

# 中欧量化驱动混合型证券投资基金 2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：中欧基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2024 年 3 月 29 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 03 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。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<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>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
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	10
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
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	13
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>14</b>
6.1 审计报告基本信息	14
6.2 审计报告的基本内容	14
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>16</b>
7.1 资产负债表	16
7.2 利润表	17
7.3 净资产变动表	19
7.4 报表附注	20
<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 报告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 .....	84
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	86
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 .....	87
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 .....	87
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 .....	87
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 .....	87
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	87
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	87
8.12 投资组合报告附注 .....	87
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>88</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	88
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	88
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情况 .....	88
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况 .....	88
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>89</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>89</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	89
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 .....	89
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	89
11.4 基金投资策略的改变 .....	89
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	89
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 .....	90
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	90
11.8 其他重大事件 .....	93
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>95</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 .....	95
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	95
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>95</b>
13.1 备查文件目录 .....	95
13.2 存放地点 .....	95
13.3 查阅方式 .....	95

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中欧量化驱动混合型证券投资基金
基金简称	中欧量化驱动混合
基金主代码	001980
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 5 月 16 日
基金管理人	中欧基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,833,498,203.78 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争获得超越业绩比较基准的收益。
投资策略	根据本基金的投资目标、投资理念和投资范围，采用战术型资产配置策略。即不断评估各类资产的风险收益状况，以调整投资组合中的大类资产配置，从变化的市场条件中获利，并强调通过自上而下的宏观分析与自下而上的市场趋势分析有机结合进行前瞻性的决策。
业绩比较基准	中证全指指数收益率*80%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*5%+银行活期存款利率（税后）*15%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金还可投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

### 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	中欧基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	黎忆海
	联系电话	021-68609600
	电子邮箱	liyihai@zofund.com
客户服务电话	021-68609700、400-700-9700	95588
传真	021-33830351	(010) 66105798
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 8 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号上海中心大厦 8、10、16 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	200120	100140
法定代表人	窦玉明	陈四清

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.zofund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人的办公场所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层
注册登记机构	中欧基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路479号上海中心大厦8、10、16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	-413,043,649.18	-558,471,706.02	82,161,599.27
本期利润	-356,033,670.21	-687,366,670.46	74,434,909.82
加权平均基金份额本期利润	-0.1209	-0.4803	0.1045
本期加权平均净值利润率	-10.29%	-30.66%	5.58%
本期基金份额净值增长率	-10.76%	-21.81%	33.37%
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	117,258,900.06	666,644,301.91	1,209,835,045.97
期末可供分配基金份额利润	0.0640	0.1923	0.8997
期末基金资产净值	1,950,757,103.84	4,133,289,234.93	2,554,554,068.61
期末基金份额净值	1.0640	1.1923	1.8997
3.1.3 累	2023 年末	2022 年末	2021 年末

计期末指标			
基金份额累计净值增长率	32.55%	48.53%	89.97%

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。

2、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3、上述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

## 3.2 基金净值表现

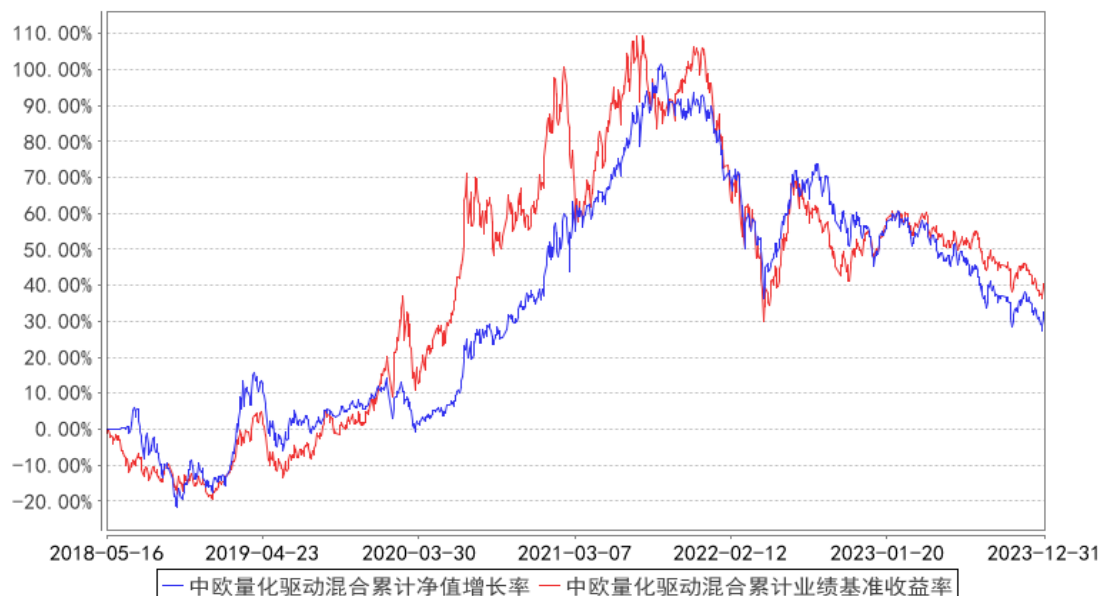
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-3.38%	0.83%	-3.66%	0.70%	0.28%	0.13%
过去六个月	-11.24%	0.84%	-7.75%	0.72%	-3.49%	0.12%
过去一年	-10.76%	0.81%	-6.13%	0.69%	-4.63%	0.12%
过去三年	-6.94%	1.11%	-20.04%	1.37%	13.10%	-0.26%
过去五年	57.46%	1.17%	71.97%	1.48%	-14.51%	-0.31%
自基金合同生效起至今	32.55%	1.21%	40.35%	1.45%	-7.80%	-0.24%

注：本基金业绩比较基准为：中证全指指数收益率\*80%+银行活期存款利率(税后)\*15%+中证港股通综合指数(人民币)收益率\*5%。比较基准每个交易日进行一次再平衡，每个交易日在加入损益后根据设定的权重比例进行大类资产之间的再平衡，使大类资产比例保持恒定。

### 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

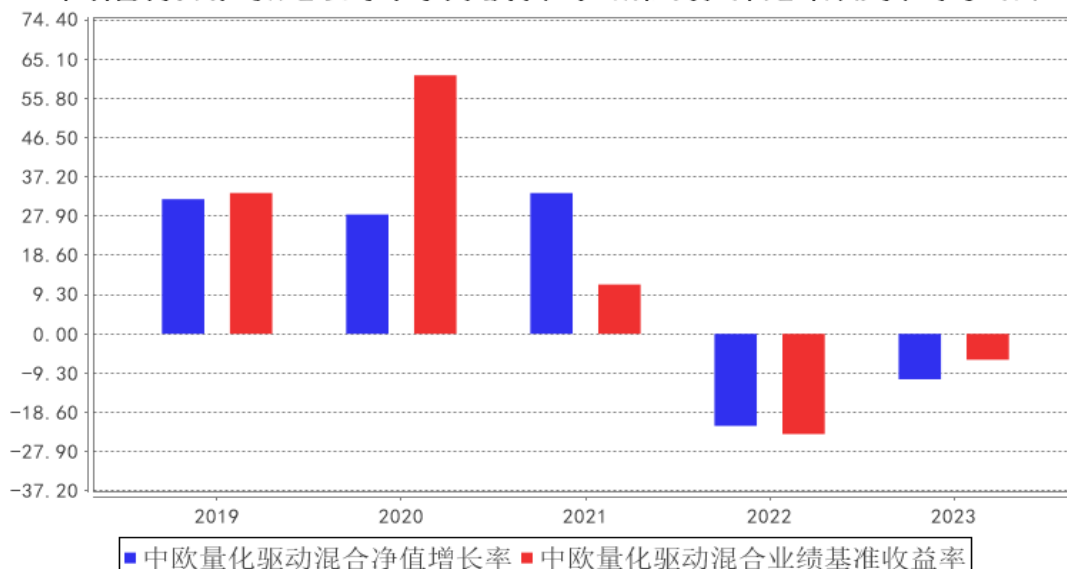
中欧量化驱动混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注:2019年4月26日,组合业绩比较基准变更为创业板指数收益率\*95%+中债综合指数收益率\*5%。  
2022年8月11日,业绩比较基准变更为中证全指指数收益率\*80%+银行活期存款利率(税后)\*15%+中证港股通综合指数(人民币)收益率\*5%。

### 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

中欧量化驱动混合基金每年净值增长率与同期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

单位:人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2019					
2020					
2021					
2022					
2023					



2022	3.0000	843,451,876.05	175,199,259.00	1,018,651,135.05	-
合计	3.0000	843,451,876.05	175,199,259.00	1,018,651,135.05	-

## § 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

中欧基金管理有限公司经中国证监会（证监基字[2006]102 号文）批准，于 2006 年 7 月 19 日正式成立。股东为 WP Asia Pacific Asset Management LLC（华平亚太资产管理有限公司）、国都证券股份有限公司、上海睦亿投资管理合伙企业（有限合伙）、上海穆延投资管理合伙企业（有限合伙）及自然人股东，注册资本为 2.20 亿元人民币，旗下设有北京分公司、深圳分公司、中欧盛世资产管理（上海）有限公司、上海中欧财富基金销售有限公司和中欧基金国际有限公司。截至 2023 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 165 只开放式基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
曲径	量化投资总监 / 基金经理 / 投资经理	2018-05-16	-	16 年	历任千禧年基金量化基金经理，中信证券股份有限公司另类投资业务线高级副总裁。2015-04-01 加入中欧基金管理有限公司。

注：1、任职日期和离任日期一般情况下指公司作出决定之日；若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从《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》等相关规定。

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

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
曲径	公募基金	8	4,252,875,183.55	2016-01-13
	私募资产管理计划	1	159,488,215.97	2021-12-22
	其他组合	-	-	-
	合计	9	4,412,363,399.52	-

注：1、“任职时间”为首次开始管理上表中本类产品的时间。

2、本报告期内兼任私募资产管理计划投资人员有产品离任情况，曲径离任产品情况：

①产品类型：公募，离任数量：1 只，离任时间：2023-04-21；

②产品类型：私募资产管理计划，离任数量：1 只，离任时间：2023-09-27。

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

基金经理薪酬激励与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

本报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，无违法违规、未履行基金合同承诺或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

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规，本基金管理人制定了《公平交易管理办法》，建立了健全、有效的公平交易制度体系，覆盖公司旗下各类资产组合及投资顾问业务涉及的投资组合；涵盖了股票、债券等各类投资品种的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动；贯穿了研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动的各个环节，以确保公司旗下管理的不同投资组合得到公平对待，保护投资者合法权益。具体控制措施包括：在研究分析环节，研究成果与全体投资人员共享，投研体系职权划明确且互不干预，各基金持仓及交易信息进行有效隔离；在投资决策环节，基金经理公平对待管理的所有组合，相同投资策略同时同价下达投资指令；在交易执行环节，本基金管理人以系统控制和人工控制相结合的方式，严格管理同向交易和反向交易，公平执行投资指令；在事后监控环节，本基金管理人设置每日异常交易分析机制，发现异常事项对基金经理进行提示，留存解释说明，并每季度编制公平交易分析报告，逐级审核签署备查。

##### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格按照相关法规及制度等规定，从研究分析、投资决策、交易执行、事后监控等环节严格把关，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行。

对于同向交易，本基金管理人采集连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内）不同投资组合的同向交易计算交易价差，并结合同向交易占比、溢价率等进行综合分析，来判断是否可能存在组合之间利益输送。

综合而言，本报告期内，公平交易制度和控制方法总体执行情况良好，不同投资组合之间不存在非公平交易或利益输送的情况。

#### 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

对于涉及基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的组合，本基金管理人按照《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》及公司内部相关制度等规定，特别地增加检查程序，将反向交易和同向交易的检查时间窗延长至 10 个交易日，并结合成交顺序、价格偏差、产品规模、成交量等因素对是否存在不公平对待的情形进行分析。综合而言，本报告期内，公平交易制度和控制方法总体执行情况良好，涉及兼任的基金经理管理的多个组合间不存在非公平交易或利益输送的情况。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司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 121 次，为量化策略组合因投资策略需要发生的反向交易，公司内部风控对上述交易均履行相应控制程序。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

### 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

回顾 2023 年，市场指数呈现出先扬后抑的走势，同时市场风格的结构分化较大，上半年以通信、传媒、计算机为代表的 TMT 行业受益于全球 AI 技术爆发的催化，下半年高分红和价值风格具有相对收益，市场指数回调到历史估值的低位区间。但我们相信“均值回归”的规律依然存在。从 A 股的估值水平来看，无论是市盈率还是市净率，都在比较低位的区间。经济周期是驱动市场周期的内在动力，工业增加值和工业企业利润同比增速的拐点或已在 2023 年出现，同时，上市公司的盈利拐点（用整体法计算的净利润同比增速的拐点）也有望在 2023 年第 4 季度的财报中确认。其次，市场的情绪周期也在低位。投资者情绪就像钟摆，引发市场的估值从过高到过低两个端点来回摆动。每当钟摆接近极端点的时候，极度悲观或者乐观的情绪无以为继，钟摆的运动方向发生反转。此时的市场上，风险规避类的投资策略占优，对公司业绩预期过于谨慎，而周期反转的力量也蕴含其中，可以更加乐观起来。我国的经济发展处于新旧产业逐步切换的过程中，在新能源、新材料、智能制造等产业链各环节中，有许多细分赛道存在国产或者渗透率提升的投资机会。当前，优质公司的基本面投资的安全边际更加坚实，展望未来，我们对权益市场保有信心。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，基金份额净值增长率为-10.76%，同期业绩比较基准收益率为-6.13%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我国的经济发展处于新旧产业逐步切换的过程中，在新能源、新材料、智能制造等产业链各

环节中，有许多细分赛道存在国产或者渗透率提升的投资机会，经济整体处于向好趋势中。展望 2024 年初，新增社融符合市场预期，政府债融资同比明显改善。2024 年全国 GDP 目标增速或在 5%左右。在稳增长目标下，相信“三大工程”政策的持续推出，将对经济形成有效助力。证券市场方面，促进资本市场平稳健康发展政策频出，一方面是强调宏观政策取向一致性，加强了协调配合。二是推动中长期资金入市。三是提高上市公司质量和投资价值。同时，整体 A 股已经调整较长周期，优质公司的估值安全边际更加坚实，我们对权益市场保有信心。

在报告期内，我们以偏股混合型基金的量化特征作为抓手，保持了分散的持仓、均衡的行业配置，整体表现为中大盘的成长风格。我们遵循基本面逻辑驱动叠加数据赋能的投资方式，以企业未来一个季度到一年的业绩为抓手，以提高对行业和个股判断的前瞻性。2023 年很多基本面驱动的模式，与技术指标量化相比，超额收益都不甚理想。我们必须承认，任何一种寻找 Alpha 方式，都有顺风或逆风的市场环境。我们认为，如果盲目追求短期最强势的量化风格，往往难以避免过度拥挤。常识来看，任何一种短期看起来完美的策略，必然承担着某种未暴露的风险。我们将潜心专注在自己擅长的领域，通过基本面模型，相信优秀企业的利润增长，终会体现在股价上，力争创造长期合理的超额回报。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2023 年，在公司业务全面发展的背景下，公司始终坚持保障基金份额持有人利益的原则，不断强化内部控制，并有效地组织开展监察稽核工作，具体包括以下方面：

##### （一）落实法律法规，培养合规文化

2023 年，监管机构相继颁布了一系列法律法规，公司在收到相关法规后以公众号“新规速递”的方式及时向部门和员工进行推送。监察稽核部负责将新颁布的法律法规及时维护至公司共享法律法规库，并以每周新规跟踪的形式，针对法律法规进行全员范围内的解读，对于重要法规或通知，公司从制度建立、流程改造、系统更新等方面安排专项落地与跟进，并配套相应检查。同时，公司致力于积极推动公司合规文化建设，通过法规培训、监管案例速递、员工合规测试、合规宣传月等多种形式，提高员工合规及风控意识，公司内部控制和风险管理基础得到夯实和优化。

##### （二）完善制度体系，提高运作效率

2023 年，公司根据业务需要及新近出台或修订的法律法规，对规章制度体系进行了进一步完善，在兼顾合规、风险管理和效率的前提下，对一系列规章制度进行了补充和修订，以使得各项业务运作更为规范、顺畅和高效：公司全年制订或修订多项制度流程，内容涵盖投资研究交易、基金运作、合规管理、信息技术等各项内容。

##### （三）加强内部审计，强化风险管理

2023 年，公司按照年初制定的监察稽核年度计划，进一步加强合规及内部稽核审计力度，全年除有序完成监管要求的法定审计工作及常规定期审计工作外，针对易发生风险的各类业务循环开展多次专项稽核工作，使业务中存在的问题能够得到及时发现和纠正。通过内部稽核审计工作，切实保证基金运作和公司经营所涉及的各个环节均能按照各项法律法规和公司内部制度有效落实。

#### （四）提升反洗钱管理水平，推进反洗钱系统建设

2023 年，公司严格参照法律法规的要求落实公司反洗钱管理，优化反洗钱和制裁风险管控的治理架构和管理体系，从制度流程、培训宣传、风险评估等层面，进一步提升和完善反洗钱管理工作。公司在今年牵头各部门完成反洗钱自查工作，并积极推进反洗钱新一代系统建设，结合最新的监管要求及业务发展需要，开发和完善了反洗钱系统各功能模块，从客户洗钱风险评估、客户尽职调查、可疑交易监测及分析等方面实现反洗钱工作系统化建设。

