

**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 年年度报告**

2024 年 12 月 31 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:2025 年 03 月 28 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经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2025年3月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中的财务资料经审计，德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自2024年1月1日起至2024年12月31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、基金净值表现及利润分配情况 .....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现 .....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§4 管理人报告 .....	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合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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 .....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 .....	15
§5 托管人报告 .....	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	15
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 .....	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 .....	16
§6 审计报告 .....	16
6.1 审计报告基本信息.....	16
6.2 审计报告的基本内容 .....	16
§7 年度财务报表.....	19
7.1 资产负债表.....	19
7.2 利润表 .....	21
7.3 净资产变动表 .....	22
7.4 报表附注 .....	24
§8 投资组合报告 .....	55
8.1 期末基金资产组合情况.....	55
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	55
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	56
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	68
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	134
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	134
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	134
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	134
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	134
8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	135

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	135
8.12 市场中性策略执行情况 .....	135
8.13 投资组合报告附注 .....	135
§9 基金份额持有人信息 .....	136
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	136
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	136
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	137
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	137
§10 开放式基金份额变动 .....	137
§11 重大事件揭示 .....	138
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	138
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	138
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	138
11.4 基金投资策略的改变 .....	138
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	138
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	138
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	139
11.8 其他重大事件 .....	140
§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....	141
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	141
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	142
§13 备查文件目录 .....	142
13.1 备查文件目录 .....	142
13.2 存放地点 .....	142
13.3 查阅方式 .....	142

## §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	110,654,441.74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	林盛
	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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.gfund.com
基金年度报告备置地点	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
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
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

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

<b>3.1.1 期间数据和指标</b>	2024年	2023年	2022年
本期已实现收益	-7,084,359.54	-1,729,573.37	-18,157,388.07
本期利润	-5,740,905.34	-1,339,452.89	-11,090,216.85
加权平均基金份额本期利润	-0.0614	-0.0196	-0.0455
本期加权平均净值利润率	-6.21%	-1.86%	-4.29%
本期基金份额净值增长率	-2.15%	-6.64%	-3.12%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	2024年末	2023年末	2022年末
期末可供分配利润	-6,594,625.71	-309,990.71	7,532,143.01
期末可供分配基金份额利润	-0.0596	-0.0293	0.0448
期末基金资产净值	105,603,895.73	10,316,000.03	175,514,198.99
期末基金份额净值	0.9544	0.9754	1.0448
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	2024年末	2023年末	2022年末
基金份额累计净值增长率	-4.56%	-2.46%	4.48%

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。

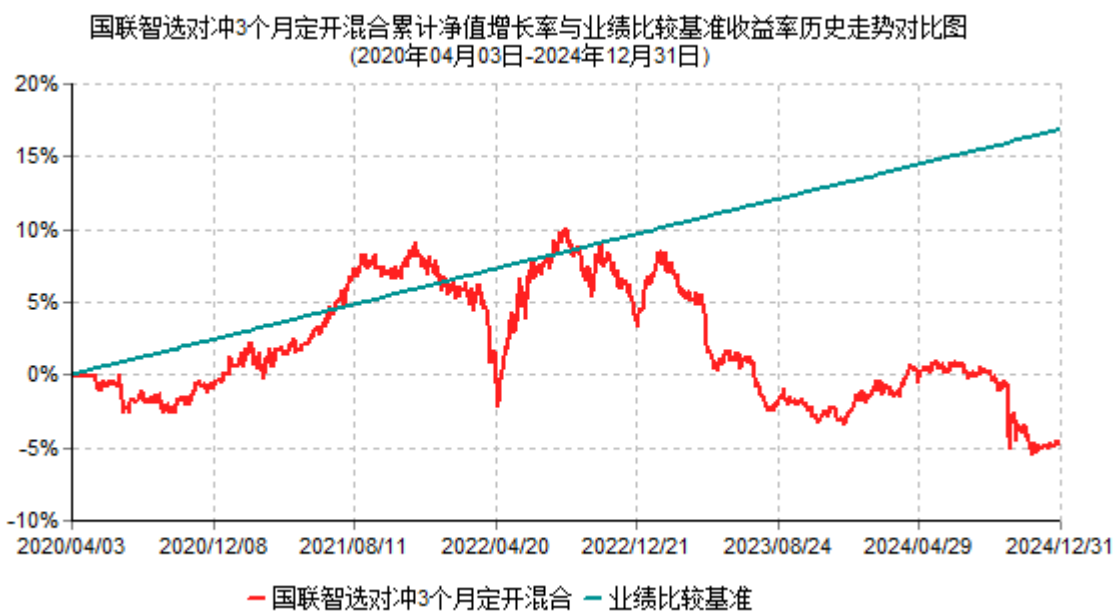
### 3.2 基金净值表现

#### 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	份额净值	业绩比较	业绩比较	①-③	②-④
----	------	------	------	------	-----	-----

	增长率①	增长率标准差②	基准收益率③	基准收益率标准差④		
过去三个月	-0.35%	0.50%	0.89%	0.01%	-1.24%	0.49%
过去六个月	-5.34%	0.45%	1.79%	0.01%	-7.13%	0.44%
过去一年	-2.15%	0.37%	3.56%	0.01%	-5.71%	0.36%
过去三年	-11.50%	0.39%	10.66%	0.01%	-22.16%	0.38%
自基金合同生效起至今	-4.56%	0.36%	16.86%	0.01%	-21.42%	0.35%

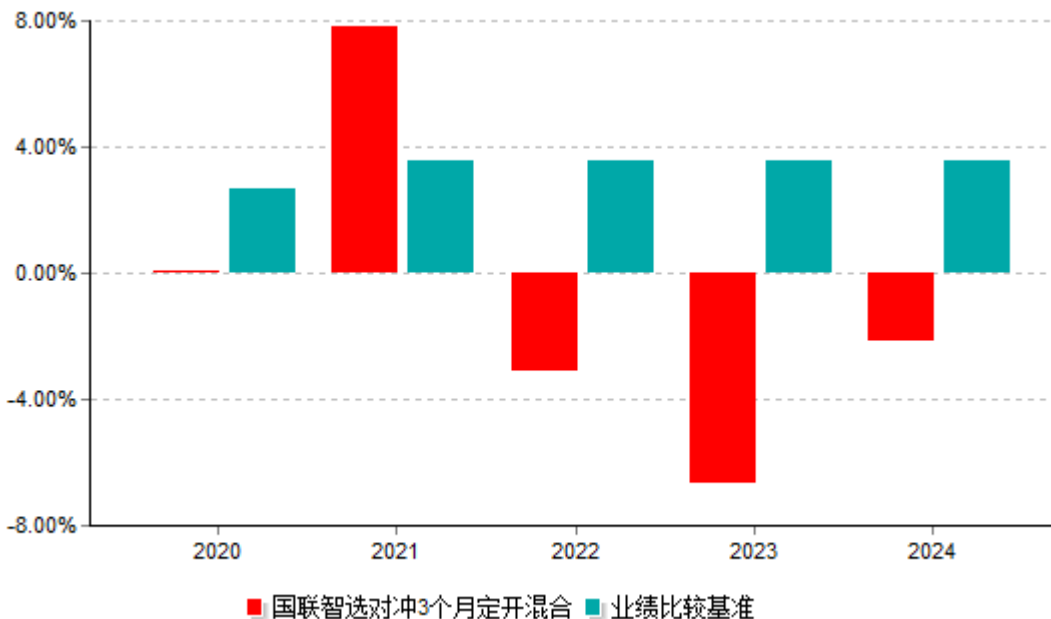
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



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。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较





注：本基金合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金过去三年未进行利润分配。

## §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，由国联民生证券股份有限公司（根据国联民生证券股份有限公司公告，自2025年2月7日起，公司名称由“国联证券股份有限公司”正式变更为“国联民生证券股份有限公司”）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12月31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、国联新经济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、国联产业升级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、国联恒泰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、国联竞争优势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、国联现金增利货币市场基金、国联恒信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、国联核心成长灵活配置混合型证券投资基金、

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、国联聚商3个月定期开放债券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、国联聚业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、国联聚安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、国联恒惠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、国联高股息精选混合型证券投资基金、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、国联聚通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、国联中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国联睿嘉39个月定期开放债券型证券投资基金、国联睿享86个月定期开放债券型证券投资基金、国联研发创新混合型证券投资基金、国联品牌优选混合型证券投资基金、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、国联价值成长6个月持有期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、国联融慧双欣一年定期开放债券型证券投资基金、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、国联恒阳纯债债券型证券投资基金、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、国联高质量成长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、国联聚优一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国联低碳经济3个月持有期混合型证券投资基金、国联景惠混合型证券投资基金、国联匠心优选混合型证券投资基金、国联金融鑫选3个月持有期混合型证券投资基金、国联恒利纯债债券型证券投资基金、国联成长先锋一年持有期混合型证券投资基金、国联恒泽纯债债券型证券投资基金、国联优势产业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、国联兴鸿优选混合型证券投资基金、国联医药消费混合型证券投资基金、国联融盛双盈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)、国联添安稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)、国联恒通纯债债券型证券投资基金、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、国联泓安3个月定期开放债券型证券投资基金、国联融誉双华6个月持有期债券型证券投资基金、国联消费精选混合型证券投资基金、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、国联中证500指数增强型证券投资基金、国联利率债债券型证券投资基金、国联沪深300指数增强型证券投资基金、国联央视财经50交易型开放式指数证券投资基金、国联国证

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、国联日日盈交易型货币市场基金、国联中证500交易型开放式指数证券投资基金。

#### 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、国联沪深300指数增强型证券投资基金的基金经理。	2020-04-08	-	16	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16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、国联中证500指数增强型证券投资基金、国联沪深300指数增强型证	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

	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。				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。
--	---------------------------------	--	--	--	--

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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《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 公平交易制度和控制方法

公司制定了《公平交易管理办法》，按照证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规的规定，从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度建设、内控措施和信息披露等多方面，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，杜绝不同投资组合之间进行利益输送，保护投资者合法权益。

公司公平交易管理办法要求境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易以及投资管理过程中各个相关环节符合公平交易的监管要求。各投资组合能够公平地获得投资信息、投资建议，并在投资决策委员会的制度规范下独立决策，实施投资决策时享有公平的机会。所有组合投资决策与交易执行保持隔离，任何组合必须经过公司交易部集中交易。各组合享有平等的交易权利，共享交易资源。对交易所公开竞价交易以及银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易制定专门的交易规则，保证各投资组合获得公平的交易机会。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，严格遵循各投资组合交易前独立确定交易要素，交易后按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

##### 4.3.2 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。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内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，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。

2024年，市场主要因子的表现不一，小市值、高beta因子波动性显著上升，估值因子优于以往年份。整体上看，上半年基本面因子表现较优，下半年价量因子表现突出。9月底的市场大幅上涨，市场呈现高贝塔高波动风格，常见选股因子大面积失效。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，注重因子配置的均衡性，11月中旬之后，组合的超额收益也逐步开始修复，策略表现恢复平稳。后续，我们将进一步控制beta暴露，加强极端环境监控，并储备新因子，提升策略的稳定性和有效性。

##### 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0.9544元，本报告期内，基金份额净值增长率为-2.15%，同期业绩比较基准收益率为3.56%。

#### 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2025年，中国经济面临新旧动能转换的压力，需要在保持经济增长的同时，推动产业升级和技术创新。得益于消费品以旧换新政策的加码，消费有望加快复苏，制造业和基建投资预计保持较高增速，尽管国际贸易摩擦仍存在不确定性，但中国凭借较低的出口价格和加征关税的缓冲空间，出口市场有望保持稳定。财政政策将持续发力，货币政策将更加积极，人工智能、半导体等高科技领域将继续成为经济增长的重要引擎，电动汽车、太阳能、风能等可再生能源领域的发展将继续推动经济增长。总而言之，2025年是中国经济结构筑底与化危为机的关键时期，在政策支持和新旧动能转换的推动下，中国经济有望延续温和回升态势。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人在内部监察稽核工作中，一切从合规运作、保障基金份额持有人的利益出发，由督察长领导法律合规部及风险管理部对公司经营、基金运作及员工行为的合规性进行定期和不定期检查，推动公司内部控制机制的完善与优化，保证各项法规和管理制度的落实，发现问题及时提出建议，并跟踪改进落实情况。本报告期内，公司内部控制体系运行顺利，本基金运作没有出现违法违规行为。

本报告期内，本基金管理人内部监察稽核工作重点集中于以下几个方面：

1、根据基金监管法律法规的最新变化，推动公司各部门及时完善与更新制度规范和业务流程，制定、颁布和更新了一系列公司基本管理制度，确保内控制度的适时性、全面性和合法合规性，并加强内部督导，将风险意识贯穿于各岗位与各业务环节。

2、日常监察和专项监察相结合，通过定期检查、不定期抽查、专项监察等工作方法，加强了对基金日常业务的合规审核和合规监测，并加强了对重要业务和关键业务环节的监督检查。

3、规范基金销售业务，保证基金销售业务的合法合规性。公司在基金募集和持续营销活动中，严格规范基金销售业务，按照《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及相关法规规定审查宣传推介材料，逐步落实反洗钱法律法规各项要求，并督促销售部门做好投资者教育工作。

4、规范基金投资业务，保证投资管理工作规范有序、合法合规进行。公司制定了严格规范的投资管理制度和流程机制，以投资决策委员会为最高投资决策机构，投资业务均按照管理制度和业务流程执行。

5、以外聘律师、讲座等多种方式加强合规教育与培训，促进公司合规文化的建设，及时向公司传达基金相关的法律法规；加大了对员工行为的监察稽核力度，从源头上防范合规风险，防范利益输送行为。公司自成立以来，各项业务运作正常，内部控制和风险防范措施逐步完善并积极发挥作用。我们将继续以风险控制为核心，进一步提高内部监察工作的科学性和有效性，切实保障基金的规范运作，充分保障基金份额持有人的利益。

#### 4.7 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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

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

本报告期内，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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	德师报(审)字(25)第P00672号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	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全体持有人
审计意见	我们审计了国联智选对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金的财务报表，包括2024年12月31日的资产负债表，2024年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了国联智选对冲策略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12月31日的财务状况以及2024年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于国联智选对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供



	了基础。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>国联基金管理有限公司(以下简称"基金管理人")管理层对其他信息负责。其他信息包括国联智选对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作,如果我们确定其他信息存在重大错报,我们应当报告该事实。在这方面,我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估国联智选对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算国联智选对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督国联智选对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资</p>

	<p>基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2)了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3)评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4)对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对国联智选对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然</p>

	<p>而，未来的事项或情况可能导致国联智选对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5)评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	孙维琦	冯适
会计师事务所的地址	上海市黄浦区延安东路222号30楼	
审计报告日期	2025-03-25	

## §7 年度财务报表

### 7.1 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12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	3,932,985.71	4,626.44
结算备付金		10,936,212.61	1,064,384.68
存出保证金		9,596,497.37	822,712.20
交易性金融资产	7.4.7.2	81,170,435.48	7,101,523.08
其中：股票投资		81,170,435.48	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	1,399,833.24
应收清算款		311,954.92	29,822.80
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		105,948,086.09	10,422,902.44
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年12月31日</b>	<b>上年度末 2023年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	32,209.43
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		107,022.17	10,480.21
应付托管费		17,837.02	1,746.71
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	219,331.17	62,466.06
负债合计		344,190.36	106,902.41
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	110,654,441.74	10,576,658.28
未分配利润	7.4.7.8	-5,050,546.01	-260,658.25

净资产合计		105,603,895.73	10,316,000.03
负债和净资产总计		105,948,086.09	10,422,902.44

注：报告截止日2024年12月31日，基金份额总额110,654,441.74份，份额净值0.9544元。

## 7.2 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12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年01月01日至2 024年12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2 023年12月31日
<b>一、营业总收入</b>		-4,274,491.04	-238,441.98
1.利息收入		299,612.86	169,665.57
其中：存款利息收入	7.4.7.9	184,787.50	89,938.13
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		114,825.36	79,727.44
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-5,961,441.49	-989,974.41
其中：股票投资收益	7.4.7.10	1,342,189.07	-4,086,643.29
基金投资收益	7.4.7.11	-	-
债券投资收益	7.4.7.12	4,047.00	-714,243.51
资产支持证券投资	7.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-9,556,172.83	3,468,819.74
股利收益	7.4.7.16	2,248,495.27	342,092.65
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失	7.4.7.17	1,343,454.20	390,120.48

以“-”号填列)			
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.18	43,883.39	191,746.38
<b>减：二、营业总支出</b>		1,466,414.30	1,101,010.91
1.管理人报酬		1,102,089.59	884,652.40
2.托管费		183,681.60	182,357.36
3.销售服务费		-	-
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.信用减值损失	7.4.7.19	-	-
7.税金及附加		29,996.72	12,886.15
8.其他费用	7.4.7.20	150,646.39	21,115.00
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		-5,740,905.34	-1,339,452.89
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		-5,740,905.34	-1,339,452.89
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-5,740,905.34	-1,339,452.89

### 7.3 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12月31日

单位：人民币元

项目	本期		
	2024年01月01日至2024年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计

一、上期期末净资产	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）	100,077,783.46	-4,789,887.76	95,287,895.70
（一）、综合收益总额	-	-5,740,905.34	-5,740,905.34
（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）	100,077,783.46	951,017.58	101,028,801.04
其中：1.基金申购款	130,022,179.24	524,038.42	130,546,217.66
2.基金赎回款	-29,944,395.78	426,979.16	-29,517,416.62
（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	110,654,441.74	-5,050,546.01	105,603,895.73
项目	上年度可比期间		
	2023年01月01日至2023年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	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）	-157,405,397.70	-7,792,801.26	-165,198,198.96

填列)			
(一)、综合收益总额	-	-1,339,452.89	-1,339,452.89
(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)	-157,405,397.70	-6,453,348.37	-163,858,746.07
其中: 1.基金申购款	50,749,540.58	3,410,438.05	54,159,978.63
2.基金赎回款	-208,154,938.28	-9,863,786.42	-218,018,724.70
(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	10,576,658.28	-260,658.25	10,316,000.03

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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(原名中融智选对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金)(以下简称“本基金”),经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]2888号文的核准,由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》等相关法规和《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”)向社会公开募集,基金合同于2020年4月3日正式生效,首次设立募集规模为10,000,000.00份基金份额,经上会会计师事务所(特殊普



通合伙)验证。本基金为契约型开放式基金,存续期限为不定期。本基金的基金管理人为国联基金管理有限公司,基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

根据基金管理人于2023年9月6日发布的《国联基金管理有限公司关于旗下基金更名事宜的公告》,自2023年9月8日起,本基金更名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)。本基金可以在履行适当程序后,参与融资融券业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为:开放期内的每个交易日日终,持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的95%;封闭期内的每个交易日日终,持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的100%。本基金权益类多头头寸价值减去权益类空头头寸价值占基金资产净值的0-10%。其中:权益类多头头寸的价值是指买入持有的股票市值、买入股指期货的合约价值及买入其他权益类衍生工具组合正风险敞口暴露价值及其它权益类工具多头价值的合计值;权益类空头头寸的价值是指融券卖出的股票市值、卖出股指期货的合约价值及卖出其他权益类衍生工具组合负风险敞口暴露价值及其它权益类工具空头价值的合计值。本基金持有的银行存款及同业存单比例不超过基金资产的20%。开放期内,在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后,基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。在封闭期内,本基金不受上述5%的限制。

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%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)、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。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则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12月31日的财务状况以及2024年度的经营成果和净资产变动情况。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

根据本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产，暂无金融资产划分为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

金融资产的合同条款规定在特定日期产生的现金流量仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付，且本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标，则本基金将该金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产。此类金融资产主要包括货币资金、各类应收款项、买入返售金融资产等。

不符合分类为以摊余成本计量的金融资产以及公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产条件的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产计入“衍生金融资产”外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产计入“交易性金融资产”。

##### (2) 金融负债的分类

本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。对于以常规方式购买或出售金融资产的，在交易日确认将收到的资产和为此将承担的负债，或者在交易日终止确认已出售的资产。金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券或资产支持证券已到付息期但尚未领取的利息，单独确认为应收项目。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失以及与该金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，发生减值或终止确认产生的利得或损失，计入当期损益。

本基金对分类为以摊余成本计量的金融资产以预期信用损失为基础确认损失准备。除购买或源生的已发生信用减值的金融资产外，本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后的变动情况。若该金融工具的信用风险自初始确认后已显著增加，本基金按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备；若该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加，本基金按照相当于该金融工具未来12个月内预期信用损失的金额计量其损失准备。信用损失准备的增加或转回金额，作为减值损失或利得计入当期损益。

