

# 信澳新能源产业股票型证券投资基金

## 2023 年年度报告

### 2023 年 12 月 31 日

基金管理人：信达澳亚基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年三月二十九日

## §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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 3 月 28 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）为本基金出具了标准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

<b>§1 重要提示及目录</b>	<b>1</b>
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
<b>§2 基金简介</b>	<b>4</b>
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	8
<b>§4 管理人报告</b>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
<b>§5 托管人报告</b>	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
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	14
<b>§6 审计报告</b>	<b>15</b>
<b>§7 年度财务报表</b>	<b>18</b>
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	19
7.3 净资产变动表	20
7.4 报表附注	22
<b>§8 投资组合报告</b>	<b>56</b>
8.1 期末基金资产组合情况	56
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	57
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	58
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	73
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	74
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	75

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	75
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	76
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	76
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	76
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	76
8.12 投资组合报告附注	76
<b>§9 基金份额持有人信息</b>	<b>77</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	77
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	78
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	78
<b>§10 开放式基金份额变动</b>	<b>78</b>
<b>§11 重大事件揭示</b>	<b>79</b>
11.1 基金份额持有人大会决议	79
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	79
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	79
11.4 基金投资策略的改变	79
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	79
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	79
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	80
11.8 其他重大事件	86
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息</b>	<b>89</b>
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	89
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	89
<b>§13 备查文件目录</b>	<b>89</b>
13.1 备查文件目录	89
13.2 存放地点	90
13.3 查阅方式	90

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	信澳新能源产业股票型证券投资基金
基金简称	信澳新能源产业股票
基金主代码	001410
交易代码	001410
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 7 月 31 日
基金管理人	信达澳亚基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,419,574,654.35 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过积极主动的管理，在有效控制风险的前提下，精选新能源及其相关产业的优秀企业进行投资，为投资者追求长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金采取自上而下和自下而上相结合的积极主动的投资策略，并对投资组合进行动态调整。由于本基金为股票型基金，核心投资策略为股票精选策略，同时辅以资产配置策略优化投资组合的风险收益，提升投资组合回报。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率 ×85%+上证国债指数收益率 ×15%
风险收益特征	本基金为股票型基金，长期预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金、货币市场基金，属于较高风险、较高预期收益率的基金产品。

### 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		信达澳亚基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	黄晖	王小飞
	联系电话	0755-83172666	021-60637103
	电子邮箱	service@fscinda.com	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		400-8888-118	021-60637228
传真		0755-83196151	021-60635778
注册地址		广东省深圳市南山区粤海街道海珠社区科苑南路 2666 号中国华润大厦 L1001	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		广东省深圳市南山区粤海街道科苑南路 2666 号中国华润大厦 10 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		518054	100033
法定代表人		朱永强	田国立

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.fscinda.com
基金年度报告备置地点	广东省深圳市南山区粤海街道科苑南路 2666 号中国华润大厦 10 层

### 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 01-12室
注册登记机构	信达澳亚基金管理有限公司	广东省深圳市南山区粤海街道科苑南路2666号中国华润大厦10层

### §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2023 年	2022 年	2021 年
本期已实现收益	-1,824,255,680.65	-1,962,158,799.87	4,462,970,873.14
本期利润	-1,235,727,010.56	-5,123,400,891.43	4,437,577,721.03
加权平均基金份额本期利润	-0.4747	-1.6582	1.5765
本期加权平均净值利润率	-13.00%	-37.78%	34.63%
本期基金份额净值增长率	-12.71%	-29.29%	45.37%
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	3,538,637,192.68	6,164,026,256.49	9,084,636,073.62
期末可供分配基金份额利润	1.4625	2.1576	2.7881
期末基金资产净值	8,011,123,604.75	10,836,485,070.31	17,477,493,124.56
期末基金份额净值	3.311	3.793	5.364
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	247.28%	297.84%	462.61%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、上述业绩指标不包括持有人交易投资组合的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### 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	-1.25%	1.22%	-5.85%	0.67%	4.60%	0.55%
过去六个月	-11.26%	1.17%	-8.90%	0.72%	-2.36%	0.45%
过去一年	-12.71%	1.18%	-9.15%	0.72%	-3.56%	0.46%
过去三年	-10.27%	1.64%	-28.27%	0.95%	18.00%	0.69%
过去五年	178.47%	1.80%	16.37%	1.03%	162.10%	0.77%
自基金合同生效起至今	247.28%	1.70%	-2.09%	1.09%	249.37%	0.61%

#### 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

信澳新能源产业股票型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

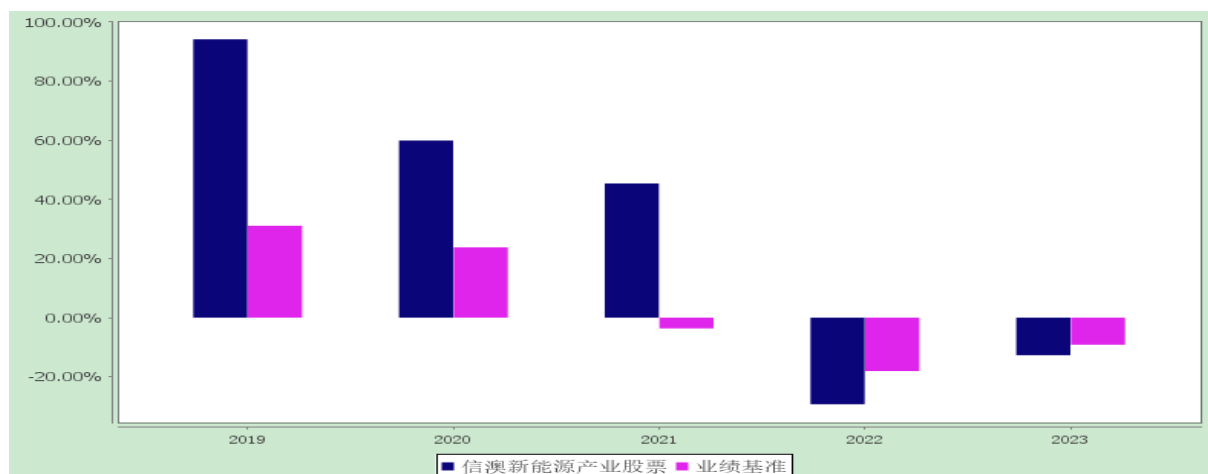
(2015年7月31日至2023年12月31日)





### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

过去三年基金无利润分配情况。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人信达澳亚基金管理有限公司（原“信达澳银基金管理有限公司”，以下简称“公司”）成立于 2006 年 6 月 5 日，注册资本 1 亿元人民币，公司总部设在中国深圳，在北京和上海设有分公司，是由中国信达资产管理股份有限公司和澳大利亚联邦银行全资子公司设立的合资公司，是经中国证监会批准（批准文号：中国证监会证监基金字[2006]71 号文）设立的国内首家由国有资产管理公司控股的基金管理公司。2015 年 5 月 22 日，信达证券股份有限公司受让中国信达资产管理股份有限公司持有的股权，与 East Topco Limited 共同持有公司股份，持股比例分别为 54% 和 46%。2022 年 3 月 21 日，由于公司外方股东的实控人变更，以及公司国际化发展战略需要，公司正式更名为信达澳亚基金管理有限公司。截至 2023 年 12 月 31 日，公司共管理 66 只公募基金产品。

公司建立了健全的法人治理结构，根据《中华人民共和国公司法》的规定设立了股东会、董事会和执行监事。董事会层面设立风险控制委员会和薪酬考核委员会两个专门

委员会，并建立了独立董事制度。公司实行董事会领导下的总经理负责制，由总经理负责公司的日常运作，并由各委员会包括经营管理委员会、投资审议委员会、风险管理委员会、产品审议委员会、IT 治理委员会、运营委员会、市场销售管理委员会、问责委员会等协助其议事决策。

公司建立了完善的组织架构，设立了权益投资总部、混合资产投资部、固收投资总部、智能量化与全球投资部、市场销售部、机构销售总部、银行机构总部、互联网金融部、战略客户部、市场支持部、投资管理部、产品创新部、运营管理总部、风险控制部、行政人事部、财务会计部、监察稽核部、董事会办公室等部门，各部门分工协作，职责明确。

报告期内，公司第六届董事会独立董事宋若冰先生以参加董事会会议、邮件、现场与管理层沟通、通讯表决董事会决议、审阅公司重要报告和提交工作报告等方式履行职责，报告期内累计履职时间达到法定要求；独立董事杨棉之先生以参加董事会会议、邮件、现场与管理层邮件沟通、通讯表决董事会决议、审阅公司重要报告和提交工作报告等方式履行职责，报告期内累计履职时间达到法定要求；独立董事屈文洲先生以参加董事会会议、通讯表决董事会决议和风险控制委员会决议、审阅公司重要报告和提交工作报告等方式履行职责，报告期内累计履职时间达到法定要求。

报告期内，公司及基金运作未发生重大利益冲突事件，独立董事在履职过程中未发现公司存在损害基金份额持有人利益的行为。

#### 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		
冯明远	本基金的基金经理，公司副总经理、联席投资总监	2016-10-19	-	13 年	浙江大学工学硕士。2010 年 9 月，任平安证券综合研究所研究员，2014 年 1 月加入信达澳亚基金公司，历任研究员，基金经理助理，现任副总经理、联席投资总监。曾任信澳

				<p>精华配置混合基金基金经理（2017年12月26日起至2022年7月19日）、信澳匠心臻选两年持有期混合基金的基金经理（2020年10月30日起至2023年1月13日）、信澳先进智造股票基金基金经理（2019年1月17日起至2023年2月3日）、信澳核心科技混合基金的基金经理（2019年8月14日起至2023年2月16日）、信澳科技创新一年定开混合基金的基金经理（2020年5月29日起至2023年11月17日）、信澳星奕混合基金的基金经理（2021年1月22日起至2023年11月17日）。现任信澳新能源产业股票基金基金经理（2016年10月19日起至今）、信澳研究优选混合基金的基金经理（2020年6月22日起至今）、信澳领先智选混合基金的基金经理（2021年6月30日起至今）、信澳智远三年持有期混合基金的基金经理（2022年1月25日起至今）。</p>
--	--	--	--	---

注：1、基金经理的任职日期、离任日期为根据公司决定确定的任职或离任日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会从业人员资格管理办法的相关规定等。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《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》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、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，为基金持有人谋求最大利益，没有发生损害基金持有人利益的行为。

### 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》和《信达澳亚基金管理有限公司公平交易实施办法》在投资决策、交易执行、风险监控等环节建立了严谨的内控制度，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，维护投资者的利益。

本基金管理人通过建立科学的投资决策体系，严谨的公平交易机制，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、业务流程和技术手段保证公平交易原则的贯彻，确保不同投资组合在买卖同一证券时，按照比例分配的原则在各投资组合间公平分配交易量，严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。

本基金管理人通过风险监控信息系统对不同投资组合同向交易进行公平交易分析，分别于每季度和每年度对本基金管理人管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别(股票、债券)的收益率差异等进行分析，形成公平交易制度执行情况分析报告。通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。若发现涉嫌违背公平交易原则的行为，及时向公司管理层汇报并采取相关控制和改进措施。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人已经建立了投资决策及交易内控制度，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，维护投资者的利益。本基金管理人建立了严谨的公平交易机制，确保不同基金在买卖同一证券时，按照比例分配的原则在各基金间公平分配交易量。公司对报告期内公司所管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行了分析；利用数据统计和重点审查价差原因相结合的方法，对连续四个季度内、不同时间窗口（日内、3日内、5日内）公司管理的不同投资组合同向交易价差进行了分析；对部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易进行了审核和监控，未发现公司所管理的投资组合存在违反公平交易原则的情形。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未出现超过该证券当日成交量的 5% 的情况。投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易，未导致不公平交易和利益输送。

