

中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券
投资基金
2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：中航基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2024 年 3 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料已经审计。天职国际会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 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	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	10
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	14
§ 4 管理人报告	15
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	15
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	16
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	16
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.....	17
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	17
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	17
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	18
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	19
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.....	19
§ 5 托管人报告	20
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	20
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.....	20
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.....	20
§ 6 审计报告	21
6.1 审计报告基本信息.....	21
6.2 审计报告的基本内容.....	21
§ 7 年度财务报表	24
7.1 资产负债表.....	24
7.2 利润表.....	25
7.3 净资产变动表.....	26
7.4 报表附注.....	28
§ 8 投资组合报告	62
8.1 期末基金资产组合情况.....	62
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	62
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.....	63
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	89
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	91
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.....	91
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.....	91

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	91
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	91
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	91
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	91
8.12 投资组合报告附注	92
§ 9 基金份额持有人信息	93
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	93
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	93
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	93
§ 10 开放式基金份额变动	94
§ 11 重大事件揭示	95
11.1 基金份额持有人大会决议	95
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	95
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	95
11.4 基金投资策略的改变	95
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	95
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	95
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	96
11.8 其他重大事件	98
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	100
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	100
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	100
§ 13 备查文件目录	101
13.1 备查文件目录	101
13.2 存放地点	101
13.3 查阅方式	101

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金	
基金简称	中航量化阿尔法六个月持有	
基金主代码	011934	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 8 月 25 日	
基金管理人	中航基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	241,951,679.74 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	中航量化阿尔法六个月持有 A	中航量化阿尔法六个月持有 C
下属分级基金的交易代码:	011934	011935
报告期末下属分级基金的份额总额	67,576,433.04 份	174,375,246.70 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金以数量化分析为基础，在充分控制基金财产风险和保证基金财产流动性的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金财产的长期稳健增值。
投资策略	（一）资产配置策略 （二）股票投资策略：（1）多因子模型（2）事件驱动模型 （三）债券投资策略 （四）股指期货投资策略 （五）国债期货投资策略 （六）资产支持证券投资策略 （七）存托凭证投资策略 （八）可转换债券及可交换债券投资策略
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×85%+中证综合债券指数收益率×15%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	中航基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	武国强
	联系电话	010-56716188
	电子邮箱	wuguoqiang@avicfund.cn
客户服务电话	400-666-2186	400-61-95555
传真	010-56716198	0755-83195201

注册地址	北京市朝阳区天辰东路 1 号院 1 号楼 1 层 101 内 10 层 B1001 号	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址	北京市朝阳区天辰东路 1 号院北京亚洲金融大厦 D 座第 8 层 801/805/806 单元	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	100101	518040
法定代表人	杨彦伟	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.avicfund.cn
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	天职国际会计师事务所（特殊普通合伙）	北京海淀区车公庄西路 19 号外文文化创意园 12 号楼
注册登记机构	中航基金管理有限公司	北京市朝阳区天辰东路 1 号院北京亚洲金融大厦 D 座第 8 层 801/805/806 单元

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2023 年		2022 年		2021 年 8 月 25 日(基金合同生效日)-2021 年 12 月 31 日	
	中航量化阿尔法六个月持有 A	中航量化阿尔法六个月持有 C	中航量化阿尔法六个月持有 A	中航量化阿尔法六个月持有 C	中航量化阿尔法六个月持有 A	中航量化阿尔法六个月持有 C
本期已实现收益	-5,062,866.78	-14,514,733.46	-7,461,230.92	-22,323,289.52	-1,964,303.86	-5,421,917.03
本期利润	-4,817,533.82	-13,819,005.92	-12,172,443.18	-35,189,056.36	-886,657.53	-3,085,207.42
加权平均基金份额本期利润	-0.0672	-0.0704	-0.1457	-0.1478	-0.0103	-0.0121
本期加权平	-7.96%	-8.42%	-16.16%	-16.49%	-1.05%	-1.23%

均净值利润率						
本期基金份额净值增长率	-8.47%	-9.03%	-14.17%	-14.68%	-1.00%	-1.21%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
期末可供分配利润	-15,024,092.45	-40,669,990.72	-11,601,630.77	-34,127,007.90	-1,756,059.79	-5,415,572.35
期末可供分配基金份额利	-0.2223	-0.2332	-0.1503	-0.1571	-0.0192	-0.0212

润						
期						
末						
基						
金	52,552,340.	133,705,255	65,606,709.	183,061,454	90,726,197	252,165,125
资	59	.98	30	.20	.67	.80
产						
净						
值						
期						
末						
基						
金						
份	0.7777	0.7668	0.8497	0.8429	0.9900	0.9879
额						
净						
值						
指						
标						
3.1.						
3						
累						
计						
期						
末						
指						
标						
2023 年末						
2022 年末						
2021 年末						
基						
金						
份						
额						
累						
计						
净						
值						
增						
长						
率						
-22.23%						
-23.32%						
-15.03%						
-15.71%						
-1.00%						
-1.21%						

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

②期末可供分配利润：对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）；如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分，如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分扣除未实现部分）。

③本基金所述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。

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

中航量化阿尔法六个月持有 A

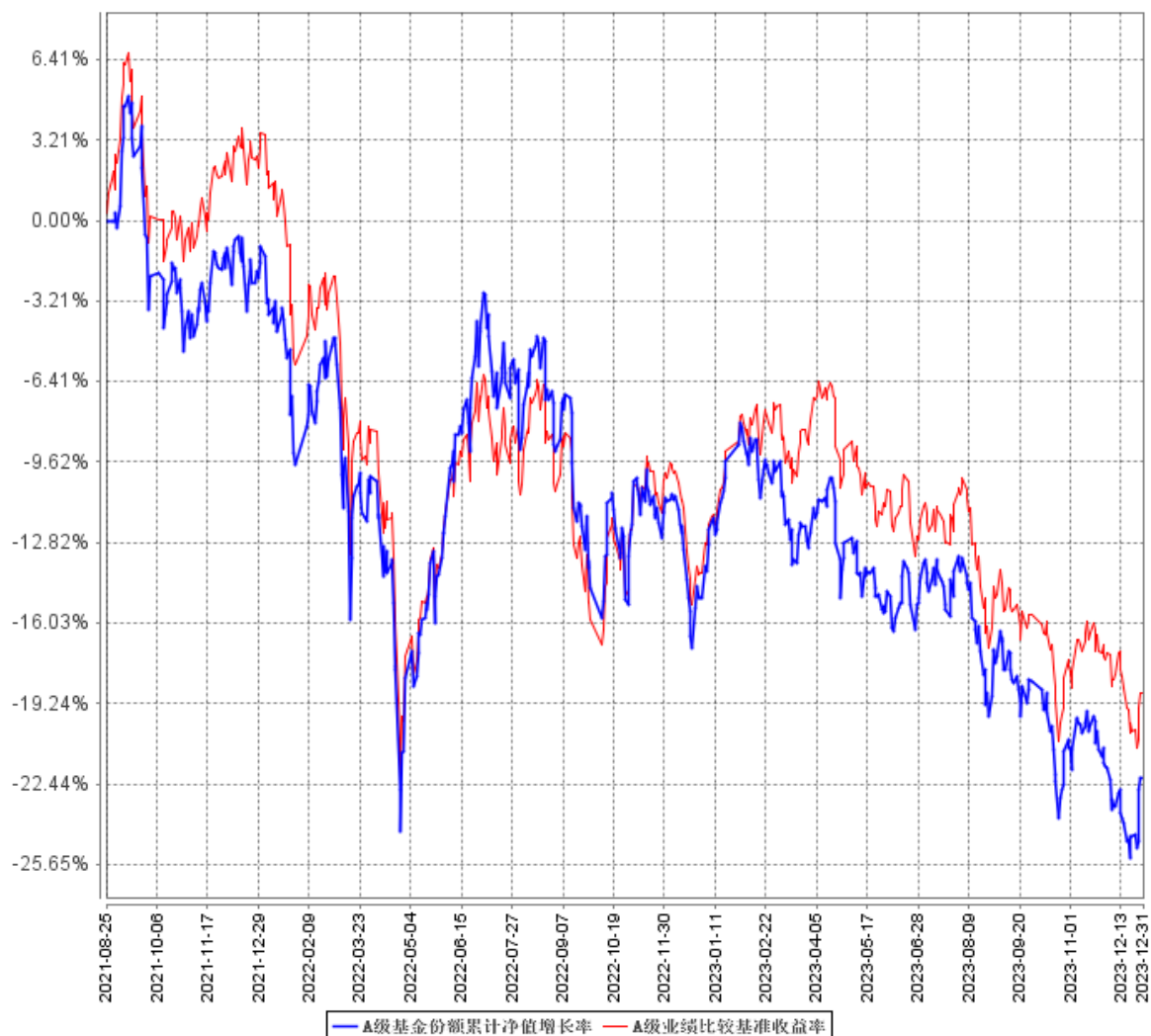
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-4.78%	0.84%	-3.70%	0.73%	-1.08%	0.11%
过去六个月	-9.32%	0.81%	-7.80%	0.73%	-1.52%	0.08%
过去一年	-8.47%	0.76%	-5.58%	0.70%	-2.89%	0.06%
自基金合同生效起至今	-22.23%	1.02%	-18.81%	0.94%	-3.42%	0.08%

中航量化阿尔法六个月持有 C

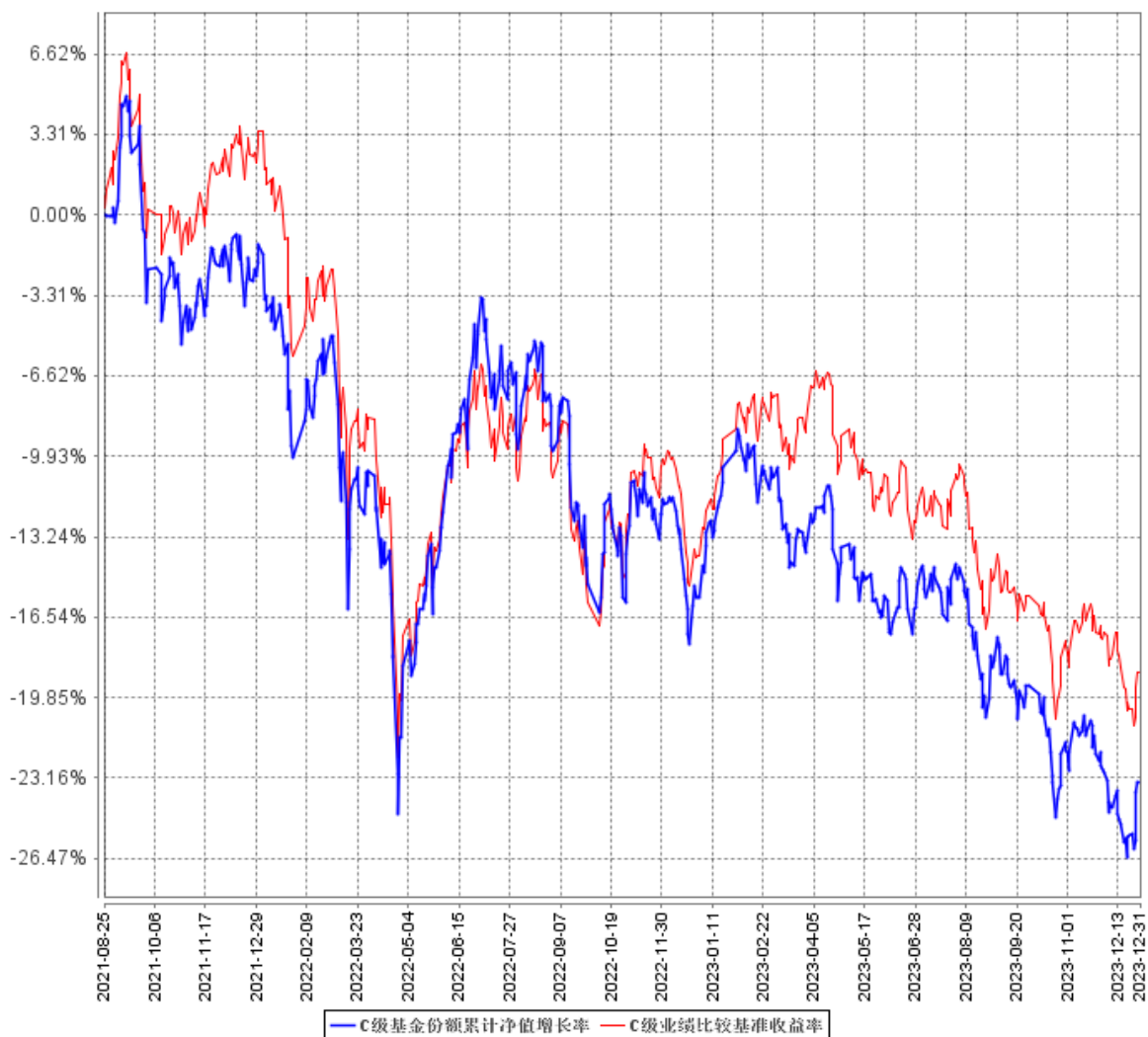
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-4.92%	0.84%	-3.70%	0.73%	-1.22%	0.11%
过去六个月	-9.59%	0.81%	-7.80%	0.73%	-1.79%	0.08%
过去一年	-9.03%	0.76%	-5.58%	0.70%	-3.45%	0.06%
自基金合同生效起至今	-23.32%	1.02%	-18.81%	0.94%	-4.51%	0.08%

