

**国联智选对冲策略 3 个月定期开放灵活配置混合型发起式  
证券投资基金**

**2024 年中期报告**

2024 年 06 月 30 日

基金管理人:国联基金管理有限公司

基金托管人:中国民生银行股份有限公司

送出日期:2024 年 08 月 30 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。本中期报告已经全体独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年8月23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01月01日起至2024年06月30日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介 .....	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
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现 .....	7
§4 管理人报告 .....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	12
4.6 管理人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
4.8 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 .....	13
§5 托管人报告 .....	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 .....	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计） .....	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表 .....	15
6.3 净资产变动表 .....	17
6.4 报表附注 .....	19
§7 投资组合报告.....	40
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	41
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 .....	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	59
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	97
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 .....	97
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 .....	97
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 .....	97
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 .....	97
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	97
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	97
7.12 市场中性策略执行情况.....	98
7.13 投资组合报告附注 .....	98
§8 基金份额持有人信息.....	99
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	99

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	99
8.3 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.....	99
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	99
§9 开放式基金份额变动.....	100
§10 重大事件揭示.....	100
10.1 基金份额持有人大会决议.....	100
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.....	100
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	100
10.4 基金投资策略的改变.....	101
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	101
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	101
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	101
10.8 其他重大事件.....	102
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	103
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.....	103
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	103
§12 备查文件目录.....	103
12.1 备查文件目录.....	103
12.2 存放地点.....	104
12.3 查阅方式.....	104

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	国联智选对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金
基金简称	国联智选对冲3个月定开混合
基金主代码	008848
基金运作方式	契约型定期开放式
基金合同生效日	2020年04月03日
基金管理人	国联基金管理有限公司
基金托管人	中国民生银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	138,019,569.86份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	基于基金管理人对市场机会的判断，灵活应用包括市场中性策略在内的多种绝对收益策略，在严格的风险管理下，追求基金资产长期稳健增值。
投资策略	1、资产配置策略；2、多头股票投资策略（1）多因子选股模型（2）投资组合优化模型；3、对冲工具投资策略；4、其他绝对收益策略；5、股票期权投资策略；6、债券投资策略；7、国债期货投资策略；8、可转换债券投资策略；9、现金管理策略；10、资产支持证券投资策略。
业绩比较基准	中国人民银行公布的同期一年期定期存款基准利率（税后）+2%
风险收益特征	本基金为特殊的混合型基金，主要采用追求绝对收益的市场中性策略，使用股指期货对冲市场风险，使得收益波动与股票市场相关性较低。相对股票型基金和一般的混合型基金，其预期风险较小。本基金实际的收益和风险主要取决于基金投资策略的有效性。

### 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		国联基金管理有限公司	中国民生银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	曹健	袁耀光
	联系电话	010-56517000	010-58560666
	电子邮箱	caojian@gfund.com	tgxxpl@cmbc.com.cn
客户服务电话		400-160-6000; 010-56517299	95568
传真		010-56517001	010-57093382
注册地址		深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路3086号大百汇广场31层02-04单元	北京市西城区复兴门内大街2号
办公地址		北京市东城区安定门外大街208号玖安广场A座11层	北京市西城区复兴门内大街2号
邮政编码		100011	100031
法定代表人		王瑶	高迎欣

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.gfund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	国联基金管理有限公司	北京市东城区安定门外大街208号玖安广场A座11层
会计师事务所	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市黄浦区延安东路222号30楼

## §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01月01日- 2024年06月30日)
本期已实现收益	884,480.73
本期利润	870,842.04
加权平均基金份额本期利润	0.0136
本期加权平均净值利润率	1.36%
本期基金份额净值增长率	3.36%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2024年06月30日)
期末可供分配利润	672,092.16
期末可供分配基金份额利润	0.0049
期末基金资产净值	139,146,882.90
期末基金份额净值	1.0082
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2024年06月30日)
基金份额累计净值增长率	0.82%

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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

过去一个月	0.03%	0.23%	0.29%	0.01%	-0.26%	0.22%
过去三个月	1.41%	0.22%	0.88%	0.01%	0.53%	0.21%
过去六个月	3.36%	0.26%	1.77%	0.01%	1.59%	0.25%
过去一年	-0.27%	0.24%	3.56%	0.01%	-3.83%	0.23%
过去三年	-3.24%	0.37%	10.66%	0.01%	-13.90%	0.36%
自基金合同生效起至今	0.82%	0.35%	15.07%	0.01%	-14.25%	0.34%

### 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



注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。

## §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

本基金管理人为国联基金管理有限公司，成立于2013年5月31日，由国联证券股份有限公司与上海融晟投资有限公司共同出资，注册资金7.5亿元人民币。截至2024年6月30日，国联基金管理有限公司共管理87只基金，包括国联货币市场基金、国联国企改革灵活配置混合型证券投资基金、国联新机遇灵活配置混合型证券投资基金、国联鑫起点



灵活配置混合型证券投资基金、国联中证钢铁行业指数型证券投资基金、国联中证煤炭指数型证券投资基金、国联新经济灵活配置混合型证券投资基金、国联日日盈交易型货币市场基金、国联产业升级灵活配置混合型证券投资基金、国联竞争优势股票型证券投资基金、国联现金增利货币市场基金、国联上海清算所银行间1-3年中高等级信用债指数发起式证券投资基金、国联恒泰纯债债券型证券投资基金、国联鑫思路灵活配置混合型证券投资基金、国联物联网主题灵活配置混合型证券投资基金、国联盈泽中短债债券型证券投资基金、国联恒信纯债债券型证券投资基金、国联睿祥纯债债券型证券投资基金、国联核心成长灵活配置混合型证券投资基金、国联沪港深大消费主题灵活配置混合型发起式证券投资基金、国联鑫价值灵活配置混合型证券投资基金、国联聚商3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国联季季红定期开放债券型证券投资基金、国联智选红利股票型证券投资基金、国联聚安3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国联医疗健康精选混合型证券投资基金、国联聚业3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国联恒裕纯债债券型证券投资基金、国联聚明3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国联恒惠纯债债券型证券投资基金、国联央视财经50交易型开放式指数证券投资基金、国联央视财经50交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国联策略优选混合型证券投资基金、国联聚汇3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国联恒鑫纯债债券型证券投资基金、国联高股息精选混合型证券投资基金、国联睿享86个月定期开放债券型证券投资基金、国联中证500交易型开放式指数证券投资基金、国联聚通3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国联睿嘉39个月定期开放债券型证券投资基金、国联中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国联恒安纯债债券型证券投资基金、国联智选对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、国联品牌优选混合型证券投资基金、国联中债1-5年国开行债券指数证券投资基金、国联聚锦一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国联融慧双欣一年定期开放债券型证券投资基金、国联价值成长6个月持有期混合型证券投资基金、国联创业板两年定期开放混合型证券投资基金、国联成长优选混合型证券投资基金、国联景瑞一年持有期混合型证券投资基金、国联景颐6个月持有期混合型证券投资基金、国联行业先锋6个月持有期混合型证券投资基金、国联鑫锐研究精选一年持有期混合型证券投资基金、国联景盛一年持有期混合型证券投资基金、国联恒益纯债债券型证券投资基金、国联恒阳纯债债券型证券投资基金、国联低碳经济3个月持有期混合型证券投资基金、国联景泓一年持有期混合型证券投资基金、国联金融鑫选3个月持有期混合型证券投资基金、国联匠心优选混合型证券投资基金、国联添益进取3个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、国联恒利纯债债券型证券投资基金、国联高质量成长混合型证券投资基金、国联景惠混合型证券投资基金、国联聚优一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国联恒泽纯债债券型证券投资基金、国联研发创新混合型证券投资基金、国联优势产业混合型证券投资基金、国联医药消费混合型证券投资基金、国联成长先锋一年持有期混合型证券投资基金、国联益海30

天滚动持有短债债券型证券投资基金、国联益泓90天滚动持有债券型证券投资基金、国联兴鸿优选混合型证券投资基金、国联恒通纯债债券型证券投资基金、国联融盛双盈债券型证券投资基金、国联养老目标日期2045三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)、国联中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金、国联恒润纯债债券型证券投资基金、国联添安稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)、国联消费精选混合型证券投资基金、国联融誉双华6个月持有期债券型证券投资基金、国联泓安3个月定期开放债券型证券投资基金、国联中债0-3年政策性金融债指数证券投资基金、国联智选先锋股票型证券投资基金、国联益诚30天持有期债券型发起式证券投资基金、国联利率债债券型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
赵菲	国联智选对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、国联智选红利股票型证券投资基金、国联物联网主题灵活配置混合型证券投资基金、国联鑫起点灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。	2020-04-08	-	15	赵菲先生，中国国籍，毕业于北京师范大学概率论与数理统计专业，研究生、硕士学位，具有基金从业资格，证券从业年限15年。2008年8月至2011年5月曾任国泰君安证券股份有限公司证券及衍生品投资总部投资经理；2011年5月至2012年11月曾任嘉实基金管理有限公司结构产品投资部专户投资经理。2012年11月加入公司，现任多策略投资部基金经理。
王喆	国联高股息精选混合型证券投资基金、国联智选对冲策略3个月定期开放灵活	2024-05-29	-	9	王喆先生，中国国籍，毕业于北京航空航天大学金融学专业，研究生、硕士学位，具有基金从业资格，证券从

	<p>配置混合型发起式证券投资基金、国联智选先锋股票型证券投资基金的基金经理及公司多策略投资总监、多策略投资部总经理。</p>			<p>业年限9年。2015年1月至2022年4月历任中邮创业基金管理股份有限公司创新业务部基金研究员、权益投资部基金经理；2022年4月至2023年9月历任中信建投基金管理有限公司特定资产管理部投资经理、多元资产配置部投资经理。2023年9月加入公司，现任公司多策略投资总监、多策略投资部总经理。</p>
--	---	--	--	--

注：（1）上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写；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）证券基金从业的含义遵从《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项配套法规、基金合同和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无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《公平交易管理办法》并严格执行，公司通过建立科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，在研究、决策、交易执行等各环节，通过制度、流程、技术手段等各方面措施确保了公平对待所管理的投资组合，保证公平交易原则的实现。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好，不同的投资组合受到了公平对待，未发生不公平的交易事项。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内未出现涉及本基金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5%的情况。

#### 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

本报告期，基金坚持市场中性投资策略，利用股指期货对股票组合进行完全对冲，在上半年大幅波动的市场下表现相对较好，获取了预期中的收益。本基金股票部位的构建采用量化多因子选股模型，主要选取低估值、高成长、高盈利、高质量等基本面因子，精选基本面优质的个股，同时考虑短期价量信息，抓取市场短周期的错误定价。在有效控制跟踪误差的前提下，力求持续获得相对基准的超额收益。同时运用股指期货进行对冲，剥离股票组合的系统性风险，根据不同股指期货合约的基差水平，灵活选择合适的股指期货合约进行对冲，并适时进行展期，力求整体对冲组合的收益最大化。

上半年，市场主要因子的表现不一，价值因子稳定占优，延续了2023年以来的表现；而成长因子的有效性在经历了一季度阶段性回暖后，持续下行；盈利质量因子表现在二季度有所回暖；市值因子在一季度大幅波动过后回归平稳；波动率、流动性因子表现在一季度强势之后二季度也较为疲软。本基金在因子的配置上以基本面因子和短期价量因子为阿尔法来源，上半年多头组合的超额收益符合预期，后续仍要严控风险暴露程度，注重较为均衡的因子配置。

此外，本基金还积极把握指数成分调整、新股申购等确定性增强机会。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国联智选对冲3个月定开混合基金份额净值为1.0082元，本报告期内，基金份额净值增长率为3.36%，同期业绩比较基准收益率为1.77%。

#### 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，预计国内经济会维持温和复苏的趋势。一方面，海外经济体需求依然不错，出口数据预计能保持稳健增长；另一方面，地产销售、投资数据仍较为平淡，地产行业预期改善状况仍需跟踪关注。值得注意的是，国内经济仍处在新旧动能转换的阵痛期。当前许多有效需求不足、预期偏弱、重点领域风险有待化解等问题在很大程度上与房地产市场低迷密切相关，这是经济结构调整中必经的过程。从长远看，降低国民经济对房地产的依赖，更有助于经济均衡和可持续增长。

当前A股市场的整体估值水平处于历史较低水平，伴随未来盈利预期迎来拐点，A股市场仍有较大的投资潜力。本基金将坚持市场中性投资策略，努力为持有人实现稳定的资产增值。

#### 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。本基金管理人制定了基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术；设立估值委员会，估值委员会成员由具有专业胜任能力和相关工作经历的高级管理人员、投资研究部门、基金运营部门、风险管理部门、法律合规部门人员组成，负责研究、指导基金估值业务，基金经理根据公司制度参加估值委员会会议，但不介入基金日常估值业务；使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则及具体估值程序；估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。本基金日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

#### 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。

#### 4.8 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，本基金存在连续60个工作日基金资产净值低于5000万元的情形。针对该情形，本基金管理人已向中国证监会报告了解决方案。

### §5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规的规定和基金合同、托管协议的约定，依法安全保管了基金财产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，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，按照相关法律法规规定和基金合同、托管协议的有关约定，本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关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约定进行。

#### 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

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、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：国联智选对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2024年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024年06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	788,756.69	4,626.44
结算备付金		17,102,250.47	1,064,384.68
存出保证金		11,669,290.18	822,712.20
交易性金融资产	6.4.7.2	99,368,989.72	7,101,523.08
其中：股票投资		99,368,989.72	7,101,523.08
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	-	1,399,833.24
应收清算款		10,967,387.96	29,822.80
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		139,896,675.02	10,422,902.44
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>

		2024年06月30日	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		-	32,209.43
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		136,564.89	10,480.21
应付托管费		22,760.80	1,746.71
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		160,016.25	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	430,450.18	62,466.06
负债合计		749,792.12	106,902.41
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	138,019,569.86	10,576,658.28
未分配利润	6.4.7.8	1,127,313.04	-260,658.25
净资产合计		139,146,882.90	10,316,000.03
负债和净资产总计		139,896,675.02	10,422,902.44

注：报告截止日2024年06月30日，基金份额总额138,019,569.86份，份额净值1.0082元。

## 6.2 利润表

会计主体：国联智选对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2024年01月01日至 2024年06月30日	2023年01月01日至202 3年06月30日

<b>一、营业总收入</b>		1,329,928.30	123,262.21
1.利息收入		116,880.06	151,239.93
其中：存款利息收入	6.4.7.9	53,639.76	79,416.70
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		63,240.30	71,823.23
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,226,034.35	-764,154.46
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-942,578.34	-2,842,020.14
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	337.32	-627,960.20
资产支持证券投资	6.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	988,048.84	2,470,524.51
股利收益	6.4.7.16	1,180,226.53	235,301.37
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-13,638.69	544,430.55
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	652.58	191,746.19
<b>减：二、营业总支出</b>		459,086.26	1,059,957.21
1.管理人报酬		381,878.79	811,570.08
2.托管费		63,646.49	169,077.09
3.销售服务费		-	-
4.投资顾问费		-	-



5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.信用减值损失	6.4.7.19	-	-
7.税金及附加		3,586.50	9,020.68
8.其他费用	6.4.7.20	9,974.48	70,289.36
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		870,842.04	-936,695.00
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		870,842.04	-936,695.00
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		870,842.04	-936,695.00

### 6.3 净资产变动表

会计主体：国联智选对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	10,576,658.28	-260,658.25	10,316,000.03
二、本期期初净资产	10,576,658.28	-260,658.25	10,316,000.03
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	127,442,911.58	1,387,971.29	128,830,882.87
（一）、综合收益总额	-	870,842.04	870,842.04
（二）、本期基金	127,442,911.58	517,129.25	127,960,040.83