### 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，本基金管理人严格按照本公司制订的《估值委员会议事规则》以及相关法律法规的规定，有效地控制基金估值流程。公司估值委员会主席为总经理，投票成员包括主席、权益及固定收益研究总监、基金运营总监、监察稽核总监、风险管理总监，非投票成员（列席表达相关意见）包括公司高管、投资组合经理、中央交易室负责人、战略规划及业务发展部负责人、主席指定的其他相关人士。估值委员会负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允、合理，防止估值被歪曲而对基金持有人产生不利影响。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。

本基金管理人按照最新的估值准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金投资品种进行估值。具体估值流程为：基金日常估值由基金管理人进行，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以 XBRL 形式报给基金托管人，基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人，由基金管理人依据本基金合同和有关法律法规的规定予以公布。报告期内相关基金估值政策的变更由托管银行进行复核确认。

上述参与估值流程人员均具有估值业务所需的专业胜任能力及相关工作经验。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

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

本报告期内基金管理人无应说明预警信息。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期内，中欧量化驱动混合型证券投资基金的管理人——中欧基金管理有限公司在中欧量化驱动混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

#### 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

本托管人依法对中欧基金管理有限公司编制和披露的中欧量化驱动混合型证券投资基金 2023 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

### § 6 审计报告

#### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2024）审字第 70028871_B33 号

#### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	中欧量化驱动混合型证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	我们审计了中欧量化驱动混合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（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附的中欧量化驱动混合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，公允反映了中欧量化驱动混合型证券投资基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净值变动情况。
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，我们独立于中欧量化驱动混合型证券投资基金，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。
强调事项	不适用
其他事项	不适用
其他信息	<p>中欧量化驱动混合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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>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。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估中欧量化驱动混合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。</p> <p>治理层负责监督中欧量化驱动混合型证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>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。</p> <p>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：</p> <p>（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。</p> <p>（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。</p> <p>（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。</p> <p>（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，</p>

	<p>根据获取的审计证据，就可能导致对中欧量化驱动混合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中欧量化驱动混合型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(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。</p> <p>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。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	陈露   张亚旋
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层
审计报告日期	2024年3月28日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：中欧量化驱动混合型证券投资基金

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	13,816,470.69	326,310,487.07
结算备付金		19,771,463.06	189,546,111.09
存出保证金		884,603.28	14,509,698.89
交易性金融资产	7.4.7.2	1,923,559,412.48	3,628,108,258.94
其中：股票投资		1,826,191,332.48	3,493,433,588.20
基金投资		-	-
债券投资		97,368,080.00	134,674,670.74
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	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-



其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		3,178,678.72	6,240,582.37
应收股利		191,735.42	-
应收申购款		299,715.95	838,867.93
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		1,961,702,079.60	4,165,554,006.29
<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		2,915,403.93	10,539,224.13
应付赎回款		267,902.82	378,061.62
应付管理人报酬		2,326,435.36	4,955,651.98
应付托管费		387,739.24	825,942.02
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	5,047,494.41	15,565,891.61
负债合计		10,944,975.76	32,264,771.36
<b>净资产:</b>			
实收基金	7.4.7.7	1,833,498,203.78	3,466,644,933.02
未分配利润	7.4.7.8	117,258,900.06	666,644,301.91
净资产合计		1,950,757,103.84	4,133,289,234.93
负债和净资产总计		1,961,702,079.60	4,165,554,006.29

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额总额 1,833,498,203.78 份，基金份额净值为人民币 1.0640 元。

## 7.2 利润表

会计主体：中欧量化驱动混合型证券投资基金

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
一、营业总收入		-307,087,632.42	-656,245,347.11

1. 利息收入		4,828,640.86	2,820,961.30
其中：存款利息收入	7.4.7.9	2,283,053.60	1,789,725.95
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		2,545,587.26	1,031,235.35
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-371,526,805.84	-534,575,757.09
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-393,082,995.29	-543,771,959.93
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	2,321,345.00	340,661.26
资产支持证券投资	7.4.7.12	-	-
收益			
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.13	-16,653,907.92	-6,756,309.68
股利收益	7.4.7.14	35,888,752.37	15,611,851.26
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	57,009,978.97	-128,894,964.44
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	2,600,553.59	4,404,413.12
<b>减：二、营业总支出</b>		48,946,037.79	31,121,323.35
1. 管理人报酬		41,736,942.03	26,441,127.43
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费		6,956,157.01	4,406,854.48
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		6,026.32	-
其中：卖出回购金融资产支出		6,026.32	-
6. 信用减值损失	7.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		12,336.43	16,072.08
8. 其他费用	7.4.7.18	234,576.00	257,269.36
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-356,033,670.21	-687,366,670.46
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-356,033,670.21	-687,366,670.46
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-

六、综合收益总额		-356,033,670.21	-687,366,670.46
----------	--	-----------------	-----------------

### 7.3 净资产变动表

会计主体：中欧量化驱动混合型证券投资基金

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	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	3,466,644,933.02	-	666,644,301.91	4,133,289,234.93
二、本期期初净资产	3,466,644,933.02	-	666,644,301.91	4,133,289,234.93
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-1,633,146,729.24	-	-549,385,401.85	-2,182,532,131.09
(一)、综合收益总额	-	-	-356,033,670.21	-356,033,670.21
(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)	-1,633,146,729.24	-	-193,351,731.64	-1,826,498,460.88
其中：1. 基金申购款	262,630,888.44	-	58,370,067.42	321,000,955.86
2. 基金赎回款	-1,895,777,617.68	-	-251,721,799.06	-2,147,499,416.74
(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	1,833,498,203.78	-	117,258,900.06	1,950,757,103.84
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	其他综合收益	未分配利润	净资产合计

一、上期期末净资产	1,344,719,022.64	-	1,209,835,045.97	2,554,554,068.61
二、本期期初净资产	1,344,719,022.64	-	1,209,835,045.97	2,554,554,068.61
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	2,121,925,910.38	-	-543,190,744.06	1,578,735,166.32
(一)、综合收益总额	-	-	-687,366,670.46	-687,366,670.46
(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)	2,121,925,910.38	-	1,162,827,061.45	3,284,752,971.83
其中：1. 基金申购款	3,294,091,646.53	-	1,875,349,365.73	5,169,441,012.26
2. 基金赎回款	-1,172,165,736.15	-	-712,522,304.28	-1,884,688,040.43
(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)	-	-	-1,018,651,135.05	-1,018,651,135.05
四、本期期末净资产	3,466,644,933.02	-	666,644,301.91	4,133,289,234.93

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：

刘建平

基金管理人负责人

杨毅

主管会计工作负责人

王音然

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

中欧量化驱动混合型证券投资基金（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]2366 号文《关于准予中欧中证银联智策大数据 100 指数型证券投资基金注册的批复》及[2017]1519 号文《关于准予中欧中证银联智策大数据 100 指数型证券投资基金变更注册的批复》(准予中欧中证银联智策大数据 100 指数型证券投资基金变更注册为中欧量化驱动混合型证券投资基金)核准,由中欧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《中欧量化驱动混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 244,603,768.62 元,业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2018)验字第 61336106\_B08 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《中欧量化驱动混合型证券投资基金基金合同》于 2018 年 5 月 16 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 244,633,211.97 份基金份额,其中包含认购利息折合 29,443.35 份基金份额。本基金的基金管理人与注册登记机构均为中欧基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧量化驱动混合型证券投资基金基金合同》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、存托凭证以及其他经中国证监会批准发行上市的股票)、港股通标的股票、国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债的纯债部分、央行票据、中期票据、短期融资券(含超短期融资券)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、现金、股指期货、股票期权、国债期货、货币市场工具以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具(但需符合中国证监会的相关规定)。

本基金投资组合中:本基金股票投资占基金资产的比例为 60% - 95%,投资于港股通标的股票投资比例不超过全部股票资产的 50%;每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后,现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。

本基金的业绩比较基准为:中证全指指数收益率 $\times$ 80%+中证港股通综合指数(人民币)收益率 $\times$ 5%+银行活期存款利率(税后) $\times$ 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

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

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

##### 7.4.4.2 记账本位币

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

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

###### （1）金融资产分类

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

###### （2）金融负债分类

除由于金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债以外，本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

##### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。

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

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

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

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

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

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

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

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按

照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

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

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

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

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

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



(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

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

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

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

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

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

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

(7) 其他收入在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) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者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；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(2) 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；

(3) 每一基金份额享有同等分配权；

(4) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

#### 7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

### 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

#### 7.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

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

#### 7.4.6.2 增值税

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

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规

定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

#### 7.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

#### 7.4.6.4 企业所得税

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

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

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

#### 7.4.6.5 个人所得税

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

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

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

持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

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

#### 7.4.6.6 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

### 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	13,816,470.69	326,310,487.07
等于：本金	13,812,469.16	326,273,353.31
加：应计利息	4,001.53	37,133.76
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	13,816,470.69	326,310,487.07

#### 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		1,887,892,499.48	-	1,826,191,332.48	-61,701,167.00
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	15,594,046.00	66,844.93	15,701,164.93	40,274.00
	银行间市场	80,026,480.00	1,626,915.07	81,666,915.07	13,520.00
	合计	95,620,526.00	1,693,760.00	97,368,080.00	53,794.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,983,513,025.48	1,693,760.00	1,923,559,412.48	-61,647,373.00
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		3,612,277,423.17	-	3,493,433,588.20	-118,843,834.97
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	132,769,377.00	1,895,470.74	134,674,670.74	9,823.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	132,769,377.00	1,895,470.74	134,674,670.74	9,823.00
资产支持证券		0.00	0.00	-	0.00
基金		0.00	-	0.00	0.00
其他		0.00	0.00	-	0.00
合计		3,745,046,800.17	1,895,470.74	3,628,108,258.94	-118,834,011.97

#### 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	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-

项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	96,050,300.00	-	-	-
—股指期货	96,050,300.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	96,050,300.00	-	-	-

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为人民币 0 元。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货投资产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指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人民币 0 元。

#### 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	608.23	502.92
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	4,966,886.18	15,365,388.69
其中：交易所市场	4,966,886.18	15,365,388.69
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用-审计费	80,000.00	80,000.00
预提费用-信息披露费	-	120,000.00
合计	5,047,494.41	15,565,891.61

## 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	3,466,644,933.02	3,466,644,933.02
本期申购	262,630,888.44	262,630,888.44
本期赎回（以“-”号填列）	-1,895,777,617.68	-1,895,777,617.68
本期末	1,833,498,203.78	1,833,498,203.78

注：申购份额含红利再投、转换入份额，赎回份额含转换出份额。

## 7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,152,858,344.71	-1,486,214,042.80	666,644,301.91
本期期初	2,152,858,344.71	-1,486,214,042.80	666,644,301.91
本期利润	-413,043,649.18	57,009,978.97	-356,033,670.21
本期基金份额交易产生的变动数	-865,172,351.05	671,820,619.41	-193,351,731.64
其中：基金申购款	161,153,329.32	-102,783,261.90	58,370,067.42
金赎回款	-1,026,325,680.37	774,603,881.31	-251,721,799.06
本期已分配利润	-	-	-
本期末	874,642,344.48	-757,383,444.42	117,258,900.06

## 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	884,389.80	933,798.22
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	1,373,981.40	841,929.02
其他	24,682.40	13,998.71
合计	2,283,053.60	1,789,725.95

#### 7.4.7.10 股票投资收益

##### 7.4.7.10.1 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	31,961,488,412.94	19,550,352,207.49
减：卖出股票成本总额	32,279,650,283.83	20,040,937,396.93
减：交易费用	74,921,124.40	53,186,770.49
买卖股票差价收入	-393,082,995.29	-543,771,959.93

#### 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	2,291,072.00	340,661.26
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	30,273.00	-
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	2,321,345.00	340,661.26

## 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	135,625,940.00	-
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	132,769,377.00	-
减：应计利息总额	2,825,940.00	-
减：交易费用	350.00	-
买卖债券差价收入	30,273.00	-

## 7.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

## 7.4.7.13 衍生工具收益

## 7.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 7.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 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	-16,653,907.92	-6,756,309.68

## 7.4.7.14 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	35,888,752.37	15,611,851.26
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	35,888,752.37	15,611,851.26

## 7.4.7.15 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	57,186,638.97	-129,071,624.44
股票投资	57,142,667.97	-129,081,447.44
债券投资	43,971.00	9,823.00
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-176,660.00	176,660.00
权证投资	-	-
期货投资	-176,660.00	176,660.00
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值 变动产生的预估增值税	-	-
合计	57,009,978.97	-128,894,964.44

#### 7.4.7.16 其他收入

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
基金赎回费收入	2,287,479.54	3,458,111.98
基金转换费收入	313,074.05	946,301.14
合计	2,600,553.59	4,404,413.12

#### 7.4.7.17 信用减值损失

无。

#### 7.4.7.18 其他费用

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
审计费用	80,000.00	80,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	3,205.53	1,992.34
账户维护费	18,000.00	3,000.00
其他	-	50,000.00
证券组合费	13,370.47	2,277.02
合计	234,576.00	257,269.36

## 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，本基金并无须作披露的或有事项。

### 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，本基金并无须作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
中欧基金管理有限公司（“中欧基金”）	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	基金托管人、基金销售机构
国都证券股份有限公司（“国都证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
WP Asia Pacific Asset Management LLC（“华平亚太资管”）	基金管理人的股东（自 2023 年 6 月 1 日起）
Unione di Banche Italiane S.p.a（“意大利意联银行”）	基金管理人的股东（截止至 2023 年 5 月 31 日）
上海穆延投资管理合伙企业（有限合伙）（“上海穆延合伙”）	基金管理人的股东（自 2023 年 5 月 11 日起）
万盛基业投资有限责任公司（“万盛基业”）	基金管理人的股东（截止至 2023 年 5 月 10 日）
上海睦亿投资管理合伙企业（有限合伙）（“上海睦亿合伙”）	基金管理人股东
自然人股东	基金管理人股东
上海中欧财富基金销售有限公司（“中欧财富”）	基金管理人的控股子公司、基金销售机构
中欧盛世资产管理（上海）有限公司（“中欧盛世资管”）	基金管理人的全资子公司
中欧基金国际有限公司（“中欧基金国际”）	基金管理人的全资子公司

注：1、自 2023 年 5 月 11 日起，万盛基业投资有限责任公司不再是我司关联方，新增关联方为上海穆延投资管理合伙企业（有限合伙）及 7 名自然人股东。

2、自 2023 年 6 月 1 日起，Unione di Banche Italiane S.p.A. 不再是我司关联方，新增关联方为 WP Asia Pacific Asset Management LLC（华平亚太资产管理有限公司）。

3、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	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

	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 (%)
国都证券	2,648,666,899.39	4.24	5,835,867,439.88	14.24

#### 7.4.10.1.2 债券交易

无。

#### 7.4.10.1.3 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 (%)
国都证券	1,100,000,000.00	3.91	3,872,300,000.00	47.84

#### 7.4.10.1.4 权证交易

无。

#### 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 (%)
国都证券	1,924,192.14	4.65	-	-
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 (%)
国都证券	4,242,686.84	14.20	3,278,447.86	21.34

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，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	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
当期发生的基金应支付的管理费	41,736,942.03	26,441,127.43
其中：应支付销售机构的客户维护费	4,524,451.18	3,386,800.10
应支付基金管理人的净管理费	37,212,490.85	23,054,327.33

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.20%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 2 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 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	6,956,157.01	4,406,854.48

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 2 个工作日内、按照指定的账户路径进行支取，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 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

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

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

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

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

本报告期及上年度可比期间，基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2023年12月31日		上年度末 2022年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例
中欧财富	119,795.72	0.01%	28,932.96	0.00%
自然人股东	42,150.06	0.00%	38,888.28	0.00%

注：1、本报告期及上年度可比期间，除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的适用费率符合本基金招募说明书和相关公告的规定。

2、截至本报告期末，关联方自然人股东持有本基金份额的比例为 0.0023%，上表展示的比例是四舍五入后的结果；截至上年度可比期末，关联方上海中欧财富基金销售有限公司持有本基金份额的比例为 0.0008%，关联方自然人股东持有本基金份额的比例为 0.0011%，上表展示的比例是四舍五入后的结果。

#### 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
中国工商银行股份有限公司	13,816,470.69	884,389.80	326,310,487.07	933,798.22

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，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

无。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

## 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内不存在利润分配情况。

## 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
001239	永达股份	2023年12月4日	6个月	新股流通受限	12.05	19.92	189	2,277.45	3,764.88	-
001306	夏厦精密	2023年11月9日	6个月	新股流通受限	53.63	75.36	64	3,432.32	4,823.04	-
001358	兴欣新材	2023年12月14日	6个月	新股流通受限	41.00	44.16	87	3,567.00	3,841.92	-
001378	德冠新材	2023年10月23日	6个月	新股流通受限	31.68	31.27	205	6,494.40	6,410.35	-
300904	威力传动	2023年8月2日	6个月	新股流通受限	35.41	61.53	304	10,764.64	18,705.12	-
301172	君逸数码	2023年7月19日	6个月	新股流通受限	31.33	38.16	438	13,722.54	16,714.08	-
301202	朗威股份	2023年6月28日	6个月	新股流通受限	25.82	31.80	306	7,900.92	9,730.80	-
301210	金杨股份	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	57.88	45.48	281	16,264.28	12,779.88	-
301251	威	2023	6个月	新股	28.88	34.59	321	9,270.48	11,103.39	-



