

# 申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)

2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：申万菱信基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年八月三十日

## 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。本中期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 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>1 重要提示及目录</b> .....	2
1.1 重要提示.....	2
<b>2 基金简介</b> .....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>4 管理人报告</b> .....	9
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遵规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
<b>5 托管人报告</b> .....	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	13
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.....	14
5.3 托管人对本中期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 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 净资产变动表.....	16
6.4 报表附注.....	18
6.4.1 基金基本情况.....	18
6.4.2 会计报表的编制基础.....	19
6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明.....	19
6.4.4 重要会计政策和会计估计.....	20
6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明.....	20
6.4.6 税项.....	20
6.4.7 重要财务报表项目的说明.....	22
6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明.....	27
6.4.9 关联方关系.....	28
6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易.....	28
6.4.11 利润分配情况.....	32
6.4.12 期末（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券.....	32
6.4.13 金融工具风险及管理.....	35
6.4.14 公允价值.....	42
6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项.....	42
<b>7 投资组合报告</b> .....	43

7.1 期末基金资产组合情况 .....	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	43
7.3 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 .....	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	62
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	64
7.6 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 .....	64
7.7 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 .....	64
7.8 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 .....	64
7.9 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 .....	64
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	64
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	64
7.12 投资组合报告附注 .....	64
<b>8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>65</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	65
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	66
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	66
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	67
<b>9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>67</b>
<b>10 重大事件揭示 .....</b>	<b>67</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	67
10.2 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 .....	67
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	68
10.4 基金投资策略的改变 .....	68
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件 .....	68
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	68
10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	68
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	68
<b>11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>72</b>
<b>12 备查文件目录 .....</b>	<b>73</b>
12.1 备查文件目录 .....	73
12.2 存放地点 .....	73
12.3 查阅方式 .....	73

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)	
基金简称	申万菱信量化小盘股票(LOF)	
场内简称	申万量化 LOF	
基金主代码	163110	
交易代码	163110	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2011 年 6 月 16 日	
基金管理人	申万菱信基金管理有限公司	
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	553,617,601.57 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2011 年 8 月 1 日	
下属分级基金的基金简称	申万菱信量化小盘股票 (LOF)A	申万菱信量化小盘股票 (LOF)C
下属分级基金的交易代码	163110	013918
报告期末下属分级基金的份额总额	553,292,235.54 份	325,366.03 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用数量化的投资方法精选个股，严格按照纪律执行，力争获取长期稳定的超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金坚持数量化的投资策略，专注于小盘股的投资。基金管理人基于对国内股票市场的大量实证研究，专门开发了适合小盘股投资的量化投资模型（简称“量化小盘投资模型”），作为本基金投资的核心。本基金的股票选择行为，都是基于该投资模型而定。这种完全基于模型的量化投资方法能够更加客观、公正而理性的去分析和筛选股票，并且不受外部分析师的影响，极大的减少了投资者情绪的影响，从而能够保持投资策略的一致性与有效性。
业绩比较基准	90%×中证 500 指数收益率+10%×银行同业存款收益率（税后）
风险收益特征	本基金是一只量化股票型基金，属于较高预期风险和较高预期收益的证券投资品种，其风险收益特征从长期平均来看高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	申万菱信基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	王菲萍	郭明
	联系电话	021-23261188	010-66105799
	电子邮箱	service@swsmu.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008808588	95588
传真		021-23261199	010-66105798
注册地址		上海市中山南路100号11层	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		上海市中山南路100号11层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		200010	100140
法定代表人		陈晓升	廖林

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.swsmu.com
基金中期报告备置地点	申万菱信基金管理有限公司 中国工商银行股份有限公司

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## 3 主要财务指标和基金净值表现

### 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	报告期（2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日）	
	申万菱信量化小盘股票 (LOF)A	申万菱信量化小盘股票 (LOF)C
本期已实现收益	-248,686,632.84	-30,734,025.07
本期利润	-228,814,751.53	-92,301,719.44
加权平均基金份额本期利润	-0.4073	-1.9324
本期加权平均净值利润率	-23.92%	-106.75%
本期基金份额净值增长率	-21.43%	-21.82%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	
	申万菱信量化小盘股票 (LOF)A	申万菱信量化小盘股票 (LOF)C

期末可供分配利润	256,611,201.43	172,071.58
期末可供分配基金份额利润	0.4638	0.5289
期末基金资产净值	857,568,896.25	497,437.61
期末基金份额净值	1.5499	1.5289
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2024年6月30日)</b>	
	申万菱信量化小盘股票 (LOF)A	申万菱信量化小盘股票 (LOF)C
基金份额累计净值增长率	162.85%	-36.76%

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、上述基金业绩指标已扣除了基金的管理费、托管费和各项交易费用，但不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如：申购费、赎回费等），计入认购或交易基金各项费用后，实际收益水平要低于所列数字。

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

申万菱信量化小盘股票(LOF)A

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
过去一个月	-7.32%	1.27%	-6.21%	0.86%	-1.11%	0.41%
过去三个月	-11.40%	1.56%	-5.82%	1.03%	-5.58%	0.53%
过去六个月	-21.43%	2.10%	-7.96%	1.45%	-13.47%	0.65%
过去一年	-25.37%	1.60%	-15.81%	1.15%	-9.56%	0.45%
过去三年	-33.76%	1.31%	-24.59%	1.08%	-9.17%	0.23%
自基金合同生效起至今	162.85%	1.44%	13.70%	1.40%	149.15%	0.04%

申万菱信量化小盘股票(LOF)C

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
过去一个月	-7.35%	1.27%	-6.21%	0.86%	-1.14%	0.41%
过去三个月	-11.49%	1.56%	-5.82%	1.03%	-5.67%	0.53%
过去六个月	-21.82%	2.10%	-7.96%	1.45%	-13.86%	0.65%
过去一年	-25.89%	1.60%	-15.81%	1.15%	-10.08%	0.45%
自基金合同生效起至今	-36.76%	1.33%	-26.95%	1.09%	-9.81%	0.24%

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平

要低于所列数字。

2、本基金业绩比较基准为： $90\% \times \text{中证 500 指数收益率} + 10\% \times \text{银行同业存款收益率（税后）}$ 。

### 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

申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)

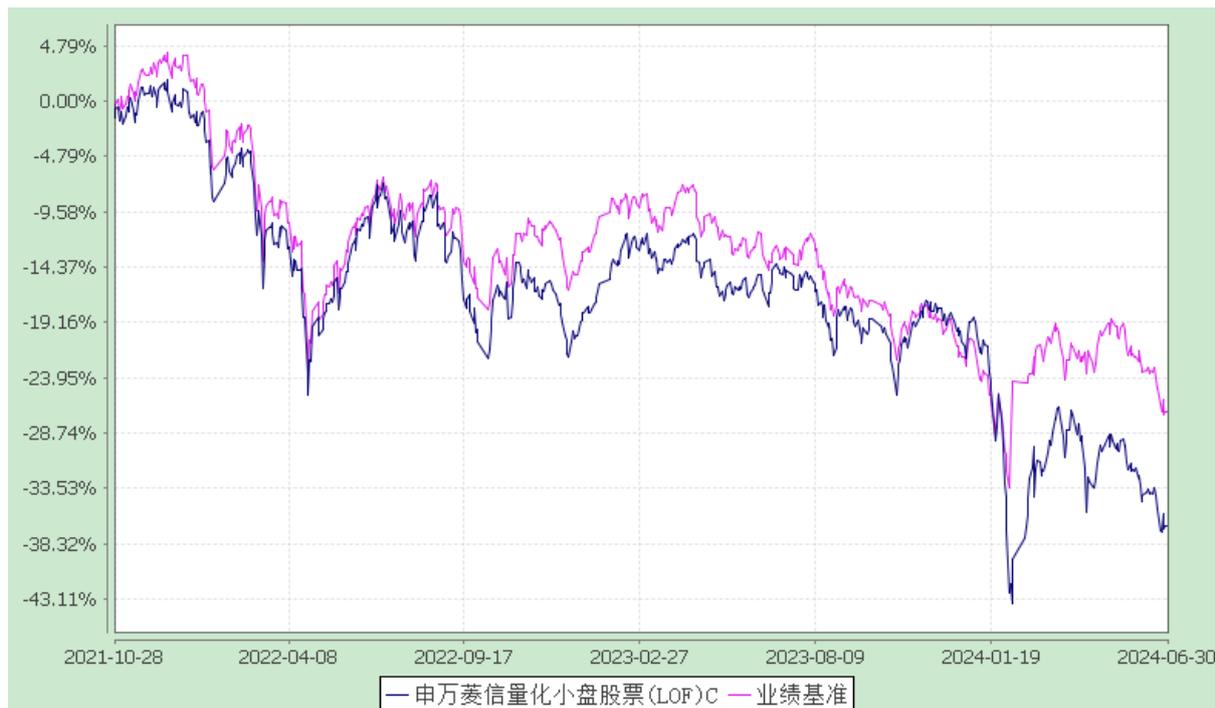
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2011 年 6 月 16 日至 2024 年 6 月 30 日)

申万菱信量化小盘股票(LOF)A



申万菱信量化小盘股票(LOF)C



注：本基金在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

## 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

申万菱信基金自成立以来，始终将持有人的利益放在首位，秉持“研究至善”的愿景、“长期致胜”的使命，遵循“诚于心、行于矩、敏于变”的企业价值观。近年来，申万菱信基金围绕市场和客户需求，逐渐形成“投资美好生活、创新理财服务”的产品规划；通过努力打造“美好生活”系列权益产品，不断丰富“全市场、宽基指数与增强、主题指数、量化对冲、固收+、另类投资和纯固收”等产品大类，致力于为持有人提供“温暖陪伴”的服务，以努力达成“长期致胜”的使命。公司现有公募基金 81 只，资产管理规模 1128.23 亿元，公募产品累计分红 213.53 亿元。（数据截至 2024 年 6 月 30 日）

近年来，申万菱信基金通过建设关键假设平台(Key Assumption Platform)，推动“研究数字化”；通过基金经理的风格开发、稳定和优化，推动“投资风格化”；通过风险管理工作的关口前移，加强市场风险管理支持，推动“风控全流程”，从而不断建设申万菱信基金的“机构理性”，以提升投资业绩。此外，申万菱信基金还持续打造卓越战略与产品管理体系（Excellent Strategy & Product）、卓越品牌与客户服务体系（Excellent Branding & Service），提升面向不同类别客户的全方位专业服务水平。

申万菱信基金股东实力雄厚，中央汇金公司控股的申万宏源证券持有公司 67%的股份，日本三菱 UFJ 信托银行持有公司 33%的股份。申万菱信基金拥有公开募集证券投资基金管理人、特定客户资产管理人、合格境内机构投资者(QDII)管理人、保险资金投资管理人、基金投资顾问、合格境内有限合伙人(QDLP)等业务资格，并全资设立申万菱信(上海)资产管理有限公司，专门从事特定客户资产管理业务和专项资产管理业务。公司曾多次荣获中国基金业金牛奖、中国明星基金奖、中国金基金奖等多项业内重量级奖项以及东方财富“最佳指数投资团队”等荣誉。

展望未来，申万菱信基金将紧紧依托双方股东优势，不断深化体制机制改革，以更加市场化的导向推动专业队伍的全方位发展，努力将公司打造成为一家优秀乃至卓越的资产管理机构！

(注：基金管理人与股东之间实行业务隔离制度)

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王剑	本基金基金经理	2021-03-22	-	8 年	王剑先生，博士研究生。2015 年起从事金融相关工作，曾任职于东证期货、浙商基金等。2020 年 12 月加入申万菱信基金，曾任申万菱信智量混合型证券投资基金基金经理，现任申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)、申万菱信国证 2000 指数增强型发起式证券投资基金、申万菱信沪深 300 优选指数增强发起式证券投资基金、申万菱信碳中和智选混合型发起式证券投资基金、申万菱信智能生活量化选股混合型发起式证券投资基金基金经理。

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行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

#### 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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》及其配套法规的规定，严格遵守基金合同约定，本着诚实信用、勤勉尽责等原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的

基础上为持有人谋求最大利益。

本基金投资运作符合法律法规和基金合同的规定,信息披露及时、准确、完整;本基金资产与本基金管理人及公司资产之间严格分开;没有发生内幕交易、操纵市场和不当关联交易及其他违规行为。在基金资产的管理运作中,无任何损害基金持有人利益的行为,并通过稳健经营、规范运作、规避风险,保护了基金持有人的合法权益。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,本公司制定了《公平交易办法》,通过组织结构的设置、工作制度、流程和技术手段全面落实公平交易原则在具体业务(包括研究分析、投资决策、交易执行等)环节中的实现,在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时,确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会;同时,通过对投资交易行为的日常监控和事后分析评估来加强对公平交易过程和结果的监督。

在研究分析方面,本公司建立了规范、完善的研究管理平台,规范了研究人员的投资建议、研究报告的发布流程,使各投资组合经理在获取投资建议的及时性、准确性及深度等方面得到公平对待。