## 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 年上半年宏观经济呈现弱复苏的局面，本基金的投资方向聚焦在新能源、科技、高端制造等新兴产业领域。下半年，在美元利率维持高位的压力下，A 股科技、制造业板块股票仍承受估值压力。从 pb 估值维度看，已经有部分股票达到历史低位。从 pe 维度看，由于各方资本前几年对新兴产业的投资热潮，导致当前企业处于激烈的竞争环境，利润的释放仍需要时间。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 3.311 元，份额累计净值为 3.373 元，本报告期内，本基金份额净值增长率为-12.71%，同期业绩比较基准收益率为-9.15%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2024 年，随着人工智能技术在各细分领域加快应用，科技类板块的估值体系将得以修复；半导体和制造业有望随着宏观经济的弱复苏而企稳见底；总体来看，整体制造业板块有望逐步见底回升。我们继续在新能源、科技、高端制造等主要赛道耕耘，深挖基本面扎实的优质个股，自下而上挖掘投资机会。中国的制造业已经具备较强的全球竞争力，在低成本的自动化、人工智能加持下，在汽车、新能源、电子硬件等领域具备挑战老牌欧美企业市场份额的机会。

## 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人在内部监察稽核工作中一切从规范运作、保障基金份额持有人利益出发，由独立于各业务部门的监察稽核部对公司日常经营、投资交易、基金运作及员工行为的合规性进行定期和不定期检查，发现问题，敦促有关部门整改，并定期

制作监察稽核报告报公司管理层和监管机构。报告期内，本基金管理人内部监察稽核工作重点完成了以下几个方面：

(1) 进一步完善公司管理及业务制度。

(2) 监督后台运营业务安全、准确运行，推进完善信息技术系统，履行反洗钱义务。

(3) 监督市场营销、基金销售的合规性，落实执行投资者适用性原则。

(4) 加强对员工包括投资管理人员的监察监督，严格执行防范投资人员合规风险的有关措施，规避不正当交易行为的发生。

(5) 对业务部门进行相关法律培训，提高员工遵规守法意识。

本报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合规合法，无不当内幕交易和关联交易，有效保障了基金份额持有人利益。我们将继续以风险控制为核心，提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金的估值工作严格按照相关法律法规、基金合同以及《信达澳亚基金管理有限公司估值委员会议事规则》进行。

为确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，本基金管理人设立了估值委员会；估值委员会负责人由分管运营的公司领导担任；估值委员会成员由权益投资总部、固收投资部门、风险控制部、监察稽核部、基金运营部指定专人并经公司经营管理委员会审议通过后担任；估值委员会主要负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，定期评价现有估值政策和程序的适用性及对估值程序执行情况进行监督。

基金经理对基金的估值原则和估值程序可以提出建议，但不参与最终决策和日常估值工作。参与估值流程各方包括基金托管人和会计师事务所，各方之间不存在任何重大利益冲突。

截止报告期末，本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供相关债券品种、流通受限股票流动性折扣、预期信用损失等估值参考数据。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规和基金合同要求，本基金管理人可以根据基金实际运作情况进行利润分配。

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 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

无。

### §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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

#### 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

本托管人复核审查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。

## §6 审计报告

安永华明（2024）审字第 70013104\_H12 号

信澳新能源产业股票型证券投资基金

信澳新能源产业股票型证券投资基金全体基金份额持有人：

### 6.1 审计意见

我们审计了信澳新能源产业股票型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，后附的信澳新能源产业股票型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，公允反映了信澳新能源产业股票型证券投资基金 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，我们独立于信澳新能源产业股票型证券投资基金，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

信澳新能源产业股票型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，管理层负责评估信澳新能源产业股票型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。

治理层负责监督信澳新能源产业股票型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，就可能导致对信澳新能源产业股票型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信澳新能源产业股票型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

高 鹤 邓 雯

北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室

2024 年 3 月 28 日

## §7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：信澳新能源产业股票型证券投资基金

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
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	418,511,083.12	600,584,306.34
结算备付金		14,490,637.00	5,922,339.34
存出保证金		1,000,668.10	1,425,296.16
交易性金融资产	7.4.7.2	7,599,069,703.80	10,271,360,262.17
其中：股票投资		7,592,115,245.47	10,240,989,915.20
基金投资		-	-
债券投资		6,954,458.33	30,370,346.97
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		3,827,842.86	8,010,041.43
应收股利		-	-
应收申购款		6,042,667.28	10,984,501.79
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		8,042,942,602.16	10,898,286,747.23
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2022 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-

卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	20,860,660.60
应付赎回款		12,800,191.37	20,046,527.89
应付管理人报酬		10,077,679.26	14,538,165.83
应付托管费		1,679,613.19	2,423,027.63
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		17.28	214.39
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	7,261,496.31	3,933,080.58
负债合计		31,818,997.41	61,801,676.92
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	2,419,574,654.35	2,856,910,760.65
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	5,591,548,950.40	7,979,574,309.66
净资产合计		8,011,123,604.75	10,836,485,070.31
负债和净资产总计		8,042,942,602.16	10,898,286,747.23

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，信澳新能源产业股票型证券投资基金基金份额净值 3.311 元，基金份额总额 2,419,574,654.35 份。

## 7.2 利润表

会计主体：信澳新能源产业股票型证券投资基金

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
<b>一、营业总收入</b>		-1,068,898,431.45	-4,885,768,605.74
1.利息收入		2,283,047.26	3,585,216.60
其中：存款利息收入	7.4.7.9	2,283,047.26	3,585,216.60
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-1,665,275,318.65	-1,756,375,271.48
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-1,767,139,459.91	-1,855,589,322.08

基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	27,038,502.21	1,766,905.03
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.12	-	-
股利收益	7.4.7.13	74,825,639.05	97,447,145.57
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益（若有）		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.14	588,528,670.09	-3,161,242,091.56
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	5,565,169.85	28,263,540.70
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>166,828,579.11</b>	<b>237,632,285.69</b>
1. 管理人报酬	7.4.10.2	142,744,536.47	203,435,567.08
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费	7.4.10.2	23,790,756.06	33,905,927.85
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	7.4.7.16	-	-
7. 税金及附加		286.73	111.32
8. 其他费用	7.4.7.17	292,999.85	290,679.44
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-1,235,727,010.56</b>	<b>-5,123,400,891.43</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-1,235,727,010.56</b>	<b>-5,123,400,891.43</b>
五、其他综合收益的税后净额		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-1,235,727,010.56</b>	<b>-5,123,400,891.43</b>

### 7.3 净资产变动表

会计主体：信澳新能源产业股票型证券投资基金

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	2,856,910,760.65	7,979,574,309.66	10,836,485,070.31
二、本期期初净资产	2,856,910,760.65	7,979,574,309.66	10,836,485,070.31
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-437,336,106.30	-2,388,025,359.26	-2,825,361,465.56
（一）、综合收益总额	-	-1,235,727,010.56	-1,235,727,010.56
（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）	-437,336,106.30	-1,152,298,348.70	-1,589,634,455.00
其中：1.基金申购款	664,403,063.03	1,807,991,338.43	2,472,394,401.46
2.基金赎回款	-1,101,739,169.33	-2,960,289,687.13	-4,062,028,856.46
（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	2,419,574,654.35	5,591,548,950.40	8,011,123,604.75
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	3,258,326,850.85	14,219,166,273.71	17,477,493,124.56
二、本期期初净资产	3,258,326,850.85	14,219,166,273.71	17,477,493,124.56
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-401,416,090.20	-6,239,591,964.05	-6,641,008,054.25
（一）、综合收	-	-5,123,400,891.43	-5,123,400,8

益总额			91.43
(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)	-401,416,090.20	-1,116,191,072.62	-1,517,607,162.82
其中: 1. 基金申购款	2,171,016,651.69	7,572,726,660.59	9,743,743,312.28
2. 基金赎回款	-2,572,432,741.89	-8,688,917,733.21	-11,261,350,475.10
(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	2,856,910,760.65	7,979,574,309.66	10,836,485,070.31

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码(序号)从 7.1 至 7.4, 财务报表由下列负责人签署:

朱永强

方敬

刘玉兰

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

信达澳银新能源产业股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]第 984 号《关于准予信达澳银新能源产业股票型证券投资基金注册的批复》核准,由信达澳银基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《信达澳银新能源产业股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具安永

华明验字(2015)第 60467227\_H01 号验资报告后, 向中国证监会备案。基金合同于 2015 年 7 月 31 日正式生效。本基金为契约型开放式, 存续期限不定。首次设立募集的有效净认购资金(本金)为人民币 286,342,869.31 元, 在首次募集期间有效认购资金产生的利息为人民币 354,644.33 元, 以上实收基金(本息)合计为人民币 286,697,513.64 元, 折合 286,697,513.64 份基金份额。本基金的基金管理人为信达澳银基金管理有限公司, 基金托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称“中国建设银行”)。2022 年 3 月 21 日, 基金管理人公司名称变更为“信达澳亚基金管理有限公司”。2022 年 6 月 1 日, 本基金名称变更为“信澳新能源产业股票型证券投资基金”。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及招募说明书的有关规定, 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(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票等)、存托凭证、债券(含中小企业私募债、可转换债券等)、债券回购、现金、货币市场工具、权证、股指期货、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金的投资组合比例为: 股票及存托凭证资产占基金资产的比例为 80%-95%, 其中投资于本基金定义的新能源产业主题相关的股票资产占非现金基金资产的比例不低于 80%; 债券(含中小企业私募债、可转换债券等)资产、现金、货币市场工具、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例为 5%-20%; 每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后, 基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%, 其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等; 权证的投资比例不超过基金资产净值的 3%; 资产支持证券的投资比例不超过基金资产净值的 20%。

本基金的业绩比较基准为: 沪深 300 指数收益率 $\times$ 85%+上证国债指数收益率 $\times$ 15%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)编制, 同时, 在信息披露和估值方面, 也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募



集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 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。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

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

#### 7.4.4.2 记账本位币

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

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

##### (1) 金融资产分类

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

##### (2) 金融负债分类

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

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最小层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

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

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

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

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

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

(3) 如有确凿证据表明按上述估值原则仍不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能适当反映公允价值的价格估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

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

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购、转入、红利再投资或赎回、转出基金份额时，申购、转入、红利再投资或赎回、转出款项中包含的按累计未分配的已实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购、转入、红利再投资或赎回、转出基金份额时，申购、转入、红利再投资或赎回、转出款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购、转入、红利再投资确认日或基金赎回、转出确认日确认。

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

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法计算的利息扣除在适用情况下的相关税费后的净额确认利息收入，计入当期损益。处置时，其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

(2) 对于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，相关交易费用直接计入投资收益。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为债权投资的，在持有期间将按票面或合同利率计算的利息收入扣除在适用情况下的相关税费后

的净额计入投资收益，扣除该部分利息后的公允价值变动额计入公允价值变动损益；除上述之外的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债的公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失扣除在适用情况下预估的增值税费后的净额计入公允价值变动损益。处置时，其处置价格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的相关税费后的净额确认为投资收益。

本基金在同时符合下列条件时确认股利收入并计入当期损益：1) 基金收取股利的权利已经确立；2) 与股利相关的经济利益很可能流入企业；3) 股利的金额能够可靠计量。

(3) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

#### **7.4.4.10 费用的确认和计量**

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

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

#### **7.4.4.11 基金的收益分配政策**

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 20%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 本基金的每份基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

#### 7.4.4.12 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- (2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- (3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

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

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期间无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

### 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

本基金本报告期间无需要说明的会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

#### 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

#### (1) 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

## （2）增值税及附加

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

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

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

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

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

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

## （3）企业所得税



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

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

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

#### （4）个人所得税

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

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

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

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

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

## 7.4.7.1 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	418,511,083.12	600,584,306.34
等于：本金	418,465,235.32	600,518,574.84
加：应计利息	45,847.80	65,731.50
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	418,511,083.12	600,584,306.34