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

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

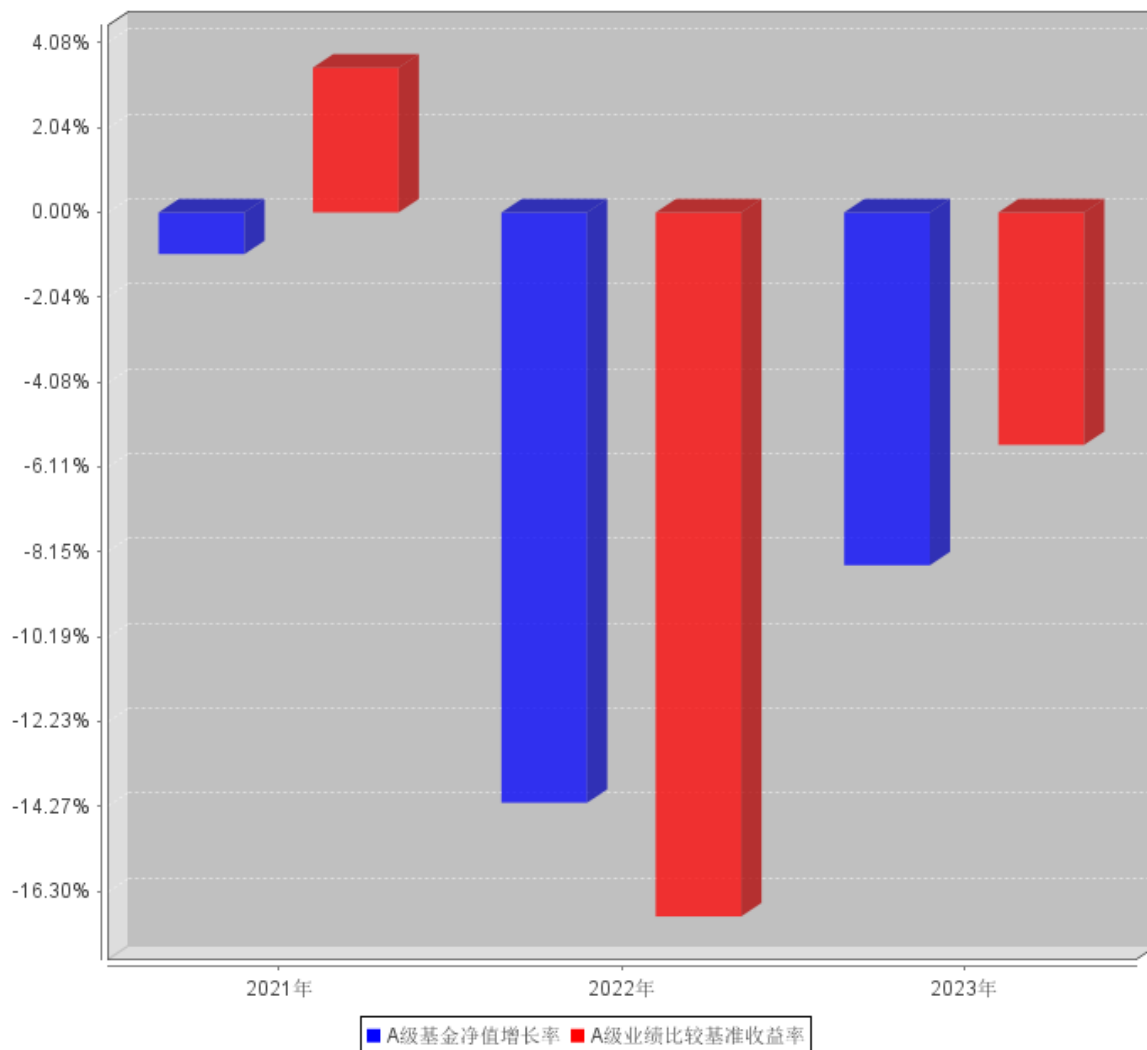


C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

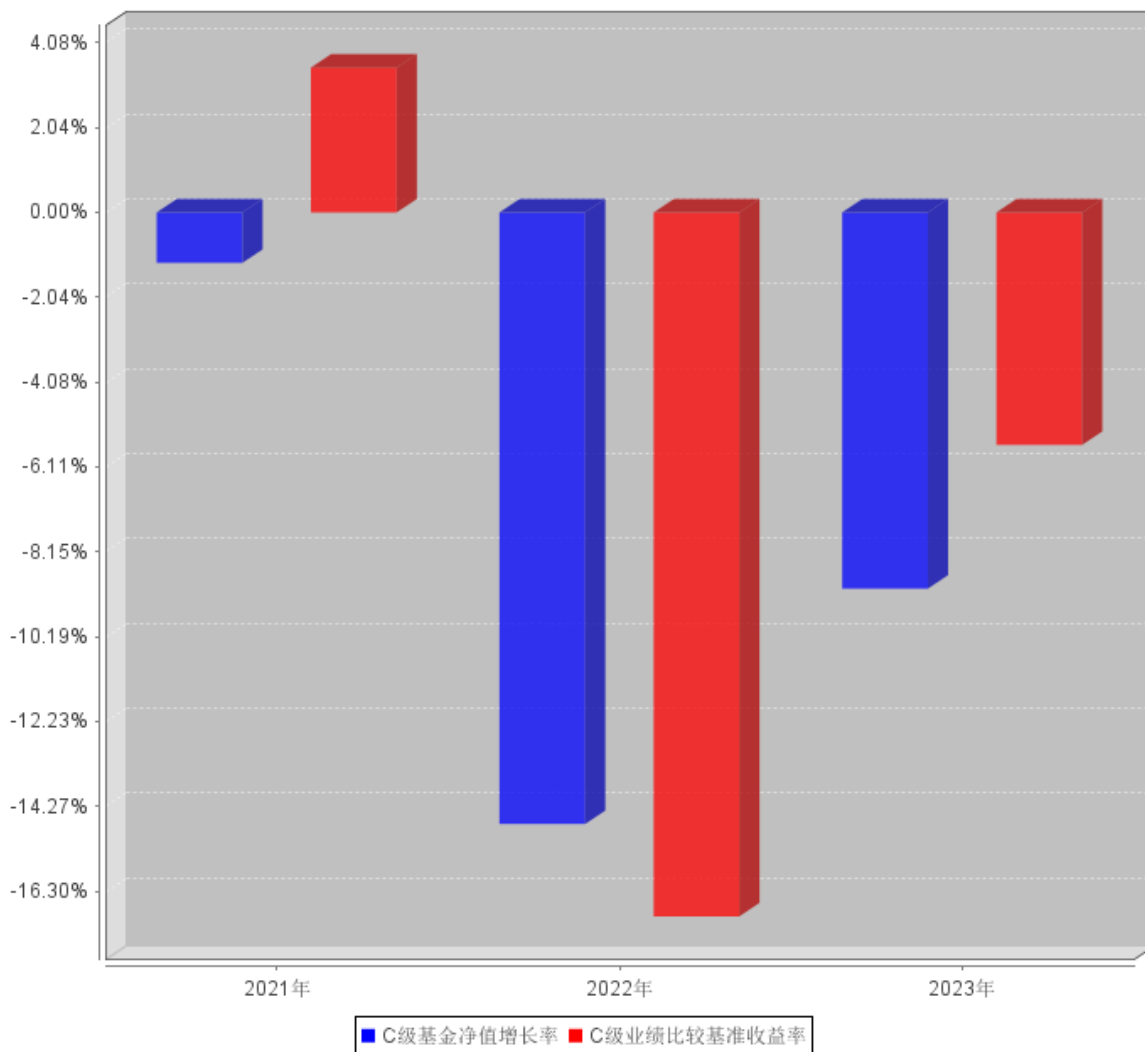


3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

A级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对比图



C级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对比图



注：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

本基金自合同生效日（2021年8月25日）至报告期截止日（2023年12月31日）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

中航基金管理有限公司成立于 2016 年 6 月 16 日，是经中国证券监督管理委员会证监许可[2016]1249 号文许可批准设立、为客户提供专业基金管理服务的全国性基金管理公司。公司总部设在北京，注册资本为 30,000 万元人民币，经营范围为基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务。

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		
龙川	基金经理	2021 年 8 月 25 日	-	13	统计博士学位，具有 8 年海外投资管理经验，10 年以上国内证券、基金行业投资管理经验，曾任职于美国 Susquehanna International Group (SIG) 担任投资经理、国泰君安证券资产管理有限公司担任首席研究员、上海东方证券资产管理有限公司担任量化投资总监、安信基金管理有限责任公司担任量化投资部总经理。2020 年 2 月起加入中航基金管理有限公司，现担任中航基金管理有限公司量化投资部负责人，中航基金管理有限公司上海分公司总经理。
杨扬	基金经理	2021 年 9 月 16 日	-	13	硕士研究生，具有 10 年以上国内证券、基金行业投资管理经验，曾任职于上海东

					方证券资产管理有限公司担任研究员、投资助理、安信基金管理有限责任公司先后担任投资经理助理、投资经理、基金经理助理、基金经理。2020年2月加入中航基金管理有限公司，现担任量化投资部基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》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守《证券投资基金法》、《中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金基金合同》及其他相关法律法规的规定，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产，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。本报告期内，本基金运作合法合规，不存在违反基金合同和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

基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度。在统一的研究平台和公共信息平台，保证各组合得到公平的投资资讯；公平对待不同投资组合，禁止各投资组合之间进行以利益输送为目的的投资交易活动；在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，严格执行授权审批程序；实行集中交易制度和公平交易分配制度；建立不同投资组合投资信息的管理及保密制度，保证不同投资组合经理之间的重大非公开投资信息的相互隔离；通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控，公平对待旗下管理的所有投资组合。同时，加强对投资交易行为的监察稽核力度，建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估体系等。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况，公司旗下各基金不存在因非公平交易等导致的利益输送行为，公平交易制度的整体执行情况良好。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内本基金不存在异常交易行为。基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价，未出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形。

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

过去的一年里，市场风格分化加剧，小微盘、价值红利上涨，其他风格普跌，机构重仓股全年承压。本基金所采用的多因子模型偏向绩优风格，受基本面因子持续疲弱的影响，过去一年的超额收益表现不及预期。

本基金的投资策略可以概括为“在宽基投资、充分分散行业和个股风险的基础上，力争通过选择基本面优秀、估值合理偏低的个股组合，为投资者创造长期的超额收益”。因此本基金的底层逻辑由两个方面构成：一是相信中国 A 股市场作为一个整体，未来仍有正的期望收益；二是相信“便宜的好股票”作为一种投资范式，仍能创造出比市场平均表现更好的超额收益。在投资策略上，我们仍将坚持以基本面优异、估值合理的绩优股构成核心仓位，在风险管理上也采取较为谨慎的策略，不过度暴露风格。同时重视对市场风格的前瞻判断，力争更灵活地应对市场环境的变化。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末中航量化阿尔法六个月持有 A 基金份额净值为 0.7777 元，本报告期基金份额净值增长率为-8.47%；截至本报告期末中航量化阿尔法六个月持有 C 基金份额净值为 0.7668 元，本报告期基金份额净值增长率为-9.03%；同期业绩比较基准收益率为-5.58%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2024 年，对于 A 股整体，我们认为诸多悲观因素已经被市场充分甚至过度定价，A 股主要指数的估值均回落至历史极低乃至最低水平，当前已呈现出很好的性价比。边际上我们可以看到诸多信号在往好的方向转变：从内部看，随着一系列稳增长政策的逐步落地，2024 年国内基本面的悲观预期有望得到扭转；从外部看，美联储加息周期已经结束，降息周期大概率即将开启，外资净流出等扰动因素也有望逐渐好转。对于基本面投资，我们坚信“便宜的好股票”长期而言仍能创造超额收益。近年来基本面因子波动加大，部分原因在于周期成长行业带来的一定业绩失真。随着这些周期成长行业的逐步出清，我们认为基本面因子有望重新具备正向的超额收益。

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，本基金管理人根据法律法规、监管要求和业务发展情况，以维护基金份额持有人利益为宗旨，组织开展内部监察稽核，完善合规与内控机制，积极推动合规风控管理，持续加

强业务风险的控制与防范，有效保证了旗下基金及公司各项业务合法合规、稳健有序运作开展。

本报告期内，本基金管理人开展的主要监察稽核工作如下：

(1) 积极推动监管新规落实，持续完善公司内控机制。结合新规实施和公司业务发展实际，不断推动公司制度、业务流程的建立、健全和完善，以适应公司产品与业务创新发展的需要；

(2) 在公司开展新产品设计、新业务过程中，就相关问题提供合规咨询，出具合规审查意见。全面履行新产品、新业务合规评估程序，保障新产品、新业务合规开展；严格审查基金宣传推介材料，及时检查基金销售业务的合法合规情况，督促完善投资者适当性管理；

(3) 有计划、有重点地对投资、研究、交易、销售、公司治理、信息技术、反洗钱等业务领域开展定期及专项监察检查，不断查缺补漏，持续提高内部控制的有效性和风险防控能力，保障公司业务合规、持续、健康、稳定发展；

(4) 持续推动建立与行业和公司业务相匹配的洗钱风险管理机制，检查洗钱风险与控制措施的有效性，进一步完善与风险能力相适应的反洗钱制度、流程，完善反洗钱系统建设，提升洗钱风险控制措施的针对性、有效性，同时，做好反洗钱宣传培训、监督检查、信息报送等各项工作；

(5) 加强合规宣导培训，不断推动公司合规文化建设。通过“面授+线上”等多种形式，有针对性地开展了投资者个人信息保护、基金宣传推介、反洗钱、新员工入职等合规宣导与合规培训，并通过新规动态、合规专题、合规风险案例等多种方式进行合规宣导，提升员工的合规风险意识，强化全员合规、主动合规理念。

本基金管理人承诺将坚持诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，积极健全内部管理制度，不断提高监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制重大风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值专业委员会，委员由投资研究、交易、基金事务、风险管理、合规等部门负责人组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。报告期内，投资研究部门负责人同时兼任基金经理、估值委员，基金经理参加估值专业委员会会议，但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；与估值相关的机构包括但不限于上海、深圳证券交易所，中国证券登记结算有限责

任公司，中央国债登记结算公司，中证指数有限公司以及中国证券投资基金业协会等。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同的相关规定，结合本基金实际运作情况，本基金本报告期末进行利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

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

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 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	天职业字[2024]11418 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金全体持有人：
审计意见	<p>我们审计了中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金(以下简称“中航量化阿尔法六个月持有股票基金”)财务报表,包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表,2023 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>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的规定编制,公允反映了中航量化阿尔法六个月持有股票基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于中航量化阿尔法六个月持有股票基金,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。</p>
强调事项	—
其他事项	—
其他信息	<p>中航量化阿尔法六个月持有股票基金管理人中航基金管理有限公司(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的规定编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p>

	<p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估中航量化阿尔法六个月持有股票基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督中航量化阿尔法六个月持有股票基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险,设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价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,就可能导致对中航量化阿尔法六个月持有股票基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而未来的事项或情</p>

	<p>况可能导致中航量化阿尔法六个月持有股票基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	天职国际会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	卢永红 周任阳
会计师事务所的地址	北京市海淀区车公庄西路 19 号外文文化创意园 12 号楼
审计报告日期	2024 年 3 月 27 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	14,530,643.47	25,035,276.81
结算备付金		1,032,044.38	839,918.61
存出保证金		25,543.81	37,070.38
交易性金融资产	7.4.7.2	170,644,205.42	223,129,751.45
其中：股票投资		170,644,205.42	223,129,751.45
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	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		1,904,442.60	1,420,480.87
应收股利		-	-
应收申购款		-	2.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		188,136,879.68	250,462,500.12
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负债：			
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		640,392.20	586,337.60
应付赎回款		396,633.22	1,114.22

应付管理人报酬		188,334.93	329,359.18
应付托管费		31,389.17	54,893.20
应付销售服务费		67,677.64	97,159.98
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	7.4.7.9	554,855.95	725,472.44
负债合计		1,879,283.11	1,794,336.62
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	241,951,679.74	294,396,802.17
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	-55,694,083.17	-45,728,638.67
净资产合计		186,257,596.57	248,668,163.50
负债和净资产总计		188,136,879.68	250,462,500.12

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额总额 241,951,679.74 份，其中中航量化阿尔法六个月持有 A 基金份额净值 0.7777 元，基金份额总额 67,576,433.04 份；中航量化阿尔法六个月持有 C 基金份额净值 0.7668 元，基金份额总额 174,375,246.70 份；

7.2 利润表

会计主体：中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-13,787,703.48	-40,867,041.61
1.利息收入		92,515.78	121,716.95
其中：存款利息收入	7.4.7.13	92,515.78	121,716.95
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-14,821,279.76	-23,411,779.46
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-17,718,549.97	-27,469,346.64
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-1,590.13	-
股利收益	7.4.7.19	2,898,860.34	4,057,567.18

以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.20	941,060.50	-17,576,979.10
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	-	-
减：二、营业总支出		4,848,836.26	6,494,457.93
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	3,175,439.17	4,333,747.33
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	529,239.90	722,291.20
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	988,135.22	1,281,242.33
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	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	7.4.7.23	156,021.97	157,177.07
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-18,636,539.74	-47,361,499.54
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-18,636,539.74	-47,361,499.54
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-18,636,539.74	-47,361,499.54

7.3 净资产变动表

会计主体：中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	294,396,802.17	-	-45,728,638.67	248,668,163.50
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	294,396,802.17	-	-45,728,638.67	248,668,163.50
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-52,445,122.43	-	-9,965,444.50	-62,410,566.93
（一）、综合收益总额	-	-	-18,636,539.74	-18,636,539.74
（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）	-52,445,122.43	-	8,671,095.24	-43,774,027.19
其中：1.基金申购款	836,954.08	-	-117,786.06	719,168.02
2.基金赎回款	-53,282,076.51	-	8,788,881.30	-44,493,195.21
（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）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	241,951,679.74	-	-55,694,083.17	186,257,596.57
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	346,894,590.56	-	-4,003,267.09	342,891,323.47
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	346,894,590.56	-	-4,003,267.09	342,891,323.47
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-52,497,788.39	-	-41,725,371.58	-94,223,159.97
（一）、综合收益总额	-	-	-47,361,499.54	-47,361,499.54
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产	-52,497,788.39	-	5,636,127.96	-46,861,660.43

减少以“-”号填列)				
其中：1.基金申购款	1,252,087.38	-	-147,663.13	1,104,424.25
2.基金赎回款	-53,749,875.77	-	5,783,791.09	-47,966,084.68
(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)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	294,396,802.17	-	-45,728,638.67	248,668,163.50

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：

<u>刘建</u>	<u>裴荣荣</u>	<u>韩丹</u>
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

中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）根据中国证券监督管理委员会（“中国证监会”）证监许可[2021]857 号文《关于准予中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金注册的批复》，由中航基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金基金合同》（“基金合同”）等规定公开募集。经向中国证监会备案，于 2021 年 8 月 25 日募集成立。本基金的基金管理人为中航基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。基金合同生效日总计认购户数 2,779 户，确认的有效认购金额为 329,106,493.46 元，实收基金份额为 329,173,593.39 份（含利息转份额 67,099.93 份）。其中：A 类份额认购户数 985 户，确认的有效认购金额为 74,890,736.46 元，实收基金份额为 74,904,100.76 份（含利息转份额 13,364.30 份）；C 类份额认购户数 1,794 户，确认的有效认购金额为 254,215,757.00 元，实收基金份额为 254,269,492.63 份（含利息转份额 53,735.63 份）；本基金募集资金经天职会计师事务所（特殊普通合伙）验资。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发

行上市的股票（包括主板、中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、存托凭证、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券（含分离型可转换债券）、可交换债券及其他中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款等）、货币市场工具、股指期货、国债期货，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。

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。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的会计报表按照财政部 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证券投资基金业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会颁布的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号—年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号—年度报告和中期报告》、《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号—会计报表附注的编制及披露》及中国证监会颁布的其他相关规定编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金编制的财务报表符合企业会计准则及其他有关规定要求，真实、完整地反映了本基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期本基金所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历每年 1 月 1 日至 12 月 31 日。本期财务报表的实际编制期间为 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金核算以人民币为记账本位币。记账单位为人民币元。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入

其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类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。

基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、同业存单、资产支持证券和衍生工具等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在资产负债表中以衍生金融资产列示外，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在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即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。包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债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。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

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

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项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。

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损失准备。

考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期

信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券、同业存单和衍生工具(主要为权证投资)等按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 对于存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，在估值日有报价的，除会计准则规定的例外情况外，应该将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

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

量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

(3)如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件,使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25%以上的,应对估值进行调整并确定公允价值。