份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	127,713,897.32	513,293.97	128,227,191.29
2.基金赎回款	-270,985.74	3,835.28	-267,150.46
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	138,019,569.86	1,127,313.04	139,146,882.90
项目	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	167,982,055.98	7,532,143.01	175,514,198.99
二、本期期初净资产	167,982,055.98	7,532,143.01	175,514,198.99
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-138,135,881.91	-7,208,175.41	-145,344,057.32
（一）、综合收益总额	-	-936,695.00	-936,695.00
（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）	-138,135,881.91	-6,271,480.41	-144,407,362.32
其中：1.基金申购款	50,322,420.45	3,419,013.56	53,741,434.01
2.基金赎回	-188,458,302.36	-9,690,493.97	-198,148,796.33

款			
(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	29,846,174.07	323,967.60	30,170,141.67

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:

王瑶

周妹云

李克

-----

-----

-----

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

国联智选对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人国联基金管理有限公司(原中融基金管理有限公司)依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《中融智选对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关法律法规的规定,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[2019]2888号文注册募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限为不定期。本基金首次设立募集基金份额为10,000,000.00份,经上会会计师事务所(特殊普通合伙)验证。基金合同于2020年4月3日正式生效。

基金管理人法定名称由中融基金管理有限公司变更为国联基金管理有限公司,于2023年8月1日办理了变更手续并获得由深圳市市场监督管理局换发的企业法人营业执照。基金管理人旗下的中融智选对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金自2023年9月8日起变更为国联智选对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金(基金的基金代码保持不变)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、截至报告期末最新公告的基金合同及《国联智选对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许买卖的香港联合交易所上市股票(以下简称“港股通标的股票”)、

债券(包括国债、央行票据、地方政府债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、金融债券、企业债券、公司债券、公开发行的次级债、可转换公司债券(含可分离交易可转债)、可交换公司债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、金融衍生工具(包括股指期货、国债期货、股票期权)及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

本基金业绩比较基准为：中国人民银行公布的同期一年期定期存款基准利率(税后)+2%。

#### **6.4.2 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”)、中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### **6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金2024年06月30日的财务状况以及2024年半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### **6.4.4 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的说明**

本基金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**

无。

##### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

无。

##### **6.4.5.3 差错更正的说明**

无。

#### **6.4.6 税项**

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008年9月18日《上海、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[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、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》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《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]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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、债券免征增值税;2018年1月1日起,公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务,以基金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。

(2) 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,暂不计缴企业所得税。

(3) 对基金取得的股票股息、红利收入,由上市公司代扣代缴个人所得税;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,股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。对基金通过港股通投资香港联交所上市H股取得的股息红利,H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请,由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册,H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过港股通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利,由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

(4) 对于基金从事A股买卖,出让方按0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税,受让方不再缴纳印花税;自2023年8月28日起,出让方减按0.05%的税率缴纳证券(股票)交易印花税。对于基金通过港股通买卖、继承、赠与联交所上市股票,按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

### 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06月30日	
活期存款	788,756.69	
等于：本金	788,147.11	
加：应计利息	609.58	
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	788,756.69	

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2024年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	103,679,122.37	-	99,368,989.72	-4,310,132.65
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	103,679,122.37	-	99,368,989.72	-4,310,132.65

### 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06月30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	101,365,240.00	-	-	-
--股指期货	101,365,240.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	101,365,240.00	-	-	-

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为零。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合约产生的持仓损益。因此，衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的股指期货暂收暂付款(结算所得的持仓损益)抵销后无余额。

#### 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
IC2407	中证500股指期货2407合约	-33.00	-32,456,160.00	1,373,160.00
IM2409	中证1000股指期货	-16.00	-15,296,640.00	1,834,560.00

	2409合约			
IC2409	中证500股指期货2409合约	-7.00	-6,825,280.00	701,400.00
IF2407	沪深300股指期货2407合约	-41.00	-42,275,100.00	602,940.00
合计				4,512,060.00
减：可抵销期货暂收款				4,512,060.00
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

注：无。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

#### 6.4.7.5 其他资产

注：无。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	420,505.70
其中：交易所市场	420,505.70
银行间市场	-
应付利息	-



预提费用	9,944.48
合计	430,450.18

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	10,576,658.28	10,576,658.28
本期申购	127,713,897.32	127,713,897.32
本期赎回（以“-”号填列）	-270,985.74	-270,985.74
本期末	138,019,569.86	138,019,569.86

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

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	-309,990.71	49,332.46	-260,658.25
本期期初	-309,990.71	49,332.46	-260,658.25
本期利润	884,480.73	-13,638.69	870,842.04
本期基金份额交易产生的变动数	97,602.14	419,527.11	517,129.25
其中：基金申购款	93,029.73	420,264.24	513,293.97
基金赎回款	4,572.41	-737.13	3,835.28
本期已分配利润	-	-	-
本期末	672,092.16	455,220.88	1,127,313.04

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
	活期存款利息收入

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	47,415.11
其他	165.16
合计	53,639.76

#### 6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
卖出股票成交总额	270,134,022.87
减：卖出股票成本总额	270,425,378.55
减：交易费用	651,222.66
买卖股票差价收入	-942,578.34

#### 6.4.7.11 基金投资收益

注：无。

#### 6.4.7.12 债券投资收益

##### 6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
债券投资收益——利息收入	449.32
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-112.00
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	337.32

##### 6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	812,138.30
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	799,984.00
减：应计利息总额	12,266.30
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-112.00

#### 6.4.7.13 资产支持证券投资收益

注：无。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

注：无。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

##### 6.4.7.15.1 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
期货投资	988,048.84

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
股票投资产生的股利收益	1,180,226.53
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	1,180,226.53

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
1.交易性金融资产	-4,306,709.16
——股票投资	-4,306,709.16
——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	4,440,260.00
——权证投资	-
——期货投资	4,440,260.00
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	147,189.53
合计	-13,638.69

**6.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
基金赎回费收入	652.58
合计	652.58

**6.4.7.19 信用减值损失**

注：无。

**6.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
审计费用	9,944.48
信息披露费	-
证券出借违约金	-
汇划手续费	30.00
合计	9,974.48

#### 6.4.7.21 分部报告

无。

#### 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

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方无发生变化的情况。

##### 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
国联基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国民生银行股份有限公司	基金托管人
国联证券股份有限公司	基金管理人股东、基金销售机构
上海融晟投资有限公司	基金管理人股东
国联（北京）资产管理有限公司	基金管理人子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 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

注：无。

#### 6.4.10.1.2 权证交易

注：无。

#### 6.4.10.1.3 债券交易

注：无。

#### 6.4.10.1.4 债券回购交易

注：无。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：无。

### 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01月01日至20 24年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至20 23年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	381,878.79	811,570.08
其中：应支付销售机构的客户维护费	123,491.92	43,288.68
应支付基金管理人的净管理费	258,386.87	768,281.40

注：①支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值的年费率计提，每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.20%/当年天数。

②客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024 年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	63,646.49	169,077.09

注：①支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值的年费率计提，每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

#### 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

注：无。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

项目	本期 2024年01月01日至 2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至 2023年06月30日
基金合同生效日（2020年04月03日）持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
报告期初持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	7.25%	33.51%

注：基金管理人持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付；

##### 6.4.10.4.2 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

注：无。

#### 6.4.10.5 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 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国民生银行股份有限公司	788,756.69	6,059.49	1,669,312.83	18,258.56

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行同业利率计息。本基金用于证券交易结算的资金通过托管人托管结算资金专用存款账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

注：无。

#### 6.4.12 期末（2024年06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
603285	键邦股份	2024-06-28	1个月内（含）	新股未流通	18.65	18.65	646	12,047.90	12,047.90	-
603285	键邦股份	2024-06-28	6个月	首次公开发行限售	18.65	18.65	72	1,342.80	1,342.80	-



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，新增股票的受限期、流通受限类型和期末估值价格与原股票一致。

#### **6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

注：无。

#### **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**

注：无。

##### **6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

无。

#### **6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券**

注：无。

### **6.4.13 金融工具风险及管理**

#### **6.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人实行全面、系统的风险管理，风险管理覆盖公司所有战略环节、业务环节和操作环节，构建了分工明确、相互协作、彼此牵制的风险管理组织结构，形成了由四大防线共同筑成的风险管理体系。本基金管理人的各个业务部门为第一道防线，各业务部门总监作为风险责任人，负责制订本部门的作业流程以及风险控制措施；公司专属风险管理部门法律合规部和风险管理部为第二道防线，负责对公司业务的法律合规风险、投资管理风险和运作风险进行监控管理；公司经营管理层和公司内控及风险管理委员会为第三道防线，负责对风险状况进行全面监督并及时制定相应的对策和实施监控措施；董事会下属的风险与合规委员会为第四道防线，负责审查公司对公司内外部风险识别、评估和分析等情况，及公司内部控制、风险管理政策、风险管理制度的执行情况等。

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。

#### **6.4.13.2 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的发行人出现违约、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。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的信用评级，通过单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制，通过分散化投资以分散信用风险。

按信用评级列示的债券、资产支持证券和同业存单的投资情况如下表所示，如无表格，则本基金于本报告期末及上年度末未持有除国债、地方政府债、政策性金融债、央行票据以外的债券。

##### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

注：无。

##### **6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

注：无。

##### **6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

注：无。

##### **6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

注：无。

##### **6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

注：无。

##### **6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

注：无。

#### **6.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于产品开放赎回期间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。

#### **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严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注6.4.12.3中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在1个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### **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**

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因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关于未来现金流的风险。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。

###### **6.4.13.4.1.1 利率风险敞口**

单位：人民币元

本期末 2024年0 6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	788,756.69	-	-	-	788,756.69
结算备付金	17,102,250.47	-	-	-	17,102,250.47
存出保证金	11,669,290.18	-	-	-	11,669,290.18
交易性金融资产	-	-	-	99,368,989.72	99,368,989.72
应收清算款	-	-	-	10,967,387.96	10,967,387.96
资产总计	29,560,297.34	-	-	110,336,377.68	139,896,675.02
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	136,564.89	136,564.89
应付托管费	-	-	-	22,760.80	22,760.80
应交税费	-	-	-	160,016.25	160,016.25
其他负债	-	-	-	430,450.18	430,450.18
负债总计	-	-	-	749,792.12	749,792.12
利率敏感度缺口	29,560,297.34	-	-	109,586,585.56	139,146,882.90
上年度末 2023年1	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

2月31日					
资产					
货币资金	4,626.44	-	-	-	4,626.44
结算备付金	1,064,384.68	-	-	-	1,064,384.68
存出保证金	822,712.20	-	-	-	822,712.20
交易性金融资产	-	-	-	7,101,523.08	7,101,523.08
买入返售金融资产	1,399,833.24	-	-	-	1,399,833.24
应收清算款	-	-	-	29,822.80	29,822.80
资产总计	3,291,556.56	-	-	7,131,345.88	10,422,902.44
负债					
应付清算款	-	-	-	32,209.43	32,209.43
应付管理人报酬	-	-	-	10,480.21	10,480.21
应付托管费	-	-	-	1,746.71	1,746.71
其他负债	-	-	-	62,466.06	62,466.06
负债总计	-	-	-	106,902.41	106,902.41
利率敏感度缺口	3,291,556.56	-	-	7,024,443.47	10,316,000.03

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，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

注：利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的情况下，利率发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值可参考的公允价值产生的影响。本基金于本报告期末及上年度末未持有债券投资或持有的债券投资占比并不重大，因而市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

#### 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。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于上市交易的证券，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。本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。

##### 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06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	99,368,989.72	71.41	7,101,523.08	68.84
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投	-	-	-	-

资				
衍生金融资产 — 权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	99,368,989.72	71.41	7,101,523.08	68.84

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1、估测组合市场价格风险的敏感性为考察沪深300指数变动时，因股票资产变动导致对基金资产净值的影响金额；		
	2、假定沪深300指数变化5%，其他市场变量不变；		
	3、Beta系数是根据组合在过去一年的净值数据和沪深300指数数据回归得出，对于成立不足一年的组合，取自成立以来的数据计算。		
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 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
	沪深300指数上升5%	353,355.84	71,516.84
	沪深300指数下降5%	-353,355.84	-71,516.84

注：本基金管理人运用定量分析方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

### 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。

#### 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06月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	99,355,599.02	7,101,523.08
第二层次	13,390.70	-
第三层次	-	-
合计	99,368,989.72	7,101,523.08

#### 6.4.14.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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。

#### 6.4.14.4 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。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## §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	99,368,989.72	71.03
	其中：股票	99,368,989.72	71.03
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	17,891,007.16	12.79
8	其他各项资产	22,636,678.14	16.18
9	合计	139,896,675.02	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	919,454.00	0.66
B	采矿业	7,519,273.99	5.40
C	制造业	62,308,787.73	44.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,066,162.00	4.36
E	建筑业	405,045.00	0.29
F	批发和零售业	766,562.00	0.55
G	交通运输、仓储和邮政业	3,296,969.00	2.37
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,116,535.00	3.68
J	金融业	9,828,392.00	7.06
K	房地产业	83,378.00	0.06
L	租赁和商务服务业	716,838.00	0.52
M	科学研究和技术服务业	665,171.00	0.48
N	水利、环境和公共设施管理业	309,466.00	0.22
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	73,746.00	0.05
Q	卫生和社会工作	778,263.00	0.56
R	文化、体育和娱乐业	357,251.00	0.26
S	综合	157,696.00	0.11
	合计	99,368,989.72	71.41

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股股票。

### 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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	1,400	2,054,346.00	1.48
2	300750	宁德时代	7,500	1,350,225.00	0.97
3	600036	招商银行	36,100	1,234,259.00	0.89
4	601318	中国平安	26,400	1,091,904.00	0.78
5	600900	长江电力	36,400	1,052,688.00	0.76
6	601899	紫金矿业	56,800	997,976.00	0.72
7	000333	美的集团	15,200	980,400.00	0.70
8	601166	兴业银行	47,400	835,188.00	0.60
9	601088	中国神华	16,627	737,739.99	0.53
10	000651	格力电器	18,100	709,882.00	0.51
11	600690	海尔智家	24,700	700,986.00	0.50
12	601328	交通银行	87,700	655,119.00	0.47
13	000725	京东方 A	159,300	651,537.00	0.47
14	600309	万华化学	8,000	646,880.00	0.46
15	601601	中国太保	21,900	610,134.00	0.44
16	600795	国电电力	97,500	584,025.00	0.42
17	601857	中国石油	56,400	582,048.00	0.42

18	002714	牧原股份	13,300	579,880.00	0.42
19	600547	山东黄金	20,800	569,504.00	0.41
20	600926	杭州银行	43,400	566,370.00	0.41
21	000538	云南白药	10,800	552,420.00	0.40
22	000768	中航西飞	22,600	543,078.00	0.39
23	600028	中国石化	84,800	535,936.00	0.39
24	601766	中国中车	70,200	527,202.00	0.38
25	600941	中国移动	4,900	526,750.00	0.38
26	600183	生益科技	25,000	526,500.00	0.38
27	601225	陕西煤业	20,000	515,400.00	0.37
28	000338	潍柴动力	31,500	511,560.00	0.37
29	600886	国投电力	27,500	501,600.00	0.36
30	601600	中国铝业	64,300	490,609.00	0.35
31	002179	中航光电	12,800	487,040.00	0.35
32	600660	福耀玻璃	10,100	483,790.00	0.35
33	600588	用友网络	48,100	481,000.00	0.35
34	000400	许继电气	13,900	478,299.00	0.34
35	601229	上海银行	65,000	471,900.00	0.34
36	600968	海油发展	114,500	471,740.00	0.34
37	688007	光峰科技	28,600	460,460.00	0.33
38	002683	广东宏大	22,800	458,964.00	0.33
39	002595	豪迈科技	12,000	458,040.00	0.33
40	601872	招商轮船	54,200	457,990.00	0.33
41	000157	中联重科	59,300	455,424.00	0.33
42	000883	湖北能源	75,700	454,957.00	0.33
43	002532	天山铝业	55,900	453,349.00	0.33
44	688728	格科微	37,200	450,492.00	0.32
45	600282	南钢股份	89,700	446,706.00	0.32
46	002078	太阳纸业	32,000	446,400.00	0.32
47	000703	恒逸石化	62,800	445,252.00	0.32
48	603556	海兴电力	9,500	444,885.00	0.32