## 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	7,981,646,615.1 7	-	7,592,115,245. 47	-389,531,369. 70

贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	6,883,200.00	935.13	6,954,458.33	70,323.20
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	6,883,200.00	935.13	6,954,458.33	70,323.20
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		7,988,529,815.17	935.13	7,599,069,703.80	-389,461,046.50
上年度末 2022 年 12 月 31 日					
项目		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		11,224,486,544.16	-	10,240,989,915.20	-983,496,628.96
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	24,851,100.00	12,334.60	30,370,346.97	5,506,912.37
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	24,851,100.00	12,334.60	30,370,346.97	5,506,912.37
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		11,249,337,644.16	12,334.60	10,271,360,262.17	-977,989,716.59

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本期末及上年度末无衍生金融资产/负债。

### 7.4.7.4 买入返售金融资产

#### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本期末及上年度末无买入返售金融资产。

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

### 7.4.7.5 其他资产

本基金本期末及上年度末无其他资产。

### 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	15,760.70	33,277.01
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	6,971,235.61	3,625,303.57
其中：交易所市场	6,971,235.61	3,625,303.57
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	274,500.00	274,500.00
合计	7,261,496.31	3,933,080.58

### 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	2,856,910,760.65	2,856,910,760.65
本期申购	664,403,063.03	664,403,063.03
本期赎回（以“-”号填列）	-1,101,739,169.33	-1,101,739,169.33
本期末	2,419,574,654.35	2,419,574,654.35

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

#### 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	6,164,026,256.49	1,815,548,053.17	7,979,574,309.66
本期期初	6,164,026,256.49	1,815,548,053.17	7,979,574,309.66
本期利润	-1,824,255,680.65	588,528,670.09	-1,235,727,010.56
本期基金份额交易产生的变动数	-801,133,383.16	-351,164,965.54	-1,152,298,348.70
其中：基金申购款	1,220,641,538.95	587,349,799.48	1,807,991,338.43
基金赎回款	-2,021,774,922.11	-938,514,765.02	-2,960,289,687.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,538,637,192.68	2,052,911,757.72	5,591,548,950.40

**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	2,029,115.35	3,190,556.11
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	223,504.75	300,064.62
其他	30,427.16	94,595.87
合计	2,283,047.26	3,585,216.60

**7.4.7.10 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	23,131,568,513.24	24,491,278,313.59
减：卖出股票成本总额	24,836,922,940.38	26,276,713,033.89
减：交易费用	61,785,032.77	70,154,601.78
买卖股票差价收入	-1,767,139,459.91	-1,855,589,322.08

**7.4.7.11 债券投资收益****7.4.7.11.1 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	79,607.78	30,864.55
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	26,958,894.43	1,736,040.48
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	27,038,502.21	1,766,905.03

#### 7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 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
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	103,349,422.48	10,004,949.17
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	76,293,000.00	8,252,900.00
减：应计利息总额	93,396.62	15,608.50
减：交易费用	4,131.43	400.19
买卖债券差价收入	26,958,894.43	1,736,040.48

#### 7.4.7.12 衍生工具收益

本基金本期及上年度可比期间无衍生工具收益。

#### 7.4.7.13 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	74,825,639.05	97,447,145.57
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	74,825,639.05	97,447,145.57

#### 7.4.7.14 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	588,528,670.09	-3,161,242,091.56
——股票投资	593,965,259.26	-3,162,359,918.28
——债券投资	-5,436,589.17	1,117,826.72
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	588,528,670.09	-3,161,242,091.56

#### 7.4.7.15 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	5,375,166.75	27,589,808.76
基金转换费收入	190,003.10	673,731.94
合计	5,565,169.85	28,263,540.70

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产即为基金赎回费收入。

2、本基金的转换费由赎回费和申购费补差两部分构成，其中不低于赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产即为基金转换费收入。

#### 7.4.7.16 信用减值损失

本基金本期及上年度可比期间无信用减值损失。

#### 7.4.7.17 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	150,000.00	150,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行结算费用	1,960.52	2,319.44
存托服务费	2,679.33	-
债券托管账户维护费	18,360.00	18,360.00
合计	292,999.85	290,679.44

#### 7.4.7.18 分部报告

截至本报告期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

## 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

## 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
信达澳亚基金管理有限公司（“信达澳亚基金公司”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金代销机构
信达证券股份有限公司（“信达证券”）	基金管理人的控股股东、基金代销机构
East Topco Limited	基金管理人的股东
信达新兴财富（北京）资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司
中国信达资产管理股份有限公司	对公司法人股东直接持股 20% 以上的股东

注：1、本基金本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

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

信达证券	10,968,593,154.31	24.58%	14,416,141,474.65	30.43%
------	-------------------	--------	-------------------	--------

#### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金本期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 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
信达证券	19,292.76	0.02%	6,560,088.76	65.57%

#### 7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的回购交易。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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
信达证券	10,253,220.72	26.60%	2,439,462.19	34.99%
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
信达证券	13,425,754.18	32.16%	1,468,473.92	40.51%

注：1、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的证管费和经手费的净额列示。

2、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等。

#### 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	142,744,536.47	203,435,567.08
其中：应支付销售机构的客户维护费	56,505,947.51	68,408,144.62
应支付基金管理人的净管理费	86,238,588.96	135,027,422.46

注：（1）自2023年12月30日起，本基金管理费由1.50%调低到1.20%。

（2）支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值1.20%的年费率计提，每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.20%/当年天数。

##### 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	23,790,756.06	33,905,927.85

注：（1）自2023年12月30日起，本基金托管费由0.25%调低到0.20%。

(2) 支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.20% / 当年天数。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本期及上年度可比期间无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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

本基金本期及上年度可比期间无与关联方进行转融通证券出借交易。

#### 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自有资金投资本基金的情况

本期及上年度可比期间基金管理人无运用自有资金投资本基金。

##### 7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本年度末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 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
中国建设银行股份有限公司	418,511,083.12	2,029,115.35	600,584,306.34	3,190,556.11

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本期及上年度可比期间无需要说明的其他关联交易事项。

### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配情况。

### 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
002906	华阳集团	2023-08-17	6个月	非公开发行流通受限	30.25	34.02	898,843	27,190,000.75	30,578,638.86	-
300793	佳禾智能	2023-07-25	6个月	大宗交易流通受限	17.41	21.08	1,358,920	23,658,797.20	28,646,033.60	-
001283	豪鹏科技	2023-10-31	6个月	大宗交易流通受限	43.87	49.76	545,600	23,935,472.00	27,149,056.00	-
603659	璞泰来	2023-11-22	6个月	非公开发行流通受限	23.16	20.11	934,365	21,639,893.40	18,790,080.15	-
300619	金银河	2023-12-28	6个月	非公开发行流通受限	46.16	53.03	327,340	15,110,014.40	17,358,840.20	-
001339	智微智能	2023-12-12	6个月	大宗交易流通	29.50	31.88	500,000	14,750,000.00	15,940,000.00	-

				受限						
300707	威唐工业	2023-12-26	6个月	非公开发行流通受限	17.78	16.67	566,366	10,069,987.48	9,441,321.22	-
002708	光洋股份	2023-11-10	6个月	非公开发行流通受限	6.98	7.53	1,243,553	8,679,999.94	9,363,954.09	-
688173	希荻微	2023-07-14	6个月	老股东转让限售	20.43	17.28	406,133	8,297,297.19	7,017,978.24	-

## 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:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
127101	豪鹏转债	2023-12-22	1个月内(含)	新债流通受限	100.00	100.01	50,000	5,000,000.00	5,000,328.77	-
127100	神码转债	2023-12-21	1个月内(含)	新债流通受限	100.00	100.01	11,552	1,155,200.00	1,155,283.55	-

## 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000801	四川九洲	2023-12-21	重大事项停牌	7.70	2024-01-05	8.47	1,678,000	13,335,353.73	12,920,600.00	-

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额，无作为质押的债券。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额，该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 日，本基金未持有从事转融通证券出借业务交易的证券。

## 7.4.13 金融工具风险及管理

### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型基金，理论上其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，属于风险较高、收益较高的证券投资基金产品。本基金的投资范围主要为具有良好流动性的股票投资和债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现"风险和收益相匹配"的风险收益目标。

本基金的基金管理人秉承全面风险管理的理念，将风险管理融入业务中，建立了由董事会风险控制委员会、经营层风险管理委员会、督察长、风险控制部、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。在董事会下设立风险控制委员会，负责审定重大风险管理战略、风险政策和风险控制制度；在经营层面设立风险管理委员会，对公司风险管理和控制政策、程序的制定、风险限额的设定等提出意见和建议，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面的风险控制主要由风险控制



部、监察稽核部负责督促与协调，各业务部门负责人为其所在部门的风险管理第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控和及时报告的义务，员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。

本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

##### 7.4.13.2.1 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日

AAA	-	-
AAA 以下	6,954,458.33	30,370,346.97
未评级	-	-
合计	6,954,458.33	30,370,346.97

注：（1）债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

（2）未评级债券为国债、政策性金融债、央票或其他未经第三方评级机构进行债项评级的债券。

### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《货币市场基金监督管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基

金持有的债券资产的公允价值。除本报告“期末债券正回购交易中作为抵押的债券”章节中列示的卖出回购金融资产款余额将在 1 个月内到期且计息外（如有），本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

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

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
货币资金	418,511,083.12	-	-	-	418,511,083.12
结算备付金	14,490,637.00	-	-	-	14,490,637.00
存出保证金	1,000,668.10	-	-	-	1,000,668.10
交易性金融资产	-	-	6,954,458.33	7,592,115,245.47	7,599,069,703.80
应收申购款	3,342.88	-	-	6,039,324.40	6,042,667.28
应收清算款	-	-	-	3,827,842.86	3,827,842.86
<b>资产总计</b>	<b>434,005,731.10</b>	-	<b>6,954,458.33</b>	<b>7,601,982,412.7</b>	<b>8,042,942,602.1</b>

				<b>3</b>	<b>6</b>
<b>负债</b>					
应付赎回款	-	-	-	12,800,191.37	12,800,191.37
应付管理人报酬	-	-	-	10,077,679.26	10,077,679.26
应付托管费	-	-	-	1,679,613.19	1,679,613.19
应交税费	-	-	-	17.28	17.28
其他负债	-	-	-	7,261,496.31	7,261,496.31
<b>负债总计</b>	-	-	-	<b>31,818,997.41</b>	<b>31,818,997.41</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>434,005,731.10</b>	-	<b>6,954,458.33</b>	<b>7,570,163,415.32</b>	<b>8,011,123,604.75</b>
<b>上年度末 2022 年 12 月 31 日</b>	<b>1 年以内</b>	<b>1-5 年</b>	<b>5 年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
<b>资产</b>					
银行存款	600,584,306.34	-	-	-	600,584,306.34
结算备付金	5,922,339.34	-	-	-	5,922,339.34
存出保证金	1,425,296.16	-	-	-	1,425,296.16
交易性金融资产	-	-	30,370,346.97	10,240,989,915.20	10,271,360,262.17
应收申购款	7,170.73	-	-	10,977,331.06	10,984,501.79
应收清算款	-	-	-	8,010,041.43	8,010,041.43
<b>资产总计</b>	<b>607,939,112.57</b>	-	<b>30,370,346.97</b>	<b>10,259,977,287.69</b>	<b>10,898,286,747.23</b>
<b>负债</b>					
应付赎回款	-	-	-	20,046,527.89	20,046,527.89
应付管理人报酬	-	-	-	14,538,165.83	14,538,165.83
应付托管费	-	-	-	2,423,027.63	2,423,027.63
应付清算款	-	-	-	20,860,660.60	20,860,660.60
应交税费	-	-	-	214.39	214.39
其他负债	-	-	-	3,933,080.58	3,933,080.58
<b>负债总计</b>	-	-	-	<b>61,801,676.92</b>	<b>61,801,676.92</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>607,939,112.57</b>	-	<b>30,370,346.97</b>	<b>10,198,175,610.77</b>	<b>10,836,485,070.31</b>