有充足理由表明按以上估值原则仍不能客观反映相关投资品种的公允价值的,基金管理公司根据具体情况与托管银行进行商定,按最能恰当反映公允价值的价格估值。

国家有最新规定的,按其规定进行估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金单位总额所对应的金额。由于申购、赎回、转换以及分红再投资引起的实收基金的变动分别于基金相关活动确认日认列。

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基金净值的比例,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

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资、资产支持证券、同业存单投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利

率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息后的净额确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、本基金在符合有关基金分红条件的前提下可进行收益分配,每次收益分配比例等具体分红方案见基金管理人届时发布的相关分红公告,若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配;

2、本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资;若投资人不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;基金份额持有人持有的基金份额(原份额)所获得的红利再投资份额的持有期,按原份额的持有期计算;

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

4、本基金每一基金份额享有同等分配权;

5、法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

7.4.4.12 分部报告

无。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本报告期本基金无其他需要披露的重要会计政策和会计估计。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本报告期本基金无需说明的重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期本基金无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本报告期本基金无需要说明的重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财税【2004】78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税【2005】103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、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》、财税明电【2008】2号《财政部、国家税务总局关于调整证券（股票）交易印花税征收方式的通知》、2008年09月18日发布的《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税【2012】85号《关于实施公司股息红利差别化个人所得税政策的通知》、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】70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1. 基金运营过程中发生的增值税应税行为，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. 基金分别按实际缴纳的增值税额的7%、3%、2%缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加；
3. 对基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征增值税；
4. 存款利息收入不征收增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入免征增值税；
5. 对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，暂不缴纳企业所得税；
6. 基金取得的股票股息、红利收入，自2015年9月8日起，基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计

入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

7. 对基金取得的企业债券利息收入，由各兑付机构在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不缴纳企业所得税；

8. 对于基金从事 A 股买卖，自 2008 年 09 月 19 日起，由出让方按 0.1% 的税率缴纳证券（股票）交易印花税，受让方不再缴纳印花税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	14,530,643.47	25,035,276.81
等于：本金	14,529,131.45	25,032,651.45
加：应计利息	1,512.02	2,625.36
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：	14,530,643.47	25,035,276.81

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	183,865,768.08	-	170,644,205.42	-13,221,562.66
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		183,865,768.08	-	170,644,205.42	-13,221,562.66
项目		上年度末 2022年12月31日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		237,292,374.61	-	223,129,751.45	-14,162,623.16
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		237,292,374.61	-	223,129,751.45	-14,162,623.16

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本报告期末及上年度末，本基金未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本报告期末及上年度末，本基金未持有期货合约。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本报告期末及上年度末，本基金未持有黄金衍生品。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本报告期末及上年度末，本基金未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末及上年度末，本基金未持有通过买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

本报告期本基金未计提减值准备。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

本报告期末及上年度末，本基金未持有债权投资。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本报告期本基金未计提债权投资减值准备。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

本报告期末及上年度末，本基金未持有其他债权投资。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本报告期本基金未计提其他债权投资减值准备。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本报告期末及上年度末，本基金未持有其他权益工具投资。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本报告期末及上年度末，本基金未持有其他权益工具投资。

7.4.7.8 其他资产

本报告期末及上年度末，本基金未持有其他资产。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	407,855.95	578,472.44
其中：交易所市场	407,855.95	578,472.44
银行间市场	-	-
-	-	-
应付利息	-	-
预提费用	147,000.00	147,000.00
合计	554,855.95	725,472.44

注：预提费用为按日计提的审计费、信息披露费。

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

中航量化阿尔法六个月持有 A		
项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	77,208,340.07	77,208,340.07
本期申购	510,793.48	510,793.48
本期赎回（以“-”号填列）	-10,142,700.51	-10,142,700.51
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	67,576,433.04	67,576,433.04

金额单位：人民币元

中航量化阿尔法六个月持有 C		
项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	217,188,462.10	217,188,462.10
本期申购	326,160.60	326,160.60
本期赎回（以“-”号填列）	-43,139,376.00	-43,139,376.00
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	174,375,246.70	174,375,246.70

注：本期申购包含基金转换入份额；本期赎回包含基金转换出份额。

7.4.7.11 其他综合收益

本报告期本基金无其他综合收益。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

中航量化阿尔法六个月持有 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-8,219,324.81	-3,382,305.96	-11,601,630.77
加：会计政策变更 （若有）	-	-	-
前期差错更正	-	-	-

(若有)			
其他(若有)	-	-	-
本期期初	-8,219,324.81	-3,382,305.96	-11,601,630.77
本期利润	-5,062,866.78	245,332.96	-4,817,533.82
本期基金份额交易产生的变动数	1,155,053.76	240,018.38	1,395,072.14
其中:基金申购款	-61,900.48	-12,053.98	-73,954.46
基金赎回款	1,216,954.24	252,072.36	1,469,026.60
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-12,127,137.83	-2,896,954.62	-15,024,092.45

单位:人民币元

中航量化阿尔法六个月持有 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-24,657,478.28	-9,469,529.62	-34,127,007.90
加:会计政策变更(若有)	-	-	-
前期差错更正(若有)	-	-	-
其他(若有)	-	-	-
本期期初	-24,657,478.28	-9,469,529.62	-34,127,007.90
本期利润	-14,514,733.46	695,727.54	-13,819,005.92
本期基金份额交易产生的变动数	5,928,044.59	1,347,978.51	7,276,023.10
其中:基金申购款	-38,425.60	-5,406.00	-43,831.60
基金赎回款	5,966,470.19	1,353,384.51	7,319,854.70
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-33,244,167.15	-7,425,823.57	-40,669,990.72

7.4.7.13 存款利息收入

单位:人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
活期存款利息收入	72,536.57	96,004.40
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	17,248.10	24,458.57
其他	2,731.11	1,253.98
合计	92,515.78	121,716.95

注:其他包括基金结算保证金利息收入。

7.4.7.14 股票投资收益**7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12 月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-17,718,549.97	-27,469,346.64
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	-17,718,549.97	-27,469,346.64

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023 年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
卖出股票成交总额	1,581,525,194.87	2,072,239,758.72
减：卖出股票成本总额	1,595,362,619.35	2,094,259,449.99
减：交易费用	3,881,125.49	5,449,655.37
买卖股票差价收入	-17,718,549.97	-27,469,346.64

7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本报告期及上年度可比期间，本基金无股票投资收益——证券出借差价收入。

7.4.7.15 债券投资收益**7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成**

本报告期及上年度可比期间，本基金无债券投资收益。

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本报告期及上年度可比期间，本基金无债券投资收益——买卖债券差价收入。

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本报告期及上年度可比期间，本基金无债券投资收益——赎回差价收入。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本报告期及上年度可比期间，本基金无债券投资收益——申购差价收入。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益**7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成**

本报告期及上年度可比期间，本基金无资产支持证券投资收益。

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本报告期及上年度可比期间，本基金无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本报告期及上年度可比期间，本基金无资产支持证券投资收益——赎回差价收入。

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本报告期及上年度可比期间，本基金无资产支持证券投资收益——申购差价收入。

7.4.7.17 贵金属投资收益**7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成**

本报告期及上年度可比期间，本基金无贵金属投资收益。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本报告期及上年度可比期间，本基金无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本报告期及上年度可比期间，本基金无贵金属投资收益——赎回差价收入。

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本报告期及上年度可比期间，本基金无贵金属投资收益——申购差价收入。

7.4.7.18 衍生工具收益**7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本报告期及上年度可比期间，本基金无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

7.4.7.18.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
国债期货投资收益	-	-

股指期货投资收益	-1,590.13	-
----------	-----------	---

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资产生的股利收益	2,898,860.34	4,057,567.18
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	2,898,860.34	4,057,567.18

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
1. 交易性金融资产	941,060.50	-17,576,979.10
——股票投资	941,060.50	-17,576,979.10
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	941,060.50	-17,576,979.10

7.4.7.21 其他收入

本报告期及上年度可比期间，本基金无其他收入。

7.4.7.22 信用减值损失

本报告期及上年度可比期间，本基金无信用减值损失。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
审计费用	27,000.00	27,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行划款费	9,021.97	10,177.07
开户费	-	-
交易费用	-	-
合计	156,021.97	157,177.07

7.4.7.24 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**

本报告期末本基金不存在需要说明的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截止本基金报告报出日，本基金不存在需要说明的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中航基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
中航证券有限公司	基金管理人股东、基金代销机构
北京首钢基金有限公司	基金管理人股东

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易**7.4.10.1.1 股票交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
中航证券有限公司	774,861,415.56	24.92%	797,415,772.57	19.59%

7.4.10.1.2 债券交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付 佣金总额的 比例
中航证券有限公司	567,294.18	24.81%	65.56	0.02%
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付 佣金总额的 比例
中航证券有限公司	583,145.08	19.59%	17,408.62	3.01%

注：①上述佣金按照市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取、并由券商承担的费用后的净额列示。

②该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,175,439.17	4,333,747.33
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,558,979.64	2,122,024.11
应支付基金管理人的净管理费	1,616,459.53	2,211,723.22

注：①计提标准：本基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.20% 的年费率计算。

管理费的计算方法如下：

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

H 为每日应付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

②计提方式与支付方式：基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前五个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

③本基金管理费由 1.50% 调整为 1.20%，自 2023 年 8 月 28 日起生效。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	529,239.90	722,291.20

注：①计提标准：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。

托管费的计算方法如下：

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

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

②计提方式与支付方式：基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人在次月初 3 个工作日内出具资金划款指令，基金托管人复核无误后于 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

③本基金托管费由 0.25% 调整为 0.20%，自 2023 年 8 月 28 日起生效。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中航量化阿尔法六个月持有 A	中航量化阿尔法六个月持有 C	合计
招商银行股份有限公司	-	967,287.22	967,287.22
中航基金管理有限公司	-	50.18	50.18
中航证券有限公司	-	18,216.60	18,216.60
合计	-	985,554.00	985,554.00
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中航量化阿尔法六个月持有 A	中航量化阿尔法六个月持有 C	合计
招商银行股份有限公司	-	1,246,245.92	1,246,245.92
中航基金管理有限公司	-	53.87	53.87
中航证券有限公司	-	31,372.00	31,372.00
合计	-	1,277,671.79	1,277,671.79

注：①计提标准：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.60% 年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

②计提方式与支付方式：基金销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人在次月初 3 个工作日内出具资金划款指令，基金托管人复核无误后于 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明**7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

本报告期及上年度可比期间，本基金均无转融通证券出借业务。

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

本报告期及上年度可比期间，本基金均无转融通证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间，基金管理人为运用自有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末，除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2023年1月1日至2023年12月31日		2022年1月1日至2022年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	15,588,231.66	92,515.78	25,912,265.80	121,716.95

注：包括活期存款，存在托管银行的定期存款，基金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算有限公司的证券交易结算资金，即结算备付金、交易保证金。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期间，本基金未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金（以下简称“量化阿尔法”）因投资管理需要，经投资决策委员会 2023 年第 14 次会议审议通过，投资了量化阿尔法托管人的关联方证券（上汽集团 600104.SH），交易采取集中竞价方式完成。

7.4.11 利润分配情况

根据本基金基金合同的相关规定，结合本基金实际运作情况，本报告期本基金未进行利润分配。

7.4.12 期末（2023 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注

601083	锦江 航运	2023 年 11 月 28 日	1-6 个 月(含)	网下配 售锁 定	11.25	11.85	297	3,341.25	3,519.45	-
601096	宏盛 华源	2023 年 12 月 15 日	1-6 个 月(含)	网下配 售锁 定	1.70	5.23	1,308	2,223.60	6,840.84	-
603004	鼎龙 科技	2023 年 12 月 20 日	1-6 个 月(含)	网下配 售锁 定	16.80	34.50	95	1,596.00	3,277.50	-
603062	麦加 芯彩	2023 年 10 月 31 日	1-6 个 月(含)	网下配 售锁 定	58.08	59.52	40	2,323.20	2,380.80	-
603075	热威 股份	2023 年 9 月 1 日	1-6 个 月(含)	网下配 售锁 定	23.10	23.32	81	1,871.10	1,888.92	-
603107	上海 汽配	2023 年 10 月 25 日	1-6 个 月(含)	网下配 售锁 定	14.23	21.96	127	1,807.21	2,788.92	-
603119	浙江 荣泰	2023 年 7 月 21 日	1-6 个 月(含)	网下配 售锁 定	15.32	23.86	113	1,731.16	2,696.18	-
603193	润本 股份	2023 年 10 月 9 日	1-6 个 月(含)	网下配 售锁 定	17.38	17.02	130	2,259.40	2,212.60	-
603231	索宝 蛋白	2023 年 12 月 6 日	1-6 个 月(含)	网下配 售锁 定	21.29	22.26	80	1,703.20	1,780.80	-
603270	金帝 股份	2023 年 8 月 25 日	1-6 个 月(含)	网下配 售锁 定	21.77	29.58	104	2,264.08	3,076.32	-
603273	天元 智能	2023 年 10 月 16 日	1-6 个 月(含)	网下配 售锁 定	9.50	20.45	170	1,615.00	3,476.50	-
603275	众辰 科技	2023 年 8 月 16 日	1-6 个 月(含)	网下配 售锁 定	49.97	39.70	62	3,098.14	2,461.40	-
603276	恒兴 新材	2023 年 9 月 18 日	1-6 个 月(含)	网下配 售锁 定	25.73	24.88	87	2,238.51	2,164.56	-
603296	华勤 技术	2023 年 8 月 1 日	1-6 个 月(含)	网下配 售锁 定	80.80	77.72	91	7,352.80	7,072.52	-
603373	安邦 护卫	2023 年 12 月 13 日	1-6 个 月(含)	网下配 售锁 定	19.10	40.47	77	1,470.70	3,116.19	-
688347	华虹 公司	2023 年 7 月 27 日	1-6 个 月(含)	网下配 售锁 定	52.00	42.04	5,948	309,296.00	250,053.92	-
688450	光格 科技	2023 年 7 月 17 日	1 个月 以 内 (含)	网下配 售锁 定	53.09	36.41	97	5,149.73	3,531.77	-
688548	广钢	2023 年 8	1-6 个	网下配	9.87	12.74	815	8,044.05	10,383.10	-

	气体	月 8 日	月(含)	售锁定							
688549	中巨芯	2023 年 8 月 30 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	5.18	8.09	1,172	6,070.96	9,481.48		-
688573	信宇人	2023 年 8 月 9 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	23.68	28.79	285	6,748.80	8,205.15		-
688582	芯动联科	2023 年 6 月 21 日	1 个月以内(含)	网下配售锁定	26.74	38.50	232	6,203.68	8,932.00		-
688591	泰凌微	2023 年 8 月 18 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	24.98	28.01	288	7,194.24	8,066.88		-
688592	司南导航	2023 年 8 月 7 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	50.50	50.52	205	10,352.50	10,356.60		-
688602	康鹏科技	2023 年 7 月 13 日	1 个月以内(含)	网下配售锁定	8.66	11.06	489	4,234.74	5,408.34		-
688603	天承科技	2023 年 6 月 30 日	1 个月以内(含)	网下配售锁定	55.00	74.10	108	5,940.00	8,002.80		-
688610	埃科光电	2023 年 7 月 10 日	1 个月以内(含)	网下配售锁定	73.33	50.97	158	11,586.14	8,053.26		-
688612	威迈斯	2023 年 7 月 19 日	1 个月以内(含)	网下配售锁定	47.29	37.94	113	5,343.77	4,287.22		-
688627	精智达	2023 年 7 月 11 日	1 个月以内(含)	网下配售锁定	46.77	87.67	130	6,080.10	11,397.10		-
688638	誉辰智能	2023 年 7 月 4 日	1 个月以内(含)	网下配售锁定	83.90	59.65	98	8,222.20	5,845.70		-
688646	逸飞激光	2023 年 7 月 21 日	1 个月以内(含)	网下配售锁定	46.80	36.06	132	6,177.60	4,759.92		-
688648	中邮科技	2023 年 11 月 6 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	15.18	24.91	286	4,341.48	7,124.26		-
688651	盛邦安全	2023 年 7 月 19 日	1 个月以内(含)	网下配售锁定	39.90	46.03	156	6,224.40	7,180.68		-
688652	京仪装备	2023 年 11 月 22 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	31.95	57.06	151	4,824.45	8,616.06		-
688653	康希通信	2023 年 11 月 10 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	10.50	18.86	433	4,546.50	8,166.38		-