	尔高	年8月30日		流通受限						
301261	恒工精密	2023年6月29日	6个月	新股流通受限	36.90	50.85	198	7,306.20	10,068.30	-
301272	英华特	2023年7月6日	6个月	新股流通受限	51.39	53.38	173	8,890.47	9,234.74	-
301292	海科新源	2023年6月29日	6个月	新股流通受限	19.99	19.35	583	11,654.17	11,281.05	-
301329	信音电子	2023年7月5日	6个月	新股流通受限	21.00	22.23	458	9,618.00	10,181.34	-
301348	蓝箭电子	2023年8月1日	6个月	新股流通受限	18.08	44.57	613	11,083.04	27,321.41	-
301362	民爆光电	2023年7月27日	6个月	新股流通受限	51.05	38.52	420	21,441.00	16,178.40	-
301370	国科恒泰	2023年7月3日	6个月	新股流通受限	13.39	16.01	1,240	16,603.60	19,852.40	-
301371	敷尔佳	2023年7月24日	6个月	新股流通受限	55.68	37.58	564	31,403.52	21,195.12	-
301393	昊帆生物	2023年7月5日	6个月	新股流通受限	67.68	59.37	260	17,596.80	15,436.20	-
301395	仁信新材	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	26.68	18.69	520	13,873.60	9,718.80	-
301413	安培龙	2023年12月11日	6个月	新股流通受限	33.25	58.19	164	5,453.00	9,543.16	-

301418	协昌科技	2023年8月10日	6个月	新股流通受限	51.88	50.20	189	9,805.32	9,487.80	-
301421	波长光电	2023年8月16日	6个月	新股流通受限	29.38	59.37	332	9,754.16	19,710.84	-
301456	盘古智能	2023年7月6日	6个月	新股流通受限	37.96	30.39	407	15,449.72	12,368.73	-
301459	丰茂股份	2023年12月6日	6个月	新股流通受限	31.90	39.84	208	6,635.20	8,286.72	-
301469	恒达新材	2023年8月10日	6个月	新股流通受限	36.58	33.09	275	10,059.50	9,099.75	-
301486	致尚科技	2023年6月30日	6个月	新股流通受限	57.66	47.25	482	27,792.12	22,774.50	-
301487	盟固利	2023年8月1日	6个月	新股流通受限	5.32	40.96	867	4,612.44	35,512.32	-
301488	豪恩汽电	2023年6月26日	6个月	新股流通受限	39.78	69.09	262	10,422.36	18,101.58	-
301489	思泉新材	2023年10月16日	6个月	新股流通受限	41.66	64.11	128	5,332.48	8,206.08	-
301499	维科精密	2023年7月13日	6个月	新股流通受限	19.50	28.93	371	7,234.50	10,733.03	-
301500	飞南资源	2023年9月13日	6个月	新股流通受限	23.97	20.89	455	10,906.35	9,504.95	-
301505	苏	2023	6个月	新股	26.35	35.81	194	5,111.90	6,947.14	-

	州规划	年7月12日		流通受限						
301507	民生健康	2023年8月24日	6个月	新股流通受限	10.00	15.85	851	8,510.00	13,488.35	-
301508	中机认检	2023年11月23日	6个月	新股流通受限	16.82	26.68	419	7,047.58	11,178.92	-
301510	固高科技	2023年8月4日	6个月	新股流通受限	12.00	35.01	396	4,752.00	13,863.96	-
301511	德福科技	2023年8月8日	6个月	新股流通受限	28.00	22.67	982	27,496.00	22,261.94	-
301515	港通医疗	2023年7月13日	6个月	新股流通受限	31.16	28.27	230	7,166.80	6,502.10	-
301516	中远通	2023年12月1日	6个月	新股流通受限	6.87	15.51	604	4,149.48	9,368.04	-
301517	陕西华达	2023年10月9日	6个月	新股流通受限	26.87	43.69	185	4,970.95	8,082.65	-
301518	长华化学	2023年7月26日	6个月	新股流通受限	25.75	23.01	385	9,913.75	8,858.85	-
301519	舜禹股份	2023年7月19日	6个月	新股流通受限	20.93	20.21	442	9,251.06	8,932.82	-
301520	万邦医药	2023年9月18日	6个月	新股流通受限	67.88	52.74	160	10,860.80	8,438.40	-
301525	儒竞	2023年8月	6个月	新股流通	99.57	81.46	266	26,485.62	21,668.36	-

	科技	23 日		受限							
301526	国际复材	2023 年 12 月 19 日	6 个月	新股流通受限	2.66	4.45	9,723	25,863.18	43,267.35	-	
301528	多浦乐	2023 年 8 月 17 日	6 个月	新股流通受限	71.80	68.91	148	10,626.40	10,198.68	-	
301529	福赛科技	2023 年 8 月 31 日	6 个月	新股流通受限	36.60	37.88	182	6,661.20	6,894.16	-	
301533	威马农机	2023 年 8 月 7 日	6 个月	新股流通受限	29.50	33.16	225	6,637.50	7,461.00	-	
301548	崇德科技	2023 年 9 月 11 日	6 个月	新股流通受限	66.80	58.99	136	9,084.80	8,022.64	-	
301550	斯菱股份	2023 年 9 月 6 日	6 个月	新股流通受限	37.56	43.57	260	9,765.60	11,328.20	-	
301555	惠柏新材	2023 年 10 月 24 日	6 个月	新股流通受限	22.88	32.44	224	5,125.12	7,266.56	-	
301558	三态股份	2023 年 9 月 21 日	6 个月	新股流通受限	7.33	13.40	1,458	10,687.14	19,537.20	-	
301559	中集环科	2023 年 9 月 26 日	6 个月	新股流通受限	24.22	18.24	1,315	31,849.30	23,985.60	-	
301566	达利凯普	2023 年 12 月 22 日	6 个月	新股流通受限	8.90	22.14	576	5,126.40	12,752.64	-	
301568	思泰克	2023 年 11 月 21 日	6 个月	新股流通受限	23.23	35.58	246	5,714.58	8,752.68	-	

		日								
301578	辰奕智能	2023年12月21日	6个月	新股流通受限	48.94	68.32	118	5,774.92	8,061.76	-
601083	锦江航运	2023年11月28日	6个月	新股流通受限	11.25	11.07	1,263	14,208.75	13,981.41	-
601096	宏盛华源	2023年12月15日	6个月	新股流通受限	1.70	4.06	3,918	6,660.60	15,907.08	-
603004	鼎龙科技	2023年12月20日	6个月	新股流通受限	16.80	31.19	195	3,276.00	6,082.05	-
603062	麦加芯彩	2023年10月31日	6个月	新股流通受限	58.08	57.81	126	7,318.08	7,284.06	-
603075	热威股份	2023年9月1日	6个月	新股流通受限	23.10	23.31	182	4,204.20	4,242.42	-
603107	上海汽配	2023年10月25日	6个月	新股流通受限	14.23	18.19	292	4,155.16	5,311.48	-
603119	浙江荣泰	2023年7月21日	6个月	新股流通受限	15.32	23.87	226	3,462.32	5,394.62	-
603193	润本股份	2023年10月9日	6个月	新股流通受限	17.38	16.66	303	5,266.14	5,047.98	-
603231	索宝蛋白	2023年12月6日	6个月	新股流通受限	21.29	21.53	161	3,427.69	3,466.33	-
603270	金帝股	2023年8月25日	6个月	新股流通受限	21.77	29.58	195	4,245.15	5,768.10	-

	份									
603273	天元智能	2023年10月16日	6个月	新股流通受限	9.50	18.97	178	1,691.00	3,376.66	-
603276	恒兴新材	2023年9月18日	6个月	新股流通受限	25.73	24.88	134	3,447.82	3,333.92	-
603296	华勤技术	2023年8月1日	6个月	新股流通受限	80.80	77.75	593	47,914.40	46,105.75	-
603373	安邦护卫	2023年12月13日	6个月	新股流通受限	19.10	34.75	88	1,680.80	3,058.00	-
688450	光格科技	2023年7月17日	6个月	新股流通受限	53.09	36.42	167	8,866.03	6,082.14	-
688548	广钢气体	2023年8月8日	6个月	新股流通受限	9.87	12.75	4,048	39,953.76	51,612.00	-
688549	中巨芯	2023年8月30日	6个月	新股流通受限	5.18	8.09	4,294	22,242.92	34,738.46	-
688563	航材股份	2023年7月12日	6个月	新股流通受限	78.99	60.49	1,501	118,563.99	90,795.49	-
688573	信宇人	2023年8月9日	6个月	新股流通受限	23.68	28.80	285	6,748.80	8,208.00	-
688582	芯动联科	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	26.74	38.67	648	17,327.52	25,058.16	-
688591	泰凌微	2023年8月18日	6个月	新股流通受限	24.98	28.02	681	17,011.38	19,081.62	-
688602	康鹏	2023年7月	6个月	新股流通	8.66	11.06	1,066	9,231.56	11,789.96	-

	科技	13 日		受限						
688610	埃科光电	2023 年 7 月 10 日	6 个月	新股流通受限	73.33	51.00	275	20,165.75	14,025.00	-
688612	威迈斯	2023 年 7 月 19 日	6 个月	新股流通受限	47.29	37.97	422	19,956.38	16,023.34	-
688638	誉辰智能	2023 年 7 月 4 日	6 个月	新股流通受限	83.90	59.68	141	11,829.90	8,414.88	-
688648	中邮科技	2023 年 11 月 6 日	6 个月	新股流通受限	15.18	21.43	303	4,599.54	6,493.29	-
688651	盛邦安全	2023 年 7 月 19 日	6 个月	新股流通受限	39.90	46.05	178	7,102.20	8,196.90	-
688652	京仪装备	2023 年 11 月 22 日	6 个月	新股流通受限	31.95	52.25	416	13,291.20	21,736.00	-
688653	康希通信	2023 年 11 月 10 日	6 个月	新股流通受限	10.50	15.99	648	6,804.00	10,361.52	-
688657	浩辰软件	2023 年 9 月 25 日	6 个月	新股流通受限	103.40	78.23	101	10,443.40	7,901.23	-
688693	锆威特	2023 年 8 月 10 日	6 个月	新股流通受限	40.83	43.41	178	7,267.74	7,726.98	-
688702	盛科通信	2023 年 9 月 6 日	6 个月	新股流通受限	42.66	48.18	549	23,420.34	26,450.82	-
688716	中研股份	2023 年 9 月 13 日	6 个月	新股流通受限	29.66	36.39	267	7,919.22	9,716.13	-

688719	爱科赛博	2023年9月20日	6个月	新股流通受限	69.98	60.10	194	13,576.12	11,659.40	-
688720	艾森股份	2023年11月29日	6个月	新股流通受限	28.03	49.84	165	4,624.95	8,223.60	-

注：基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，则此新增股票的流通受限期和估值价格与相应原股票一致。

#### 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(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000657	中钨高新	2023年12月26日	重大资产重组	8.48	2024年1月10日	9.33	143,210	1,320,818.32	1,214,420.80	-

#### 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，本基金无因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。

##### 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，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的融出证券。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。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。本基金还可投资港股通标的的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特



有风险。本基金在严格控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争获得超越业绩比较基准的收益。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心，督察长、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。风险控制委员会负责协助确立公司风险控制的原则、目标和策略，并就风险控制重要事项进行审议和决策。督察长负责组织和指导公司的监察稽核工作。监察稽核部独立于公司各业务部门开展监察稽核工作，负责监察公司的风险管理措施的执行，对内部控制制度的执行情况进行全面及专项检查 and 反馈。风险管理部负责公司层面金融工具投资的风险评估、风险监测以及风险管理措施的执行。相关业务部门负责本部门的风险评估和监控。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。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金的基金管理人管理的所有开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股股票不得超过该上市公司可流通股股票的 15%。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，本基金所持大部分资产均能以合理价格适时变现。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投资的公允价值。

于 2023 年 12 月 31 日，本基金所承担的除卖出回购金融资产款以外的金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金持有的资产主要为银行存款、股票及信用状况良好的固定收益类资产，其中银行存款主要为活期存款及可提前支取的定期存款，股票及固定收益类资产主要为在交易所及银行间公开发行上市且可自由流通的品种。本基金持有的流通受限资产比例较低，未对组合流动性造成重大影响，附注 7.4.12 披露的流通受限资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。

#### 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。本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。

##### 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
资产					
货币资金	13,816,470.69	-	-	-	13,816,470.69
结算备付金	19,771,463.06	-	-	-	19,771,463.06
存出保证金	884,603.28	-	-	-	884,603.28
交易性金融资产	97,368,080.00	-	-	-1,826,191,332.48	1,923,559,412.48
应收股利	-	-	-	191,735.42	191,735.42
应收申购款	-	-	-	299,715.95	299,715.95
应收清算款	-	-	-	3,178,678.72	3,178,678.72
资产总计	131,840,617.03	-	-	-1,829,861,462.57	1,961,702,079.60
负债					
应付赎回款	-	-	-	267,902.82	267,902.82
应付管理人报酬	-	-	-	2,326,435.36	2,326,435.36
应付托管费	-	-	-	387,739.24	387,739.24
应付清算款	-	-	-	2,915,403.93	2,915,403.93
其他负债	-	-	-	5,047,494.41	5,047,494.41
负债总计	-	-	-	10,944,975.76	10,944,975.76
利率敏感度缺口	131,840,617.03	-	-	-1,818,916,486.81	1,950,757,103.84
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	326,310,487.07	-	-	-	326,310,487.07
结算备付金	189,546,111.09	-	-	-	189,546,111.09
存出保证金	1,068,858.89	-	-	13,440,840.00	14,509,698.89
交易性金融资产	134,674,670.74	-	-	-3,493,433,588.20	3,628,108,258.94
应收清算款	-	-	-	6,240,582.37	6,240,582.37
应收申购款	-	-	-	838,867.93	838,867.93
资产总计	651,600,127.79	-	-	-3,513,953,878.50	4,165,554,006.29
负债					
应付清算款	-	-	-	10,539,224.13	10,539,224.13
应付赎回款	-	-	-	378,061.62	378,061.62
应付管理人报酬	-	-	-	4,955,651.98	4,955,651.98
应付托管费	-	-	-	825,942.02	825,942.02
其他负债	-	-	-	15,565,891.61	15,565,891.61
负债总计	-	-	-	32,264,771.36	32,264,771.36
利率敏感度缺口	651,600,127.79	-	-	-3,481,689,107.14	4,133,289,234.93

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

于 2023 年 12 月 31 日，本基金持有交易性债券资产占基金资产净值的比例为 4.99%（2022 年 12 月 31 日：3.26%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2022 年 12 月 31

日：同)。

#### 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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
交易性金融资产	-	186,840,013.64	-	186,840,013.64
应收股利	-	191,735.42	-	191,735.42
资产合计	-	187,031,749.06	-	187,031,749.06
以外币计价的 负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 汇风险敞口净 额	-	187,031,749.06	-	187,031,749.06
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
交易性金融资产	-	232,048,807.81	-	232,048,807.81
资产合计	-	232,048,807.81	-	232,048,807.81
以外币计价的 负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 汇风险敞口净 额	-	232,048,807.81	-	232,048,807.81

额				
---	--	--	--	--

#### 7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变，且未考虑基金管理人为降低汇率风险而可能采取的风险管理活动		
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）
	港币相对人民币贬值5%	-9,351,587.45	-11,602,440.39
	港币相对人民币升值5%	9,351,587.45	11,602,440.39

#### 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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的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。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	1,826,191,332.48	93.61	3,493,433,588.20	84.52
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	1,826,191,332.48	93.61	3,493,433,588.20	84.52

### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变，表格中本期与上期的数据均披露		
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）
	业绩比较基准上升 5%	107,083,041.22	165,362,333.38
	业绩比较基准下降 5%	-107,083,041.22	-165,362,333.38

### 7.4.14 公允价值

#### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

#### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	1,823,725,466.22	3,487,135,339.58
第二层次	98,582,500.80	134,674,670.74
第三层次	1,251,445.46	6,298,248.62
合计	1,923,559,412.48	3,628,108,258.94

##### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低

层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

#### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

##### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 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	0.00	6,298,248.62	6,298,248.62
当期购买	0.00	1,107,158.47	1,107,158.47
当期出售/结算	0.00	0.00	0.00
转入第三层次	0.00	0.00	0.00
转出第三层次	0.00	6,298,248.62	6,298,248.62
当期利得或损失总额	0.00	144,286.99	144,286.99
其中：计入损益的利得或损失	0.00	144,286.99	144,286.99
计入其他综合收益的利得或损失	0.00	0.00	0.00
期末余额	0.00	1,251,445.46	1,251,445.46
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	0.00	144,286.99	144,286.99
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	-	968,541.26	968,541.26
当期购买	-	5,400,747.14	5,400,747.14
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	968,541.26	968,541.26
当期利得或损失总额	-	897,501.48	897,501.48
其中：计入损益的利得或损失	-	897,501.48	897,501.48
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	6,298,248.62	6,298,248.62