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	1.市场利率下降 25 个基点	98,473.16	434,720.40
	2.市场利率上升 25 个基点	-96,854.79	-427,477.51

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 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	7,592,115,245.47	94.77	10,240,989,915.20	94.50
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
<b>合计</b>	<b>7,592,115,245.47</b>	<b>94.77</b>	<b>10,240,989,915.20</b>	<b>94.50</b>

#### 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
	沪深 300 指数上升 5%	378,652,341.36	580,715,333.14
	沪深 300 指数下降 5%	-378,652,341.36	-580,715,333.14

#### 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	7,415,707,589.12	10,106,137,577.82
第二层次	19,076,212.32	36,454,710.26
第三层次	164,285,902.36	128,767,974.09
合计	7,599,069,703.80	10,271,360,262.17

##### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

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

##### 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	-	128,767,974.09	128,767,974.09
当期购买	-	153,331,462.36	153,331,462.36
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	128,767,974.09	128,767,974.09
当期利得或损失总额	-	10,954,440.00	10,954,440.00
其中：计入损益的利得或损失	-	10,954,440.00	10,954,440.00

计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	164,285,902.36	164,285,902.36
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	-	10,954,440.00	10,954,440.00
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	-	138,729,895.65	138,729,895.65
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	38,609.20	38,609.20
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-10,000,530.76	-10,000,530.76
其中：计入损益的利得或损失	-	-10,000,530.76	-10,000,530.76
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	128,767,974.09	128,767,974.09
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-10,000,530.76	-10,000,530.76

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
流通受限股票	164,285,902.36	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.2742 至 0.6530	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
流通受限股票	128,767,974.09	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.2392 至 0.7400	负相关



**7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明**

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

**7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明**

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

**7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项****7.4.15.1 承诺事项**

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

**7.4.15.2 其他事项**

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

**7.4.15.3 财务报表的批准**

本财务报表已于 2024 年 03 月 28 日经本基金的基金管理人批准报出。

**§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	7,592,115,245.47	94.39
	其中：股票	7,592,115,245.47	94.39
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	6,954,458.33	0.09

	其中：债券	6,954,458.33	0.09
	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	433,001,720.12	5.38
8	其他各项资产	10,871,178.24	0.14
9	合计	8,042,942,602.16	100.00

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	22,113,926.28	0.28
C	制造业	6,235,641,029.84	77.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	17,745,485.00	0.22
F	批发和零售业	74,460,167.14	0.93
G	交通运输、仓储和邮政业	130,641,181.48	1.63

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	771,133,688.52	9.63
J	金融业	159,541,872.25	1.99
K	房地产业	33,080,148.00	0.41
L	租赁和商务服务业	24,492,651.46	0.31
M	科学研究和技术服务业	79,362,243.22	0.99
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	20,785.86	0.00
R	文化、体育和娱乐业	34,223,530.66	0.43
S	综合	9,658,535.76	0.12
	合计	7,592,115,245.47	94.77

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本报告期末未持有港股通股票。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	603659	璞泰来	12,849,476	268,173,353.38	3.35
2	002475	立讯精密	6,172,292	212,635,459.40	2.65
3	301308	江波龙	1,632,127	150,237,290.35	1.88
4	002273	水晶光电	9,332,829	126,366,504.66	1.58
5	601702	华峰铝业	6,572,900	117,983,555.00	1.47
6	002138	顺络电子	3,935,499	106,297,827.99	1.33

7	603986	兆易创新	1,044,277	96,480,752.03	1.20
8	002189	中光学	3,294,300	76,790,133.00	0.96
9	603061	金海通	749,594	71,196,438.12	0.89
10	002938	鹏鼎控股	3,007,987	67,138,269.84	0.84
11	002906	华阳集团	1,935,421	67,118,013.36	0.84
12	300308	中际旭创	566,901	64,008,791.91	0.80
13	002179	中航光电	1,603,381	62,531,859.00	0.78
14	002387	维信诺	5,118,000	57,372,780.00	0.72
15	688538	和辉光电	22,885,137	55,610,882.91	0.69
16	603166	福达股份	7,890,026	54,520,079.66	0.68
17	600885	宏发股份	1,966,801	54,362,379.64	0.68
18	002583	海能达	8,618,285	51,278,795.75	0.64
19	688157	松井股份	947,973	51,133,663.62	0.64
20	600552	凯盛科技	3,809,000	50,773,970.00	0.63
21	002600	领益智造	7,488,100	50,619,556.00	0.63
22	688110	东芯股份	1,414,109	48,687,772.87	0.61
23	603179	新泉股份	936,221	47,475,766.91	0.59
24	300475	香农芯创	1,381,544	46,682,371.76	0.58
25	603197	保隆科技	820,913	46,299,493.20	0.58
26	002993	奥海科技	1,210,750	46,129,575.00	0.58
27	688097	博众精工	1,346,830	45,253,488.00	0.56
28	002957	科瑞技术	2,330,900	44,776,589.00	0.56
29	688019	安集科技	277,629	44,354,009.04	0.55
30	301338	凯格精机	1,076,140	44,121,740.00	0.55
31	000725	京东方 A	10,775,900	42,026,010.00	0.52
32	300793	佳禾智能	1,964,450	41,792,089.90	0.52
33	600933	爱柯迪	1,862,106	40,854,605.64	0.51
34	688515	裕太微	404,030	39,922,204.30	0.50
35	301067	显盈科技	1,181,340	39,704,837.40	0.50
36	688003	天准科技	1,038,004	38,945,910.08	0.49
37	301387	光大同创	575,212	38,941,852.40	0.49
38	001283	豪鹏科技	765,100	38,541,106.00	0.48
39	300101	振芯科技	1,677,586	38,299,288.38	0.48
40	688766	普冉股份	385,126	37,734,645.48	0.47
41	300687	赛意信息	1,699,499	37,015,088.22	0.46
42	000045	深纺织 A	3,049,784	35,987,451.20	0.45
43	688216	气派科技	1,295,123	35,836,053.41	0.45
44	300857	协创数据	674,700	35,752,353.00	0.45
45	300919	中伟股份	724,261	35,582,942.93	0.44
46	601038	一拖股份	2,385,900	34,762,563.00	0.43
47	000997	新大陆	1,748,550	34,289,065.50	0.43
48	000625	长安汽车	2,026,854	34,111,952.82	0.43

49	600418	江淮汽车	2,097,100	33,868,165.00	0.42
50	600183	生益科技	1,847,544	33,828,530.64	0.42
51	688595	芯海科技	777,620	33,670,946.00	0.42
52	600760	中航沈飞	785,120	33,116,361.60	0.41
53	002824	和胜股份	1,597,510	32,860,780.70	0.41
54	688123	聚辰股份	529,458	32,418,713.34	0.40
55	002706	良信股份	3,615,688	31,926,525.04	0.40
56	688343	云天励飞	646,264	31,828,502.00	0.40
57	300803	指南针	527,700	31,799,202.00	0.40
58	688772	珠海冠宇	1,438,338	31,657,819.38	0.40
59	001309	德明利	322,420	30,594,433.80	0.38
60	688627	精智达	342,042	30,503,305.56	0.38
61	002845	同兴达	1,704,640	30,257,360.00	0.38
62	300602	飞荣达	1,673,535	30,240,777.45	0.38
63	603626	科森科技	3,180,646	28,912,072.14	0.36
64	688111	金山办公	91,292	28,866,530.40	0.36
65	002185	华天科技	3,375,694	28,760,912.88	0.36
66	002837	英维克	1,044,934	28,714,786.32	0.36
67	002384	东山精密	1,474,279	26,802,392.22	0.33
68	000786	北新建材	1,142,931	26,698,868.16	0.33
69	002050	三花智控	903,480	26,562,312.00	0.33
70	601018	宁波港	7,407,100	26,369,276.00	0.33
71	300638	广和通	1,352,502	25,738,113.06	0.32
72	688525	佰维存储	407,303	25,521,605.98	0.32
73	000100	TCL 科技	5,898,430	25,363,249.00	0.32
74	301269	华大九天	238,700	25,266,395.00	0.32
75	001872	招商港口	1,571,300	25,077,948.00	0.31
76	002965	祥鑫科技	596,307	24,549,959.19	0.31
77	688371	菲沃泰	1,361,589	23,977,582.29	0.30
78	002850	科达利	283,732	23,964,004.72	0.30
79	688630	芯碁微装	279,359	23,848,877.83	0.30
80	600030	中信证券	1,164,900	23,729,013.00	0.30
81	301128	强瑞技术	509,400	23,692,194.00	0.30
82	603183	建研院	5,035,160	23,514,197.20	0.29
83	603203	快克智能	804,700	23,263,877.00	0.29
84	300059	东方财富	1,647,600	23,132,304.00	0.29
85	603977	国泰集团	2,218,816	23,075,686.40	0.29
86	688361	中科飞测	306,417	22,806,617.31	0.28
87	688416	恒烁股份	387,378	22,696,477.02	0.28
88	301312	智立方	209,071	22,650,752.14	0.28
89	688213	思特威	401,234	22,292,561.04	0.28
90	688152	麒麟信安	317,338	22,235,873.66	0.28

91	601688	华泰证券	1,588,400	22,158,180.00	0.28
92	002903	宇环数控	863,350	22,058,592.50	0.28
93	688008	澜起科技	374,604	22,011,731.04	0.27
94	688590	新致软件	969,612	21,932,623.44	0.27
95	002156	通富微电	942,200	21,783,664.00	0.27
96	300400	劲拓股份	1,334,206	21,734,215.74	0.27
97	688507	索辰科技	158,605	21,689,233.75	0.27
98	688052	纳芯微	129,804	21,657,797.40	0.27
99	603501	韦尔股份	200,875	21,435,371.25	0.27
100	300081	恒信东方	1,836,600	21,212,730.00	0.26
101	300731	科创新源	1,005,140	21,067,734.40	0.26
102	300083	创世纪	3,310,000	20,952,300.00	0.26
103	600126	杭钢股份	3,926,300	20,927,179.00	0.26
104	688372	伟测科技	262,012	20,541,740.80	0.26
105	688268	华特气体	295,604	19,917,797.52	0.25
106	605128	上海沿浦	342,833	19,901,455.65	0.25
107	002937	兴瑞科技	762,533	19,871,609.98	0.25
108	301382	蜂助手	555,732	19,795,173.84	0.25
109	301181	标榜股份	692,336	19,544,645.28	0.24
110	301013	利和兴	1,231,912	19,525,805.20	0.24
111	688279	峰昭科技	153,903	19,410,246.36	0.24
112	002988	豪美新材	799,629	19,087,144.23	0.24
113	688601	力芯微	364,061	19,073,155.79	0.24
114	688048	长光华芯	298,025	18,677,226.75	0.23
115	688201	信安世纪	947,887	18,654,416.16	0.23
116	002858	力盛体育	979,900	18,618,100.00	0.23
117	688028	沃尔德	743,307	18,500,911.23	0.23
118	603758	秦安股份	1,609,500	18,412,680.00	0.23
119	300504	天邑股份	997,200	18,238,788.00	0.23
120	603993	洛阳钼业	3,481,362	18,103,082.40	0.23
121	600585	海螺水泥	802,000	18,093,120.00	0.23
122	603712	七一二	570,800	17,985,908.00	0.22
123	603040	新坐标	685,688	17,930,741.20	0.22
124	688138	清溢光电	791,749	17,909,362.38	0.22
125	002212	天融信	1,801,119	17,614,943.82	0.22
126	300866	安克创新	196,900	17,445,340.00	0.22
127	300619	金银河	327,340	17,358,840.20	0.22
128	300031	宝通科技	921,700	17,088,318.00	0.21
129	600735	新华锦	2,620,682	16,903,398.90	0.21
130	301377	鼎泰高科	714,531	16,898,658.15	0.21
131	000034	神州数码	563,918	16,866,787.38	0.21
132	300634	彩讯股份	821,500	16,816,105.00	0.21