688657	浩辰软件	2023年9月25日	1-6个月(含)	网下配售锁定	103.40	79.31	49	5,066.60	3,886.19	-
688671	碧兴物联	2023年8月2日	1-6个月(含)	网下配售锁定	36.12	34.29	218	7,874.16	7,475.22	-
688693	锴威特	2023年8月10日	1-6个月(含)	网下配售锁定	40.83	43.40	122	4,981.26	5,294.80	-
688702	盛科通信	2023年9月6日	1-6个月(含)	网下配售锁定	42.66	48.19	134	5,716.44	6,457.46	-
688716	中研股份	2023年9月13日	1-6个月(含)	网下配售锁定	29.66	36.38	150	4,449.00	5,457.00	-
688719	爱科赛博	2023年9月20日	1-6个月(含)	网下配售锁定	69.98	60.10	84	5,878.32	5,048.40	-
688720	艾森股份	2023年11月29日	1-6个月(含)	网下配售锁定	28.03	57.51	151	4,232.53	8,684.01	-
301172	君逸数码	2023年7月19日	1个月内(含)	网下配售锁定	31.33	38.14	302	9,461.66	11,518.28	-
301210	金杨股份	2023年6月21日	1个月内(含)	网下配售锁定	57.88	45.30	150	8,682.00	6,795.00	-
301251	威尔高	2023年8月30日	1-6个月(含)	网下配售锁定	28.88	34.64	186	5,371.68	6,443.04	-
301261	恒工精密	2023年6月29日	1个月内(含)	网下配售锁定	36.90	50.81	133	4,907.70	6,757.73	-
301272	英华特	2023年7月6日	1个月内(含)	网下配售锁定	51.39	53.34	125	6,423.75	6,667.50	-
301291	明阳电气	2023年6月21日	1个月内(含)	网下配售锁定	38.13	28.28	277	10,562.01	7,833.56	-
301292	海科新源	2023年6月29日	1个月内(含)	网下配售锁定	19.99	19.34	377	7,536.23	7,291.18	-
301329	信音电子	2023年7月5日	1个月内(含)	网下配售锁定	21.00	22.21	288	6,048.00	6,396.48	-
301348	蓝箭电子	2023年8月1日	1-6个月(含)	网下配售锁定	18.08	44.55	380	6,870.40	16,929.00	-
301362	民爆光电	2023年7月27日	1-6个月(含)	网下配售锁定	51.05	38.51	189	9,648.45	7,278.39	-
301370	国科	2023年7月	1个月	网下配	13.39	16.00	643	8,609.77	10,288.00	-

	恒泰	月 3 日	以 内 (含)	售锁定							
301371	敷尔佳	2023 年 7 月 24 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	55.68	37.55	113	6,291.84	4,243.15	-	
301372	科净源	2023 年 8 月 3 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	45.00	43.58	190	8,550.00	8,280.20	-	
301381	赛维时代	2023 年 7 月 5 日	1 个月以 内 (含)	网下配售锁定	20.45	29.67	405	8,282.25	12,016.35	-	
301393	昊帆生物	2023 年 7 月 5 日	1 个月以 内 (含)	网下配售锁定	67.68	59.34	93	6,294.24	5,518.62	-	
301395	仁信新材	2023 年 6 月 21 日	1 个月以 内 (含)	网下配售锁定	26.68	18.67	308	8,217.44	5,750.36	-	
301413	安培龙	2023 年 12 月 11 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	33.25	70.25	143	4,754.75	10,045.75	-	
301418	协昌科技	2023 年 8 月 10 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	51.88	50.22	114	5,914.32	5,725.08	-	
301421	波长光电	2023 年 8 月 16 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	29.38	59.36	226	6,639.88	13,415.36	-	
301456	盘古智能	2023 年 7 月 6 日	1 个月以 内 (含)	网下配售锁定	37.96	30.38	174	6,605.04	5,286.12	-	
301459	丰茂股份	2023 年 12 月 6 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	31.90	44.48	141	4,497.90	6,271.68	-	
301468	博盈特焊	2023 年 7 月 12 日	1 个月以 内 (含)	网下配售锁定	47.58	30.21	218	10,372.44	6,585.78	-	
301469	恒达新材	2023 年 8 月 10 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	36.58	33.10	196	7,169.68	6,487.60	-	
301486	致尚科技	2023 年 6 月 30 日	1 个月以 内 (含)	网下配售锁定	57.66	47.20	145	8,360.70	6,844.00	-	
301487	盟固利	2023 年 8 月 1 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	5.32	40.95	867	4,612.44	35,503.65	-	
301488	豪恩汽电	2023 年 6 月 26 日	1 个月以 内 (含)	网下配售锁定	39.78	69.04	180	7,160.40	12,427.20	-	
301489	思泉新材	2023 年 10 月 16 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	41.66	67.77	100	4,166.00	6,777.00	-	

301498	乖宝宠物	2023年8月9日	1-6个月(含)	网下配售锁定	39.99	38.80	181	7,238.19	7,022.80	-
301499	维科精密	2023年7月13日	1个月以内(含)	网下配售锁定	19.50	28.91	338	6,591.00	9,771.58	-
301500	飞南资源	2023年9月13日	1-6个月(含)	网下配售锁定	23.97	20.89	216	5,177.52	4,512.24	-
301505	苏州规划	2023年7月12日	1个月以内(含)	网下配售锁定	26.35	35.79	191	5,032.85	6,835.89	-
301507	民生健康	2023年8月24日	1-6个月(含)	网下配售锁定	10.00	15.85	446	4,460.00	7,069.10	-
301508	中机认检	2023年11月23日	1-6个月(含)	网下配售锁定	16.82	32.25	257	4,322.74	8,288.25	-
301510	固高科技	2023年8月4日	1-6个月(含)	网下配售锁定	12.00	35.00	396	4,752.00	13,860.00	-
301511	德福科技	2023年8月8日	1-6个月(含)	网下配售锁定	28.00	22.67	281	7,868.00	6,370.27	-
301515	港通医疗	2023年7月13日	1个月以内(含)	网下配售锁定	31.16	28.26	166	5,172.56	4,691.16	-
301516	中远通	2023年12月1日	1-6个月(含)	网下配售锁定	6.87	20.07	543	3,730.41	10,898.01	-
301517	陕西华达	2023年10月9日	1-6个月(含)	网下配售锁定	26.87	51.90	132	3,546.84	6,850.80	-
301519	舜禹股份	2023年7月19日	1个月以内(含)	网下配售锁定	20.93	20.20	293	6,132.49	5,918.60	-
301520	万邦医药	2023年9月18日	1-6个月(含)	网下配售锁定	67.88	52.74	77	5,226.76	4,060.98	-
301525	儒竞科技	2023年8月23日	1-6个月(含)	网下配售锁定	99.57	81.46	58	5,775.06	4,724.68	-
301526	国际复材	2023年12月19日	1-6个月(含)	网下配售锁定	2.66	5.26	2,764	7,352.24	14,538.64	-
301528	多浦乐	2023年8月17日	1-6个月(含)	网下配售锁定	71.80	68.86	83	5,959.40	5,715.38	-
301529	福赛科技	2023年8月31日	1-6个月(含)	网下配售锁定	36.60	37.88	115	4,209.00	4,356.20	-
301533	威马农机	2023年8月7日	1-6个月(含)	网下配售锁定	29.50	33.15	202	5,959.00	6,696.30	-
301548	崇德	2023年9月	1-6个月(含)	网下配售锁定	66.80	59.03	67	4,475.60	3,955.01	-

	科技	月 11 日	月(含)	售锁定							
301550	斯菱股份	2023 年 9 月 6 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	37.56	43.58	125	4,695.00	5,447.50	-	
301555	惠柏新材	2023 年 10 月 24 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	22.88	39.68	218	4,987.84	8,650.24	-	
301558	三态股份	2023 年 9 月 21 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	7.33	13.67	700	5,131.00	9,569.00	-	
301559	中集环科	2023 年 9 月 26 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	24.22	18.25	233	5,643.26	4,252.25	-	
301566	达利凯普	2023 年 12 月 22 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	8.90	27.95	484	4,307.60	13,527.80	-	
301568	思泰克	2023 年 11 月 21 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	23.23	43.26	168	3,902.64	7,267.68	-	
301578	辰奕智能	2023 年 12 月 21 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	48.94	74.43	91	4,453.54	6,773.13	-	
001239	永达股份	2023 年 12 月 4 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	12.05	21.94	166	2,000.30	3,642.04	-	
001306	夏厦精密	2023 年 11 月 9 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	53.63	84.62	36	1,930.68	3,046.32	-	
001326	联域股份	2023 年 11 月 1 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	41.18	51.74	70	2,882.60	3,621.80	-	
001358	兴欣新材	2023 年 12 月 14 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	41.00	46.28	54	2,214.00	2,499.12	-	
001378	德冠新材	2023 年 10 月 23 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	31.68	36.39	121	3,833.28	4,403.19	-	
688717	艾罗能源	2023 年 12 月 26 日	2 个交易日	新股流通受限	55.66	55.66	3,816	212,398.56	212,398.56	-	

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
300096	ST 易联众	2023 年 12 月 29 日	重大事项	6.82	2024 年 1 月 2 日	5.46	24,900	173,378.43	169,818.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本报告期末本基金未持有银行间市场债券正回购。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本报告期末本基金未持有交易所市场债券正回购。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本报告期末本基金无转融通证券出借业务。

7.4.13 金融工具风险及管理

本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目的是在严格控制风险的前提下，力求实现基金资产的长期稳定增长的投资目标。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理办法主要通过定性分析和定量分析的方法去评估各种风险发生的可能损失。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。

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人董事会重视建立完善的公司治理结构与内部控制体系。

董事会对公司风险管理负有最终责任，董事会下设合规及风险管理委员会与督察长。合规及风险管理委员会主要负责审核和指导公司的风险管理政策，对公司的整体风险水平、风险控制措施的实施情况进行评价。督察长负责组织指导公司监察稽核工作，监督检查受托资产和公司运作的合法合规情况及公司内部风险控制情况。

经营管理层负责风险管理政策、风险控制措施的制定和落实，经营管理层下设风险控制委员会。风险控制委员会主要负责审议风险管理制度和流程，处置重大风险事件，促进风险管理文化的形成。

监察稽核部和风险管理部是公司内部控制的职能部门。各职能部门负责从经营管理的各环节上贯彻落实风险管理措施，执行风险识别、风险测量、风险控制、风险评价和风险报告等风险管理程序，并持续完善相应的内部控制制度和流程。

7.4.13.2 信用风险

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

基金的货币资金存放在托管人和其他具有基金托管资格的股份制商业银行，与该货币资金相关的信用风险不重大。基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，不投资短期信用评级在 A-1 级以下或长期信用评级在 BBB 级以下的债券，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及同业存单。

于本报告期末，本基金未持有资产支持证券（上年末：无）。

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

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本报告期末及上年度末，本基金未持有短期信用评级的债券。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本报告期末及上年度末，本基金未持有短期信用评级的资产支持证券。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本期报告末及上年度末，本基金未持有短期信用评级的同业存单。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本报告期末及上年度末，本基金未持有长期信用评级的债券。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本报告期末及上年度末，本基金未持有长期信用评级的资产支持证券。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本报告期末及上年度末，本基金未持有长期信用评级的同业存单。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可于开放日要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资

品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

于本报告期末，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，

以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为货币资金、结算备付金、存出保证金等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	14,530,643.47	-	-	-	14,530,643.47
结算备付金	1,032,044.38	-	-	-	1,032,044.38
存出保证金	25,543.81	-	-	-	25,543.81
交易性金融资产	-	-	-	170,644,205.42	170,644,205.42
应收清算款	-	-	-	1,904,442.60	1,904,442.60
资产总计	15,588,231.66	-	-	172,548,648.02	188,136,879.68
负债					
应付清算款	-	-	-	640,392.20	640,392.20

应付赎回款	-	-	-	396,633.22	396,633.22
应付管理人报酬	-	-	-	188,334.93	188,334.93
应付托管费	-	-	-	31,389.17	31,389.17
应付销售服务费	-	-	-	67,677.64	67,677.64
其他负债	-	-	-	554,855.95	554,855.95
负债总计	-	-	-	1,879,283.11	1,879,283.11
利率敏感度缺口	15,588,231.66	-	-	-170,669,364.91	186,257,596.57
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	25,035,276.81	-	-	-	25,035,276.81
结算备付金	839,918.61	-	-	-	839,918.61
存出保证金	37,070.38	-	-	-	37,070.38
交易性金融资产	-	-	-	-223,129,751.45	223,129,751.45
应收清算款	-	-	-	1,420,480.87	1,420,480.87
应收申购款	-	-	-	2.00	2.00
资产总计	25,912,265.80	-	-	-224,550,234.32	250,462,500.12
负债					
应付清算款	-	-	-	586,337.60	586,337.60
应付赎回款	-	-	-	1,114.22	1,114.22
应付管理人报酬	-	-	-	329,359.18	329,359.18
应付托管费	-	-	-	54,893.20	54,893.20
应付销售服务费	-	-	-	97,159.98	97,159.98
其他负债	-	-	-	725,472.44	725,472.44
负债总计	-	-	-	1,794,336.62	1,794,336.62
利率敏感度缺口	25,912,265.80	-	-	-222,755,897.70	248,668,163.50

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

于本报告期末，若市场利率上升或者下降 25 个基点且其他市场变量保持不变，本基金资产净值将不会产生重大变动。

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，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	170,644,205.42	91.62	223,129,751.45	89.73
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	170,644,205.42	91.62	223,129,751.45	89.73

注：本表中交易性金融资产-债券投资科目仅包含可转换公司债券和可交换公司债券等。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023 年 12 月 31 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	9,848,472.95	13,232,059.62
	业绩比较基准下降 5%	-9,848,472.95	-13,232,059.62

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	169,498,685.64	222,221,274.05

第二层次	212,398.56	-
第三层次	933,121.22	908,477.40
合计	170,644,205.42	223,129,751.45

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至 2023年12月31日			
	交易性金融资产			合计
	债券投资	股票投资	基金投资	
期初余额	-	908,477.40	-	908,477.40
当期购买	-	1,591,327.34	-	1,591,327.34
当期出售/结算	-	-	-	-
转入第三层次	-	-	-	-
转出第三层次	-	1,770,910.43	-	1,770,910.43
当期利得或损失总额	-	204,226.91	-	204,226.91
其中：计入损益的利得或损失	-	204,226.91	-	204,226.91
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-	-
期末余额	-	933,121.22	-	933,121.22
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	-	90,471.85	-	90,471.85
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至 2022年12月31日			
	交易性金融资产			合计
	债券投资	股票投资	基金投资	
期初余额	-	-	-	-
当期购买	-	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-	-
转入第三层次	-	2,892,083.59	-	2,892,083.59

转出第三层次	-	1,869,851.13	-	1,869,851.13
当期利得或损失总额	-	-113,755.06	-	-113,755.06
其中：计入损益的利得或损失	-	-113,755.06	-	-113,755.06
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-	-
期末余额	-	908,477.40	-	908,477.40
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	-	-113,755.06	-	-113,755.06

于 2023 年 12 月 31 日，本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。于 2023 年度，本基金转入/转出第三层次的交易性金融资产均为限售期开始/结束的股票投资。

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

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

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流通受限股票	933,121.22	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.1476-1.5417	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流通受限股票	908,477.40	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.1909-0.8792	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 12 月 31 日，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

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	170,644,205.42	90.70
	其中：股票	170,644,205.42	90.70
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	15,562,687.85	8.27
8	其他各项资产	1,929,986.41	1.03
9	合计	188,136,879.68	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

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,231,472.00	0.66
B	采矿业	3,558,032.00	1.91
C	制造业	118,997,061.59	63.89
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,277,279.00	1.76
E	建筑业	5,405,803.00	2.90
F	批发和零售业	1,800,733.75	0.97
G	交通运输、仓储和邮政业	1,468,286.45	0.79
H	住宿和餐饮业	177,130.00	0.10
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,213,260.13	3.34
J	金融业	16,946,726.40	9.10
K	房地产业	3,339,689.00	1.79
L	租赁和商务服务业	347,797.19	0.19
M	科学研究和技术服务业	2,615,727.29	1.40

N	水利、环境和公共设施管理业	1,488,827.50	0.80
O	居民服务、修理和其他服务业	171,118.00	0.09
P	教育	32,232.00	0.02
Q	卫生和社会工作	1,980,986.48	1.06
R	文化、体育和娱乐业	1,310,541.64	0.70
S	综合	281,502.00	0.15
	合计	170,644,205.42	91.62

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本报告期末本基金未持有港股通股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	1,400	2,416,400.00	1.30
2	002594	比亚迪	11,200	2,217,600.00	1.19
3	300760	迈瑞医疗	6,200	1,801,720.00	0.97
4	300274	阳光电源	19,100	1,672,969.00	0.90
5	000858	五粮液	11,600	1,627,596.00	0.87
6	000333	美的集团	29,400	1,606,122.00	0.86
7	600887	伊利股份	53,700	1,436,475.00	0.77
8	000568	泸州老窖	8,000	1,435,360.00	0.77
9	000651	格力电器	43,700	1,405,829.00	0.75
10	600690	海尔智家	62,700	1,316,700.00	0.71
11	002371	北方华创	4,900	1,203,979.00	0.65
12	002304	洋河股份	10,800	1,186,920.00	0.64
13	600809	山西汾酒	5,100	1,176,723.00	0.63
14	603501	韦尔股份	10,500	1,120,455.00	0.60
15	300015	爱尔眼科	66,264	1,048,296.48	0.56
16	600276	恒瑞医药	21,300	963,399.00	0.52
17	300003	乐普医疗	59,500	961,520.00	0.52
18	600919	江苏银行	141,800	948,642.00	0.51
19	603259	药明康德	13,000	945,880.00	0.51
20	688390	固德威	7,202	940,437.16	0.50
21	600763	通策医疗	12,200	932,690.00	0.50
22	300122	智飞生物	14,600	892,206.00	0.48
23	002966	苏州银行	137,140	885,924.40	0.48
24	000661	长春高新	5,700	831,060.00	0.45