在投资决策方面,首先,公司建立健全投资授权制度,明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限。投资决策委员会和投资总监等管理机构和人员不得对投资经理在授权范围内的投资活动进行干预。投资经理在授权范围内可以自主决策,超过投资权限的操作必须经过严格的审批程序;其次,公司建立投资组合投资信息的管理及保密制度,除分管投资副总及投资总监等因业务管理的需要外,不同投资经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离;另外,公司还建立机制要求公募投资经理与特定客户资产投资经理互相隔离,且不能互相授权投资事宜。

在交易执行方面,本公司设立了独立于投资管理职能的交易部,实行了集中交易制度和公平的交易分配制度:(1)对于交易所公开竞价的同向交易,内部制定了专门的交易规则,保证各投资组合获得公平的交易执行机会;(2)对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易,各投资经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量,集中交易室按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配;(3)对于银行间市场的现券交易,交易部在银行间市场开展独立、公平的询价,并由风险管理部对交易价格的公允性(根据市场公认的第三方信息)、交易对手和交易方式进行事前审核,确保交易得到公平和公允的执行。

在日常监控和事后分析评估方面，本公司风险管理部开展日内和定期的工作对公平交易执行情况作整体监控和效果评估。其中日常监控包括了日内不定点对交易系统的抽查监控；对非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购的申购方案和分配过程进行审核和监控；以及对银行间交易过程中投资组合与交易对手之间议价交易的交易方式和交易价格的公允性进行审查。事后分析评估上，风险管理部在每个季度和每年度的《公平交易执行报告》中，对不同组合间同一投资标的、临近交易日的同向交易和反向交易的合理性开展分析评估。

本公司通过事前的制度规范、事中的监控和事后的分析评估，严格执行了公平交易制度，公平对待了旗下各投资组合。本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司制定了《异常交易监控与报告办法》，明确定义了投资交易过程中出现的各种可能导致不公平交易和利益输送的异常交易类型，并规定且落实了异常交易的日常监控、识别以及事后的分析流程。

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期，未发生我司旗下投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况以及其他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

2024 年上半年，股市呈现出显著的分化现象。沪深 300 指数所代表的大型股票表现相对出色，而中证 2000 指数所代表的小型股票则出现调整。这种分化的原因有两方面：首先，由于过去几年小市值股票的过于集中，当市场风格发生调整时，在反身性效应的影响下，小市值股票受到较大压力；其次，随着国九条政策的推出，市场更加重视分红和公司基本面，而许多小市值公司的财务状况有待改善，导致投资者倾向于那些分红率高且基本面相对稳健的大型股票。从投资风格的角度来看，小市值股票回撤较大，而低估值、高分红的股票则表现相对出色。

在宏观经济基本面方面，与内需相关的消费、房地产和基础设施建设等领域表现较弱，而与外需相关的领域则持续改善，并通过制造业为经济稳定增长提供了支撑。从当前的视角来看，A 股市场的整体预期收益率（ERP）处于相对高位，这为权益类资产的后续表现提供了乐观的预期。基于此，预计未来基金会保持较高的仓位运作。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金 A 类产品报告期内净值表现为-21.43%,同期业绩基准表现为-7.96%。

本基金 C 类产品报告期内净值表现为-21.82%,同期业绩基准表现为-7.96%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，以行业轮动和多因子模型方式进行选股，结合机器学习的方式，争取做出超额收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值政策及净值计算的复核责任。会计师事务所所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性发表专业意见。

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值委员会，并制定了相关制度及流程。估值委员会主要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与合理。本基金管理人估值委员会成员包括分管基金运营的高级管理人员、督察长、分管基金投资研究的高级管理人员、基金研究部门负责人、基金运营部门负责人、法律合规与审计部门负责人、风险管理部门负责人。以上成员均具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规、基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与最终决策和日常估值的执行。参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

报告期内，本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据和流通受限股票的折扣率数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所债券市场的估值数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

## 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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本基金的管理人——申万菱信基金管理有限公司在本基金的投资运作、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，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

## 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对申万菱信基金管理有限公司编制和披露的本基金 2024 年中期报告中财务指标、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 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	89,531,698.20	142,658,835.69
结算备付金		15,818,868.25	43,475,235.23
存出保证金		5,521,139.84	9,561,903.49
交易性金融资产	6.4.7.2	751,459,788.42	1,428,916,287.82
其中：股票投资		751,459,788.42	1,428,916,287.82
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		893,765.50	-
应收股利		-	-
应收申购款		47,054.25	57,370.62
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		863,272,314.46	1,624,669,632.85

负债和净资产	附注号	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		444,810.85	3,211,317.46
应付赎回款		87,370.65	204,332.90
应付管理人报酬		871,023.18	1,607,638.62
应付托管费		145,170.52	267,939.79
应付销售服务费		165.91	162,620.13
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	6.4.7.6	3,657,439.49	5,139,611.90
负债合计		5,205,980.60	10,593,460.80
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	553,617,601.57	820,330,899.88
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	304,448,732.29	793,745,272.17
净资产合计		858,066,333.86	1,614,076,172.05
负债和净资产总计		863,272,314.46	1,624,669,632.85

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额总额 553,617,601.57 份。A 类基金份额净值 1.5499 元，份额总额 553,292,235.54 份；C 类基金份额净值 1.5289 元，份额总额 325,366.03 份。

## 6.2 利润表

会计主体：申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年1月1日至 2024年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至 2023年6月30日
<b>一、营业总收入</b>		-313,655,208.65	45,663,156.39
1.利息收入		392,686.45	151,871.96
其中：存款利息收入	6.4.7.9	392,686.45	151,871.96
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-

2.投资收益（损失以“-”填列）		-273,208,942.09	7,632,507.62
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-264,331,880.51	753,611.48
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-2,059.18
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-16,843,359.15	-61,625.82
股利收益	6.4.7.15	7,966,297.57	6,942,581.14
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-41,695,813.06	37,867,482.62
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	856,860.05	11,294.19
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>7,461,262.32</b>	<b>6,200,116.09</b>
1. 管理人报酬		6,159,317.48	5,118,602.66
2. 托管费		1,026,552.95	853,100.48
3. 销售服务费		160,441.51	113,635.15
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		-	330.37
8. 其他费用	6.4.7.19	114,950.38	114,447.43
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-321,116,470.97</b>	<b>39,463,040.30</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-321,116,470.97</b>	<b>39,463,040.30</b>
五、其他综合收益的税后净额		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-321,116,470.97</b>	<b>39,463,040.30</b>

### 6.3 净资产变动表

会计主体：申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	820,330,899.88	-	793,745,272.17	1,614,076,172.05
二、本期期初净资产	820,330,899.88	-	793,745,272.17	1,614,076,172.05

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-266,713,298.31	-	-489,296,539.88	-756,009,838.19
（一）、综合收益总额	-	-	-321,116,470.97	-321,116,470.97
（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）	-266,713,298.31	-	-168,180,068.91	-434,893,367.22
其中：1.基金申购款	163,239,477.92	-	96,118,290.64	259,357,768.56
2.基金赎回款	-429,952,776.23	-	-264,298,359.55	-694,251,135.78
（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	553,617,601.57	-	304,448,732.29	858,066,333.86
项目	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日			
	实收基金	其他综合收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	263,537,314.47	-	246,717,069.80	510,254,384.27
二、本期期初净资产	263,537,314.47	-	246,717,069.80	510,254,384.27
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	158,080,881.45	-	205,948,546.04	364,029,427.49
（一）、综合收益总额	-	-	39,463,040.30	39,463,040.30
（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）	158,080,881.45	-	166,485,505.74	324,566,387.19
其中：1.基金申购款	168,775,172.75	-	178,053,071.53	346,828,244.28
2.基金赎回款	-10,694,291.30	-	-11,567,565.79	-22,261,857.09
（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	421,618,195.92	-	452,665,615.84	874,283,811.76

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：汪涛，主管会计工作负责人：汪涛，会计机构负责人：徐越

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

申万菱信量化小盘股票型证券投资基金（LOF）（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”）证监基金字[2011]525 号《关于核准申万菱信量化小盘股票型证券投资基金（LOF）募集的批复》核准，由申万菱信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《申万菱信量化小盘股票型证券投资基金（LOF）基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 512,877,725.48 元。经向中国证监会备案，《申万菱信量化小盘股票型证券投资基金（LOF）基金合同》于 2011 年 6 月 16 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 512,987,683.05 份基金份额，其中认购资金利息折合 109,957.57 份基金份额。本基金的基金管理人为申万菱信基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

经深圳证券交易所深证上[2011]225 号文审核同意，本基金 63,363,855 份基金份额于 2011 年 8 月 1 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外，基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。根据《关于申万菱信量化小盘股票型证券投资基金（LOF）增加 C 类基金份额并相应修订基金合同及托管协议的公告》，本基金自 2021 年 10 月 25 日起增加 C 类基金份额。增加 C 类份额后，原有的持有本基金份额的投资人，其基金账户中保留的本基金份额余额为 A 类基金份额。A 类基金份额在投资者申购时收取手续费，不计提销售服务费；C 类基金份额从本类别基金资产中计提销售服务费，不收取手续费。本基金新增的 C 类基金份额不开放场内申购与赎回，不上市交易。C 类基金份额投资者仅可通过场外方式对基金份额进行申购与赎

回。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)基金合同》和最新公布的《申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)更新招募说明书》的有关规定,本基金投资于流动性良好的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票及存托凭证)、债券、权证、资产支持证券、股指期货、股票期权以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。本基金可以参与融资业务。

本基金各类资产投资比例为:本基金投资于股票及存托凭证的资产不低于基金资产的 80%,投资于本基金界定的小盘股及存托凭证占非现金基金资产的比例不低于 80%。每个交易日日终,在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金投资股指期货、权证、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为:中证 500 指数收益率 $\times$ 90%+银行同业存款收益率(税后) $\times$ 10%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称“企业会计准则”)的要求,同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2024 年 6 月 30 日的财务状况、2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税 [2004] 78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、财税 [2015] 101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2008] 1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2016] 36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、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》、财税 [2017] 2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税 [2017] 56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023] 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部税务总局公告 2024 年第 8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

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

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(b) 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。

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(c) 对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息红利所得，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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 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。

对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

(d) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(e) 对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

## 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
活期存款	89,531,698.20
等于：本金	89,523,099.85
加：应计利息	8,598.35
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	89,531,698.20

## 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	808,485,203.40	-	751,459,788.42	-57,025,414.98
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
	资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

合计	808,485,203.40	-	751,459,788.42	-57,025,414.98
----	----------------	---	----------------	----------------

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30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	46,060,588.57	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	46,060,588.57	-	-	-

#### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IM2412	IM2412	1.00	937,800.00	-90,860.00
IH2407	IH2407	4.00	2,838,720.00	5,640.00
IM2408	IM2408	1.00	963,720.00	3,520.00
IM2407	IM2407	16.00	15,545,600.00	-686,584.57
IM2409	IM2409	24.00	22,944,960.00	-2,061,504.00
合计	-	-	-	-2,829,788.57
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	-2,829,788.57
净额	-	-	-	-

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

## 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	62.83
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	3,549,146.77
其中：交易所市场	3,549,146.77
银行间市场	-
应付利息	-
其他应付款	12,754.51
预提审计费用	35,803.04
预提信息披露费用	59,672.34
合计	3,657,439.49

## 6.4.7.7 实收基金

申万菱信量化小盘股票(LOF)A

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	575,962,683.72	575,962,683.72
本期申购	101,545,460.79	101,545,460.79
本期赎回（以“-”号填列）	-124,215,908.97	-124,215,908.97
本期末	553,292,235.54	553,292,235.54

申万菱信量化小盘股票(LOF)C

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	244,368,216.16	244,368,216.16
本期申购	61,694,017.13	61,694,017.13
本期赎回（以“-”号填列）	-305,736,867.26	-305,736,867.26

本期末	325,366.03	325,366.03
-----	------------	------------

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.8 未分配利润

申万菱信量化小盘股票(LOF)A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	518,806,108.09	41,456,390.30	560,262,498.39
本期期初	518,806,108.09	41,456,390.30	560,262,498.39
本期利润	-248,686,632.84	19,871,881.31	-228,814,751.53
本期基金份额交易产生的变动数	-13,508,273.82	-13,662,812.33	-27,171,086.15
其中：基金申购款	64,455,211.16	-3,153,545.36	61,301,665.80
基金赎回款	-77,963,484.98	-10,509,266.97	-88,472,751.95
本期已分配利润	-	-	-
本期末	256,611,201.43	47,665,459.28	304,276,660.71

申万菱信量化小盘股票(LOF)C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	245,907,046.16	-12,424,272.38	233,482,773.78
本期期初	245,907,046.16	-12,424,272.38	233,482,773.78
本期利润	-30,734,025.07	-61,567,694.37	-92,301,719.44
本期基金份额交易产生的变动数	-214,988,836.83	73,979,854.07	-141,008,982.76
其中：基金申购款	42,620,614.63	-7,803,989.79	34,816,624.84
基金赎回款	-257,609,451.46	81,783,843.86	-175,825,607.60
本期已分配利润	-	-	-
本期末	184,184.26	-12,112.68	172,071.58

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	199,910.03
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	186,987.80
其他	5,788.62
合计	392,686.45