133	301095	广立微	223,753	16,721,061.69	0.21
134	601138	工业富联	1,103,765	16,688,926.80	0.21
135	300545	联得装备	476,100	16,449,255.00	0.21
136	002587	奥拓电子	1,916,329	16,422,939.53	0.21
137	000021	深科技	1,008,700	16,351,027.00	0.20
138	688210	统联精密	625,052	16,345,109.80	0.20
139	603809	豪能股份	1,378,619	16,336,635.15	0.20
140	688365	光云科技	1,497,743	16,310,421.27	0.20
141	003029	吉大正元	827,016	16,300,485.36	0.20
142	300258	精锻科技	1,249,741	16,146,653.72	0.20
143	002049	紫光国微	237,129	15,994,351.05	0.20
144	688328	深科达	356,508	15,989,383.80	0.20
145	001339	智微智能	500,000	15,940,000.00	0.20
146	600741	华域汽车	975,836	15,886,610.08	0.20
147	603589	口子窖	348,900	15,805,170.00	0.20
148	605068	明新旭腾	701,647	15,744,958.68	0.20
149	688728	格科微	764,991	15,659,365.77	0.20
150	002756	永兴材料	298,820	15,601,392.20	0.19
151	600038	中直股份	398,459	15,352,625.27	0.19
152	300559	佳发教育	984,900	15,265,950.00	0.19
153	300679	电连技术	366,144	15,194,976.00	0.19
154	300697	电工合金	1,155,900	14,934,228.00	0.19
155	688608	恒玄科技	96,601	14,902,636.27	0.19
156	603920	世运电路	800,370	14,630,763.60	0.18
157	689009	九号公司	489,611	14,521,862.26	0.18
158	603043	广州酒家	732,885	14,313,244.05	0.18
159	002439	启明星辰	528,732	14,275,764.00	0.18
160	300782	卓胜微	101,000	14,241,000.00	0.18
161	600029	南方航空	2,449,000	14,106,240.00	0.18
162	688798	艾为电子	202,161	13,955,173.83	0.17
163	301489	思泉新材	184,532	13,950,619.20	0.17
164	002635	安洁科技	849,500	13,872,335.00	0.17
165	603283	赛腾股份	190,900	13,851,704.00	0.17
166	003012	东鹏控股	1,669,800	13,775,850.00	0.17
167	601111	中国国航	1,868,500	13,714,790.00	0.17
168	603005	晶方科技	623,100	13,683,276.00	0.17
169	300461	田中精机	524,078	13,568,379.42	0.17
170	605133	嵘泰股份	489,181	13,535,638.27	0.17
171	000503	国新健康	1,018,200	13,419,876.00	0.17
172	603083	剑桥科技	351,500	13,258,580.00	0.17
173	002920	德赛西威	101,884	13,194,996.84	0.16
174	300806	斯迪克	937,500	13,190,625.00	0.16

175	301169	零点有数	249,820	13,160,517.60	0.16
176	600458	时代新材	1,426,697	13,139,879.37	0.16
177	603319	湘油泵	744,717	13,062,336.18	0.16
178	000801	四川九洲	1,678,000	12,920,600.00	0.16
179	688475	萤石网络	287,499	12,908,705.10	0.16
180	605589	圣泉集团	574,200	12,850,596.00	0.16
181	300707	威唐工业	745,212	12,766,068.36	0.16
182	002918	蒙娜丽莎	932,800	12,630,112.00	0.16
183	688519	南亚新材	490,222	12,628,118.72	0.16
184	603816	顾家家居	359,200	12,572,000.00	0.16
185	002876	三利谱	340,400	12,516,508.00	0.16
186	603236	移远通信	231,090	12,421,087.50	0.16
187	300130	新国都	512,150	12,394,030.00	0.15
188	688080	映翰通	304,967	12,375,560.86	0.15
189	300474	景嘉微	174,470	12,336,773.70	0.15
190	603296	华勤技术	153,264	12,244,260.96	0.15
191	300547	川环科技	719,203	12,118,570.55	0.15
192	688125	安达智能	306,177	12,078,682.65	0.15
193	600699	均胜电子	670,946	12,050,190.16	0.15
194	002916	深南电路	169,679	12,045,512.21	0.15
195	000088	盐田港	2,445,146	11,932,312.48	0.15
196	000837	秦川机床	1,107,500	11,905,625.00	0.15
197	002857	三晖电气	712,900	11,762,850.00	0.15
198	002869	金溢科技	572,900	11,595,496.00	0.14
199	300382	斯莱克	1,162,295	11,541,589.35	0.14
200	300812	易天股份	272,600	11,337,434.00	0.14
201	002284	亚太股份	1,278,300	11,210,691.00	0.14
202	000066	中国长城	1,103,400	11,166,408.00	0.14
203	002765	蓝黛科技	1,660,961	11,145,048.31	0.14
204	688045	必易微	259,934	11,132,973.22	0.14
205	301360	荣旗科技	118,300	11,072,880.00	0.14
206	600779	水井坊	188,200	11,060,514.00	0.14
207	601633	长城汽车	437,600	11,036,272.00	0.14
208	601127	赛力斯	144,800	11,033,760.00	0.14
209	300724	捷佳伟创	148,700	11,005,287.00	0.14
210	603657	春光科技	678,500	10,917,065.00	0.14
211	300213	佳讯飞鸿	1,499,400	10,795,680.00	0.13
212	688227	品高股份	561,712	10,711,847.84	0.13
213	603267	鸿远电子	213,100	10,697,620.00	0.13
214	688060	云涌科技	227,644	10,674,227.16	0.13
215	688258	卓易信息	215,000	10,642,500.00	0.13
216	688023	安恒信息	95,392	10,578,018.88	0.13



217	688079	美迪凯	791,139	10,530,060.09	0.13
218	601021	春秋航空	209,400	10,511,880.00	0.13
219	300507	苏奥传感	1,525,442	10,311,987.92	0.13
220	300790	宇瞳光学	631,200	10,269,624.00	0.13
221	603859	能科科技	268,996	10,149,219.08	0.13
222	688502	茂莱光学	45,630	9,901,253.70	0.12
223	603068	博通集成	338,600	9,870,190.00	0.12
224	600673	东阳光	1,317,672	9,658,535.76	0.12
225	002949	华阳国际	686,702	9,593,226.94	0.12
226	603885	吉祥航空	798,873	9,586,476.00	0.12
227	300611	美力科技	832,874	9,569,722.26	0.12
228	300811	铂科新材	180,794	9,558,578.78	0.12
229	002708	光洋股份	1,243,553	9,363,954.09	0.12
230	601155	新城控股	818,400	9,337,944.00	0.12
231	603466	风语筑	647,907	9,316,902.66	0.12
232	601689	拓普集团	126,092	9,267,762.00	0.12
233	002283	天润工业	1,551,700	9,077,445.00	0.11
234	002126	银轮股份	480,418	8,969,404.06	0.11
235	300624	万兴科技	94,700	8,958,620.00	0.11
236	001314	亿道信息	123,900	8,912,127.00	0.11
237	603085	天成自控	873,722	8,911,964.40	0.11
238	603171	税友股份	250,200	8,852,076.00	0.11
239	600660	福耀玻璃	236,200	8,831,518.00	0.11
240	001914	招商积余	724,600	8,666,216.00	0.11
241	300459	汤姆猫	1,752,600	8,657,844.00	0.11
242	002152	广电运通	697,500	8,551,350.00	0.11
243	601231	环旭电子	561,800	8,488,798.00	0.11
244	300170	汉得信息	1,018,914	8,467,175.34	0.11
245	688116	天奈科技	290,427	8,434,000.08	0.11
246	603311	金海高科	812,400	8,400,216.00	0.10
247	301486	致尚科技	174,700	8,373,371.00	0.10
248	688618	三旺通信	142,546	8,353,195.60	0.10
249	688629	华丰科技	379,997	8,321,934.30	0.10
250	300456	赛微电子	345,885	8,315,075.40	0.10
251	002881	美格智能	306,691	8,299,058.46	0.10
252	300930	屹通新材	345,651	8,267,971.92	0.10
253	002063	远光软件	1,336,017	8,256,585.06	0.10
254	002182	宝武镁业	419,571	8,248,765.86	0.10
255	000887	中鼎股份	664,100	8,214,917.00	0.10
256	300102	乾照光电	1,111,698	8,170,980.30	0.10
257	000050	深天马 A	764,534	8,142,287.10	0.10
258	002139	拓邦股份	833,931	8,139,166.56	0.10

259	300219	鸿利智汇	964,000	8,116,880.00	0.10
260	603633	徕木股份	841,140	8,058,121.20	0.10
261	300360	炬华科技	587,000	8,018,420.00	0.10
262	000988	华工科技	268,900	8,002,464.00	0.10
263	002240	盛新锂能	351,459	7,995,692.25	0.10
264	301335	天元宠物	372,353	7,968,354.20	0.10
265	300236	上海新阳	225,975	7,958,839.50	0.10
266	603035	常熟汽饰	420,174	7,928,683.38	0.10
267	300496	中科创达	98,676	7,900,000.56	0.10
268	688433	华曙高科	249,921	7,810,031.25	0.10
269	300085	银之杰	544,326	7,794,748.32	0.10
270	688206	概伦电子	356,860	7,779,548.00	0.10
271	002046	国机精工	673,500	7,778,925.00	0.10
272	688041	海光信息	109,281	7,756,765.38	0.10
273	603160	汇顶科技	112,200	7,753,020.00	0.10
274	603893	瑞芯微	121,994	7,734,419.60	0.10
275	001979	招商蛇口	805,400	7,675,462.00	0.10
276	300036	超图软件	363,100	7,588,790.00	0.09
277	300042	朗科科技	216,400	7,574,000.00	0.09
278	603982	泉峰汽车	525,045	7,565,898.45	0.09
279	002474	榕基软件	1,149,600	7,564,368.00	0.09
280	603595	东尼电子	203,528	7,487,795.12	0.09
281	300458	全志科技	328,000	7,442,320.00	0.09
282	301325	曼恩斯特	95,762	7,425,385.48	0.09
283	002947	恒铭达	227,422	7,318,439.96	0.09
284	300499	高澜股份	509,400	7,304,796.00	0.09
285	601390	中国中铁	1,285,000	7,298,800.00	0.09
286	688071	华依科技	149,717	7,292,715.07	0.09
287	301186	超达装备	183,910	7,269,962.30	0.09
288	000026	飞亚达	657,800	7,209,488.00	0.09
289	688435	英方软件	149,679	7,187,585.58	0.09
290	300893	松原股份	245,500	7,175,965.00	0.09
291	002443	金洲管道	1,047,000	7,171,950.00	0.09
292	600155	华创云信	855,500	7,134,870.00	0.09
293	688686	奥普特	63,248	7,083,776.00	0.09
294	300684	中石科技	328,400	7,057,316.00	0.09
295	300480	光力科技	330,200	7,049,770.00	0.09
296	688037	芯源微	52,688	7,039,643.68	0.09
297	688173	希荻微	406,133	7,017,978.24	0.09
298	300590	移为通信	582,800	6,999,428.00	0.09
299	301091	深城交	302,100	6,933,195.00	0.09
300	300302	同有科技	511,729	6,928,810.66	0.09