本基金在上一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形的，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来12个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

本基金利用可获得的合理且有依据的前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止、该金融资产已转移且其所有权上几乎所有的风险和报酬已转移或虽然既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是未保留对该金融资产的控制，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。若本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有风险和报酬，且保留了对该金融资产控制的，则按照其继续涉入被转移金融资产的程度继续确认该被转移金融资产，并相应确认相关负债。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部

或部分终止确认的,将终止确认部分的账面价值与支付的对价(包括转出的非现金资产或承担的新金融负债)之间的差额,计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中,出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性,将其公允价值划分为三个层次。第一层次输入值是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;第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值;第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值原则如下:

(1)对存在活跃市场的投资品种,如估值日有市价的,采用市价确定公允价值;估值日无市价,且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,采用最近交易市价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市价不能真实反映公允价值的,应对市价进行调整,确定公允价值。与上述投资品种相同,但具有不同特征的,应以相同资产或负债的公允价值为基础,并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等,如果该限制是针对资产持有者的,那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外,基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2)当投资品种不存在活跃市场,基金管理人估值委员会认为必要时,采用市场参与者普遍认同,且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术,确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时,尽可能最大程度使用市场参数,减少使用与本基金特定相关的参数。

(3)经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时,应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素,对估值进行调整,确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占净资产的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

##### (1)利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

##### (2)投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本与相关交易费用的差额确认。

债券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖债券价差收入。除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。买卖债券价差收入为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

资产支持证券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖资产支持证券价差收入。资产支持证券利息收入在持有期内，按资产支持证券的票面价值和预计收益率计算的利息逐日确认资产支持证券利息收入。在收到资产支持证券支付的款项时，其中属于证券投资收益的部分冲减应计利息(若有)后的差额，确认资产支持证券利息收入。买卖资产支持证券价差收入为卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本、相关交易费用与税费后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额确认，由上市公司代扣代缴的个人所得税于卖出交易日按实际代扣代缴金额确认。

#### (3)公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

#### (4)信用减值损失

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认信用损失准备。本基金所计提的信用减值损失计入当期损益。

#### (5)其他收入

本基金履行了基金合同中的履约义务，即在客户取得服务控制权时确认收入。

### 7.4.4.10 费用的确认和计量

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的交易费用发生时按照确定的金额计入交易费用。

卖出回购金融资产款支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率逐日计提。

### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1)本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

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

(3)每一基金份额享有同等分配权；

(4)法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在对基金份额持有人利益无实质不利影响的情况下，基金管理人可在不违反法律法规规定的前提下并按照监管部门要求履行适当程序后，酌情调整基金收益分配原则，此项调整不需要召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在指定媒介公告。

### 7.4.4.12 外币交易

本基金本报告期内无外币交易。

### 7.4.4.13 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
  - (2)能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
  - (3)能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。
- 本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》(中基协发[2017]6号)，在估值日按照该通知规定的流通受限股票公允价值计算模型进行估值。

(2)对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，根据《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》(中国证监会公告[2017]13号)及《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》(中基协发[2013]13号)相关规定，本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(3)对于中国证券投资基金业协会《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》(中基协字[2022]566号)所规定的固定收益品种，本基金按照相关规定，对以公允价值计量的固定收益品种选取第三方估值基准服务机构提供估值全价进行估值；对以摊余成本计量的固定收益品种用自建或由第三方估值基准服务机构提供的预期信用损失模型参数或减值计量结果。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

无。

#### 7.4.6 税项

根据财税[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》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号《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所得，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。其中，对基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所挂牌交易的上市公司限售股，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。

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
活期存款	3,932,985.71	4,626.44
等于：本金	3,932,561.37	4,622.40
加：应计利息	424.34	4.04
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	3,932,985.71	4,626.44

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年12月31日

		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		79,595,464.77	-	81,170,435.48	1,574,970.71
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		79,595,464.77	-	81,170,435.48	1,574,970.71
项目		上年度末 2023年12月31日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		7,104,946.57	-	7,101,523.08	-3,423.49
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		7,104,946.57	-	7,101,523.08	-3,423.49

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024年12月31日		
	合同/名义金额	公允价值	备注

		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	79,006,740.00	-	-	-
--股指期货	79,006,740.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	79,006,740.00	-	-	-
项目	上年度末 2023年12月31日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	6,828,520.00	-	-	-
--股指期货	6,828,520.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	6,828,520.00	-	-	-

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。

#### 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IF2501	沪深300股指期货2501合约	-67.00	-79,169,880.00	-163,140.00
合计				-163,140.00
减：可抵销期货暂收款				-163,140.00
净额				-

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-
项目	上年度末 2023年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	1,399,833.24	-
银行间市场	-	-
合计	1,399,833.24	-

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

#### 7.4.7.5 其他资产

注：无。

#### 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	69,331.17	42,466.06
其中：交易所市场	69,331.17	42,466.06

银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	150,000.00	20,000.00
合计	219,331.17	62,466.06

#### 7.4.7.7 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12月31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	130,022,179.24	130,022,179.24
本期赎回（以“-”号填列）	-29,944,395.78	-29,944,395.78
本期末	110,654,441.74	110,654,441.74

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-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	-7,084,359.54	1,343,454.20	-5,740,905.34
本期基金份额交易产生的变动数	799,724.54	151,293.04	951,017.58
其中：基金申购款	107,130.26	416,908.16	524,038.42
基金赎回款	692,594.28	-265,615.12	426,979.16
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-6,594,625.71	1,544,079.70	-5,050,546.01

#### 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2024年01月01日至2024年 12月31日	2023年01月01日至2023年 12月31日
活期存款利息收入	10,957.80	19,780.55
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	173,010.55	69,029.23
其他	819.15	1,128.35
合计	184,787.50	89,938.13

#### 7.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年 12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年 12月31日
卖出股票成交总额	755,702,733.65	564,741,893.46
减：卖出股票成本总额	753,078,578.61	567,450,933.13
减：交易费用	1,281,965.97	1,377,603.62
买卖股票差价收入	1,342,189.07	-4,086,643.29

#### 7.4.7.11 基金投资收益

注：无。

#### 7.4.7.12 债券投资收益

##### 7.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年 12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年 12月31日
债券投资收益——利息收入	8,903.00	32,396.26
债券投资收益——买卖债券 (债转股及债券到期兑付) 差价收入	-4,856.00	-746,639.77

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	4,047.00	-714,243.51

#### 7.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年01月01日至2024年12月31日	2023年01月01日至2023年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	16,480,669.42	56,825,096.99
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	16,229,452.00	57,373,439.86
减：应计利息总额	256,073.42	195,544.68
减：交易费用	-	2,752.22
买卖债券差价收入	-4,856.00	-746,639.77

#### 7.4.7.13 资产支持证券投资收益

注：无。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

注：无。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

##### 7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

##### 7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年 12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年 12月31日
期货投资	-9,556,172.83	3,468,819.74

#### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024 年12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023 年12月31日
股票投资产生的股利收益	2,248,495.27	342,092.65
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	2,248,495.27	342,092.65

#### 7.4.7.17 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12 月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年12 月31日
1.交易性金融资产	1,578,394.20	8,691,211.12
——股票投资	1,578,394.20	7,022,107.24
——债券投资	-	1,669,103.88
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-234,940.00	-8,415,447.11
——权证投资	-	-
——期货投资	-234,940.00	-8,415,447.11
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允 价值变动产生的预估增	-	-114,356.47



值税		
合计	1,343,454.20	390,120.48

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年 12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年 12月31日
基金赎回费收入	43,278.56	191,746.38
转换费收入	604.83	-
合计	43,883.39	191,746.38

#### 7.4.7.19 信用减值损失

注：无。

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年 12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年 12月31日
审计费用	30,000.00	20,000.00
信息披露费	120,000.00	-
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	646.39	1,115.00
合计	150,646.39	21,115.00

#### 7.4.7.21 分部报告

无。

### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 7.4.8.1 或有事项

无。

**7.4.8.2 资产负债表日后事项**

无。

**7.4.9 关联方关系**

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、基金销售机构
国联民生证券股份有限公司	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：（1）根据国联民生证券股份有限公司公告，自2025年2月7日起，公司名称由“国联证券股份有限公司”正式变更为“国联民生证券股份有限公司”。

（2）以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

**7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易****7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****7.4.10.1.1 股票交易**

注：无。

**7.4.10.1.2 权证交易**

注：无。

**7.4.10.1.3 债券交易**

注：无。

**7.4.10.1.4 债券回购交易**

注：无。

**7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

注：无。

**7.4.10.2 关联方报酬****7.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至20 24年12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至20 23年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,102,089.59	884,652.40
其中：应支付销售机构的客户维护费	381,869.89	44,105.41
应支付基金管理人的净管理费	720,219.70	840,546.99

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1.20%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。

#### 7.4.10.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024 年12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023 年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	183,681.60	182,357.36

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值0.20%的年费率计提，每日计提，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。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 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12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至 2023年12月31日
基金合同生效日（2020年04月03日）持有	-	-

的基金份额		
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	9.04%	94.55%

注：① 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；  
② 期间申购/买入总份额：含红利再投、转换入份额；期间赎回/卖出总份额：含转换出份额。

#### 7.4.10.4.2 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。

#### 7.4.10.5 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12月31日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国民生银行股份有限公司	3,932,985.71	10,957.80	4,626.44	19,780.55

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。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况--固定净值型货币市场基金之外的基金

注：无。

### 7.4.12 期末（2024年12月31日）本基金持有的流通受限证券

#### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
603072	天和磁材	2024-12-24	1个月内（含）	新股未流通	12.30	12.30	821	10,098.30	10,098.30	-
603285	键邦股份	2024-06-28	6个月	首次公开发行限售	18.65	22.61	72	1,342.80	1,627.92	-
603072	天和磁材	2024-12-24	6个月	首次公开发行限售	12.30	12.30	92	1,131.60	1,131.60	-

注：基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，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。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002252	上海莱	2024-1-2	重大事	7.22	2025-01-07	6.93	60,800	435,458.11	438,976.00	-

	士	3	项 停 牌							
--	---	---	-------------	--	--	--	--	--	--	--

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：无。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金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。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券的发行人出现违约、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。

#### **7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

注：无。

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

注：无。

#### **7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

注：无。

#### **7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

注：无。

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

注：无。

#### **7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

注：无。

#### **7.4.13.3 流动性风险**

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

### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》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7.4.12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7.4.12.3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。

### 7.4.13.4 市场风险

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

#### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024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	3,932,985.71	-	-	-	3,932,985.71
结算备付金	10,936,212.61	-	-	-	10,936,212.61
存出保证金	9,596,497.37	-	-	-	9,596,497.37
交易性金融资产	-	-	-	81,170,435.48	81,170,435.48
应收清算款	-	-	-	311,954.92	311,954.92
资产总计	24,465,695.69	-	-	81,482,390.40	105,948,086.09
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	107,022.17	107,022.17
应付托管费	-	-	-	17,837.02	17,837.02
其他负债	-	-	-	219,331.17	219,331.17
负债总计	-	-	-	344,190.36	344,190.36
利率敏感度缺口	24,465,695.69	-	-	81,138,200.04	105,603,895.73
上年度末 2023年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	4,626.44	-	-	-	4,626.44
结算备	1,064,384.68	-	-	-	1,064,384.68

付金					
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。

#### 7.4.13.4.1.2 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。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 7.4.13.4.3 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。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年12月31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	81,170,435.48	76.86	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	81,170,435.48	76.86	7,101,523.08	68.84

### 7.4.13.4.3.2 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12月31日	上年度末 2023年12月31日
	沪深300指数上升5%	25,994.75	71,516.84
	沪深300指数下降5%	-25,994.75	-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。

## 7.4.14 公允价值

### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

#### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	80,718,601.66	7,101,523.08
第二层次	450,205.90	-
第三层次	1,627.92	-
合计	81,170,435.48	7,101,523.08

#### 7.4.14.2.2 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。

#### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

##### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期		
	2024年01月01日至2024年12月31日		
	交易性金融资产		合计
债券投资	股票投资		
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	1,342.80	1,342.80
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	285.12	285.12
其中：计入损益的利得或损失	-	285.12	285.12
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,627.92	1,627.92
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	285.12	285.12
项目	上年度可比期间		

	2023年01月01日至2023年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	1,135,967.01	1,135,967.01
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	157,794.48	157,794.48
转出第三层次	-	1,602,140.88	1,602,140.88
当期利得或损失总额	-	308,379.39	308,379.39
其中：计入损益的利得或损失	-	308,379.39	308,379.39
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售期股票	1,627.92	平均价格亚式期权模型	股票在剩余限售期内的股价的预期年化波动率	0.3521-0.3521	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
-	-	-	-	-	-

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

### §8 投资组合报告

#### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	81,170,435.48	76.61
	其中：股票	81,170,435.48	76.61
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	14,869,198.32	14.03
8	其他各项资产	9,908,452.29	9.35
9	合计	105,948,086.09	100.00

#### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	761,829.00	0.72
B	采矿业	4,218,092.64	3.99
C	制造业	40,210,323.84	38.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,655,616.00	3.46
E	建筑业	2,591,905.00	2.45
F	批发和零售业	654,602.00	0.62
G	交通运输、仓储和邮政业	3,633,679.00	3.44
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,820,119.00	2.67
J	金融业	21,066,082.00	19.95
K	房地产业	49,216.00	0.05
L	租赁和商务服务业	637,756.00	0.60
M	科学研究和技术服务业	476,326.00	0.45
N	水利、环境和公共设施管理业	307,439.00	0.29
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	87,450.00	0.08
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	81,170,435.48	76.86

### 8.2.2 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。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
----	------	------	-------	---------	--------------



1	600519	贵州茅台	2,500	3,810,000.00	3.61
2	300750	宁德时代	11,493	3,057,138.00	2.89
3	601318	中国平安	48,200	2,537,730.00	2.40
4	600036	招商银行	52,400	2,059,320.00	1.95
5	600900	长江电力	58,800	1,737,540.00	1.65
6	000333	美的集团	18,100	1,361,482.00	1.29
7	601166	兴业银行	68,000	1,302,880.00	1.23
8	601899	紫金矿业	75,300	1,138,536.00	1.08
9	601398	工商银行	157,000	1,086,440.00	1.03
10	600887	伊利股份	35,500	1,071,390.00	1.01
11	000651	格力电器	21,900	995,355.00	0.94
12	300059	东方财富	38,200	986,324.00	0.93
13	601328	交通银行	122,500	951,825.00	0.90
14	000725	京东方 A	215,900	947,801.00	0.90
15	002475	立讯精密	22,400	913,024.00	0.86
16	601816	京沪高铁	134,400	827,904.00	0.78
17	600030	中信证券	28,300	825,511.00	0.78
18	601668	中国建筑	133,500	801,000.00	0.76
19	601601	中国太保	22,500	766,800.00	0.73
20	000858	五粮液	5,400	756,216.00	0.72
21	601766	中国中车	85,300	714,814.00	0.68
22	600406	国电南瑞	28,300	713,726.00	0.68
23	002594	比亚迪	2,500	706,650.00	0.67
24	600660	福耀玻璃	11,300	705,120.00	0.67
25	688981	中芯国际	7,400	700,188.00	0.66
26	601919	中远海控	44,500	689,750.00	0.65
27	002714	牧原股份	17,800	684,232.00	0.65
28	600690	海尔智家	23,900	680,433.00	0.64
29	600919	江苏银行	67,600	663,832.00	0.63
30	601688	华泰证券	37,300	656,107.00	0.62
31	300760	迈瑞医疗	2,500	637,500.00	0.60

32	300502	新易盛	5,200	601,016.00	0.57
33	002027	分众传媒	85,000	597,550.00	0.57
34	601288	农业银行	108,400	578,856.00	0.55
35	000425	徐工机械	72,800	577,304.00	0.55
36	601169	北京银行	93,800	576,870.00	0.55
37	600028	中国石化	85,400	570,472.00	0.54
38	601658	邮储银行	98,600	560,048.00	0.53
39	601939	建设银行	62,100	545,859.00	0.52
40	601628	中国人寿	12,700	532,384.00	0.50
41	688041	海光信息	3,547	531,305.13	0.50
42	600926	杭州银行	35,300	515,733.00	0.49
43	300408	三环集团	13,300	512,183.00	0.49
44	601390	中国中铁	80,100	511,839.00	0.48
45	600276	恒瑞医药	10,900	500,310.00	0.47
46	002352	顺丰控股	12,200	491,660.00	0.47
47	603993	洛阳钼业	73,800	490,770.00	0.46
48	601600	中国铝业	66,500	488,775.00	0.46
49	000166	申万宏源	91,000	486,850.00	0.46
50	300274	阳光电源	6,500	479,895.00	0.45
51	601916	浙商银行	164,900	479,859.00	0.45
52	600031	三一重工	29,100	479,568.00	0.45
53	300433	蓝思科技	21,800	477,420.00	0.45
54	600795	国电电力	102,600	469,908.00	0.44
55	601728	中国电信	63,200	456,304.00	0.43
56	002001	新和成	20,100	441,597.00	0.42
57	002252	上海莱士	60,800	438,976.00	0.42
58	000776	广发证券	26,900	436,049.00	0.41
59	600196	复星医药	17,100	424,935.00	0.40
60	601117	中国化学	51,000	422,790.00	0.40
61	600176	中国巨石	37,000	421,430.00	0.40
62	600219	南山铝业	106,600	416,806.00	0.39

63	688223	晶科能源	58,600	416,646.00	0.39
64	002601	龙佰集团	23,500	415,245.00	0.39
65	600233	圆通速递	28,600	405,834.00	0.38
66	002938	鹏鼎控股	11,100	404,928.00	0.38
67	601319	中国人保	52,600	400,812.00	0.38
68	600023	浙能电力	70,800	400,728.00	0.38
69	002180	纳思达	14,200	400,014.00	0.38
70	601618	中国中冶	121,100	399,630.00	0.38
71	688472	阿特斯	31,500	395,640.00	0.37
72	000963	华东医药	11,400	394,440.00	0.37
73	000876	新希望	43,256	388,438.88	0.37
74	601989	中国重工	80,300	386,243.00	0.37
75	600362	江西铜业	18,600	383,904.00	0.36
76	002236	大华股份	23,800	380,800.00	0.36
77	688009	中国通号	60,252	377,177.52	0.36
78	000975	山金国际	24,000	368,880.00	0.35
79	601988	中国银行	66,700	367,517.00	0.35
80	600066	宇通客车	13,000	342,940.00	0.32
81	002459	晶澳科技	22,900	314,875.00	0.30
82	002422	科伦药业	10,400	311,272.00	0.29
83	000001	平安银行	26,400	308,880.00	0.29
84	000408	藏格矿业	11,100	307,803.00	0.29
85	002142	宁波银行	12,500	303,875.00	0.29
86	600061	国投资本	40,400	303,808.00	0.29
87	688187	时代电气	6,333	303,477.36	0.29
88	688599	天合光能	15,700	303,010.00	0.29
89	300308	中际旭创	2,420	298,894.20	0.28
90	600570	恒生电子	10,300	288,297.00	0.27
91	000895	双汇发展	11,100	288,156.00	0.27
92	600489	中金黄金	21,800	262,254.00	0.25
93	601877	正泰电器	11,200	262,192.00	0.25

94	601818	光大银行	67,600	261,612.00	0.25
95	601088	中国神华	5,743	249,705.64	0.24
96	601377	兴业证券	39,100	244,766.00	0.23
97	002648	卫星化学	13,000	244,270.00	0.23
98	600438	通威股份	11,000	243,210.00	0.23
99	603501	韦尔股份	2,300	240,143.00	0.23
100	603259	药明康德	4,300	236,672.00	0.22
101	601006	大秦铁路	34,700	235,266.00	0.22
102	600000	浦发银行	22,600	232,554.00	0.22
103	300759	康龙化成	8,900	228,730.00	0.22
104	600309	万华化学	3,100	221,185.00	0.21
105	601138	工业富联	10,100	217,150.00	0.21
106	600027	华电国际	37,800	212,058.00	0.20
107	600073	光明肉业	30,400	210,976.00	0.20
108	601225	陕西煤业	8,900	207,014.00	0.20
109	600115	中国东航	51,600	206,400.00	0.20
110	601229	上海银行	22,400	204,960.00	0.19
111	300628	亿联网络	5,300	204,580.00	0.19
112	600958	东方证券	19,200	202,752.00	0.19
113	000063	中兴通讯	5,000	202,000.00	0.19
114	688256	寒武纪	306	201,348.00	0.19
115	002736	国信证券	17,600	197,120.00	0.19
116	601211	国泰君安	10,500	195,825.00	0.19
117	002371	北方华创	500	195,500.00	0.19
118	600096	云天化	8,700	194,010.00	0.18
119	300124	汇川技术	3,300	193,314.00	0.18
120	300001	特锐德	8,700	190,965.00	0.18
121	600879	航天电子	21,300	190,848.00	0.18
122	002550	千红制药	30,700	190,340.00	0.18
123	002100	天康生物	28,400	186,020.00	0.18
124	601336	新华保险	3,700	183,890.00	0.17