**6.4.7.10 股票投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	4,581,417,757.92
减：卖出股票成本总额	4,834,641,129.76
减：交易费用	11,108,508.67
买卖股票差价收入	-264,331,880.51

**6.4.7.11 债券投资收益**

本基金本报告期无债券投资收益。

**6.4.7.12 资产支持证券投资收益****6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成**

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.13 贵金属投资收益**

本基金本报告期无贵金属投资收益。

**6.4.7.14 衍生工具收益**

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股指期货投资收益	-16,843,359.15

**6.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	7,966,297.57
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	7,966,297.57

**6.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
1.交易性金融资产	-40,095,874.09

——股票投资	-40,095,874.09
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-1,599,938.97
——权证投资	-
——期货投资	-1,599,938.97
4.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	-41,695,813.06

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	856,854.37
基金转换费收入	5.68
合计	856,860.05

#### 6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内未发生信用减值损失。

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	35,803.04
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
汇划手续费	875.00
合计	114,950.38

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

无。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
申万菱信基金管理有限公司（以下简称“申万菱信”）	基金管理人、基金销售机构
申万宏源证券有限公司（以下简称“申万宏源”）	基金管理人的股东、基金销售机构
三菱 UFJ 信托银行株式会社	基金管理人的股东
中国工商银行股份有限公司（以下简称“中国工商银行”）	基金托管人、基金销售机构
申万菱信（上海）资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 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	
	2024年1月1日至2024年6月30日		2023年1月1日至2023年6月30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
申万宏源	1,056,413,416.59	12.04%	1,262,981,743.88	27.31%

##### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

##### 6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30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
申万宏源	994,074.66	12.04%	439,363.17	12.38%
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30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
申万宏源	1,169,532.64	27.32%	433,463.34	21.28%

注：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，以扣除证券公司需承担的费用后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月 30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6 月30日
当期发生的基金应支付的管理费	6,159,317.48	5,118,602.66
其中：支付销售机构的客户维护费	642,778.16	940,918.05
应支付基金管理人的净管理费	5,516,539.32	4,177,684.61

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.20% 的年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2024年1月1日至2024年6月 30日	2023年1月1日至2023年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,026,552.95	853,100.48

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。

### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关 联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	申万菱信量化小盘 股票(LOF)A	申万菱信量化小盘股票 (LOF)C	合计
中国工商银行	-	11.18	11.18
申万菱信	-	145,100.53	145,100.53
合计	-	145,111.71	145,111.71
获得销售服务费的各关 联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	申万菱信量化小盘 股票(LOF)A	申万菱信量化小盘股票 (LOF)C	合计
中国工商银行	-	-	-
申万菱信	-	80,331.61	80,331.61
合计	-	80,331.61	80,331.61

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%，销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.40% 年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times \text{C 类基金销售服务费年费率} / \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

**6.4.10.4 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****6.4.10.4.1 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。

**6.4.10.4.2 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。

**6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况****6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本报告期内和上年度可比期间内，本基金管理人未发生运用固有资金投资本基金的情况。

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

本期末和上年度末，除基金管理人之外的其他关联方未发生投资本基金的情况。

**6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2024年1月1日至2024年6月30日		2023年1月1日至2023年6月30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	89,531,698.20	199,910.03	74,001,529.80	92,257.95

**6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

**6.4.10.8 其他关联交易事项的说明****6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明**

无。

**6.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用**

无。

### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

### 6.4.12 期末（2024年6月30日）本基金持有的流通受限证券

#### 6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 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
001359	平安电工	2024-03-19	1-6个月(含)	新股限售	17.39	20.61	184.00	3,199.76	3,792.24	-
001379	腾达科技	2024-01-11	1-6个月(含)	新股限售	16.98	13.48	213.00	3,616.74	2,871.24	-
001387	雪祺电气	2024-01-04	1-6个月(含)	新股限售	15.38	15.23	133.00	2,045.54	2,025.59	-
001387	雪祺电气	2024-06-03	1-6个月(含)	新股限售-送股	0.00	15.23	40.00	0.00	609.20	限售期送股
001389	广合科技	2024-03-26	1-6个月(含)	新股限售	17.43	42.03	222.00	3,869.46	9,330.66	-
301392	汇成真真空	2024-05-28	1-6个月(含)	新股限售	12.20	55.87	219.00	2,671.80	12,235.53	-
301502	华阳智能	2024-01-26	1-6个月(含)	新股限售	28.01	37.81	138.00	3,865.38	5,217.78	-
301536	星辰科技	2024-03-20	1-6个月(含)	新股限售	16.16	32.26	481.00	7,772.96	15,517.06	-
301538	骏鼎达	2024-03-13	1-6个月(含)	新股限售	55.82	91.22	107.00	5,972.74	9,760.54	-
301538	骏鼎达	2024-05-22	1-6个月(含)	新股限售-送股	0.00	91.22	43.00	0.00	3,922.46	限售期送股

301539	宏鑫科技	2024-04-03	1-6个月(含)	新股限售	10.64	24.30	361.00	3,841.04	8,772.30	-
301565	中仑新材	2024-06-13	1-6个月(含)	新股限售	11.88	23.32	711.00	8,446.68	16,580.52	-
301566	达利凯普	2023-12-22	1-6个月(含)	新股限售	8.90	16.75	576.00	5,126.40	9,648.00	-
301580	爱迪特	2024-06-19	1-6个月(含)	新股限售	44.95	74.00	202.00	9,079.90	14,948.00	-
301587	中瑞股份	2024-03-27	1-6个月(含)	新股限售	21.73	27.10	306.00	6,649.38	8,292.60	-
603082	北自科技	2024-01-23	1-6个月(含)	新股限售	21.28	29.48	107.00	2,276.96	3,154.36	-
603285	键邦股份	2024-06-28	1个月内(含)	认购新发证券	18.65	18.65	1,158.00	21,596.70	21,596.70	-
603285	键邦股份	2024-06-28	1-6个月(含)	新股限售	18.65	18.65	129.00	2,405.85	2,405.85	-
603312	西典新能	2024-01-04	1-6个月(含)	新股限售	29.02	25.34	130.00	3,772.60	3,294.20	-
603325	博隆技术	2024-01-03	1-6个月(含)	新股限售	72.46	68.02	66.00	4,782.36	4,489.32	-
603341	龙旗科技	2024-02-23	1-6个月(含)	新股限售	26.00	37.47	298.00	7,748.00	11,166.06	-
603344	星德胜	2024-03-13	1-6个月(含)	新股限售	19.18	22.66	182.00	3,490.76	4,124.12	-
603350	安乃达	2024-06-26	1个月内(含)	认购新发证券	20.56	20.56	945.00	19,429.20	19,429.20	-
603350	安乃达	2024-06-26	1-6个月(含)	新股限售	20.56	20.56	106.00	2,179.36	2,179.36	-
603375	盛景微	2024-01-17	1-6个月	新股限售	38.18	38.88	72.00	2,748.96	2,799.36	-

			(含)							
60338 1	永臻 股份	2024-0 6-19	1-6 个 月 (含)	新股 限售	23.35	26.59	178.00	4,156. 30	4,733. 02	-
68853 0	欧莱 新材	2024-0 4-29	1-6 个 月 (含)	新股 限售	9.60	18.96	344.00	3,302. 40	6,522. 24	-
68869 1	灿芯 股份	2024-0 4-02	1-6 个 月 (含)	新股 限售	19.86	49.38	247.00	4,905. 42	12,196 .86	-
68869 2	达梦 数据	2024-0 6-04	1-6 个 月 (含)	新股 限售	86.96	209.54	175.00	15,218 .00	36,669 .50	-
68869 5	中创 股份	2024-0 3-06	1-6 个 月 (含)	新股 限售	22.43	31.54	186.00	4,171. 98	5,866. 44	-
68870 9	成都 华微	2024-0 1-31	1-6 个 月 (含)	新股 限售	15.69	18.77	1,045. 00	16,396 .05	19,614 .65	-

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票 代码	股票 名称	停牌 日期	停牌 原因	期末估 值单价	复牌 日期	复牌 开 盘单 价	数量 (单位：股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
00083 6	ST 富 通	2024-06 -18	重大事 项停牌	0.09	-	-	1,061,500.0 0	2,168,788.18	95,535.00	重大 事项

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 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。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 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。

#### 6.4.12.4 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。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

本基金为股票型基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资等。与这些金融工具有关的风险，以及本基金管理人管理这些风险所采取的风险管理政策如下所述。

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是股票型证券投资基金，属于中高风险品种，本基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使得本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“长期平均风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金”。

本基金管理人已制定针对以上金融工具风险的管理政策和控制制度，并且形成了由本基金管理人在公司层面建立的风险管理委员会以及在董事会层面建立的风险控制委员会负责对与所投资金融工具相关的风险类型、管理政策和各种投资限制的定期回顾、评估和修改，本基金管理人的风险管理部门负责具体落实和日常跟踪的工作机制。

本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。

本基金面临的主要风险包括：信用风险、流动性风险和市场风险。与本基金相关的市场风险主要是其他价格风险。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指金融工具的一方到期无法履行约定义务致使本基金遭受损失的风险。本基金的信用风险主要来源于金融工具的发行者或是交易对手不能履行约定义务而产生。

本基金的银行存款存放在本基金的托管行或其他国内大中型商业银行，本基金管理人认为与以上银行相关的信用风险不重大。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成债券等投资品种的交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小，本基金管理人认为在交易所进行的交易涉及的信用风险不重大。

对于银行间债券等品种的交易，本基金管理人主要通过事前检查和控制交易对手信用及交割方式来管理风险。

对于发行者的信用风险控制，本基金管理人主要通过对投资品种的信用等级评估来选择适当的投资对象来管理。于本期末，本基金持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占净资产的比例为 0%（上期末：0%）。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指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主要来源于基金兑付赎回资金的流动性风险，以及因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险以及因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。

本基金管理人已经建立涵盖制度、流程、组织架构、制衡机制、风险处置等方面的流动性风险管控体系；建立以压力测试为核心、覆盖全类型产品的基金流动性风险监测与预警制度及风险应对预案。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金管理人已经建立针对公募基金申购赎回状况的监控和预测机制以及建立了巨额赎回审批规程，对于巨额赎回建立严格的流动性评估机制；此外，本基金管理人在基金合同约定巨额赎回条款，设计了非常情况下赎回资金的处理模式，控制因开放模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对资产的流动性风险，本基金管理人持续监控和预测旗下基金的各项流动性指标，包括组合持仓集中度指标、投资组合在短时间内变现能力的综合指标、组合持仓中变现能力较差的品种的比例控制和流通受限资产的总量控制，通过指标来持续地评估、选择、跟踪和控制投资组合的投资流动性风险。

除了上述日常流动性管理机制外，本基金管理人已建立压力测试制度，针对不同类型投资组合建立流动性压力测试模型，对各相关风险因子进行极端假设，进而评估对投资组合流动性的负面影响。此外，本基金管理人已建立流动性风险应急机制，一旦发生或认为可能发生较大的流动性风险，本基金管理人会立即启动相应的应急流程。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余是流动性较好的可在银行间同业市场交易的金融资产工具、银行存款和结算备付金，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过净资产的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。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。于本期末，除附注“期末债券正回购交易中作为抵押的债券”中列示的卖出回购证券款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他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。

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

综合上述各项流动性指标的监测结果、流动性风险管理措施的实施以及本基金的资产和负债情况，本基金管理人认为本基金在本报告期内流动性情况良好。

#### **6.4.13.4 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。

##### **6.4.13.4.1 利率风险**

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。

于本期末，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。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年6月30 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	89,531,698.20	-	-	-	-	-	89,531,698.20
结算备付金	15,818,868.25	-	-	-	-	-	15,818,868.25
存出保证金	333,443.84	-	-	-	-	5,187,696.00	5,521,139.84
交易性金融资产	-	-	-	-	-	751,459,788.42	751,459,788.42
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	893,765.50	893,765.50
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	47,054.25	47,054.25
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	105,684,010.29	-	-	-	-	757,588,304.17	863,272,314.46
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	444,810.85	444,810.85
应付赎回款	-	-	-	-	-	87,370.65	87,370.65
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	871,023.18	871,023.18
应付托管费	-	-	-	-	-	145,170.52	145,170.52

应付销售服务费	-	-	-	-	-	165.91	165.91
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	3,657,439.49	3,657,439.49
负债总计	-	-	-	-	-	5,205,980.60	5,205,980.60
利率敏感度缺口	105,684.01	-	-	-	-	752,382.32	858,066.33
	0.29					3.57	3.86
上年度末							
2023 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	142,658,835.69	-	-	-	-	-	142,658,835.69
结算备付金	43,475,235.23	-	-	-	-	-	43,475,235.23
存出保证金	304,777.09	-	-	-	-	9,257,126.40	9,561,903.49
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,428,916.287.82	1,428,916.287.82
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	57,370.62	57,370.62
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	186,438,848.01	-	-	-	-	1,438,230.784.84	1,624,669,632.85
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	3,211,317.4	3,211,317.4