301	300502	新易盛	139,300	6,870,276.00	0.09
302	002463	沪电股份	308,300	6,819,596.00	0.09
303	603138	海量数据	382,700	6,812,060.00	0.09
304	688308	欧科亿	243,526	6,794,375.40	0.08
305	300902	国安达	192,200	6,775,050.00	0.08
306	300674	宇信科技	408,344	6,647,840.32	0.08
307	605228	神通科技	560,700	6,621,867.00	0.08
308	301179	泽宇智能	250,280	6,494,766.00	0.08
309	603256	宏和科技	775,600	6,452,992.00	0.08
310	002472	双环传动	247,929	6,451,112.58	0.08
311	002738	中矿资源	172,554	6,437,989.74	0.08
312	000938	紫光股份	326,400	6,315,840.00	0.08
313	601668	中国建筑	1,311,200	6,306,872.00	0.08
314	603305	旭升集团	318,350	6,281,045.50	0.08
315	002966	苏州银行	962,140	6,215,424.40	0.08
316	688260	昀冢科技	204,138	6,185,381.40	0.08
317	688088	虹软科技	149,688	6,143,195.52	0.08
318	300845	捷安高科	339,000	6,125,730.00	0.08
319	688668	鼎通科技	110,362	6,105,225.84	0.08
320	603232	格尔软件	439,137	6,011,785.53	0.08
321	600584	长电科技	199,447	5,955,487.42	0.07
322	300766	每日互动	384,600	5,934,378.00	0.07
323	301296	新巨丰	570,980	5,881,094.00	0.07
324	600926	杭州银行	585,435	5,860,204.35	0.07
325	002158	汉钟精机	262,600	5,845,476.00	0.07
326	603989	艾华集团	269,775	5,805,558.00	0.07
327	688031	星环科技	89,172	5,802,422.04	0.07
328	301160	翔楼新材	137,400	5,802,402.00	0.07
329	688148	芳源股份	755,743	5,796,548.81	0.07
330	600702	舍得酒业	59,900	5,792,330.00	0.07
331	002466	天齐锂业	103,100	5,751,949.00	0.07
332	000778	新兴铸管	1,484,000	5,668,880.00	0.07
333	600036	招商银行	203,300	5,655,806.00	0.07
334	301358	湖南裕能	166,134	5,640,249.30	0.07
335	002971	和远气体	201,900	5,596,668.00	0.07
336	000001	平安银行	594,500	5,582,355.00	0.07
337	605168	三人行	87,800	5,563,008.00	0.07
338	603888	新华网	219,935	5,540,162.65	0.07
339	002540	亚太科技	838,109	5,539,900.49	0.07
340	603118	共进股份	617,200	5,530,112.00	0.07
341	688007	光峰科技	211,290	5,468,185.20	0.07
342	002268	电科网安	239,317	5,375,059.82	0.07

343	688777	中控技术	117,819	5,343,091.65	0.07
344	600114	东睦股份	341,800	5,294,482.00	0.07
345	301330	熵基科技	158,300	5,239,730.00	0.07
346	300925	法本信息	442,100	5,194,675.00	0.06
347	603039	泛微网络	109,900	5,154,310.00	0.06
348	600285	羚锐制药	300,425	5,140,271.75	0.06
349	300188	国投智能	318,975	5,109,979.50	0.06
350	600850	电科数字	232,139	5,049,023.25	0.06
351	002056	横店东磁	371,322	5,027,699.88	0.06
352	300647	超频三	782,002	5,020,452.84	0.06
353	002142	宁波银行	245,500	4,937,005.00	0.06
354	688386	泛亚微透	119,052	4,857,321.60	0.06
355	300593	新雷能	321,484	4,748,318.68	0.06
356	002085	万丰奥威	945,700	4,671,758.00	0.06
357	601000	唐山港	1,319,100	4,616,850.00	0.06
358	600941	中国移动	46,300	4,605,924.00	0.06
359	688332	中科蓝讯	60,508	4,563,513.36	0.06
360	688083	中望软件	45,825	4,561,420.50	0.06
361	688636	智明达	68,649	4,475,914.80	0.06
362	603516	淳中科技	198,200	4,453,554.00	0.06
363	688281	华秦科技	32,468	4,404,608.88	0.05
364	688103	国力股份	87,748	4,332,996.24	0.05
365	603335	迪生力	643,090	4,315,133.90	0.05
366	000895	双汇发展	160,600	4,289,626.00	0.05
367	688187	时代电气	117,128	4,255,260.24	0.05
368	000333	美的集团	77,800	4,250,214.00	0.05
369	300531	优博讯	277,000	4,246,410.00	0.05
370	603111	康尼机电	761,842	4,243,459.94	0.05
371	000089	深圳机场	656,200	4,219,366.00	0.05
372	600641	万业企业	240,900	4,157,934.00	0.05
373	000915	华特达因	142,831	4,136,385.76	0.05
374	600269	赣粤高速	996,400	4,095,204.00	0.05
375	600633	浙数文化	368,100	4,071,186.00	0.05
376	300232	洲明科技	462,549	4,070,431.20	0.05
377	002197	证通电子	390,600	4,058,334.00	0.05
378	300539	横河精密	325,445	4,038,772.45	0.05
379	002707	众信旅游	565,600	4,038,384.00	0.05
380	300750	宁德时代	24,700	4,032,522.00	0.05
381	300088	长信科技	601,600	4,024,704.00	0.05
382	603799	华友钴业	121,500	4,000,995.00	0.05
383	603730	岱美股份	274,423	3,976,389.27	0.05
384	600563	法拉电子	42,564	3,941,426.40	0.05

385	301365	矩阵股份	260,500	3,938,760.00	0.05
386	300415	伊之密	221,500	3,905,045.00	0.05
387	300607	拓斯达	247,400	3,876,758.00	0.05
388	688484	南芯科技	96,572	3,848,394.20	0.05
389	600271	航天信息	361,100	3,842,104.00	0.05
390	000555	神州信息	337,969	3,815,670.01	0.05
391	603596	伯特利	54,946	3,807,757.80	0.05
392	688150	莱特光电	174,860	3,775,227.40	0.05
393	688095	福昕软件	53,956	3,768,826.60	0.05
394	300951	博硕科技	57,950	3,754,001.00	0.05
395	000158	常山北明	434,100	3,741,942.00	0.05
396	603026	胜华新材	81,296	3,728,234.56	0.05
397	000829	天音控股	388,000	3,701,520.00	0.05
398	600203	福日电子	499,200	3,699,072.00	0.05
399	002579	中京电子	420,100	3,684,277.00	0.05
400	688301	奕瑞科技	11,253	3,660,150.78	0.05
401	688362	甬矽电子	138,139	3,617,860.41	0.05
402	300348	长亮科技	349,200	3,600,252.00	0.04
403	002508	老板电器	161,300	3,513,114.00	0.04
404	000860	顺鑫农业	163,900	3,489,431.00	0.04
405	601838	成都银行	303,300	3,415,158.00	0.04
406	002318	久立特材	171,500	3,409,420.00	0.04
407	688256	寒武纪	24,811	3,348,492.56	0.04
408	003015	日久光电	282,300	3,319,848.00	0.04
409	603833	欧派家居	47,500	3,306,475.00	0.04
410	002709	天赐材料	131,786	3,305,192.88	0.04
411	000700	模塑科技	466,200	3,263,400.00	0.04
412	300235	方直科技	284,200	3,259,774.00	0.04
413	002897	意华股份	87,600	3,255,216.00	0.04
414	002968	新大正	259,200	3,242,592.00	0.04
415	603306	华懋科技	118,600	3,215,246.00	0.04
416	601228	广州港	1,016,100	3,180,393.00	0.04
417	600963	岳阳林纸	530,700	3,125,823.00	0.04
418	688682	霍莱沃	65,092	3,105,539.32	0.04
419	301503	智迪科技	91,900	3,091,516.00	0.04
420	000049	德赛电池	112,622	3,054,308.64	0.04
421	300351	永贵电器	138,800	2,875,936.00	0.04
422	002926	华西证券	359,700	2,791,272.00	0.03
423	601928	凤凰传媒	315,600	2,780,436.00	0.03
424	601799	星宇股份	21,100	2,766,421.00	0.03
425	601618	中国中冶	902,500	2,761,650.00	0.03
426	300494	盛天网络	174,300	2,755,683.00	0.03

427	300890	翔丰华	79,400	2,745,652.00	0.03
428	300726	宏达电子	87,900	2,653,701.00	0.03
429	000933	神火股份	156,785	2,633,988.00	0.03
430	688508	芯朋微	52,854	2,600,945.34	0.03
431	300394	天孚通信	28,200	2,580,864.00	0.03
432	300037	新宙邦	54,219	2,564,558.70	0.03
433	000776	广发证券	178,300	2,547,907.00	0.03
434	002609	捷顺科技	223,100	2,547,802.00	0.03
435	603505	金石资源	93,811	2,546,968.65	0.03
436	002997	瑞鹄模具	76,100	2,535,652.00	0.03
437	600498	烽火通信	152,200	2,532,608.00	0.03
438	600109	国金证券	278,400	2,527,872.00	0.03
439	600918	中泰证券	365,500	2,507,330.00	0.03
440	688793	倍轻松	72,954	2,454,902.10	0.03
441	603517	绝味食品	90,200	2,422,772.00	0.03
442	603239	浙江仙通	157,900	2,411,133.00	0.03
443	601377	兴业证券	410,500	2,409,635.00	0.03
444	300124	汇川技术	37,900	2,393,006.00	0.03
445	603018	华设集团	314,200	2,387,920.00	0.03
446	601788	光大证券	154,200	2,377,764.00	0.03
447	002420	毅昌科技	380,400	2,373,696.00	0.03
448	603019	中科曙光	59,331	2,342,981.19	0.03
449	600958	东方证券	264,065	2,297,365.50	0.03
450	300551	古鳌科技	125,500	2,183,700.00	0.03
451	000858	五粮液	15,500	2,174,805.00	0.03
452	300609	汇纳科技	79,400	2,167,620.00	0.03
453	688141	杰华特	76,896	2,126,943.36	0.03
454	301159	三维天地	45,700	2,085,291.00	0.03
455	002110	三钢闽光	513,500	2,079,675.00	0.03
456	000070	特发信息	260,100	2,065,194.00	0.03
457	300709	精研科技	63,500	1,980,565.00	0.02
458	688496	清越科技	88,423	1,979,790.97	0.02
459	002465	海格通信	153,700	1,975,045.00	0.02
460	688077	大地熊	81,705	1,948,664.25	0.02
461	603662	柯力传感	53,800	1,936,262.00	0.02
462	300454	深信服	26,000	1,879,540.00	0.02
463	605277	新亚电子	125,600	1,876,464.00	0.02
464	002444	巨星科技	80,800	1,819,616.00	0.02
465	002577	雷柏科技	102,800	1,812,364.00	0.02
466	688282	理工导航	45,294	1,780,054.20	0.02
467	300337	银邦股份	218,417	1,766,993.53	0.02
468	000783	长江证券	326,500	1,756,570.00	0.02

469	301313	凡拓数创	48,500	1,748,910.00	0.02
470	600410	华胜天成	258,300	1,735,776.00	0.02
471	603383	顶点软件	35,200	1,735,360.00	0.02
472	001308	康冠科技	62,000	1,734,760.00	0.02
473	688458	美芯晟	22,418	1,725,289.28	0.02
474	301011	华立科技	73,700	1,724,580.00	0.02
475	002068	黑猫股份	146,900	1,704,040.00	0.02
476	600797	浙大网新	259,700	1,703,632.00	0.02
477	601333	广深铁路	642,400	1,663,816.00	0.02
478	688286	敏芯股份	23,175	1,661,647.50	0.02
479	300014	亿纬锂能	39,100	1,650,020.00	0.02
480	002655	共达电声	120,900	1,635,777.00	0.02
481	300938	信测标准	45,500	1,632,995.00	0.02
482	688378	奥来德	34,224	1,620,164.16	0.02
483	688012	中微公司	10,536	1,618,329.60	0.02
484	300769	德方纳米	26,200	1,598,986.00	0.02
485	601019	山东出版	169,900	1,593,662.00	0.02
486	688252	天德钰	78,589	1,568,636.44	0.02
487	601298	青岛港	253,500	1,566,630.00	0.02
488	600892	大晟文化	255,900	1,555,872.00	0.02
489	300418	昆仑万维	41,400	1,548,360.00	0.02
490	605018	长华集团	139,100	1,541,228.00	0.02
491	301248	杰创智能	87,500	1,540,875.00	0.02
492	301419	阿莱德	41,400	1,535,940.00	0.02
493	688381	帝奥微	60,595	1,534,265.40	0.02
494	301319	唯特偶	26,200	1,530,342.00	0.02
495	603358	华达科技	65,100	1,522,038.00	0.02
496	603636	南威软件	117,501	1,506,362.82	0.02
497	688115	思林杰	42,678	1,479,646.26	0.02
498	002657	中科金财	80,400	1,464,888.00	0.02
499	002925	盈趣科技	72,500	1,411,575.00	0.02
500	688385	复旦微电	35,958	1,389,057.54	0.02
501	002553	南方精工	112,900	1,377,380.00	0.02
502	600481	双良节能	162,600	1,375,596.00	0.02
503	300788	中信出版	46,900	1,364,790.00	0.02
504	300533	冰川网络	48,600	1,346,220.00	0.02
505	002624	完美世界	113,200	1,340,288.00	0.02
506	002851	麦格米特	53,200	1,308,720.00	0.02
507	603737	三棵树	22,800	1,085,508.00	0.01
508	300408	三环集团	36,400	1,071,980.00	0.01
509	300211	亿通科技	104,500	1,056,495.00	0.01
510	688661	和林微纳	22,974	1,052,668.68	0.01

