211	国泰君安	2,017,321.20	2.30
553	300624	万兴科技	2,016,655.50	2.29
554	688707	振华新材	2,012,299.27	2.29
555	603236	移远通信	1,997,782.00	2.27
556	000567	海德股份	1,988,492.00	2.26
557	603613	国联股份	1,983,122.00	2.26
558	300133	华策影视	1,981,312.00	2.25
559	688330	宏力达	1,962,970.63	2.23
560	301171	易点天下	1,956,537.00	2.23
561	601212	白银有色	1,951,296.00	2.22
562	603055	台华新材	1,944,702.00	2.21

563	300607	拓斯达	1,938,040.00	2.21
564	603567	珍宝岛	1,935,734.00	2.20
565	600578	京能电力	1,934,322.00	2.20
566	603916	苏博特	1,933,717.00	2.20
567	600508	上海能源	1,925,759.00	2.19
568	688788	科思科技	1,925,308.58	2.19
569	600873	梅花生物	1,922,186.00	2.19
570	601588	北辰实业	1,913,486.00	2.18
571	600523	贵航股份	1,912,831.00	2.18
572	002726	龙大美食	1,911,664.00	2.18
573	300170	汉得信息	1,909,735.00	2.17
574	002960	青鸟消防	1,905,550.00	2.17
575	300294	博雅生物	1,904,463.00	2.17
576	002956	西麦食品	1,899,715.00	2.16
577	000951	中国重汽	1,893,337.00	2.15
578	002320	海峡股份	1,892,371.00	2.15
579	603267	鸿远电子	1,889,480.00	2.15
580	002782	可立克	1,882,388.00	2.14
581	300820	英杰电气	1,882,339.00	2.14
582	002138	顺络电子	1,881,820.00	2.14
583	002176	江特电机	1,880,979.00	2.14
584	300151	昌红科技	1,866,425.00	2.12
585	600604	市北高新	1,864,385.00	2.12
586	688391	钜泉科技	1,863,431.70	2.12
587	600820	隧道股份	1,859,931.00	2.12
588	000630	铜陵有色	1,857,370.00	2.11
589	002131	利欧股份	1,855,230.00	2.11
590	688370	丛麟科技	1,852,634.56	2.11
591	603228	景旺电子	1,850,719.00	2.11
592	600267	海正药业	1,849,285.00	2.10
593	601101	昊华能源	1,843,982.00	2.10
594	688578	艾力斯	1,843,964.76	2.10
595	300702	天宇股份	1,840,753.00	2.09
596	600050	中国联通	1,839,298.00	2.09
597	603926	铁流股份	1,830,406.90	2.08
598	600299	安迪苏	1,827,730.00	2.08
599	000608	阳光股份	1,823,263.00	2.07
600	300146	汤臣倍健	1,819,877.00	2.07
601	000969	安泰科技	1,814,932.00	2.07
602	601717	郑煤机	1,814,808.00	2.07
603	600273	嘉化能源	1,810,563.00	2.06
604	600623	华谊集团	1,800,092.00	2.05
605	600580	卧龙电驱	1,799,084.40	2.05
606	605268	王力安防	1,786,676.00	2.03

607	603499	翔港科技	1,783,279.00	2.03
608	002697	红旗连锁	1,780,800.00	2.03
609	300596	利安隆	1,772,928.00	2.02
610	300741	华宝股份	1,765,205.00	2.01
611	688551	科威尔	1,759,352.02	2.00
612	603056	德邦股份	1,758,869.00	2.00

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	4,365,105,277.54
卖出股票收入（成交）总额	3,054,760,391.57

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	533,035.05	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	533,035.05	0.03

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113069	博23转债	5,330	533,035.05	0.03
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

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

(1) 股指期货对冲策略

本基金参与股指期货投资将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的。基金经理根据市场的变化、现货市场与期货市场的相关性等因素，计算需要用到的期货合约数量，对这个数量进行动态跟踪与测算，并进行适时灵活调整。

(2) 股指期货套利策略

股指期货套利策略是指积极发现市场上如期货与现货之间、期货不同合约之间等的价差关系，进行套利，以获取绝对收益。股指期货套利包括以下两种方式：

①期现套利：期现套利过程中，由于股指期货合约价格与标的指数价格之间的价差不断变动，套利交易可以通过捕捉该价差进而获利。

②跨期套利：跨期套利过程中，不同期货合约之间的价差不断变动，套利交易通过捕捉合约间价差进而获利。

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 市场中性策略执行情况

截至本报告期末，本基金持有股票资产 1,335,831,136.43 元，占基金资产净值的比例为 78.43%；运用股指期货进行对冲的空头合约市值-1,249,295,080.00 元，占基金资产净值的比例为-73.35%，空头合约市值占股票资产的比例为-93.52%。

本报告期内，本基金执行市场中性策略的投资收益为 57,402,825.61 元，公允价值变动损益为-3,018,561.06 元。

8.13 投资组合报告附注

8.13.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国农业银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