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	-	897,501.48	897,501.48
--	---	------------	------------

#### 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	1,251,445.46	平均价格亚式期权模型	波动率	0.1855-2.1988	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	6,298,248.62	平均价格亚式期权模型	波动率	0.1891-2.4756	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 3 月 28 日经本基金的基金管理人批准。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元



序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,826,191,332.48	93.09
	其中：股票	1,826,191,332.48	93.09
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	97,368,080.00	4.96
	其中：债券	97,368,080.00	4.96
	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	33,587,933.75	1.71
8	其他各项资产	4,554,733.37	0.23
9	合计	1,961,702,079.60	100.00

注：权益投资中通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 186,840,013.64 元，占基金资产净值比例 9.58%。

## 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

金额单位：人民币元

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	2,415,229.00	0.12
B	采矿业	31,780,197.40	1.63
C	制造业	1,154,502,743.25	59.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	42,792,119.60	2.19
E	建筑业	48,385,205.04	2.48
F	批发和零售业	34,486,013.41	1.77
G	交通运输、仓储和邮政业	30,053,316.76	1.54
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	106,449,193.05	5.46
J	金融业	41,467,538.00	2.13
K	房地产业	30,372,808.60	1.56
L	租赁和商务服务业	16,190,459.00	0.83
M	科学研究和技术服务业	32,154,966.35	1.65
N	水利、环境和公共设施管理业	26,130,883.14	1.34
O	居民服务、修理和其他服务业	1,663,931.00	0.09
P	教育	2,747,300.00	0.14
Q	卫生和社会工作	-	-

R	文化、体育和娱乐业	30,197,895.24	1.55
S	综合	7,561,520.00	0.39
	合计	1,639,351,318.84	84.04

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
基础材料	13,712,513.25	0.70
消费者非必需品	8,645,534.55	0.44
消费者常用品	13,156,211.97	0.67
能源	-	-
金融	-	-
医疗保健	14,058,009.62	0.72
工业	-	-
信息技术	41,103,615.38	2.11
电信服务	60,056,952.93	3.08
公用事业	18,712,754.27	0.96
地产业	17,394,421.67	0.89
合计	186,840,013.64	9.58

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

### 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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	00700	腾讯控股	99,700	26,526,799.34	1.36
2	01024	快手-W	491,500	23,584,307.53	1.21
3	00123	越秀地产	3,018,000	17,394,421.67	0.89
4	002541	鸿路钢构	754,800	16,401,804.00	0.84
5	00285	比亚迪电子	448,000	14,859,108.10	0.76
6	02367	巨子生物	407,800	13,156,211.97	0.67
7	600316	洪都航空	595,700	12,610,969.00	0.65
8	600039	四川路桥	1,548,020	11,594,669.80	0.59
9	601633	长城汽车	448,100	11,301,082.00	0.58
10	01071	华电国际电力股份	3,580,000	11,257,608.57	0.58
11	03993	洛阳钼业	2,658,000	10,285,288.89	0.53
12	00772	阅文集团	377,800	9,945,846.06	0.51
13	00268	金蝶国际	906,000	9,343,381.94	0.48
14	002997	瑞鹄模具	269,000	8,963,080.00	0.46
15	002022	科华生物	784,300	8,925,334.00	0.46
16	09868	小鹏汽车-W	168,200	8,642,565.77	0.44
17	02382	舜宇光学科技	133,100	8,545,776.94	0.44
18	600585	海螺水泥	376,900	8,502,864.00	0.44
19	01415	高伟电子	400,000	8,355,348.40	0.43

20	603327	福蓉科技	604,469	8,057,571.77	0.41
21	00836	华润电力	526,000	7,455,145.70	0.38
22	301391	卡莱特	61,800	7,074,864.00	0.36
23	000932	华菱钢铁	1,351,800	6,961,770.00	0.36
24	600373	中文传媒	521,356	6,871,472.08	0.35
25	000725	京东方 A	1,747,700	6,816,030.00	0.35
26	601636	旗滨集团	977,000	6,682,680.00	0.34
27	01548	金斯瑞生物科技	364,000	6,551,100.63	0.34
28	600064	南京高科	1,044,500	6,308,780.00	0.32
29	300981	中红医疗	393,450	6,303,069.00	0.32
30	688167	炬光科技	54,000	6,156,000.00	0.32
31	600941	中国移动	59,705	5,939,453.40	0.30
32	300556	丝路视觉	157,200	5,792,820.00	0.30
33	600325	华发股份	795,000	5,731,950.00	0.29
34	002415	海康威视	161,700	5,614,224.00	0.29
35	688720	艾森股份	92,262	5,557,988.82	0.28
36	002030	达安基因	571,303	5,530,213.04	0.28
37	688019	安集科技	34,107	5,448,934.32	0.28
38	000930	中粮科技	813,400	5,400,976.00	0.28
39	300583	赛托生物	271,100	5,362,358.00	0.27
40	600961	株冶集团	626,400	5,236,704.00	0.27
41	688072	拓荆科技	22,617	5,231,312.10	0.27
42	688687	凯因科技	149,221	5,201,844.06	0.27
43	002810	山东赫达	245,300	5,197,907.00	0.27
44	603516	淳中科技	226,800	5,096,196.00	0.26
45	688209	英集芯	284,500	5,081,170.00	0.26
46	601728	中国电信	933,600	5,050,776.00	0.26
47	600028	中国石化	899,030	5,016,587.40	0.26
48	000581	威孚高科	332,300	5,007,761.00	0.26
49	600741	华域汽车	306,700	4,993,076.00	0.26
50	000906	浙商中拓	681,000	4,978,110.00	0.26
51	600967	内蒙一机	602,300	4,974,998.00	0.26
52	688258	卓易信息	100,100	4,954,950.00	0.25
53	600104	上汽集团	365,000	4,938,450.00	0.25
54	601098	中南传媒	485,548	4,938,023.16	0.25
55	688012	中微公司	32,011	4,916,889.60	0.25
56	600820	隧道股份	853,204	4,914,455.04	0.25
57	300969	恒帅股份	54,600	4,906,902.00	0.25
58	601857	中国石油	694,500	4,903,170.00	0.25
59	000157	中联重科	749,200	4,892,276.00	0.25
60	601998	中信银行	924,700	4,891,663.00	0.25
61	600901	江苏金租	1,005,120	4,864,780.80	0.25
62	603977	国泰集团	466,700	4,853,680.00	0.25

63	603267	鸿远电子	96,600	4,849,320.00	0.25
64	601229	上海银行	810,400	4,838,088.00	0.25
65	600461	洪城环境	526,500	4,812,210.00	0.25
66	601658	邮储银行	1,105,100	4,807,185.00	0.25
67	601288	农业银行	1,319,200	4,801,888.00	0.25
68	601988	中国银行	1,201,600	4,794,384.00	0.25
69	688120	华海清科	25,371	4,762,136.70	0.24
70	601088	中国神华	151,800	4,758,930.00	0.24
71	02269	药明生物	175,500	4,707,631.66	0.24
72	605319	无锡振华	202,500	4,661,550.00	0.24
73	600938	中国海油	220,400	4,621,788.00	0.24
74	002244	滨江集团	622,200	4,523,394.00	0.23
75	000030	富奥股份	847,000	4,522,980.00	0.23
76	002110	三钢闽光	1,116,100	4,520,205.00	0.23
77	301383	天键股份	69,279	4,503,135.00	0.23
78	601699	潞安环能	204,300	4,476,213.00	0.23
79	000568	泸州老窖	24,700	4,431,674.00	0.23
80	002376	新北洋	574,500	4,377,690.00	0.22
81	300700	岱勒新材	257,000	4,361,290.00	0.22
82	300254	仟源医药	451,900	4,351,797.00	0.22
83	001314	亿道信息	60,400	4,344,572.00	0.22
84	600755	厦门国贸	615,400	4,289,338.00	0.22
85	001965	招商公路	430,900	4,209,893.00	0.22
86	301117	佳缘科技	77,000	4,197,270.00	0.22
87	300779	惠城环保	81,100	4,184,760.00	0.21
88	601009	南京银行	561,400	4,143,132.00	0.21
89	600519	贵州茅台	2,400	4,142,400.00	0.21
90	300873	海晨股份	173,900	4,140,559.00	0.21
91	301312	智立方	38,100	4,127,754.00	0.21
92	001309	德明利	43,200	4,099,248.00	0.21
93	688401	路维光电	132,930	4,083,609.60	0.21
94	600662	外服控股	841,700	4,040,160.00	0.21
95	000789	万年青	588,300	4,035,738.00	0.21
96	688550	瑞联新材	101,637	4,032,956.16	0.21
97	300818	耐普矿机	118,850	3,923,238.50	0.20
98	600582	天地科技	717,100	3,901,024.00	0.20
99	688981	中芯国际	73,000	3,870,460.00	0.20
100	300145	中金环境	1,275,400	3,851,708.00	0.20
101	300415	伊之密	217,500	3,834,525.00	0.20
102	603778	国晟科技	686,700	3,818,052.00	0.20
103	688127	蓝特光学	162,527	3,785,253.83	0.19
104	688362	甬矽电子	143,944	3,769,893.36	0.19
105	300161	华中数控	104,800	3,762,320.00	0.19

106	688313	仕佳光子	296,000	3,762,160.00	0.19
107	688150	莱特光电	173,598	3,747,980.82	0.19
108	300203	聚光科技	235,900	3,739,015.00	0.19
109	002035	华帝股份	600,700	3,730,347.00	0.19
110	002068	黑猫股份	321,100	3,724,760.00	0.19
111	600684	珠江股份	1,071,600	3,718,452.00	0.19
112	601028	玉龙股份	346,300	3,708,873.00	0.19
113	002154	报喜鸟	650,803	3,696,561.04	0.19
114	002338	奥普光电	109,400	3,681,310.00	0.19
115	603666	亿嘉和	116,900	3,669,491.00	0.19
116	600057	厦门象屿	543,700	3,648,227.00	0.19
117	002446	盛路通信	438,300	3,637,890.00	0.19
118	003000	劲仔食品	294,900	3,603,678.00	0.18
119	603200	上海洗霸	168,500	3,587,365.00	0.18
120	603167	渤海轮渡	402,700	3,575,976.00	0.18
121	300548	博创科技	131,500	3,546,555.00	0.18
122	002034	旺能环境	232,500	3,545,625.00	0.18
123	688378	奥来德	74,700	3,536,298.00	0.18
124	600790	轻纺城	888,400	3,526,948.00	0.18
125	300926	博俊科技	119,900	3,516,667.00	0.18
126	603439	贵州三力	184,900	3,490,912.00	0.18
127	688468	科美诊断	322,350	3,478,156.50	0.18
128	002947	恒铭达	107,400	3,456,132.00	0.18
129	688078	龙软科技	85,403	3,443,448.96	0.18
130	02099	中国黄金国际	113,400	3,427,224.36	0.18
131	301345	涛涛车业	56,154	3,419,778.60	0.18
132	300407	凯发电气	358,200	3,381,408.00	0.17
133	301129	瑞纳智能	126,660	3,372,955.80	0.17
134	688035	德邦科技	62,800	3,351,008.00	0.17
135	603383	顶点软件	67,900	3,347,470.00	0.17
136	688601	力芯微	63,800	3,342,482.00	0.17
137	300517	海波重科	231,800	3,279,970.00	0.17
138	600757	长江传媒	434,700	3,238,515.00	0.17
139	603322	超讯通信	85,800	3,235,518.00	0.17
140	688518	联赢激光	157,830	3,232,358.40	0.17
141	688513	苑东生物	50,024	3,190,530.72	0.16
142	688048	长光华芯	50,600	3,171,102.00	0.16
143	002749	国光股份	264,500	3,168,710.00	0.16
144	002256	兆新股份	1,146,500	3,141,410.00	0.16
145	002843	泰嘉股份	117,467	3,112,875.50	0.16
146	300996	普联软件	135,400	3,100,660.00	0.16
147	605167	利柏特	321,000	3,046,290.00	0.16
148	688260	昀冢科技	100,382	3,041,574.60	0.16

149	300606	金太阳	88,900	3,036,824.00	0.16
150	300592	华凯易佰	122,600	3,036,802.00	0.16
151	600603	广汇物流	389,800	3,032,644.00	0.16
152	002126	银轮股份	160,800	3,002,136.00	0.15
153	601766	中国中车	568,100	2,988,206.00	0.15
154	605289	罗曼股份	51,600	2,967,000.00	0.15
155	605128	上海沿浦	50,900	2,954,745.00	0.15
156	300181	佐力药业	276,200	2,944,292.00	0.15
157	603859	能科科技	77,651	2,929,772.23	0.15
158	300494	盛天网络	185,100	2,926,431.00	0.15
159	000333	美的集团	53,400	2,917,242.00	0.15
160	688621	阳光诺和	41,800	2,915,550.00	0.15
161	300882	万胜智能	119,200	2,903,712.00	0.15
162	688627	精智达	32,517	2,899,866.06	0.15
163	688611	杭州柯林	88,399	2,897,719.22	0.15
164	603330	天洋新材	381,300	2,890,254.00	0.15
165	688323	瑞华泰	134,400	2,885,568.00	0.15
166	688053	思科瑞	57,622	2,877,642.68	0.15
167	002150	通润装备	161,900	2,872,106.00	0.15
168	002291	遥望科技	305,100	2,861,838.00	0.15
169	688577	浙海德曼	30,329	2,856,991.80	0.15
170	000661	长春高新	19,500	2,843,100.00	0.15
171	300349	金卡智能	228,400	2,836,728.00	0.15
172	300539	横河精密	228,180	2,831,713.80	0.15
173	300218	安利股份	208,044	2,818,996.20	0.14
174	300141	和顺电气	269,800	2,816,712.00	0.14
175	03692	翰森制药	196,000	2,799,277.33	0.14
176	002891	中宠股份	106,000	2,793,100.00	0.14
177	603699	纽威股份	201,500	2,792,790.00	0.14
178	688239	航宇科技	58,349	2,787,331.73	0.14
179	300757	罗博特科	34,200	2,783,538.00	0.14
180	688115	思林杰	80,200	2,780,534.00	0.14
181	300522	世名科技	205,900	2,779,650.00	0.14
182	688278	特宝生物	52,975	2,773,241.25	0.14
183	301272	英华特	50,973	2,768,690.74	0.14
184	300315	掌趣科技	531,800	2,738,770.00	0.14
185	300213	佳讯飞鸿	380,300	2,738,160.00	0.14
186	002472	双环传动	105,000	2,732,100.00	0.14
187	688059	华锐精密	34,700	2,731,237.00	0.14
188	301188	力诺特玻	152,400	2,726,436.00	0.14
189	002903	宇环数控	106,300	2,715,965.00	0.14
190	300608	思特奇	159,800	2,708,610.00	0.14
191	605016	百龙创园	95,400	2,708,406.00	0.14

192	300687	赛意信息	123,500	2,689,830.00	0.14
193	002215	诺普信	325,200	2,686,152.00	0.14
194	600900	长江电力	114,600	2,674,764.00	0.14
195	300158	振东制药	395,827	2,671,832.25	0.14
196	600566	济川药业	84,900	2,668,407.00	0.14
197	001380	华纬科技	76,509	2,665,573.56	0.14
198	603878	武进不锈	352,600	2,662,130.00	0.14
199	002991	甘源食品	37,200	2,658,312.00	0.14
200	002046	国机精工	229,788	2,654,051.40	0.14
201	002208	合肥城建	412,060	2,641,304.60	0.14
202	300782	卓胜微	18,700	2,636,700.00	0.14
203	603558	健盛集团	272,000	2,635,680.00	0.14
204	603009	北特科技	177,300	2,629,359.00	0.13
205	002149	西部材料	166,800	2,622,096.00	0.13
206	001269	欧晶科技	48,980	2,617,981.00	0.13
207	001306	夏厦精密	28,864	2,615,543.04	0.13
208	688182	灿勤科技	147,005	2,613,748.90	0.13
209	300418	昆仑万维	69,500	2,599,300.00	0.13
210	688311	盟升电子	50,926	2,597,735.26	0.13
211	688228	开普云	39,600	2,591,028.00	0.13
212	002949	华阳国际	184,600	2,578,862.00	0.13
213	688590	新致软件	113,900	2,576,418.00	0.13
214	300795	米奥会展	69,700	2,569,839.00	0.13
215	300928	华安鑫创	50,927	2,568,757.88	0.13
216	600376	首开股份	836,500	2,542,960.00	0.13
217	603388	元成股份	280,200	2,533,008.00	0.13
218	601928	凤凰传媒	285,500	2,515,255.00	0.13
219	600251	冠农股份	286,700	2,491,423.00	0.13
220	301349	信德新材	52,900	2,490,532.00	0.13
221	688503	聚和材料	46,292	2,481,251.20	0.13
222	300727	润禾材料	86,000	2,475,940.00	0.13
223	300366	创意信息	187,200	2,456,064.00	0.13
224	688393	安必平	97,348	2,430,779.56	0.12
225	603901	永创智能	204,200	2,429,980.00	0.12
226	300389	艾比森	139,300	2,415,462.00	0.12
227	300295	三六五网	195,200	2,406,816.00	0.12
228	002452	长高电新	338,700	2,404,770.00	0.12
229	601168	西部矿业	168,200	2,400,214.00	0.12
230	688103	国力股份	48,535	2,396,658.30	0.12
231	600997	开滦股份	313,400	2,391,242.00	0.12
232	688356	键凯科技	22,167	2,358,568.80	0.12
233	002646	天佑德酒	173,000	2,354,530.00	0.12
234	688529	豪森智能	102,019	2,353,578.33	0.12