49	600098	广州发展	69,500	444,800.00	0.32
50	688002	睿创微纳	15,900	444,723.00	0.32
51	002563	森马服饰	76,200	442,722.00	0.32
52	603728	鸣志电器	11,000	442,530.00	0.32
53	601336	新华保险	14,700	441,441.00	0.32
54	600416	湘电股份	44,400	441,336.00	0.32
55	600745	闻泰科技	15,600	440,700.00	0.32
56	300601	康泰生物	28,000	437,080.00	0.31
57	601319	中国人保	84,500	435,175.00	0.31
58	688276	百克生物	15,300	434,061.00	0.31
59	603185	弘元绿能	25,200	430,668.00	0.31
60	002153	石基信息	75,100	430,323.00	0.31
61	688567	孚能科技	44,800	430,080.00	0.31
62	300226	上海钢联	25,000	423,500.00	0.30
63	605499	东鹏饮料	1,950	420,712.50	0.30
64	600025	华能水电	38,900	419,342.00	0.30
65	002241	歌尔股份	21,400	417,514.00	0.30
66	603348	文灿股份	14,900	412,581.00	0.30
67	600150	中国船舶	10,100	411,171.00	0.30
68	600489	中金黄金	27,200	402,560.00	0.29
69	002410	广联达	42,000	402,360.00	0.29
70	600559	老白干酒	21,900	398,142.00	0.29
71	300433	蓝思科技	21,600	394,200.00	0.28
72	600674	川投能源	20,900	391,875.00	0.28
73	601058	赛轮轮胎	27,700	387,800.00	0.28
74	688561	奇安信	16,400	387,368.00	0.28
75	601231	环旭电子	24,100	386,805.00	0.28
76	000858	五粮液	3,000	384,120.00	0.28
77	600705	中航产融	172,100	382,062.00	0.27
78	002001	新和成	19,600	376,320.00	0.27
79	600095	湘财股份	62,600	373,096.00	0.27

80	600552	凯盛科技	39,500	372,485.00	0.27
81	300979	华利集团	6,000	365,100.00	0.26
82	600219	南山铝业	95,300	363,093.00	0.26
83	600760	中航沈飞	9,000	360,900.00	0.26
84	600233	圆通速递	22,900	358,385.00	0.26
85	000786	北新建材	12,000	355,920.00	0.26
86	002073	软控股份	48,100	355,459.00	0.26
87	002916	深南电路	3,300	349,041.00	0.25
88	600018	上港集团	60,300	348,534.00	0.25
89	601898	中煤能源	27,600	344,448.00	0.25
90	000975	山金国际	21,000	342,090.00	0.25
91	000876	新希望	37,200	340,008.00	0.24
92	601009	南京银行	32,400	336,636.00	0.24
93	002594	比亚迪	1,300	325,325.00	0.23
94	300759	康龙化成	17,500	325,150.00	0.23
95	002252	上海莱士	40,900	319,838.00	0.23
96	688111	金山办公	1,400	318,500.00	0.23
97	002821	凯莱英	4,800	315,840.00	0.23
98	000800	一汽解放	39,900	312,417.00	0.22
99	600732	爱旭股份	33,000	298,650.00	0.21
100	002601	龙佰集团	16,000	297,120.00	0.21
101	601838	成都银行	19,300	293,167.00	0.21
102	000516	国际医学	61,900	289,692.00	0.21
103	002128	电投能源	13,700	289,070.00	0.21
104	600993	马应龙	10,800	288,036.00	0.21
105	600882	妙可蓝多	22,200	276,834.00	0.20
106	600875	东方电气	14,800	273,060.00	0.20
107	603558	健盛集团	27,400	272,630.00	0.20
108	002567	唐人神	49,400	264,784.00	0.19
109	601865	福莱特	13,000	261,300.00	0.19
110	688187	时代电气	5,200	256,776.00	0.18

111	601398	工商银行	44,800	255,360.00	0.18
112	002475	立讯精密	6,400	251,584.00	0.18
113	688208	道通科技	10,200	246,228.00	0.18
114	300134	大富科技	36,000	245,520.00	0.18
115	688510	航亚科技	13,300	244,853.00	0.18
116	600999	招商证券	17,600	244,816.00	0.18
117	000598	兴蓉环境	32,500	244,400.00	0.18
118	600529	山东药玻	9,600	243,264.00	0.17
119	002745	木林森	30,100	242,606.00	0.17
120	603338	浙江鼎力	4,000	241,680.00	0.17
121	002831	裕同科技	9,400	240,546.00	0.17
122	600578	京能电力	73,900	239,436.00	0.17
123	600398	海澜之家	25,900	239,316.00	0.17
124	600459	贵研铂业	17,700	239,127.00	0.17
125	600458	时代新材	23,600	238,360.00	0.17
126	300747	锐科激光	13,400	237,850.00	0.17
127	688363	华熙生物	4,200	237,594.00	0.17
128	603056	德邦股份	18,000	235,800.00	0.17
129	603565	中谷物流	26,900	235,106.00	0.17
130	000933	神火股份	11,600	234,668.00	0.17
131	603997	继峰股份	22,900	234,267.00	0.17
132	603225	新凤鸣	15,000	233,850.00	0.17
133	002019	亿帆医药	18,800	232,368.00	0.17
134	002240	盛新锂能	17,200	230,824.00	0.17
135	002597	金禾实业	11,600	230,724.00	0.17
136	603568	伟明环保	11,200	230,496.00	0.17
137	605020	永和股份	12,000	230,160.00	0.17
138	000550	江铃汽车	10,600	230,126.00	0.17
139	601101	昊华能源	25,000	229,750.00	0.17
140	600062	华润双鹤	11,700	229,086.00	0.16
141	688220	翱捷科技	6,100	228,506.00	0.16

142	601828	美凯龙	89,100	227,205.00	0.16
143	603919	金徽酒	12,500	227,125.00	0.16
144	000997	新大陆	16,300	226,733.00	0.16
145	601608	中信重工	59,200	225,552.00	0.16
146	603699	纽威股份	13,100	224,272.00	0.16
147	603529	爱玛科技	8,200	224,106.00	0.16
148	002497	雅化集团	25,100	223,892.00	0.16
149	002387	维信诺	36,800	223,744.00	0.16
150	603337	杰克股份	8,500	223,720.00	0.16
151	002807	江阴银行	59,100	222,807.00	0.16
152	600030	中信证券	12,000	218,760.00	0.16
153	300348	长亮科技	31,500	214,830.00	0.15
154	600276	恒瑞医药	5,300	203,838.00	0.15
155	300760	迈瑞医疗	700	203,637.00	0.15
156	600066	宇通客车	7,700	198,660.00	0.14
157	600399	抚顺特钢	34,400	193,672.00	0.14
158	600197	伊力特	10,800	192,348.00	0.14
159	600887	伊利股份	7,400	191,216.00	0.14
160	600105	永鼎股份	49,700	184,884.00	0.13
161	600012	皖通高速	13,100	183,007.00	0.13
162	002534	西子洁能	18,200	182,182.00	0.13
163	600642	申能股份	20,100	177,483.00	0.13
164	688772	珠海冠宇	11,889	177,146.10	0.13
165	002273	水晶光电	10,400	176,592.00	0.13
166	603866	桃李面包	34,800	176,436.00	0.13
167	002608	江苏国信	22,500	174,375.00	0.13
168	002035	华帝股份	27,700	172,571.00	0.12
169	600483	福能股份	14,800	172,568.00	0.12
170	601991	大唐发电	57,300	172,473.00	0.12
171	600498	烽火通信	10,800	171,720.00	0.12
172	002025	航天电器	3,700	171,606.00	0.12

173	600707	彩虹股份	25,100	170,931.00	0.12
174	000830	鲁西化工	14,700	170,373.00	0.12
175	601866	中远海发	65,700	169,506.00	0.12
176	600582	天地科技	24,600	169,494.00	0.12
177	002223	鱼跃医疗	4,500	169,200.00	0.12
178	600612	老凤祥	2,900	168,751.00	0.12
179	002408	齐翔腾达	30,100	168,560.00	0.12
180	300296	利亚德	37,400	168,300.00	0.12
181	000050	深天马 A	23,100	168,168.00	0.12
182	002444	巨星科技	6,800	167,960.00	0.12
183	002044	美年健康	44,400	167,832.00	0.12
184	601107	四川成渝	31,900	167,475.00	0.12
185	000513	丽珠集团	4,500	167,445.00	0.12
186	603712	七一二	9,200	167,348.00	0.12
187	002028	思源电气	2,500	167,250.00	0.12
188	600350	山东高速	18,800	166,380.00	0.12
189	603882	金域医学	6,100	165,859.00	0.12
190	002064	华峰化学	23,100	165,627.00	0.12
191	688520	神州细胞	4,200	165,270.00	0.12
192	000683	远兴能源	23,900	165,149.00	0.12
193	601567	三星医疗	4,700	164,500.00	0.12
194	600486	扬农化工	2,900	163,705.00	0.12
195	600521	华海药业	9,600	163,680.00	0.12
196	688065	凯赛生物	3,600	163,404.00	0.12
197	002739	万达电影	13,500	163,215.00	0.12
198	000423	东阿阿胶	2,600	162,760.00	0.12
199	600739	辽宁成大	19,300	161,541.00	0.12
200	002961	瑞达期货	14,700	160,965.00	0.12
201	600060	海信视像	6,500	160,810.00	0.12
202	300558	贝达药业	4,900	159,495.00	0.11
203	688778	厦钨新能	5,100	159,324.00	0.11



204	000729	燕京啤酒	18,000	158,940.00	0.11
205	603678	火炬电子	6,400	158,016.00	0.11
206	600673	东阳光	22,400	157,696.00	0.11
207	600380	健康元	14,100	157,497.00	0.11
208	688169	石头科技	400	157,040.00	0.11
209	300748	金力永磁	12,100	156,816.00	0.11
210	600315	上海家化	8,800	156,464.00	0.11
211	000758	中色股份	30,200	153,416.00	0.11
212	002468	申通快递	18,200	152,880.00	0.11
213	002993	奥海科技	4,100	152,520.00	0.11
214	603517	绝味食品	9,900	152,460.00	0.11
215	000801	四川九洲	15,200	152,000.00	0.11
216	600037	歌华有线	25,400	151,892.00	0.11
217	601126	四方股份	7,900	151,838.00	0.11
218	600392	盛和资源	17,600	151,712.00	0.11
219	000902	新洋丰	12,700	150,749.00	0.11
220	300212	易华录	8,900	149,787.00	0.11
221	002865	钧达股份	3,900	149,682.00	0.11
222	002318	久立特材	6,400	149,312.00	0.11
223	600812	华北制药	36,200	149,144.00	0.11
224	300861	美畅股份	7,700	148,995.00	0.11
225	300595	欧普康视	9,500	148,960.00	0.11
226	002020	京新药业	14,200	148,674.00	0.11
227	300438	鹏辉能源	8,100	148,554.00	0.11
228	000921	海信家电	4,600	148,304.00	0.11
229	000860	顺鑫农业	8,800	147,312.00	0.11
230	002773	康弘药业	6,800	147,220.00	0.11
231	000600	建投能源	23,300	146,790.00	0.11
232	600995	南网储能	15,100	145,866.00	0.10
233	002422	科伦药业	4,800	145,584.00	0.10
234	600927	永安期货	13,000	144,950.00	0.10

235	002212	天融信	29,700	144,639.00	0.10
236	002036	联创电子	21,400	144,450.00	0.10
237	603169	兰石重装	32,000	144,000.00	0.10
238	601577	长沙银行	17,500	143,150.00	0.10
239	603039	泛微网络	4,500	142,920.00	0.10
240	002221	东华能源	17,400	142,854.00	0.10
241	603355	莱克电气	6,600	142,560.00	0.10
242	600480	凌云股份	14,500	142,535.00	0.10
243	603129	春风动力	1,000	142,340.00	0.10
244	300463	迈克生物	12,500	142,250.00	0.10
245	003006	百亚股份	6,000	142,200.00	0.10
246	002635	安洁科技	9,200	142,048.00	0.10
247	300687	赛意信息	10,200	141,984.00	0.10
248	688009	中国通号	23,600	141,600.00	0.10
249	600320	振华重工	41,300	141,246.00	0.10
250	300451	创业慧康	40,800	141,168.00	0.10
251	600366	宁波韵升	26,800	139,896.00	0.10
252	002068	黑猫股份	19,600	139,160.00	0.10
253	603026	石大胜华	4,100	138,580.00	0.10
254	605333	沪光股份	4,700	130,895.00	0.09
255	300498	温氏股份	6,600	130,812.00	0.09
256	600155	华创云信	21,700	128,247.00	0.09
257	002311	海大集团	2,700	127,035.00	0.09
258	688383	新益昌	2,400	125,064.00	0.09
259	000913	钱江摩托	7,900	124,504.00	0.09
260	000738	航发控制	6,200	124,434.00	0.09
261	603055	台华新材	12,200	123,586.00	0.09
262	300059	东方财富	11,500	121,440.00	0.09
263	301155	海力风电	3,000	120,690.00	0.09
264	002385	大北农	30,900	118,965.00	0.09
265	600125	铁龙物流	19,900	118,803.00	0.09

266	600050	中国联通	24,600	115,620.00	0.08
267	601288	农业银行	25,700	112,052.00	0.08
268	601985	中国核电	10,200	108,732.00	0.08
269	603103	横店影视	7,700	106,568.00	0.08
270	601000	唐山港	22,000	103,400.00	0.07
271	002541	鸿路钢构	5,800	98,426.00	0.07
272	688188	柏楚电子	520	95,966.00	0.07
273	601816	京沪高铁	17,800	95,586.00	0.07
274	600956	新天绿能	11,600	94,772.00	0.07
275	600765	中航重机	4,600	93,840.00	0.07
276	300088	长信科技	19,400	91,180.00	0.07
277	300888	稳健医疗	3,600	91,080.00	0.07
278	600021	上海电力	9,200	90,988.00	0.07
279	603979	金诚信	1,800	90,954.00	0.07
280	600820	隧道股份	13,900	90,767.00	0.07
281	600801	华新水泥	6,600	90,750.00	0.07
282	601598	中国外运	16,100	90,643.00	0.07
283	002138	顺络电子	3,300	90,618.00	0.07
284	600038	中直股份	2,200	90,442.00	0.06
285	600863	内蒙华电	19,400	90,016.00	0.06
286	002429	兆驰股份	18,700	89,947.00	0.06
287	603486	科沃斯	1,900	89,642.00	0.06
288	002152	广电运通	8,500	88,910.00	0.06
289	601717	郑煤机	6,000	88,800.00	0.06
290	002436	兴森科技	8,600	88,752.00	0.06
291	600339	中油工程	28,400	88,608.00	0.06
292	600808	马钢股份	43,800	88,476.00	0.06
293	300677	英科医疗	3,300	88,473.00	0.06
294	600862	中航高科	4,700	88,266.00	0.06
295	600988	赤峰黄金	5,400	88,236.00	0.06
296	600737	中粮糖业	9,200	88,228.00	0.06