25	601166	兴业银行	50,800	823,468.00	0.44
26	600030	中信证券	40,400	822,948.00	0.44
27	601658	邮储银行	187,800	816,930.00	0.44
28	300782	卓胜微	5,700	803,700.00	0.43
29	600926	杭州银行	79,700	797,797.00	0.43
30	600908	无锡银行	154,400	779,720.00	0.42
31	002807	江阴银行	211,000	749,050.00	0.40
32	600085	同仁堂	13,900	746,430.00	0.40
33	002142	宁波银行	37,100	746,081.00	0.40
34	000001	平安银行	79,300	744,627.00	0.40
35	601009	南京银行	100,800	743,904.00	0.40
36	601012	隆基绿能	31,540	722,266.00	0.39
37	600600	青岛啤酒	9,500	710,125.00	0.38
38	600132	重庆啤酒	10,600	704,370.00	0.38
39	300763	锦浪科技	10,050	702,495.00	0.38
40	600161	天坛生物	22,500	696,150.00	0.37
41	600737	中粮糖业	83,900	691,336.00	0.37
42	600745	闻泰科技	16,300	689,653.00	0.37
43	601318	中国平安	17,100	689,130.00	0.37
44	605117	德业股份	8,100	679,590.00	0.36
45	603688	石英股份	7,800	677,664.00	0.36
46	600703	三安光电	48,000	664,800.00	0.36
47	601688	华泰证券	47,600	664,020.00	0.36
48	688276	百克生物	12,018	658,706.58	0.35
49	600150	中国船舶	22,200	653,568.00	0.35
50	300394	天孚通信	7,100	649,792.00	0.35
51	300827	上能电气	21,456	649,258.56	0.35
52	688223	晶科能源	71,420	632,781.20	0.34
53	300568	星源材质	40,700	627,594.00	0.34
54	300347	泰格医药	11,400	626,658.00	0.34
55	603063	禾望电气	25,000	625,000.00	0.34
56	002335	科华数据	22,400	620,032.00	0.33
57	600584	长电科技	20,100	600,186.00	0.32
58	601058	赛轮轮胎	50,800	596,900.00	0.32
59	300896	爱美客	1,900	559,227.00	0.30
60	601958	金铂股份	57,300	541,485.00	0.29
61	601636	旗滨集团	77,800	532,152.00	0.29
62	002291	遥望科技	56,100	526,218.00	0.28
63	600867	通化东宝	48,200	522,006.00	0.28

64	688772	珠海冠宇	23,634	520,184.34	0.28
65	300316	晶盛机电	11,700	515,853.00	0.28
66	002252	上海莱士	64,300	514,400.00	0.28
67	300808	久量股份	33,000	514,140.00	0.28
68	600487	亨通光电	42,800	511,032.00	0.27
69	002850	科达利	6,000	506,760.00	0.27
70	688169	石头科技	1,770	500,821.50	0.27
71	601668	中国建筑	103,100	495,911.00	0.27
72	600893	航发动力	13,200	493,416.00	0.26
73	601211	国泰君安	32,700	486,576.00	0.26
74	300498	温氏股份	24,100	483,446.00	0.26
75	002714	牧原股份	11,700	481,806.00	0.26
76	603517	绝味食品	17,800	478,108.00	0.26
77	603893	瑞芯微	7,500	475,500.00	0.26
78	603027	千禾味业	29,400	475,398.00	0.26
79	603876	鼎胜新材	37,760	473,132.80	0.25
80	002812	恩捷股份	8,300	471,606.00	0.25
81	601989	中国重工	112,900	466,277.00	0.25
82	002518	科士达	16,300	449,880.00	0.24
83	300842	帝科股份	6,300	444,465.00	0.24
84	002739	万达电影	33,982	442,445.64	0.24
85	300286	安科瑞	17,000	440,810.00	0.24
86	688348	昱能科技	3,593	439,711.34	0.24
87	300217	东方电热	81,400	437,932.00	0.24
88	603611	诺力股份	23,100	437,283.00	0.23
89	688226	威腾电气	23,160	435,408.00	0.23
90	601137	博威合金	28,000	434,840.00	0.23
91	002625	光启技术	29,400	434,532.00	0.23
92	002138	顺络电子	16,000	432,160.00	0.23
93	300118	东方日升	24,400	430,660.00	0.23
94	000631	顺发恒业	129,500	429,940.00	0.23
95	002121	科陆电子	76,600	429,726.00	0.23
96	601390	中国中铁	75,500	428,840.00	0.23
97	300888	稳健医疗	11,400	424,650.00	0.23
98	688002	睿创微纳	9,573	423,318.06	0.23
99	603290	斯达半导	2,300	416,300.00	0.22
100	600048	保利发展	41,900	414,810.00	0.22
101	300376	易事特	64,400	410,228.00	0.22
102	601186	中国铁建	53,700	408,657.00	0.22

103	002074	国轩高科	18,900	406,350.00	0.22
104	600970	中材国际	43,500	406,290.00	0.22
105	300014	亿纬锂能	9,600	405,120.00	0.22
106	300750	宁德时代	2,480	404,884.80	0.22
107	000728	国元证券	58,900	402,287.00	0.22
108	300866	安克创新	4,500	398,700.00	0.21
109	600707	彩虹股份	58,800	396,900.00	0.21
110	600066	宇通客车	29,200	386,900.00	0.21
111	300558	贝达药业	7,500	386,625.00	0.21
112	688005	容百科技	9,691	385,701.80	0.21
113	002007	华兰生物	17,400	385,062.00	0.21
114	601618	中国中冶	125,600	384,336.00	0.21
115	688599	天合光能	13,466	384,184.98	0.21
116	600109	国金证券	40,000	363,200.00	0.19
117	300529	健帆生物	16,300	362,349.00	0.19
118	000738	航发控制	18,200	362,180.00	0.19
119	002025	航天电器	7,400	355,348.00	0.19
120	601788	光大证券	22,900	353,118.00	0.19
121	688188	柏楚电子	1,395	353,088.45	0.19
122	002459	晶澳科技	16,844	349,007.68	0.19
123	300478	杭州高新	27,300	345,072.00	0.19
124	000997	新大陆	17,500	343,175.00	0.18
125	002738	中矿资源	9,168	342,058.08	0.18
126	600549	厦门钨业	19,643	337,466.74	0.18
127	300073	当升科技	8,800	336,160.00	0.18
128	601985	中国核电	43,400	325,500.00	0.17
129	000960	锡业股份	22,700	325,064.00	0.17
130	605167	利柏特	34,200	324,558.00	0.17
131	002521	齐峰新材	39,000	322,530.00	0.17
132	601138	工业富联	20,800	314,496.00	0.17
133	688516	奥特维	3,464	313,492.00	0.17
134	002683	广东宏大	15,600	313,248.00	0.17
135	605377	华旺科技	16,400	313,076.00	0.17
136	600988	赤峰黄金	22,300	312,423.00	0.17
137	600481	双良节能	36,900	312,174.00	0.17
138	002986	宇新股份	20,000	312,000.00	0.17
139	600792	云煤能源	66,800	311,288.00	0.17
140	002558	巨人网络	27,900	310,806.00	0.17
141	000975	银泰黄金	20,700	310,500.00	0.17

142	002185	华天科技	36,383	309,983.16	0.17
143	002156	通富微电	13,400	309,808.00	0.17
143	300285	国瓷材料	13,400	309,808.00	0.17
144	601966	玲珑轮胎	16,100	309,603.00	0.17
145	603093	南华期货	25,800	309,600.00	0.17
146	002532	天山铝业	51,400	308,914.00	0.17
147	600502	安徽建工	66,300	308,295.00	0.17
148	002223	鱼跃医疗	8,900	307,762.00	0.17
149	601128	常熟银行	48,100	307,359.00	0.17
150	600497	驰宏锌锗	60,500	305,525.00	0.16
151	000776	广发证券	21,200	302,948.00	0.16
152	000589	贵州轮胎	49,500	302,940.00	0.16
153	603338	浙江鼎力	5,900	301,903.00	0.16
154	000973	佛塑科技	61,700	301,713.00	0.16
155	600732	爱旭股份	17,020	300,232.80	0.16
156	600535	天士力	17,600	299,552.00	0.16
157	002939	长城证券	37,400	299,200.00	0.16
158	002296	辉煌科技	36,200	298,650.00	0.16
159	000612	焦作万方	51,900	298,425.00	0.16
160	301149	隆华新材	24,100	298,117.00	0.16
161	688556	高测股份	7,634	297,649.66	0.16
162	002393	力生制药	11,400	297,540.00	0.16
163	000990	诚志股份	36,200	297,202.00	0.16
164	601163	三角轮胎	20,600	296,846.00	0.16
165	603225	新风鸣	20,900	296,780.00	0.16
166	600251	冠农股份	34,000	295,460.00	0.16
167	600094	大名城	97,700	293,100.00	0.16
168	002028	思源电气	5,600	291,424.00	0.16
169	300144	宋城演艺	29,500	291,165.00	0.16
170	600985	淮北矿业	17,500	291,025.00	0.16
171	300850	新强联	9,100	289,653.00	0.16
172	601899	紫金矿业	23,100	287,826.00	0.15
173	601633	长城汽车	11,400	287,508.00	0.15
174	300001	特锐德	14,300	287,430.00	0.15
175	000563	陕国投 A	94,300	286,672.00	0.15
176	600675	中华企业	90,800	286,020.00	0.15
177	002051	中工国际	35,200	285,824.00	0.15
178	002941	新疆交建	21,900	285,138.00	0.15
179	600853	龙建股份	66,600	284,382.00	0.15

180	603613	国联股份	12,900	283,929.00	0.15
181	000928	中钢国际	48,700	283,921.00	0.15
182	300251	光线传媒	34,800	283,620.00	0.15
183	600248	陕建股份	70,400	283,008.00	0.15
184	000065	北方国际	25,100	281,622.00	0.15
185	601233	桐昆股份	18,500	279,905.00	0.15
186	600900	长江电力	11,900	277,746.00	0.15
187	600153	建发股份	28,800	277,344.00	0.15
188	688234	天岳先进	4,160	274,851.20	0.15
189	002460	赣锋锂业	6,400	273,920.00	0.15
190	002045	国光电器	16,400	273,060.00	0.15
191	002244	滨江集团	37,400	271,898.00	0.15
192	600369	西南证券	66,400	271,576.00	0.15
193	603929	亚翔集成	11,300	270,296.00	0.15
194	300390	天华新能	10,630	269,470.50	0.14
195	002466	天齐锂业	4,800	267,792.00	0.14
196	300350	华鹏飞	52,200	267,786.00	0.14
197	003002	壶化股份	17,500	265,825.00	0.14
198	000543	皖能电力	42,400	265,424.00	0.14
199	002697	红旗连锁	53,000	263,940.00	0.14
200	688208	道通科技	11,065	262,793.75	0.14
201	603185	弘元绿能	7,821	260,282.88	0.14
202	600958	东方证券	29,600	257,520.00	0.14
203	603650	彤程新材	7,700	256,410.00	0.14
204	603160	汇顶科技	3,700	255,670.00	0.14
205	688099	晶晨股份	4,081	255,593.03	0.14
206	002653	海思科	11,000	254,650.00	0.14
207	300395	菲利华	6,850	250,436.00	0.13
208	688347	华虹公司	5,948	250,053.92	0.13
209	600901	江苏金租	51,500	249,260.00	0.13
210	002064	华峰化学	37,100	248,941.00	0.13
211	603712	七一二	7,900	248,929.00	0.13
212	600089	特变电工	17,930	247,434.00	0.13
213	002032	苏泊尔	4,600	243,846.00	0.13
214	600808	马钢股份	89,100	242,352.00	0.13
215	300535	达威股份	13,800	241,638.00	0.13
216	688082	盛美上海	2,310	241,187.10	0.13
217	600438	通威股份	9,600	240,288.00	0.13
218	603885	吉祥航空	19,800	237,600.00	0.13

219	000002	万科 A	22,700	237,442.00	0.13
220	603568	伟明环保	14,800	236,800.00	0.13
221	002568	百润股份	9,600	236,256.00	0.13
222	000733	振华科技	4,000	235,360.00	0.13
223	688680	海优新材	3,576	234,764.40	0.13
224	688129	东来技术	14,183	234,728.65	0.13
225	600383	金地集团	53,800	234,568.00	0.13
226	600529	山东药玻	9,100	232,960.00	0.13
227	301269	华大九天	2,200	232,870.00	0.13
228	600309	万华化学	3,000	230,460.00	0.12
229	688560	明冠新材	12,225	227,629.50	0.12
230	002623	亚玛顿	8,500	227,375.00	0.12
231	601908	京运通	49,700	227,129.00	0.12
232	603087	甘李药业	4,300	226,395.00	0.12
233	301207	华兰疫苗	8,100	225,180.00	0.12
234	002563	森马服饰	38,600	222,722.00	0.12
235	600905	三峡能源	50,900	222,433.00	0.12
236	600482	中国动力	12,300	221,523.00	0.12
237	002415	海康威视	6,300	218,736.00	0.12
238	002555	三七互娱	11,600	218,196.00	0.12
239	002865	钧达股份	2,800	216,944.00	0.12
240	688717	艾罗能源	3,816	212,398.56	0.11
241	002648	卫星化学	14,300	210,925.00	0.11
242	002572	索菲亚	13,200	210,540.00	0.11
243	688122	西部超导	3,935	209,460.05	0.11
244	603315	福鞍股份	14,400	209,232.00	0.11
245	600517	国网英大	43,400	207,018.00	0.11
246	000729	燕京啤酒	23,900	206,257.00	0.11
247	688567	孚能科技	12,589	205,326.59	0.11
248	300207	欣旺达	13,800	203,688.00	0.11
249	300035	中科电气	19,300	203,422.00	0.11
250	002998	优彩资源	25,300	201,135.00	0.11
251	300890	翔丰华	5,800	200,564.00	0.11
252	600493	凤竹纺织	29,800	200,256.00	0.11
253	300253	卫宁健康	27,800	199,882.00	0.11
254	300724	捷佳伟创	2,700	199,827.00	0.11
255	603659	璞泰来	9,535	199,567.55	0.11
256	600909	华安证券	40,700	198,616.00	0.11
257	600884	杉杉股份	14,565	198,375.30	0.11

258	300487	蓝晓科技	3,700	196,322.00	0.11
259	688036	传音控股	1,412	195,420.80	0.10
260	603221	爱丽家居	19,600	194,824.00	0.10
261	301156	美农生物	10,300	194,258.00	0.10
262	300009	安科生物	19,000	194,180.00	0.10
263	002465	海格通信	15,100	194,035.00	0.10
264	000725	京东方 A	49,600	193,440.00	0.10
264	600062	华润双鹤	10,400	193,440.00	0.10
265	002268	电科网安	8,600	193,156.00	0.10
266	002299	圣农发展	11,100	190,698.00	0.10
267	000089	深圳机场	29,300	188,399.00	0.10
268	601717	郑煤机	14,600	184,690.00	0.10
269	688127	蓝特光学	7,920	184,456.80	0.10
270	301257	普蕊斯	2,900	184,150.00	0.10
271	688072	拓荆科技	792	183,189.60	0.10
272	300860	锋尚文化	3,300	180,279.00	0.10
273	002129	TCL 中环	11,525	180,251.00	0.10
274	300450	先导智能	7,000	179,200.00	0.10
275	300936	中英科技	4,200	179,046.00	0.10
276	603127	昭衍新药	7,500	177,825.00	0.10
277	002867	周大生	11,700	177,606.00	0.10
278	002608	江苏国信	27,000	177,390.00	0.10
279	002463	沪电股份	8,000	176,960.00	0.10
280	002429	兆驰股份	31,700	176,886.00	0.09
281	600061	国投资本	26,200	176,588.00	0.09
282	300902	国安达	5,000	176,250.00	0.09
283	688618	三旺通信	3,000	175,800.00	0.09
284	300638	广和通	9,200	175,076.00	0.09
285	688059	华锐精密	2,220	174,736.20	0.09
286	002919	名臣健康	6,800	174,352.00	0.09
287	603989	艾华集团	8,100	174,312.00	0.09
288	688628	优利德	4,417	174,029.80	0.09
289	601611	中国核建	25,100	173,943.00	0.09
290	688619	罗普特	12,363	173,823.78	0.09
291	688793	倍轻松	5,160	173,634.00	0.09
292	605100	华丰股份	10,900	173,419.00	0.09
293	600854	春兰股份	32,900	173,383.00	0.09
294	688398	赛特新材	5,474	172,978.40	0.09
295	688368	晶丰明源	1,600	172,704.00	0.09