235	600353	旭光电子	257,300	2,351,722.00	0.12
236	688636	智明达	36,000	2,347,200.00	0.12
237	300997	欢乐家	166,100	2,320,417.00	0.12
238	603611	诺力股份	122,563	2,320,117.59	0.12
239	000700	模塑科技	331,297	2,319,079.00	0.12
240	600690	海尔智家	109,400	2,297,400.00	0.12
241	601019	山东出版	244,800	2,296,224.00	0.12
242	300280	紫天科技	53,300	2,277,509.00	0.12
243	300833	浩洋股份	25,200	2,270,520.00	0.12
244	688305	科德数控	29,462	2,252,369.90	0.12
245	002983	芯瑞达	72,700	2,243,522.00	0.12
246	601985	中国核电	297,900	2,234,250.00	0.11
247	605098	行动教育	57,600	2,220,480.00	0.11
248	600499	科达制造	207,900	2,193,345.00	0.11
249	688132	邦彦技术	101,943	2,184,638.49	0.11
250	601113	华鼎股份	636,100	2,181,823.00	0.11
251	600795	国电电力	524,400	2,181,504.00	0.11
252	603500	祥和实业	177,900	2,179,275.00	0.11
253	300228	富瑞特装	306,200	2,174,020.00	0.11
254	603408	建霖家居	168,400	2,162,256.00	0.11
255	301096	百诚医药	33,051	2,151,620.10	0.11
256	603868	飞科电器	42,400	2,141,200.00	0.11
257	688330	宏力达	75,300	2,139,273.00	0.11
258	300654	世纪天鸿	189,600	2,138,688.00	0.11
259	688631	莱斯信息	60,389	2,128,712.25	0.11
260	300545	联得装备	61,400	2,121,370.00	0.11
261	300206	理邦仪器	207,400	2,117,554.00	0.11
262	605287	德才股份	124,340	2,110,049.80	0.11
263	603071	物产环能	137,800	2,094,560.00	0.11
264	688093	世华科技	114,298	2,081,366.58	0.11
265	001218	丽臣实业	95,580	2,065,483.80	0.11
266	000090	天健集团	447,600	2,058,960.00	0.11
267	603230	内蒙新华	132,250	2,049,875.00	0.11
268	688596	正帆科技	50,900	2,017,167.00	0.10
269	300729	乐歌股份	112,400	2,013,084.00	0.10
270	300384	三联虹普	125,600	2,004,576.00	0.10
271	688676	金盘科技	55,889	2,002,502.87	0.10
272	301004	嘉益股份	43,800	1,990,710.00	0.10
273	603239	浙江仙通	130,300	1,989,681.00	0.10
274	603826	坤彩科技	33,660	1,986,949.80	0.10
275	300042	朗科科技	56,600	1,981,000.00	0.10
276	603725	天安新材	177,754	1,978,402.02	0.10
277	002061	浙江交科	539,200	1,968,080.00	0.10



278	600886	国投电力	148,900	1,962,502.00	0.10
279	688613	奥精医疗	87,699	1,952,179.74	0.10
280	000019	深粮控股	258,000	1,945,320.00	0.10
281	600588	用友网络	109,100	1,940,889.00	0.10
282	300803	指南针	32,100	1,934,346.00	0.10
283	603600	永艺股份	175,100	1,933,104.00	0.10
284	688320	禾川科技	46,949	1,924,909.00	0.10
285	688533	上声电子	50,068	1,908,592.16	0.10
286	301313	凡拓数创	52,800	1,903,968.00	0.10
287	301193	家联科技	110,100	1,869,498.00	0.10
288	600571	信雅达	135,500	1,863,125.00	0.10
289	000977	浪潮信息	55,997	1,859,100.40	0.10
290	603111	康尼机电	329,900	1,837,543.00	0.09
291	301000	肇民科技	85,900	1,834,824.00	0.09
292	600079	人福医药	73,500	1,827,210.00	0.09
293	300054	鼎龙股份	75,400	1,824,680.00	0.09
294	300857	协创数据	34,400	1,822,856.00	0.09
295	603848	好太太	117,300	1,815,804.00	0.09
296	002753	永东股份	219,900	1,814,175.00	0.09
297	301056	森赫股份	177,300	1,812,006.00	0.09
298	688571	杭华股份	241,100	1,803,428.00	0.09
299	300501	海顺新材	124,600	1,797,978.00	0.09
300	300260	新莱应材	58,900	1,792,327.00	0.09
301	688361	中科飞测	23,903	1,779,100.29	0.09
302	000893	亚钾国际	67,800	1,779,072.00	0.09
303	603660	苏州科达	202,300	1,778,217.00	0.09
304	688668	鼎通科技	32,100	1,775,772.00	0.09
305	002448	中原内配	266,900	1,772,216.00	0.09
306	301050	雷电微力	30,400	1,771,104.00	0.09
307	600579	克劳斯	243,500	1,767,810.00	0.09
308	603130	云中马	81,700	1,760,635.00	0.09
309	000551	创元科技	166,600	1,744,302.00	0.09
310	002875	安奈儿	116,300	1,731,707.00	0.09
311	600323	瀚蓝环境	98,800	1,712,204.00	0.09
312	600379	宝光股份	169,100	1,699,455.00	0.09
313	605288	凯迪股份	35,800	1,686,896.00	0.09
314	605007	五洲特纸	114,600	1,685,766.00	0.09
315	688383	新益昌	16,039	1,680,726.81	0.09
316	000708	中信特钢	119,700	1,680,588.00	0.09
317	002727	一心堂	72,531	1,679,817.96	0.09
318	603929	亚翔集成	70,200	1,679,184.00	0.09
319	688136	科兴制药	82,911	1,678,947.75	0.09
320	603658	安图生物	29,400	1,676,094.00	0.09

321	300335	迪森股份	298,600	1,672,160.00	0.09
322	603890	春秋电子	146,000	1,671,700.00	0.09
323	601100	恒立液压	30,500	1,667,740.00	0.09
324	300736	百邦科技	130,300	1,663,931.00	0.09
325	600737	中粮糖业	201,200	1,657,888.00	0.08
326	600101	明星电力	197,100	1,657,611.00	0.08
327	688595	芯海科技	38,092	1,649,383.60	0.08
328	688328	深科达	36,564	1,639,895.40	0.08
329	300693	盛弘股份	54,800	1,639,068.00	0.08
330	000612	焦作万方	284,000	1,633,000.00	0.08
331	002296	辉煌科技	197,900	1,632,675.00	0.08
332	688519	南亚新材	63,257	1,629,500.32	0.08
333	000404	长虹华意	275,100	1,620,339.00	0.08
334	601512	中新集团	209,400	1,614,474.00	0.08
335	002083	孚日股份	320,200	1,613,808.00	0.08
336	603225	新凤鸣	112,800	1,601,760.00	0.08
337	688018	乐鑫科技	15,535	1,599,328.25	0.08
338	603530	神马电力	77,000	1,596,980.00	0.08
339	002327	富安娜	178,000	1,593,100.00	0.08
340	688603	天承科技	21,132	1,584,477.36	0.08
341	605333	沪光股份	79,300	1,578,070.00	0.08
342	601233	桐昆股份	104,200	1,576,546.00	0.08
343	300129	泰胜风能	145,800	1,570,266.00	0.08
344	002847	盐津铺子	22,600	1,570,248.00	0.08
345	688097	博众精工	46,488	1,561,996.80	0.08
346	301368	丰立智能	33,000	1,555,620.00	0.08
347	000531	穗恒运 A	232,420	1,554,889.80	0.08
348	603903	中持股份	156,900	1,550,172.00	0.08
349	600847	万里股份	129,500	1,543,640.00	0.08
350	688660	电气风电	298,871	1,536,196.94	0.08
351	605369	拱东医疗	27,500	1,535,050.00	0.08
352	688165	埃夫特	133,100	1,525,326.00	0.08
353	002092	中泰化学	249,000	1,518,900.00	0.08
354	600592	龙溪股份	131,500	1,513,565.00	0.08
355	301168	通灵股份	32,500	1,500,200.00	0.08
356	002971	和远气体	53,900	1,494,108.00	0.08
357	002965	祥鑫科技	35,800	1,473,886.00	0.08
358	300902	国安达	41,486	1,462,381.50	0.07
359	300117	嘉寓股份	503,800	1,461,020.00	0.07
360	002838	道恩股份	113,800	1,457,778.00	0.07
361	603255	鼎际得	38,800	1,447,240.00	0.07
362	603112	华翔股份	118,800	1,443,420.00	0.07
363	300787	海能实业	85,800	1,443,156.00	0.07

364	002028	思源电气	27,700	1,441,508.00	0.07
365	600529	山东药玻	56,300	1,441,280.00	0.07
366	300323	华灿光电	196,800	1,440,576.00	0.07
367	605222	起帆电缆	74,700	1,440,216.00	0.07
368	300977	深圳瑞捷	76,700	1,433,523.00	0.07
369	300239	东宝生物	229,900	1,432,277.00	0.07
370	002017	东信和平	137,200	1,428,252.00	0.07
371	300793	佳禾智能	65,400	1,419,834.00	0.07
372	300274	阳光电源	16,200	1,418,958.00	0.07
373	000534	万泽股份	108,400	1,418,956.00	0.07
374	603109	神驰机电	86,200	1,415,404.00	0.07
375	601500	通用股份	340,300	1,408,842.00	0.07
376	688108	赛诺医疗	112,200	1,408,110.00	0.07
377	603126	中材节能	208,700	1,406,638.00	0.07
378	301377	鼎泰高科	59,400	1,404,810.00	0.07
379	300578	会畅通讯	78,600	1,403,796.00	0.07
380	002204	大连重工	306,800	1,402,076.00	0.07
381	300040	九洲集团	249,600	1,397,760.00	0.07
382	300352	北信源	293,600	1,394,600.00	0.07
383	600572	康恩贝	275,600	1,391,780.00	0.07
384	000881	中广核技	191,900	1,391,275.00	0.07
385	000786	北新建材	59,550	1,391,088.00	0.07
386	603992	松霖科技	76,600	1,389,524.00	0.07
387	603099	长白山	92,600	1,387,148.00	0.07
388	002009	天奇股份	91,909	1,386,906.81	0.07
389	300962	中金辐照	89,300	1,385,936.00	0.07
390	600620	天宸股份	147,300	1,384,620.00	0.07
391	603387	基蛋生物	125,700	1,382,700.00	0.07
392	603227	雪峰科技	199,700	1,377,930.00	0.07
393	002546	新联电子	275,400	1,377,000.00	0.07
394	002441	众业达	145,400	1,376,938.00	0.07
395	601601	中国太保	57,900	1,376,862.00	0.07
396	301360	荣旗科技	14,700	1,375,920.00	0.07
397	300365	恒华科技	203,100	1,372,956.00	0.07
398	300867	圣元环保	86,000	1,371,700.00	0.07
399	300241	瑞丰光电	243,600	1,371,468.00	0.07
400	002286	保龄宝	168,200	1,365,784.00	0.07
401	300838	浙江力诺	83,100	1,359,516.00	0.07
402	600590	泰豪科技	203,500	1,359,380.00	0.07
403	688041	海光信息	19,104	1,356,001.92	0.07
404	002969	嘉美包装	328,600	1,353,832.00	0.07
405	002540	亚太科技	204,800	1,353,728.00	0.07
406	002735	王子新材	104,000	1,352,000.00	0.07

407	300752	隆利科技	74,300	1,350,031.00	0.07
408	300871	回盛生物	93,300	1,349,118.00	0.07
409	300437	清水源	107,300	1,348,761.00	0.07
410	600403	大有能源	354,000	1,345,200.00	0.07
411	688580	伟思医疗	21,000	1,342,530.00	0.07
412	688429	时创能源	63,335	1,342,068.65	0.07
413	002090	金智科技	134,400	1,341,312.00	0.07
414	300783	三只松鼠	74,200	1,339,310.00	0.07
415	300471	厚普股份	97,100	1,339,009.00	0.07
416	300790	宇瞳光学	82,200	1,337,394.00	0.07
417	002079	苏州固锔	118,400	1,335,552.00	0.07
418	301235	华康医疗	52,000	1,332,760.00	0.07
419	000625	长安汽车	79,162	1,332,296.46	0.07
420	300120	经纬辉开	183,400	1,331,484.00	0.07
421	002239	奥特佳	409,600	1,331,200.00	0.07
422	688289	圣湘生物	68,000	1,329,400.00	0.07
423	603163	圣晖集成	40,100	1,328,513.00	0.07
424	605388	均瑶健康	105,300	1,320,462.00	0.07
425	300520	科大国创	60,700	1,319,618.00	0.07
426	002326	永太科技	113,500	1,318,870.00	0.07
427	300337	银邦股份	163,000	1,318,670.00	0.07
428	002096	易普力	127,100	1,316,756.00	0.07
429	600180	瑞茂通	215,900	1,314,831.00	0.07
430	002920	德赛西威	10,133	1,312,324.83	0.07
431	002757	南兴股份	83,900	1,312,196.00	0.07
432	688306	均普智能	235,400	1,311,178.00	0.07
433	600279	重庆港	293,600	1,306,520.00	0.07
434	300789	唐源电气	57,900	1,305,066.00	0.07
435	002119	康强电子	97,600	1,304,912.00	0.07
436	688013	天臣医疗	61,800	1,303,980.00	0.07
437	300266	兴源环境	482,700	1,303,290.00	0.07
438	600501	航天晨光	95,200	1,302,336.00	0.07
439	002166	莱茵生物	167,600	1,302,252.00	0.07
440	603369	今世缘	26,700	1,301,625.00	0.07
441	300531	优博讯	84,800	1,299,984.00	0.07
442	002454	松芝股份	173,100	1,299,981.00	0.07
443	601609	金田股份	192,000	1,299,840.00	0.07
444	002759	天际股份	122,500	1,299,725.00	0.07
445	600955	维远股份	72,400	1,299,580.00	0.07
446	600429	三元股份	291,300	1,299,198.00	0.07
447	601107	四川成渝	295,600	1,297,684.00	0.07
448	002226	江南化工	296,200	1,297,356.00	0.07
449	300523	辰安科技	63,900	1,297,170.00	0.07

450	300472	新元科技	137,400	1,297,056.00	0.07
451	300401	花园生物	109,800	1,296,738.00	0.07
452	001267	汇绿生态	247,900	1,296,517.00	0.07
453	300131	英唐智控	215,300	1,293,953.00	0.07
454	002421	达实智能	401,800	1,293,796.00	0.07
455	002723	小崧股份	126,400	1,293,072.00	0.07
456	002297	博云新材	162,200	1,292,734.00	0.07
457	300125	聆达股份	102,500	1,292,525.00	0.07
458	003026	中晶科技	36,100	1,292,380.00	0.07
459	688553	汇宇制药	85,350	1,291,345.50	0.07
460	688159	有方科技	34,291	1,291,056.15	0.07
461	300890	翔丰华	37,316	1,290,387.28	0.07
462	601137	博威合金	83,000	1,288,990.00	0.07
463	300485	赛升药业	121,700	1,288,803.00	0.07
464	603759	海天股份	155,000	1,288,050.00	0.07
465	603378	亚士创能	152,200	1,287,612.00	0.07
466	000925	众合科技	148,600	1,286,876.00	0.07
467	002197	证通电子	123,800	1,286,282.00	0.07
468	002190	成飞集成	67,800	1,286,166.00	0.07
469	600073	上海梅林	188,600	1,284,366.00	0.07
470	300072	海新能科	365,700	1,283,607.00	0.07
471	002023	海特高新	141,000	1,283,100.00	0.07
472	002728	特一药业	71,600	1,283,072.00	0.07
473	002342	巨力索具	297,600	1,282,656.00	0.07
474	300105	龙源技术	188,900	1,282,631.00	0.07
475	000993	闽东电力	125,700	1,282,140.00	0.07
476	002730	电光科技	135,100	1,280,748.00	0.07
477	002412	汉森制药	188,900	1,280,742.00	0.07
478	002111	威海广泰	141,300	1,280,178.00	0.07
479	301175	中科环保	256,400	1,279,436.00	0.07
480	300085	银之杰	89,300	1,278,776.00	0.07
481	300021	大禹节水	268,400	1,277,584.00	0.07
482	000731	四川美丰	172,400	1,275,760.00	0.07
483	002093	国脉科技	169,400	1,273,888.00	0.07
484	600420	国药现代	129,900	1,271,721.00	0.07
485	300278	华昌达	332,900	1,271,678.00	0.07
486	300802	矩子科技	66,500	1,271,480.00	0.07
487	001696	宗申动力	191,700	1,270,971.00	0.07
488	000949	新乡化纤	393,100	1,269,713.00	0.07
489	300397	天和防务	123,000	1,269,360.00	0.07
490	688211	中科微至	34,614	1,269,295.38	0.07
491	002933	新兴装备	34,800	1,268,460.00	0.07
492	688296	和达科技	70,568	1,268,106.96	0.07