511	600078	ST 澄星	124,200	1,047,006.00	0.01
512	688025	杰普特	11,277	1,043,686.35	0.01
513	002832	比音勒芬	32,854	1,041,471.80	0.01
514	600050	中国联通	235,300	1,030,614.00	0.01
515	688352	颀中科技	66,834	1,029,911.94	0.01
516	002645	华宏科技	90,700	1,024,910.00	0.01
517	688100	威胜信息	35,297	1,020,789.24	0.01
518	603650	彤程新材	30,500	1,015,650.00	0.01
519	688234	天岳先进	15,313	1,011,729.91	0.01
520	300460	惠伦晶体	80,340	984,968.40	0.01
521	603186	华正新材	27,600	957,720.00	0.01
522	600737	中粮糖业	115,600	952,544.00	0.01
523	688036	传音控股	6,728	931,155.20	0.01
524	688072	拓荆科技	4,012	927,975.60	0.01
525	002119	康强电子	69,308	926,647.96	0.01
526	000061	农产品	140,300	907,741.00	0.01
527	688512	慧智微	46,103	898,547.47	0.01
528	688035	德邦科技	16,526	881,827.36	0.01
529	600745	闻泰科技	20,800	880,048.00	0.01
530	002741	光华科技	58,985	877,106.95	0.01
531	000815	美利云	78,400	867,104.00	0.01
532	002368	太极股份	29,234	863,280.02	0.01
533	600366	宁波韵升	109,928	854,140.56	0.01
534	688195	腾景科技	23,636	850,659.64	0.01
535	601088	中国神华	26,700	837,045.00	0.01
536	688323	瑞华泰	38,628	829,343.16	0.01
537	603158	腾龙股份	84,882	826,750.68	0.01
538	301307	美利信	23,771	824,615.99	0.01
539	300688	创业黑马	28,666	823,000.86	0.01
540	300802	矩子科技	43,000	822,160.00	0.01
541	688249	晶合集成	47,138	813,130.50	0.01
542	603997	继峰股份	59,373	799,754.31	0.01
543	000911	广农糖业	98,000	798,700.00	0.01
544	000799	酒鬼酒	10,800	790,020.00	0.01
545	300656	民德电子	32,200	789,866.00	0.01
546	300870	欧陆通	17,800	788,006.00	0.01
547	000977	浪潮信息	23,703	786,939.60	0.01
548	688128	中国电研	38,147	782,776.44	0.01
549	688368	晶丰明源	7,233	780,730.02	0.01
550	000651	格力电器	24,200	778,514.00	0.01
551	300378	鼎捷软件	36,444	776,621.64	0.01
552	002747	埃斯顿	41,700	775,203.00	0.01



553	601186	中国铁建	101,500	772,415.00	0.01
554	300161	华中数控	21,500	771,850.00	0.01
555	301221	光庭信息	13,200	769,560.00	0.01
556	688599	天合光能	26,927	768,227.31	0.01
557	688005	容百科技	19,051	758,229.80	0.01
558	603738	泰晶科技	46,200	755,370.00	0.01
559	600031	三一重工	54,513	750,644.01	0.01
560	002446	盛路通信	90,200	748,660.00	0.01
561	688353	华盛锂电	27,231	746,129.40	0.01
562	603348	文灿股份	19,200	744,960.00	0.01
563	300623	捷捷微电	46,867	743,779.29	0.01
564	688200	华峰测控	5,990	735,572.00	0.01
565	002459	晶澳科技	35,472	734,979.84	0.01
566	002025	航天电器	15,305	734,946.10	0.01
567	000948	南天信息	48,200	726,374.00	0.01
568	688120	华海清科	3,860	724,522.00	0.01
569	600619	海立股份	104,400	710,964.00	0.01
570	601375	中原证券	184,500	706,635.00	0.01
571	603876	鼎胜新材	56,304	705,489.12	0.01
572	002791	坚朗五金	17,200	696,428.00	0.01
573	300002	神州泰岳	74,800	661,980.00	0.01
574	002354	天娱数科	117,400	648,048.00	0.01
575	688022	瀚川智能	28,919	634,482.86	0.01
576	603496	恒为科技	20,320	633,171.20	0.01
577	002192	融捷股份	11,563	626,830.23	0.01
578	000032	深桑达 A	28,600	605,748.00	0.01
579	600601	方正科技	209,400	605,166.00	0.01
580	300073	当升科技	14,800	565,360.00	0.01
581	600229	城市传媒	72,800	549,640.00	0.01
582	688299	长阳科技	36,347	507,040.65	0.01
583	301018	申菱环境	15,551	409,613.34	0.01
584	688535	华海诚科	2,200	204,116.00	0.00
585	002180	纳思达	7,000	158,410.00	0.00
586	603927	中科软	5,178	155,236.44	0.00
587	688147	微导纳米	3,216	125,391.84	0.00
588	002460	赣锋锂业	2,900	124,120.00	0.00
589	688082	盛美上海	691	72,147.31	0.00
590	300671	富满微	2,000	64,660.00	0.00
591	688576	西山科技	240	23,071.20	0.00
592	301293	三博脑科	333	20,785.86	0.00
593	002987	京北方	60	1,114.80	0.00

注：2024 年 1 月 2 日，股票代码 300188 证券简称由“美亚柏科”变更为“国投智能”。

## 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	300750	宁德时代	362,905,565.67	3.35
2	603986	兆易创新	329,742,072.59	3.04
3	300769	德方纳米	254,797,441.88	2.35
4	002475	立讯精密	254,566,695.48	2.35
5	603659	璞泰来	252,787,522.01	2.33
6	301308	江波龙	237,488,872.90	2.19
7	603799	华友钴业	215,913,551.85	1.99
8	300919	中伟股份	213,478,860.44	1.97
9	002594	比亚迪	192,268,276.65	1.77
10	000021	深科技	157,422,683.60	1.45
11	000725	京东方 A	156,777,137.00	1.45
12	002460	赣锋锂业	151,637,019.36	1.40
13	002466	天齐锂业	144,634,537.04	1.33
14	000625	长安汽车	142,783,366.94	1.32
15	688005	容百科技	138,777,584.12	1.28
16	002273	水晶光电	137,543,759.75	1.27
17	002138	顺络电子	136,440,874.65	1.26
18	688110	东芯股份	126,551,455.60	1.17
19	300045	华力创通	120,299,335.00	1.11
20	600030	中信证券	119,276,269.99	1.10

注：本表中累计买入金额是按照买入成交金额（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	300750	宁德时代	541,267,298.72	4.99

2	002594	比亚迪	435,162,754.83	4.02
3	002466	天齐锂业	429,940,824.89	3.97
4	002460	赣锋锂业	310,305,705.46	2.86
5	300769	德方纳米	241,846,411.09	2.23
6	603799	华友钴业	235,508,159.95	2.17
7	603986	兆易创新	235,377,813.65	2.17
8	300045	华力创通	227,191,012.19	2.10
9	000625	长安汽车	217,052,840.03	2.00
10	002850	科达利	210,117,953.77	1.94
11	300919	中伟股份	205,302,554.84	1.89
12	600933	爱柯迪	197,361,050.41	1.82
13	603197	保隆科技	190,573,834.48	1.76
14	000021	深科技	181,534,529.07	1.68
15	002906	华阳集团	155,613,026.88	1.44
16	300382	斯莱克	143,624,806.54	1.33
17	600673	东阳光	143,034,434.31	1.32
18	002756	永兴材料	141,690,145.85	1.31
19	603179	新泉股份	139,556,116.15	1.29
20	300679	电连技术	136,020,855.09	1.26

注：本表中累计卖出金额是按照卖出成交金额（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

买入股票的成本（成交）总额	21,594,083,011.39
卖出股票的收入（成交）总额	23,131,568,513.24

注：本表中买入股票成本（成交）总额、卖出股票收入（成交），总额均按照买卖成交金额（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)	6,954,458.33	0.09
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	6,954,458.33	0.09

### 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	127101	豪鹏转债	50,000	5,000,328.77	0.06
2	127100	神码转债	11,552	1,155,283.55	0.01
3	110095	双良转债	4,710	497,112.24	0.01
4	127091	科数转债	2,570	301,733.77	0.00

注：本基金本报告期末仅持有上述债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

**8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

本基金本报告期末未持有权证。

**8.10 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金未参与投资股指期货。

**8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****8.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金未参与投资国债期货。

**8.11.2 本期国债期货投资评价**

本基金未参与投资国债期货。

**8.12 投资组合报告附注****8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。**

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

**8.12.2 本基金投资的前十名股票中，投资超出基金合同规定备选股票库的情形。**

本基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库的情形。

**8.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,000,668.10
2	应收清算款	3,827,842.86

3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	6,042,667.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,871,178.24

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	603659	璞泰来	18,790,080.15	0.23	非公开发行流通受限

#### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

### 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	持有份额	占总份

			比例		额比例
716,044	3,379.09	203,065,299.41	8.39%	2,216,509,354.94	91.61%

### 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	2,281,411.20	0.09%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	>100

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2015年7月31日)基金份额总额	286,697,513.64
本报告期期初基金份额总额	2,856,910,760.65
本报告期基金总申购份额	664,403,063.03
减：本报告期基金总赎回份额	1,101,739,169.33
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,419,574,654.35

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，未召开基金份额持有人大会，未有相关决议。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人经第六届董事会第六次会议决定，自 2023 年 1 月起黄晖女士担任公司督察长兼董事会秘书，徐伟文先生担任公司首席信息官，公司总经理朱永强先生不再兼任首席信息官。第六届董事会第十次会议决定，自 2023 年 3 月起，王咏辉先生离任公司副总经理。2023 年 12 月 15 日通过第六届董事会第十六次会议，黄晖女士不再担任公司董事会秘书，由方敬先生担任公司董事会秘书。2023 年 12 月 15 日通过股东会书面决议，批准了监事 Ken Okamoto 的辞职申请。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门根据工作需要，任命牛环起、施伟为资产托管业务部副总经理。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内，未发生基金投资策略的改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内，本基金管理人继续聘任安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金的外部审计机构。报告期内应支付给会计师事务所的基金审计费用为 150000.00 元。

### 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

无。



## 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

无。

## 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	
渤海证券	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
财通证券	4	88,242,861.30	0.20%	65,820.53	0.17%	新增 2 个
财信证券	2	0.00	0.00%	0.00	0.00%	新增 1 个
川财证券	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
东方财富	2	6,714,624,125.10	15.04%	4,930,617.21	12.79%	-
东方证券	3	983,386,278.74	2.20%	915,865.21	2.38%	-
东海证券	2	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
东吴证券	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
东兴证券	2	341,169,341.02	0.76%	254,478.95	0.66%	-
方正证券	3	1,418,241,782.99	3.18%	1,320,957.79	3.43%	-
光大证券	2	290,030,937.74	0.65%	274,339.06	0.71%	-
广发证券	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
国都证券	1	806,795,573.50	1.81%	590,278.77	1.53%	-
国海证券	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
国金证券	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
国联证券	4	186,067,729.15	0.42%	138,787.87	0.36%	新增 2 个
国盛证券	3	0.00	0.00%	0.00	0.00%	新增 2 个
国泰君安	2	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
国投证券	2	0.00	0.00%	0.00	0.00%	安