297	688536	思瑞浦	900	88,029.00	0.06
298	601168	西部矿业	4,900	87,955.00	0.06
299	600143	金发科技	13,300	87,913.00	0.06
300	603606	东方电缆	1,800	87,858.00	0.06
301	002203	海亮股份	11,000	87,780.00	0.06
302	601990	南京证券	11,400	87,552.00	0.06
303	002568	百润股份	5,200	87,516.00	0.06
304	688779	五矿新能	18,900	87,507.00	0.06
305	000066	中国长城	10,000	87,500.00	0.06
306	601019	山东出版	7,400	87,468.00	0.06
307	002120	韵达股份	11,300	87,462.00	0.06
308	300357	我武生物	4,300	86,946.00	0.06
309	002487	大金重工	3,800	86,944.00	0.06
310	300699	光威复材	3,500	86,905.00	0.06
311	000887	中鼎股份	7,100	86,904.00	0.06
312	600859	王府井	7,400	86,876.00	0.06
313	600166	福田汽车	38,600	86,850.00	0.06
314	000739	普洛药业	6,400	86,848.00	0.06
315	603927	中科软	4,800	86,832.00	0.06
316	000998	隆平高科	8,800	86,504.00	0.06
317	600763	通策医疗	1,600	86,480.00	0.06
318	002080	中材科技	6,700	86,430.00	0.06
319	002439	启明星辰	5,000	86,300.00	0.06
320	600580	卧龙电驱	7,100	86,265.00	0.06
321	600549	厦门钨业	5,000	86,250.00	0.06
322	002867	周大生	6,600	86,196.00	0.06
323	300054	鼎龙股份	3,800	86,184.00	0.06
324	002653	海思科	2,800	85,960.00	0.06
325	000967	盈峰环境	20,300	85,869.00	0.06
326	300037	新宙邦	3,000	85,680.00	0.06
327	000893	亚钾国际	5,300	85,648.00	0.06

328	600970	中材国际	7,100	85,626.00	0.06
329	600566	济川药业	2,700	85,617.00	0.06
330	688521	芯原股份	3,200	85,600.00	0.06
331	688006	杭可科技	4,900	85,505.00	0.06
332	300308	中际旭创	620	85,485.60	0.06
333	600096	云天化	4,400	85,448.00	0.06
334	688516	奥特维	2,043	85,417.83	0.06
335	600985	淮北矿业	5,100	85,374.00	0.06
336	600027	华电国际	12,300	85,362.00	0.06
337	300568	星源材质	10,400	85,280.00	0.06
338	003022	联泓新科	6,200	85,002.00	0.06
339	002518	科士达	4,800	84,960.00	0.06
340	301029	怡合达	4,300	84,538.00	0.06
341	300001	特锐德	4,200	84,504.00	0.06
342	603218	日月股份	8,200	84,214.00	0.06
342	600329	达仁堂	2,600	84,214.00	0.06
344	002353	杰瑞股份	2,400	84,192.00	0.06
345	300676	华大基因	2,400	84,024.00	0.06
346	002850	科达利	1,100	84,018.00	0.06
347	600129	太极集团	2,900	83,868.00	0.06
348	688005	容百科技	3,600	83,808.00	0.06
349	603456	九洲药业	6,100	83,692.00	0.06
350	688239	航宇科技	2,400	83,520.00	0.06
351	603737	三棵树	2,300	83,421.00	0.06
352	603786	科博达	1,300	83,395.00	0.06
353	601155	新城控股	9,400	83,378.00	0.06
354	603233	大参林	5,800	82,940.00	0.06
355	300012	华测检测	8,200	82,492.00	0.06
356	002056	横店东磁	6,600	82,302.00	0.06
357	000429	粤高速 A	7,900	82,239.00	0.06
358	002544	普天科技	4,400	82,236.00	0.06

359	688017	绿的谐波	1,000	82,100.00	0.06
360	600481	双良节能	17,500	81,725.00	0.06
361	603993	洛阳钼业	9,600	81,600.00	0.06
362	601298	青岛港	8,500	81,260.00	0.06
363	600971	恒源煤电	6,800	81,192.00	0.06
364	300724	捷佳伟创	1,500	81,015.00	0.06
365	603505	金石资源	2,900	80,997.00	0.06
366	603127	昭衍新药	6,100	80,947.00	0.06
367	002096	易普力	6,800	80,920.00	0.06
368	300628	亿联网络	2,200	80,894.00	0.06
369	002139	拓邦股份	7,600	80,712.00	0.06
370	600362	江西铜业	3,400	80,512.00	0.06
371	002531	天顺风能	9,000	80,460.00	0.06
372	000723	美锦能源	16,900	80,444.00	0.06
373	002463	沪电股份	2,200	80,300.00	0.06
374	603279	景津装备	3,700	80,253.00	0.06
375	002460	赣锋锂业	2,800	80,220.00	0.06
376	688029	南微医学	1,300	80,028.00	0.06
377	002151	北斗星通	3,300	79,794.00	0.06
378	600516	方大炭素	18,500	79,735.00	0.06
379	002572	索菲亚	5,200	79,716.00	0.06
380	601163	三角轮胎	5,200	79,144.00	0.06
381	002539	云图控股	11,100	79,143.00	0.06
382	603612	索通发展	6,200	79,112.00	0.06
383	601500	通用股份	14,800	79,032.00	0.06
384	002399	海普瑞	9,100	78,897.00	0.06
385	603305	旭升集团	7,400	78,144.00	0.06
386	002396	星网锐捷	5,900	77,939.00	0.06
387	002011	盾安环境	7,900	77,657.00	0.06
388	601628	中国人寿	2,500	77,625.00	0.06
389	002602	世纪华通	22,500	77,175.00	0.06

389	000627	天茂集团	44,100	77,175.00	0.06
391	002430	杭氧股份	3,400	75,650.00	0.05
392	600295	鄂尔多斯	7,600	75,392.00	0.05
393	601636	旗滨集团	11,500	74,175.00	0.05
394	002947	恒铭达	2,100	73,920.00	0.05
395	002607	中公教育	48,200	73,746.00	0.05
396	000543	皖能电力	8,200	72,570.00	0.05
397	002791	坚朗五金	2,800	72,436.00	0.05
398	300638	广和通	4,200	71,820.00	0.05
399	603583	捷昌驱动	3,500	71,330.00	0.05
400	300735	光弘科技	3,300	71,280.00	0.05
401	002415	海康威视	2,300	71,093.00	0.05
402	600009	上海机场	2,200	70,950.00	0.05
403	002866	传艺科技	5,500	70,785.00	0.05
404	002724	海洋王	15,700	69,865.00	0.05
405	301078	孩子王	13,800	69,828.00	0.05
406	603108	润达医疗	4,600	69,644.00	0.05
407	002971	和远气体	2,800	69,384.00	0.05
408	002749	国光股份	4,600	69,184.00	0.05
409	601015	陕西黑猫	24,700	69,160.00	0.05
410	600691	阳煤化工	40,400	69,084.00	0.05
411	688630	芯碁微装	1,100	68,827.00	0.05
412	002782	可立克	6,200	68,696.00	0.05
413	300382	斯莱克	11,600	68,556.00	0.05
414	603727	博迈科	5,200	68,432.00	0.05
415	300244	迪安诊断	5,700	68,400.00	0.05
416	605196	华通线缆	6,500	68,380.00	0.05
417	300142	沃森生物	6,000	68,280.00	0.05
418	002741	光华科技	7,600	68,248.00	0.05
419	000875	吉电股份	12,800	68,224.00	0.05
420	300772	运达股份	7,100	68,160.00	0.05

421	300181	佐力药业	4,500	68,040.00	0.05
422	688598	金博股份	2,400	67,920.00	0.05
423	002100	天康生物	9,800	67,914.00	0.05
424	600285	羚锐制药	2,800	67,788.00	0.05
425	601890	亚星锚链	9,600	67,680.00	0.05
426	688311	盟升电子	3,300	67,617.00	0.05
427	300850	新强联	4,500	67,590.00	0.05
428	000795	英洛华	12,200	67,588.00	0.05
429	688177	百奥泰	3,200	67,584.00	0.05
430	600810	神马股份	10,900	67,580.00	0.05
431	300377	赢时胜	13,300	67,564.00	0.05
432	002777	久远银海	4,500	67,455.00	0.05
433	002101	广东鸿图	6,400	67,392.00	0.05
434	002979	雷赛智能	3,700	67,340.00	0.05
435	600420	国药现代	6,300	67,284.00	0.05
436	002901	大博医疗	2,600	67,158.00	0.05
437	300233	金城医药	4,500	67,140.00	0.05
438	300085	银之杰	8,300	67,064.00	0.05
439	300693	盛弘股份	3,200	67,008.00	0.05
440	601886	江河集团	13,700	66,856.00	0.05
441	300080	易成新能	23,200	66,816.00	0.05
442	605090	九丰能源	2,300	66,700.00	0.05
443	002324	普利特	7,800	66,690.00	0.05
444	300113	顺网科技	6,500	66,560.00	0.05
445	603297	永新光学	1,100	66,539.00	0.05
446	301071	力量钻石	2,400	66,504.00	0.05
447	002549	凯美特气	13,000	66,430.00	0.05
448	688127	蓝特光学	3,600	66,204.00	0.05
449	300662	科锐国际	4,100	66,133.00	0.05
450	002135	东南网架	16,700	66,132.00	0.05
451	601778	晶科科技	29,000	66,120.00	0.05



452	002378	章源钨业	11,500	66,010.00	0.05
453	688690	纳微科技	3,800	66,006.00	0.05
454	688033	天宜上佳	11,000	66,000.00	0.05
455	002276	万马股份	9,200	65,964.00	0.05
456	688185	康希诺	1,600	65,744.00	0.05
457	002421	达实智能	28,200	65,706.00	0.05
458	002747	埃斯顿	4,600	65,412.00	0.05
459	688083	中望软件	900	65,358.00	0.05
460	002752	昇兴股份	12,900	65,274.00	0.05
461	300685	艾德生物	3,700	65,268.00	0.05
462	002706	良信股份	9,500	65,170.00	0.05
463	600211	西藏药业	2,000	65,160.00	0.05
464	301090	华润材料	9,900	65,142.00	0.05
465	688202	美迪西	2,500	65,125.00	0.05
466	002326	永太科技	8,300	64,906.00	0.05
467	300087	荃银高科	10,500	64,890.00	0.05
468	002048	宁波华翔	5,000	64,700.00	0.05
469	002550	千红制药	12,000	64,680.00	0.05
470	300068	南都电源	7,800	64,584.00	0.05
471	600063	皖维高新	18,200	64,064.00	0.05
472	688686	奥普特	1,000	64,030.00	0.05
473	601668	中国建筑	12,000	63,720.00	0.05
474	300482	万孚生物	2,600	63,440.00	0.05
475	300783	三只松鼠	2,900	63,423.00	0.05
476	603229	奥翔药业	6,300	63,315.00	0.05
477	688116	天奈科技	2,700	62,316.00	0.04
478	002928	华夏航空	9,800	62,132.00	0.04
479	603489	八方股份	2,300	62,054.00	0.04
480	600963	岳阳林纸	16,600	60,922.00	0.04
481	300203	聚光科技	6,000	60,540.00	0.04
482	002053	云南能投	5,000	60,450.00	0.04

483	002043	兔宝宝	5,800	60,146.00	0.04
484	603197	保隆科技	1,900	59,850.00	0.04
485	002912	中新赛克	3,300	58,476.00	0.04
486	300224	正海磁材	6,300	58,338.00	0.04
487	600556	天下秀	15,900	57,876.00	0.04
488	000568	泸州老窖	400	57,396.00	0.04
489	002041	登海种业	7,100	57,368.00	0.04
490	300119	瑞普生物	4,200	57,204.00	0.04
491	688388	嘉元科技	5,800	56,550.00	0.04
492	300973	立高食品	2,000	56,180.00	0.04
493	002838	道恩股份	6,200	56,172.00	0.04
494	601138	工业富联	2,000	54,800.00	0.04
495	300122	智飞生物	1,700	47,651.00	0.03
496	603711	香飘飘	3,400	47,090.00	0.03
497	688268	华特气体	900	46,449.00	0.03
498	688389	普门科技	2,600	42,276.00	0.03
499	600809	山西汾酒	200	42,176.00	0.03
500	600919	江苏银行	5,600	41,608.00	0.03
501	605186	健麾信息	1,600	35,936.00	0.03
502	002371	北方华创	100	31,989.00	0.02
503	601919	中远海控	1,900	29,431.00	0.02
504	600590	泰豪科技	7,600	28,956.00	0.02
505	002884	凌霄泵业	1,500	28,800.00	0.02
506	000783	长江证券	5,900	28,497.00	0.02
507	603259	药明康德	700	27,433.00	0.02
508	000970	中科三环	3,500	26,775.00	0.02
509	603317	天味食品	2,100	23,961.00	0.02
510	000001	平安银行	2,300	23,345.00	0.02
511	600406	国电南瑞	900	22,464.00	0.02
512	002472	双环传动	1,000	22,020.00	0.02
513	603285	键邦股份	718	13,390.70	0.01

514	600323	瀚蓝环境	600	12,540.00	0.01
515	600901	江苏金租	2,300	11,615.00	0.01
516	300455	航天智装	800	9,888.00	0.01
517	600039	四川路桥	1,200	9,468.00	0.01
518	002332	仙琚制药	800	9,128.00	0.01
519	002184	海得控制	800	7,184.00	0.01
520	603068	博通集成	300	6,828.00	0.00
521	000625	长安汽车	500	6,715.00	0.00
522	600710	苏美达	400	3,260.00	0.00
523	002926	华西证券	300	1,977.00	0.00
524	300009	安科生物	200	1,708.00	0.00
525	601011	宝泰隆	500	800.00	0.00
526	688636	智明达	26	592.80	0.00
527	688819	天能股份	20	477.20	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	600519	贵州茅台	2,519,350.00	24.42
2	601899	紫金矿业	2,121,096.00	20.56
3	300750	宁德时代	1,868,672.00	18.11
4	601318	中国平安	1,812,804.00	17.57
5	000338	潍柴动力	1,609,273.00	15.60
6	000333	美的集团	1,597,233.00	15.48
7	600900	长江电力	1,590,800.00	15.42
8	002410	广联达	1,447,519.00	14.03
9	600036	招商银行	1,410,073.00	13.67
10	601225	陕西煤业	1,366,193.00	13.24

11	002821	凯莱英	1,350,170.00	13.09
12	601919	中远海控	1,347,229.00	13.06
13	601985	中国核电	1,245,654.00	12.07
14	600588	用友网络	1,218,826.60	11.81
15	601872	招商轮船	1,206,461.36	11.70
16	300759	康龙化成	1,144,902.00	11.10
17	601600	中国铝业	1,141,993.00	11.07
18	601088	中国神华	1,119,486.48	10.85
19	601328	交通银行	1,094,950.00	10.61
20	601601	中国太保	1,087,338.00	10.54
21	300122	智飞生物	1,062,555.00	10.30
22	600028	中国石化	1,058,780.00	10.26
23	603185	弘元绿能	1,058,337.95	10.26
24	600547	山东黄金	1,040,993.00	10.09
25	600309	万华化学	1,038,100.00	10.06
26	601166	兴业银行	1,034,865.00	10.03
27	000725	京东方A	1,023,962.00	9.93
28	601058	赛轮轮胎	1,011,275.00	9.80
29	000651	格力电器	972,992.00	9.43
30	600927	永安期货	969,775.00	9.40
31	601989	中国重工	962,893.00	9.33
32	000157	中联重科	959,657.00	9.30
33	601857	中国石油	943,167.00	9.14
34	002001	新和成	941,707.20	9.13
35	002078	太阳纸业	907,456.00	8.80
36	600745	闻泰科技	895,586.00	8.68
37	600875	东方电气	892,901.00	8.66
38	600886	国投电力	889,514.00	8.62
39	000933	神火股份	887,765.00	8.61
40	600332	白云山	882,465.00	8.55
41	600233	圆通速递	882,071.00	8.55