						6	6
应付赎回款	-	-	-	-	-	204,332.90	204,332.90
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,607,638.62	1,607,638.62
应付托管费	-	-	-	-	-	267,939.79	267,939.79
应付销售服务费	-	-	-	-	-	162,620.13	162,620.13
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	5,139,611.90	5,139,611.90
负债总计	-	-	-	-	-	10,593,460.80	10,593,460.80
利率敏感度缺口	186,438,848.01	-	-	-	-	1,427,637,324.04	1,614,076,172.05

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。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末，本基金持有交易性债券投资公允价值占净资产的比例为 0%（上期末：0%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上期末：同）。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

基金的其他价格风险是指以交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险，该风险可能与特定投资品种相关，也有可能与整体投资品种相关。本基金的市场价格风险主要来源于本基金投资的股权和债权工具的未来价格可能受到一般市场波动或是其他影响个别股权工具价值的特定风险影响。由于本基金是一只中高风险的量化股票型基金，所以存在很高的市场价格风险。

本基金管理人通过采用数量化技术对投资策略进行优化，将特定的投资思想和理念通过具体指标与参数的设定体现在数量模型中，坚持以数量化的方式进行投资。

此外，本基金管理人在构建基金资产配置和资产投资组合的基础上，通过建立事前和事后跟踪误差以及运用多种定量的方法对基金进行风险度量，来测试基金的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制，争取将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	751,459,788. 42	87.58	1,428,916,287 .82	88.53
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	-	-	-	-
<b>合计</b>	<b>751,459,788. 42</b>	<b>87.58</b>	<b>1,428,916,287 .82</b>	<b>88.53</b>

注：其他包含股指期货投资，于本期末，持仓数量为46手，合约市值为43230800元(附注6.4.7.3)。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，则其他中包含的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得持仓损益)之间按抵消后的金额为0。

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准（见附注 6.4.1）中的股票指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	基准上升 5%	增加约 3,828	增加约 7,618
基准下降 5%	减少约 3,828	减少约 7,618	

## 6.4.14 公允价值

### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

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到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

#### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	751,080,488.46	1,426,734,858.01
第二层次	45,611.11	1,761,687.59
第三层次	333,688.85	419,742.22
合计	751,459,788.42	1,428,916,287.82

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。对于本基金投资的证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况时，本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值的层次。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2024 年 6 月 30 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具（2023 年 12 月 31 日：无）。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于 2024 年 6 月 30 日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

## 7 投资组合报告

## 7.1 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	751,459,788.42	87.05
	其中：股票	751,459,788.42	87.05
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	105,350,566.45	12.20
8	其他各项资产	6,461,959.59	0.75
9	合计	863,272,314.46	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

## 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	3,170,567.00	0.37
B	采矿业	17,898,965.00	2.09
C	制造业	487,147,226.78	56.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	25,221,773.00	2.94
E	建筑业	14,961,083.28	1.74
F	批发和零售业	33,037,469.88	3.85
G	交通运输、仓储和邮政业	27,638,285.08	3.22
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	66,795,194.81	7.78
J	金融业	34,135,337.55	3.98

K	房地产业	12,762,254.96	1.49
L	租赁和商务服务业	6,542,558.12	0.76
M	科学研究和技术服务业	2,934,503.40	0.34
N	水利、环境和公共设施管理业	9,703,660.00	1.13
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	375,760.00	0.04
Q	卫生和社会工作	2,829,664.00	0.33
R	文化、体育和娱乐业	6,305,485.56	0.73
S	综合	-	-
	合计	751,459,788.42	87.58

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	002498	汉缆股份	1,409,400.00	4,636,926.00	0.54
2	002267	陕天然气	518,400.00	3,919,104.00	0.46
3	600252	中恒集团	1,717,800.00	3,727,626.00	0.43
4	601718	际华集团	1,486,700.00	3,687,016.00	0.43
5	000727	冠捷科技	1,746,100.00	3,596,966.00	0.42
6	002705	新宝股份	254,700.00	3,583,629.00	0.42
7	000403	派林生物	130,200.00	3,471,132.00	0.40
8	000951	中国重汽	241,700.00	3,461,144.00	0.40
9	600623	华谊集团	592,900.00	3,426,962.00	0.40
10	600577	精达股份	849,700.00	3,373,309.00	0.39
11	300059	东方财富	310,500.00	3,278,880.00	0.38
12	600273	嘉化能源	436,868.00	3,119,237.52	0.36
13	603583	捷昌驱动	152,000.00	3,097,760.00	0.36
14	601609	金田股份	538,200.00	3,046,212.00	0.36
15	300166	东方国信	464,548.00	2,843,033.76	0.33
16	600248	陕建股份	779,900.00	2,831,037.00	0.33

17	688002	睿创微纳	100,654.00	2,815,292.38	0.33
18	000848	承德露露	357,500.00	2,809,950.00	0.33
19	601126	四方股份	146,000.00	2,806,120.00	0.33
20	300458	全志科技	119,100.00	2,800,041.00	0.33
21	600688	上海石化	1,071,200.00	2,795,832.00	0.33
22	688779	长远锂科	587,200.00	2,718,736.00	0.32
23	002390	信邦制药	813,600.00	2,693,016.00	0.31
24	603093	南华期货	301,000.00	2,606,660.00	0.30
25	002171	楚江新材	391,400.00	2,579,326.00	0.30
26	002004	华邦健康	674,400.00	2,562,720.00	0.30
27	605158	华达新材	394,300.00	2,535,349.00	0.30
28	600206	有研新材	279,600.00	2,488,440.00	0.29
29	600007	中国国贸	112,451.00	2,469,423.96	0.29
30	603626	科森科技	439,500.00	2,443,620.00	0.28
31	600017	日照港	914,000.00	2,440,380.00	0.28
32	300770	新媒股份	73,000.00	2,436,740.00	0.28
33	600366	宁波韵升	466,700.00	2,436,174.00	0.28
34	002041	登海种业	301,300.00	2,434,504.00	0.28
35	002291	遥望科技	563,100.00	2,421,330.00	0.28
36	002681	奋达科技	662,800.00	2,419,220.00	0.28
37	688278	特宝生物	45,129.00	2,416,657.95	0.28
38	000591	太阳能	512,600.00	2,414,346.00	0.28
39	002434	万里扬	492,500.00	2,413,250.00	0.28
40	000623	吉林敖东	179,800.00	2,409,320.00	0.28
41	601992	金隅集团	1,757,600.00	2,407,912.00	0.28
42	002108	沧州明珠	786,300.00	2,406,078.00	0.28
43	603025	大豪科技	174,100.00	2,406,062.00	0.28
44	603393	新天然气	69,000.00	2,397,060.00	0.28
45	600169	太原重工	1,309,000.00	2,395,470.00	0.28
46	600459	贵研铂业	177,000.00	2,391,270.00	0.28
47	600446	金证股份	239,500.00	2,378,235.00	0.28
48	000523	红棉股份	917,000.00	2,375,030.00	0.28
49	002110	三钢闽光	804,600.00	2,373,570.00	0.28
50	002093	国脉科技	391,000.00	2,373,370.00	0.28
51	600552	凯盛科技	251,576.00	2,372,361.68	0.28
52	600998	九州通	485,681.00	2,370,123.28	0.28
53	600305	恒顺醋业	327,200.00	2,365,656.00	0.28
54	600780	通宝能源	399,800.00	2,358,820.00	0.27
55	600821	金开新能	458,600.00	2,357,204.00	0.27
56	601015	陕西黑猫	841,700.00	2,356,760.00	0.27
57	603077	和邦生物	1,427,400.00	2,355,210.00	0.27

			0		
58	000600	建投能源	372,900.00	2,349,270.00	0.27
59	000935	四川双马	195,600.00	2,349,156.00	0.27
60	300451	创业慧康	674,400.00	2,333,424.00	0.27
61	600515	海南机场	742,800.00	2,332,392.00	0.27
62	600739	辽宁成大	277,700.00	2,324,349.00	0.27
63	603995	甬金股份	132,400.00	2,319,648.00	0.27
64	600170	上海建工	1,078,200.00	2,318,130.00	0.27
65	601330	绿色动力	396,400.00	2,307,048.00	0.27
66	002859	洁美科技	114,200.00	2,293,136.00	0.27
67	002237	恒邦股份	197,000.00	2,267,470.00	0.26
68	601677	明泰铝业	195,800.00	2,263,448.00	0.26
69	002245	蔚蓝锂芯	291,600.00	2,259,900.00	0.26
70	002215	诺普信	300,100.00	2,235,745.00	0.26
71	600033	福建高速	665,700.00	2,230,095.00	0.26
72	688018	乐鑫科技	22,586.00	2,228,786.48	0.26
73	600320	振华重工	648,400.00	2,217,528.00	0.26
74	688578	艾力斯	34,714.00	2,212,670.36	0.26
75	603699	纽威股份	129,200.00	2,211,904.00	0.26
76	600761	安徽合力	102,100.00	2,209,444.00	0.26
77	600285	羚锐制药	90,800.00	2,198,268.00	0.26
78	002053	云南能投	181,700.00	2,196,753.00	0.26
79	301219	腾远钴业	57,100.00	2,184,646.00	0.25
80	000915	华特达因	72,020.00	2,172,123.20	0.25
81	601101	昊华能源	236,100.00	2,169,759.00	0.25
82	601886	江河集团	442,681.00	2,160,283.28	0.25
83	605333	沪光股份	77,300.00	2,152,805.00	0.25
84	002351	漫步者	163,400.00	2,148,710.00	0.25
85	601375	中原证券	628,300.00	2,142,503.00	0.25
86	301308	江波龙	22,600.00	2,141,124.00	0.25
87	600037	歌华有线	357,000.00	2,134,860.00	0.25
88	002139	拓邦股份	201,000.00	2,134,620.00	0.25
89	000550	江铃汽车	98,300.00	2,134,093.00	0.25
90	601001	晋控煤业	128,500.00	2,122,820.00	0.25
91	002906	华阳集团	79,100.00	2,116,716.00	0.25
92	000990	诚志股份	283,800.00	2,111,472.00	0.25
93	600458	时代新材	207,647.00	2,097,234.70	0.24
94	688208	道通科技	86,400.00	2,085,696.00	0.24
95	601678	滨化股份	599,200.00	2,085,216.00	0.24
96	300049	福瑞股份	41,400.00	2,084,076.00	0.24
97	601608	中信重工	541,500.00	2,063,115.00	0.24
98	600269	赣粤高速	396,400.00	2,049,388.00	0.24
99	002437	誉衡药业	1,199,700.00	2,039,490.00	0.24

			0		
100	300113	顺网科技	199,000.00	2,037,760.00	0.24
101	688006	杭可科技	116,700.00	2,036,415.00	0.24
102	603236	移远通信	43,500.00	2,032,755.00	0.24
103	688484	南芯科技	54,600.00	2,025,660.00	0.24
104	002219	新里程	1,083,300.00	2,014,938.00	0.23
105	002961	瑞达期货	183,100.00	2,004,945.00	0.23
106	688575	亚辉龙	85,798.00	2,000,809.36	0.23
107	000709	河钢股份	1,030,400.00	1,998,976.00	0.23
108	002468	申通快递	236,300.00	1,984,920.00	0.23
109	300034	钢研高纳	124,300.00	1,975,127.00	0.23
110	002936	郑州银行	1,139,700.00	1,971,681.00	0.23
111	002318	久立特材	84,300.00	1,966,719.00	0.23
112	002537	海联金汇	379,000.00	1,959,430.00	0.23
113	603113	金能科技	357,700.00	1,956,619.00	0.23
114	601702	华峰铝业	106,700.00	1,948,342.00	0.23
115	300428	立中集团	104,500.00	1,942,655.00	0.23
116	603881	数据港	152,810.00	1,942,215.10	0.23
117	601228	广州港	634,800.00	1,936,140.00	0.23
118	300687	赛意信息	138,900.00	1,933,488.00	0.23
119	000100	TCL 科技	445,400.00	1,924,128.00	0.22
120	601952	苏垦农发	213,100.00	1,922,162.00	0.22
121	002891	中宠股份	91,000.00	1,899,170.00	0.22
122	002249	大洋电机	401,400.00	1,898,622.00	0.22
123	603233	大参林	132,600.00	1,896,180.00	0.22
124	600480	凌云股份	192,000.00	1,887,360.00	0.22
125	600020	中原高速	532,700.00	1,885,758.00	0.22
126	002635	安洁科技	121,500.00	1,875,960.00	0.22
127	000030	富奥股份	382,000.00	1,875,620.00	0.22
128	603919	金徽酒	103,100.00	1,873,327.00	0.22
129	300415	伊之密	90,100.00	1,872,278.00	0.22
130	000065	北方国际	180,500.00	1,871,785.00	0.22
131	300627	华测导航	62,200.00	1,856,670.00	0.22
132	002534	西子洁能	184,100.00	1,842,841.00	0.21
133	300188	国投智能	165,800.00	1,842,038.00	0.21
134	601038	一拖股份	116,500.00	1,841,865.00	0.21
135	300634	彩讯股份	109,300.00	1,839,519.00	0.21
136	000543	皖能电力	207,300.00	1,834,605.00	0.21
137	000498	山东路桥	349,900.00	1,829,977.00	0.21
138	603103	横店影视	132,000.00	1,826,880.00	0.21
139	601326	秦港股份	573,800.00	1,818,946.00	0.21