125	601881	中国银河	12,000	182,760.00	0.17
126	600161	天坛生物	8,700	178,350.00	0.17
127	600018	上港集团	28,700	175,644.00	0.17
128	601898	中煤能源	13,700	166,866.00	0.16
129	000685	中山公用	17,800	164,294.00	0.16
130	301175	中科环保	30,300	163,620.00	0.15
131	603296	华勤技术	2,300	163,185.00	0.15
132	600008	首创环保	47,300	155,144.00	0.15
133	600968	海油发展	34,800	148,596.00	0.14
134	601009	南京银行	13,900	148,035.00	0.14
135	600583	海油工程	26,600	145,502.00	0.14
136	300413	芒果超媒	5,400	145,206.00	0.14
137	601083	锦江航运	15,000	142,800.00	0.14
138	002007	华兰生物	8,400	141,540.00	0.13
139	688772	珠海冠宇	8,800	141,504.00	0.13
140	002415	海康威视	4,600	141,220.00	0.13
141	600741	华域汽车	8,000	140,880.00	0.13
142	000967	盈峰环境	28,200	140,154.00	0.13
143	300525	博思软件	8,900	138,662.00	0.13
144	600015	华夏银行	17,300	138,573.00	0.13
145	601998	中信银行	18,900	131,922.00	0.12
146	600332	白云山	4,500	127,890.00	0.12
147	002120	韵达股份	17,000	127,840.00	0.12
148	002565	顺灏股份	42,000	127,680.00	0.12
149	600268	国电南自	18,700	125,664.00	0.12
150	002567	唐人神	24,500	124,950.00	0.12
151	000708	中信特钢	10,600	120,946.00	0.11
152	601669	中国电建	21,500	117,390.00	0.11
153	688538	和辉光电	49,700	115,304.00	0.11
154	301039	中集车辆	12,000	108,600.00	0.10
155	600160	巨化股份	4,500	108,540.00	0.10

156	603799	华友钴业	3,700	108,262.00	0.10
157	600941	中国移动	900	106,344.00	0.10
158	002035	华帝股份	14,300	104,962.00	0.10
159	600837	海通证券	9,400	104,528.00	0.10
160	600875	东方电气	6,500	103,285.00	0.10
161	600585	海螺水泥	4,300	102,254.00	0.10
162	603019	中科曙光	1,400	101,248.00	0.10
163	002376	新北洋	15,400	100,408.00	0.10
164	300661	圣邦股份	1,200	98,136.00	0.09
165	601868	中国能建	41,700	95,493.00	0.09
166	601857	中国石油	10,500	93,870.00	0.09
167	601127	赛力斯	700	93,373.00	0.09
168	600131	国网信通	4,900	92,659.00	0.09
169	600640	国脉文化	7,600	90,744.00	0.09
170	000768	中航西飞	3,200	90,368.00	0.09
171	600029	南方航空	13,900	90,211.00	0.09
172	000800	一汽解放	10,900	89,380.00	0.08
173	601985	中国核电	8,500	88,655.00	0.08
174	300015	爱尔眼科	6,600	87,450.00	0.08
175	600104	上汽集团	4,200	87,192.00	0.08
176	600141	兴发集团	4,000	86,800.00	0.08
177	601012	隆基绿能	5,500	86,405.00	0.08
178	000100	TCL科技	16,900	85,007.00	0.08
179	301262	海看股份	3,400	84,558.00	0.08
180	601808	中海油服	5,500	83,875.00	0.08
181	600999	招商证券	4,200	80,472.00	0.08
182	600699	均胜电子	5,100	79,917.00	0.08
183	300498	温氏股份	4,700	77,597.00	0.07
184	002230	科大讯飞	1,600	77,312.00	0.07
185	688012	中微公司	400	75,664.00	0.07
186	000568	泸州老窖	600	75,120.00	0.07

187	600809	山西汾酒	400	73,684.00	0.07
188	002204	大连重工	14,700	73,206.00	0.07
189	600704	物产中大	14,100	71,346.00	0.07
190	002063	远光软件	12,300	70,848.00	0.07
191	002179	中航光电	1,800	70,740.00	0.07
192	000404	长虹华意	9,500	70,300.00	0.07
193	600050	中国联通	12,900	68,499.00	0.06
194	000039	中集集团	8,600	66,822.00	0.06
195	601186	中国铁建	7,200	66,024.00	0.06
196	600547	山东黄金	2,900	65,627.00	0.06
197	603288	海天味业	1,400	64,260.00	0.06
198	300074	华平股份	16,000	63,680.00	0.06
199	002091	江苏国泰	8,600	62,952.00	0.06
200	601717	郑煤机	4,800	62,304.00	0.06
201	000157	中联重科	8,500	61,455.00	0.06
202	600150	中国船舶	1,700	61,132.00	0.06
203	688008	澜起科技	900	61,110.00	0.06
204	600918	中泰证券	9,200	60,444.00	0.06
205	688111	金山办公	200	57,278.00	0.05
206	002241	歌尔股份	2,200	56,782.00	0.05
207	002745	木林森	6,500	56,680.00	0.05
208	603392	万泰生物	800	56,368.00	0.05
209	600011	华能国际	8,300	56,191.00	0.05
210	601111	中国国航	7,100	56,161.00	0.05
211	600372	中航机载	4,500	55,485.00	0.05
212	603986	兆易创新	500	53,400.00	0.05
213	000338	潍柴动力	3,800	52,060.00	0.05
214	000630	铜陵有色	16,000	51,680.00	0.05
215	601607	上海医药	2,400	50,400.00	0.05
216	300523	辰安科技	2,500	49,475.00	0.05
217	600039	四川路桥	6,600	48,048.00	0.05

218	600025	华能水电	4,900	46,599.00	0.04
219	601311	骆驼股份	5,500	45,595.00	0.04
220	300207	欣旺达	2,000	44,620.00	0.04
221	603806	福斯特	3,000	44,400.00	0.04
222	002266	浙富控股	14,200	44,304.00	0.04
223	600998	九州通	8,500	43,520.00	0.04
224	600436	片仔癀	200	42,900.00	0.04
225	603195	公牛集团	600	42,144.00	0.04
226	603833	欧派家居	600	41,364.00	0.04
227	600271	航天信息	4,500	40,995.00	0.04
228	600183	生益科技	1,700	40,885.00	0.04
229	601888	中国中免	600	40,206.00	0.04
230	000625	长安汽车	3,000	40,080.00	0.04
231	300253	卫宁健康	5,400	38,664.00	0.04
232	600089	特变电工	2,900	36,946.00	0.03
233	000938	紫光股份	1,300	36,179.00	0.03
234	002368	太极股份	1,500	35,520.00	0.03
235	600048	保利发展	4,000	35,440.00	0.03
236	603588	高能环境	6,500	34,060.00	0.03
237	000528	柳工	2,800	33,768.00	0.03
238	600428	中远海特	4,600	33,580.00	0.03
239	600216	浙江医药	2,100	33,306.00	0.03
240	002128	电投能源	1,700	33,286.00	0.03
241	600905	三峡能源	7,600	33,212.00	0.03
242	601018	宁波港	8,600	33,110.00	0.03
243	000792	盐湖股份	2,000	32,920.00	0.03
244	600925	苏能股份	6,200	32,860.00	0.03
245	600874	创业环保	5,500	32,835.00	0.03
246	000885	城发环境	2,500	32,775.00	0.03
247	600098	广州发展	5,100	32,742.00	0.03
248	600248	陕建股份	7,300	32,704.00	0.03



249	600380	健康元	2,900	32,683.00	0.03
250	601200	上海环境	4,000	32,680.00	0.03
251	601179	中国西电	4,300	32,637.00	0.03
251	000598	兴蓉环境	4,300	32,637.00	0.03
252	601598	中国外运	6,100	32,635.00	0.03
253	600664	哈药股份	7,900	32,627.00	0.03
254	600572	康恩贝	7,000	32,620.00	0.03
255	601333	广深铁路	9,500	32,585.00	0.03
256	600320	振华重工	8,300	32,536.00	0.03
257	601222	林洋能源	4,600	32,522.00	0.03
258	300919	中伟股份	900	32,508.00	0.03
258	000050	深天马 A	3,600	32,508.00	0.03
259	002507	涪陵榨菜	2,300	32,499.00	0.03
260	001286	陕西能源	3,500	32,480.00	0.03
261	002385	大北农	7,500	32,475.00	0.03
262	600938	中国海油	1,100	32,461.00	0.03
263	603612	索通发展	2,400	32,424.00	0.03
264	601886	江河集团	6,000	32,400.00	0.03
265	600995	南网储能	3,200	32,384.00	0.03
266	600267	海正药业	3,900	32,370.00	0.03
266	000883	湖北能源	6,500	32,370.00	0.03
267	000060	中金岭南	6,900	32,361.00	0.03
268	600820	隧道股份	4,500	32,355.00	0.03
269	601399	国机重装	10,500	32,340.00	0.03
270	000960	锡业股份	2,300	32,269.00	0.03
271	002532	天山铝业	4,100	32,267.00	0.03
272	300181	佐力药业	2,100	32,256.00	0.03
273	600420	国药现代	2,700	32,238.00	0.03
274	600970	中材国际	3,400	32,232.00	0.03
274	600871	石化油服	15,800	32,232.00	0.03
275	601958	金钼股份	3,200	32,192.00	0.03

276	300515	三德科技	2,700	32,157.00	0.03
277	601168	西部矿业	2,000	32,140.00	0.03
278	688425	铁建重工	7,300	32,120.00	0.03
279	601577	长沙银行	3,600	32,004.00	0.03
280	002597	金禾实业	1,400	31,962.00	0.03
281	601061	中信金属	4,400	31,944.00	0.03
282	688428	诺诚健华	2,600	31,928.00	0.03
283	600378	昊华科技	1,100	31,801.00	0.03
284	000878	云南铜业	2,600	31,694.00	0.03
285	600017	日照港	9,900	31,680.00	0.03
286	603858	步长制药	2,000	31,600.00	0.03
287	600019	宝钢股份	4,500	31,500.00	0.03
288	000783	长江证券	4,600	31,372.00	0.03
289	601555	东吴证券	4,000	31,200.00	0.03
290	000999	华润三九	700	31,038.00	0.03
291	002636	金安国纪	4,000	30,960.00	0.03
292	600985	淮北矿业	2,200	30,954.00	0.03
293	300812	易天股份	1,400	30,856.00	0.03
294	601838	成都银行	1,800	30,798.00	0.03
295	601128	常熟银行	3,800	28,766.00	0.03
296	300033	同花顺	100	28,750.00	0.03
297	600584	长电科技	700	28,602.00	0.03
298	300014	亿纬锂能	600	28,044.00	0.03
299	000686	东北证券	3,200	25,408.00	0.02
300	002064	华峰化学	3,100	25,358.00	0.02
301	001289	龙源电力	1,500	23,565.00	0.02
302	600435	北方导航	2,400	23,424.00	0.02
303	002019	亿帆医药	2,100	22,512.00	0.02
304	002273	水晶光电	1,000	22,220.00	0.02
305	603087	甘李药业	500	22,050.00	0.02
306	600901	江苏金租	4,200	21,924.00	0.02

307	600582	天地科技	3,500	21,630.00	0.02
308	600111	北方稀土	1,000	21,220.00	0.02
309	000977	浪潮信息	400	20,752.00	0.02
310	600893	航发动力	500	20,725.00	0.02
311	601866	中远海发	7,900	20,619.00	0.02
312	601077	渝农商行	3,400	20,570.00	0.02
313	000807	云铝股份	1,500	20,295.00	0.02
314	600760	中航沈飞	400	20,288.00	0.02
315	002463	沪电股份	500	19,825.00	0.02
316	002050	三花智控	800	18,808.00	0.02
317	600531	豫光金铅	2,900	18,618.00	0.02
318	000538	云南白药	300	17,985.00	0.02
319	603158	腾龙股份	2,200	17,776.00	0.02
320	600282	南钢股份	3,700	17,353.00	0.02
321	600863	内蒙华电	4,000	17,320.00	0.02
322	601991	大唐发电	5,200	14,820.00	0.01
323	600663	陆家嘴	1,400	13,776.00	0.01
324	300054	鼎龙股份	500	13,010.00	0.01
325	000539	粤电力A	2,800	12,684.00	0.01
326	000683	远兴能源	2,200	12,298.00	0.01
327	603072	天和磁材	913	11,229.90	0.01
328	002920	德赛西威	100	11,011.00	0.01
329	300347	泰格医药	200	10,924.00	0.01
330	600909	华安证券	1,800	10,908.00	0.01
331	603817	海峡环保	1,800	10,044.00	0.01
332	603299	苏盐井神	900	10,026.00	0.01
333	300203	聚光科技	600	9,138.00	0.01
334	000544	中原环保	1,000	8,730.00	0.01
335	300335	迪森股份	1,800	8,676.00	0.01
336	002004	华邦健康	1,900	8,588.00	0.01
337	688516	奥特维	43	1,862.33	0.00

338	603285	键邦股份	72	1,627.92	0.00
339	688636	智明达	26	730.60	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	10,349,529.00	100.33
2	300750	宁德时代	6,810,458.86	66.02
3	601318	中国平安	6,134,953.00	59.47
4	600036	招商银行	5,259,606.00	50.98
5	601899	紫金矿业	5,185,608.00	50.27
6	600900	长江电力	4,939,954.00	47.89
7	000333	美的集团	4,151,345.00	40.24
8	000725	京东方A	3,722,112.00	36.08
9	601166	兴业银行	3,522,333.00	34.14
10	601919	中远海控	3,340,509.00	32.38
11	601398	工商银行	3,280,604.00	31.80
12	000651	格力电器	3,163,296.00	30.66
13	601601	中国太保	3,110,166.00	30.15
14	601328	交通银行	3,087,545.00	29.93
15	000338	潍柴动力	3,070,192.00	29.76
16	601600	中国铝业	2,923,767.00	28.34
17	600030	中信证券	2,723,827.00	26.40
18	600309	万华化学	2,688,627.00	26.06
19	603993	洛阳钼业	2,678,102.00	25.96
20	002475	立讯精密	2,662,074.00	25.81
21	601088	中国神华	2,658,186.60	25.77
22	601169	北京银行	2,615,692.00	25.36

23	600050	中国联通	2,515,736.00	24.39
24	600019	宝钢股份	2,513,557.00	24.37
25	600690	海尔智家	2,483,009.00	24.07
26	600887	伊利股份	2,474,065.00	23.98
27	600919	江苏银行	2,457,133.00	23.82
28	600066	宇通客车	2,437,107.00	23.62
29	000157	中联重科	2,419,282.00	23.45
30	601225	陕西煤业	2,413,005.00	23.39
31	601985	中国核电	2,399,987.00	23.26
32	002714	牧原股份	2,373,928.00	23.01
33	600276	恒瑞医药	2,369,011.00	22.96
34	601988	中国银行	2,356,613.00	22.84
35	600233	圆通速递	2,323,282.00	22.52
36	601857	中国石油	2,268,735.00	21.99
37	600406	国电南瑞	2,243,600.00	21.75
38	600362	江西铜业	2,240,236.00	21.72
39	601766	中国中车	2,235,966.00	21.67
40	601728	中国电信	2,234,481.00	21.66
41	601288	农业银行	2,230,428.00	21.62
42	002916	深南电路	2,225,488.00	21.57
43	600028	中国石化	2,212,507.00	21.45
44	002601	龙佰集团	2,205,519.00	21.38
45	600023	浙能电力	2,191,133.00	21.24
46	002410	广联达	2,179,453.80	21.13
47	002001	新和成	2,122,940.20	20.58
48	601872	招商轮船	2,081,347.36	20.18
49	601816	京沪高铁	2,075,638.00	20.12
50	601989	中国重工	2,069,115.00	20.06
51	600926	杭州银行	2,062,427.00	19.99
52	601808	中海油服	2,052,673.67	19.90
53	002252	上海莱士	2,032,631.00	19.70

54	600219	南山铝业	2,030,873.00	19.69
55	600489	中金黄金	2,022,224.00	19.60
56	000166	申万宏源	2,017,660.00	19.56
57	600588	用友网络	1,994,568.60	19.33
58	601336	新华保险	1,991,357.00	19.30
59	600875	东方电气	1,963,176.00	19.03
60	003816	中国广核	1,948,825.00	18.89
61	600000	浦发银行	1,944,138.00	18.85
62	002648	卫星化学	1,924,160.00	18.65
63	600795	国电电力	1,916,602.00	18.58
64	600989	宝丰能源	1,905,081.36	18.47
65	600901	江苏金租	1,900,228.20	18.42
66	600183	生益科技	1,899,880.00	18.42
67	000100	TCL科技	1,882,175.60	18.25
68	000786	北新建材	1,859,842.00	18.03
69	688981	中芯国际	1,858,156.61	18.01
70	300760	迈瑞医疗	1,855,950.00	17.99
71	601229	上海银行	1,816,009.00	17.60
72	601668	中国建筑	1,809,227.00	17.54
73	002241	歌尔股份	1,785,581.00	17.31
74	000876	新希望	1,773,898.00	17.20
75	601898	中煤能源	1,764,847.00	17.11
76	000708	中信特钢	1,724,009.00	16.71
77	600018	上港集团	1,707,179.00	16.55
78	300498	温氏股份	1,701,047.00	16.49
79	002311	海大集团	1,699,190.00	16.47
80	002938	鹏鼎控股	1,693,387.00	16.42
81	300142	沃森生物	1,686,467.00	16.35
82	688187	时代电气	1,677,311.53	16.26
83	601390	中国中铁	1,672,652.00	16.21
84	000975	山金国际	1,672,569.00	16.21

85	000858	五粮液	1,661,482.00	16.11
86	601319	中国人保	1,643,651.00	15.93
87	000425	徐工机械	1,620,006.00	15.70
88	300122	智飞生物	1,612,149.00	15.63
89	600398	海澜之家	1,606,982.00	15.58
90	601818	光大银行	1,603,448.00	15.54
91	601006	大秦铁路	1,584,358.00	15.36
92	600025	华能水电	1,577,231.00	15.29
93	601838	成都银行	1,574,469.00	15.26
94	002236	大华股份	1,560,800.00	15.13
95	600660	福耀玻璃	1,548,533.00	15.01
96	601939	建设银行	1,544,223.00	14.97
97	300433	蓝思科技	1,533,983.00	14.87
98	000039	中集集团	1,533,169.00	14.86
99	600741	华域汽车	1,528,857.00	14.82
100	603501	韦尔股份	1,524,020.00	14.77
101	600031	三一重工	1,519,170.00	14.73
102	601117	中国化学	1,506,399.00	14.60
103	000568	泸州老窖	1,493,747.51	14.48
104	300059	东方财富	1,485,753.00	14.40
105	600320	振华重工	1,481,242.00	14.36
106	600941	中国移动	1,478,047.00	14.33
107	300759	康龙化成	1,464,633.00	14.20
108	600160	巨化股份	1,455,490.00	14.11
109	601628	中国人寿	1,451,601.00	14.07
110	601916	浙商银行	1,443,969.00	14.00
111	600886	国投电力	1,442,411.00	13.98
112	300628	亿联网络	1,432,271.00	13.88
113	600161	天坛生物	1,419,112.00	13.76
114	601058	赛轮轮胎	1,407,951.00	13.65
115	603195	公牛集团	1,402,480.00	13.60