							信 证 券 更 名 为 国 投 证 券
国信证券	2	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-	
海通证券	2	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-	
恒泰证券	2	378,898,812.74	0.85%	277,091.33	0.72%	新增 1 个	
红塔证券	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-	
华安证券	3	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-	
华创证券	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-	
华金证券	2	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-	
华泰证券	4	0.00	0.00%	0.00	0.00%	新增 1 个	
华西证券	2	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-	
汇丰前海	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-	
江海证券	2	96,072,889.00	0.22%	71,664.86	0.19%	-	
金元证券	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-	
开源证券	3	0.00	0.00%	0.00	0.00%	新增 2 个	
民生证券	1	2,072,320,546.58	4.64%	1,940,305.23	5.03%	-	
平安证券	1	96,905,307.53	0.22%	90,283.44	0.23%	-	
瑞银证券	2	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-	
山西证券	2	167,454,209.37	0.38%	122,455.07	0.32%	-	
申港证券	3	669,350,382.28	1.50%	499,268.54	1.30%	新增 2 个	
申万宏源	2	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-	
世纪证券	2	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-	
首创证券	1	1,253,398,066.52	2.81%	928,653.62	2.41%	-	
太平洋证 券	4	110,217,418.52	0.25%	80,603.99	0.21%	-	
天风证券	3	521,853,642.60	1.17%	410,150.63	1.06%	-	

五矿证券	2	1,618,454,872.66	3.63%	1,508,246.01	3.91%	-
西部证券	1	285,389,975.76	0.64%	208,706.29	0.54%	-
西南证券	2	246,876,581.75	0.55%	233,523.04	0.61%	-
新时代证券	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
信达证券	5	10,968,593,154.31	24.58%	10,253,220.72	26.60%	-
兴业证券	3	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
野村东方	1	2,164,035,966.81	4.85%	1,591,478.26	4.13%	-
银河证券	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
英大证券	2	0.00	0.00%	0.00	0.00%	新增 2 个
粤开证券	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
长城证券	1	199,433,255.18	0.45%	185,729.14	0.48%	-
长江证券	2	3,869,961,219.56	8.67%	3,620,664.27	9.39%	-
招商证券	2	1,134,005,895.53	2.54%	1,050,141.28	2.72%	-
浙商证券	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
中金财富	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
中金公司	2	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
中山证券	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	新增 1 个
中泰证券	3	936,043,264.37	2.10%	728,959.97	1.89%	新增 1 个
中信建投	2	5,324,461,868.06	11.93%	4,970,120.39	12.89%	-
中信证券	4	1,689,221,615.03	3.78%	1,286,565.97	3.34%	新增 1 个
中信证券 (山东)	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
中银国际	2	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-

注：根据《交易单元及佣金管理办法》、《投资审议委员会议事规则》的规定，交易单元开设、增设或退租由研究咨询部提议，经公司投资审议委员会审议。在分配交易量方面，公司制订合理的评分体系，相关投资研究人员于每个季度最后 20 个工作日对提供研究报告的证券公司的研究水平、服务质量等综合情况通过投研管理系统进行评比打分。交易管理部根据上季度研究服务评分结果安排研究机构交易佣金分配，每季度佣金分配量应与上季度研究服务评分排名基本匹配，并确保券商研究机构年度佣金分配量与全年合计研究服务评分排名基本匹配。

## 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		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
渤海证券	0.00	0.00%	-	-	-	-	-	-
财通证券	0.00	0.00%	-	-	-	-	-	-
财信证券	0.00	0.00%	-	-	-	-	-	-
川财证券	0.00	0.00%	-	-	-	-	-	-
东方财富	8,191,236.73	7.93%	-	-	-	-	-	-
东方证券	0.00	0.00%	-	-	-	-	-	-
东海证券	0.00	0.00%	-	-	-	-	-	-
东吴证券	0.00	0.00%	-	-	-	-	-	-
东兴证券	0.00	0.00%	-	-	-	-	-	-
方正证券	0.00	0.00%	-	-	-	-	-	-
光大证券	0.00	0.00%	-	-	-	-	-	-
广发证券	0.00	0.00%	-	-	-	-	-	-
国都证券	0.00	0.00%	-	-	-	-	-	-
国海证券	0.00	0.00%	-	-	-	-	-	-
国金证券	0.00	0.00%	-	-	-	-	-	-
国联证券	0.00	0.00%	-	-	-	-	-	-

国盛证券	0.00	0.00%	-	-	-	-	-	-
国泰君安	0.00	0.00%	-	-	-	-	-	-
国投证券	0.00	0.00%	-	-	-	-	-	-
国信证券	0.00	0.00%	-	-	-	-	-	-
海通证券	0.00	0.00%	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	0.00	0.00%	-	-	-	-	-	-
红塔证券	0.00	0.00%	-	-	-	-	-	-
华安证券	0.00	0.00%	-	-	-	-	-	-
华创证券	0.00	0.00%	-	-	-	-	-	-
华金证券	0.00	0.00%	-	-	-	-	-	-
华泰证券	0.00	0.00%	-	-	-	-	-	-
华西证券	0.00	0.00%	-	-	-	-	-	-
汇丰前海	0.00	0.00%	-	-	-	-	-	-
江海证券	0.00	0.00%	-	-	-	-	-	-
金元证券	0.00	0.00%	-	-	-	-	-	-
开源证券	0.00	0.00%	-	-	-	-	-	-
民生证券	6,252,892.47	6.05%	-	-	-	-	-	-
平安证券	0.00	0.00%	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	0.00	0.00%	-	-	-	-	-	-
山西证券	0.00	0.00%	-	-	-	-	-	-
申港证券	0.00	0.00%	-	-	-	-	-	-
申万	0.00	0.00%	-	-	-	-	-	-

宏源									
世纪证券	0.00	0.00%	-	-	-	-	-	-	-
首创证券	48,663,456.33	47.09%	-	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	0.00	0.00%	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	0.00	0.00%	-	-	-	-	-	-	-
五矿证券	64,763.06	0.06%	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	0.00	0.00%	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	0.00	0.00%	-	-	-	-	-	-	-
新时代证券	0.00	0.00%	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	19,292.76	0.02%	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	0.00	0.00%	-	-	-	-	-	-	-
野村东方	0.00	0.00%	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	0.00	0.00%	-	-	-	-	-	-	-
英大证券	0.00	0.00%	-	-	-	-	-	-	-
粤开证券	0.00	0.00%	-	-	-	-	-	-	-
长城证券	0.00	0.00%	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	0.00	0.00%	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	0.00	0.00%	-	-	-	-	-	-	-
浙商证券	0.00	0.00%	-	-	-	-	-	-	-
中金财富	0.00	0.00%	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	0.00	0.00%	-	-	-	-	-	-	-

中山证券	0.00	0.00%	-	-	-	-	-	-
中泰证券	0.00	0.00%	-	-	-	-	-	-
中信建投	0.00	0.00%	-	-	-	-	-	-
中信证券	40,157,781.13	38.86%	-	-	-	-	-	-
中信证券(山东)	0.00	0.00%	-	-	-	-	-	-
中银国际	0.00	0.00%	-	-	-	-	-	-

### 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	信达澳亚基金管理有限公司关于提醒投资者谨防虚假客服电话诈骗的提示性公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2023-01-10
2	信达澳亚基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2023-01-14
3	信澳新能源产业股票型证券投资基金 2022 年第四季度报告	证监会信息披露网站、公司网站	2023-01-18
4	信达澳亚基金管理有限公司关于对个人投资者通过超级现金宝交易实施费率优惠的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2023-02-15
5	信达澳亚基金管理有限公司关于旗下部分基金投资非公开发行股票的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2023-02-15

6	信达澳亚基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2023-03-25
7	信澳新能源产业股票型证券投资基金 2022 年年度报告	证监会信息披露网站、公司网站	2023-03-29
8	信达澳亚基金管理有限公司关于对个人投资者通过直销网上交易汇款交易业务实施费率优惠的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2023-04-18
9	信澳新能源产业股票型证券投资基金 2023 年第一季度报告	证监会信息披露网站、公司网站	2023-04-20
10	信达澳亚基金管理有限公司关于提醒客户及时更新身份证件及非自然人客户及时登记受益所有人信息的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2023-06-21
11	信澳新能源产业股票型证券投资基金 2023 年第二季度报告	证监会信息披露网站、公司网站	2023-07-20
12	信达澳亚基金管理有限公司关于旗下基金可投资北京证券交易所股票的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2023-08-11
13	信达澳亚基金管理有限公司关于旗下部分基金投资非公开发行股票的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2023-08-21
14	信达澳亚基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修改基金合同等法律文件的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2023-08-31
15	信澳新能源产业股票型证券投资基金 2023 年中期报告	证监会信息披露网站、公司网站	2023-08-31
16	信达澳亚基金管理有限公司关于调低旗下部分基	证监会指定信	2023-09-04



	金费率并修改基金合同等法律文件的公告	息披露报纸、 证监会信息披露网站、公司网站	
17	信澳新能源产业股票型证券投资基金 2023 年第三季度报告	证监会信息披露网站、公司网站	2023-10-25
18	信达澳亚基金管理有限公司关于旗下部分基金投资非公开发行股票的公告	证监会指定信息披露报纸、 证监会信息披露网站、公司网站	2023-11-14
19	信达澳亚基金管理有限公司关于谨防不法分子假冒“信达澳亚”名义进行非法活动的声明	证监会指定信息披露报纸、 证监会信息披露网站、公司网站	2023-11-23
20	信达澳亚基金管理有限公司关于旗下部分基金投资非公开发行股票的公告	证监会指定信息披露报纸、 证监会信息披露网站、公司网站	2023-11-24
21	信澳新能源产业股票型证券投资基金基金产品资料概要更新	证监会信息披露网站、公司网站	2023-12-07
22	信澳新能源产业股票型证券投资基金招募说明书更新	证监会信息披露网站、公司网站	2023-12-07
23	信达澳亚基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修改基金合同等法律文件的公告	证监会指定信息披露报纸、 证监会信息披露网站、公司网站	2023-12-14
24	信达澳亚基金管理有限公司关于旗下部分基金投资非公开发行股票的公告	证监会指定信息披露报纸、 证监会信息披露网站、公司网站	2023-12-27
25	信达澳亚基金管理有限公司关于旗下部分基金投资非公开发行股票的公告	证监会指定信息披露报纸、 证监会信息披露网站、公司网站	2023-12-29

26	信达澳亚基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修改基金合同等法律文件的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2023-12-29
27	信澳新能源产业股票型证券投资基金基金产品资料概要更新	证监会信息披露网站、公司网站	2023-12-30
28	信澳新能源产业股票型证券投资基金基金合同更新	证监会信息披露网站、公司网站	2023-12-30
29	信澳新能源产业股票型证券投资基金托管协议更新	证监会信息披露网站、公司网站	2023-12-30
30	信澳新能源产业股票型证券投资基金招募说明书更新	证监会信息披露网站、公司网站	2023-12-30

## §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

报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、《信澳新能源产业股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《信澳新能源产业股票型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；
- 7、本报告期内公开披露的基金资产净值、基金份额净值及其他临时公告；
- 8、中国证监会要求的其他文件。

### 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/或基金托管人的办公场所、营业场所及网站免费查阅备查文件。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。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人。

客户服务中心电话：400-8888-118

网址：[www.fscinda.com](http://www.fscinda.com)

信达澳亚基金管理有限公司

二〇二四年三月二十九日