140	603556	海兴电力	38,800.00	1,817,004.00	0.21
141	000690	宝新能源	355,800.00	1,814,580.00	0.21
142	600718	东软集团	219,000.00	1,811,130.00	0.21
143	000156	华数传媒	288,000.00	1,808,640.00	0.21
144	002315	焦点科技	66,800.00	1,800,928.00	0.21
145	300088	长信科技	381,900.00	1,794,930.00	0.21
146	688123	聚辰股份	29,432.00	1,790,348.56	0.21
147	605218	伟时电子	110,800.00	1,789,420.00	0.21
148	300142	沃森生物	156,900.00	1,785,522.00	0.21
149	600330	天通股份	261,900.00	1,780,920.00	0.21
150	002266	浙富控股	638,300.00	1,780,857.00	0.21
151	000488	晨鸣纸业	513,700.00	1,777,402.00	0.21
152	603989	艾华集团	126,400.00	1,777,184.00	0.21
153	002275	桂林三金	143,200.00	1,777,112.00	0.21
154	000681	视觉中国	154,100.00	1,772,150.00	0.21
155	600967	内蒙一机	246,000.00	1,771,200.00	0.21
156	600869	远东股份	507,500.00	1,771,175.00	0.21
157	300446	航天智造	148,300.00	1,764,770.00	0.21
158	600651	飞乐音响	639,100.00	1,763,916.00	0.21
159	600717	天津港	412,200.00	1,760,094.00	0.21
160	600123	兰花科创	196,300.00	1,756,885.00	0.20
161	300747	锐科激光	98,600.00	1,750,150.00	0.20
162	300748	金力永磁	134,900.00	1,748,304.00	0.20
163	600410	华胜天成	451,700.00	1,748,079.00	0.20
164	600664	哈药股份	660,100.00	1,742,664.00	0.20
165	000597	东北制药	450,300.00	1,742,661.00	0.20
166	300296	利亚德	387,000.00	1,741,500.00	0.20
167	002978	安宁股份	62,500.00	1,741,250.00	0.20
168	002151	北斗星通	72,000.00	1,740,960.00	0.20
169	601519	大智慧	312,500.00	1,737,500.00	0.20
170	002239	奥特佳	754,100.00	1,734,430.00	0.20
171	603181	皇马科技	192,400.00	1,729,676.00	0.20
172	601882	海天精工	75,400.00	1,727,414.00	0.20
173	002371	北方华创	5,400.00	1,727,406.00	0.20
174	600496	精工钢构	673,700.00	1,724,672.00	0.20
175	002506	协鑫集成	887,100.00	1,720,974.00	0.20
176	600787	中储股份	357,700.00	1,720,537.00	0.20
177	002698	博实股份	140,171.00	1,719,898.17	0.20
178	603599	广信股份	141,200.00	1,712,756.00	0.20
179	600409	三友化工	340,500.00	1,709,310.00	0.20
180	300409	道氏技术	199,000.00	1,703,440.00	0.20
181	002065	东华软件	376,400.00	1,701,328.00	0.20
182	002518	科士达	96,100.00	1,700,970.00	0.20
183	688055	龙腾光电	536,353.00	1,700,239.01	0.20

184	600966	博汇纸业	355,100.00	1,697,378.00	0.20
185	301078	孩子王	335,260.00	1,696,415.60	0.20
186	600618	氯碱化工	193,100.00	1,695,418.00	0.20
187	601137	博威合金	110,100.00	1,677,924.00	0.20
188	600750	江中药业	72,500.00	1,675,475.00	0.20
189	300185	通裕重工	973,400.00	1,674,248.00	0.20
190	301071	力量钻石	60,400.00	1,673,684.00	0.20
191	000718	苏宁环球	991,700.00	1,666,056.00	0.19
192	600810	神马股份	267,800.00	1,660,360.00	0.19
193	300953	震裕科技	30,600.00	1,658,520.00	0.19
194	688100	威胜信息	43,411.00	1,656,129.65	0.19
195	000923	河钢资源	95,600.00	1,646,232.00	0.19
196	300476	胜宏科技	50,900.00	1,642,034.00	0.19
197	600064	南京高科	270,200.00	1,640,114.00	0.19
198	002048	宁波华翔	126,200.00	1,633,028.00	0.19
199	601311	骆驼股份	203,600.00	1,632,872.00	0.19
200	002158	汉钟精机	97,400.00	1,628,528.00	0.19
201	688076	诺泰生物	20,800.00	1,628,224.00	0.19
202	600475	华光环能	186,300.00	1,622,673.00	0.19
203	300115	长盈精密	135,100.00	1,619,849.00	0.19
204	301050	雷电微力	33,600.00	1,618,176.00	0.19
205	600648	外高桥	182,500.00	1,616,950.00	0.19
206	002061	浙江交科	442,300.00	1,614,395.00	0.19
207	002153	石基信息	281,641.00	1,613,802.93	0.19
208	002946	新乳业	184,000.00	1,611,840.00	0.19
209	603297	永新光学	26,500.00	1,602,985.00	0.19
210	002993	奥海科技	43,020.00	1,600,344.00	0.19
211	002773	康弘药业	73,900.00	1,599,935.00	0.19
212	601163	三角轮胎	105,100.00	1,599,622.00	0.19
213	000528	柳工	142,400.00	1,593,456.00	0.19
214	600278	东方创业	296,300.00	1,591,131.00	0.19
215	688289	圣湘生物	90,308.00	1,587,614.64	0.19
216	601860	紫金银行	634,000.00	1,585,000.00	0.18
217	000758	中色股份	311,500.00	1,582,420.00	0.18
218	000821	京山轻机	139,500.00	1,580,535.00	0.18
219	300679	电连技术	39,200.00	1,577,016.00	0.18
220	600100	同方股份	306,600.00	1,560,594.00	0.18
221	002745	木林森	193,600.00	1,560,416.00	0.18
222	600916	中国黄金	161,900.00	1,557,478.00	0.18
223	600158	中体产业	201,800.00	1,551,842.00	0.18
224	300638	广和通	90,700.00	1,550,970.00	0.18
225	000686	东北证券	277,700.00	1,549,566.00	0.18
226	000034	神州数码	67,600.00	1,547,364.00	0.18
227	601279	英利汽车	414,800.00	1,547,204.00	0.18

228	600850	电科数字	85,300.00	1,543,930.00	0.18
229	688336	三生国健	74,900.00	1,524,215.00	0.18
230	688127	蓝特光学	82,173.00	1,511,161.47	0.18
231	600323	瀚蓝环境	72,000.00	1,504,800.00	0.18
232	001309	德明利	17,360.00	1,499,904.00	0.17
233	688408	中信博	16,220.00	1,493,537.60	0.17
234	002233	塔牌集团	203,300.00	1,486,123.00	0.17
235	600216	浙江医药	134,500.00	1,476,810.00	0.17
236	002911	佛燃能源	161,100.00	1,472,454.00	0.17
237	601811	新华文轩	105,000.00	1,471,050.00	0.17
238	002034	旺能环境	112,900.00	1,468,829.00	0.17
239	002701	奥瑞金	353,000.00	1,468,480.00	0.17
240	301327	华宝新能	25,600.00	1,466,880.00	0.17
241	300857	协创数据	25,500.00	1,453,500.00	0.17
242	000536	华映科技	719,500.00	1,453,390.00	0.17
243	603609	禾丰股份	221,300.00	1,447,302.00	0.17
244	600125	铁龙物流	242,300.00	1,446,531.00	0.17
245	000567	海德股份	256,950.00	1,441,489.50	0.17
246	002402	和而泰	134,000.00	1,435,140.00	0.17
247	000795	英洛华	258,100.00	1,429,874.00	0.17
248	600740	山西焦化	360,500.00	1,413,160.00	0.16
249	603871	嘉友国际	79,820.00	1,412,015.80	0.16
250	600596	新安股份	185,700.00	1,411,320.00	0.16
251	002515	金字火腿	370,700.00	1,404,953.00	0.16
252	002456	欧菲光	179,800.00	1,404,238.00	0.16
253	600933	爱柯迪	94,400.00	1,396,176.00	0.16
254	603505	金石资源	49,700.00	1,388,121.00	0.16
255	603983	丸美股份	50,164.00	1,381,014.92	0.16
256	605599	菜百股份	108,300.00	1,378,659.00	0.16
257	000426	兴业银锡	101,500.00	1,378,370.00	0.16
258	300596	利安隆	50,700.00	1,375,491.00	0.16
259	002214	大立科技	121,600.00	1,371,648.00	0.16
260	300180	华峰超纤	388,100.00	1,369,993.00	0.16
261	600776	东方通信	139,300.00	1,369,319.00	0.16
262	002287	奇正藏药	69,500.00	1,360,810.00	0.16
263	603043	广州酒家	85,200.00	1,360,644.00	0.16
264	600685	中船防务	48,700.00	1,358,730.00	0.16
265	600601	方正科技	448,400.00	1,345,200.00	0.16
266	002204	大连重工	314,400.00	1,342,488.00	0.16
267	000061	农产品	276,000.00	1,341,360.00	0.16
268	002461	珠江啤酒	179,900.00	1,334,858.00	0.16
269	001914	招商积余	133,100.00	1,333,662.00	0.16
270	000725	京东方A	325,400.00	1,330,886.00	0.16
271	300140	节能环保	222,400.00	1,327,728.00	0.15

272	603368	柳药集团	75,774.00	1,326,045.00	0.15
273	300705	九典制药	49,500.00	1,323,630.00	0.15
274	000811	冰轮环境	137,100.00	1,323,015.00	0.15
275	688586	江航装备	142,000.00	1,320,600.00	0.15
276	600993	马应龙	49,500.00	1,320,165.00	0.15
277	600562	国睿科技	96,600.00	1,319,556.00	0.15
278	600710	苏美达	161,500.00	1,316,225.00	0.15
279	600597	光明乳业	169,200.00	1,314,684.00	0.15
280	601975	招商南油	365,500.00	1,312,145.00	0.15
281	603229	奥翔药业	130,400.00	1,310,520.00	0.15
282	688050	爱博医疗	17,851.00	1,308,835.32	0.15
283	603997	继峰股份	127,800.00	1,307,394.00	0.15
284	688739	成大生物	53,935.00	1,307,384.40	0.15
285	300685	艾德生物	74,100.00	1,307,124.00	0.15
286	002088	鲁阳节能	108,000.00	1,305,720.00	0.15
287	688235	百济神州	11,250.00	1,303,200.00	0.15
288	603328	依顿电子	165,550.00	1,301,223.00	0.15
289	002011	盾安环境	131,000.00	1,287,730.00	0.15
290	603171	税友股份	47,300.00	1,278,992.00	0.15
291	601963	重庆银行	164,300.00	1,273,325.00	0.15
292	002960	青鸟消防	100,400.00	1,269,056.00	0.15
293	300226	上海钢联	74,800.00	1,267,112.00	0.15
294	300303	聚飞光电	260,100.00	1,264,086.00	0.15
295	688232	新点软件	64,016.00	1,262,395.52	0.15
296	300482	万孚生物	51,700.00	1,261,480.00	0.15
297	688776	国光电气	22,700.00	1,257,580.00	0.15
298	301015	百洋医药	52,700.00	1,240,031.00	0.14
299	688016	心脉医疗	12,646.00	1,239,940.30	0.14
300	688798	艾为电子	21,753.00	1,231,654.86	0.14
301	603039	泛微网络	38,300.00	1,216,408.00	0.14
302	300232	洲明科技	230,800.00	1,204,776.00	0.14
303	603267	鸿远电子	35,200.00	1,200,320.00	0.14
304	000905	厦门港务	212,000.00	1,197,800.00	0.14
305	000785	居然之家	489,400.00	1,189,242.00	0.14
306	002839	张家港行	290,600.00	1,168,212.00	0.14
307	000557	西部创业	308,900.00	1,161,464.00	0.14
308	600449	宁夏建材	98,600.00	1,158,550.00	0.14
309	603071	物产环能	92,400.00	1,157,772.00	0.13
310	600662	外服控股	271,300.00	1,087,913.00	0.13
311	600308	华泰股份	341,000.00	1,070,740.00	0.12
312	688083	中望软件	14,635.00	1,062,793.70	0.12
313	002100	天康生物	151,000.00	1,046,430.00	0.12
314	002091	江苏国泰	152,100.00	1,035,801.00	0.12
315	600928	西安银行	309,700.00	1,012,719.00	0.12