116	600958	东方证券	1,385,666.00	13.43
117	002821	凯莱英	1,369,578.00	13.28
118	002180	纳思达	1,354,862.00	13.13
119	601699	潞安环能	1,354,172.00	13.13
120	601717	郑煤机	1,351,944.00	13.11
121	600332	白云山	1,347,643.00	13.06
122	601877	正泰电器	1,340,984.00	13.00
123	603259	药明康德	1,335,154.00	12.94
124	688009	中国通号	1,334,257.33	12.93
125	000800	一汽解放	1,331,716.00	12.91
126	600968	海油发展	1,322,561.00	12.82
127	002078	太阳纸业	1,321,602.00	12.81
128	601865	福莱特	1,319,952.00	12.80
129	002594	比亚迪	1,319,273.00	12.79
130	600426	华鲁恒升	1,318,008.00	12.78
131	300308	中际旭创	1,313,996.00	12.74
132	600745	闻泰科技	1,307,544.00	12.67
133	002128	电投能源	1,306,565.00	12.67
134	601009	南京银行	1,300,540.00	12.61
135	603317	天味食品	1,299,713.00	12.60
136	300751	迈为股份	1,296,746.80	12.57
137	600998	九州通	1,296,734.00	12.57
138	002273	水晶光电	1,293,904.00	12.54
139	600196	复星医药	1,291,084.00	12.52
140	603379	三美股份	1,288,573.00	12.49
141	601138	工业富联	1,282,460.00	12.43
142	688363	华熙生物	1,281,303.38	12.42
143	002841	视源股份	1,278,317.00	12.39
144	600999	招商证券	1,274,679.00	12.36
145	000807	云铝股份	1,264,546.00	12.26
146	601186	中国铁建	1,262,995.00	12.24



147	600015	华夏银行	1,258,954.00	12.20
148	688041	海光信息	1,250,603.74	12.12
149	601991	大唐发电	1,230,671.00	11.93
150	300124	汇川技术	1,225,760.00	11.88
151	002773	康弘药业	1,220,871.00	11.83
152	600547	山东黄金	1,216,694.00	11.79
153	000933	神火股份	1,190,688.00	11.54
154	002019	亿帆医药	1,178,974.00	11.43
155	000683	远兴能源	1,177,629.00	11.42
156	000895	双汇发展	1,170,226.00	11.34
157	300253	卫宁健康	1,169,431.00	11.34
158	600282	南钢股份	1,164,573.00	11.29
159	600938	中国海油	1,160,887.00	11.25
160	603185	弘元绿能	1,157,130.95	11.22
161	688082	盛美上海	1,152,770.54	11.17
162	600150	中国船舶	1,149,829.00	11.15
163	600060	海信视像	1,146,602.00	11.11
164	002408	齐翔腾达	1,134,737.00	11.00
165	000703	恒逸石化	1,131,913.00	10.97
166	601128	常熟银行	1,125,395.00	10.91
167	600104	上汽集团	1,124,071.00	10.90
168	603712	七一二	1,122,082.00	10.88
169	002027	分众传媒	1,106,311.00	10.72
170	300408	三环集团	1,104,887.00	10.71
171	601666	平煤股份	1,100,492.00	10.67
172	600971	恒源煤电	1,099,129.00	10.65
173	000528	柳工	1,092,879.00	10.59
174	600498	烽火通信	1,086,638.00	10.53
175	000768	中航西飞	1,082,711.00	10.50
176	601211	国泰君安	1,073,627.00	10.41
177	601598	中国外运	1,066,147.00	10.33

178	600927	永安期货	1,065,407.00	10.33
179	603225	新凤鸣	1,064,429.00	10.32
180	002532	天山铝业	1,059,777.00	10.27
181	002602	ST华通	1,058,124.00	10.26
182	002745	木林森	1,052,499.00	10.20
183	002271	东方雨虹	1,046,013.00	10.14
184	600438	通威股份	1,043,622.00	10.12
185	002139	拓邦股份	1,041,615.00	10.10
186	000423	东阿阿胶	1,040,799.00	10.09
187	002422	科伦药业	1,037,633.00	10.06
188	000538	云南白药	1,033,494.00	10.02
189	688007	光峰科技	1,028,791.89	9.97
190	601333	广深铁路	1,027,356.00	9.96
191	300058	蓝色光标	1,025,752.00	9.94
192	000776	广发证券	1,018,687.00	9.87
193	002153	石基信息	1,016,674.00	9.86
194	300296	利亚德	1,013,369.00	9.82
195	001965	招商公路	1,009,459.00	9.79
196	603568	伟明环保	1,009,391.00	9.78
197	688111	金山办公	1,006,424.72	9.76
198	601658	邮储银行	1,002,834.00	9.72
199	300274	阳光电源	998,743.00	9.68
200	600061	国投资本	996,059.00	9.66
201	601168	西部矿业	994,241.00	9.64
202	601108	财通证券	993,824.00	9.63
203	000050	深天马 A	992,214.00	9.62
204	688510	航亚科技	987,127.86	9.57
205	300919	中伟股份	979,944.00	9.50
206	002385	大北农	979,755.00	9.50
207	600737	中粮糖业	976,830.00	9.47
208	000661	长春高新	976,296.00	9.46

209	603986	兆易创新	968,631.00	9.39
210	601688	华泰证券	967,076.00	9.37
211	000400	许继电气	966,676.00	9.37
212	688728	格科微	965,167.94	9.36
213	600582	天地科技	964,527.00	9.35
214	600988	赤峰黄金	963,327.00	9.34
215	000596	古井贡酒	960,705.00	9.31
216	601231	环旭电子	960,624.00	9.31
217	000887	中鼎股份	960,529.00	9.31
218	601615	明阳智能	959,552.00	9.30
219	603558	健盛集团	957,467.00	9.28
220	002179	中航光电	950,099.00	9.21
221	000921	海信家电	949,196.00	9.20
222	300601	康泰生物	943,454.00	9.15
223	600096	云天化	940,418.00	9.12
224	603866	桃李面包	939,139.00	9.10
225	600176	中国巨石	938,460.00	9.10
226	600011	华能国际	936,529.00	9.08
227	601607	上海医药	936,163.00	9.07
228	000617	中油资本	931,926.00	9.03
229	600707	彩虹股份	931,199.00	9.03
230	600177	雅戈尔	930,646.52	9.02
231	001203	大中矿业	930,471.00	9.02
232	000401	冀东水泥	926,687.00	8.98
233	600480	凌云股份	925,868.00	8.98
234	601012	隆基绿能	923,196.00	8.95
235	600295	鄂尔多斯	919,969.00	8.92
236	688561	奇安信	915,068.48	8.87
237	000811	冰轮环境	911,935.00	8.84
238	300413	芒果超媒	911,219.00	8.83
239	600143	金发科技	910,599.00	8.83

240	000883	湖北能源	909,798.00	8.82
241	300054	鼎龙股份	906,757.00	8.79
242	600718	东软集团	905,842.00	8.78
243	002925	盈趣科技	904,836.00	8.77
244	601298	青岛港	902,612.00	8.75
245	600482	中国动力	901,893.00	8.74
246	688220	翱捷科技	898,696.89	8.71
247	002563	森马服饰	894,322.00	8.67
248	300001	特锐德	889,543.00	8.62
249	601233	桐昆股份	886,901.00	8.60
250	002948	青岛银行	884,204.00	8.57
251	600095	湘财股份	884,070.00	8.57
252	000729	燕京啤酒	877,972.00	8.51
253	603296	华勤技术	876,569.00	8.50
254	000598	兴蓉环境	869,021.00	8.42
255	601995	中金公司	862,805.00	8.36
256	600012	皖通高速	858,880.00	8.33
257	600416	湘电股份	857,312.00	8.31
258	002867	周大生	856,154.00	8.30
259	603056	德邦股份	853,746.00	8.28
260	002352	顺丰控股	853,502.49	8.27
261	601828	美凯龙	853,223.00	8.27
262	002073	软控股份	851,516.00	8.25
263	002064	华峰化学	846,272.00	8.20
264	600529	山东药玻	844,741.00	8.19
265	603565	中谷物流	843,399.00	8.18
266	600809	山西汾酒	843,079.00	8.17
267	688276	百克生物	840,803.38	8.15
268	300595	欧普康视	835,467.00	8.10
269	603939	益丰药房	832,695.08	8.07
270	002498	汉缆股份	827,591.00	8.02

271	002739	万达电影	827,184.00	8.02
272	600956	新天绿能	824,530.00	7.99
273	002961	瑞达期货	820,202.00	7.95
274	002415	海康威视	820,179.00	7.95
275	000963	华东医药	816,239.00	7.91
276	002439	启明星辰	815,389.00	7.90
277	688520	神州细胞	815,001.69	7.90
278	600559	老白干酒	813,150.00	7.88
279	000830	鲁西化工	811,706.00	7.87
280	600739	辽宁成大	803,486.00	7.79
281	601567	三星医疗	799,668.00	7.75
282	300748	金力永磁	799,448.00	7.75
283	000516	国际医学	798,831.00	7.74
284	601878	浙商证券	798,405.00	7.74
285	600346	恒力石化	798,094.00	7.74
286	600566	济川药业	791,338.00	7.67
287	600674	川投能源	788,042.00	7.64
288	688776	国光电气	787,417.12	7.63
289	603556	海兴电力	787,101.00	7.63
290	601236	红塔证券	786,707.00	7.63
291	000997	新大陆	783,780.00	7.60
292	601669	中国电建	782,450.00	7.58
293	600688	上海石化	776,884.00	7.53
294	603368	柳药集团	776,520.00	7.53
295	002706	良信股份	774,864.00	7.51
296	600123	兰花科创	773,408.00	7.50
297	600820	隧道股份	772,591.00	7.49
298	603899	晨光股份	766,308.00	7.43
299	600188	兖矿能源	762,716.50	7.39
300	000552	甘肃能化	762,386.00	7.39
301	601618	中国中冶	762,251.00	7.39

302	600098	广州发展	760,986.00	7.38
303	000627	天茂集团	759,486.00	7.36
304	002705	新宝股份	758,209.00	7.35
305	600350	山东高速	757,220.00	7.34
306	688536	思瑞浦	756,456.55	7.33
307	688567	孚能科技	755,554.58	7.32
308	002597	金禾实业	755,049.00	7.32
309	603517	绝味食品	754,509.42	7.31
310	000728	国元证券	752,281.00	7.29
311	600699	均胜电子	750,671.00	7.28
312	002460	赣锋锂业	750,046.00	7.27
313	000066	中国长城	749,979.00	7.27
314	002539	云图控股	749,575.00	7.27
315	300979	华利集团	748,905.00	7.26
316	600808	马钢股份	746,234.00	7.23
317	688002	睿创微纳	742,344.10	7.20
318	601800	中国交建	740,238.00	7.18
319	002152	广电运通	739,780.00	7.17
320	002044	美年健康	739,131.00	7.16
321	002237	恒邦股份	737,489.00	7.15
322	002100	天康生物	735,431.00	7.13
323	300676	华大基因	734,832.00	7.12
324	002123	梦网科技	730,578.00	7.08
325	000408	藏格矿业	729,309.00	7.07
326	688223	晶科能源	727,512.65	7.05
327	600339	中油工程	724,660.00	7.02
328	600583	海油工程	724,485.00	7.02
329	601577	长沙银行	723,160.00	7.01
330	002384	东山精密	723,032.00	7.01
331	600761	安徽合力	722,045.00	7.00
332	002444	巨星科技	721,920.00	7.00

333	600916	中国黄金	720,851.00	6.99
334	002003	伟星股份	718,394.00	6.96
335	000937	冀中能源	717,668.00	6.96
336	603883	老百姓	717,526.00	6.96
337	002683	广东宏大	716,084.00	6.94
338	600027	华电国际	711,349.00	6.90
339	600673	东阳光	709,431.00	6.88
340	601868	中国能建	707,636.00	6.86
341	002558	巨人网络	703,342.00	6.82
342	603658	安图生物	703,223.00	6.82
343	300383	光环新网	703,160.00	6.82
344	688012	中微公司	702,378.87	6.81
345	003031	中瓷电子	698,687.00	6.77
346	600039	四川路桥	696,264.00	6.75
347	600760	中航沈飞	694,233.00	6.73
348	000630	铜陵有色	691,930.00	6.71
349	600732	爱旭股份	691,368.00	6.70
350	688521	芯原股份	689,866.59	6.69
351	600704	物产中大	687,801.00	6.67
352	000636	风华高科	687,494.00	6.66
353	603979	金诚信	687,223.00	6.66
354	002402	和而泰	686,678.00	6.66
355	002472	双环传动	680,469.00	6.60
356	002223	鱼跃医疗	679,079.00	6.58
357	603355	莱克电气	676,741.00	6.56
358	600141	兴发集团	675,738.00	6.55
359	601000	唐山港	675,536.00	6.55
360	600497	驰宏锌锗	671,529.00	6.51
361	000987	越秀资本	670,806.00	6.50
362	603026	石大胜华	668,002.00	6.48
363	600312	平高电气	666,493.00	6.46

364	000600	建投能源	664,330.00	6.44
365	601118	海南橡胶	663,971.00	6.44
366	601636	旗滨集团	663,919.00	6.44
367	002270	华明装备	659,739.00	6.40
368	300285	国瓷材料	657,811.00	6.38
369	688180	君实生物	657,645.17	6.38
370	600873	梅花生物	657,305.00	6.37
371	600755	厦门国贸	657,138.00	6.37
372	002791	坚朗五金	656,185.00	6.36
373	601608	中信重工	655,773.00	6.36
374	600057	厦门象屿	655,591.00	6.36
375	300496	中科创达	654,735.00	6.35
376	688389	普门科技	653,450.63	6.33
377	600392	盛和资源	653,146.00	6.33
378	000878	云南铜业	652,811.00	6.33
379	300558	贝达药业	652,075.00	6.32
380	300212	易华录	652,058.00	6.32
381	002020	京新药业	650,245.00	6.30
382	300502	新易盛	648,658.00	6.29
383	601881	中国银河	647,028.00	6.27
384	002493	荣盛石化	644,834.00	6.25
385	002595	豪迈科技	643,106.00	6.23
386	605333	沪光股份	641,614.00	6.22
387	600377	宁沪高速	640,763.00	6.21
388	000960	锡业股份	640,236.00	6.21
389	002249	大洋电机	639,064.96	6.19
390	600618	氯碱化工	639,020.00	6.19
391	603737	三棵树	638,492.00	6.19
392	600500	中化国际	637,160.00	6.18
393	600623	华谊集团	636,821.00	6.17
394	002436	兴森科技	636,809.00	6.17



395	000650	仁和药业	636,488.00	6.17
396	300454	深信服	635,784.00	6.16
397	002120	韵达股份	635,106.00	6.16
398	601139	深圳燃气	633,409.72	6.14
399	300450	先导智能	629,375.00	6.10
400	002430	杭氧股份	628,674.00	6.09
401	600750	江中药业	628,344.52	6.09
402	002736	国信证券	625,551.00	6.06
403	600499	科达制造	625,327.00	6.06
404	300442	润泽科技	624,603.00	6.05
405	603915	国茂股份	624,572.00	6.05
406	000969	安泰科技	621,672.00	6.03
407	000860	顺鑫农业	621,661.00	6.03
408	600549	厦门钨业	621,114.00	6.02
409	600420	国药现代	618,084.00	5.99
410	688185	康希诺	617,138.76	5.98
411	002387	维信诺	615,747.00	5.97
412	605499	东鹏饮料	615,043.50	5.96
413	600089	特变电工	614,508.00	5.96
414	300679	电连技术	614,451.00	5.96
415	000999	华润三九	614,052.00	5.95
416	600837	海通证券	613,366.00	5.95
417	688599	天合光能	612,917.16	5.94
418	000938	紫光股份	611,962.00	5.93
419	603529	爱玛科技	611,627.00	5.93
420	600578	京能电力	611,428.00	5.93
421	600985	淮北矿业	610,240.00	5.92
422	603833	欧派家居	610,183.00	5.91
423	601022	宁波远洋	605,160.00	5.87
424	000032	深桑达 A	604,888.00	5.86
425	300226	上海钢联	601,873.00	5.83

426	688586	江航装备	601,860.12	5.83
427	002484	江海股份	600,214.00	5.82
428	600511	国药股份	597,764.00	5.79
429	300782	卓胜微	597,556.00	5.79
430	601633	长城汽车	594,562.00	5.76
431	600521	华海药业	594,439.82	5.76
432	688234	天岳先进	592,367.96	5.74
433	601555	东吴证券	592,087.00	5.74
434	600765	中航重机	591,523.00	5.73
435	603728	鸣志电器	591,144.00	5.73
436	301015	百洋医药	590,037.00	5.72
437	600575	淮河能源	589,452.00	5.71
438	600483	福能股份	587,534.00	5.70
439	600933	爱柯迪	585,551.00	5.68
440	600073	光明肉业	585,473.00	5.68
441	000977	浪潮信息	583,120.00	5.65
442	601677	明泰铝业	582,834.00	5.65
443	601958	金钼股份	581,234.00	5.63
444	600801	华新水泥	580,715.00	5.63
445	300390	天华新能	579,655.00	5.62
446	002643	万润股份	579,065.00	5.61
447	002368	太极股份	578,579.00	5.61
448	600100	同方股份	576,718.00	5.59
449	600048	保利发展	570,329.00	5.53
450	600399	抚顺特钢	569,725.00	5.52
451	002653	海思科	569,722.00	5.52
452	600153	建发股份	567,584.00	5.50
453	603260	合盛硅业	565,966.00	5.49
454	603659	璞泰来	565,410.00	5.48
455	600197	伊力特	563,879.00	5.47
456	002240	盛新锂能	563,768.00	5.46

457	002371	北方华创	561,568.00	5.44
458	600893	航发动力	561,295.00	5.44
459	002608	江苏国信	561,123.00	5.44
460	688126	沪硅产业	560,171.07	5.43
461	601966	玲珑轮胎	558,015.00	5.41
462	002567	唐人神	556,900.00	5.40
463	001872	招商港口	555,839.00	5.39
464	002063	远光软件	554,706.00	5.38
465	600995	南网储能	553,808.00	5.37
466	002865	钧达股份	549,852.00	5.33
467	605196	华通线缆	548,450.00	5.32
468	603103	横店影视	548,405.00	5.32
469	600029	南方航空	548,298.00	5.32
470	601990	南京证券	545,833.00	5.29
471	603288	海天味业	545,639.00	5.29
472	000930	中粮科技	545,621.00	5.29
473	002465	海格通信	544,272.00	5.28
474	600380	健康元	543,185.00	5.27
475	000563	陕国投 A	542,547.00	5.26
476	002056	横店东磁	541,427.00	5.25
477	000739	普洛药业	541,075.00	5.25
478	300674	宇信科技	540,007.00	5.23
479	002434	万里扬	539,022.00	5.23
480	603583	捷昌驱动	538,405.00	5.22
481	603699	纽威股份	537,885.00	5.21
482	601901	方正证券	537,242.00	5.21
483	600038	中直股份	536,578.00	5.20
484	300003	乐普医疗	536,321.00	5.20
485	603589	口子窖	534,156.00	5.18
486	600970	中材国际	531,934.00	5.16
487	601156	东航物流	529,466.00	5.13

488	002901	大博医疗	528,236.00	5.12
489	002399	海普瑞	527,474.00	5.11
490	002533	金杯电工	527,142.00	5.11
491	688772	珠海冠宇	526,404.43	5.10
492	003022	联泓新科	526,371.00	5.10
493	000983	山西焦煤	525,850.00	5.10
494	300747	锐科激光	524,948.00	5.09
495	300687	赛意信息	522,963.00	5.07
496	600879	航天电子	522,541.00	5.07
497	600323	瀚蓝环境	522,114.00	5.06
498	600348	华阳股份	521,096.00	5.05
499	688472	阿特斯	520,597.34	5.05
500	601077	渝农商行	519,984.00	5.04
501	002782	可立克	519,483.00	5.04
502	601038	一拖股份	517,430.00	5.02
503	603348	文灿股份	517,187.00	5.01
504	000898	鞍钢股份	516,633.00	5.01
505	002203	海亮股份	513,816.00	4.98
506	300244	迪安诊断	513,237.00	4.98
507	600884	杉杉股份	512,578.00	4.97
508	000723	美锦能源	512,449.00	4.97
509	601179	中国西电	512,355.00	4.97
510	301165	锐捷网络	511,422.00	4.96
511	300009	安科生物	509,672.00	4.94
512	000810	创维数字	508,917.00	4.93
513	601369	陕鼓动力	508,149.00	4.93
514	601998	中信银行	507,475.00	4.92
515	300529	健帆生物	507,295.00	4.92
516	601019	山东出版	507,151.00	4.92
517	601866	中远海发	506,778.00	4.91
518	600918	中泰证券	504,687.00	4.89