42	300142	沃森生物	880,202.00	8.53
43	601766	中国中车	874,747.00	8.48
44	600690	海尔智家	872,348.00	8.46
45	600050	中国联通	869,667.00	8.43
46	603558	健盛集团	856,127.00	8.30
47	600660	福耀玻璃	849,292.00	8.23
48	601229	上海银行	845,775.00	8.20
49	002601	龙佰集团	844,842.00	8.19
50	688082	盛美上海	843,948.04	8.18
51	603568	伟明环保	837,626.00	8.12
52	600025	华能水电	832,161.00	8.07
53	601865	福莱特	830,999.00	8.06
54	600795	国电电力	823,367.00	7.98
55	600559	老白干酒	813,150.00	7.88
56	688220	翱捷科技	804,183.97	7.80
57	601398	工商银行	798,730.00	7.74
58	601878	浙商证券	798,405.00	7.74
59	601336	新华保险	793,903.00	7.70
60	600095	湘财股份	791,453.00	7.67
61	000400	许继电气	783,639.00	7.60
62	600320	振华重工	782,996.00	7.59
63	000975	山金国际	780,696.00	7.57
64	601898	中煤能源	775,975.00	7.52
65	600398	海澜之家	774,894.00	7.51
66	688561	奇安信	774,253.07	7.51
67	600489	中金黄金	771,264.00	7.48
68	600219	南山铝业	764,775.00	7.41
69	600030	中信证券	760,820.00	7.38
70	688363	华熙生物	759,535.25	7.36
71	688536	思瑞浦	756,456.55	7.33
72	002408	齐翔腾达	753,183.00	7.30

73	601168	西部矿业	751,019.00	7.28
74	600416	湘电股份	750,164.00	7.27
75	603517	绝味食品	743,358.42	7.21
76	600177	雅戈尔	743,176.52	7.20
77	601808	中海油服	741,387.67	7.19
78	600737	中粮糖业	737,542.00	7.15
79	600362	江西铜业	736,609.00	7.14
80	688728	格科微	735,501.46	7.13
81	000768	中航西飞	732,870.00	7.10
82	000039	中集集团	731,104.00	7.09
83	300296	利亚德	729,472.00	7.07
84	300979	华利集团	728,823.00	7.06
85	600941	中国移动	720,885.00	6.99
86	600019	宝钢股份	712,406.00	6.91
87	600988	赤峰黄金	712,017.00	6.90
88	601567	三星医疗	710,756.00	6.89
89	600066	宇通客车	709,910.00	6.88
90	002128	电投能源	706,403.00	6.85
91	601615	明阳智能	701,903.00	6.80
92	002916	深南电路	699,793.00	6.78
93	601991	大唐发电	699,541.00	6.78
94	600926	杭州银行	696,891.00	6.76
95	002714	牧原股份	696,591.00	6.75
96	600887	伊利股份	695,084.00	6.74
97	688521	芯原股份	689,866.59	6.69
98	603556	海兴电力	686,995.00	6.66
99	603317	天味食品	685,229.00	6.64
100	600282	南钢股份	684,969.00	6.64
101	600023	浙能电力	684,234.00	6.63
102	600999	招商证券	682,748.00	6.62
103	002925	盈趣科技	681,968.00	6.61

104	002223	鱼跃医疗	679,079.00	6.58
105	000703	恒逸石化	678,503.00	6.58
106	002773	康弘药业	674,201.00	6.54
107	600497	驰宏锌锗	671,529.00	6.51
108	688276	百克生物	669,627.40	6.49
109	600406	国电南瑞	667,091.00	6.47
110	601838	成都银行	664,072.00	6.44
111	300601	康泰生物	660,102.00	6.40
112	688567	孚能科技	659,336.84	6.39
113	000883	湖北能源	658,960.00	6.39
114	600150	中国船舶	657,443.00	6.37
115	600873	梅花生物	657,305.00	6.37
116	002064	华峰化学	653,777.00	6.34
117	601666	平煤股份	653,384.00	6.33
118	002739	万达电影	652,477.00	6.32
119	000538	云南白药	651,269.00	6.31
120	601319	中国人保	651,211.00	6.31
121	000100	TCL科技	649,798.60	6.30
122	000786	北新建材	644,098.00	6.24
123	688002	睿创微纳	640,944.34	6.21
124	600098	广州发展	640,094.00	6.20
125	600498	烽火通信	636,677.00	6.17
126	601728	中国电信	636,000.00	6.17
127	600295	鄂尔多斯	633,929.00	6.15
128	000050	深天马A	633,842.00	6.14
129	003816	中国广核	628,958.00	6.10
130	000800	一汽解放	628,254.00	6.09
131	603993	洛阳钼业	626,721.00	6.08
132	002153	石基信息	624,973.00	6.06
133	600018	上港集团	623,761.00	6.05
134	000423	东阿阿胶	613,524.00	5.95

135	003031	中瓷电子	612,614.00	5.94
136	600968	海油发展	607,510.00	5.89
137	002532	天山铝业	605,214.00	5.87
138	002273	水晶光电	604,985.00	5.86
139	300226	上海钢联	601,873.00	5.83
140	600998	九州通	598,853.00	5.81
141	000858	五粮液	598,190.00	5.80
142	603225	新凤鸣	597,775.00	5.79
143	300782	卓胜微	597,556.00	5.79
144	600989	宝丰能源	594,284.00	5.76
145	002683	广东宏大	593,341.00	5.75
146	688234	天岳先进	592,367.96	5.74
147	002841	视源股份	591,805.00	5.74
148	002179	中航光电	591,461.00	5.73
149	600183	生益科技	591,295.00	5.73
150	600160	巨化股份	587,372.00	5.69
151	000401	冀东水泥	583,548.00	5.66
152	600919	江苏银行	581,606.00	5.64
153	600760	中航沈飞	581,376.00	5.64
154	601828	美凯龙	580,793.00	5.63
155	002241	歌尔股份	580,782.00	5.63
156	300558	贝达药业	580,776.00	5.63
157	002271	东方雨虹	576,410.00	5.59
158	601231	环旭电子	573,929.00	5.56
159	601717	郑煤机	570,357.00	5.53
160	688187	时代电气	570,027.86	5.53
161	300748	金力永磁	565,090.00	5.48
162	601288	农业银行	564,607.00	5.47
163	002073	软控股份	564,094.00	5.47
164	002595	豪迈科技	563,493.00	5.46
165	600060	海信视像	562,274.00	5.45



166	002961	瑞达期货	561,032.00	5.44
167	601139	深圳燃气	560,290.72	5.43
168	002444	巨星科技	558,350.00	5.41
169	600012	皖通高速	558,195.00	5.41
170	000516	国际医学	556,169.00	5.39
171	688007	光峰科技	553,705.69	5.37
172	600031	三一重工	552,835.00	5.36
173	300676	华大基因	548,104.00	5.31
174	002436	兴森科技	547,392.00	5.31
175	002123	梦网科技	543,104.00	5.26
176	000876	新希望	538,383.00	5.22
177	002563	森马服饰	536,901.00	5.20
178	600901	江苏金租	536,542.20	5.20
179	688510	航亚科技	535,693.70	5.19
180	688185	康希诺	535,128.76	5.19
181	603589	口子窖	534,156.00	5.18
182	600673	东阳光	531,980.00	5.16
183	605499	东鹏饮料	528,395.50	5.12
184	000860	顺鑫农业	528,122.00	5.12
185	300496	中科创达	527,016.00	5.11
186	603348	文灿股份	517,187.00	5.01
187	601877	正泰电器	516,795.00	5.01
188	000528	柳工	516,098.00	5.00
189	300595	欧普康视	515,622.00	5.00
190	600511	国药股份	515,554.00	5.00
191	601169	北京银行	515,467.00	5.00
192	000166	申万宏源	514,776.00	4.99
193	300244	迪安诊断	513,237.00	4.98
194	603866	桃李面包	511,998.00	4.96
195	600521	华海药业	510,865.82	4.95
196	000708	中信特钢	510,667.00	4.95

197	002385	大北农	505,706.00	4.90
198	600578	京能电力	504,788.00	4.89
199	688366	昊海生科	504,554.83	4.89
200	600732	爱旭股份	503,875.00	4.88
201	000016	深康佳 A	502,360.00	4.87
202	002705	新宝股份	499,146.00	4.84
203	300433	蓝思科技	498,445.00	4.83
204	600820	隧道股份	493,072.00	4.78
205	002608	江苏国信	491,929.00	4.77
206	002387	维信诺	491,642.00	4.77
207	000598	兴蓉环境	489,467.00	4.74
208	002791	坚朗五金	487,736.00	4.73
209	300212	易华录	487,198.00	4.72
210	688180	君实生物	484,685.12	4.70
211	000729	燕京啤酒	482,645.00	4.68
212	600971	恒源煤电	481,727.00	4.67
213	000937	冀中能源	480,423.00	4.66
214	002865	钧达股份	478,751.00	4.64
215	601179	中国西电	478,443.00	4.64
216	600566	济川药业	478,386.00	4.64
217	688111	金山办公	476,556.72	4.62
218	000997	新大陆	473,640.00	4.59
219	600674	川投能源	469,933.00	4.56
220	600096	云天化	469,060.00	4.55
221	002311	海大集团	468,570.00	4.54
222	300390	天华新能	467,269.00	4.53
223	603026	石大胜华	466,671.00	4.52
224	600000	浦发银行	465,460.00	4.51
225	600460	士兰微	463,928.00	4.50
226	000066	中国长城	463,448.00	4.49
227	603195	公牛集团	462,975.00	4.49

228	002079	苏州固锴	462,676.00	4.49
229	002003	伟星股份	459,562.00	4.45
230	603379	三美股份	457,372.00	4.43
231	603728	鸣志电器	456,960.00	4.43
232	300047	天源迪科	455,699.00	4.42
233	600352	浙江龙盛	454,174.00	4.40
234	600499	科达制造	452,652.00	4.39
235	000739	普洛药业	452,440.00	4.39
236	603087	甘李药业	447,710.00	4.34
237	688776	国光电气	447,687.09	4.34
238	001914	招商积余	446,729.00	4.33
239	002472	双环传动	446,694.00	4.33
240	601598	中国外运	443,608.00	4.30
241	601233	桐昆股份	443,522.00	4.30
242	002019	亿帆医药	442,765.00	4.29
243	002648	卫星化学	441,916.00	4.28
244	600329	达仁堂	441,379.00	4.28
245	601995	中金公司	437,979.00	4.25
246	002399	海普瑞	437,784.00	4.24
247	300776	帝尔激光	436,382.00	4.23
248	603355	莱克电气	435,972.00	4.23
249	600346	恒力石化	433,686.00	4.20
250	002025	航天电器	433,461.00	4.20
251	000425	徐工机械	433,330.00	4.20
252	002600	领益智造	432,051.00	4.19
253	603979	金诚信	428,704.00	4.16
254	002203	海亮股份	428,220.00	4.15
255	600761	安徽合力	427,526.00	4.14
256	603297	永新光学	426,045.00	4.13
257	300123	亚光科技	425,975.00	4.13
258	600985	淮北矿业	425,641.00	4.13

259	600196	复星医药	423,843.00	4.11
260	002867	周大生	423,670.00	4.11
261	600808	马钢股份	423,487.00	4.11
262	600837	海通证券	422,346.00	4.09
263	600582	天地科技	422,181.00	4.09
264	601211	国泰君安	421,889.00	4.09
265	600029	南方航空	421,058.00	4.08
266	002384	东山精密	420,032.00	4.07
267	000627	天茂集团	419,061.00	4.06
268	688520	神州细胞	417,292.16	4.05
269	601101	昊华能源	416,814.00	4.04
270	600188	兖矿能源	414,771.50	4.02
271	688107	安路科技	414,383.82	4.02
272	600141	兴发集团	413,680.00	4.01
273	688516	奥特维	413,327.35	4.01
274	603939	益丰药房	413,046.00	4.00
275	002074	国轩高科	411,089.00	3.98
276	002539	云图控股	410,689.00	3.98
277	600529	山东药玻	410,144.00	3.98
278	603882	金域医学	410,133.00	3.98
279	000830	鲁西化工	409,820.00	3.97
280	600750	江中药业	409,258.52	3.97
281	601126	四方股份	408,749.00	3.96
282	600377	宁沪高速	408,025.00	3.96
283	601009	南京银行	407,913.00	3.95
284	002906	华阳集团	406,146.00	3.94
285	000895	双汇发展	404,887.00	3.92
286	603103	横店影视	404,744.00	3.92
287	600392	盛和资源	402,727.00	3.90
288	300088	长信科技	402,712.00	3.90
289	601988	中国银行	401,607.00	3.89

290	600075	新疆天业	401,563.00	3.89
291	001203	大中矿业	400,381.00	3.88
292	600552	凯盛科技	399,514.00	3.87
293	688586	江航装备	399,291.82	3.87
294	603039	泛微网络	398,740.00	3.87
295	002831	裕同科技	398,713.80	3.87
296	600705	中航产融	398,236.00	3.86
297	688006	杭可科技	397,443.90	3.85
298	603871	嘉友国际	395,124.00	3.83
299	002252	上海莱士	394,379.00	3.82
300	000930	中粮科技	393,288.00	3.81
301	601608	中信重工	393,028.00	3.81
302	300687	赛意信息	392,505.00	3.80
303	300065	海兰信	392,457.00	3.80
304	605358	立昂微	391,934.00	3.80
305	600143	金发科技	391,705.00	3.80
306	000921	海信家电	391,492.00	3.79
307	603919	金徽酒	391,351.00	3.79
308	600863	内蒙华电	390,204.00	3.78
309	600500	中化国际	390,102.00	3.78
310	002291	遥望科技	389,991.00	3.78
311	300377	赢时胜	388,169.00	3.76
312	688239	航宇科技	385,137.82	3.73
313	000783	长江证券	385,026.00	3.73
314	603806	福斯特	384,720.00	3.73
315	603737	三棵树	384,354.00	3.73
316	688065	凯赛生物	383,787.58	3.72
317	600350	山东高速	383,471.00	3.72
318	600575	淮河能源	383,063.00	3.71
319	688772	珠海冠宇	382,496.29	3.71
320	600585	海螺水泥	382,484.00	3.71