316	600835	上海机电	86,600.00	996,766.00	0.12
317	301047	义翘神州	15,640.00	937,618.00	0.11
318	002777	久远银海	61,100.00	915,889.00	0.11
319	688788	科思科技	38,900.00	904,425.00	0.11
320	002226	江南化工	199,040.00	891,699.20	0.10
321	000016	深康佳A	414,400.00	882,672.00	0.10
322	688322	奥比中光	32,773.00	875,366.83	0.10
323	002302	西部建设	167,800.00	872,560.00	0.10
324	605589	圣泉集团	42,900.00	870,441.00	0.10
325	000650	仁和药业	146,200.00	862,580.00	0.10
326	000060	中金岭南	200,900.00	851,816.00	0.10
327	600737	中粮糖业	88,800.00	851,592.00	0.10
328	600604	市北高新	245,800.00	850,468.00	0.10
329	002755	奥赛康	87,500.00	844,375.00	0.10
330	002385	大北农	219,200.00	843,920.00	0.10
331	688095	福昕软件	18,315.00	839,010.15	0.10
332	000050	深天马A	115,000.00	837,200.00	0.10
333	688365	光云科技	138,500.00	833,770.00	0.10
334	002545	东方铁塔	122,000.00	830,820.00	0.10
335	000059	华锦股份	198,100.00	830,039.00	0.10
336	300203	聚光科技	82,000.00	827,380.00	0.10
337	688617	惠泰医疗	1,800.00	820,980.00	0.10
338	300079	数码视讯	201,300.00	817,278.00	0.10
339	002617	露笑科技	169,200.00	812,160.00	0.09
340	000035	中国天楹	179,200.00	811,776.00	0.09
341	002099	海翔药业	157,000.00	802,270.00	0.09
342	601688	华泰证券	64,200.00	795,438.00	0.09
343	002626	金达威	54,700.00	790,415.00	0.09
344	002912	中新赛克	44,500.00	788,540.00	0.09
345	601918	新集能源	80,700.00	786,825.00	0.09
346	605369	拱东医疗	19,500.00	778,050.00	0.09
347	003012	东鹏控股	127,300.00	777,803.00	0.09
348	601778	晶科科技	340,700.00	776,796.00	0.09
349	300768	迪普科技	65,400.00	774,990.00	0.09
350	002060	广东建工	225,800.00	772,236.00	0.09
351	600959	江苏有线	292,300.00	771,672.00	0.09
352	600499	科达制造	90,500.00	762,915.00	0.09
353	002958	青农商行	281,200.00	753,616.00	0.09
354	600210	紫江企业	141,100.00	750,652.00	0.09
355	600643	爱建集团	198,900.00	749,853.00	0.09
356	000032	深桑达A	48,700.00	729,526.00	0.09
357	002573	清新环境	187,000.00	723,690.00	0.08
358	600637	东方明珠	117,300.00	713,184.00	0.08
359	003035	南网能源	160,200.00	704,880.00	0.08

360	688007	光峰科技	42,933.00	691,221.30	0.08
361	000029	深深房 A	64,700.00	687,761.00	0.08
362	300894	火星人	53,586.00	686,972.52	0.08
363	601211	国泰君安	50,600.00	685,630.00	0.08
364	300031	宝通科技	46,900.00	673,953.00	0.08
365	603156	养元饮品	31,500.00	670,005.00	0.08
366	002115	三维通信	137,100.00	666,306.00	0.08
367	601018	宁波港	194,500.00	661,300.00	0.08
368	603688	石英股份	22,250.00	658,822.50	0.08
369	603877	太平鸟	47,700.00	654,921.00	0.08
370	688318	财富趋势	8,271.00	652,664.61	0.08
371	601616	广电电气	223,800.00	651,258.00	0.08
372	002491	通鼎互联	191,200.00	646,256.00	0.08
373	300251	光线传媒	76,200.00	640,842.00	0.07
374	002788	鹭燕医药	81,100.00	639,068.00	0.07
375	300195	长荣股份	152,200.00	637,718.00	0.07
376	300076	GQY 视讯	199,100.00	637,120.00	0.07
377	002160	常铝股份	233,348.00	632,373.08	0.07
378	002161	远望谷	136,700.00	631,554.00	0.07
379	002231	奥维通信	154,500.00	630,360.00	0.07
380	600420	国药现代	58,800.00	627,984.00	0.07
381	600108	亚盛集团	264,900.00	627,813.00	0.07
382	002044	美年健康	165,800.00	626,724.00	0.07
383	000895	双汇发展	26,300.00	625,151.00	0.07
384	600626	申达股份	258,300.00	625,086.00	0.07
385	605151	西上海	42,600.00	624,090.00	0.07
386	000607	华媒控股	201,700.00	623,253.00	0.07
387	603618	杭电股份	141,900.00	621,522.00	0.07
388	600751	海航科技	279,900.00	621,378.00	0.07
389	002337	赛象科技	163,400.00	620,920.00	0.07
390	002406	远东传动	125,100.00	616,743.00	0.07
391	600135	乐凯胶片	126,200.00	615,856.00	0.07
392	002224	三力士	159,800.00	615,230.00	0.07
393	300422	博世科	128,700.00	612,612.00	0.07
394	000931	中关村	172,000.00	607,160.00	0.07
395	000590	启迪药业	114,600.00	603,942.00	0.07
396	300324	旋极信息	318,500.00	601,965.00	0.07
397	601668	中国建筑	112,800.00	598,968.00	0.07
398	300910	瑞丰新材	13,700.00	598,964.00	0.07
399	000630	铜陵有色	164,200.00	592,762.00	0.07
400	000558	莱茵体育	275,700.00	589,998.00	0.07
401	688027	国盾量子	3,900.00	588,900.00	0.07
402	300618	寒锐钴业	22,200.00	587,190.00	0.07
403	000791	甘肃能源	94,500.00	583,065.00	0.07

404	002925	盈趣科技	45,900.00	581,553.00	0.07
405	603803	瑞斯康达	81,900.00	581,490.00	0.07
406	300856	科思股份	18,100.00	579,381.00	0.07
407	688187	时代电气	11,700.00	577,746.00	0.07
408	002387	维信诺	94,900.00	576,992.00	0.07
409	688538	和辉光电	290,286.00	574,766.28	0.07
410	002376	新北洋	106,600.00	574,574.00	0.07
411	601068	中铝国际	136,300.00	573,823.00	0.07
412	600819	耀皮玻璃	135,900.00	573,498.00	0.07
413	603283	赛腾股份	7,500.00	573,000.00	0.07
414	000715	中兴商业	120,100.00	571,676.00	0.07
415	002270	华明装备	25,600.00	569,344.00	0.07
416	600691	阳煤化工	332,100.00	567,891.00	0.07
417	002036	联创电子	84,100.00	567,675.00	0.07
418	300259	新天科技	224,200.00	567,226.00	0.07
419	300080	易成新能	196,600.00	566,208.00	0.07
420	600012	皖通高速	40,500.00	565,785.00	0.07
421	600812	华北制药	137,200.00	565,264.00	0.07
422	601107	四川成渝	107,500.00	564,375.00	0.07
423	603595	东尼电子	27,400.00	564,166.00	0.07
424	603906	龙蟠科技	72,400.00	563,996.00	0.07
425	300825	阿尔特	58,000.00	562,020.00	0.07
426	300369	绿盟科技	109,800.00	561,078.00	0.07
427	300379	东方通	69,300.00	559,944.00	0.07
428	601595	上海电影	28,300.00	559,774.00	0.07
429	002003	伟星股份	44,500.00	558,475.00	0.07
430	688209	英集芯	45,000.00	558,450.00	0.07
431	002182	宝武镁业	49,500.00	558,360.00	0.07
432	688136	科兴制药	33,300.00	558,108.00	0.07
433	000828	东莞控股	61,900.00	557,719.00	0.06
434	002677	浙江美大	68,700.00	557,157.00	0.06
435	603859	能科科技	26,500.00	557,030.00	0.06
436	601360	三六零	72,400.00	556,032.00	0.06
437	300072	海新能科	308,200.00	554,760.00	0.06
438	300777	中简科技	25,800.00	554,700.00	0.06
439	600217	中再资环	147,500.00	554,600.00	0.06
440	300773	拉卡拉	44,500.00	553,135.00	0.06
441	600971	恒源煤电	46,100.00	550,434.00	0.06
442	688185	康希诺	13,373.00	549,496.57	0.06
443	600720	中交设计	61,500.00	547,350.00	0.06
444	003006	百亚股份	22,900.00	542,730.00	0.06
445	600211	西藏药业	16,630.00	541,805.40	0.06
446	300741	华宝股份	35,500.00	541,020.00	0.06
447	688177	百奥泰	25,600.00	540,672.00	0.06

448	600999	招商证券	38,800.00	539,708.00	0.06
449	688266	泽璟制药	9,900.00	536,778.00	0.06
450	300130	新国都	32,000.00	532,480.00	0.06
451	688520	神州细胞	13,500.00	531,225.00	0.06
452	603206	嘉环科技	42,000.00	530,460.00	0.06
453	603886	元祖股份	35,100.00	528,606.00	0.06
454	688608	恒玄科技	3,600.00	526,968.00	0.06
455	002068	黑猫股份	74,200.00	526,820.00	0.06
456	002416	爱施德	59,200.00	523,920.00	0.06
457	688331	荣昌生物	12,100.00	522,720.00	0.06
458	688062	迈威生物	18,000.00	520,920.00	0.06
459	002847	盐津铺子	12,100.00	517,517.00	0.06
460	688153	唯捷创芯	13,900.00	514,300.00	0.06
461	601225	陕西煤业	19,800.00	510,246.00	0.06
462	300432	富临精工	78,600.00	506,184.00	0.06
463	002932	明德生物	30,100.00	505,981.00	0.06
464	601002	晋亿实业	174,200.00	505,180.00	0.06
465	603920	世运电路	25,500.00	503,370.00	0.06
466	601727	上海电气	135,100.00	499,870.00	0.06
467	002550	千红制药	92,000.00	495,880.00	0.06
468	600847	万里股份	77,400.00	491,490.00	0.06
469	002194	武汉凡谷	60,900.00	490,245.00	0.06
470	003039	顺控发展	39,100.00	489,923.00	0.06
471	000006	深振业A	126,000.00	488,880.00	0.06
472	301095	广立微	11,800.00	485,216.00	0.06
473	300613	富瀚微	14,500.00	477,195.00	0.06
474	000019	深粮控股	83,000.00	476,420.00	0.06
475	000813	德展健康	226,900.00	471,952.00	0.06
476	600958	东方证券	61,900.00	470,440.00	0.05
477	000762	西藏矿业	25,900.00	468,272.00	0.05
478	000818	航锦科技	21,100.00	465,888.00	0.05
479	002979	雷赛智能	25,200.00	458,640.00	0.05
480	601908	京运通	181,000.00	457,930.00	0.05
481	002948	青岛银行	135,800.00	457,646.00	0.05
482	600633	浙数文化	51,900.00	457,239.00	0.05
483	600797	浙大网新	98,600.00	456,518.00	0.05
484	000776	广发证券	36,625.00	445,726.25	0.05
485	002101	广东鸿图	42,200.00	444,366.00	0.05
486	603489	八方股份	16,380.00	441,932.40	0.05
487	002724	海洋王	98,700.00	439,215.00	0.05
488	603132	金徽股份	31,800.00	437,568.00	0.05
489	300841	康华生物	8,600.00	435,504.00	0.05
490	600735	新华锦	112,900.00	432,407.00	0.05
491	601377	兴业证券	85,300.00	431,618.00	0.05

492	002174	游族网络	56,700.00	430,353.00	0.05
493	601022	宁波远洋	48,700.00	429,534.00	0.05
494	601996	丰林集团	253,700.00	428,753.00	0.05
495	688262	国芯科技	22,644.00	412,347.24	0.05
496	002467	二六三	122,700.00	409,818.00	0.05
497	600491	龙元建设	147,900.00	405,246.00	0.05
498	000652	泰达股份	134,500.00	400,810.00	0.05
499	300567	精测电子	7,000.00	395,570.00	0.05
500	601512	中新集团	50,800.00	387,096.00	0.05
501	603029	天鹅股份	27,600.00	383,364.00	0.04
502	600938	中国海油	11,600.00	382,800.00	0.04
503	000526	学大教育	6,100.00	375,760.00	0.04
504	601901	方正证券	47,800.00	369,494.00	0.04
505	600861	北京人力	22,500.00	367,200.00	0.04
506	000627	天茂集团	209,300.00	366,275.00	0.04
507	603196	日播时尚	50,600.00	357,236.00	0.04
508	002342	巨力索具	123,600.00	355,968.00	0.04
509	603128	华贸物流	61,200.00	353,124.00	0.04
510	600072	中船科技	26,000.00	351,520.00	0.04
511	002540	亚太科技	66,100.00	349,669.00	0.04
512	300760	迈瑞医疗	1,200.00	349,092.00	0.04
513	300533	冰川网络	25,100.00	348,388.00	0.04
514	000088	盐田港	75,676.00	342,812.28	0.04
515	603529	爱玛科技	12,400.00	338,892.00	0.04
516	601995	中金公司	11,300.00	334,593.00	0.04
517	300671	富满微	13,100.00	333,002.00	0.04
518	601066	中信建投	16,900.00	325,156.00	0.04
519	603527	众源新材	45,600.00	323,760.00	0.04
520	600312	平高电气	16,600.00	322,870.00	0.04
521	688106	金宏气体	18,243.00	319,617.36	0.04
522	601788	光大证券	21,800.00	318,716.00	0.04
523	600055	万东医疗	25,800.00	318,630.00	0.04
524	300308	中际旭创	2,300.00	317,124.00	0.04
525	600266	城建发展	84,600.00	316,404.00	0.04
526	601333	广深铁路	97,600.00	316,224.00	0.04
527	600981	汇鸿集团	184,700.00	312,143.00	0.04
528	600602	云赛智联	28,100.00	310,224.00	0.04
529	603160	汇顶科技	4,500.00	309,375.00	0.04
530	688439	振华风光	4,554.00	302,613.30	0.04
531	603567	珍宝岛	28,400.00	299,052.00	0.03
532	300319	麦捷科技	31,900.00	297,627.00	0.03
533	600114	东睦股份	20,500.00	294,995.00	0.03
534	001206	依依股份	22,600.00	294,252.00	0.03
535	301316	慧博云通	20,000.00	293,600.00	0.03