519	688366	昊海生科	504,554.83	4.89
520	000001	平安银行	504,054.00	4.89
521	600864	哈投股份	503,840.00	4.88
522	002441	众业达	503,082.00	4.88
523	300406	九强生物	502,563.09	4.87
524	603505	金石资源	502,371.00	4.87
525	000016	深康佳 A	502,360.00	4.87
526	600863	内蒙华电	499,754.00	4.84
527	688630	芯碁微装	499,669.73	4.84
528	002906	华阳集团	497,578.00	4.82
529	603236	移远通信	496,258.00	4.81
530	603612	索通发展	496,164.00	4.81
531	000553	安道麦A	495,605.00	4.80
532	600062	华润双鹤	494,052.00	4.79
533	300428	立中集团	490,984.00	4.76
534	300088	长信科技	490,242.00	4.75
535	000031	大悦城	489,787.00	4.75
536	600585	海螺水泥	489,087.00	4.74
537	300783	三只松鼠	488,997.00	4.74
538	002807	江阴银行	486,851.00	4.72
539	601888	中国中免	486,072.00	4.71
540	002154	报喜鸟	483,957.00	4.69
541	600562	国睿科技	483,834.00	4.69
542	002993	奥海科技	483,774.00	4.69
543	603305	旭升集团	482,855.20	4.68
544	603882	金域医学	482,328.00	4.68
545	600598	北大荒	480,478.00	4.66
546	600075	新疆天业	479,294.00	4.65
547	688639	华恒生物	478,543.56	4.64
548	603337	杰克股份	478,526.00	4.64
549	002226	江南化工	477,207.00	4.63

550	605358	立昂微	475,803.00	4.61
551	300065	海兰信	475,539.00	4.61
552	603806	福斯特	475,196.00	4.61
553	300257	开山股份	474,869.00	4.60
554	603919	金徽酒	474,650.00	4.60
555	002335	科华数据	472,418.00	4.58
556	600201	生物股份	471,391.00	4.57
557	603087	甘李药业	470,313.00	4.56
558	002396	星网锐捷	470,277.00	4.56
559	300702	天宇股份	469,811.00	4.55
560	688065	凯赛生物	469,786.58	4.55
561	002065	东华软件	469,473.00	4.55
562	300677	英科医疗	467,828.00	4.53
563	300015	爱尔眼科	467,268.00	4.53
564	000967	盈峰环境	467,157.00	4.53
565	000848	承德露露	465,138.00	4.51
566	002544	普天科技	464,792.00	4.51
567	688188	柏楚电子	464,577.44	4.50
568	600460	士兰微	463,928.00	4.50
569	002507	涪陵榨菜	463,370.00	4.49
570	002429	兆驰股份	463,254.00	4.49
571	002079	苏州固锝	462,676.00	4.49
572	002322	理工能科	462,030.88	4.48
573	002007	华兰生物	461,505.00	4.47
574	002603	以岭药业	460,845.00	4.47
575	600827	百联股份	459,072.00	4.45
576	603279	景津装备	458,943.00	4.45
577	000027	深圳能源	458,075.00	4.44
578	600487	亨通光电	457,756.00	4.44
579	002635	安洁科技	457,694.00	4.44
580	600642	申能股份	457,684.00	4.44

581	001914	招商积余	457,331.00	4.43
582	300047	天源迪科	455,699.00	4.42
583	600352	浙江龙盛	454,174.00	4.40
584	002511	中顺洁柔	453,915.00	4.40
585	688029	南微医学	453,768.79	4.40
586	001286	陕西能源	451,953.00	4.38
587	603786	科博达	451,371.96	4.38
588	600032	浙江新能	450,931.00	4.37
589	000932	华菱钢铁	449,424.00	4.36
590	601377	兴业证券	448,353.00	4.35
591	688239	航宇科技	447,492.82	4.34
592	600577	精达股份	447,039.00	4.33
593	601918	新集能源	445,031.00	4.31
594	600782	新钢股份	442,929.00	4.29
595	000301	东方盛虹	442,356.00	4.29
596	600329	达仁堂	441,379.00	4.28
597	603228	景旺电子	439,962.00	4.26
598	300232	洲明科技	439,736.00	4.26
599	002572	索菲亚	439,728.00	4.26
600	603588	高能环境	438,624.44	4.25
601	600570	恒生电子	438,394.00	4.25
602	002697	红旗连锁	437,832.00	4.24
603	600705	中航产融	437,085.00	4.24
604	300776	帝尔激光	436,382.00	4.23
605	601061	中信金属	436,373.00	4.23
606	002221	东华能源	435,363.00	4.22
607	688819	天能股份	435,090.48	4.22
608	600516	方大炭素	434,579.00	4.21
609	002292	奥飞娱乐	433,903.00	4.21
610	002025	航天电器	433,461.00	4.20
611	688778	厦钨新能	433,225.11	4.20

612	002353	杰瑞股份	432,601.00	4.19
613	688208	道通科技	432,400.34	4.19
614	600797	浙大网新	432,087.00	4.19
615	002600	领益智造	432,051.00	4.19
616	000998	隆平高科	429,146.00	4.16
617	600977	中国电影	428,033.00	4.15
618	600703	三安光电	427,461.00	4.14
619	603297	永新光学	426,045.00	4.13
620	300123	亚光科技	425,975.00	4.13
621	600436	片仔癀	425,854.00	4.13
622	601126	四方股份	425,259.00	4.12
623	002550	千红制药	424,933.00	4.12
624	002531	天顺风能	424,345.00	4.11
625	002142	宁波银行	424,272.00	4.11
626	300026	红日药业	423,773.00	4.11
627	600459	贵研铂业	423,238.00	4.10
628	600285	羚锐制药	421,738.00	4.09
629	601101	昊华能源	420,867.00	4.08
630	000783	长江证券	420,656.00	4.08
631	000738	航发控制	420,484.00	4.08
632	603606	东方电缆	420,379.00	4.08
633	000758	中色股份	418,954.00	4.06
634	600552	凯盛科技	418,586.00	4.06
635	002568	百润股份	417,999.00	4.05
636	002920	德赛西威	417,426.00	4.05
637	688107	安路科技	414,383.82	4.02
638	688516	奥特维	413,327.35	4.01
639	603039	泛微网络	413,173.00	4.01
640	002459	晶澳科技	412,457.00	4.00
641	002978	安宁股份	412,337.00	4.00
642	601163	三角轮胎	412,163.00	4.00



643	002074	国轩高科	411,089.00	3.98
644	300207	欣旺达	410,405.00	3.98
645	600612	老凤祥	410,338.00	3.98
646	688150	莱特光电	410,175.43	3.98
647	601066	中信建投	406,869.00	3.94
648	603160	汇顶科技	404,849.00	3.92
649	002984	森麒麟	403,325.00	3.91
650	300803	指南针	401,200.00	3.89
651	601001	晋控煤业	400,964.00	3.89
652	002831	裕同科技	398,713.80	3.87
653	000539	粤电力A	398,539.00	3.86
654	002709	天赐材料	397,989.00	3.86
655	688006	杭可科技	397,443.90	3.85
656	601969	海南矿业	396,104.00	3.84
657	603218	日月股份	395,277.00	3.83
658	603871	嘉友国际	395,124.00	3.83
659	300068	南都电源	394,892.00	3.83
660	600299	安迪苏	394,490.00	3.82
661	002050	三花智控	394,277.00	3.82
662	600378	昊华科技	392,683.00	3.81
663	002390	信邦制药	392,292.00	3.80
664	002607	中公教育	391,780.00	3.80
665	002261	拓维信息	391,704.00	3.80
666	000060	中金岭南	391,695.00	3.80
667	600126	杭钢股份	391,614.00	3.80
668	000069	华侨城A	390,145.00	3.78
669	000970	中科三环	390,045.00	3.78
670	002291	遥望科技	389,991.00	3.78
671	002497	雅化集团	389,222.00	3.77
672	600155	华创云信	388,508.00	3.77
673	300377	赢时胜	388,169.00	3.76

674	000709	河钢股份	387,962.00	3.76
675	002276	万马股份	383,258.00	3.72
676	002832	比音勒芬	382,937.00	3.71
677	688798	艾为电子	381,949.85	3.70
678	600810	神马股份	381,573.00	3.70
679	603100	川仪股份	381,553.00	3.70
680	300850	新强联	381,256.00	3.70
681	000415	渤海租赁	380,778.00	3.69
682	600606	绿地控股	380,056.00	3.68
683	600993	马应龙	379,116.00	3.68
684	300033	同花顺	378,324.00	3.67
685	002035	华帝股份	377,647.00	3.66
686	600602	云赛智联	377,613.00	3.66
687	002068	黑猫股份	377,401.00	3.66
688	600391	航发科技	375,545.00	3.64
689	605296	神农集团	374,832.00	3.63
690	601921	浙版传媒	373,432.00	3.62
691	002192	融捷股份	372,966.00	3.62
692	002446	盛路通信	371,443.00	3.60
693	600486	扬农化工	370,094.00	3.59
694	300223	北京君正	368,345.00	3.57
695	002649	博彦科技	367,593.00	3.56
696	002839	张家港行	366,806.00	3.56
697	603439	贵州三力	365,851.00	3.55
698	002487	大金重工	365,451.00	3.54
699	603456	九洲药业	365,241.00	3.54
700	002518	科士达	365,236.00	3.54
701	002202	金风科技	364,809.00	3.54
702	600595	中孚实业	364,418.00	3.53
703	000869	张裕A	363,747.00	3.53
704	002453	华软科技	362,750.00	3.52

705	603033	三维股份	362,639.00	3.52
706	603338	浙江鼎力	361,834.00	3.51
707	600315	上海家化	361,378.00	3.50
708	002008	大族激光	361,358.00	3.50
709	601727	上海电气	360,813.00	3.50
710	605589	圣泉集团	360,466.00	3.49
711	300203	聚光科技	360,418.00	3.49
712	000551	创元科技	360,323.00	3.49
713	601198	东兴证券	359,348.00	3.48
714	300140	节能环境	358,812.00	3.48
715	002340	格林美	358,077.00	3.47
716	688690	纳微科技	356,830.83	3.46
717	000529	广弘控股	356,286.00	3.45
718	002028	思源电气	355,198.00	3.44
719	601928	凤凰传媒	355,183.00	3.44
720	002318	久立特材	354,932.00	3.44
721	603678	火炬电子	354,336.00	3.43
722	600963	岳阳林纸	353,067.00	3.42
723	600085	同仁堂	352,598.00	3.42
724	002500	山西证券	352,490.00	3.42
725	002048	宁波华翔	351,104.00	3.40
726	600710	苏美达	349,885.00	3.39
727	300134	大富科技	348,874.00	3.38
728	688169	石头科技	348,180.34	3.38
729	000923	河钢资源	347,348.00	3.37
730	300323	华灿光电	347,159.00	3.37
731	002541	鸿路钢构	346,611.00	3.36
732	300866	安克创新	346,545.00	3.36
733	600882	妙可蓝多	346,142.00	3.36
734	000958	电投产融	345,971.00	3.35
735	600316	洪都航空	344,326.00	3.34

736	603816	顾家家居	344,090.00	3.34
737	603093	南华期货	344,083.00	3.34
738	600037	歌华有线	343,338.00	3.33
739	000785	居然智家	342,676.00	3.32
740	002315	焦点科技	340,022.00	3.30
741	002212	天融信	339,841.00	3.29
742	002726	龙大美食	338,827.00	3.28
743	601886	江河集团	336,867.00	3.27
744	603171	税友股份	336,649.00	3.26
745	600997	开滦股份	336,526.00	3.26
746	600273	嘉化能源	336,327.00	3.26
747	603233	大参林	336,156.00	3.26
748	301171	易点天下	334,654.00	3.24
749	000750	国海证券	333,274.00	3.23
750	600115	中国东航	332,737.00	3.23
751	002416	爱施德	332,587.00	3.22
752	002204	大连重工	332,403.00	3.22
753	600812	华北制药	332,147.00	3.22
754	002155	湖南黄金	330,734.00	3.21
755	002011	盾安环境	330,060.00	3.20
756	300482	万孚生物	329,861.00	3.20
757	300037	新宙邦	329,768.00	3.20
758	600967	内蒙一机	329,451.00	3.19
759	601311	骆驼股份	329,242.00	3.19
760	600859	王府井	328,754.00	3.19
761	600481	双良节能	326,889.00	3.17
762	300415	伊之密	326,396.00	3.16
763	688088	虹软科技	326,183.63	3.16
764	002088	鲁阳节能	325,113.00	3.15
765	600563	法拉电子	325,087.00	3.15
766	003039	顺控发展	324,579.00	3.15

767	600580	卧龙电驱	324,076.00	3.14
768	002727	一心堂	324,049.00	3.14
769	002557	洽洽食品	323,764.00	3.14
770	000555	神州信息	323,582.00	3.14
771	300593	新雷能	322,780.00	3.13
772	000426	兴业银锡	321,909.00	3.12
773	605020	永和股份	321,397.00	3.12
774	688063	派能科技	320,939.60	3.11
775	600422	昆药集团	320,803.00	3.11
776	002138	顺络电子	320,547.00	3.11
777	002549	凯美特气	319,938.00	3.10
778	002534	西子洁能	318,760.00	3.09
779	601155	新城控股	318,213.00	3.08
780	002488	金固股份	318,069.00	3.08
781	688106	金宏气体	317,402.21	3.08
782	000021	深科技	316,459.00	3.07
783	688105	诺唯赞	315,751.86	3.06
784	002092	ST中泰	315,366.00	3.06
785	000030	富奥股份	315,263.00	3.06
786	002421	达实智能	314,354.00	3.05
787	603893	瑞芯微	314,054.00	3.04
788	300639	凯普生物	313,755.00	3.04
789	000547	航天发展	313,527.00	3.04
790	000818	航锦科技	313,222.00	3.04
791	002171	楚江新材	312,949.00	3.03
792	603197	保隆科技	312,798.00	3.03
793	000825	太钢不锈	311,994.00	3.02
794	601106	中国一重	311,980.00	3.02
795	000550	江铃汽车	311,205.00	3.02
796	002036	联创电子	311,096.00	3.02
797	603730	岱美股份	311,037.00	3.02

798	000063	中兴通讯	310,484.00	3.01
799	600929	雪天盐业	310,443.00	3.01
800	002812	恩捷股份	309,953.00	3.00
801	300260	新莱应材	309,951.00	3.00
802	601360	三六零	309,695.00	3.00
803	300861	美畅股份	309,020.00	3.00
804	600458	时代新材	309,019.00	3.00
805	002545	东方铁塔	308,841.00	2.99
806	688025	杰普特	308,261.19	2.99
807	601963	重庆银行	308,085.00	2.99
808	000922	佳电股份	307,886.00	2.98
809	000902	新洋丰	307,234.00	2.98
810	600298	安琪酵母	306,476.00	2.97
811	300451	创业慧康	305,874.00	2.97
812	603019	中科曙光	305,723.00	2.96
813	300363	博腾股份	304,912.00	2.96
814	603927	中科软	304,104.00	2.95
815	002126	银轮股份	303,968.00	2.95
816	600079	人福医药	302,698.00	2.93
817	300705	九典制药	302,562.00	2.93
818	301175	中科环保	301,336.00	2.92
819	688158	优刻得	300,912.34	2.92
820	300181	佐力药业	300,654.00	2.91
821	688303	大全能源	300,522.71	2.91
822	300348	长亮科技	300,321.00	2.91
823	688289	圣湘生物	298,964.62	2.90
824	601399	国机重装	298,235.00	2.89
825	002091	江苏国泰	298,130.00	2.89
826	300568	星源材质	298,112.00	2.89
827	688383	新益昌	297,934.74	2.89
828	300475	香农芯创	297,436.00	2.88

829	000028	国药一致	297,136.40	2.88
830	601933	永辉超市	296,637.00	2.88
831	603005	晶方科技	296,286.00	2.87
832	600548	深高速	294,771.00	2.86
833	600596	新安股份	294,372.00	2.85
834	301018	申菱环境	293,750.00	2.85
835	600663	陆家嘴	293,510.00	2.85
836	688612	威迈斯	292,850.84	2.84
837	603063	禾望电气	292,205.00	2.83
838	603118	共进股份	290,223.00	2.81
839	300049	福瑞股份	290,025.00	2.81
840	601222	林洋能源	289,899.00	2.81
841	002041	登海种业	289,856.00	2.81
842	600105	永鼎股份	289,793.00	2.81
843	002334	英威腾	289,308.00	2.80
844	603298	杭叉集团	289,108.00	2.80
845	002468	申通快递	289,038.00	2.80
846	600975	新五丰	288,993.00	2.80
847	000913	钱江摩托	288,759.00	2.80
848	000795	英洛华	288,482.00	2.80
849	300251	光线传媒	288,066.00	2.79
850	002283	天润工业	287,872.00	2.79
851	600869	远东股份	287,577.00	2.79
852	002612	朗姿股份	286,245.00	2.77
853	002010	传化智联	285,942.00	2.77
854	300682	朗新集团	285,699.00	2.77
855	600271	航天信息	285,378.00	2.77
856	688636	智明达	285,228.40	2.76
857	600771	广誉远	284,873.00	2.76
858	300316	晶盛机电	283,885.00	2.75
859	002625	光启技术	283,801.00	2.75

860	603826	坤彩科技	283,494.00	2.75
861	002508	老板电器	283,249.00	2.75
862	300474	景嘉微	282,945.00	2.74
863	600435	北方导航	282,446.00	2.74
864	600906	财达证券	281,970.00	2.73
865	300113	顺网科技	281,159.00	2.73
866	300012	华测检测	280,829.00	2.72
867	002215	诺普信	280,677.00	2.72
868	600008	首创环保	280,095.00	2.72
869	000543	皖能电力	279,811.00	2.71
870	603987	康德莱	279,275.00	2.71
871	300233	金城医药	278,589.00	2.70
872	002467	二六三	277,414.00	2.69
873	688005	容百科技	276,789.33	2.68
874	003035	南网能源	275,679.00	2.67
875	600720	中交设计	275,298.00	2.67
876	600166	福田汽车	274,692.00	2.66
877	300761	立华股份	274,502.00	2.66
878	603486	科沃斯	274,168.00	2.66
879	301029	怡合达	272,420.00	2.64
880	300432	富临精工	271,741.00	2.63
881	300772	运达股份	271,474.00	2.63
882	300236	上海新阳	271,087.00	2.63
883	600129	太极集团	270,373.00	2.62
884	688177	百奥泰	270,332.70	2.62
885	002463	沪电股份	269,278.00	2.61
886	601778	晶科科技	269,276.00	2.61
887	000623	吉林敖东	268,816.00	2.61
888	600237	铜峰电子	267,749.00	2.60
889	002245	蔚蓝锂芯	267,457.00	2.59
890	001219	青岛食品	266,670.10	2.59



891	003006	百亚股份	265,882.20	2.58
892	002156	通富微电	264,985.00	2.57
893	600835	上海机电	264,496.00	2.56
894	600787	中储股份	264,242.00	2.56
895	002032	苏泊尔	263,868.99	2.56
896	600116	三峡水利	263,581.00	2.56
897	688779	五矿新能	262,747.48	2.55
898	300188	国投智能	261,923.00	2.54
899	600764	中国海防	261,440.00	2.53
900	600872	中炬高新	260,788.00	2.53
901	000403	派林生物	260,014.00	2.52
902	001287	中电港	259,845.00	2.52
903	600021	上海电力	259,781.00	2.52
904	601187	厦门银行	258,864.00	2.51
905	688686	奥普特	258,803.85	2.51
906	688598	金博股份	258,196.99	2.50
907	600125	铁龙物流	257,154.00	2.49
908	688339	亿华通	257,134.81	2.49
909	600026	中远海能	257,007.00	2.49
910	002266	浙富控股	256,633.00	2.49
911	002922	伊戈尔	256,568.00	2.49
912	601059	信达证券	256,487.00	2.49
913	300144	宋城演艺	256,459.00	2.49
914	601375	中原证券	255,803.00	2.48
915	002409	雅克科技	254,453.42	2.47
916	002242	九阳股份	254,391.00	2.47
917	603113	金能科技	254,343.00	2.47
918	688017	绿的谐波	254,313.81	2.47
919	300357	我武生物	254,093.00	2.46
920	300604	长川科技	252,694.00	2.45
921	002835	同为股份	252,619.00	2.45