493	002062	宏润建设	286,100	1,267,423.00	0.06
494	600575	淮河能源	525,700	1,266,937.00	0.06
495	603012	创力集团	214,200	1,265,922.00	0.06
496	301116	益客食品	98,669	1,264,936.58	0.06
497	000899	赣能股份	163,400	1,264,716.00	0.06
498	600736	苏州高新	265,600	1,264,256.00	0.06
499	600283	钱江水利	100,300	1,262,777.00	0.06
500	301220	亚香股份	38,200	1,262,510.00	0.06
501	300020	银江技术	152,100	1,262,430.00	0.06
502	002067	景兴纸业	372,200	1,261,758.00	0.06
503	601011	宝泰隆	360,500	1,261,750.00	0.06
504	300099	尤洛卡	203,800	1,261,522.00	0.06
505	600551	时代出版	115,800	1,261,062.00	0.06
506	600903	贵州燃气	159,720	1,260,190.80	0.06
507	600217	中再资环	287,400	1,258,812.00	0.06
508	300792	壹网壹创	52,500	1,258,425.00	0.06
509	600017	日照港	457,100	1,257,025.00	0.06
510	600664	哈药股份	374,400	1,254,240.00	0.06
511	600880	博瑞传播	250,300	1,254,003.00	0.06
512	300813	泰林生物	50,900	1,248,068.00	0.06
513	002404	嘉欣丝绸	206,200	1,245,448.00	0.06
514	000055	方大集团	275,400	1,244,808.00	0.06
515	000901	航天科技	133,465	1,243,893.80	0.06
516	300318	博晖创新	199,300	1,243,632.00	0.06
517	688380	中微半导	52,100	1,243,106.00	0.06
518	002102	冠福股份	458,600	1,242,806.00	0.06
519	601133	柏诚股份	94,300	1,241,931.00	0.06
520	300259	新天科技	341,700	1,240,371.00	0.06
521	000722	湖南发展	128,900	1,238,729.00	0.06
522	300197	节能铁汉	598,000	1,237,860.00	0.06
523	002262	恩华药业	45,600	1,236,672.00	0.06
524	300546	雄帝科技	78,400	1,236,368.00	0.06
525	002626	金达威	75,700	1,236,181.00	0.06
526	002562	兄弟科技	305,500	1,234,220.00	0.06
527	688247	宣泰医药	112,400	1,234,152.00	0.06
528	000607	华媒控股	269,000	1,232,020.00	0.06
529	603297	永新光学	12,400	1,231,940.00	0.06
530	002666	德联集团	228,000	1,231,200.00	0.06
531	300722	新余国科	47,000	1,230,930.00	0.06
532	688081	兴图新科	71,517	1,230,807.57	0.06
533	000791	甘肃能源	220,200	1,226,514.00	0.06
534	300662	科锐国际	44,400	1,226,328.00	0.06
535	301199	迈赫股份	46,500	1,220,625.00	0.06

536	300092	科新机电	91,400	1,217,448.00	0.06
537	000657	中钨高新	143,210	1,214,420.80	0.06
538	688681	科汇股份	78,360	1,210,662.00	0.06
539	000601	韶能股份	279,100	1,194,548.00	0.06
540	603053	成都燃气	116,600	1,193,984.00	0.06
541	000807	云铝股份	97,500	1,191,450.00	0.06
542	300963	中洲特材	90,800	1,191,296.00	0.06
543	601006	大秦铁路	164,635	1,187,018.35	0.06
544	000078	海王生物	375,300	1,178,442.00	0.06
545	300743	天地数码	84,000	1,165,920.00	0.06
546	688656	浩欧博	33,200	1,154,032.00	0.06
547	601121	宝地矿业	163,400	1,153,604.00	0.06
548	688038	中科通达	79,922	1,151,676.02	0.06
549	603062	麦加芯彩	18,326	1,143,692.06	0.06
550	688698	伟创电气	31,400	1,140,762.00	0.06
551	603308	应流股份	79,500	1,139,235.00	0.06
552	600019	宝钢股份	191,900	1,137,967.00	0.06
553	001231	农心科技	54,588	1,137,068.04	0.06
554	601668	中国建筑	235,700	1,133,717.00	0.06
555	603300	华铁应急	176,320	1,128,448.00	0.06
556	603915	国茂股份	67,000	1,104,160.00	0.06
557	300826	测绘股份	61,100	1,104,077.00	0.06
558	688543	国科军工	19,700	1,101,230.00	0.06
559	603556	海兴电力	37,800	1,097,334.00	0.06
560	601127	赛力斯	14,400	1,097,280.00	0.06
561	000680	山推股份	221,400	1,093,716.00	0.06
562	002015	协鑫能科	87,000	1,077,060.00	0.06
563	002225	濮耐股份	284,401	1,075,035.78	0.06
564	000619	海螺新材	153,800	1,064,296.00	0.05
565	603339	四方科技	89,032	1,058,590.48	0.05
566	000533	顺钠股份	225,400	1,057,126.00	0.05
567	601921	浙版传媒	137,400	1,049,736.00	0.05
568	300609	汇纳科技	38,400	1,048,320.00	0.05
569	600060	海信视像	49,600	1,036,640.00	0.05
570	301022	海泰科	37,900	1,033,912.00	0.05
571	300062	中能电气	165,800	1,032,934.00	0.05
572	688009	中国通号	233,600	1,023,168.00	0.05
573	002852	道道全	94,200	1,019,244.00	0.05
574	688028	沃尔德	40,800	1,015,512.00	0.05
575	002074	国轩高科	47,100	1,012,650.00	0.05
576	600480	凌云股份	111,100	1,012,121.00	0.05
577	000039	中集集团	132,100	1,010,565.00	0.05
578	300124	汇川技术	16,000	1,010,240.00	0.05

579	605599	菜百股份	67,500	1,005,075.00	0.05
580	600356	恒丰纸业	125,900	1,004,682.00	0.05
581	300462	华铭智能	85,000	1,002,150.00	0.05
582	300970	华绿生物	57,700	995,902.00	0.05
583	600262	北方股份	51,500	991,375.00	0.05
584	003023	彩虹集团	48,900	990,714.00	0.05
585	603020	爱普股份	118,500	990,660.00	0.05
586	603319	湘油泵	56,400	989,256.00	0.05
587	300308	中际旭创	8,691	981,300.81	0.05
588	002568	百润股份	39,600	974,556.00	0.05
589	002444	巨星科技	42,900	966,108.00	0.05
590	000589	贵州轮胎	157,800	965,736.00	0.05
591	688096	京源环保	102,000	955,740.00	0.05
592	600642	申能股份	148,300	952,086.00	0.05
593	603758	秦安股份	83,200	951,808.00	0.05
594	300272	开能健康	152,775	947,205.00	0.05
595	688410	山外山	32,200	940,240.00	0.05
596	688556	高测股份	24,000	935,760.00	0.05
597	300394	天孚通信	10,200	933,504.00	0.05
598	603589	口子窖	20,600	933,180.00	0.05
599	000933	神火股份	55,500	932,400.00	0.05
600	603197	保隆科技	16,500	930,600.00	0.05
601	603298	杭叉集团	37,400	930,512.00	0.05
602	300217	东方电热	172,700	929,126.00	0.05
603	603183	建研院	198,800	928,396.00	0.05
604	605300	佳禾食品	59,000	923,940.00	0.05
605	600809	山西汾酒	4,000	922,920.00	0.05
606	000777	中核科技	63,400	921,836.00	0.05
607	603100	川仪股份	33,000	914,760.00	0.05
608	002389	航天彩虹	49,100	913,260.00	0.05
609	688510	航亚科技	51,751	911,852.62	0.05
610	002851	麦格米特	37,000	910,200.00	0.05
611	002611	东方精工	182,500	905,200.00	0.05
612	300898	熊猫乳品	37,400	903,584.00	0.05
613	600391	航发科技	47,200	902,464.00	0.05
614	603170	宝立食品	53,300	901,303.00	0.05
615	300430	诚益通	62,900	898,841.00	0.05
616	000715	中兴商业	122,700	896,937.00	0.05
617	300831	派瑞股份	72,500	888,850.00	0.05
618	002351	漫步者	50,300	888,801.00	0.05
619	601890	亚星锚链	89,500	886,050.00	0.05
620	600641	万业企业	51,300	885,438.00	0.05
621	000811	冰轮环境	65,000	882,050.00	0.05



622	603757	大元泵业	36,200	877,488.00	0.04
623	600150	中国船舶	29,800	877,312.00	0.04
624	300580	贝斯特	28,900	875,092.00	0.04
625	603366	日出东方	140,100	872,823.00	0.04
626	688037	芯源微	6,500	868,465.00	0.04
627	000921	海信家电	42,500	867,000.00	0.04
628	603093	南华期货	72,100	865,200.00	0.04
629	688626	翔宇医疗	16,200	863,298.00	0.04
630	601975	招商南油	307,300	860,440.00	0.04
631	000521	长虹美菱	151,500	852,945.00	0.04
632	300419	浩丰科技	144,100	850,190.00	0.04
633	688578	艾力斯	20,400	849,864.00	0.04
634	600377	宁沪高速	82,400	844,600.00	0.04
635	600502	安徽建工	180,996	841,631.40	0.04
636	688679	通源环境	65,170	836,131.10	0.04
637	601126	四方股份	59,000	835,440.00	0.04
638	603027	千禾味业	51,200	827,904.00	0.04
639	002508	老板电器	37,900	825,462.00	0.04
640	603606	东方电缆	19,300	825,075.00	0.04
641	300567	精测电子	9,300	814,866.00	0.04
642	601717	郑煤机	64,100	810,865.00	0.04
643	688466	金科环境	45,630	809,932.50	0.04
644	002402	和而泰	56,600	808,814.00	0.04
645	603688	石英股份	9,299	807,897.12	0.04
646	001217	华尔泰	57,100	806,252.00	0.04
647	603680	今创集团	85,200	805,140.00	0.04
648	688472	阿特斯	63,707	804,619.41	0.04
649	600282	南钢股份	216,700	801,790.00	0.04
650	600674	川投能源	52,300	790,776.00	0.04
651	000063	中兴通讯	29,850	790,428.00	0.04
652	002463	沪电股份	35,730	790,347.60	0.04
653	600011	华能国际	101,600	782,320.00	0.04
654	300801	泰和科技	45,500	781,690.00	0.04
655	603233	大参林	31,060	773,394.00	0.04
656	688169	石头科技	2,720	769,624.00	0.04
657	688008	澜起科技	13,080	768,580.80	0.04
658	688548	广钢气体	58,648	764,688.00	0.04
659	688652	京仪装备	12,716	762,811.00	0.04
660	301237	和顺科技	25,000	761,750.00	0.04
661	000400	许继电气	34,400	755,424.00	0.04
662	603236	移远通信	14,000	752,500.00	0.04
663	002011	盾安环境	54,700	752,125.00	0.04
664	002151	北斗星通	23,800	751,604.00	0.04

665	688772	珠海冠宇	34,100	750,541.00	0.04
666	002996	顺博合金	68,700	750,204.00	0.04
667	688057	金达莱	52,900	749,064.00	0.04
668	605296	神农集团	24,300	746,739.00	0.04
669	002779	中坚科技	30,000	746,100.00	0.04
670	600398	海澜之家	100,100	742,742.00	0.04
671	603596	伯特利	10,700	741,510.00	0.04
672	300741	华宝股份	34,600	740,786.00	0.04
673	300862	蓝盾光电	17,500	739,200.00	0.04
674	301196	唯科科技	21,500	739,170.00	0.04
675	002929	润建股份	17,700	738,621.00	0.04
676	002777	久远银海	29,400	738,234.00	0.04
677	000016	深康佳 A	176,900	737,673.00	0.04
678	603976	正川股份	37,400	737,154.00	0.04
679	300604	长川科技	19,400	737,006.00	0.04
680	688200	华峰测控	6,000	736,800.00	0.04
681	603806	福斯特	30,100	730,527.00	0.04
682	001336	楚环科技	25,400	729,488.00	0.04
683	002459	晶澳科技	35,200	729,344.00	0.04
684	600188	兖矿能源	36,700	727,027.00	0.04
685	002014	永新股份	86,900	725,615.00	0.04
686	600673	东阳光	98,800	724,204.00	0.04
687	688175	高凌信息	25,834	721,543.62	0.04
688	688099	晶晨股份	11,500	720,245.00	0.04
689	600036	招商银行	25,860	719,425.20	0.04
690	001219	青岛食品	31,200	719,160.00	0.04
691	600475	华光环能	69,000	717,600.00	0.04
692	002544	普天科技	35,300	717,296.00	0.04
693	002722	物产金轮	46,500	716,565.00	0.04
694	600548	深高速	79,700	716,503.00	0.04
695	300458	全志科技	31,500	714,735.00	0.04
696	603797	联泰环保	129,200	713,184.00	0.04
697	600933	爱柯迪	32,400	710,856.00	0.04
698	603026	胜华新材	15,500	710,830.00	0.04
699	000027	深圳能源	110,100	710,145.00	0.04
700	600681	百川能源	180,100	707,793.00	0.04
701	301061	匠心家居	14,200	706,450.00	0.04
702	600505	西昌电力	83,100	705,519.00	0.04
703	300162	雷曼光电	86,900	703,890.00	0.04
704	688433	华曙高科	22,500	703,125.00	0.04
705	002879	长缆科技	43,800	701,676.00	0.04
706	002520	日发精机	106,600	701,428.00	0.04
707	300677	英科医疗	30,000	700,800.00	0.04

708	002358	森源电气	161,000	700,350.00	0.04
709	300281	金明精机	116,500	697,835.00	0.04
710	003004	声迅股份	22,900	697,763.00	0.04
711	600110	诺德股份	123,620	697,216.80	0.04
712	603289	泰瑞机器	63,100	696,624.00	0.04
713	002282	博深股份	86,000	696,600.00	0.04
714	600711	盛屯矿业	159,900	693,966.00	0.04
715	002078	太阳纸业	57,000	693,690.00	0.04
716	002169	智光电气	100,800	693,504.00	0.04
717	300800	力合科技	50,700	693,069.00	0.04
718	000793	华闻集团	317,900	693,022.00	0.04
719	301390	经纬股份	15,900	691,809.00	0.04
720	002249	大洋电机	139,100	691,327.00	0.04
721	300376	易事特	108,500	691,145.00	0.04
722	002717	岭南股份	213,800	690,574.00	0.04
723	688130	晶华微	16,900	690,365.00	0.04
724	603121	华培动力	63,500	690,245.00	0.04
725	603179	新泉股份	13,600	689,656.00	0.04
726	603195	公牛集团	7,200	688,680.00	0.04
727	000651	格力电器	21,400	688,438.00	0.04
728	300980	祥源新材	29,300	687,378.00	0.04
729	300004	南风股份	111,200	687,216.00	0.04
730	001212	中旗新材	28,900	686,664.00	0.04
730	002156	通富微电	29,700	686,664.00	0.04
731	301002	崧盛股份	33,100	686,494.00	0.04
732	301063	海锅股份	30,100	686,280.00	0.04
733	603010	万盛股份	63,600	686,244.00	0.04
734	688585	上纬新材	80,900	685,223.00	0.04
735	301222	浙江恒威	23,034	684,800.82	0.04
736	300889	爱克股份	40,700	683,760.00	0.04
737	600010	包钢股份	468,300	683,718.00	0.04
738	688567	孚能科技	41,900	683,389.00	0.04
739	301027	华蓝集团	54,600	683,046.00	0.04
740	605196	华通线缆	88,600	682,220.00	0.03
741	688010	福光股份	28,309	681,114.54	0.03
742	000529	广弘控股	100,300	681,037.00	0.03
743	603956	威派格	85,700	680,458.00	0.03
744	002408	齐翔腾达	128,862	680,391.36	0.03
745	301200	大族数控	18,000	679,860.00	0.03
746	002831	裕同科技	24,700	679,497.00	0.03
747	601608	中信重工	175,900	678,974.00	0.03
748	002091	江苏国泰	86,700	678,861.00	0.03
749	300111	向日葵	223,200	678,528.00	0.03