296	300870	欧陆通	3,900	172,653.00	0.09
297	603383	顶点软件	3,500	172,550.00	0.09
298	600212	绿能慧充	24,000	172,320.00	0.09
299	001207	联科科技	10,100	172,205.00	0.09
300	603897	长城科技	8,400	172,032.00	0.09
301	300719	安达维尔	12,900	171,957.00	0.09
302	688379	华光新材	8,697	171,939.69	0.09
303	603699	纽威股份	12,400	171,864.00	0.09
304	688511	天微电子	5,453	171,605.91	0.09
305	688607	康众医疗	8,419	171,579.22	0.09
306	688100	威胜信息	5,929	171,466.68	0.09
307	300851	交大思诺	5,500	171,435.00	0.09
308	300736	百邦科技	13,400	171,118.00	0.09
309	002641	公元股份	34,000	171,020.00	0.09
310	002581	未名医药	11,700	170,820.00	0.09
311	600215	派斯林	20,000	170,800.00	0.09
312	301036	双乐股份	7,700	170,709.00	0.09
313	600510	黑牡丹	30,200	170,630.00	0.09
314	688109	品茗科技	6,054	170,541.18	0.09
315	688510	航亚科技	9,676	170,491.12	0.09
316	600486	扬农化工	2,700	170,424.00	0.09
317	002170	芭田股份	30,700	170,385.00	0.09
318	002588	史丹利	26,700	170,346.00	0.09
319	002731	萃华珠宝	15,400	170,324.00	0.09
320	688325	赛微微电	4,341	170,123.79	0.09
321	000066	中国长城	16,800	170,016.00	0.09
322	300243	瑞丰高材	17,400	169,998.00	0.09
323	002852	道道全	15,700	169,874.00	0.09
324	300096	ST 易联众	24,900	169,818.00	0.09
325	000426	兴业银锡	18,700	169,796.00	0.09
325	002171	楚江新材	22,700	169,796.00	0.09
326	003038	鑫铂股份	4,940	169,689.00	0.09
327	000888	峨眉山 A	19,000	169,670.00	0.09
328	605222	起帆电缆	8,800	169,664.00	0.09
329	002283	天润工业	29,000	169,650.00	0.09
330	002159	三特索道	11,100	169,386.00	0.09
331	603208	江山欧派	5,700	169,233.00	0.09
332	605007	五洲特纸	11,500	169,165.00	0.09
333	600435	北方导航	14,400	169,056.00	0.09

334	300905	宝丽迪	8,700	168,606.00	0.09
335	688466	金科环境	9,498	168,589.50	0.09
336	002753	永东股份	20,400	168,300.00	0.09
337	301046	能辉科技	6,200	168,144.00	0.09
338	600531	豫光金铅	27,700	167,585.00	0.09
339	000061	农产品	25,900	167,573.00	0.09
340	000680	山推股份	33,900	167,466.00	0.09
341	600545	卓郎智能	62,200	167,318.00	0.09
342	002208	合肥城建	26,100	167,301.00	0.09
343	600346	恒力石化	12,700	167,259.00	0.09
344	605158	华达新材	22,000	167,200.00	0.09
345	688669	聚石化学	8,912	167,010.88	0.09
346	000797	中国武夷	55,800	166,842.00	0.09
347	002016	世荣兆业	26,500	166,685.00	0.09
348	688332	中科蓝讯	2,200	165,924.00	0.09
349	600696	岩石股份	9,200	165,508.00	0.09
350	688310	迈得医疗	5,507	164,659.30	0.09
351	688257	新锐股份	6,554	164,112.16	0.09
352	300040	九洲集团	28,900	161,840.00	0.09
353	001203	大中矿业	15,900	161,703.00	0.09
354	688281	华秦科技	1,188	161,164.08	0.09
355	601021	春秋航空	3,200	160,640.00	0.09
356	002736	国信证券	18,800	160,552.00	0.09
357	603833	欧派家居	2,300	160,103.00	0.09
358	603866	桃李面包	20,900	160,094.00	0.09
359	300017	网宿科技	20,200	158,570.00	0.09
360	000883	湖北能源	37,100	156,933.00	0.08
361	600258	首旅酒店	10,000	156,200.00	0.08
362	000598	兴蓉环境	27,200	154,768.00	0.08
363	688728	格科微	7,460	152,706.20	0.08
364	600157	永泰能源	110,700	151,659.00	0.08
365	002150	通润装备	8,500	150,790.00	0.08
366	002791	坚朗五金	3,700	149,813.00	0.08
367	601991	大唐发电	61,900	149,798.00	0.08
368	000400	许继电气	6,800	149,328.00	0.08
369	600585	海螺水泥	6,600	148,896.00	0.08
370	000818	航锦科技	4,700	147,486.00	0.08
371	002506	协鑫集成	52,000	142,480.00	0.08
372	300882	万胜智能	5,800	141,288.00	0.08

373	002870	香山股份	3,900	139,893.00	0.08
374	300547	川环科技	8,300	139,855.00	0.08
375	603326	我乐家居	14,800	139,564.00	0.07
376	002014	永新股份	16,600	138,610.00	0.07
377	601108	财通证券	17,800	138,128.00	0.07
378	002158	汉钟精机	6,200	138,012.00	0.07
379	600101	明星电力	16,400	137,924.00	0.07
380	301109	军信股份	8,700	137,460.00	0.07
381	000404	长虹华意	23,300	137,237.00	0.07
382	603279	景津装备	6,200	137,082.00	0.07
383	002960	青鸟消防	9,900	137,016.00	0.07
384	000899	赣能股份	17,700	136,998.00	0.07
385	605266	健之佳	2,300	136,620.00	0.07
386	300861	美畅股份	4,100	136,489.00	0.07
387	603689	皖天然气	15,700	136,433.00	0.07
388	603368	柳药集团	7,200	136,224.00	0.07
389	600710	苏美达	19,200	136,128.00	0.07
390	600284	浦东建设	21,600	136,080.00	0.07
391	301227	森鹰窗业	5,000	135,350.00	0.07
392	000921	海信家电	6,600	134,640.00	0.07
393	300566	激智科技	7,200	134,496.00	0.07
394	300699	光威复材	5,040	134,416.80	0.07
395	600399	抚顺特钢	13,700	133,164.00	0.07
396	600637	东方明珠	17,650	132,728.00	0.07
397	601006	大秦铁路	18,400	132,664.00	0.07
398	600879	航天电子	17,200	132,612.00	0.07
399	600859	王府井	8,300	132,551.00	0.07
400	688625	呈和科技	3,360	131,779.20	0.07
401	300043	星辉娱乐	35,500	131,705.00	0.07
402	600118	中国卫星	5,100	131,682.00	0.07
403	688571	杭华股份	17,566	131,393.68	0.07
404	688737	中自科技	3,932	130,149.20	0.07
405	688205	德科立	2,628	130,033.44	0.07
406	688230	芯导科技	3,101	129,745.84	0.07
407	603167	渤海轮渡	14,600	129,648.00	0.07
408	002381	双箭股份	17,100	129,618.00	0.07
409	603676	卫信康	12,400	129,332.00	0.07
410	605287	德才股份	7,600	128,972.00	0.07
411	600028	中国石化	23,100	128,898.00	0.07

412	601669	中国电建	26,300	128,607.00	0.07
413	300789	唐源电气	5,700	128,478.00	0.07
414	601199	江南水务	25,900	128,464.00	0.07
415	002517	恺英网络	11,500	128,455.00	0.07
416	600425	青松建化	32,500	128,375.00	0.07
417	603101	汇嘉时代	19,100	128,352.00	0.07
418	300355	蒙草生态	34,200	128,250.00	0.07
419	603758	秦安股份	11,200	128,128.00	0.07
420	603709	中源家居	7,100	127,800.00	0.07
421	300084	海默科技	16,700	127,588.00	0.07
422	688219	会通股份	11,627	127,548.19	0.07
423	600288	大恒科技	11,200	127,456.00	0.07
424	002443	金洲管道	18,600	127,410.00	0.07
425	688045	必易微	2,974	127,376.42	0.07
426	300700	岱勒新材	7,500	127,275.00	0.07
427	000063	中兴通讯	4,800	127,104.00	0.07
428	600778	友好集团	20,300	126,875.00	0.07
429	300111	向日葵	41,600	126,464.00	0.07
430	000751	锌业股份	38,800	126,100.00	0.07
431	002111	威海广泰	13,900	125,934.00	0.07
432	002392	北京利尔	33,300	125,874.00	0.07
433	600866	星湖科技	27,000	125,820.00	0.07
434	600894	广日股份	17,100	125,685.00	0.07
435	603588	高能环境	19,200	125,568.00	0.07
436	603949	雪龙集团	6,700	125,491.00	0.07
437	601088	中国神华	4,000	125,400.00	0.07
438	688231	隆达股份	5,692	125,280.92	0.07
439	600390	五矿资本	26,700	124,956.00	0.07
440	600897	厦门空港	10,000	124,900.00	0.07
441	600512	腾达建设	50,300	124,744.00	0.07
442	000737	北方铜业	21,500	124,700.00	0.07
443	600120	浙江东方	34,700	124,573.00	0.07
444	002414	高德红外	17,064	124,567.20	0.07
445	000531	穗恒运 A	18,600	124,434.00	0.07
446	003012	东鹏控股	15,000	123,750.00	0.07
447	002062	宏润建设	27,900	123,597.00	0.07
448	688058	宝兰德	2,610	123,218.10	0.07
449	688130	晶华微	3,008	122,876.80	0.07
450	688580	伟思医疗	1,917	122,553.81	0.07

451	600967	内蒙一机	14,700	121,422.00	0.07
452	688180	君实生物	2,882	120,554.06	0.06
453	601877	正泰电器	5,600	120,456.00	0.06
454	301095	广立微	1,600	119,568.00	0.06
455	603233	大参林	4,746	118,175.40	0.06
456	688053	思科瑞	2,360	117,858.40	0.06
457	300026	红日药业	27,700	117,448.00	0.06
458	600918	中泰证券	17,100	117,306.00	0.06
459	301200	大族数控	3,100	117,087.00	0.06
460	688206	概伦电子	5,322	116,019.60	0.06
461	601878	浙商证券	11,100	115,773.00	0.06
462	003043	华亚智能	2,300	115,483.00	0.06
463	300621	维业股份	10,000	114,900.00	0.06
464	688393	安必平	4,600	114,862.00	0.06
465	300604	长川科技	3,000	113,970.00	0.06
466	688012	中微公司	740	113,664.00	0.06
467	002389	航天彩虹	6,100	113,460.00	0.06
468	688200	华峰测控	922	113,221.60	0.06
469	301369	联动科技	1,950	112,846.50	0.06
470	688120	华海清科	596	111,869.20	0.06
471	301043	绿岛风	3,400	111,282.00	0.06
472	601000	唐山港	31,600	110,600.00	0.06
473	688037	芯源微	827	110,495.47	0.06
474	688156	路德环境	4,600	110,492.00	0.06
475	000887	中鼎股份	8,900	110,093.00	0.06
476	688409	富创精密	1,400	109,634.00	0.06
477	000338	潍柴动力	8,000	109,200.00	0.06
478	000009	中国宝安	9,300	109,182.00	0.06
479	002027	分众传媒	17,100	108,072.00	0.06
480	600398	海澜之家	14,500	107,590.00	0.06
481	600663	陆家嘴	12,100	105,875.00	0.06
482	688233	神工股份	3,000	105,870.00	0.06
483	600741	华域汽车	6,500	105,820.00	0.06
484	300666	江丰电子	1,800	105,444.00	0.06
485	688138	清溢光电	4,653	105,250.86	0.06
486	002151	北斗星通	3,300	104,214.00	0.06
487	600282	南钢股份	28,000	103,600.00	0.06
488	605588	冠石科技	2,000	103,400.00	0.06
489	600271	航天信息	9,700	103,208.00	0.06

490	000519	中兵红箭	7,300	102,492.00	0.06
491	300346	南大光电	3,700	102,157.00	0.05
492	002119	康强电子	7,600	101,612.00	0.05
493	600206	有研新材	8,200	101,598.00	0.05
494	688126	沪硅产业	5,844	101,218.08	0.05
495	300706	阿石创	3,900	100,932.00	0.05
496	002409	雅克科技	1,800	100,314.00	0.05
497	003026	中晶科技	2,800	100,240.00	0.05
498	301319	唯特偶	1,715	100,173.15	0.05
499	002078	太阳纸业	8,100	98,577.00	0.05
500	000100	TCL 科技	22,700	97,610.00	0.05
501	600436	片仔癀	400	96,796.00	0.05
502	688035	德邦科技	1,800	96,048.00	0.05
503	688006	杭可科技	4,090	96,033.20	0.05
504	000625	长安汽车	5,700	95,931.00	0.05
505	002152	广电运通	7,800	95,628.00	0.05
506	688333	铂力特	823	95,385.70	0.05
507	002595	豪迈科技	3,200	95,264.00	0.05
508	600362	江西铜业	5,300	94,658.00	0.05
509	688185	康希诺	1,257	93,671.64	0.05
510	000547	航天发展	11,100	92,907.00	0.05
511	300777	中简科技	3,100	92,473.00	0.05
512	600416	湘电股份	5,800	92,104.00	0.05
513	600685	中船防务	3,600	91,980.00	0.05
514	601225	陕西煤业	4,400	91,916.00	0.05
515	600050	中国联通	20,900	91,542.00	0.05
516	000783	长江证券	17,000	91,460.00	0.05
517	603596	伯特利	1,300	90,090.00	0.05
518	600941	中国移动	900	89,532.00	0.05
519	601857	中国石油	12,500	88,250.00	0.05
520	601898	中煤能源	9,100	88,179.00	0.05
521	002673	西部证券	13,700	87,269.00	0.05
522	003816	中国广核	28,000	87,080.00	0.05
523	002958	青农商行	32,700	85,674.00	0.05
524	600418	江淮汽车	5,200	83,980.00	0.05
525	000825	太钢不锈	22,300	83,179.00	0.04
526	601766	中国中车	15,800	83,108.00	0.04
527	300034	钢研高纳	4,080	83,028.00	0.04
528	300762	上海瀚讯	5,500	82,940.00	0.04

529	000581	威孚高科	5,500	82,885.00	0.04
530	601816	京沪高铁	16,500	81,180.00	0.04
531	300775	三角防务	2,900	80,910.00	0.04
532	600456	宝钛股份	2,500	78,475.00	0.04
533	002439	启明星辰	2,900	78,300.00	0.04
534	603883	老百姓	2,600	77,714.00	0.04
535	600570	恒生电子	2,600	74,776.00	0.04
536	600426	华鲁恒升	2,700	74,493.00	0.04
537	002271	东方雨虹	3,800	72,960.00	0.04
538	688067	爱威科技	3,043	72,453.83	0.04
539	000539	粤电力 A	14,800	72,372.00	0.04
540	601728	中国电信	13,300	71,953.00	0.04
541	600325	华发股份	9,900	71,379.00	0.04
542	301233	盛帮股份	1,600	71,072.00	0.04
543	301113	雅艺科技	2,200	70,994.00	0.04
544	300387	富邦股份	8,500	70,890.00	0.04
545	688163	赛伦生物	3,543	70,824.57	0.04
546	688616	西力科技	5,180	70,655.20	0.04
547	603267	鸿远电子	1,400	70,280.00	0.04
548	603679	华体科技	4,700	70,171.00	0.04
549	603725	天安新材	6,300	70,119.00	0.04
550	001211	双枪科技	2,900	70,064.00	0.04
551	300819	聚杰微纤	4,500	69,975.00	0.04
552	003041	真爱美家	4,200	69,930.00	0.04
552	300651	金陵体育	3,500	69,930.00	0.04
553	301003	江苏博云	2,800	69,888.00	0.04
554	000596	古井贡酒	300	69,840.00	0.04
555	000027	深圳能源	10,800	69,660.00	0.04
555	300321	同大股份	3,600	69,660.00	0.04
555	605155	西大门	4,500	69,660.00	0.04
556	002853	皮阿诺	5,400	69,606.00	0.04
557	002899	英派斯	4,200	69,510.00	0.04
558	300371	汇中股份	5,700	69,483.00	0.04
559	688656	浩欧博	1,998	69,450.48	0.04
560	301008	宏昌科技	2,300	69,437.00	0.04
561	002209	达意隆	6,300	69,300.00	0.04
562	600928	西安银行	20,800	69,264.00	0.04
563	603903	中持股份	7,000	69,160.00	0.04
564	603799	华友钴业	2,100	69,153.00	0.04