922	603997	继峰股份	252,373.00	2.45
923	002101	广东鸿图	252,027.00	2.44
924	300724	捷佳伟创	251,506.00	2.44
925	300224	正海磁材	251,173.00	2.43
926	600702	舍得酒业	250,056.00	2.42
927	000682	东方电子	249,841.00	2.42
928	603766	隆鑫通用	249,512.00	2.42
929	300587	天铁科技	249,027.00	2.41
930	002135	东南网架	248,821.00	2.41
931	001322	箭牌家居	248,682.00	2.41
932	300456	赛微电子	248,123.00	2.41
933	603369	今世缘	246,834.00	2.39
934	002378	章源钨业	246,292.00	2.39
935	000513	丽珠集团	245,106.00	2.38
936	688133	泰坦科技	244,972.57	2.37
937	600691	阳煤化工	244,247.00	2.37
938	002145	中核钛白	244,101.00	2.37
939	002351	漫步者	244,062.00	2.37
940	600211	西藏药业	243,898.00	2.36
941	300398	飞凯材料	242,616.00	2.35
942	300465	高伟达	241,888.00	2.34
943	603108	润达医疗	241,554.00	2.34
944	600210	紫江企业	241,444.00	2.34
945	300031	宝通科技	240,879.00	2.34
946	002516	旷达科技	240,224.76	2.33
947	600685	中船防务	240,034.00	2.33
948	000801	四川九洲	239,334.00	2.32
949	600007	中国国贸	239,238.00	2.32
950	600195	中牧股份	239,235.00	2.32
951	000155	川能动力	239,047.00	2.32
952	603328	依顿电子	238,359.00	2.31

953	300857	协创数据	237,668.00	2.30
954	688439	振华风光	237,548.11	2.30
955	603123	翠微股份	236,705.00	2.29
956	300280	紫天科技	236,202.00	2.29
957	600885	宏发股份	235,839.00	2.29
958	000680	山推股份	235,520.00	2.28
959	300035	中科电气	234,179.00	2.27
960	600223	福瑞达	233,151.00	2.26
961	600366	宁波韵升	233,033.00	2.26
962	688601	力芯微	232,885.22	2.26
963	600528	中铁工业	231,605.00	2.25
964	688008	澜起科技	231,380.22	2.24
965	688387	信科移动	230,946.56	2.24
966	002966	苏州银行	230,723.00	2.24
967	300525	博思软件	230,229.00	2.23
968	000657	中钨高新	230,000.00	2.23
969	300638	广和通	229,940.00	2.23
970	603609	禾丰股份	229,750.00	2.23
971	002698	博实股份	227,977.00	2.21
972	000950	重药控股	226,837.00	2.20
973	688685	迈信林	226,653.95	2.20
974	300303	聚飞光电	226,631.00	2.20
975	300463	迈克生物	226,205.00	2.19
976	601811	新华文轩	224,559.00	2.18
977	002043	兔宝宝	223,982.00	2.17
978	000603	盛达资源	223,113.00	2.16
979	002583	海能达	222,238.00	2.15
980	002565	顺灏股份	221,727.00	2.15
981	600996	贵广网络	221,478.00	2.15
982	600131	国网信通	221,078.00	2.14
983	600557	康缘药业	220,976.00	2.14

984	002983	芯瑞达	220,902.00	2.14
985	002859	洁美科技	220,829.00	2.14
986	688110	东芯股份	220,233.25	2.13
987	300699	光威复材	219,422.00	2.13
988	002414	高德红外	219,200.00	2.12
989	000915	华特达因	219,131.00	2.12
990	600118	中国卫星	218,805.00	2.12
991	605117	德业股份	218,664.00	2.12
992	300394	天孚通信	218,660.00	2.12
993	000503	国新健康	218,109.00	2.11
994	600966	博汇纸业	217,184.00	2.11
995	002372	伟星新材	217,159.00	2.11
996	002815	崇达技术	215,845.00	2.09
997	002797	第一创业	215,014.00	2.08
998	000519	中兵红箭	214,903.00	2.08
999	603799	华友钴业	214,858.00	2.08
100 0	300527	中船应急	214,616.00	2.08
100 1	600236	桂冠电力	214,254.00	2.08
100 2	600779	水井坊	213,907.00	2.07
100 3	300143	盈康生命	213,606.00	2.07
100 4	600063	皖维高新	213,054.00	2.07
100 5	000049	德赛电池	212,505.00	2.06
100 6	002053	云南能投	211,036.00	2.05
100 7	603127	昭衍新药	210,162.69	2.04
100	300662	科锐国际	209,104.00	2.03

8				
1009	000966	长源电力	208,326.00	2.02
1010	600850	电科数字	208,113.00	2.02
1011	603055	台华新材	207,867.00	2.01
1012	603906	龙蟠科技	207,811.00	2.01
1013	300888	稳健医疗	207,141.00	2.01
1014	688315	诺禾致源	206,395.06	2.00

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

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	6,807,039.00	65.99
2	300750	宁德时代	4,768,770.11	46.23
3	601318	中国平安	4,195,007.00	40.67
4	601899	紫金矿业	3,955,679.00	38.35
5	600036	招商银行	3,521,662.00	34.14
6	600900	长江电力	3,414,489.00	33.10
7	000338	潍柴动力	3,098,204.00	30.03
8	000333	美的集团	3,058,326.00	29.65
9	601919	中远海控	2,858,422.00	27.71
10	000725	京东方A	2,821,191.00	27.35
11	601601	中国太保	2,631,109.00	25.51
12	600019	宝钢股份	2,530,562.00	24.53

13	601088	中国神华	2,503,719.00	24.27
14	601398	工商银行	2,473,566.00	23.98
15	601600	中国铝业	2,461,324.00	23.86
16	600050	中国联通	2,454,898.00	23.80
17	601166	兴业银行	2,452,784.00	23.78
18	002916	深南电路	2,399,168.00	23.26
19	000157	中联重科	2,369,645.00	22.97
20	600309	万华化学	2,344,616.00	22.73
21	002410	广联达	2,334,065.30	22.63
22	601985	中国核电	2,331,900.00	22.60
23	601328	交通银行	2,264,673.00	21.95
24	601225	陕西煤业	2,248,457.00	21.80
25	603993	洛阳钼业	2,235,425.00	21.67
26	601336	新华保险	2,215,669.00	21.48
27	000651	格力电器	2,206,696.00	21.39
28	601872	招商轮船	2,159,866.00	20.94
29	600066	宇通客车	2,120,335.00	20.55
30	601857	中国石油	2,118,157.00	20.53
31	000100	TCL科技	2,117,356.00	20.52
32	601169	北京银行	2,082,564.00	20.19
33	601988	中国银行	2,077,512.00	20.14
34	600588	用友网络	2,067,819.20	20.04
35	600030	中信证券	2,052,596.00	19.90
36	600183	生益科技	2,044,899.00	19.82
37	601808	中海油服	2,027,370.00	19.65
38	600875	东方电气	2,004,945.00	19.44
39	002241	歌尔股份	1,990,092.00	19.29
40	003816	中国广核	1,966,264.00	19.06
41	600919	江苏银行	1,945,514.00	18.86
42	600989	宝丰能源	1,933,078.97	18.74
43	600000	浦发银行	1,920,248.00	18.61

44	600901	江苏金租	1,916,961.00	18.58
45	600233	圆通速递	1,896,491.00	18.38
46	600362	江西铜业	1,879,836.00	18.22
47	002001	新和成	1,874,099.00	18.17
48	000786	北新建材	1,870,428.00	18.13
49	600276	恒瑞医药	1,854,657.40	17.98
50	601728	中国电信	1,835,156.00	17.79
51	002475	立讯精密	1,834,309.00	17.78
52	002311	海大集团	1,828,359.00	17.72
53	002648	卫星化学	1,822,091.00	17.66
54	002601	龙佰集团	1,815,215.00	17.60
55	600023	浙能电力	1,790,668.00	17.36
56	601288	农业银行	1,781,385.00	17.27
57	600690	海尔智家	1,778,783.00	17.24
58	600489	中金黄金	1,775,226.00	17.21
59	002714	牧原股份	1,764,739.00	17.11
60	300498	温氏股份	1,756,901.00	17.03
61	600219	南山铝业	1,746,377.20	16.93
62	300142	沃森生物	1,723,139.00	16.70
63	601229	上海银行	1,711,848.00	16.59
64	601766	中国中车	1,688,176.62	16.36
65	002252	上海莱士	1,678,434.00	16.27
66	600028	中国石化	1,675,509.00	16.24
67	601838	成都银行	1,647,253.00	15.97
68	600926	杭州银行	1,624,744.00	15.75
69	601898	中煤能源	1,624,391.00	15.75
70	601989	中国重工	1,611,134.00	15.62
71	600398	海澜之家	1,607,905.00	15.59
72	300751	迈为股份	1,593,626.40	15.45
73	000708	中信特钢	1,587,472.00	15.39
74	600018	上港集团	1,579,689.00	15.31

75	300122	智飞生物	1,546,679.00	14.99
76	000166	申万宏源	1,540,043.00	14.93
77	600025	华能水电	1,534,065.00	14.87
78	000568	泸州老窖	1,531,915.00	14.85
79	688187	时代电气	1,497,286.15	14.51
80	600886	国投电力	1,474,709.00	14.30
81	000039	中集集团	1,474,679.00	14.30
82	600887	伊利股份	1,468,322.00	14.23
83	600741	华域汽车	1,464,863.00	14.20
84	603195	公牛集团	1,460,524.00	14.16
85	600320	振华重工	1,450,315.00	14.06
86	600406	国电南瑞	1,449,269.00	14.05
87	600160	巨化股份	1,442,524.00	13.98
88	600795	国电电力	1,438,555.00	13.94
89	600941	中国移动	1,432,646.00	13.89
90	000876	新希望	1,416,900.16	13.73
91	600426	华鲁恒升	1,411,116.00	13.68
92	300760	迈瑞医疗	1,397,210.00	13.54
93	601058	赛轮轮胎	1,391,673.00	13.49
94	601699	潞安环能	1,389,281.00	13.47
95	000807	云铝股份	1,387,955.00	13.45
96	002273	水晶光电	1,382,106.00	13.40
97	601319	中国人保	1,370,219.00	13.28
98	601186	中国铁建	1,369,064.00	13.27
99	601006	大秦铁路	1,363,901.00	13.22
100	601865	福莱特	1,340,135.00	12.99
101	601818	光大银行	1,327,867.00	12.87
102	603317	天味食品	1,317,705.16	12.77
103	601390	中国中铁	1,314,435.00	12.74
104	600745	闻泰科技	1,312,199.00	12.72
105	600161	天坛生物	1,296,924.00	12.57



106	688363	华熙生物	1,294,512.55	12.55
107	002841	视源股份	1,287,951.00	12.48
108	601816	京沪高铁	1,274,410.00	12.35
109	002821	凯莱英	1,273,905.00	12.35
110	000975	山金国际	1,267,589.00	12.29
111	002938	鹏鼎控股	1,264,578.00	12.26
112	002236	大华股份	1,262,594.00	12.24
113	002078	太阳纸业	1,259,885.00	12.21
114	300628	亿联网络	1,259,460.00	12.21
115	603379	三美股份	1,248,216.00	12.10
116	600958	东方证券	1,245,489.00	12.07
117	600998	九州通	1,243,006.90	12.05
118	002773	康弘药业	1,242,557.00	12.04
119	601717	郑煤机	1,241,828.00	12.04
120	000617	中油资本	1,241,105.00	12.03
121	002128	电投能源	1,240,971.00	12.03
122	300759	康龙化成	1,235,817.00	11.98
123	601117	中国化学	1,225,495.00	11.88
124	000800	一汽解放	1,223,636.00	11.86
125	600332	白云山	1,202,720.00	11.66
126	601991	大唐发电	1,194,262.00	11.58
127	000425	徐工机械	1,188,844.00	11.52
128	600015	华夏银行	1,187,562.00	11.51
129	600999	招商证券	1,184,082.00	11.48
130	600104	上汽集团	1,176,833.00	11.41
131	601668	中国建筑	1,167,664.00	11.32
132	600938	中国海油	1,167,359.00	11.32
133	002019	亿帆医药	1,162,870.00	11.27
134	601009	南京银行	1,157,377.00	11.22
135	688009	中国通号	1,156,009.77	11.21
136	603501	韦尔股份	1,152,003.00	11.17

137	688082	盛美上海	1,147,583.23	11.12
138	603259	药明康德	1,145,484.00	11.10
139	600968	海油发展	1,140,992.00	11.06
140	000933	神火股份	1,134,552.00	11.00
141	002408	齐翔腾达	1,134,156.00	10.99
142	002180	纳思达	1,123,313.00	10.89
143	601877	正泰电器	1,120,679.00	10.86
144	600547	山东黄金	1,119,168.00	10.85
145	600498	烽火通信	1,109,490.00	10.76
146	600150	中国船舶	1,102,689.00	10.69
147	300253	卫宁健康	1,102,680.00	10.69
148	600282	南钢股份	1,100,016.00	10.66
149	300433	蓝思科技	1,099,004.00	10.65
150	600971	恒源煤电	1,097,393.00	10.64
151	002271	东方雨虹	1,092,767.00	10.59
152	600060	海信视像	1,086,120.00	10.53
153	000528	柳工	1,082,393.00	10.49
154	000683	远兴能源	1,076,298.00	10.43
155	300124	汇川技术	1,074,817.00	10.42
156	601939	建设银行	1,073,735.00	10.41
157	601666	平煤股份	1,073,406.00	10.41
158	300308	中际旭创	1,070,424.00	10.38
159	002745	木林森	1,069,502.00	10.37
160	603712	七一二	1,067,641.00	10.35
161	601128	常熟银行	1,059,205.60	10.27
162	000703	恒逸石化	1,051,374.00	10.19
163	603185	弘元绿能	1,048,855.00	10.17
164	601108	财通证券	1,047,285.70	10.15
165	002602	ST华通	1,041,231.00	10.09
166	000858	五粮液	1,034,645.00	10.03
167	002139	拓邦股份	1,032,954.00	10.01

168	688981	中芯国际	1,022,848.66	9.92
169	000596	古井贡酒	1,022,766.00	9.91
170	601916	浙商银行	1,022,644.00	9.91
171	601231	环旭电子	1,019,873.00	9.89
172	601598	中国外运	1,019,566.00	9.88
173	300296	利亚德	1,019,189.00	9.88
174	600927	永安期货	1,018,627.00	9.87
175	601138	工业富联	1,017,906.00	9.87
176	601615	明阳智能	1,012,837.00	9.82
177	000538	云南白药	1,008,341.00	9.77
178	300058	蓝色光标	1,001,479.00	9.71
179	603568	伟明环保	999,281.00	9.69
180	000423	东阿阿胶	999,004.00	9.68
181	000768	中航西飞	998,406.00	9.68
182	300919	中伟股份	988,139.00	9.58
183	000661	长春高新	985,160.00	9.55
184	603225	新凤鸣	984,553.88	9.54
185	001965	招商公路	982,421.00	9.52
186	600031	三一重工	970,734.00	9.41
187	000811	冰轮环境	968,062.00	9.38
188	601333	广深铁路	967,659.00	9.38
189	600480	凌云股份	965,351.00	9.36
190	000400	许继电气	964,992.00	9.35
191	688510	航亚科技	964,380.32	9.35
192	601168	西部矿业	961,645.00	9.32
193	688007	光峰科技	957,267.16	9.28
194	002532	天山铝业	956,895.00	9.28
195	600737	中粮糖业	955,364.00	9.26
196	600988	赤峰黄金	955,216.00	9.26
197	601800	中国交建	953,037.00	9.24
198	600582	天地科技	950,685.00	9.22

199	000887	中鼎股份	947,909.00	9.19
200	601607	上海医药	939,723.86	9.11
201	601628	中国人寿	939,321.00	9.11
202	600660	福耀玻璃	935,019.00	9.06
203	002153	石基信息	932,516.00	9.04
204	000921	海信家电	931,273.00	9.03
205	600295	鄂尔多斯	930,197.00	9.02
206	000050	深天马 A	930,072.00	9.02
207	603558	健盛集团	929,882.00	9.01
208	600011	华能国际	929,219.00	9.01
209	000729	燕京啤酒	917,597.00	8.89
210	603866	桃李面包	914,925.00	8.87
211	300059	东方财富	912,385.00	8.84
212	600718	东软集团	912,090.00	8.84
213	601298	青岛港	909,004.00	8.81
214	688111	金山办公	906,730.77	8.79
215	600143	金发科技	904,355.00	8.77
216	600707	彩虹股份	902,634.00	8.75
217	000401	冀东水泥	901,439.00	8.74
218	601233	桐昆股份	899,953.00	8.72
219	600482	中国动力	897,154.00	8.70
220	688220	翱捷科技	892,616.03	8.65
221	002385	大北农	889,206.00	8.62
222	600177	雅戈尔	883,921.00	8.57
223	601878	浙商证券	877,190.00	8.50
224	002948	青岛银行	876,605.00	8.50
225	001203	大中矿业	875,241.00	8.48
226	000895	双汇发展	869,439.00	8.43
227	600095	湘财股份	866,211.00	8.40
228	601211	国泰君安	865,346.00	8.39
229	000598	兴蓉环境	863,079.00	8.37

230	688728	格科微	861,481.69	8.35
231	002179	中航光电	861,350.00	8.35
232	002925	盈趣科技	860,668.00	8.34
233	603986	兆易创新	859,242.00	8.33
234	601828	美凯龙	856,242.00	8.30
235	601995	中金公司	854,770.00	8.29
236	600012	皖通高速	852,579.00	8.26
237	300054	鼎龙股份	849,776.00	8.24
238	000883	湖北能源	841,784.00	8.16
239	603056	德邦股份	841,478.00	8.16
240	600529	山东药玻	838,807.00	8.13
241	300601	康泰生物	836,345.09	8.11
242	603939	益丰药房	831,519.20	8.06
243	002498	汉缆股份	829,739.00	8.04
244	002594	比亚迪	828,986.00	8.04
245	300595	欧普康视	827,032.00	8.02
246	601567	三星医疗	824,904.00	8.00
247	002867	周大生	821,938.00	7.97
248	600196	复星医药	818,880.00	7.94
249	600739	辽宁成大	818,671.00	7.94
250	688561	奇安信	816,975.80	7.92
251	002073	软控股份	811,726.00	7.87
252	688520	神州细胞	807,595.36	7.83
253	600956	新天绿能	801,190.00	7.77
254	601236	红塔证券	798,202.00	7.74
255	002706	良信股份	796,689.00	7.72
256	603565	中谷物流	796,238.00	7.72
257	002961	瑞达期货	793,282.00	7.69
258	600566	济川药业	791,395.00	7.67
259	000830	鲁西化工	791,327.00	7.67
260	002439	启明星辰	788,558.00	7.64

261	600123	兰花科创	784,024.00	7.60
262	600350	山东高速	782,538.00	7.59
263	600039	四川路桥	778,687.00	7.55
264	603296	华勤技术	777,891.00	7.54
265	600674	川投能源	776,900.00	7.53
266	688776	国光电气	776,781.10	7.53
267	603556	海兴电力	775,665.00	7.52
268	603517	绝味食品	774,830.00	7.51
269	300413	芒果超媒	773,371.00	7.50
270	300748	金力永磁	773,140.00	7.49
271	000627	天茂集团	772,109.00	7.48
272	002705	新宝股份	771,797.00	7.48
273	688536	思瑞浦	770,902.65	7.47
274	603368	柳药集团	769,055.00	7.45
275	600688	上海石化	766,673.00	7.43
276	002384	东山精密	764,710.00	7.41
277	600416	湘电股份	763,657.00	7.40
278	002739	万达电影	763,462.00	7.40
279	002563	森马服饰	759,031.00	7.36
280	000066	中国长城	757,760.00	7.35
281	002460	赣锋锂业	755,639.00	7.32
282	002444	巨星科技	754,519.00	7.31
283	600188	兖矿能源	753,995.00	7.31
284	000516	国际医学	753,773.00	7.31
285	000728	国元证券	753,306.00	7.30
286	600346	恒力石化	753,235.00	7.30
287	002064	华峰化学	753,001.00	7.30
288	688521	芯原股份	750,535.22	7.28
289	603899	晨光股份	747,554.00	7.25
290	002415	海康威视	744,751.00	7.22
291	600096	云天化	739,710.00	7.17