321	002120	韵达股份	382,226.00	3.71
322	000630	铜陵有色	382,107.00	3.70
323	600810	神马股份	381,573.00	3.70
324	603100	川仪股份	381,553.00	3.70
325	300850	新强联	381,256.00	3.70
326	000848	承德露露	380,993.00	3.69
327	600549	厦门钨业	380,982.00	3.69
328	600606	绿地控股	380,056.00	3.68
329	600062	华润双鹤	379,901.00	3.68
330	600618	氯碱化工	379,743.00	3.68
331	600993	马应龙	379,116.00	3.68
332	002439	启明星辰	379,069.00	3.67
333	600312	平高电气	377,279.00	3.66
334	600176	中国巨石	377,209.00	3.66
335	600276	恒瑞医药	377,177.00	3.66
336	688126	沪硅产业	377,108.47	3.66
337	000683	远兴能源	376,716.00	3.65
338	002697	红旗连锁	375,056.00	3.64
339	600739	辽宁成大	374,540.00	3.63
340	002497	雅化集团	374,519.00	3.63
341	002978	安宁股份	373,817.00	3.62
342	601390	中国中铁	373,163.00	3.62
343	002192	融捷股份	372,966.00	3.62
344	603529	爱玛科技	372,588.00	3.61
345	600486	扬农化工	370,094.00	3.59
346	688029	南微医学	369,815.79	3.58
347	600438	通威股份	369,513.00	3.58
348	002839	张家港行	366,806.00	3.56
349	601866	中远海发	366,458.00	3.55
350	002487	大金重工	365,451.00	3.54
351	603456	九洲药业	365,241.00	3.54

352	000869	张裕A	363,747.00	3.53
353	603338	浙江鼎力	361,834.00	3.51
354	000878	云南铜业	361,791.00	3.51
355	600315	上海家化	361,378.00	3.50
356	002008	大族激光	361,358.00	3.50
357	600707	彩虹股份	361,172.00	3.50
358	002511	中顺洁柔	360,447.00	3.49
359	603883	老百姓	358,951.00	3.48
360	600391	航发科技	357,195.00	3.46
361	603699	纽威股份	357,006.00	3.46
362	688690	纳微科技	356,830.83	3.46
363	000553	安道麦A	355,356.00	3.44
364	300253	卫宁健康	355,341.00	3.44
365	000758	中色股份	355,315.00	3.44
366	002028	思源电气	355,198.00	3.44
367	603678	火炬电子	354,336.00	3.43
368	300015	爱尔眼科	354,292.00	3.43
369	601001	晋控煤业	354,171.00	3.43
370	002240	盛新锂能	354,072.00	3.43
371	002745	木林森	353,318.00	3.42
372	600963	岳阳林纸	353,067.00	3.42
373	002500	山西证券	352,490.00	3.42
374	688778	厦钨新能	350,888.13	3.40
375	601298	青岛港	350,844.00	3.40
376	300747	锐科激光	350,670.00	3.40
377	688208	道通科技	349,331.00	3.39
378	603786	科博达	349,156.96	3.38
379	601918	新集能源	349,104.00	3.38
380	300134	大富科技	348,874.00	3.38
381	600801	华新水泥	348,796.00	3.38
382	603228	景旺电子	348,409.00	3.38

383	688169	石头科技	348,180.34	3.38
384	603056	德邦股份	347,474.00	3.37
385	600201	生物股份	347,470.00	3.37
386	300323	华灿光电	347,159.00	3.37
387	600741	华域汽车	347,005.00	3.36
388	600765	中航重机	346,648.00	3.36
389	600882	妙可蓝多	346,142.00	3.36
390	601117	中国化学	345,363.00	3.35
391	002594	比亚迪	345,115.00	3.35
392	002507	涪陵榨菜	344,291.00	3.34
393	600399	抚顺特钢	343,942.00	3.33
394	000785	居然之家	342,676.00	3.32
395	601369	陕鼓动力	340,190.00	3.30
396	000563	陕国投 A	340,124.00	3.30
397	600420	国药现代	339,978.00	3.30
398	002643	万润股份	339,517.00	3.29
399	600718	东软集团	338,537.00	3.28
400	603583	捷昌驱动	338,204.00	3.28
401	603171	税友股份	336,649.00	3.26
402	000970	中科三环	334,010.00	3.24
403	002100	天康生物	333,573.00	3.23
404	002353	杰瑞股份	333,519.00	3.23
405	600015	华夏银行	333,509.00	3.23
406	000750	国海证券	333,274.00	3.23
407	002416	爱施德	332,587.00	3.22
408	601916	浙商银行	332,054.00	3.22
409	603565	中谷物流	331,926.00	3.22
410	600037	歌华有线	331,173.00	3.21
411	000811	冰轮环境	330,921.00	3.21
412	002422	科伦药业	330,314.00	3.20
413	300001	特锐德	329,087.00	3.19



414	601939	建设银行	329,084.00	3.19
415	002807	江阴银行	328,849.00	3.19
416	600859	王府井	328,754.00	3.19
417	600995	南网储能	326,652.00	3.17
418	601118	海南橡胶	325,776.00	3.16
419	002567	唐人神	325,583.00	3.16
420	601163	三角轮胎	325,205.00	3.15
421	600563	法拉电子	325,087.00	3.15
422	600612	老凤祥	323,260.00	3.13
423	300593	新雷能	322,780.00	3.13
424	300677	英科医疗	322,582.00	3.13
425	600459	贵研铂业	321,492.00	3.12
426	600038	中直股份	321,144.00	3.11
427	688063	派能科技	320,939.60	3.11
428	002549	凯美特气	319,938.00	3.10
429	002044	美年健康	319,245.00	3.09
430	002488	金固股份	318,069.00	3.08
431	688106	金宏气体	317,402.21	3.08
432	000998	隆平高科	317,387.00	3.08
433	603260	合盛硅业	317,189.00	3.07
434	000021	深科技	316,459.00	3.07
435	002092	ST中泰	315,366.00	3.06
436	002421	达实智能	314,354.00	3.05
437	600958	东方证券	313,973.00	3.04
438	000547	航天发展	313,527.00	3.04
439	300674	宇信科技	313,385.00	3.04
440	002226	江南化工	312,068.00	3.03
441	000550	江铃汽车	311,205.00	3.02
442	002597	金禾实业	310,468.00	3.01
443	300260	新莱应材	309,951.00	3.00
444	600688	上海石化	309,789.00	3.00

445	600956	新天绿能	309,669.00	3.00
446	600458	时代新材	309,019.00	3.00
447	688025	杰普特	308,261.19	2.99
448	601963	重庆银行	308,085.00	2.99
449	600298	安琪酵母	306,476.00	2.97
450	000969	安泰科技	306,417.00	2.97
451	300363	博腾股份	304,912.00	2.96
452	300383	光环新网	304,095.00	2.95
453	000960	锡业股份	303,313.00	2.94
454	600079	人福医药	302,698.00	2.93
455	600482	中国动力	301,892.00	2.93
456	002782	可立克	301,126.00	2.92
457	603368	柳药集团	300,623.00	2.91
458	300348	长亮科技	300,321.00	2.91
459	688289	圣湘生物	298,964.62	2.90
460	601677	明泰铝业	298,899.00	2.90
461	002607	中公教育	297,768.00	2.89
462	601933	永辉超市	296,637.00	2.88
463	603005	晶方科技	296,286.00	2.87
464	600918	中泰证券	295,784.00	2.87
465	603337	杰克股份	295,648.00	2.87
466	002558	巨人网络	294,762.00	2.86
467	605333	沪光股份	294,508.00	2.85
468	000069	华侨城 A	294,483.00	2.85
469	600596	新安股份	294,372.00	2.85
470	301018	申菱环境	293,750.00	2.85
471	600929	雪天盐业	292,871.00	2.84
472	600323	瀚蓝环境	292,586.00	2.84
473	600916	中国黄金	292,405.00	2.83
474	000600	建投能源	291,605.00	2.83
475	000027	深圳能源	291,307.00	2.82

476	000810	创维数字	291,237.00	2.82
477	603118	共进股份	290,223.00	2.81
478	002041	登海种业	289,856.00	2.81
479	603160	汇顶科技	289,819.00	2.81
480	600105	永鼎股份	289,793.00	2.81
481	002334	英威腾	289,308.00	2.80
482	002468	申通快递	289,038.00	2.80
483	601958	金钼股份	288,664.00	2.80
484	688188	柏楚电子	288,630.54	2.80
485	000795	英洛华	288,482.00	2.80
486	600869	远东股份	287,577.00	2.79
487	002736	国信证券	287,369.00	2.79
488	000738	航发控制	286,229.00	2.77
489	002010	传化智联	285,942.00	2.77
490	688798	艾为电子	285,864.85	2.77
491	300682	朗新集团	285,699.00	2.77
492	600642	申能股份	285,605.00	2.77
493	688636	智明达	285,228.40	2.76
494	002020	京新药业	284,964.00	2.76
495	603826	坤彩科技	283,494.00	2.75
496	688303	大全能源	283,141.71	2.74
497	300474	景嘉微	282,945.00	2.74
498	002901	大博医疗	282,392.00	2.74
499	002518	科士达	281,526.00	2.73
500	300068	南都电源	281,473.00	2.73
501	002139	拓邦股份	278,623.00	2.70
502	002602	世纪华通	277,680.00	2.69
503	603063	禾望电气	275,889.00	2.67
504	603712	七一二	275,725.00	2.67
505	600577	精达股份	275,096.00	2.67
506	603439	贵州三力	274,821.00	2.66

507	600166	福田汽车	274,692.00	2.66
508	600348	华阳股份	274,684.00	2.66
509	600598	北大荒	273,437.00	2.65
510	002396	星网锐捷	272,708.00	2.64
511	601198	东兴证券	272,578.00	2.64
512	002340	格林美	272,084.00	2.64
513	300772	运达股份	271,474.00	2.63
514	600970	中材国际	271,089.00	2.63
515	300236	上海新阳	271,087.00	2.63
516	600380	健康元	270,575.00	2.62
517	601969	海南矿业	270,176.00	2.62
518	300003	乐普医疗	270,117.00	2.62
519	601778	晶科科技	269,276.00	2.61
520	002534	西子洁能	269,257.00	2.61
521	600704	物产中大	268,878.00	2.61
522	600378	昊华科技	268,384.00	2.60
523	002048	宁波华翔	268,317.00	2.60
524	003022	联泓新科	266,987.00	2.59
525	002011	盾安环境	266,937.00	2.59
526	000636	风华高科	266,297.00	2.58
527	001872	招商港口	265,972.00	2.58
528	688383	新益昌	265,822.74	2.58
529	002156	通富微电	264,985.00	2.57
530	002221	东华能源	264,093.00	2.56
531	300451	创业慧康	264,022.00	2.56
532	002032	苏泊尔	263,868.99	2.56
533	600116	三峡水利	263,581.00	2.56
534	600073	光明肉业	263,149.00	2.55
535	002212	天融信	262,863.00	2.55
536	600516	方大炭素	262,589.00	2.55
537	300113	顺网科技	262,523.00	2.54

538	300760	迈瑞医疗	262,260.00	2.54
539	300207	欣旺达	261,637.00	2.54
540	600764	中国海防	261,440.00	2.53
541	002050	三花智控	261,417.00	2.53
542	603305	旭升集团	261,174.20	2.53
543	002635	安洁科技	259,504.00	2.52
544	601128	常熟银行	259,339.00	2.51
545	601187	厦门银行	258,864.00	2.51
546	600703	三安光电	258,323.00	2.50
547	688598	金博股份	258,196.99	2.50
548	600197	伊力特	257,746.00	2.50
549	600435	北方导航	257,544.00	2.50
550	688339	亿华通	257,134.81	2.49
551	601668	中国建筑	254,548.00	2.47
552	600161	天坛生物	254,505.00	2.47
553	688599	天合光能	254,010.12	2.46
554	002035	华帝股份	252,461.00	2.45
555	603997	继峰股份	252,373.00	2.45
556	601000	唐山港	251,725.00	2.44
557	300724	捷佳伟创	251,506.00	2.44
558	000682	东方电子	249,841.00	2.42
559	300257	开山股份	249,363.00	2.42
560	688105	诺唯赞	249,293.92	2.42
561	300456	赛微电子	248,123.00	2.41
562	002948	青岛银行	246,463.00	2.39
563	600483	福能股份	246,434.00	2.39
564	601928	凤凰传媒	245,409.00	2.38
565	002545	东方铁塔	245,306.00	2.38
566	601555	东吴证券	245,254.00	2.38
567	000513	丽珠集团	245,106.00	2.38
568	688133	泰坦科技	244,972.57	2.37

569	002649	博彦科技	244,413.00	2.37
570	600691	阳煤化工	244,247.00	2.37
571	002351	漫步者	244,062.00	2.37
572	000913	钱江摩托	243,546.00	2.36
573	000031	大悦城	242,677.00	2.35
574	300398	飞凯材料	242,616.00	2.35
575	300465	高伟达	241,888.00	2.34
576	603108	润达医疗	241,554.00	2.34
577	300031	宝通科技	240,879.00	2.34
578	002453	华软科技	240,641.00	2.33
579	600085	同仁堂	239,739.00	2.32
580	000801	四川九洲	239,334.00	2.32
581	600007	中国国贸	239,238.00	2.32
582	002318	久立特材	239,003.00	2.32
583	605020	永和股份	238,854.00	2.32
584	000028	国药一致	238,711.40	2.31
585	600812	华北制药	238,060.00	2.31
586	603123	翠微股份	236,705.00	2.29
587	300280	紫天科技	236,202.00	2.29
588	002036	联创电子	235,896.00	2.29
589	600885	宏发股份	235,839.00	2.29
590	000680	山推股份	235,520.00	2.28
591	600339	中油工程	234,464.00	2.27
592	601108	财通证券	233,418.00	2.26
593	600223	福瑞达	233,151.00	2.26
594	600366	宁波韵升	233,033.00	2.26
595	688601	力芯微	232,885.22	2.26
596	300428	立中集团	232,736.00	2.26
597	601311	骆驼股份	232,141.00	2.25
598	601636	旗滨集团	231,225.00	2.24
599	603893	瑞芯微	230,847.00	2.24

600	603730	岱美股份	230,812.00	2.24
601	600271	航天信息	230,452.00	2.23
602	002984	森麒麟	230,315.00	2.23
603	603609	禾丰股份	229,750.00	2.23
604	002429	兆驰股份	229,653.00	2.23
605	300285	国瓷材料	228,619.00	2.22
606	002138	顺络电子	228,603.00	2.22
607	002475	立讯精密	228,114.00	2.21
608	002237	恒邦股份	227,619.00	2.21
609	002270	华明装备	226,479.00	2.20
610	300463	迈克生物	226,205.00	2.19
611	300037	新宙邦	225,223.00	2.18
612	600481	双良节能	224,786.00	2.18
613	000902	新洋丰	224,155.00	2.17
614	300861	美畅股份	222,454.00	2.16
615	600699	均胜电子	221,800.00	2.15
616	002653	海思科	221,767.00	2.15
617	600996	贵广网络	221,478.00	2.15
618	002056	横店东磁	221,278.00	2.14
619	603915	国茂股份	220,916.00	2.14
620	002983	芯瑞达	220,902.00	2.14
621	002572	索菲亚	219,927.00	2.13
622	002414	高德红外	219,200.00	2.12
623	000915	华特达因	219,131.00	2.12
624	002390	信邦制药	218,713.00	2.12
625	000503	国新健康	218,109.00	2.11
626	002430	杭氧股份	216,733.00	2.10
627	601966	玲珑轮胎	215,217.00	2.09
628	000519	中兵红箭	214,903.00	2.08
629	601138	工业富联	214,567.00	2.08
630	000709	河钢股份	214,357.00	2.08

631	600126	杭钢股份	214,194.00	2.08
632	000060	中金岭南	214,093.00	2.08
633	300143	盈康生命	213,606.00	2.07
634	600063	皖维高新	213,054.00	2.07
635	002068	黑猫股份	212,868.00	2.06
636	002706	良信股份	212,638.00	2.06
637	000049	德赛电池	212,505.00	2.06
638	000568	泸州老窖	211,116.00	2.05
639	601886	江河集团	209,900.00	2.03
640	300026	红日药业	209,386.00	2.03
641	300529	健帆生物	208,770.00	2.02
642	603197	保隆科技	208,734.00	2.02
643	300432	富临精工	208,513.00	2.02
644	603055	台华新材	207,867.00	2.01
645	000825	太钢不锈	207,718.00	2.01
646	600021	上海电力	207,528.00	2.01
647	000987	越秀资本	206,998.00	2.01
648	000818	航锦科技	206,860.00	2.01
649	600755	厦门国贸	206,623.00	2.00