750	600026	中远海能	55,400	678,096.00	0.03
751	000911	广农糖业	83,200	678,080.00	0.03
752	601727	上海电气	162,600	678,042.00	0.03
753	300676	华大基因	14,100	676,800.00	0.03
754	002228	合兴包装	197,300	676,739.00	0.03
755	601568	北元集团	142,700	676,398.00	0.03
756	300644	南京聚隆	32,594	676,325.50	0.03
757	000985	大庆华科	41,800	676,324.00	0.03
758	601689	拓普集团	9,200	676,200.00	0.03
759	001288	运机集团	40,200	676,164.00	0.03
760	600805	悦达投资	132,500	675,750.00	0.03
761	600271	航天信息	63,500	675,640.00	0.03
762	300932	三友联众	41,500	675,620.00	0.03
763	000559	万向钱潮	130,100	675,219.00	0.03
764	600221	海航控股	492,600	674,862.00	0.03
765	002418	康盛股份	241,800	674,622.00	0.03
766	688597	煜邦电力	74,093	674,246.30	0.03
767	300943	春晖智控	47,000	673,980.00	0.03
768	603839	安正时尚	81,200	673,960.00	0.03
769	300016	北陆药业	94,600	673,552.00	0.03
770	600744	华银电力	207,800	673,272.00	0.03
771	301201	诚达药业	26,460	672,877.80	0.03
772	600056	中国医药	60,220	672,657.40	0.03
773	300967	晓鸣股份	47,100	672,588.00	0.03
774	300086	康芝药业	114,500	672,115.00	0.03
775	002255	海陆重工	127,000	671,830.00	0.03
776	688307	中润光学	21,600	671,760.00	0.03
777	002268	电科网安	29,900	671,554.00	0.03
778	000709	河钢股份	315,200	671,376.00	0.03
779	300834	星辉环材	31,400	671,332.00	0.03
780	002183	怡亚通	149,800	671,104.00	0.03
781	002734	利民股份	84,200	671,074.00	0.03
782	300502	新易盛	13,600	670,752.00	0.03
783	605259	绿田机械	29,500	669,650.00	0.03
784	600435	北方导航	57,000	669,180.00	0.03
785	600644	乐山电力	96,100	668,856.00	0.03
786	605122	四方新材	41,400	667,782.00	0.03
787	002136	安纳达	57,400	666,988.00	0.03
788	601061	中信金属	86,500	666,915.00	0.03
789	003018	金富科技	62,600	666,690.00	0.03
790	688230	芯导科技	15,934	666,678.56	0.03
791	002298	中电兴发	115,700	666,432.00	0.03
792	300950	德固特	41,300	666,169.00	0.03

793	600917	重庆燃气	103,400	665,896.00	0.03
794	300907	康平科技	30,000	665,700.00	0.03
795	301248	杰创智能	37,800	665,658.00	0.03
796	000723	美锦能源	99,900	665,334.00	0.03
797	002572	索菲亚	41,700	665,115.00	0.03
798	002131	利欧股份	291,700	665,076.00	0.03
799	600538	国发股份	143,300	664,912.00	0.03
800	301127	天源环保	60,500	664,895.00	0.03
801	688087	英科再生	27,600	664,608.00	0.03
802	002884	凌霄泵业	38,200	663,152.00	0.03
803	600273	嘉化能源	77,200	663,148.00	0.03
804	002492	恒基达鑫	110,700	663,093.00	0.03
805	688334	西高院	38,200	662,006.00	0.03
806	601818	光大银行	228,100	661,490.00	0.03
807	601198	东兴证券	80,300	660,869.00	0.03
808	688051	佳华科技	19,800	660,330.00	0.03
809	603192	汇得科技	33,600	660,240.00	0.03
810	000665	湖北广电	137,500	660,000.00	0.03
811	600281	华阳新材	142,100	659,344.00	0.03
812	603689	皖天然气	75,800	658,702.00	0.03
813	601956	东贝集团	110,200	657,894.00	0.03
814	002029	七匹狼	114,700	657,231.00	0.03
815	002650	加加食品	161,000	656,880.00	0.03
816	301212	联盛化学	24,300	656,100.00	0.03
817	301223	中荣股份	36,200	655,944.00	0.03
818	002320	海峡股份	112,500	655,875.00	0.03
819	001333	光华股份	29,598	655,299.72	0.03
820	301356	天振股份	35,980	654,476.20	0.03
821	688538	和辉光电	269,200	654,156.00	0.03
822	000720	新能泰山	158,000	654,120.00	0.03
823	600717	天津港	159,100	653,901.00	0.03
824	688485	九州一轨	46,749	653,551.02	0.03
825	605155	西大门	42,200	653,256.00	0.03
826	002010	传化智联	141,000	651,420.00	0.03
827	002109	兴化股份	137,400	651,276.00	0.03
828	300983	尤安设计	21,200	649,356.00	0.03
829	001286	陕西能源	75,900	648,945.00	0.03
830	001210	金房能源	32,800	647,800.00	0.03
831	601866	中远海发	273,700	640,458.00	0.03
832	002901	大博医疗	15,700	637,263.00	0.03
833	603079	圣达生物	43,400	632,338.00	0.03
834	600285	羚锐制药	36,850	630,503.50	0.03
835	000761	本钢板材	175,500	626,535.00	0.03

836	600699	均胜电子	34,500	619,620.00	0.03
837	002516	旷达科技	123,500	608,855.00	0.03
838	002123	梦网科技	54,300	605,445.00	0.03
839	603997	继峰股份	44,800	603,456.00	0.03
840	600872	中炬高新	21,300	598,530.00	0.03
841	688610	埃科光电	11,524	598,073.08	0.03
842	301079	邵阳液压	34,430	595,639.00	0.03
843	688036	传音控股	4,300	595,120.00	0.03
844	600000	浦发银行	89,100	589,842.00	0.03
845	600309	万华化学	7,600	583,832.00	0.03
846	000937	冀中能源	80,500	574,770.00	0.03
847	300886	华业香料	23,100	572,187.00	0.03
848	600421	华嵘控股	51,200	569,856.00	0.03
849	688219	会通股份	51,441	564,307.77	0.03
850	688669	聚石化学	29,600	554,704.00	0.03
851	688367	工大高科	30,300	540,552.00	0.03
852	600855	航天长峰	50,200	538,144.00	0.03
853	003002	壶化股份	35,400	537,726.00	0.03
854	603955	大千生态	36,600	537,654.00	0.03
855	300449	汉邦高科	79,400	533,568.00	0.03
856	601328	交通银行	92,100	528,654.00	0.03
857	603507	振江股份	20,400	528,564.00	0.03
858	600455	博通股份	21,200	526,820.00	0.03
859	688217	睿昂基因	14,700	525,966.00	0.03
860	688517	金冠电气	33,000	521,070.00	0.03
861	301046	能辉科技	19,200	520,704.00	0.03
862	300122	智飞生物	8,500	519,435.00	0.03
863	002917	金奥博	52,500	518,175.00	0.03
864	603021	山东华鹏	78,600	517,974.00	0.03
865	688218	江苏北人	26,015	516,918.05	0.03
866	688309	恒誉环保	25,807	515,107.72	0.03
867	688589	力合微	12,900	514,839.00	0.03
868	002591	恒大高新	72,400	514,764.00	0.03
869	603856	东宏股份	44,000	513,480.00	0.03
870	688021	奥福环保	24,532	511,492.20	0.03
871	603356	华菱精工	34,900	510,587.00	0.03
872	688655	迅捷兴	33,777	510,032.70	0.03
873	300845	捷安高科	28,200	509,574.00	0.03
874	002633	申科股份	43,500	508,515.00	0.03
875	301040	中环海陆	26,800	508,396.00	0.03
876	002669	康达新材	42,600	507,792.00	0.03
877	002674	兴业科技	41,700	507,489.00	0.03
878	688616	西力科技	37,200	507,408.00	0.03

879	688701	卓锦股份	55,954	506,383.70	0.03
880	300849	锦盛新材	38,200	505,768.00	0.03
881	300626	华瑞股份	46,600	505,610.00	0.03
882	688067	爱威科技	21,200	504,772.00	0.03
883	003017	大洋生物	20,740	504,396.80	0.03
884	301156	美农生物	26,700	503,562.00	0.03
885	300716	泉为科技	43,500	503,295.00	0.03
886	603580	艾艾精工	33,800	503,282.00	0.03
887	300594	朗进科技	24,100	503,208.00	0.03
888	300535	达威股份	28,700	502,537.00	0.03
889	002789	建艺集团	36,500	502,240.00	0.03
890	688379	华光新材	25,400	502,158.00	0.03
891	300611	美力科技	43,700	502,113.00	0.03
892	301158	德石股份	31,200	502,008.00	0.03
893	300270	中威电子	65,000	501,800.00	0.03
894	688193	仁度生物	11,111	501,328.32	0.03
895	600066	宇通客车	37,800	500,850.00	0.03
896	688215	瑞晟智能	13,900	499,705.00	0.03
897	000880	潍柴重机	47,000	499,610.00	0.03
898	301273	瑞晨环保	18,100	499,379.00	0.03
899	300321	同大股份	25,800	499,230.00	0.03
900	600768	宁波富邦	42,100	498,885.00	0.03
901	301037	保立佳	25,000	498,250.00	0.03
902	300509	新美星	68,800	497,424.00	0.03
903	688607	康众医疗	24,400	497,272.00	0.03
904	300329	海伦钢琴	66,700	496,915.00	0.03
905	301300	远翔新材	15,700	496,591.00	0.03
906	300425	中建环能	106,100	496,548.00	0.03
907	300816	艾可蓝	20,100	495,867.00	0.03
908	300717	华信新材	29,500	495,305.00	0.03
909	600778	友好集团	79,100	494,375.00	0.03
910	301125	腾亚精工	26,100	493,812.00	0.03
911	688271	联影医疗	3,602	493,510.02	0.03
912	002295	精艺股份	60,400	493,468.00	0.03
913	002620	瑞和股份	91,500	492,270.00	0.03
914	688178	万德斯	27,200	491,776.00	0.03
915	301010	晶雪节能	26,300	491,547.00	0.03
916	300665	飞鹿股份	56,800	490,752.00	0.03
917	300929	华骐环保	40,300	490,451.00	0.03
918	301336	趣睡科技	11,200	490,448.00	0.03
919	300992	泰福泵业	22,700	489,866.00	0.03
920	603709	中源家居	27,200	489,600.00	0.03
921	003003	天元股份	42,600	489,474.00	0.03

922	301198	喜悦智行	40,300	489,242.00	0.03
923	300640	德艺文创	76,200	489,204.00	0.03
924	301057	汇隆新材	29,100	488,880.00	0.03
925	300961	深水海纳	43,500	488,505.00	0.03
926	600845	宝信软件	10,000	488,000.00	0.03
927	002629	仁智股份	123,800	487,772.00	0.03
928	000668	荣丰控股	38,400	487,680.00	0.03
929	002188	中天服务	74,100	487,578.00	0.02
930	301167	建研设计	28,800	487,296.00	0.02
931	605303	园林股份	39,900	486,780.00	0.02
932	002836	新宏泽	55,500	485,625.00	0.02
933	603316	诚邦股份	72,000	485,280.00	0.02
934	300223	北京君正	7,500	484,875.00	0.02
935	688171	纬德信息	21,500	483,750.00	0.02
936	300703	创源股份	43,000	483,320.00	0.02
937	000929	兰州黄河	49,300	483,140.00	0.02
938	002899	英派斯	29,100	481,605.00	0.02
939	001259	利仁科技	17,000	481,440.00	0.02
940	002890	弘宇股份	31,100	480,495.00	0.02
941	600406	国电南瑞	21,500	479,880.00	0.02
942	603813	原尚股份	29,700	479,655.00	0.02
943	002883	中设股份	39,000	478,920.00	0.02
944	688004	博汇科技	16,300	478,731.00	0.02
945	300152	新动力	163,900	478,588.00	0.02
946	688329	艾隆科技	19,244	478,405.84	0.02
947	603272	联翔股份	28,300	477,704.00	0.02
948	600883	博闻科技	56,200	477,700.00	0.02
949	001211	双枪科技	19,700	475,952.00	0.02
950	002144	宏达高科	40,800	474,096.00	0.02
951	600493	凤竹纺织	70,300	472,416.00	0.02
952	300033	同花顺	3,000	470,610.00	0.02
953	002275	桂林三金	32,200	466,578.00	0.02
954	002236	大华股份	25,200	464,940.00	0.02
955	688326	经纬恒润	4,000	464,200.00	0.02
956	688498	源杰科技	3,111	463,476.78	0.02
957	300405	科隆股份	71,400	461,244.00	0.02
958	300013	新宁物流	121,300	458,514.00	0.02
959	688001	华兴源创	13,066	456,656.70	0.02
960	603296	华勤技术	5,704	454,423.54	0.02
961	688357	建龙微纳	8,562	442,569.78	0.02
962	688166	博瑞医药	12,607	441,245.00	0.02
963	601369	陕鼓动力	54,700	436,506.00	0.02
964	000423	东阿阿胶	8,800	434,016.00	0.02



965	002993	奥海科技	11,000	419,100.00	0.02
966	600184	光电股份	35,500	405,765.00	0.02
967	600276	恒瑞医药	8,961	405,306.03	0.02
968	002088	鲁阳节能	28,200	401,850.00	0.02
969	603129	春风动力	3,922	400,985.28	0.02
970	688528	秦川物联	36,000	397,800.00	0.02
971	300827	上能电气	13,043	394,681.18	0.02
972	603707	健友股份	26,300	394,500.00	0.02
973	688728	格科微	19,064	390,240.08	0.02
974	600350	山东高速	56,200	390,028.00	0.02
975	002775	文科股份	96,700	386,800.00	0.02
976	603305	旭升集团	19,200	378,816.00	0.02
977	688350	富淼科技	22,600	373,578.00	0.02
978	001230	劲旅环境	15,000	351,900.00	0.02
979	603108	润达医疗	16,864	343,182.40	0.02
980	600123	兰花科创	31,060	342,902.40	0.02
981	600919	江苏银行	47,500	317,775.00	0.02
982	300529	健帆生物	14,100	313,443.00	0.02
983	688321	微芯生物	13,452	295,271.40	0.02
984	600985	淮北矿业	16,720	278,053.60	0.01
985	600812	华北制药	47,600	271,320.00	0.01
986	688335	复洁环保	21,000	269,430.00	0.01
987	300615	欣天科技	14,600	230,826.00	0.01
988	603059	倍加洁	9,300	209,808.00	0.01
989	605001	威奥股份	30,200	202,038.00	0.01
990	601319	中国人保	41,600	201,344.00	0.01
991	000852	石化机械	29,300	180,195.00	0.01
992	002367	康力电梯	21,100	158,672.00	0.01
993	688153	唯捷创芯	2,072	135,716.00	0.01
994	301210	金杨股份	2,801	127,389.48	0.01
995	300770	新媒股份	2,600	100,568.00	0.01
996	603886	元祖股份	5,500	100,265.00	0.01
997	688563	航材股份	1,501	90,795.49	0.00
998	301358	湖南裕能	2,023	68,680.85	0.00
999	301260	格力博	3,121	54,242.98	0.00
1,000	301526	国际复材	9,723	43,267.35	0.00
1,001	000557	西部创业	8,600	41,538.00	0.00
1,002	301487	盟固利	867	35,512.32	0.00
1,003	688549	中巨芯	4,294	34,738.46	0.00
1,004	301348	蓝箭电子	613	27,321.41	0.00
1,005	688702	盛科通信	549	26,450.82	0.00
1,006	688582	芯动联科	648	25,058.16	0.00
1,007	301246	宏源药业	931	24,187.38	0.00

1,008	301559	中集环科	1,315	23,985.60	0.00
1,009	301486	致尚科技	482	22,774.50	0.00
1,010	301511	德福科技	982	22,261.94	0.00
1,011	301525	儒竞科技	266	21,668.36	0.00
1,012	301371	敷尔佳	564	21,195.12	0.00
1,013	301370	国科恒泰	1,240	19,852.40	0.00
1,014	301421	波长光电	332	19,710.84	0.00
1,015	301558	三态股份	1,458	19,537.20	0.00
1,016	688591	泰凌微	681	19,081.62	0.00
1,017	300904	威力传动	304	18,705.12	0.00
1,018	301488	豪恩汽电	262	18,101.58	0.00
1,019	301172	君逸数码	438	16,714.08	0.00
1,020	301362	民爆光电	420	16,178.40	0.00
1,021	688612	威迈斯	422	16,023.34	0.00
1,022	601096	宏盛华源	3,918	15,907.08	0.00
1,023	301393	昊帆生物	260	15,436.20	0.00
1,024	301277	新天地	676	14,067.56	0.00
1,025	301408	华人健康	879	14,020.05	0.00
1,026	601083	锦江航运	1,263	13,981.41	0.00
1,027	301439	泓淋电力	949	13,874.38	0.00
1,028	301510	固高科技	396	13,863.96	0.00
1,029	301507	民生健康	851	13,488.35	0.00
1,030	301566	达利凯普	576	12,752.64	0.00
1,031	301456	盘古智能	407	12,368.73	0.00
1,032	301419	阿莱德	330	12,243.00	0.00
1,033	301141	中科磁业	262	12,193.48	0.00
1,034	688602	康鹏科技	1,066	11,789.96	0.00
1,035	688719	爱科赛博	194	11,659.40	0.00
1,036	301281	科源制药	337	11,471.48	0.00
1,037	301550	斯菱股份	260	11,328.20	0.00
1,038	301292	海科新源	583	11,281.05	0.00
1,039	301508	中机认检	419	11,178.92	0.00
1,040	301251	威尔高	321	11,103.39	0.00
1,041	301499	维科精密	371	10,733.03	0.00
1,042	688653	康希通信	648	10,361.52	0.00
1,043	301528	多浦乐	148	10,198.68	0.00
1,044	301329	信音电子	458	10,181.34	0.00
1,045	301261	恒工精密	198	10,068.30	0.00
1,046	301202	朗威股份	306	9,730.80	0.00
1,047	301395	仁信新材	520	9,718.80	0.00
1,048	688716	中研股份	267	9,716.13	0.00
1,049	301386	未来电器	378	9,612.54	0.00
1,050	301357	北方长龙	190	9,591.20	0.00