292	002152	广电运通	737,594.00	7.15
293	002539	云图控股	737,158.00	7.15
294	000997	新大陆	736,082.00	7.14
295	000937	冀中能源	734,063.00	7.12
296	600732	爱旭股份	732,186.00	7.10
297	600808	马钢股份	732,183.00	7.10
298	688180	君实生物	731,993.83	7.10
299	600098	广州发展	730,474.00	7.08
300	002003	伟星股份	730,384.00	7.08
301	002597	金禾实业	727,864.00	7.06
302	600916	中国黄金	724,724.00	7.03
303	002493	荣盛石化	723,007.00	7.01
304	300676	华大基因	722,933.00	7.01
305	600339	中油工程	722,569.00	7.00
306	003031	中瓷电子	721,905.35	7.00
307	000552	甘肃能化	719,282.00	6.97
308	600820	隧道股份	716,661.00	6.95
309	600761	安徽合力	714,544.00	6.93
310	601012	隆基绿能	712,080.00	6.90
311	603915	国茂股份	711,489.00	6.90
312	300979	华利集团	710,773.00	6.89
313	688041	海光信息	708,667.05	6.87
314	688276	百克生物	707,861.17	6.86
315	600061	国投资本	704,523.00	6.83
316	688389	普门科技	703,884.20	6.82
317	002422	科伦药业	702,622.00	6.81
318	300001	特锐德	700,644.00	6.79
319	300496	中科创达	699,447.00	6.78
320	002123	梦网科技	698,781.00	6.77
321	600559	老白干酒	697,402.00	6.76
322	002237	恒邦股份	697,196.00	6.76

323	601577	长沙银行	695,619.00	6.74
324	002683	广东宏大	695,273.00	6.74
325	002558	巨人网络	694,802.00	6.74
326	603737	三棵树	692,693.00	6.71
327	603658	安图生物	692,003.00	6.71
328	002044	美年健康	691,472.00	6.70
329	600057	厦门象屿	688,894.00	6.68
330	601000	唐山港	687,859.00	6.67
331	300383	光环新网	686,295.00	6.65
332	002791	坚朗五金	686,259.00	6.65
333	600312	平高电气	683,986.00	6.63
334	000977	浪潮信息	683,530.00	6.63
335	600438	通威股份	683,079.00	6.62
336	688002	睿创微纳	682,605.27	6.62
337	002402	和而泰	682,497.00	6.62
338	601118	海南橡胶	682,201.00	6.61
339	600809	山西汾酒	679,340.00	6.59
340	002472	双环传动	678,005.00	6.57
341	002270	华明装备	677,784.00	6.57
342	002223	鱼跃医疗	676,715.00	6.56
343	600673	东阳光	674,888.00	6.54
344	603979	金诚信	673,030.00	6.52
345	600618	氯碱化工	672,038.00	6.51
346	600699	均胜电子	670,456.00	6.50
347	600497	驰宏锌锗	668,737.00	6.48
348	601669	中国电建	667,991.00	6.48
349	600755	厦门国贸	667,751.00	6.47
350	000987	越秀资本	662,561.00	6.42
351	000630	铜陵有色	661,108.00	6.41
352	000650	仁和药业	658,814.00	6.39
353	600392	盛和资源	657,487.00	6.37



354	688234	天岳先进	657,217.65	6.37
355	603355	莱克电气	656,326.00	6.36
356	300285	国瓷材料	653,671.00	6.34
357	300408	三环集团	652,553.00	6.33
358	000636	风华高科	652,424.00	6.32
359	600623	华谊集团	651,945.00	6.32
360	600500	中化国际	651,533.00	6.32
361	600100	同方股份	651,280.00	6.31
362	002020	京新药业	649,933.00	6.30
363	603883	老百姓	649,755.40	6.30
364	600377	宁沪高速	649,650.00	6.30
365	600760	中航沈飞	648,121.00	6.28
366	002249	大洋电机	646,527.00	6.27
367	000600	建投能源	644,998.00	6.25
368	600750	江中药业	642,182.00	6.23
369	300442	润泽科技	640,099.00	6.20
370	600575	淮河能源	639,121.00	6.20
371	600873	梅花生物	638,469.00	6.19
372	605333	沪光股份	637,807.00	6.18
373	002436	兴森科技	635,208.00	6.16
374	300212	易华录	634,162.00	6.15
375	601139	深圳燃气	632,799.00	6.13
376	605499	东鹏饮料	631,776.00	6.12
377	688185	康希诺	627,700.35	6.08
378	000860	顺鑫农业	626,262.00	6.07
379	002595	豪迈科技	622,953.00	6.04
380	688567	孚能科技	619,940.46	6.01
381	000969	安泰科技	619,286.00	6.00
382	300454	深信服	618,075.00	5.99
383	000776	广发证券	616,774.00	5.98
384	000878	云南铜业	614,136.00	5.95

385	600765	中航重机	612,568.00	5.94
386	300558	贝达药业	612,027.00	5.93
387	600549	厦门钨业	611,638.00	5.93
388	601633	长城汽车	609,615.00	5.91
389	300679	电连技术	608,417.00	5.90
390	002484	江海股份	607,960.00	5.89
391	000938	紫光股份	607,901.00	5.89
392	600499	科达制造	607,288.00	5.89
393	600578	京能电力	606,687.00	5.88
394	002434	万里扬	606,421.00	5.88
395	601636	旗滨集团	601,527.00	5.83
396	600864	哈投股份	597,598.00	5.79
397	300450	先导智能	597,207.00	5.79
398	601608	中信重工	596,410.00	5.78
399	603833	欧派家居	594,961.00	5.77
400	600521	华海药业	593,623.00	5.75
401	600704	物产中大	593,410.00	5.75
402	601022	宁波远洋	593,020.00	5.75
403	603260	合盛硅业	592,067.00	5.74
404	000960	锡业股份	591,405.00	5.73
405	600483	福能股份	588,738.00	5.71
406	601868	中国能建	588,424.00	5.70
407	301015	百洋医药	587,762.00	5.70
408	002430	杭氧股份	585,978.00	5.68
409	603026	石大胜华	585,831.00	5.68
410	688586	江航装备	583,993.09	5.66
411	300782	卓胜微	583,883.00	5.66
412	000032	深桑达 A	582,790.00	5.65
413	600985	淮北矿业	582,015.00	5.64
414	603529	爱玛科技	579,275.00	5.62
415	600511	国药股份	578,790.00	5.61

416	600141	兴发集团	578,684.00	5.61
417	300390	天华新能	577,478.00	5.60
418	002027	分众传媒	577,189.00	5.60
419	688126	沪硅产业	576,395.47	5.59
420	603728	鸣志电器	575,642.00	5.58
421	600933	爱柯迪	573,770.00	5.56
422	002387	维信诺	571,949.00	5.54
423	600801	华新水泥	571,007.00	5.54
424	601966	玲珑轮胎	570,734.00	5.53
425	001872	招商港口	569,062.00	5.52
426	002653	海思科	566,218.00	5.49
427	600399	抚顺特钢	566,200.00	5.49
428	601555	东吴证券	563,803.00	5.47
429	300226	上海钢联	563,342.00	5.46
430	601677	明泰铝业	563,232.00	5.46
431	600583	海油工程	562,192.00	5.45
432	000999	华润三九	558,971.00	5.42
433	002643	万润股份	558,530.00	5.41
434	603699	纽威股份	556,743.00	5.40
435	601958	金钼股份	556,662.00	5.40
436	600153	建发股份	555,080.00	5.38
437	002154	报喜鸟	553,293.00	5.36
438	301165	锐捷网络	551,329.00	5.34
439	601038	一拖股份	551,301.00	5.34
440	601990	南京证券	549,510.00	5.33
441	601901	方正证券	549,449.00	5.33
442	000983	山西焦煤	549,354.00	5.33
443	000739	普洛药业	548,003.00	5.31
444	002608	江苏国信	545,803.00	5.29
445	603589	口子窖	545,579.00	5.29
446	002865	钧达股份	543,999.00	5.27

447	002100	天康生物	542,774.00	5.26
448	600348	华阳股份	542,514.00	5.26
449	605196	华通线缆	538,527.00	5.22
450	601019	山东出版	537,833.00	5.21
451	600197	伊力特	533,701.00	5.17
452	600038	中直股份	533,590.00	5.17
453	600089	特变电工	532,374.00	5.16
454	002120	韵达股份	532,287.00	5.16
455	002368	太极股份	531,039.00	5.15
456	600323	瀚蓝环境	530,708.00	5.14
457	002533	金杯电工	529,988.00	5.14
458	600420	国药现代	528,639.00	5.12
459	002782	可立克	526,892.00	5.11
460	605358	立昂微	525,433.00	5.09
461	000898	鞍钢股份	525,139.00	5.09
462	300529	健帆生物	524,928.00	5.09
463	002056	横店东磁	522,770.00	5.07
464	002399	海普瑞	522,602.00	5.07
465	000563	陕国投 A	521,962.00	5.06
466	603505	金石资源	521,524.00	5.06
467	002603	以岭药业	519,985.00	5.04
468	003022	联泓新科	518,162.00	5.02
469	002465	海格通信	517,723.00	5.02
470	603236	移远通信	516,357.00	5.01
471	603583	捷昌驱动	515,990.00	5.00
472	000930	中粮科技	515,689.00	5.00
473	300009	安科生物	514,794.00	4.99
474	002901	大博医疗	513,882.00	4.98
475	300274	阳光电源	513,829.60	4.98
476	002441	众业达	512,257.00	4.97
477	603659	璞泰来	511,648.00	4.96

478	688366	昊海生科	510,706.80	4.95
479	688012	中微公司	510,522.42	4.95
480	601179	中国西电	510,482.00	4.95
481	603103	横店影视	508,917.00	4.93
482	601156	东航物流	508,902.00	4.93
483	002240	盛新锂能	506,273.00	4.91
484	600884	杉杉股份	505,655.00	4.90
485	600027	华电国际	505,532.00	4.90
486	300244	迪安诊断	505,133.00	4.90
487	300674	宇信科技	504,711.00	4.89
488	603228	景旺电子	503,113.00	4.88
489	000415	渤海租赁	501,495.00	4.86
490	600487	亨通光电	501,440.00	4.86
491	002544	普天科技	500,780.00	4.85
492	600995	南网储能	500,272.00	4.85
493	600837	海通证券	499,618.00	4.84
494	300687	赛意信息	497,761.00	4.83
495	001914	招商积余	497,604.00	4.82
496	600176	中国巨石	495,198.00	4.80
497	688630	芯碁微装	494,844.73	4.80
498	000810	创维数字	494,441.00	4.79
499	600863	内蒙华电	493,183.00	4.78
500	600642	申能股份	491,960.00	4.77
501	300088	长信科技	491,551.00	4.76
502	000031	大悦城	488,124.00	4.73
503	600380	健康元	488,046.00	4.73
504	601369	陕鼓动力	485,825.00	4.71
505	600048	保利发展	485,663.00	4.71
506	603279	景津装备	485,423.00	4.71
507	601077	渝农商行	484,990.00	4.70
508	600970	中材国际	484,713.00	4.70

509	300003	乐普医疗	484,259.33	4.69
510	603919	金徽酒	483,578.00	4.69
511	601881	中国银河	483,300.00	4.68
512	600893	航发动力	483,244.00	4.68
513	603348	文灿股份	482,835.00	4.68
514	000551	创元科技	482,607.00	4.68
515	600062	华润双鹤	481,680.00	4.67
516	002203	海亮股份	481,117.00	4.66
517	300677	英科医疗	481,078.00	4.66
518	600827	百联股份	479,739.00	4.65
519	000553	安道麦A	479,379.00	4.65
520	688029	南微医学	478,727.22	4.64
521	002065	东华软件	478,095.00	4.63
522	002807	江阴银行	477,427.00	4.63
523	601658	邮储银行	477,301.00	4.63
524	603288	海天味业	476,623.00	4.62
525	002226	江南化工	476,272.00	4.62
526	601866	中远海发	476,212.00	4.62
527	600598	北大荒	475,979.00	4.61
528	300747	锐科激光	475,734.00	4.61
529	600562	国睿科技	473,731.00	4.59
530	600075	新疆天业	473,651.00	4.59
531	000932	华菱钢铁	473,319.00	4.59
532	300065	海兰信	471,847.00	4.57
533	300428	立中集团	471,069.00	4.57
534	000016	深康佳A	469,146.00	4.55
535	002568	百润股份	468,880.00	4.55
536	300783	三只松鼠	468,762.00	4.54
537	002906	华阳集团	468,300.00	4.54
538	002322	理工能科	467,543.96	4.53
539	002063	远光软件	466,857.00	4.53

540	002335	科华数据	466,122.00	4.52
541	000723	美锦能源	466,108.00	4.52
542	002920	德赛西威	465,082.00	4.51
543	300702	天宇股份	464,100.00	4.50
544	600029	南方航空	463,466.00	4.49
545	300776	帝尔激光	462,232.00	4.48
546	002396	星网锐捷	461,987.00	4.48
547	601918	新集能源	461,141.00	4.47
548	600460	士兰微	460,848.00	4.47
549	002600	领益智造	460,673.00	4.47
550	688639	华恒生物	460,476.44	4.46
551	000301	东方盛虹	456,622.00	4.43
552	300257	开山股份	456,126.00	4.42
553	601888	中国中免	456,039.00	4.42
554	002074	国轩高科	455,452.00	4.42
555	600577	精达股份	455,093.00	4.41
556	603087	甘李药业	454,442.00	4.41
557	603882	金域医学	454,059.00	4.40
558	600782	新钢股份	454,042.00	4.40
559	600285	羚锐制药	453,730.00	4.40
560	002025	航天电器	452,557.00	4.39
561	300047	天源迪科	452,505.00	4.39
562	002429	兆驰股份	452,402.00	4.39
563	300406	九强生物	452,274.93	4.38
564	300232	洲明科技	452,000.00	4.38
565	601126	四方股份	450,743.00	4.37
566	688188	柏楚电子	450,444.80	4.37
567	688819	天能股份	450,213.16	4.36
568	002079	苏州固锝	449,201.00	4.35
569	002993	奥海科技	448,797.00	4.35
570	600918	中泰证券	445,871.00	4.32

571	688107	安路科技	445,536.07	4.32
572	002635	安洁科技	445,358.00	4.32
573	000027	深圳能源	445,326.00	4.32
574	603305	旭升集团	444,485.00	4.31
575	601001	晋控煤业	444,367.00	4.31
576	002221	东华能源	443,385.00	4.30
577	600329	达仁堂	441,968.00	4.28
578	603588	高能环境	441,450.00	4.28
579	603786	科博达	440,672.00	4.27
580	600352	浙江龙盛	440,406.00	4.27
581	600705	中航产融	440,371.00	4.27
582	600032	浙江新能	439,253.00	4.26
583	603337	杰克股份	439,242.00	4.26
584	688239	航宇科技	437,144.94	4.24
585	603606	东方电缆	434,299.00	4.21
586	688208	道通科技	433,589.19	4.20
587	600201	生物股份	431,091.00	4.18
588	688065	凯赛生物	430,006.93	4.17
589	600552	凯盛科技	429,450.00	4.16
590	002292	奥飞娱乐	429,241.00	4.16
591	000848	承德露露	427,350.00	4.14
592	601998	中信银行	426,924.00	4.14
593	600703	三安光电	426,843.00	4.14
594	300068	南都电源	426,758.00	4.14
595	002697	红旗连锁	426,435.00	4.13
596	002572	索菲亚	426,363.00	4.13
597	603612	索通发展	425,550.00	4.13
598	600606	绿地控股	425,229.00	4.12
599	002353	杰瑞股份	424,973.00	4.12
600	600977	中国电影	424,853.00	4.12
601	000963	华东医药	424,711.00	4.12



602	002736	国信证券	424,417.00	4.11
603	600516	方大炭素	423,145.00	4.10
604	600797	浙大网新	419,464.00	4.07
605	603297	永新光学	418,822.00	4.06
606	300316	晶盛机电	418,638.00	4.06
607	002531	天顺风能	418,347.00	4.06
608	688778	厦钨新能	417,419.42	4.05
609	000408	藏格矿业	417,298.00	4.05
610	000998	隆平高科	417,275.00	4.04
611	300026	红日药业	415,488.00	4.03
612	002507	涪陵榨菜	415,399.60	4.03
613	000758	中色股份	414,448.00	4.02
614	601061	中信金属	411,958.00	3.99
615	002984	森麒麟	411,886.00	3.99
616	601163	三角轮胎	411,523.00	3.99
617	688772	珠海冠宇	409,733.97	3.97
618	603160	汇顶科技	408,970.00	3.96
619	000069	华侨城 A	408,721.00	3.96
620	601066	中信建投	408,237.00	3.96
621	002978	安宁股份	406,107.00	3.94
622	002390	信邦制药	406,084.00	3.94
623	001286	陕西能源	405,505.00	3.93
624	002511	中顺洁柔	401,241.00	3.89
625	688150	莱特光电	400,631.70	3.88
626	002261	拓维信息	399,748.00	3.88
627	603039	泛微网络	399,390.00	3.87
628	603100	川仪股份	399,109.00	3.87
629	000539	粤电力 A	399,084.00	3.87
630	000738	航发控制	398,764.00	3.87
631	002276	万马股份	398,018.00	3.86
632	603218	日月股份	397,457.00	3.85

633	603871	嘉友国际	396,370.80	3.84
634	605296	神农集团	396,036.00	3.84
635	002050	三花智控	395,167.00	3.83
636	688798	艾为电子	394,563.69	3.82
637	600459	贵研铂业	394,424.00	3.82
638	300123	亚光科技	393,610.00	3.82
639	600299	安迪苏	392,923.00	3.81
640	603439	贵州三力	392,219.00	3.80
641	688516	奥特维	391,780.32	3.80
642	300803	指南针	390,833.00	3.79
643	000529	广弘控股	390,760.00	3.79
644	600391	航发科技	389,484.00	3.78
645	603806	福斯特	388,623.00	3.77
646	000970	中科三环	388,017.00	3.76
647	601101	昊华能源	387,741.00	3.76
648	000783	长江证券	386,299.00	3.74
649	600595	中孚实业	385,877.00	3.74
650	000060	中金岭南	385,458.00	3.74
651	688006	杭可科技	384,614.98	3.73
652	600993	马应龙	383,753.00	3.72
653	000709	河钢股份	383,237.00	3.71
654	002607	中公教育	382,868.00	3.71
655	601969	海南矿业	381,201.00	3.70
656	600710	苏美达	379,323.00	3.68
657	600612	老凤祥	379,183.00	3.68
658	601198	东兴证券	378,582.00	3.67
659	300223	北京君正	378,070.00	3.66
660	600073	光明肉业	377,833.00	3.66
661	600155	华创云信	377,218.00	3.66
662	300377	赢时胜	376,223.00	3.65
663	605589	圣泉集团	374,073.00	3.63

664	600602	云赛智联	374,052.00	3.63
665	300593	新雷能	373,891.00	3.62
666	002202	金风科技	373,170.00	3.62
667	600126	杭钢股份	373,165.00	3.62
668	603093	南华期货	372,315.00	3.61
669	600378	昊华科技	372,310.00	3.61
670	002709	天赐材料	370,883.00	3.60
671	002192	融捷股份	370,367.00	3.59
672	003039	顺控发展	369,999.00	3.59
673	600585	海螺水泥	368,988.00	3.58
674	002831	裕同科技	368,860.00	3.58
675	002446	盛路通信	368,559.00	3.57
676	300015	爱尔眼科	368,489.00	3.57
677	603033	三维股份	367,811.00	3.57
678	600085	同仁堂	367,640.00	3.56
679	600859	王府井	366,954.00	3.56
680	600963	岳阳林纸	365,721.00	3.55
681	603730	岱美股份	365,450.00	3.54
682	601618	中国中冶	364,591.00	3.53
683	002371	北方华创	364,587.00	3.53
684	601727	上海电气	364,232.00	3.53
685	002048	宁波华翔	363,813.00	3.53
686	300207	欣旺达	363,337.00	3.52
687	002340	格林美	362,569.00	3.51
688	000923	河钢资源	361,796.00	3.51
689	002008	大族激光	361,665.00	3.51
690	002649	博彦科技	359,440.00	3.48
691	000869	张裕A	359,432.00	3.48
692	300033	同花顺	358,480.00	3.47
693	002487	大金重工	357,288.00	3.46
694	002318	久立特材	357,064.00	3.46