565	300947	德必集团	4,400	69,036.00	0.04
566	300823	建科机械	3,200	68,832.00	0.04
567	601600	中国铝业	12,200	68,808.00	0.04
568	002098	浔兴股份	10,300	68,804.00	0.04
569	603238	诺邦股份	5,000	68,750.00	0.04
570	688178	万德斯	3,800	68,704.00	0.04
571	603041	美思德	5,100	68,646.00	0.04
572	603329	上海雅仕	4,300	68,542.00	0.04
573	300117	嘉寓股份	23,600	68,440.00	0.04
574	601288	农业银行	18,800	68,432.00	0.04
575	601169	北京银行	15,100	68,403.00	0.04
576	600837	海通证券	7,300	68,401.00	0.04
577	601939	建设银行	10,500	68,355.00	0.04
578	601398	工商银行	14,300	68,354.00	0.04
579	601328	交通银行	11,900	68,306.00	0.04
579	603080	新疆火炬	4,100	68,306.00	0.04
580	601238	广汽集团	7,800	68,250.00	0.04
581	601988	中国银行	17,100	68,229.00	0.04
582	600704	物产中大	15,400	68,222.00	0.04
583	601818	光大银行	23,500	68,150.00	0.04
584	605189	富春染织	4,200	68,040.00	0.04
585	600350	山东高速	9,800	68,012.00	0.04
586	600883	博闻科技	8,000	68,000.00	0.04
587	601555	东吴证券	9,300	67,983.00	0.04
588	000932	华菱钢铁	13,200	67,980.00	0.04
589	000898	鞍钢股份	27,300	67,977.00	0.04
590	688092	爱科科技	2,209	67,948.84	0.04
591	601998	中信银行	12,800	67,712.00	0.04
592	600019	宝钢股份	11,400	67,602.00	0.04
593	600000	浦发银行	10,200	67,524.00	0.04
594	600322	津投城开	31,400	67,510.00	0.04
595	000877	天山股份	10,100	67,468.00	0.04
596	600027	华电国际	13,100	67,334.00	0.04
597	003028	振邦智能	1,500	66,090.00	0.04
598	688303	大全能源	2,228	65,881.96	0.04
599	301050	雷电微力	1,100	64,086.00	0.03
600	601698	中国卫通	3,700	64,047.00	0.03
601	603678	火炬电子	2,400	63,528.00	0.03
602	603369	今世缘	1,300	63,375.00	0.03

603	688111	金山办公	200	63,240.00	0.03
604	002373	千方科技	5,600	62,776.00	0.03
605	002756	永兴材料	1,200	62,652.00	0.03
606	601198	东兴证券	7,600	62,548.00	0.03
607	600095	湘财股份	8,300	62,333.00	0.03
608	601778	晶科科技	17,600	61,600.00	0.03
609	688617	惠泰医疗	158	61,383.00	0.03
610	002985	北摩高科	1,758	60,967.44	0.03
611	603993	洛阳钼业	11,600	60,320.00	0.03
612	301528	多浦乐	821	59,951.00	0.03
613	600562	国睿科技	4,300	59,512.00	0.03
614	600906	财达证券	7,900	59,250.00	0.03
615	000425	徐工机械	10,800	58,968.00	0.03
616	300408	三环集团	2,000	58,900.00	0.03
617	688568	中科星图	1,192	58,479.52	0.03
618	600547	山东黄金	2,500	57,175.00	0.03
619	000591	太阳能	10,100	56,358.00	0.03
620	600009	上海机场	1,700	55,726.00	0.03
621	601568	北元集团	11,500	54,510.00	0.03
622	000830	鲁西化工	5,400	54,162.00	0.03
623	000538	云南白药	1,100	54,065.00	0.03
624	002497	雅化集团	4,100	53,669.00	0.03
625	002236	大华股份	2,900	53,505.00	0.03
626	600839	四川长虹	10,100	53,429.00	0.03
627	603826	坤彩科技	900	53,127.00	0.03
628	003031	中瓷电子	600	52,938.00	0.03
629	002493	荣盛石化	5,100	52,785.00	0.03
630	601608	中信重工	13,500	52,110.00	0.03
631	002920	德赛西威	400	51,804.00	0.03
632	300855	图南股份	1,700	51,340.00	0.03
633	300123	亚光科技	7,000	51,310.00	0.03
634	600348	华阳股份	5,200	50,752.00	0.03
635	600989	宝丰能源	3,400	50,218.00	0.03
636	000963	华东医药	1,200	49,752.00	0.03
637	000938	紫光股份	2,500	48,375.00	0.03
638	300593	新雷能	3,270	48,297.90	0.03
639	600536	中国软件	1,300	47,138.00	0.03
640	603156	养元饮品	2,200	46,772.00	0.03
641	603317	天味食品	3,500	46,515.00	0.02

642	000977	浪潮信息	1,400	46,480.00	0.02
643	000020	深华发 A	3,500	45,325.00	0.02
644	603859	能科科技	1,200	45,276.00	0.02
645	688633	星球石墨	1,449	45,252.27	0.02
646	603197	保隆科技	800	45,120.00	0.02
647	600764	中国海防	1,800	44,910.00	0.02
648	600886	国投电力	3,400	44,812.00	0.02
649	301196	唯科科技	1,300	44,694.00	0.02
650	301195	北路智控	1,100	44,638.00	0.02
651	600755	厦门国贸	6,400	44,608.00	0.02
652	000533	顺钠股份	9,500	44,555.00	0.02
653	002601	龙佰集团	2,600	44,538.00	0.02
654	300990	同飞股份	1,000	44,510.00	0.02
655	601500	通用股份	10,700	44,298.00	0.02
656	603602	纵横通信	3,000	44,220.00	0.02
657	300426	唐德影视	4,000	44,120.00	0.02
658	000951	中国重汽	3,300	44,088.00	0.02
659	601236	红塔证券	5,800	44,022.00	0.02
660	000035	中国天楹	8,900	43,966.00	0.02
661	600694	大商股份	2,600	43,914.00	0.02
662	605116	奥锐特	1,700	43,894.00	0.02
663	300815	玉禾田	3,000	43,800.00	0.02
664	300872	天阳科技	3,200	43,776.00	0.02
665	601811	新华文轩	3,200	43,712.00	0.02
666	603680	今创集团	4,600	43,470.00	0.02
667	600598	北大荒	3,600	43,092.00	0.02
667	601677	明泰铝业	3,800	43,092.00	0.02
668	688288	鸿泉物联	1,807	42,934.32	0.02
669	002991	甘源食品	600	42,876.00	0.02
670	601111	中国国航	5,800	42,572.00	0.02
671	603567	珍宝岛	3,500	42,560.00	0.02
672	603112	华翔股份	3,500	42,525.00	0.02
673	600623	华谊集团	6,600	42,504.00	0.02
674	600795	国电电力	10,200	42,432.00	0.02
675	002859	洁美科技	1,700	42,415.00	0.02
676	605288	凯迪股份	900	42,408.00	0.02
677	300695	兆丰股份	800	42,368.00	0.02
678	300726	宏达电子	1,400	42,266.00	0.02
679	001215	千味央厨	800	42,248.00	0.02

680	688159	有方科技	1,104	41,565.60	0.02
681	601615	明阳智能	3,300	41,382.00	0.02
682	600863	内蒙华电	10,600	41,340.00	0.02
683	600022	山东钢铁	29,600	40,552.00	0.02
684	601360	三六零	4,500	40,545.00	0.02
685	688121	卓然股份	2,000	40,460.00	0.02
686	002338	奥普光电	1,200	40,380.00	0.02
687	601139	深圳燃气	5,800	39,962.00	0.02
688	002056	横店东磁	2,900	39,266.00	0.02
689	000157	中联重科	6,000	39,180.00	0.02
690	600845	宝信软件	800	39,040.00	0.02
691	688776	国光电气	400	38,956.00	0.02
692	002080	中材科技	2,400	38,208.00	0.02
693	601606	长城军工	3,100	37,758.00	0.02
694	688016	心脉医疗	191	37,174.33	0.02
695	300438	鹏辉能源	1,300	36,777.00	0.02
696	605499	东鹏饮料	200	36,502.00	0.02
697	605123	派克新材	400	36,480.00	0.02
698	600208	新湖中宝	16,600	36,022.00	0.02
699	300629	新劲刚	1,664	35,992.32	0.02
700	301487	盟固利	867	35,503.65	0.02
701	600848	上海临港	3,500	35,175.00	0.02
702	000786	北新建材	1,500	35,040.00	0.02
703	688063	派能科技	324	34,344.00	0.02
704	300433	蓝思科技	2,600	34,320.00	0.02
705	002935	天奥电子	1,871	34,127.04	0.02
706	002273	水晶光电	2,500	33,850.00	0.02
707	601838	成都银行	3,000	33,780.00	0.02
708	603004	鼎龙科技	941	33,733.50	0.02
709	601699	潞安环能	1,500	32,865.00	0.02
710	000301	东方盛虹	3,400	32,640.00	0.02
711	600864	哈投股份	5,700	32,433.00	0.02
712	000998	隆平高科	2,300	32,430.00	0.02
713	600621	华鑫股份	2,300	32,361.00	0.02
714	002607	中公教育	7,900	32,232.00	0.02
715	300900	广联航空	1,300	32,084.00	0.02
716	300527	中船应急	4,200	32,004.00	0.02
717	600183	生益科技	1,700	31,127.00	0.02
718	002670	国盛金控	3,300	30,756.00	0.02

719	300696	爱乐达	1,740	30,293.40	0.02
720	600674	川投能源	2,000	30,240.00	0.02
721	600011	华能国际	3,900	30,030.00	0.02
722	600377	宁沪高速	2,900	29,725.00	0.02
723	301550	斯菱股份	642	29,425.96	0.02
724	603806	福斯特	1,200	29,124.00	0.02
725	601607	上海医药	1,700	28,441.00	0.02
726	600990	四创电子	1,417	28,297.49	0.02
727	300601	康泰生物	1,000	27,150.00	0.01
728	300999	金龙鱼	800	26,704.00	0.01
729	000561	烽火电子	3,100	26,040.00	0.01
730	300751	迈为股份	200	25,902.00	0.01
731	600332	白云山	900	25,740.00	0.01
732	002933	新兴装备	700	25,515.00	0.01
733	300413	芒果超媒	1,000	25,200.00	0.01
734	600184	光电股份	2,200	25,146.00	0.01
735	600875	东方电气	1,700	24,854.00	0.01
736	688779	长远锂科	3,374	24,630.20	0.01
737	301533	威马农机	718	24,565.38	0.01
738	601865	福莱特	900	24,030.00	0.01
739	301272	英华特	444	23,995.58	0.01
740	002423	中粮资本	3,500	23,380.00	0.01
741	300581	晨曦航空	2,310	22,707.30	0.01
742	603589	口子窖	500	22,650.00	0.01
743	688693	锆威特	512	22,622.50	0.01
744	688778	厦钨新能	560	22,198.40	0.01
745	002508	老板电器	1,000	21,780.00	0.01
746	300136	信维通信	900	21,240.00	0.01
747	300424	航新科技	1,600	20,960.00	0.01
748	600754	锦江酒店	700	20,930.00	0.01
749	601880	辽港股份	14,300	20,735.00	0.01
750	688520	神州细胞	378	20,362.86	0.01
751	600025	华能水电	2,300	19,849.00	0.01
752	601216	君正集团	5,300	19,822.00	0.01
753	300722	新余国科	752	19,694.88	0.01
754	300919	中伟股份	400	19,652.00	0.01
755	603899	晨光股份	500	18,775.00	0.01
756	003009	中天火箭	400	18,444.00	0.01
757	688707	振华新材	884	18,122.00	0.01

758	300776	帝尔激光	300	18,078.00	0.01
759	000617	中油资本	3,200	17,280.00	0.01
760	603737	三棵树	360	17,139.60	0.01
761	301348	蓝箭电子	380	16,929.00	0.01
762	000831	中国稀土	600	16,602.00	0.01
763	300677	英科医疗	700	16,352.00	0.01
764	688387	信科移动	2,200	15,862.00	0.01
765	688366	昊海生科	146	15,810.34	0.01
766	002195	岩山科技	5,100	15,657.00	0.01
767	002153	石基信息	1,600	15,584.00	0.01
768	300922	天秦装备	900	15,363.00	0.01
769	600582	天地科技	2,800	15,232.00	0.01
770	002131	利欧股份	6,600	15,048.00	0.01
771	002511	中顺洁柔	1,500	15,000.00	0.01
772	688535	华海诚科	161	14,937.58	0.01
773	002019	亿帆医药	1,000	14,780.00	0.01
774	301526	国际复材	2,764	14,538.64	0.01
775	688187	时代电气	400	14,532.00	0.01
776	301510	固高科技	396	13,860.00	0.01
777	600029	南方航空	2,400	13,824.00	0.01
778	601155	新城控股	1,200	13,692.00	0.01
779	688630	芯碁微装	160	13,659.20	0.01
780	301566	达利凯普	484	13,527.80	0.01
781	301421	波长光电	226	13,415.36	0.01
782	601808	中海油服	900	13,158.00	0.01
783	301488	豪恩汽电	180	12,427.20	0.01
784	301381	赛维时代	405	12,016.35	0.01
785	300875	捷强装备	400	11,676.00	0.01
786	301172	君逸数码	302	11,518.28	0.01
787	688627	精智达	130	11,397.10	0.01
788	688301	奕瑞科技	35	11,384.10	0.01
789	688123	聚辰股份	180	11,021.40	0.01
790	301516	中远通	543	10,898.01	0.01
791	688283	坤恒顺维	157	10,774.91	0.01
792	688548	广钢气体	815	10,383.10	0.01
793	688592	司南导航	205	10,356.60	0.01
794	301370	国科恒泰	643	10,288.00	0.01
795	301413	安培龙	143	10,045.75	0.01
796	301499	维科精密	338	9,771.58	0.01

797	688766	普冉股份	98	9,602.04	0.01
798	301558	三态股份	700	9,569.00	0.01
799	688239	航宇科技	199	9,506.23	0.01
800	688549	中巨芯	1,172	9,481.48	0.01
801	000800	一汽解放	1,100	9,350.00	0.01
802	688582	芯动联科	232	8,932.00	0.00
803	688020	方邦股份	184	8,920.32	0.00
804	688531	日联科技	87	8,793.96	0.00
805	688720	艾森股份	151	8,684.01	0.00
806	301555	惠柏新材	218	8,650.24	0.00
807	688155	先惠技术	155	8,622.65	0.00
808	688652	京仪装备	151	8,616.06	0.00
809	688391	钜泉科技	171	8,481.60	0.00
810	688190	云路股份	118	8,452.34	0.00
811	688543	国科军工	151	8,440.90	0.00
812	688489	三未信安	178	8,369.56	0.00
813	301508	中机认检	257	8,288.25	0.00
814	301372	科净源	190	8,280.20	0.00
815	688399	硕世生物	151	8,238.56	0.00
816	688626	翔宇医疗	154	8,206.66	0.00
817	688573	信宇人	285	8,205.15	0.00
818	688653	康希通信	433	8,166.38	0.00
819	688408	中信博	113	8,107.75	0.00
820	688591	泰凌微	288	8,066.88	0.00
821	688610	埃科光电	158	8,053.26	0.00
822	688603	天承科技	108	8,002.80	0.00
823	688661	和林微纳	172	7,881.04	0.00
824	301291	明阳电气	277	7,833.56	0.00
825	688671	碧兴物联	218	7,475.22	0.00
826	688589	力合微	186	7,423.26	0.00
827	301292	海科新源	377	7,291.18	0.00
828	301362	民爆光电	189	7,278.39	0.00
829	301568	思泰克	168	7,267.68	0.00
830	688029	南微医学	75	7,260.00	0.00
831	688668	鼎通科技	130	7,191.60	0.00
832	688651	盛邦安全	156	7,180.68	0.00
833	688648	中邮科技	286	7,124.26	0.00
834	603296	华勤技术	91	7,072.52	0.00
835	301507	民生健康	446	7,069.10	0.00

836	688228	开普云	108	7,066.44	0.00
837	301498	乖宝宠物	181	7,022.80	0.00
838	688458	美芯晟	91	7,003.36	0.00
839	301517	陕西华达	132	6,850.80	0.00
840	301486	致尚科技	145	6,844.00	0.00
841	601096	宏盛华源	1,308	6,840.84	0.00
842	301505	苏州规划	191	6,835.89	0.00
843	301210	金杨股份	150	6,795.00	0.00
844	301489	思泉新材	100	6,777.00	0.00
845	301578	辰奕智能	91	6,773.13	0.00
846	688071	华依科技	139	6,770.69	0.00
847	301261	恒工精密	133	6,757.73	0.00
848	688581	安杰思	54	6,739.74	0.00
849	688311	盟升电子	130	6,631.30	0.00
850	301468	博盈特焊	218	6,585.78	0.00
851	301469	恒达新材	196	6,487.60	0.00
852	688702	盛科通信	134	6,457.46	0.00
853	301251	威尔高	186	6,443.04	0.00
854	688799	华纳药厂	131	6,411.14	0.00
855	688215	瑞晟智能	178	6,399.10	0.00
856	301329	信音电子	288	6,396.48	0.00
857	301511	德福科技	281	6,370.27	0.00
858	301459	丰茂股份	141	6,271.68	0.00
859	688278	特宝生物	118	6,177.30	0.00
860	688435	英方软件	128	6,146.56	0.00
861	688217	睿昂基因	167	5,975.26	0.00
862	301519	舜禹股份	293	5,918.60	0.00
863	688638	誉辰智能	98	5,845.70	0.00
864	688539	高华科技	133	5,825.40	0.00
865	301395	仁信新材	308	5,750.36	0.00
866	688631	莱斯信息	163	5,745.75	0.00
867	301418	协昌科技	114	5,725.08	0.00
868	688008	澜起科技	94	5,523.44	0.00
869	301393	昊帆生物	93	5,518.62	0.00
870	688716	中研股份	150	5,457.00	0.00
871	688602	康鹏科技	489	5,408.34	0.00
872	301456	盘古智能	174	5,286.12	0.00
873	688251	井松智能	180	5,234.40	0.00
874	688719	爱科赛博	84	5,048.40	0.00