536	300866	安克创新	4,100.00	291,961.00	0.03
537	300441	鲍斯股份	49,200.00	291,756.00	0.03
538	603355	莱克电气	13,500.00	291,600.00	0.03
539	601222	林洋能源	46,500.00	291,555.00	0.03
540	001308	康冠科技	12,900.00	290,250.00	0.03
541	300790	宇瞳光学	21,500.00	290,250.00	0.03
542	002322	理工能科	18,100.00	289,962.00	0.03
543	603727	博迈科	22,000.00	289,520.00	0.03
544	300589	江龙船艇	24,300.00	288,684.00	0.03
545	600874	创业环保	51,600.00	288,444.00	0.03
546	002588	史丹利	38,200.00	287,646.00	0.03
547	300170	汉得信息	46,800.00	287,352.00	0.03
548	600888	新疆众和	40,400.00	285,628.00	0.03
549	688510	航亚科技	15,500.00	285,355.00	0.03
550	300274	阳光电源	4,600.00	285,338.00	0.03
551	000090	天健集团	70,900.00	285,018.00	0.03
552	300726	宏达电子	12,500.00	285,000.00	0.03
553	300758	七彩化学	26,500.00	284,875.00	0.03
554	002697	红旗连锁	61,300.00	283,819.00	0.03
555	000959	首钢股份	104,000.00	282,880.00	0.03
556	300181	佐力药业	18,700.00	282,744.00	0.03
557	601919	中远海控	18,200.00	281,918.00	0.03
558	600066	宇通客车	10,900.00	281,220.00	0.03
559	002474	榕基软件	64,500.00	281,220.00	0.03
560	600219	南山铝业	73,700.00	280,797.00	0.03
561	300587	天铁股份	69,500.00	280,780.00	0.03
562	002020	京新药业	26,800.00	280,596.00	0.03
563	002274	华昌化工	37,700.00	279,734.00	0.03
564	002818	富森美	22,800.00	279,528.00	0.03
565	002043	兔宝宝	26,900.00	278,953.00	0.03
566	601108	财通证券	42,200.00	278,942.00	0.03
567	002023	海特高新	30,400.00	278,160.00	0.03
568	688690	纳微科技	16,000.00	277,920.00	0.03
569	300119	瑞普生物	20,400.00	277,848.00	0.03
570	002332	仙琚制药	24,350.00	277,833.50	0.03
571	300783	三只松鼠	12,700.00	277,749.00	0.03
572	300463	迈克生物	24,400.00	277,672.00	0.03
573	601500	通用股份	51,700.00	276,078.00	0.03
574	002753	永东股份	47,400.00	275,394.00	0.03
575	002130	沃尔核材	19,500.00	275,340.00	0.03
576	300394	天孚通信	3,100.00	274,102.00	0.03
577	603197	保隆科技	8,700.00	274,050.00	0.03
578	300456	赛微电子	17,200.00	272,964.00	0.03
579	688222	成都先导	24,000.00	272,400.00	0.03

580	600327	大东方	84,900.00	271,680.00	0.03
581	002920	德赛西威	3,100.00	269,979.00	0.03
582	600531	豫光金铅	41,800.00	269,192.00	0.03
583	688036	传音控股	3,500.00	267,890.00	0.03
584	002324	普利特	31,307.00	267,674.85	0.03
585	603713	密尔克卫	5,000.00	267,600.00	0.03
586	688707	振华新材	27,420.00	267,070.80	0.03
587	002335	科华数据	12,600.00	266,238.00	0.03
588	002587	奥拓电子	49,300.00	265,234.00	0.03
589	300396	迪瑞医疗	13,000.00	264,030.00	0.03
590	300502	新易盛	2,500.00	263,875.00	0.03
591	300377	赢时胜	51,800.00	263,144.00	0.03
592	600201	生物股份	36,400.00	262,444.00	0.03
593	601099	太平洋	85,800.00	261,690.00	0.03
594	002367	康力电梯	45,000.00	259,650.00	0.03
595	600903	贵州燃气	41,600.00	259,584.00	0.03
596	600829	人民同泰	46,100.00	258,621.00	0.03
597	600109	国金证券	34,000.00	256,700.00	0.03
598	688033	天宜上佳	42,705.00	256,230.00	0.03
599	600098	广州发展	39,900.00	255,360.00	0.03
600	603566	普莱柯	18,700.00	253,946.00	0.03
601	603096	新经典	15,000.00	253,500.00	0.03
602	000552	甘肃能化	73,000.00	253,310.00	0.03
603	603588	高能环境	40,300.00	253,084.00	0.03
604	000737	北方铜业	27,200.00	252,416.00	0.03
605	601606	长城军工	26,200.00	250,472.00	0.03
606	603733	仙鹤股份	14,200.00	249,636.00	0.03
607	688147	微导纳米	10,000.00	249,000.00	0.03
608	002967	广电计量	21,100.00	248,980.00	0.03
609	601881	中国银河	22,900.00	248,694.00	0.03
610	002991	甘源食品	4,100.00	248,665.00	0.03
611	300743	天地数码	18,235.00	246,901.90	0.03
612	688766	普冉股份	2,500.00	242,925.00	0.03
613	002440	闰土股份	44,500.00	241,635.00	0.03
614	002030	达安基因	48,100.00	240,500.00	0.03
615	300443	金雷股份	15,500.00	237,615.00	0.03
616	001203	大中矿业	24,500.00	235,445.00	0.03
617	300696	爱乐达	13,100.00	232,525.00	0.03
618	601878	浙商证券	21,600.00	231,552.00	0.03
619	601162	天风证券	104,800.00	228,464.00	0.03
620	003031	中瓷电子	4,920.00	227,500.80	0.03
621	601318	中国平安	5,500.00	227,480.00	0.03
622	603949	雪龙集团	20,140.00	226,776.40	0.03
623	002283	天润工业	51,400.00	220,506.00	0.03

624	002410	广联达	23,000.00	220,340.00	0.03
625	002212	天融信	44,800.00	218,176.00	0.03
626	000783	长江证券	45,100.00	217,833.00	0.03
627	002580	圣阳股份	35,000.00	215,250.00	0.03
628	603109	神驰机电	16,300.00	213,693.00	0.02
629	600155	华创云信	36,000.00	212,760.00	0.02
630	002803	吉宏股份	19,000.00	211,470.00	0.02
631	002797	第一创业	41,200.00	209,708.00	0.02
632	300985	致远新能	13,080.00	209,541.60	0.02
633	600918	中泰证券	36,600.00	207,522.00	0.02
634	002666	德联集团	57,300.00	207,426.00	0.02
635	002375	亚厦股份	63,600.00	206,700.00	0.02
636	688131	皓元医药	10,420.00	199,334.60	0.02
637	002516	旷达科技	54,600.00	198,744.00	0.02
638	002128	电投能源	9,400.00	198,340.00	0.02
639	300724	捷佳伟创	3,600.00	194,436.00	0.02
640	000728	国元证券	31,700.00	192,102.00	0.02
641	600061	国投资本	33,500.00	189,275.00	0.02
642	301239	普瑞眼科	5,300.00	187,249.00	0.02
643	600640	国脉文化	18,000.00	186,300.00	0.02
644	601696	中银证券	20,500.00	186,140.00	0.02
645	601990	南京证券	24,200.00	185,856.00	0.02
646	600361	创新新材	46,000.00	185,380.00	0.02
647	600468	百利电气	43,000.00	185,330.00	0.02
648	000685	中山公用	25,000.00	180,250.00	0.02
649	688020	方邦股份	5,354.00	178,609.44	0.02
650	000505	京粮控股	32,300.00	175,712.00	0.02
651	601198	东兴证券	22,000.00	175,120.00	0.02
652	300999	金龙鱼	6,400.00	175,040.00	0.02
653	600284	浦东建设	32,300.00	172,482.00	0.02
654	002673	西部证券	27,800.00	172,082.00	0.02
655	000503	国新健康	25,700.00	171,419.00	0.02
656	600369	西南证券	47,400.00	169,692.00	0.02
657	603360	百傲化学	14,140.00	166,145.00	0.02
658	300702	天宇股份	9,100.00	162,253.00	0.02
659	603277	银都股份	5,400.00	162,216.00	0.02
660	000157	中联重科	20,800.00	159,744.00	0.02
661	000599	青岛双星	44,900.00	158,497.00	0.02
662	000921	海信家电	4,900.00	157,976.00	0.02
663	300123	亚光科技	32,923.00	152,762.72	0.02
664	600120	浙江东方	44,100.00	147,294.00	0.02
665	600572	康恩贝	32,600.00	145,722.00	0.02
666	000750	国海证券	49,600.00	144,336.00	0.02
667	002939	长城证券	21,400.00	143,380.00	0.02

668	600800	渤海化学	71,900.00	143,081.00	0.02
669	002928	华夏航空	22,000.00	139,480.00	0.02
670	600909	华安证券	32,900.00	138,509.00	0.02
671	002926	华西证券	21,000.00	138,390.00	0.02
672	301039	中集车辆	15,600.00	134,160.00	0.02
673	002643	万润股份	13,400.00	134,000.00	0.02
674	601456	国联证券	13,900.00	133,996.00	0.02
675	601236	红塔证券	19,200.00	123,264.00	0.01
676	002649	博彦科技	15,300.00	121,788.00	0.01
677	002500	山西证券	25,800.00	121,260.00	0.01
678	603087	甘李药业	2,500.00	115,800.00	0.01
679	002414	高德红外	18,740.00	110,378.60	0.01
680	002670	国盛金控	12,900.00	109,263.00	0.01
681	002081	金螳螂	36,000.00	109,080.00	0.01
682	000735	罗牛山	25,000.00	108,250.00	0.01
683	000788	北大医药	20,700.00	103,293.00	0.01
684	600906	财达证券	17,700.00	101,421.00	0.01
685	000836	ST 富通	1,061,500.00	95,535.00	0.01
686	002559	亚威股份	12,100.00	92,686.00	0.01
687	000888	峨眉山 A	8,000.00	87,120.00	0.01
688	600389	江山股份	6,100.00	86,071.00	0.01
689	601828	美凯龙	33,500.00	85,425.00	0.01
690	600864	哈投股份	17,800.00	84,550.00	0.01
691	000868	安凯客车	21,800.00	83,494.00	0.01
692	600621	华鑫股份	6,600.00	80,916.00	0.01
693	002909	集泰股份	16,300.00	66,830.00	0.01
694	300821	东岳硅材	8,100.00	55,404.00	0.01
695	688692	达梦数据	175.00	36,669.50	0.00
696	301526	国际复材	9,723.00	32,377.59	0.00
697	603285	键邦股份	1,287.00	24,002.55	0.00
698	603350	安乃达	1,051.00	21,608.56	0.00
699	688709	成都华微	1,045.00	19,614.65	0.00
700	301565	中仑新材	711.00	16,580.52	0.00
701	601096	宏盛华源	3,918.00	16,024.62	0.00
702	301536	星宸科技	481.00	15,517.06	0.00
703	301580	爱迪特	202.00	14,948.00	0.00
704	605111	新洁能	460.00	14,071.40	0.00
705	301538	骏鼎达	150.00	13,683.00	0.00
706	301392	汇成真空	219.00	12,235.53	0.00
707	688691	灿芯股份	247.00	12,196.86	0.00
708	603341	龙旗科技	298.00	11,166.06	0.00
709	002463	沪电股份	300.00	10,950.00	0.00
710	601567	三星医疗	300.00	10,500.00	0.00