695	600810	神马股份	355,976.00	3.45
696	300482	万孚生物	355,570.00	3.45
697	002518	科士达	355,396.00	3.45
698	600316	洪都航空	355,294.00	3.44
699	603171	税友股份	354,699.00	3.44
700	603678	火炬电子	353,045.00	3.42
701	600315	上海家化	352,727.00	3.42
702	002541	鸿路钢构	351,759.00	3.41
703	601921	浙版传媒	351,593.00	3.41
704	300323	华灿光电	350,728.00	3.40
705	601928	凤凰传媒	349,257.00	3.39
706	002028	思源电气	349,030.00	3.38
707	002567	唐人神	348,198.00	3.38
708	600869	远东股份	346,670.00	3.36
709	002088	鲁阳节能	346,181.00	3.36
710	000958	电投产融	345,744.00	3.35
711	600486	扬农化工	345,715.00	3.35
712	002497	雅化集团	345,518.00	3.35
713	002138	顺络电子	343,779.00	3.33
714	002291	遥望科技	343,777.00	3.33
715	000785	居然智家	343,474.00	3.33
716	603816	顾家家居	343,239.00	3.33
717	002352	顺丰控股	342,709.00	3.32
718	002453	华软科技	342,577.00	3.32
719	002500	山西证券	342,488.00	3.32
720	603456	九洲药业	341,415.00	3.31
721	000967	盈峰环境	340,855.00	3.30
722	600882	妙可蓝多	340,816.00	3.30
723	300866	安克创新	340,716.00	3.30
724	002155	湖南黄金	340,324.00	3.30
725	300140	节能环境	340,022.00	3.30

726	300850	新强联	339,492.00	3.29
727	000547	航天发展	339,193.00	3.29
728	300203	聚光科技	338,694.00	3.28
729	600967	内蒙一机	338,608.00	3.28
730	600273	嘉化能源	338,271.00	3.28
731	600997	开滦股份	337,842.00	3.27
732	688106	金宏气体	336,324.24	3.26
733	002212	天融信	336,266.00	3.26
734	601688	华泰证券	335,164.00	3.25
735	002011	盾安环境	334,643.00	3.24
736	002839	张家港行	333,934.00	3.24
737	002832	比音勒芬	332,619.00	3.22
738	000922	佳电股份	332,006.00	3.22
739	300037	新宙邦	330,485.00	3.20
740	601933	永辉超市	329,653.00	3.20
741	688088	虹软科技	327,830.90	3.18
742	600563	法拉电子	327,750.00	3.18
743	600436	片仔癀	327,525.00	3.17
744	002726	龙大美食	327,473.00	3.17
745	688690	纳微科技	326,986.73	3.17
746	301171	易点天下	326,979.00	3.17
747	300415	伊之密	326,539.00	3.17
748	002171	楚江新材	325,545.00	3.16
749	002315	焦点科技	324,735.00	3.15
750	000750	国海证券	322,812.00	3.13
751	002488	金固股份	322,192.00	3.12
752	002068	黑猫股份	321,022.00	3.11
753	002534	西子洁能	320,698.00	3.11
754	002612	朗姿股份	320,079.00	3.10
755	601155	新城控股	319,833.00	3.10
756	603927	中科软	319,178.00	3.09

757	688289	圣湘生物	318,870.64	3.09
758	002557	洽洽食品	318,337.00	3.09
759	603338	浙江鼎力	318,282.00	3.09
760	603197	保隆科技	318,242.00	3.08
761	603893	瑞芯微	318,236.00	3.08
762	600879	航天电子	317,967.00	3.08
763	600580	卧龙电驱	317,722.00	3.08
764	600929	雪天盐业	317,653.00	3.08
765	000021	深科技	315,987.00	3.06
766	002812	恩捷股份	314,972.00	3.05
767	603233	大参林	314,593.00	3.05
768	002036	联创电子	314,230.00	3.05
769	000825	太钢不锈	313,982.00	3.04
770	002727	一心堂	313,606.00	3.04
771	300260	新莱应材	313,189.00	3.04
772	002007	华兰生物	312,619.00	3.03
773	688636	智明达	311,700.37	3.02
774	688303	大全能源	311,696.31	3.02
775	300705	九典制药	311,666.00	3.02
776	600037	歌华有线	311,267.00	3.02
777	300348	长亮科技	311,262.00	3.02
778	300134	大富科技	310,943.00	3.01
779	600298	安琪酵母	310,841.00	3.01
780	000555	神州信息	310,174.00	3.01
781	002283	天润工业	309,996.00	3.01
782	600422	昆药集团	309,402.00	3.00
783	603005	晶方科技	309,354.00	3.00
784	601106	中国一重	308,802.00	2.99
785	000030	富奥股份	306,814.00	2.97
786	600481	双良节能	306,668.00	2.97
787	688105	诺唯赞	306,201.21	2.97

788	300233	金城医药	305,486.00	2.96
789	000426	兴业银锡	305,139.00	2.96
790	601360	三六零	304,869.00	2.96
791	002549	凯美特气	303,242.00	2.94
792	300363	博腾股份	303,178.00	2.94
793	600812	华北制药	302,824.00	2.94
794	688025	杰普特	302,641.86	2.93
795	002416	爱施德	302,482.00	2.93
796	001219	青岛食品	302,133.00	2.93
797	601963	重庆银行	301,957.00	2.93
798	000818	航锦科技	301,483.00	2.92
799	300474	景嘉微	301,195.00	2.92
800	002010	传化智联	301,183.00	2.92
801	002468	申通快递	300,347.00	2.91
802	603987	康德莱	300,254.00	2.91
803	002467	二六三	300,203.00	2.91
804	002126	银轮股份	299,859.00	2.91
805	300639	凯普生物	298,456.00	2.89
806	002421	达实智能	298,023.00	2.89
807	300861	美畅股份	297,449.00	2.88
808	300568	星源材质	296,452.00	2.87
809	002215	诺普信	296,341.00	2.87
810	000550	江铃汽车	296,208.00	2.87
811	688063	派能科技	295,657.58	2.87
812	301018	申菱环境	295,166.00	2.86
813	600458	时代新材	295,088.00	2.86
814	002508	老板电器	294,879.00	2.86
815	688339	亿华通	294,877.50	2.86
816	300475	香农芯创	294,450.00	2.85
817	300682	朗新集团	293,749.00	2.85
818	603826	坤彩科技	293,489.00	2.84

819	601886	江河集团	293,189.00	2.84
820	600079	人福医药	293,052.00	2.84
821	000902	新洋丰	292,251.00	2.83
822	601311	骆驼股份	292,023.00	2.83
823	688158	优刻得	290,616.82	2.82
824	002092	ST中泰	290,610.00	2.82
825	600548	深高速	290,182.00	2.81
826	002245	蔚蓝锂芯	289,673.00	2.81
827	603298	杭叉集团	289,572.00	2.81
828	002545	东方铁塔	289,542.00	2.81
829	000543	皖能电力	287,889.00	2.79
830	688169	石头科技	287,238.94	2.78
831	603118	共进股份	287,037.00	2.78
832	688612	威迈斯	286,842.51	2.78
833	300772	运达股份	286,800.00	2.78
834	300451	创业慧康	286,386.00	2.78
835	600835	上海机电	285,955.00	2.77
836	300761	立华股份	285,915.00	2.77
837	000795	英洛华	285,841.00	2.77
838	300012	华测检测	285,756.00	2.77
839	603113	金能科技	285,711.00	2.77
840	300049	福瑞股份	284,992.00	2.76
841	002041	登海种业	283,709.00	2.75
842	000028	国药一致	283,492.00	2.75
843	002334	英威腾	283,058.00	2.74
844	601059	信达证券	282,502.00	2.74
845	600906	财达证券	282,080.00	2.73
846	300236	上海新阳	281,875.00	2.73
847	600975	新五丰	281,054.00	2.72
848	603486	科沃斯	280,718.00	2.72
849	301029	怡合达	280,674.00	2.72



850	002625	光启技术	280,308.00	2.72
851	600166	福田汽车	279,897.00	2.71
852	001287	中电港	279,763.00	2.71
853	603063	禾望电气	279,717.00	2.71
854	600596	新安股份	279,328.60	2.71
855	000913	钱江摩托	279,230.00	2.71
856	688599	天合光能	277,946.56	2.69
857	002156	通富微电	277,198.00	2.69
858	600237	铜峰电子	276,439.00	2.68
859	688005	容百科技	275,898.47	2.67
860	002204	大连重工	275,649.00	2.67
861	601222	林洋能源	275,216.00	2.67
862	300113	顺网科技	274,719.00	2.66
863	600663	陆家嘴	273,198.00	2.65
864	605020	永和股份	273,128.00	2.65
865	003035	南网能源	271,137.00	2.63
866	603328	依顿电子	271,105.00	2.63
867	688779	五矿新能	270,454.08	2.62
868	600771	广誉远	268,168.00	2.60
869	002851	麦格米特	267,942.00	2.60
870	003006	百亚股份	265,808.00	2.58
871	600021	上海电力	265,157.00	2.57
872	000623	吉林敖东	264,890.00	2.57
873	000682	东方电子	264,677.00	2.57
874	601778	晶科科技	263,433.00	2.55
875	002835	同为股份	263,261.00	2.55
876	300638	广和通	262,984.00	2.55
877	300432	富临精工	261,758.00	2.54
878	600787	中储股份	259,998.00	2.52
879	600764	中国海防	259,757.00	2.52
880	002409	雅克科技	259,058.22	2.51

881	601399	国机重装	258,876.00	2.51
882	601811	新华文轩	258,868.00	2.51
883	600872	中炬高新	258,802.00	2.51
884	300724	捷佳伟创	258,617.00	2.51
885	300181	佐力药业	258,395.00	2.50
886	600116	三峡水利	258,143.00	2.50
887	002463	沪电股份	256,682.00	2.49
888	300604	长川科技	256,397.00	2.49
889	600105	永鼎股份	256,395.00	2.49
890	300144	宋城演艺	256,116.00	2.48
891	300188	国投智能	255,870.00	2.48
892	688177	百奥泰	255,772.10	2.48
893	600026	中远海能	255,709.00	2.48
894	300456	赛微电子	254,985.00	2.47
895	300031	宝通科技	254,620.00	2.47
896	300398	飞凯材料	254,460.00	2.47
897	688598	金博股份	254,313.71	2.47
898	603766	隆鑫通用	253,630.00	2.46
899	600435	北方导航	253,611.00	2.46
900	002032	苏泊尔	253,566.00	2.46
901	300251	光线传媒	253,495.00	2.46
902	300357	我武生物	253,196.00	2.45
903	688383	新益昌	251,525.87	2.44
904	002550	千红制药	251,236.00	2.44
905	000680	山推股份	250,950.00	2.43
906	600366	宁波韵升	250,831.00	2.43
907	002378	章源钨业	249,992.00	2.42
908	688601	力芯微	249,203.00	2.42
909	002135	东南网架	248,887.00	2.41
910	002242	九阳股份	248,660.00	2.41
911	001322	箭牌家居	248,647.00	2.41

912	300587	天铁科技	248,532.00	2.41
913	600129	太极集团	248,240.00	2.41
914	603369	今世缘	247,882.00	2.40
915	300224	正海磁材	246,895.00	2.39
916	300857	协创数据	246,293.00	2.39
917	002006	精工科技	246,206.00	2.39
918	688686	奥普特	246,192.00	2.39
919	600125	铁龙物流	246,051.00	2.39
920	600702	舍得酒业	245,995.00	2.38
921	002145	中核钛白	244,701.00	2.37
922	002922	伊戈尔	244,675.00	2.37
923	002351	漫步者	244,625.00	2.37
924	002372	伟星新材	244,008.00	2.37
925	600720	中交设计	243,669.00	2.36
926	603108	润达医疗	243,069.00	2.36
927	600007	中国国贸	242,906.00	2.35
928	601375	中原证券	242,605.00	2.35
929	000155	川能动力	241,976.00	2.35
930	002859	洁美科技	241,940.00	2.35
931	300465	高伟达	241,055.00	2.34
932	600885	宏发股份	240,179.00	2.33
933	000403	派林生物	239,467.00	2.32
934	600210	紫江企业	239,184.00	2.32
935	000801	四川九洲	239,181.00	2.32
936	688685	迈信林	238,798.06	2.31
937	603997	继峰股份	237,911.00	2.31
938	600685	中船防务	237,777.00	2.30
939	600271	航天信息	237,346.00	2.30
940	600211	西藏药业	236,806.00	2.30
941	000513	丽珠集团	236,450.00	2.29
942	688017	绿的谐波	236,282.00	2.29

943	600195	中牧股份	235,991.00	2.29
944	300143	盈康生命	235,424.00	2.28
945	000727	冠捷科技	233,758.00	2.27
946	600236	桂冠电力	233,352.00	2.26
947	600118	中国卫星	233,272.00	2.26
948	688133	泰坦科技	233,074.06	2.26
949	002516	旷达科技	230,900.00	2.24
950	600966	博汇纸业	230,582.00	2.24
951	600691	阳煤化工	230,249.00	2.23
952	002101	广东鸿图	229,078.00	2.22
953	688387	信科移动	228,986.54	2.22
954	002035	华帝股份	228,880.00	2.22
955	601187	厦门银行	228,376.00	2.21
956	600850	电科数字	227,258.00	2.20
957	000603	盛达资源	226,728.00	2.20
958	300035	中科电气	226,721.00	2.20
959	600528	中铁工业	226,696.00	2.20
960	600223	福瑞达	226,571.00	2.20
961	002091	江苏国泰	225,842.00	2.19
962	300737	科顺股份	224,895.00	2.18
963	002966	苏州银行	224,330.00	2.17
964	002815	崇达技术	223,771.00	2.17
965	300394	天孚通信	222,985.00	2.16
966	600158	中体产业	222,931.94	2.16
967	002698	博实股份	222,237.00	2.15
968	300280	紫天科技	222,205.00	2.15
969	600288	大恒科技	222,197.00	2.15
970	000519	中兵红箭	222,082.00	2.15
971	000657	中钨高新	221,277.00	2.14
972	301050	雷电微力	221,209.00	2.14
973	300699	光威复材	220,507.00	2.14

974	300303	聚飞光电	219,501.00	2.13
975	300567	精测电子	219,373.00	2.13
976	600063	皖维高新	217,857.00	2.11
977	000950	重药控股	217,677.00	2.11
978	000966	长源电力	217,209.00	2.11
979	002983	芯瑞达	217,051.56	2.10
980	603609	禾丰股份	216,341.00	2.10
981	000049	德赛电池	215,942.00	2.09
982	600996	贵广网络	215,711.00	2.09
983	002583	海能达	215,391.00	2.09
984	000915	华特达因	215,282.00	2.09
985	688110	东芯股份	214,574.70	2.08
986	002449	国星光电	214,465.00	2.08
987	002797	第一创业	214,144.00	2.08
988	603267	鸿远电子	213,990.00	2.07
989	600597	光明乳业	213,641.00	2.07
990	688439	振华风光	213,565.57	2.07
991	300888	稳健医疗	213,407.00	2.07
992	688223	晶科能源	213,173.36	2.07
993	600557	康缘药业	212,676.00	2.06
994	603055	台华新材	212,513.00	2.06
995	603707	健友股份	211,524.00	2.05
996	600779	水井坊	210,601.00	2.04
997	603098	森特股份	210,536.00	2.04
998	605117	德业股份	210,237.00	2.04
999	002392	北京利尔	210,159.00	2.04
100 0	688099	晶晨股份	209,732.36	2.03
100 1	002414	高德红外	209,307.00	2.03
100 2	688202	美迪西	208,882.94	2.02

100 3	000503	国新健康	208,757.00	2.02
100 4	603123	翠微股份	208,645.00	2.02
100 5	000001	平安银行	208,536.00	2.02
100 6	603127	昭衍新药	208,492.00	2.02
100 7	300527	中船应急	206,834.00	2.00
100 8	002043	兔宝宝	206,636.00	2.00

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

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	825,569,096.81
卖出股票收入（成交）总额	755,702,733.65

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。

#### 8.5 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。

#### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

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

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金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。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

无。

### 8.11.2 本期国债期货投资评价

无。

## 8.12 市场中性策略执行情况

截至本报告期末，本基金持有股票资产81,170,435.48元，占基金资产净值的比例为76.86%；运用股指期货进行对冲的空头合约市值-79,169,880.00元，占基金资产净值的比例为-74.97%，空头合约市值占股票资产的比例为-97.54%。

本报告期内，本基金执行市场中性策略的投资收益为-5,965,488.49元，公允价值变动损益为1,343,454.20元。

## 8.13 投资组合报告附注

8.13.1 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,兴业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。

国家金融监督管理总局2024年06月24日对招商银行股份有限公司进行处罚(金罚决字[2024]30号)。国家金融监督管理总局福建监管局2024年07月17日对兴业银行股份有限公司进行处罚(闽金罚决字[2024]12号)。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述主体外,本基金投资的其他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受到公开谴责、处罚的情形。

8.13.2 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。

### 8.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	9,596,497.37
2	应收清算款	311,954.92
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	9,908,452.29

### 8.13.4 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。

### 8.13.5 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。

### 8.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，各比例的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
410	269,888.88	66,408,435.03	60.01%	44,246,006.71	39.99%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况



项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	165,988.61	0.15%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	-
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

### 9.4 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	9.04%	10,000,000.00	9.04%	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	9.04%	10,000,000.00	9.04%	-

### §10 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	130,022,179.24
减：本报告期基金总赎回份额	29,944,395.78
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	110,654,441.74

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。

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### (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，曹健先生担任国联基金管理有限公司督察长职务、周妹云女士、马荣荣女士、刘鲁旦先生担任国联基金管理有限公司副总经理职务，同时曹健先生不再担任国联基金管理有限公司副总经理职务、周妹云女士不再担任国联基金管理有限公司督察长职务。

本基金管理人于2024年7月10日发布公告，闫军先生担任国联基金管理有限公司总经理职务，同时闫军先生不再担任国联基金管理有限公司副总经理职务。

#### (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。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，未改聘会计师事务所。该审计机构已经连续2年为本基金提供审计服务。报告期内本基金应支付给会计师事务所的报酬为30,000.00元人民币。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。

#### 11.6.2 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在开展基金托管业务过程中未受到相关监管部门稽查或处罚。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
海通证券	2	1,103,311,693.06	69.77%	683,097.23	85.11%	-
华林证券	2	477,935,516.80	30.23%	119,491.24	14.89%	新增2个交易单元。

注：①根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》等法规及监管要求，公司制定了选择券商的标准，即为：

- 1、财务状况良好；
- 2、经营行为规范；
- 3、合规风控能力和交易能力较强；
- 4、研究能力较强，可为公司提供需要的研究支持。研究能力包括但不限于：
  - （1）有较强的宏观及行业研究能力。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，并进行路演、培训等。
  - （2）有较强的数据资源提供能力。拥有丰富的数据库资源，能够及时准确地为公司提供国内外宏观经济、政策、行业、公司等各层面的学术文献、研究报告、信息资讯、数据资源等。
  - （3）有提供特色定制服务的能力。能够根据不同类型基金投资的特点，提供专门的定制研究和定制服务（如专题研究、专题会议、专题路演、专题研讨等）。

②券商专用交易单元选择程序：

- 1、对提供服务的券商按照上述标准进行遴选及审批，确定合作券商；
- 2、本基金管理人与合作券商签订相关协议。

③本部分的数据统计时间区间与本报告的报告期一致；本公司网站披露的《国联基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024年度）》的报告期为2024年7月1日至2024年12月31日。敬请投资者关注上述报告统计时间区间的口径差异。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
海通证券	18,434,868.00	56.80%	1,341,612,000.00	91.20%	-	-	-	-
华林证券	14,019,180.00	43.20%	129,500,000.00	8.80%	-	-	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	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	中国证监会指定报刊及网站	2024-05-31

	经理变更公告（国联智选对冲3个月定开混合）		
7	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十七个开放期开放申购、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	2024-07-09
8	国联基金管理有限公司关于公司董事变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024-07-10
9	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	2024-07-10
10	国联基金管理有限公司关于国联基金直销电子交易平台等业务临时暂停服务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024-08-22
11	国联基金管理有限公司关于提醒投资者持续完善客户身份信息的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024-09-02
12	国联基金管理有限公司关于国联基金直销电子交易平台等业务临时暂停服务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024-09-10
13	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十八个开放期开放申购、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	2024-10-08
14	国联基金管理有限公司关于国联基金直销电子交易平台等业务临时暂停服务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024-11-07

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资	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	持有基金份额比	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额

者类别	号	例达到或者超过20%的时间区间					
机构	1	20240416-20240418	0.00	20,204,461.91	5,000,000.00	15,204,461.91	13.74%
	2	20240101-20240417	10,000,000.00	0.00	0.00	10,000,000.00	9.04%
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>							

## 12.2 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。

## §13 备查文件目录

### 13.1 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

### 13.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所。

### 13.3 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  
二〇二五年三月二十八日