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

#### 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	601919	中远海控	1,549,504.00	15.02
2	601899	紫金矿业	1,195,065.00	11.58
3	601985	中国核电	1,188,130.00	11.52
4	000338	潍柴动力	1,115,544.00	10.81



5	002410	广联达	1,074,242.00	10.41
6	300122	智飞生物	977,088.00	9.47
7	002821	凯莱英	963,230.00	9.34
8	601989	中国重工	929,229.00	9.01
9	601225	陕西煤业	888,743.00	8.62
10	601878	浙商证券	877,190.00	8.50
11	688082	盛美上海	858,265.78	8.32
12	300759	康龙化成	836,787.00	8.11
13	600332	白云山	835,957.00	8.10
14	601872	招商轮船	815,276.00	7.90
15	600927	永安期货	774,955.00	7.51
16	601615	明阳智能	764,957.00	7.42
17	300142	沃森生物	748,758.00	7.26
18	600050	中国联通	746,915.00	7.24
19	601600	中国铝业	745,371.00	7.23
20	000039	中集集团	745,165.00	7.22
21	600023	浙能电力	741,534.00	7.19
22	601808	中海油服	741,466.00	7.19
23	601318	中国平安	721,993.00	7.00
24	600588	用友网络	708,546.20	6.87
25	600177	雅戈尔	702,545.00	6.81
26	688536	思瑞浦	688,967.40	6.68
27	600019	宝钢股份	686,089.00	6.65
28	601168	西部矿业	683,358.00	6.62
29	003816	中国广核	674,985.00	6.54
30	600362	江西铜业	672,396.00	6.52
31	600497	驰宏锌锗	668,737.00	6.48
32	600875	东方电气	657,311.00	6.37
33	688234	天岳先进	657,217.65	6.37
34	000100	TCL科技	656,205.00	6.36
35	601666	平煤股份	653,565.00	6.34

36	688521	芯原股份	652,226.82	6.32
37	002925	盈趣科技	648,432.00	6.29
38	600320	振华重工	647,905.00	6.28
39	600873	梅花生物	638,469.00	6.19
40	003031	中瓷电子	637,381.60	6.18
41	600737	中粮糖业	631,068.00	6.12
42	002271	东方雨虹	630,808.00	6.11
43	000933	神火股份	630,617.00	6.11
44	600160	巨化股份	629,043.00	6.10
45	601728	中国电信	625,442.00	6.06
46	603317	天味食品	623,842.00	6.05
47	600988	赤峰黄金	620,319.00	6.01
48	603517	绝味食品	615,801.00	5.97
49	002408	齐翔腾达	613,768.00	5.95
50	600406	国电南瑞	610,216.00	5.92
51	603568	伟明环保	609,614.00	5.91
52	603185	弘元绿能	605,614.00	5.87
53	600989	宝丰能源	604,014.00	5.86
54	600900	长江电力	603,306.00	5.85
55	601058	赛轮轮胎	597,136.00	5.79
56	600998	九州通	594,886.90	5.77
57	002001	新和成	591,465.00	5.73
58	002841	视源股份	590,631.00	5.73
59	000333	美的集团	589,234.00	5.71
60	688220	翱捷科技	586,242.03	5.68
61	300782	卓胜微	583,883.00	5.66
62	600295	鄂尔多斯	581,924.00	5.64
63	603558	健盛集团	576,614.00	5.59
64	300496	中科创达	575,433.00	5.58
65	601567	三星医疗	574,832.00	5.57
66	603993	洛阳钼业	571,776.00	5.54

67	300296	利亚德	562,621.00	5.45
68	000528	柳工	561,751.00	5.45
69	601139	深圳燃气	559,371.00	5.42
70	688180	君实生物	559,235.61	5.42
71	000401	冀东水泥	559,064.00	5.42
72	600031	三一重工	558,362.00	5.41
73	002773	康弘药业	558,187.00	5.41
74	601398	工商银行	550,164.00	5.33
75	600066	宇通客车	549,295.00	5.32
76	601601	中国太保	548,476.00	5.32
77	600030	中信证券	547,387.00	5.31
78	603589	口子窖	545,579.00	5.29
79	600233	圆通速递	541,310.00	5.25
80	601865	福莱特	539,829.00	5.23
81	600901	江苏金租	537,942.00	5.21
82	600919	江苏银行	535,894.00	5.19
83	600398	海澜之家	534,585.00	5.18
84	600028	中国石化	529,596.00	5.13
85	601991	大唐发电	526,523.00	5.10
86	002705	新宝股份	518,082.00	5.02
87	002601	龙佰集团	515,420.00	5.00
88	002123	梦网科技	515,303.00	5.00
89	002223	鱼跃医疗	513,000.00	4.97
90	688366	昊海生科	510,706.80	4.95
91	601179	中国西电	509,685.00	4.94
92	601169	北京银行	509,246.00	4.94
93	601877	正泰电器	505,655.00	4.90
94	688363	华熙生物	505,397.99	4.90
95	000166	申万宏源	501,525.00	4.86
96	000937	冀中能源	501,275.00	4.86
97	600511	国药股份	500,080.00	4.85

98	001914	招商积余	486,684.00	4.72
99	601328	交通银行	485,773.00	4.71
100	600887	伊利股份	485,497.00	4.71
101	600498	烽火通信	482,218.00	4.67
102	688185	康希诺	481,195.94	4.66
103	600000	浦发银行	479,525.00	4.65
104	000425	徐工机械	476,139.00	4.62
105	002003	伟星股份	474,150.00	4.60
106	000708	中信特钢	470,826.00	4.56
107	601898	中煤能源	470,002.00	4.56
108	000016	深康佳 A	469,146.00	4.55
109	002436	兴森科技	468,412.00	4.54
110	300390	天华新能	467,618.00	4.53
111	002384	东山精密	465,077.00	4.51
112	600219	南山铝业	464,068.00	4.50
113	002791	坚朗五金	462,725.00	4.49
114	300776	帝尔激光	462,232.00	4.48
115	600460	士兰微	460,848.00	4.47
116	002600	领益智造	460,673.00	4.47
117	600489	中金黄金	457,091.00	4.43
118	000157	中联重科	456,294.00	4.42
119	603379	三美股份	455,990.00	4.42
120	002074	国轩高科	455,452.00	4.42
121	601233	桐昆股份	455,330.00	4.41
122	603087	甘李药业	454,442.00	4.41
123	000050	深天马 A	453,977.00	4.40
124	601088	中国神华	453,379.00	4.39
125	300047	天源迪科	452,505.00	4.39
126	002273	水晶光电	452,010.00	4.38
127	600886	国投电力	451,070.00	4.37
128	002079	苏州固锝	449,201.00	4.35

129	603195	公牛集团	448,159.00	4.34
130	605358	立昂微	447,640.00	4.34
131	688107	安路科技	445,536.07	4.32
132	002739	万达电影	444,091.00	4.30
133	300676	华大基因	443,089.00	4.30
134	600499	科达制造	442,362.00	4.29
135	601288	农业银行	441,688.00	4.28
136	600575	淮河能源	441,669.00	4.28
137	002128	电投能源	441,550.00	4.28
138	002648	卫星化学	441,050.00	4.28
139	600352	浙江龙盛	440,406.00	4.27
140	688776	国光电气	439,307.08	4.26
141	600025	华能水电	439,240.00	4.26
142	300750	宁德时代	438,706.00	4.25
143	600745	闻泰科技	438,661.00	4.25
144	300244	迪安诊断	438,308.00	4.25
145	600750	江中药业	435,275.00	4.22
146	600547	山东黄金	435,095.00	4.22
147	601995	中金公司	434,296.00	4.21
148	000423	东阿阿胶	434,290.00	4.21
149	002472	双环传动	431,922.00	4.19
150	600029	南方航空	429,850.00	4.17
151	000630	铜陵有色	427,775.00	4.15
152	600971	恒源煤电	426,053.00	4.13
153	002064	华峰化学	425,955.00	4.13
154	002444	巨星科技	425,549.00	4.13
155	600188	兖矿能源	425,481.00	4.12
156	600606	绿地控股	425,229.00	4.12
157	601211	国泰君安	422,772.00	4.10
158	600837	海通证券	422,647.00	4.10
159	002078	太阳纸业	422,340.00	4.09

160	600196	复星医药	419,936.00	4.07
161	600761	安徽合力	418,916.00	4.06
162	601717	郑煤机	418,705.00	4.06
163	600999	招商证券	418,462.00	4.06
164	603939	益丰药房	414,746.00	4.02
165	603228	景旺电子	409,084.00	3.97
166	688586	江航装备	407,749.07	3.95
167	603225	新凤鸣	407,383.88	3.95
168	600141	兴发集团	405,772.00	3.93
169	600377	宁沪高速	405,554.00	3.93
170	600500	中化国际	404,679.00	3.92
171	600075	新疆天业	399,646.00	3.87
172	601001	晋控煤业	399,265.00	3.87
173	603100	川仪股份	399,109.00	3.87
174	600346	恒力石化	398,173.00	3.86
175	603871	嘉友国际	396,370.80	3.84
176	600660	福耀玻璃	396,003.00	3.84
177	600820	隧道股份	393,670.00	3.82
178	001203	大中矿业	393,661.00	3.82
179	300123	亚光科技	393,610.00	3.82
180	000895	双汇发展	393,596.00	3.82
181	300748	金力永磁	391,391.00	3.79
182	601988	中国银行	390,466.00	3.79
183	600312	平高电气	390,322.00	3.78
184	688126	沪硅产业	390,055.86	3.78
185	600060	海信视像	389,511.00	3.78
186	601390	中国中铁	389,092.00	3.77
187	600096	云天化	386,941.00	3.75
188	300065	海兰信	386,634.00	3.75
189	601857	中国石油	385,464.00	3.74
190	601766	中国中车	382,693.62	3.71

191	000975	山金国际	382,387.00	3.71
192	300558	贝达药业	381,954.00	3.70
193	002906	华阳集团	379,819.00	3.68
194	002961	瑞达期货	378,754.00	3.67
195	000860	顺鑫农业	378,487.00	3.67
196	000066	中国长城	378,461.00	3.67
197	002916	深南电路	377,278.00	3.66
198	600438	通威股份	377,049.00	3.65
199	000878	云南铜业	375,092.00	3.64
200	300593	新雷能	373,891.00	3.62
201	600095	湘财股份	372,053.00	3.61
202	000400	许继电气	371,162.00	3.60
203	600985	淮北矿业	370,860.00	3.59
204	002192	融捷股份	370,367.00	3.59
205	601918	新集能源	370,292.00	3.59
206	000739	普洛药业	369,324.00	3.58
207	600585	海螺水泥	368,988.00	3.58
208	601828	美凯龙	368,682.00	3.57
209	300595	欧普康视	368,622.00	3.57
210	600391	航发科技	368,014.00	3.57
211	002978	安宁股份	367,811.00	3.57
212	600618	氯碱化工	367,639.00	3.56
213	601229	上海银行	366,621.00	3.55
214	601838	成都银行	365,862.00	3.55
215	002697	红旗连锁	365,574.00	3.54
216	000811	冰轮环境	363,943.00	3.53
217	002008	大族激光	361,665.00	3.51
218	600566	济川药业	360,819.00	3.50
219	000869	张裕A	359,432.00	3.48
220	000930	中粮科技	359,130.00	3.48
221	600176	中国巨石	357,760.00	3.47

222	000627	天茂集团	356,911.00	3.46
223	600329	达仁堂	356,297.00	3.45
224	600309	万华化学	356,104.00	3.45
225	603171	税友股份	354,699.00	3.44
226	600808	马钢股份	354,535.00	3.44
227	300015	爱尔眼科	354,368.00	3.44
228	600673	东阳光	354,357.00	3.44
229	000783	长江证券	354,061.00	3.43
230	600012	皖通高速	353,172.00	3.42
231	601598	中国外运	352,711.00	3.42
232	603260	合盛硅业	351,009.00	3.40
233	300323	华灿光电	350,728.00	3.40
234	600521	华海药业	349,374.00	3.39
235	603297	永新光学	349,320.00	3.39
236	600795	国电电力	349,077.00	3.38
237	000848	承德露露	348,951.00	3.38
238	002399	海普瑞	346,862.00	3.36
239	600869	远东股份	346,670.00	3.36
240	603737	三棵树	346,244.00	3.36
241	002291	遥望科技	343,777.00	3.33
242	000785	居然之家	343,474.00	3.33
243	002385	大北农	343,319.00	3.33
244	603806	福斯特	342,919.00	3.32
245	300253	卫宁健康	342,782.00	3.32
246	002500	山西证券	342,488.00	3.32
247	600741	华域汽车	342,142.00	3.32
248	601916	浙商银行	342,034.00	3.32
249	603979	金诚信	341,716.00	3.31
250	601117	中国化学	341,534.00	3.31
251	000553	安道麦A	340,313.00	3.30
252	000547	航天发展	339,193.00	3.29



253	601336	新华保险	338,381.00	3.28
254	000729	燕京啤酒	338,347.00	3.28
255	002643	万润股份	336,838.00	3.27
256	002120	韵达股份	336,498.00	3.26
257	688106	金宏气体	336,324.24	3.26
258	002839	张家港行	333,934.00	3.24
259	300979	华利集团	333,606.00	3.23
260	002865	钧达股份	332,970.00	3.23
261	002507	涪陵榨菜	332,479.60	3.22
262	601118	海南橡胶	331,788.00	3.22
263	601933	永辉超市	329,653.00	3.20
264	000725	京东方 A	328,715.00	3.19
265	600563	法拉电子	327,750.00	3.18
266	601939	建设银行	327,395.00	3.17
267	600718	东软集团	324,997.00	3.15
268	000563	陕国投 A	324,432.00	3.14
269	000750	国海证券	322,812.00	3.13
270	601369	陕鼓动力	322,641.00	3.13
271	002539	云图控股	322,310.00	3.12
272	002488	金固股份	322,192.00	3.12
273	300212	易华录	321,796.00	3.12
274	600863	内蒙华电	320,167.00	3.10
275	688187	时代电气	319,652.89	3.10
276	688798	艾为电子	319,460.29	3.10
277	603866	桃李面包	319,174.00	3.09
278	688289	圣湘生物	318,870.64	3.09
279	002511	中顺洁柔	318,569.00	3.09
280	000069	华侨城 A	316,995.00	3.07
281	688029	南微医学	316,189.19	3.07
282	000021	深科技	315,987.00	3.06
283	601958	金钼股份	315,981.00	3.06