711	002984	森麒麟	420.00	10,117.80	0.00
712	301566	达利凯普	576.00	9,648.00	0.00
713	001389	广合科技	222.00	9,330.66	0.00
714	301539	宏鑫科技	361.00	8,772.30	0.00
715	301587	中瑞股份	306.00	8,292.60	0.00
716	603298	杭叉集团	380.00	7,463.20	0.00
717	688133	泰坦科技	460.00	7,258.80	0.00
718	688530	欧莱新材	344.00	6,522.24	0.00
719	301578	辰奕智能	154.00	6,093.78	0.00
720	688695	中创股份	186.00	5,866.44	0.00
721	688400	凌云光	327.00	5,454.36	0.00
722	300457	赢合科技	300.00	5,349.00	0.00
723	301502	华阳智能	138.00	5,217.78	0.00
724	603381	永臻股份	178.00	4,733.02	0.00
725	603325	博隆技术	66.00	4,489.32	0.00
726	603888	新华网	200.00	4,302.00	0.00
727	603344	星德胜	182.00	4,124.12	0.00
728	300037	新宙邦	142.00	4,055.52	0.00
729	301301	川宁生物	300.00	3,834.00	0.00
730	001359	平安电工	184.00	3,792.24	0.00
731	301367	怡和嘉业	60.00	3,732.00	0.00
732	603719	良品铺子	300.00	3,501.00	0.00
733	002095	生意宝	278.00	3,402.72	0.00
734	603004	鼎龙科技	195.00	3,305.25	0.00
735	603312	西典新能	130.00	3,294.20	0.00
736	603082	北自科技	107.00	3,154.36	0.00
737	001379	腾达科技	213.00	2,871.24	0.00
738	601890	亚星锚链	400.00	2,820.00	0.00
739	603375	盛景微	72.00	2,799.36	0.00
740	003021	兆威机电	60.00	2,769.00	0.00
741	001387	雪祺电气	173.00	2,634.79	0.00
742	603373	安邦护卫	88.00	2,419.12	0.00
743	002955	鸿合科技	100.00	2,338.00	0.00
744	600667	太极实业	400.00	2,284.00	0.00
745	002063	远光软件	400.00	2,096.00	0.00
746	001258	立新能源	300.00	2,079.00	0.00
747	300012	华测检测	200.00	2,012.00	0.00
748	002726	龙大美食	300.00	1,968.00	0.00
749	002001	新和成	100.00	1,920.00	0.00
750	601801	皖新传媒	222.00	1,538.46	0.00
751	000970	中科三环	200.00	1,530.00	0.00
752	601686	友发集团	300.00	1,509.00	0.00
753	603185	弘元绿能	85.00	1,452.65	0.00
754	300645	正元智慧	100.00	1,263.00	0.00

755	688789	宏华数科	10.00	1,078.00	0.00
756	300225	金力泰	200.00	982.00	0.00
757	300772	运达股份	100.00	960.00	0.00
758	000062	深圳华强	100.00	890.00	0.00
759	300002	神州泰岳	100.00	812.00	0.00
760	601369	陕鼓动力	100.00	802.00	0.00
761	000009	中国宝安	88.00	756.80	0.00
762	300143	盈康生命	100.00	753.00	0.00
763	002987	京北方	60.00	631.80	0.00
764	603987	康德莱	100.00	611.00	0.00
765	300219	鸿利智汇	80.00	447.20	0.00
766	000756	新华制药	30.00	434.40	0.00
767	600512	腾达建设	200.00	378.00	0.00
768	600871	石化油服	200.00	348.00	0.00
769	002202	金风科技	42.00	282.24	0.00
770	000816	智慧农业	100.00	149.00	0.00
771	002276	万马股份	13.00	93.21	0.00
772	601019	山东出版	5.00	59.10	0.00

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 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	605208	永茂泰	14,304,135.00	0.89
2	002160	常铝股份	12,326,859.00	0.76
3	301001	凯淳股份	12,019,702.00	0.74
4	002364	中恒电气	11,639,678.00	0.72
5	600889	南京化纤	11,551,556.98	0.72
6	002498	汉缆股份	10,234,794.00	0.63
7	601609	金田股份	10,055,560.00	0.62
8	300328	宜安科技	9,828,452.00	0.61
9	600791	京能置业	9,720,153.00	0.60
10	002961	瑞达期货	9,587,593.00	0.59
11	300059	东方财富	9,433,494.90	0.58
12	605158	华达新材	9,377,794.00	0.58
13	301063	海锅股份	9,333,477.00	0.58
14	600255	鑫科材料	9,322,833.00	0.58
15	002231	奥维通信	9,120,213.00	0.57
16	688013	天臣医疗	9,016,000.42	0.56
17	002093	国脉科技	9,010,936.00	0.56

18	002161	远望谷	8,983,526.00	0.56
19	688233	神工股份	8,840,623.57	0.55
20	300082	奥克股份	8,775,145.00	0.54

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

#### 7.4.2 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	002160	常铝股份	16,706,238.98	1.04
2	601088	中国神华	14,875,438.00	0.92
3	605208	永茂泰	14,513,497.68	0.90
4	600030	中信证券	13,016,585.00	0.81
5	605258	协和电子	12,268,963.00	0.76
6	301001	凯淳股份	11,949,027.65	0.74
7	000698	沈阳化工	11,465,425.90	0.71
8	600936	广西广电	11,427,145.99	0.71
9	300411	金盾股份	11,417,453.36	0.71
10	301359	东南电子	11,389,587.14	0.71
11	603922	金鸿顺	11,300,218.00	0.70
12	600617	国新能源	11,149,143.00	0.69
13	603819	神力股份	10,962,133.10	0.68
14	002762	金发拉比	10,909,881.00	0.68
15	600889	南京化纤	10,775,040.00	0.67
16	300043	星辉娱乐	10,752,257.89	0.67
17	000590	启迪药业	10,724,053.62	0.66
18	300289	利德曼	10,663,999.00	0.66
19	002391	长青股份	10,627,945.84	0.66
20	600255	鑫科材料	10,487,258.00	0.65

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

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	4,197,280,504.45
卖出股票的收入（成交）总额	4,581,417,757.92

注：买入股票成本总额、卖出股票收入总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。

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

## 7.7 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。

## 7.8 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。

## 7.9 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。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

在报告期内，当期货出现较大负基差时，应用期货进行多头替代，其仓位不超过基金净资产的 10%，同时满足现货加期货净多头不超过基金净资产的 95%。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内收到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 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	5,521,139.84
2	应收清算款	893,765.50
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	47,054.25
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,461,959.59

#### 7.12.4 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。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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
申万菱信量化小	17,767	31,141.57	419,230,729.62	75.77%	134,061,505.92	24.23%

盘股票(LOF)A						
申万菱信量化小盘股票(LOF)C	158	2,059.28	102,259.43	31.43%	223,106.60	68.57%
合计	17,905	30,919.72	419,332,989.05	75.74%	134,284,612.52	24.26%

注：（1）机构投资者/个人投资者持有份额占总份额比例计算中，对于下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对于合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

（2）若同一持有人同时持有多个类别基金份额，会存在持有人户数合计数小于各份额类别持有人户数总和的情形。

## 8.2 期末上市基金前十名持有人

申万菱信量化小盘股票(LOF)A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	陈翠芳	669,590.00	14.26%
2	吴家驹	586,576.00	12.49%
3	吴祥宝	256,106.00	5.45%
4	宋晖	171,082.00	3.64%
5	尤超	164,022.00	3.49%
6	章蒙恩	148,556.00	3.16%
7	陈勇	128,300.00	2.73%
8	吴建城	121,903.00	2.60%
9	戴亚克	96,824.00	2.06%
10	谢苏民	84,463.00	1.80%

注：以上数据由中国证券登记结算有限责任公司提供。

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	申万菱信量化小盘股票(LOF)A	53,443.57	0.01%
	申万菱信量化小盘股票(LOF)C	0.00	0.00%
	合计	53,443.57	0.01%

注：分级基金管理人的从业人员持有基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总

额)。

#### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	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	申万菱信量化小盘股票(LOF)A	-
	申万菱信量化小盘股票(LOF)C	-
	合计	-
本基金基金经理持有本开放式基金	申万菱信量化小盘股票(LOF)A	0~10
	申万菱信量化小盘股票(LOF)C	0
	合计	0~10

### 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	申万菱信量化小盘股票(LOF)A	申万菱信量化小盘股票(LOF)C
基金合同生效日(2011年6月16日)基金份额总额	512,987,683.05	-
本报告期期初基金份额总额	575,962,683.72	244,368,216.16
本报告期基金总申购份额	101,545,460.79	61,694,017.13
减：本报告期基金总赎回份额	124,215,908.97	305,736,867.26
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	553,292,235.54	325,366.03

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

### 10 重大事件揭示

#### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

#### 10.2 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

1、本报告期内，经基金管理人股东会决议，同意免去安田敬之先生、福井雄介先生董事职务，由川上丰先生、四宫大辅先生继任公司董事会董事，并授权川上丰先生履行股东代表相应职责。

2、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。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的，与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金管理人的基金投资策略严格遵循本基金《招募说明书》中披露的基本投资策略，未发生显著的改变。

### 10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。

### 10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金聘用毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）负责基金审计事务，未发生改聘会计师事务所事宜。

### 10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.7.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

#### 10.7.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.8.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	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	
申万宏源证券	2	1,056,413,416.59	12.04%	994,074.66	12.04%	-
国泰君安证券	2	978,708,958.48	11.15%	924,327.72	11.20%	-
东吴证券	1	533,651,619.60	6.08%	499,452.99	6.05%	-
方正证券	2	512,864,598.92	5.84%	480,613.51	5.82%	-
长江证券	1	509,983,866.01	5.81%	482,376.34	5.84%	-
国金证券	2	471,162,673.32	5.37%	444,454.73	5.38%	-
国投证券	1	467,812,237.04	5.33%	437,835.05	5.30%	-
民生证券	1	404,117,210.08	4.60%	378,225.89	4.58%	-
信达证券	1	388,206,297.64	4.42%	363,329.89	4.40%	-
中泰证券	3	321,263,576.45	3.66%	303,494.47	3.68%	-
中信建投证券	2	305,182,748.79	3.48%	288,421.85	3.49%	-

兴业证券	1	284,480,132.08	3.24%	266,244.54	3.23%	-
天风证券	2	275,753,939.53	3.14%	260,822.17	3.16%	-
海通证券	2	258,729,972.17	2.95%	242,574.93	2.94%	-
财通证券	2	250,501,726.70	2.85%	236,704.77	2.87%	-
光大证券	1	202,445,886.00	2.31%	189,468.10	2.30%	-
华泰证券	1	193,909,459.12	2.21%	181,482.32	2.20%	-
国信证券	1	158,155,579.95	1.80%	148,020.18	1.79%	-
长城证券	3	151,210,864.45	1.72%	142,632.46	1.73%	-
西部证券	1	143,043,730.38	1.63%	133,877.20	1.62%	-
西南证券	2	140,945,391.91	1.61%	133,319.28	1.62%	-
第一创业	1	125,552,335.64	1.43%	118,767.43	1.44%	-
浙商证券	1	103,800,852.31	1.18%	98,189.94	1.19%	-
广发证券	1	101,641,982.29	1.16%	95,129.92	1.15%	-
中邮证券	1	74,657,822.00	0.85%	69,873.20	0.85%	新增
中银国际	1	66,747,335.01	0.76%	62,469.86	0.76%	-
银河证券	1	66,157,941.05	0.75%	61,918.97	0.75%	-
东兴证券	1	57,565,226.91	0.66%	53,874.57	0.65%	-
东北证券	2	53,537,335.43	0.61%	50,642.69	0.61%	-
中信证券	2	45,511,141.79	0.52%	42,594.01	0.52%	-
国元证券	1	39,015,452.22	0.44%	36,904.66	0.45%	-
招商证券	2	18,068,419.30	0.21%	16,910.45	0.20%	-
华金证券	1	10,206,707.00	0.12%	9,653.88	0.12%	-
华创证券	1	2,759,156.30	0.03%	2,609.95	0.03%	-
太平洋证券	1	1,972,619.37	0.02%	1,866.37	0.02%	-
东方证券	1	1,576,626.00	0.02%	1,475.55	0.02%	-
红塔证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
北京高华	2	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
华信证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	2	-	-	-	-	-
五矿证券	1	-	-	-	-	-
东方财富证券	2	-	-	-	-	-
申港证券	1	-	-	-	-	-

注：(1)交易单元选择的标准:1、经营行为规范,在近三年内无重大违规行为;2、公司财务状况良好;3、有良好的内控制度,在业内有良好的声誉;4、有较强的研究能力,能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告,并能根据基金投资的特殊要求,提供专门的研究报告;5、建立了广泛的信息网络,能及时提供准确的信息资讯和服务。(2)本基金本报告期内退租申港证券交易席位1个。

## 10.8.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰	-	-	-	-	-	-	-	-

证券									
国信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
长城 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
西部 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
西南 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
第一 创业	-	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
广发 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中邮 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中银 国际	-	-	-	-	-	-	-	-	-
银河 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东北 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国元 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
招商 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华金 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华创 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
太平 洋证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东方 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
红塔 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
德邦 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-

平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-	-	-
北京高华	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
华信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-	-	-
五矿证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-	-	-

## 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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	20240101—20240122	229,265,871.15	1,216,249.09	230,482,120.24	0.00	0.00%
	2	20240101—20240630	245,110,246.88	36,143,863.52	0.00	281,254,110.40	50.80%
产品特有风险							
<p>本基金本报告期存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过20%的情况。在单一投资者持有基金份额比例较高的情况下，如投资者集中赎回，可能会给基金带来流动性冲击。基金管理人将专业审慎、勤勉尽责地管控基金的流动性风险，保护持有人利益。</p>							

## 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

基金合同；  
招募说明书及其更新；  
产品资料概要及其更新；  
发售公告；  
成立公告；  
定期报告；  
其他临时公告。

### 12.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

### 12.3 查阅方式

上述文件均可到本基金管理人的住所进行查阅，也可在本基金管理人的网站进行查阅，查询网址：[www.swsmu.com](http://www.swsmu.com)。

申万菱信基金管理有限公司

二〇二四年八月三十日