8.13.2 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。

8.13.3 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	150,328,847.78
2	应收清算款	157,413.58
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	150,486,261.36

8.13.4 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。

8.13.5 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。

8.13.6 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	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
16,604	85,798.09	761,492,717.81	53.45%	663,098,698.65	46.55%

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	954,543.02	0.07%
----------------------	------------	-------

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、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

截至2023年6月5日，华夏安泰对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金的基金合同生效届满三年。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2020年6月5日）基金份额总额	1,154,005,597.33
本报告期期初基金份额总额	81,388,980.02
本报告期基金总申购份额	1,965,527,165.97
减：本报告期基金总赎回份额	622,324,729.53
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,424,591,416.46

§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，张佑君先生担任本基金管理人董事长，杨明辉先生离任本基金管理人董事长。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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。

本报告期无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

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

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 70,000 元人民币。截至本报告期末，该事务所已向本基金提供 4 年的审计服务。

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

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人及其高级管理人员在本报告期内无受稽查或处罚等情况。

11.6.2 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相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	25	5,868,599,684.11	79.23%	540,899.16	44.91%	-
广发证券	3	595,674,530.03	8.04%	256,918.17	21.33%	-
华泰证券	3	412,455,320.53	5.57%	177,880.29	14.77%	-
天风证券	1	349,099,793.13	4.71%	150,562.52	12.50%	-
方正证券	4	67,679,236.44	0.91%	29,189.76	2.42%	-
中信建投证券	5	49,862,059.79	0.67%	21,505.22	1.79%	-
长江证券	4	38,115,533.01	0.51%	16,439.65	1.36%	-
华安证券	1	25,780,214.10	0.35%	11,119.33	0.92%	-
国盛证券	2	49,900.00	0.00%	21.52	0.00%	-

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

i 经营行为规范。

ii 公司财务状况良好。

iii 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。

iv 有较强的全方位金融服务能力和水平：能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

v 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

②券商专用交易单元选择程序：

i 本基金管理人根据上述标准进行评估并确定选用的券商。

ii 本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议/证券经纪服务协议。

③除本表列示外，本基金还选择了北京高华证券、财通证券、东北证券、东方财富证券、东方证券、东海证券、东吴证券、东兴证券、高华证券、国金证券、国泰君安证券、国信证券、海通证券、华西证券、金通证券、南京证券、平安证券、瑞银证券、申万宏源、申万宏源证券、太平洋证券、万和证券、五矿证券、西部证券、西南证券、信达证券、兴业证券、野村东方国际、野村东方国际证券、银河证券、招商证券、浙商证券、中国银河证券、中金公司、中信证券(浙江)、中银国际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。

④在上述租用的券商交易单元中，兴业证券、中信证券的部分交易单元、财通证券的交易单元为本基金本期新增的交易单元。本期没有剔除的券商交易单元。

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	1,255,773.58	94.78%	-	-	-	-	-	-
广发证券	392.21	0.03%	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	15,022.23	1.13%	-	-	-	-	-	-
方正证券	52,838.24	3.99%	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	897.13	0.07%	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-01-06
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	中国证监会指定报刊及网站	2023-01-19
3	华夏安泰对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回、转换业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-02-14
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	中国证监会指定报刊及网站	2023-03-23

5	华夏安泰对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回、转换业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-05-16
6	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	中国证监会指定报刊及网站	2023-07-01
7	华夏基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-07-08
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	中国证监会指定报刊及网站	2023-07-14
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	中国证监会指定报刊及网站	2023-07-19
10	华夏基金管理有限公司关于设立武汉分公司的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-07-20
11	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	中国证监会指定报刊及网站	2023-07-26
12	华夏基金管理有限公司关于设立沈阳分公司的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-07-26
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	中国证监会指定报刊及网站	2023-08-03
14	华夏安泰对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回、转换业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-08-15
15	华夏基金管理有限公司关于华夏安泰对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金开放期规模控制方案的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-08-15
16	华夏基金管理有限公司关于限制华夏安泰对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金申购及转换转入业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-08-15
17	华夏基金管理有限公司关于华夏安泰对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金调整申购及转换转入业务限额的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-08-19
18	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-09-22
19	华夏基金管理有限公司关于杭州分公司营业场所变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-09-27
20	华夏基金管理有限公司关于设立华夏股权投资基金管理(北京)有限公司的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-10-12
21	华夏安泰对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回、转换业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-11-10
22	华夏基金管理有限公司关于华夏安泰对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金开放期规模控制方案的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-11-10

23	华夏基金管理有限公司关于限制华夏安泰对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金申购及转换转入业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-11-10
----	---	--------------	------------

§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	2023-01-01至2023-02-19	18,790,754.49	-	18,790,754.49	-	-
产品特有风险							
<p>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。</p> <p>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。</p>							

§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、《华夏安泰对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《华夏安泰对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议》；
- 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

二〇二四年三月二十八日