284	600559	老白干酒	315,732.00	3.06
285	300088	长信科技	315,139.00	3.05
286	600958	东方证券	314,219.00	3.05
287	688516	奥特维	314,217.76	3.05
288	300260	新莱应材	313,189.00	3.04
289	002867	周大生	312,860.00	3.03
290	002608	江苏国信	312,227.00	3.03
291	603883	老百姓	311,919.40	3.02
292	688636	智明达	311,700.37	3.02
293	600201	生物股份	311,166.00	3.02
294	600298	安琪酵母	310,841.00	3.01
295	002311	海大集团	310,798.00	3.01
296	002226	江南化工	310,289.00	3.01
297	600015	华夏银行	309,652.00	3.00
298	603005	晶方科技	309,354.00	3.00
299	002203	海亮股份	308,479.00	2.99
300	600916	中国黄金	308,398.00	2.99
301	600963	岳阳林纸	308,372.00	2.99
302	300377	赢时胜	306,543.00	2.97
303	000969	安泰科技	306,337.00	2.97
304	000970	中科三环	305,602.00	2.96
305	000960	锡业股份	305,431.00	2.96
306	688006	杭可科技	304,091.12	2.95
307	600688	上海石化	303,724.00	2.94
308	600918	中泰证券	303,424.00	2.94
309	300363	博腾股份	303,178.00	2.94
310	688025	杰普特	302,641.86	2.93
311	002416	爱施德	302,482.00	2.93
312	688510	航亚科技	302,398.34	2.93
313	601963	重庆银行	301,957.00	2.93
314	603439	贵州三力	301,606.00	2.92

315	300474	景嘉微	301,195.00	2.92
316	002010	传化智联	301,183.00	2.92
317	603368	柳药集团	300,096.00	2.91
318	600929	雪天盐业	299,675.00	2.90
319	600482	中国动力	297,934.00	2.89
320	600323	瀚蓝环境	297,569.00	2.88
321	688239	航宇科技	296,711.94	2.88
322	601126	四方股份	296,424.00	2.87
323	600150	中国船舶	296,123.00	2.87
324	688063	派能科技	295,657.58	2.87
325	300383	光环新网	295,369.00	2.86
326	301018	申菱环境	295,166.00	2.86
327	688339	亿华通	294,877.50	2.86
328	000027	深圳能源	294,589.00	2.86
329	603160	汇顶科技	293,956.00	2.85
330	688303	大全能源	293,895.31	2.85
331	300682	朗新集团	293,749.00	2.85
332	603826	坤彩科技	293,489.00	2.84
333	600348	华阳股份	293,199.00	2.84
334	600079	人福医药	293,052.00	2.84
335	688561	奇安信	292,236.86	2.83
336	601198	东兴证券	291,066.00	2.82
337	002092	ST中泰	290,610.00	2.82
338	600549	厦门钨业	290,536.00	2.82
339	002558	巨人网络	290,299.00	2.81
340	600810	神马股份	289,830.00	2.81
341	601298	青岛港	288,791.00	2.80
342	002439	启明星辰	288,632.00	2.80
343	600018	上港集团	287,269.00	2.78
344	603118	共进股份	287,037.00	2.78
345	600378	昊华科技	286,831.00	2.78

346	600161	天坛生物	286,677.00	2.78
347	002736	国信证券	285,999.00	2.77
348	603730	岱美股份	284,333.00	2.76
349	300674	宇信科技	284,224.00	2.76
350	600143	金发科技	284,173.00	2.75
351	002340	格林美	283,449.00	2.75
352	002025	航天电器	283,345.00	2.75
353	002334	英威腾	283,058.00	2.74
354	300236	上海新阳	281,875.00	2.73
355	000800	一汽解放	281,459.00	2.73
356	600596	新安股份	279,328.60	2.71
357	601677	明泰铝业	279,063.00	2.71
358	000598	兴蓉环境	278,217.00	2.70
359	002050	三花智控	277,693.00	2.69
360	002156	通富微电	277,198.00	2.69
361	002487	大金重工	276,799.00	2.68
362	001872	招商港口	275,854.00	2.67
363	603026	石大胜华	275,666.00	2.67
364	000810	创维数字	274,954.00	2.67
365	603556	海兴电力	274,356.00	2.66
366	601128	常熟银行	273,978.60	2.66
367	600577	精达股份	273,354.00	2.65
368	300850	新强联	273,231.00	2.65
369	000651	格力电器	273,125.00	2.65
370	600598	北大荒	272,570.00	2.64
371	300003	乐普医疗	272,518.33	2.64
372	600859	王府井	272,346.00	2.64
373	000636	风华高科	269,719.00	2.61
374	603103	横店影视	269,471.00	2.61
375	603355	莱克电气	268,319.00	2.60
376	002851	麦格米特	267,942.00	2.60

377	603786	科博达	267,214.00	2.59
378	600765	中航重机	266,837.00	2.59
379	603583	捷昌驱动	265,443.00	2.57
380	688690	纳微科技	265,204.73	2.57
381	000682	东方电子	264,677.00	2.57
382	603063	禾望电气	263,658.00	2.56
383	600578	京能电力	263,284.00	2.55
384	601969	海南矿业	262,959.00	2.55
385	600703	三安光电	262,407.00	2.54
386	002100	天康生物	262,347.00	2.54
387	688599	天合光能	262,007.56	2.54
388	600073	光明肉业	261,318.00	2.53
389	600582	天地科技	260,999.00	2.53
390	603456	九洲药业	260,409.00	2.52
391	300207	欣旺达	260,063.00	2.52
392	600764	中国海防	259,757.00	2.52
393	600801	华新水泥	258,291.00	2.50
394	600116	三峡水利	258,143.00	2.50
395	000031	大悦城	256,535.00	2.49
396	300456	赛微电子	254,985.00	2.47
397	300031	宝通科技	254,620.00	2.47
398	002353	杰瑞股份	254,535.00	2.47
399	300398	飞凯材料	254,460.00	2.47
400	601555	东吴证券	254,417.00	2.47
401	600704	物产中大	254,120.00	2.46
402	603039	泛微网络	254,041.00	2.46
403	600435	北方导航	253,611.00	2.46
404	002032	苏泊尔	253,566.00	2.46
405	600416	湘电股份	252,509.00	2.45
406	600392	盛和资源	251,394.00	2.44
407	000680	山推股份	250,950.00	2.43

408	300257	开山股份	250,821.00	2.43
409	000830	鲁西化工	250,309.00	2.43
410	688601	力芯微	249,203.00	2.42
411	002782	可立克	247,926.00	2.40
412	000060	中金岭南	247,467.00	2.40
413	688520	神州细胞	247,447.38	2.40
414	601163	三角轮胎	246,646.00	2.39
415	300001	特锐德	246,623.00	2.39
416	002351	漫步者	244,625.00	2.37
417	600420	国药现代	243,605.00	2.36
418	600007	中国国贸	242,906.00	2.35
419	601311	骆驼股份	242,898.00	2.35
420	002237	恒邦股份	242,454.00	2.35
421	601928	凤凰传媒	242,109.00	2.35
422	000921	海信家电	241,613.00	2.34
423	300465	高伟达	241,055.00	2.34
424	600885	宏发股份	240,179.00	2.33
425	603893	瑞芯微	239,805.00	2.32
426	688105	诺唯赞	239,245.21	2.32
427	002984	森麒麟	239,238.00	2.32
428	600085	同仁堂	238,141.00	2.31
429	002549	凯美特气	237,940.00	2.31
430	000786	北新建材	237,255.00	2.30
431	002390	信邦制药	236,695.00	2.29
432	688772	珠海冠宇	236,335.98	2.29
433	600038	中直股份	235,905.00	2.29
434	002387	维信诺	235,881.00	2.29
435	300428	立中集团	235,603.00	2.28
436	601108	财通证券	235,435.00	2.28
437	300143	盈康生命	235,424.00	2.28
438	002241	歌尔股份	235,209.00	2.28

439	002421	达实智能	234,905.00	2.28
440	002649	博彦科技	234,770.00	2.28
441	600941	中国移动	233,987.00	2.27
442	002948	青岛银行	233,621.00	2.26
443	000883	湖北能源	233,273.00	2.26
444	688133	泰坦科技	233,074.06	2.26
445	300677	英科医疗	232,544.00	2.25
446	002453	华软科技	232,358.00	2.25
447	601966	玲珑轮胎	231,083.00	2.24
448	601319	中国人保	230,246.00	2.23
449	002270	华明装备	229,794.00	2.23
450	601166	兴业银行	229,722.00	2.23
451	000028	国药一致	229,722.00	2.23
452	300687	赛意信息	228,904.00	2.22
453	600350	山东高速	228,476.00	2.21
454	601187	厦门银行	228,376.00	2.21
455	300285	国瓷材料	228,371.00	2.21
456	600271	航天信息	227,526.00	2.21
457	002545	东方铁塔	227,326.00	2.20
458	603915	国茂股份	226,808.00	2.20
459	600223	福瑞达	226,571.00	2.20
460	002041	登海种业	225,526.00	2.19
461	000997	新大陆	224,767.00	2.18
462	300068	南都电源	224,048.00	2.17
463	000516	国际医学	223,742.00	2.17
464	600282	南钢股份	222,466.00	2.16
465	300280	紫天科技	222,205.00	2.15
466	000519	中兵红箭	222,082.00	2.15
467	000998	隆平高科	221,742.00	2.15
468	600699	均胜电子	221,487.00	2.15
469	300529	健帆生物	221,269.00	2.14

470	300567	精测电子	219,373.00	2.13
471	601231	环旭电子	218,936.00	2.12
472	300772	运达股份	218,129.00	2.11
473	000795	英洛华	217,779.00	2.11
474	000703	恒逸石化	217,614.00	2.11
475	002048	宁波华翔	217,585.00	2.11
476	600827	百联股份	217,201.00	2.11
477	002983	芯瑞达	217,051.56	2.10
478	002607	中公教育	216,639.00	2.10
479	603609	禾丰股份	216,341.00	2.10
480	000049	德赛电池	215,942.00	2.09
481	600996	贵广网络	215,711.00	2.09
482	000915	华特达因	215,282.00	2.09
483	600098	广州发展	214,925.00	2.08
484	002449	国星光电	214,465.00	2.08
485	603267	鸿远电子	213,990.00	2.07
486	002508	老板电器	213,908.00	2.07
487	688065	凯赛生物	213,633.48	2.07
488	000825	太钢不锈	213,047.00	2.07
489	600126	杭钢股份	211,006.00	2.05
490	000709	河钢股份	210,699.00	2.04
491	600739	辽宁成大	210,597.00	2.04
492	002414	高德红外	209,307.00	2.03
493	600732	爱旭股份	208,776.00	2.02
494	000503	国新健康	208,757.00	2.02
495	603123	翠微股份	208,645.00	2.02
496	600032	浙江新能	206,527.00	2.00

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

#### 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

买入股票成本（成交）总额	366,999,554.35
卖出股票收入（成交）总额	270,134,022.87

注：“买入股票成本总额”和“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，不考虑交易费用。

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：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

注：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

注：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

注：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

注：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

本基金主要运用股指期货合约进行套期保值操作，利用股指期货空头合约对冲多头股票部分的系统性风险。本基金根据股票多头组合的市值计算需要用到的股指期货合约数量，并对这个数量进行动态跟踪以及适时调整。同时，综合考虑股指期货的流动性、对冲成本以及保证金要求等因素，选择合适的股指期货合约并适时进行合约展期操作，通过空头部分的优化降低对冲成本。

## 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

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金在本报告期末未持有国债期货。

## 7.12 市场中性策略执行情况

截至本报告期末，本基金持有股票资产99,368,989.72元，占基金资产净值的比例为71.41%；运用股指期货进行对冲的空头合约市值-96,853,180.00元，占基金资产净值的比例为-69.60%，空头合约市值占股票资产的比例为-97.47%。

本报告期内，本基金执行市场中性策略的投资收益为1,225,697.03元，公允价值变动损益为2,131.62元。

## 7.13 投资组合报告附注

**7.13.1 报告期内基金投资的前十名证券除招商银行股份有限公司外其他证券的发行主体本期未出现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。** 国家外汇管理局深圳市分局2023年11月27日发布对招商银行股份有限公司的处罚(深外管检[2023]42号),国家金融监督管理总局深圳监管局2023年12月13日发布对招商银行股份有限公司的处罚(深金罚决字[2023]81号),国家金融监督管理总局2024年06月24日发布对招商银行股份有限公司的处罚(金罚决字[2024]30号)。前述发行主体受到的处罚未影响其正常业务运作，上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的规定。

**7.13.2 基金投资的前十名股票未超过基金合同规定的备选股票库。**

## 7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	11,669,290.18
2	应收清算款	10,967,387.96
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	22,636,678.14

## 7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限的情况。

### 7.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，各比例的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

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
525	262,894.42	72,403,361.03	52.46%	65,616,208.83	47.54%

### 8.2 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	411,140.86	0.30%

### 8.3 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	-
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

### 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	7.25%	10,000,000.00	7.25%	三年

基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,000.00	7.25%	10,000,000.00	7.25%	-

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2020年04月03日)基金份额总额	10,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	10,576,658.28
本报告期基金总申购份额	127,713,897.32
减：本报告期基金总赎回份额	270,985.74
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	138,019,569.86

注：申购含红利再投、转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，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) 基金管理人的重大人事变动情况

本基金管理人于2024年4月10日发布公告，国联基金管理有限公司副总裁曹健先生转任公司督察长、公司督察长周妹云女士转任公司副总裁、刘鲁旦先生担任公司副总裁、马荣荣女士担任公司副总裁。

#### (2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

#### 10.4 基金投资策略的改变

无。

#### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金进行审计的会计师事务所为德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)，本报告期内未变更为其提供审计服务的会计师事务所。

#### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

##### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内管理人及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

##### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：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。

#### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

##### 10.7.1 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	
海通证券	2	637,120,186.52	100.00%	475,222.96	100.00%	-

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

i 经营行为规范，在近一年内无重大违规行为。

ii 公司财务状况良好。

iii 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。

iv 有较强的研究能力，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。

v 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

② 券商专用交易单元选择程序：

i 对交易单元候选券商的研究服务进行评估

本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。

ii 协议签署及通知托管人

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
海通证券	1,599,856.00	100.00%	772,212,000.00	100.00%	-	-	-	-

10.8 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	国联智选对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金第十五个开放期开放申购、赎回、转换业务和规模控制安排的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024-01-09
2	国联基金管理有限公司关于办公地址名称变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024-01-12
3	国联智选对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金第十六个开放期开放申购、赎回、转换业务和规模控制安排的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024-04-08
4	国联基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2024-04-10

5	国联基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2024-04-10
6	国联基金管理有限公司基金经理变更公告（国联智选对冲3个月定开混合）	中国证监会指定报刊及网站	2024-05-31

## §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	20240416-20240418	0.00	20,204,461.91	0.00	20,204,461.91	14.64%
	2	20240101-20240417	10,000,000.00	0.00	0.00	10,000,000.00	7.25%
产品特有风险							
<p>本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况，该类投资者大额赎回所持有的基金份额时，将可能产生流动性风险，即基金资产不能迅速变现，或者未能以合理的价格变现基金资产以支付投资者赎回款，对资产净值产生不利影响。</p> <p>当开放式基金发生巨额赎回，基金管理人认为基金组合资产变现能力有限或认为因应对赎回导致的资产变现对基金单位份额净值产生较大的波动时，为了切实保护存量基金份额持有人的合法权益，可能出现延期支付赎回款等情形。同时为了公平对待所有投资者合法权益不受损害，管理人有权根据基金合同和招募说明书的约定，暂停或者拒绝申购、暂停赎回，基金份额持有人存在可能无法及时赎回持有的全部基金份额的风险。</p>							

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- （1）中国证监会准予中融智选对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金募集注册的文件
- （2）《国联智选对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》
- （3）《国联智选对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议》

(4) 关于申请募集注册中融智选对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金之法律意见书

(5) 基金管理人业务资格批件、营业执照

(6) 基金托管人业务资格批件、营业执照

(7) 中国证监会要求的其他文件

## 12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所。

## 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可在支付工本费后，在合理时间取得上述文件的复印件。

咨询电话：国联基金管理有限公司客户服务电话400-160-6000, (010) 56517299。

网址：<http://www.glfund.com/>

国联基金管理有限公司  
二〇二四年八月三十日