1,051	301413	安培龙	164	9,543.16	0.00
1,052	301500	飞南资源	455	9,504.95	0.00
1,053	301418	协昌科技	189	9,487.80	0.00
1,054	301516	中远通	604	9,368.04	0.00
1,055	301469	恒达新材	275	9,099.75	0.00
1,056	301519	舜禹股份	442	8,932.82	0.00
1,057	301518	长华化学	385	8,858.85	0.00
1,058	301568	思泰克	246	8,752.68	0.00
1,059	301203	国泰环保	225	8,748.00	0.00
1,060	301520	万邦医药	160	8,438.40	0.00
1,061	688638	誉辰智能	141	8,414.88	0.00
1,062	301459	丰茂股份	208	8,286.72	0.00
1,063	301373	凌玮科技	277	8,213.05	0.00
1,064	688573	信宇人	285	8,208.00	0.00
1,065	301489	思泉新材	128	8,206.08	0.00
1,066	688651	盛邦安全	178	8,196.90	0.00
1,067	301517	陕西华达	185	8,082.65	0.00
1,068	301578	辰奕智能	118	8,061.76	0.00
1,069	301548	崇德科技	136	8,022.64	0.00
1,070	688657	浩辰软件	101	7,901.23	0.00
1,071	688693	锆威特	178	7,726.98	0.00
1,072	301533	威马农机	225	7,461.00	0.00
1,073	301555	惠柏新材	224	7,266.56	0.00
1,074	301505	苏州规划	194	6,947.14	0.00
1,075	301529	福赛科技	182	6,894.16	0.00
1,076	301515	港通医疗	230	6,502.10	0.00
1,077	688648	中邮科技	303	6,493.29	0.00
1,078	301157	华塑科技	150	6,420.00	0.00
1,079	001378	德冠新材	205	6,410.35	0.00
1,080	688450	光格科技	167	6,082.14	0.00
1,081	603004	鼎龙科技	195	6,082.05	0.00
1,082	603270	金帝股份	195	5,768.10	0.00
1,083	603119	浙江荣泰	226	5,394.62	0.00
1,084	603107	上海汽配	292	5,311.48	0.00
1,085	603193	润本股份	303	5,047.98	0.00
1,086	603075	热威股份	182	4,242.42	0.00
1,087	688561	奇安信	102	4,089.18	0.00
1,088	001358	兴欣新材	87	3,841.92	0.00
1,089	001239	永达股份	189	3,764.88	0.00
1,090	603231	索宝蛋白	161	3,466.33	0.00
1,091	603273	天元智能	178	3,376.66	0.00
1,092	603276	恒兴新材	134	3,333.92	0.00
1,093	603373	安邦护卫	88	3,058.00	0.00

1,094	03690	美团-W	40	2,968.78	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	600546	山煤国际	212,293,345.69	5.14
2	688111	金山办公	188,459,311.66	4.56
3	300573	兴齐眼药	183,101,028.35	4.43
4	600487	亨通光电	178,755,508.49	4.32
5	002230	科大讯飞	177,009,609.30	4.28
6	600050	中国联通	165,462,509.00	4.00
7	300750	宁德时代	164,535,230.32	3.98
8	600028	中国石化	160,820,315.15	3.89
9	000568	泸州老窖	156,880,505.00	3.80
10	002271	东方雨虹	156,512,304.28	3.79
11	000661	长春高新	154,693,750.74	3.74
12	600188	兖矿能源	152,986,247.66	3.70
13	600988	赤峰黄金	152,353,166.00	3.69
14	002841	视源股份	145,751,391.63	3.53
15	002459	晶澳科技	139,030,658.36	3.36
16	002508	老板电器	138,924,630.81	3.36
17	600886	国投电力	132,638,689.24	3.21
18	601702	华峰铝业	121,556,924.56	2.94
19	002371	北方华创	121,142,584.05	2.93
20	300593	新雷能	115,879,713.04	2.80
21	603659	璞泰来	115,855,380.37	2.80
22	600426	华鲁恒升	115,399,389.42	2.79
23	600026	中远海能	114,797,982.01	2.78
24	300491	通合科技	108,469,262.80	2.62
25	600570	恒生电子	108,333,375.58	2.62
26	601225	陕西煤业	105,532,411.00	2.55
27	688223	晶科能源	104,395,981.57	2.53
28	300454	深信服	102,233,125.43	2.47
29	000425	徐工机械	99,499,166.00	2.41
30	300274	阳光电源	99,275,991.35	2.40
31	600276	恒瑞医药	99,059,604.60	2.40
32	688358	祥生医疗	97,634,713.70	2.36
33	688023	安恒信息	96,026,563.19	2.32
34	002050	三花智控	94,637,655.00	2.29
35	000921	海信家电	91,992,970.51	2.23
36	300014	亿纬锂能	91,581,570.94	2.22
37	601728	中国电信	91,424,837.18	2.21

38	002179	中航光电	91,240,337.24	2.21
39	601208	东材科技	91,193,346.80	2.21
40	000932	华菱钢铁	91,066,068.00	2.20
41	601636	旗滨集团	89,879,411.50	2.17
42	300308	中际旭创	89,239,706.07	2.16
43	600585	海螺水泥	87,464,117.95	2.12
44	300638	广和通	85,395,320.55	2.07
45	000516	国际医学	84,766,998.00	2.05
46	000858	五粮液	83,168,504.73	2.01

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

#### 8.4.2 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	300573	兴齐眼药	230,829,538.26	5.58
2	600546	山煤国际	218,687,263.46	5.29
3	300750	宁德时代	203,008,616.30	4.91
4	688111	金山办公	193,641,988.47	4.68
5	600188	兖矿能源	161,706,356.06	3.91
5	01171	兖矿能源	23,325,627.35	0.56
6	002271	东方雨虹	184,342,120.18	4.46
7	600487	亨通光电	182,946,059.38	4.43
8	002230	科大讯飞	181,982,838.54	4.40
9	600050	中国联通	168,924,432.24	4.09
10	000568	泸州老窖	155,470,472.80	3.76
11	600988	赤峰黄金	153,362,438.56	3.71
12	600028	中国石化	152,089,874.56	3.68
13	000661	长春高新	151,717,563.35	3.67
14	002841	视源股份	148,986,857.07	3.60
15	002371	北方华创	145,560,568.79	3.52
16	002508	老板电器	144,324,328.38	3.49
17	002459	晶澳科技	144,007,419.12	3.48
18	002179	中航光电	143,734,853.74	3.48
19	600886	国投电力	134,269,192.40	3.25
20	603659	璞泰来	130,568,934.06	3.16
21	601702	华峰铝业	121,001,731.89	2.93
22	300593	新雷能	119,805,513.48	2.90
23	600426	华鲁恒升	118,229,902.75	2.86
24	300491	通合科技	117,671,792.56	2.85
25	601225	陕西煤业	114,540,603.44	2.77
26	600570	恒生电子	112,286,049.80	2.72
27	300308	中际旭创	111,014,215.08	2.69
28	600276	恒瑞医药	110,393,787.74	2.67

29	300502	新易盛	108,841,444.28	2.63
30	600026	中远海能	107,853,627.78	2.61
31	002043	兔宝宝	106,869,063.65	2.59
32	688358	祥生医疗	104,321,060.00	2.52
33	300454	深信服	102,063,194.36	2.47
34	300274	阳光电源	100,403,220.68	2.43
35	688223	晶科能源	98,814,537.18	2.39
36	000425	徐工机械	98,409,100.34	2.38
37	002050	三花智控	95,590,371.04	2.31
38	000921	海信家电	94,638,859.96	2.29
39	688023	安恒信息	90,504,719.27	2.19
40	601208	东材科技	90,206,688.70	2.18
41	300014	亿纬锂能	87,450,653.99	2.12
42	600557	康缘药业	87,261,152.67	2.11
43	300394	天孚通信	85,540,647.83	2.07
44	000932	华菱钢铁	85,268,047.11	2.06
45	300451	创业慧康	85,211,440.77	2.06
46	01024	快手-W	84,379,108.18	2.04
47	000333	美的集团	84,348,270.12	2.04
48	300638	广和通	83,308,852.00	2.02
49	601728	中国电信	82,761,888.82	2.00

注：卖出金额均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.3 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	30,555,265,360.14
卖出股票收入（成交）总额	31,961,488,412.94

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	15,701,164.93	0.80
2	央行票据	-	-
3	金融债券	81,666,915.07	4.19
	其中：政策性金融债	81,666,915.07	4.19
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

10	合计	97,368,080.00	4.99
----	----	---------------	------

## 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	230401	23 农发 01	800,000	81,666,915.07	4.19
2	019727	23 国债 24	156,000	15,701,164.93	0.80

## 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

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

## 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

本基金投资国债期货以套期保值为目的，以回避市场风险。故国债期货空头的合约价值主要与债券组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理国债期货合约数量，以萃取相应债券组合的超额收益。

### 8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 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本报告期内没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 8.12.2

本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选库之外的股票。

### 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	884,603.28

2	应收清算款	3,178,678.72
3	应收股利	191,735.42
4	应收利息	-
5	应收申购款	299,715.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,554,733.37

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本报告中因四舍五入原因，投资组合报告中市值占总资产或净资产比例的分项之和与合计可能存在尾差。

## § 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
181,070	10,125.91	1,485,073,716.40	81.00%	348,424,487.38	19.00%

### 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	408,562.57	0.02%

### 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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0

### 9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

基金经理姓名	产品类型	持有本人管理的产品份额总量的数量区间(万份)
--------	------	------------------------



曲径	公募基金	>100
	私募资产管理计划	0
	合计	>100

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2018年5月16日） 基金份额总额	244,633,211.97
本报告期期初基金份额总额	3,466,644,933.02
本报告期基金总申购份额	262,630,888.44
减：本报告期基金总赎回份额	1,895,777,617.68
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,833,498,203.78

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 11.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

#### 11.2.2 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，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、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

报告期内本基金投资策略未发生重大改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自合同生效日起聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。报告期内本基金未改聘会计师事务所。本年度应支付给所聘任的会计师事务所审计费用为 80,000.00 元人民币。

## 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

报告期内，基金管理人及其高级管理人不存在受稽查或处罚的情况。

### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，托管人及其高级管理人员不存在受稽查或处罚的情况。

## 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 (%)	
民生证券	2	14,070,346,007.81	22.52	8,737,210.49	21.10	-
光大证券	1	4,960,656,347.11	7.94	3,627,757.05	8.76	-
财通证券	1	4,475,424,456.56	7.16	3,272,886.50	7.90	-
中泰证券	2	3,435,034,011.95	5.50	2,512,021.58	6.07	-
东方财富	1	3,037,667,624.84	4.86	2,040,875.60	4.93	-
德邦证券	2	2,959,042,494.56	4.74	1,899,586.25	4.59	-
中信建投	2	2,879,372,421.56	4.61	1,895,428.05	4.58	-
中信证券	2	2,807,514,320.59	4.49	1,810,217.92	4.37	本报告期新增1个
国都证券	3	2,648,666,899.39	4.24	1,924,192.14	4.65	-
国海证券	1	2,530,328,702.71	4.05	1,698,015.30	4.10	本报告期新增1个
申万宏源证券	1	2,035,361,439.50	3.26	1,088,916.18	2.63	-
天风证券	1	1,725,551,823.11	2.76	941,952.47	2.27	-
国泰君安	1	1,564,082,74	2.50	1,056,724.12	2.55	-

		1.07				
西南证券	1	1,410,355,02 1.36	2.26	1,031,394.43	2.49	-
西部证券	1	1,360,356,41 9.97	2.18	994,825.57	2.40	-
华福证券	1	1,202,075,21 5.04	1.92	896,629.09	2.16	本报告期新增 1 个
广发证券	2	1,177,659,21 6.75	1.88	642,873.83	1.55	本报告期新增 1 个
东北证券	2	1,028,215,81 5.82	1.65	751,937.44	1.82	-
东方证券	2	995,460,557. 21	1.59	724,680.73	1.75	-
国金证券	1	961,591,223. 70	1.54	510,896.09	1.23	-
浙商证券	1	932,718,187. 88	1.49	674,716.62	1.63	-
华创证券	1	839,813,933. 62	1.34	451,850.79	1.09	-
华泰证券	2	769,335,823. 22	1.23	562,610.13	1.36	-
海通证券	1	733,180,899. 20	1.17	499,392.39	1.21	-
中金公司	1	639,956,544. 12	1.02	467,997.47	1.13	-
国投证券	1	633,279,695. 59	1.01	341,621.55	0.82	-
东吴证券	1	460,092,971. 02	0.74	251,160.94	0.61	-
国信证券	1	219,429,909. 96	0.35	109,714.93	0.26	-
长江证券	2	-	-	-	-	本报告期新增 1 个
川财证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	本报告期新增

						1 个
平安证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-

注：1、根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能力的基础上，选择基金专用交易席位。2、本报告期内，安信证券变更为国投证券。

### 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	
	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(%)
民生证券	-	-	2,644,000,000.00	9.41	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	3,830,000,000.00	13.63	-	-
中泰证券	-	-	4,717,000,000.00	16.78	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	3,530,000,000.00	12.56	-	-
中信建投	-	-	2,116,000,000.00	7.53	-	-
中信证券	-	-	4,430,000,000.00	15.76	-	-
国都证券	-	-	1,100,000,000.00	3.91	-	-
国海证券	-	-	1,505,999,000.00	5.36	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	15,631,400.52	100.00	448,000,000.00	1.59	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	450,000,000.00	1.60	-	-

华福证 券	-	-	350,000,000. 00	1.25	-	-
广发证 券	-	-	327,000,000. 00	1.16	-	-
东北证 券	-	-	-	-	-	-
东方证 券	-	-	-	-	-	-
国金证 券	-	-	-	-	-	-
浙商证 券	-	-	1,530,000,00 0.00	5.44	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-
华泰证 券	-	-	270,000,000. 00	0.96	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	860,000,000. 00	3.06	-	-
国投证 券	-	-	-	-	-	-
东吴证 券	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
长江证 券	-	-	-	-	-	-
川财证 券	-	-	-	-	-	-
东兴证 券	-	-	-	-	-	-
华安证 券	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-

注：1、根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能力的基础上，选择基金专用交易席位。2、本报告期内，安信证券变更为国投证券。

### 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	中欧量化驱动混合型证券投资基金	中国证监会指定媒介	2023-01-20

	2022 年第四季度报告		
2	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2022 年第四季度报告提示性公告	中国证监会指定媒介	2023-01-20
3	中欧基金管理有限公司关于调整中欧量化驱动混合型证券投资基金大额申购、转换转入及定期定额投资限额的公告	中国证监会指定媒介	2023-02-10
4	中欧基金管理有限公司部分部门办公地址变更公告	中国证监会指定媒介	2023-02-17
5	中欧量化驱动混合型证券投资基金 2022 年年度报告	中国证监会指定媒介	2023-03-31
6	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2022 年年度报告	中国证监会指定媒介	2023-03-31
7	中欧量化驱动混合型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	中国证监会指定媒介	2023-04-22
8	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2023 年第一季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2023-04-22
9	中欧基金管理有限公司关于公司股权变更的公告	中国证监会指定媒介	2023-06-03
10	中欧量化驱动混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定媒介	2023-06-29
11	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2023 年第 2 季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2023-07-21
12	中欧量化驱动混合型证券投资基金 2023 年第 2 季度报告	中国证监会指定媒介	2023-07-21
13	中欧量化驱动混合型证券投资基金 2023 年中期报告	中国证监会指定媒介	2023-08-31
14	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2023 年中期报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2023-08-31
15	中欧量化驱动混合型证券投资基金恢复大额申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	中国证监会指定媒介	2023-10-18
16	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2023 年第三季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2023-10-25
17	中欧量化驱动混合型证券投资基金 2023 年第 3 季度报告	中国证监会指定媒介	2023-10-25
18	中欧量化驱动混合型证券投资基金更新招募说明书（2023 年 12 月）	中国证监会指定媒介	2023-12-20
19	中欧量化驱动混合型证券投资基金更新招募说明书（2023 年 12 月）	中国证监会指定媒介	2023-12-20

## § 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 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	753,519,264.36	0.00	200,000,000.00	553,519,264.36	30.19%
	2	2023 年 12 月 22 日至 2023 年 12 月 31 日	399,091,308.77	0.00	0.00	399,091,308.77	21.77%
产品特有风险							
本基金本报告期存在单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况，在市场情况突变的情况下，可能出现集中甚至巨额赎回从而引发基金的流动性风险，本基金管理人将对申购赎回进行审慎的应对，并在基金运作中对流动性进行严格的管理，降低流动性风险，保护中小投资者利益。							

注：申购份额含红利再投份额、转换入份额，赎回份额含转换出份额。

### 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、中国证监会准予中欧量化驱动混合型证券投资基金变更注册的文件
- 2、《中欧量化驱动混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《中欧量化驱动混合型证券投资基金托管协议》
- 4、《中欧量化驱动混合型证券投资基金招募说明书》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、本报告期内在中国证监会指定媒介上公开披露的各项公告

### 13.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

### 13.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站(www.zofund.com)查阅，或在营业时间内至基金管理人办公场所免费查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人中欧基金管理有限公司：

客户服务中心电话：021-68609700，400-700-9700

中欧基金管理有限公司

2024 年 3 月 29 日