875	688429	时创能源	238	5,043.22	0.00
876	688508	芯朋微	100	4,921.00	0.00
877	688768	容知日新	132	4,858.92	0.00
878	688646	逸飞激光	132	4,759.92	0.00
879	301525	儒竞科技	58	4,724.68	0.00
880	301515	港通医疗	166	4,691.16	0.00
881	688611	杭州柯林	143	4,687.54	0.00
882	688682	霍莱沃	96	4,580.16	0.00
883	688683	莱尔科技	178	4,553.24	0.00
884	301500	飞南资源	216	4,512.24	0.00
885	688078	龙软科技	111	4,475.52	0.00
886	001378	德冠新材	121	4,403.19	0.00
887	301529	福赛科技	115	4,356.20	0.00
888	688612	威迈斯	113	4,287.22	0.00
889	688711	宏微科技	103	4,273.47	0.00
890	301559	中集环科	233	4,252.25	0.00
891	301371	敷尔佳	113	4,243.15	0.00
892	688629	华丰科技	187	4,095.30	0.00
893	301520	万邦医药	77	4,060.98	0.00
894	688021	奥福环保	191	3,982.35	0.00
895	688623	双元科技	56	3,974.88	0.00
896	301548	崇德科技	67	3,955.01	0.00
897	688657	浩辰软件	49	3,886.19	0.00
898	688028	沃尔德	153	3,808.17	0.00
899	688048	长光华芯	60	3,760.20	0.00
900	688090	瑞松科技	115	3,724.85	0.00
901	688621	阳光诺和	53	3,696.75	0.00
902	001239	永达股份	166	3,642.04	0.00
903	001326	联域股份	70	3,621.80	0.00
904	688450	光格科技	97	3,531.77	0.00
905	601083	锦江航运	297	3,519.45	0.00
906	603273	天元智能	170	3,476.50	0.00
907	688196	卓越新能	99	3,323.43	0.00
908	688033	天宜上佳	186	3,143.40	0.00
908	688601	力芯微	60	3,143.40	0.00
909	688338	赛科希德	93	3,124.80	0.00
910	688088	虹软科技	76	3,119.04	0.00
911	603373	安邦护卫	77	3,116.19	0.00
912	688479	友车科技	133	3,101.56	0.00

913	688030	山石网科	154	3,083.08	0.00
914	603270	金帝股份	104	3,076.32	0.00
915	001306	夏厦精密	36	3,046.32	0.00
916	688260	昀冢科技	100	3,030.00	0.00
917	688478	晶升股份	57	2,964.00	0.00
918	688400	凌云光	108	2,916.00	0.00
919	688523	航天环宇	108	2,896.56	0.00
920	603107	上海汽配	127	2,788.92	0.00
921	688069	德林海	140	2,783.20	0.00
922	688670	金迪克	97	2,760.62	0.00
923	688262	国芯科技	93	2,728.62	0.00
924	603119	浙江荣泰	113	2,696.18	0.00
925	688529	豪森智能	113	2,606.91	0.00
926	688093	世华科技	139	2,531.19	0.00
927	001358	兴欣新材	54	2,499.12	0.00
928	603275	众辰科技	62	2,461.40	0.00
929	688663	新风光	87	2,439.48	0.00
930	688512	慧智微	125	2,436.25	0.00
931	688677	海泰新光	45	2,395.35	0.00
932	603062	麦加芯彩	40	2,380.80	0.00
933	688396	华润微	51	2,279.19	0.00
934	688552	航天南湖	97	2,278.53	0.00
935	688484	南芯科技	57	2,271.45	0.00
936	688718	唯赛勃	151	2,255.94	0.00
937	688135	利扬芯片	100	2,231.00	0.00
938	603193	润本股份	130	2,212.60	0.00
939	688593	新相微	148	2,178.56	0.00
940	688357	建龙微纳	42	2,170.98	0.00
941	603276	恒兴新材	87	2,164.56	0.00
942	688225	亚信安全	114	2,090.76	0.00
943	688202	美迪西	30	2,051.40	0.00
944	603075	热威股份	81	1,888.92	0.00
945	688066	航天宏图	43	1,816.32	0.00
946	603231	索宝蛋白	80	1,780.80	0.00
947	688322	奥比中光	47	1,766.26	0.00
948	688168	安博通	47	1,699.52	0.00
949	688112	鼎阳科技	40	1,601.60	0.00
950	688252	天德钰	79	1,576.84	0.00
951	688039	当虹科技	41	1,482.56	0.00

952	688559	海目星	40	1,428.00	0.00
953	688562	航天软件	59	1,416.00	0.00
954	688173	希荻微	76	1,336.84	0.00
955	688377	迪威尔	48	1,287.36	0.00
956	688361	中科飞测	16	1,190.88	0.00
957	688106	金宏气体	49	1,180.41	0.00
958	688004	博汇科技	38	1,116.06	0.00
959	688518	联赢激光	54	1,105.92	0.00
960	688570	天玛智控	39	1,061.19	0.00
961	688557	兰剑智能	28	1,031.24	0.00
962	688655	迅捷兴	65	981.50	0.00
963	688469	芯联集成	153	768.06	0.00
964	688060	云涌科技	16	750.24	0.00
965	688981	中芯国际	14	742.28	0.00
966	688528	秦川物联	67	740.35	0.00
967	688378	奥来德	14	662.76	0.00
968	688433	华曙高科	21	656.25	0.00
969	688146	中船特气	19	646.19	0.00
970	688330	宏力达	22	625.02	0.00
971	688246	嘉和美康	13	434.46	0.00
972	688136	科兴制药	20	405.00	0.00
973	688551	科威尔	7	399.70	0.00
974	688777	中控技术	8	362.80	0.00
975	688521	芯原股份	7	349.72	0.00
976	688334	西高院	19	329.27	0.00
977	688186	广大特材	18	324.36	0.00
978	688015	交控科技	17	318.92	0.00
979	688389	普门科技	14	315.14	0.00
980	688456	有研粉材	11	309.87	0.00
981	688211	中科微至	8	293.36	0.00
982	688386	泛亚微透	7	285.60	0.00
983	688102	斯瑞新材	20	263.80	0.00
984	688352	硕中科技	17	261.97	0.00
985	688013	天臣医疗	10	211.00	0.00
986	688010	福光股份	8	192.48	0.00
987	688183	生益电子	16	181.92	0.00
988	688620	安凯微	13	153.66	0.00
989	688722	同益中	10	153.00	0.00
990	688113	联测科技	3	139.32	0.00

991	688488	艾迪药业	11	137.61	0.00
992	688285	高铁电气	15	133.20	0.00
993	688609	九联科技	10	132.00	0.00
994	688101	三达膜	9	121.14	0.00
995	688265	南模生物	3	115.35	0.00
996	688191	智洋创新	6	111.00	0.00
997	688189	南新制药	11	103.73	0.00
998	688056	莱伯泰科	3	100.53	0.00
999	688321	微芯生物	4	87.80	0.00
1,000	688468	科美诊断	7	75.53	0.00
1,001	688298	东方生物	2	71.52	0.00
1,002	688148	芳源股份	9	69.03	0.00
1,003	688501	青达环保	4	66.92	0.00
1,004	688011	新光光电	2	47.30	0.00
1,005	688218	江苏北人	2	39.74	0.00
1,006	688227	品高股份	2	38.14	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	002594	比亚迪	6,309,484.00	2.54
2	688390	固德威	5,359,759.87	2.16
3	600487	亨通光电	5,018,588.00	2.02
4	300274	阳光电源	4,881,693.00	1.96
5	600519	贵州茅台	4,443,079.00	1.79
6	603260	合盛硅业	4,278,287.00	1.72
7	603688	石英股份	4,172,852.00	1.68
8	002056	横店东磁	4,029,292.00	1.62
9	300760	迈瑞医疗	3,783,956.00	1.52
10	601958	金钼股份	3,515,951.00	1.41
11	600094	大名城	3,250,251.65	1.31
12	688063	派能科技	3,216,549.78	1.29
13	300615	欣天科技	3,212,446.00	1.29
14	603613	国联股份	3,196,831.60	1.29
15	600481	双良节能	3,188,180.00	1.28

16	002738	中矿资源	3,160,617.60	1.27
17	002371	北方华创	3,137,574.00	1.26
18	688257	新锐股份	3,077,889.28	1.24
19	002518	科士达	3,047,276.00	1.23
20	600173	卧龙地产	3,032,287.00	1.22

注：①买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票。

②“买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	688390	固德威	5,577,226.29	2.24
2	603260	合盛硅业	5,418,233.00	2.18
3	002738	中矿资源	4,307,872.80	1.73
4	600487	亨通光电	4,226,042.00	1.70
5	688063	派能科技	4,074,509.66	1.64
6	002850	科达利	4,059,940.28	1.63
7	000878	云南铜业	3,839,996.00	1.54
8	603688	石英股份	3,724,751.00	1.50
9	603613	国联股份	3,684,787.14	1.48
10	002056	横店东磁	3,665,981.00	1.47
11	002048	宁波华翔	3,628,762.00	1.46
12	300115	长盈精密	3,536,765.00	1.42
13	300615	欣天科技	3,536,022.48	1.42
14	300073	当升科技	3,501,430.09	1.41
15	000937	冀中能源	3,445,522.00	1.39
16	002594	比亚迪	3,413,726.00	1.37
17	300861	美畅股份	3,400,782.60	1.37
18	300724	捷佳伟创	3,357,992.00	1.35
19	300274	阳光电源	3,355,562.58	1.35
20	300568	星源材质	3,268,196.00	1.31

注：①卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

②“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,541,936,012.82
--------------	------------------

卖出股票收入（成交）总额	1,581,525,194.87
--------------	------------------

注：①买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

②“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本报告期末本基金未持有债券。

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

本报告期末本基金未持有债券。

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

本报告期末本基金未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本报告期末本基金未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本报告期末本基金未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在股指期货的投资中将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，采用流动性好、交易活跃的期货合约，并充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，主要遵循避险和有效管理两项策略和原则：（1）避险：在市场风险大幅累积时，减小基金投资组合因市场下跌而遭受的市场风险；（2）有效管理：利用股指期货流动性好、交易成本低等特点，通过股指期货对投资组合的仓位进行及时调整，提高投资组合的运作效率。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的进行国债期货投资，将构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在大限度保证基金资产安全的基础上管理利率波动风险，实现基金资产保值增值。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本报告期内，本基金未投资于国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

无

8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	25,543.81
2	应收清算款	1,904,442.60
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	1,929,986.41

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末本基金未持有债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末本基金前十名股票中不存在流通受限股票。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
中航量化阿尔法六个月持有 A	646	104,607.48	1,422.51	0.00%	67,575,010.53	100.00%
中航量化阿尔法六个月持有 C	1,248	139,723.76	-	-	174,375,246.70	100.00%
合计	1,894	127,746.40	1,422.51	0.00%	241,950,257.23	100.00%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中航量化阿尔法六个月持有 A	578,833.46	0.86%
	中航量化阿尔法六个月持有 C	1,900,347.01	1.09%
	合计	2,479,180.47	1.02%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	中航量化阿尔法六个月持有 A	10~50
	中航量化阿尔法六个月持有 C	-
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	中航量化阿尔法六个月持有 A	0~10
	中航量化阿尔法六个月持有 C	>100
	合计	>100

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中航量化阿尔法六 个月持有 A	中航量化阿尔法六 个月持有 C
基金合同生效日（2021 年 8 月 25 日）基金 份额总额	74,904,100.76	254,269,492.63
本报告期期初基金份额总额	77,208,340.07	217,188,462.10
本报告期基金总申购份额	510,793.48	326,160.60
减:本报告期基金总赎回份额	10,142,700.51	43,139,376.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以 “-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	67,576,433.04	174,375,246.70

注：基金总申购份额包含基金转换入份额，基金总赎回份额包含基金转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、2023 年 6 月 2 日，本基金管理人发布《中航基金管理有限公司关于首席信息官任职的公告》。自 2023 年 5 月 31 日起，王君彧先生担任中航基金管理有限公司首席信息官。

2、本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

无

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所，本年度应支付给天职国际会计师事务所（特殊普通合伙）报酬为 27,000.00 元；截至 2023 年 12 月 31 日，该审计机构已向本基金提供 3 年的审计服务。

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

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	基金管理人
受到稽查或处罚等措施的时间	2023 年 3 月 2 日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会北京监管局
受到的具体措施类型	暂停新增私募资管产品备案 3 个月的行政监管措施
受到稽查或处罚等措施的原因	部分产品主动管理责任履行不到位，部分内部控制制度不完善或执行不到位。
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司积极进行整改，截至报告期末，已完成全部整改工作。
其他	截至本报告披露日，整改成果已经监管机构验收通过。
措施 2	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	杨彦伟（时任中航证券有限公司总会计师（财务总监））

受到稽查或处罚等措施的时间	2023 年 8 月 4 日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国人民银行南昌中心支行
受到的具体措施类型	罚款人民币 4.5 万元
受到稽查或处罚等措施的原因	对中航证券有限公司以下违法违规行为负有责任：1. 未按规定履行客户身份识别义务；2. 未按规定报送大额交易报告或者可疑交易报告；3. 与身份不明的客户进行交易。
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	不适用
其他	其所受处罚与基金管理人业务无关
措施 3	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	王君彧（时任中航证券有限公司信息技术部总经理）
受到稽查或处罚等措施的时间	2023 年 8 月 4 日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国人民银行南昌中心支行
受到的具体措施类型	罚款人民币 2.5 万元
受到稽查或处罚等措施的原因	对中航证券有限公司未按规定报送大额交易报告或者可疑交易报告的违法违规行为负有责任。
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	不适用
其他	其所受处罚与基金管理人业务无关

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东吴证券股份有限公司	2	864,118,012.61	27.79%	636,393.60	27.83%	-
中航证券有限公司	2	774,861,415.56	24.92%	567,294.18	24.81%	-
国金证券股份有限公司	2	583,202,072.31	18.75%	426,492.47	18.65%	-

国盛证券有 限责任公司	4	513,923,349.16	16.53%	381,376.80	16.68%	-
东方财富证 券股份有 限公司	1	229,580,087.12	7.38%	167,895.47	7.34%	-
广发证券股 份有限公司	2	144,191,972.51	4.64%	107,550.23	4.70%	-
华金证券	2	-	-	-	-	-

注：1：本表“佣金”指本基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该等券商的佣金合计。

2：交易单元的选择标准和程序

(1) 实力雄厚，信誉良好；

(2) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为基金提供高质量的资讯服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场分析、个股分析报告、市场数据统计及其它专门报告等，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；

(3) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；

(4) 经营行为规范，内部管理规范、严格，具备健全的内部控制制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

(5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的要求，并能为基金提供全面的信息服务。

基金管理人根据以上标准进行考察后确定租用券商的交易单元。基金管理人与被选择的券商签订协议，并通知基金托管人。

3：本报告期内本基金新增租用 2 个交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东吴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中航证券有限公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

国盛证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
东方财富证 券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中航量化阿尔法六个月持有 期股票型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	管理人网站、中国证监会基金 电子披露网站	2023 年 1 月 20 日
2	关于中航基金管理有限公司 旗下部分产品增加销售机构 的公告	证券时报、管理人网站、中国 证监会基金电子披露网站	2023 年 3 月 24 日
3	中航量化阿尔法六个月持有 期股票型证券投资基金 2022 年年度报告	管理人网站、中国证监会基金 电子披露网站	2023 年 3 月 30 日
4	中航量化阿尔法六个月持有 期股票型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	管理人网站、中国证监会基金 电子披露网站	2023 年 4 月 21 日
5	关于中航基金管理有限公司 旗下部分产品增加销售机构 的公告	证券时报、管理人网站、中国 证监会基金电子披露网站	2023 年 5 月 19 日
6	中航基金管理有限公司关于 首席信息官任职的公告	证券时报、管理人网站、中国 证监会基金电子披露网站	2023 年 6 月 2 日
7	关于中航基金管理有限公司 旗下部分产品增加销售机构 的公告	证券时报、管理人网站、中国 证监会基金电子披露网站	2023 年 6 月 30 日
8	中航基金管理有限公司关于 办公地址变更的公告	证券时报、管理人网站、中国 证监会基金电子披露网站	2023 年 7 月 11 日
9	中航量化阿尔法六个月持有 期股票型证券投资基金 2023 年第 2 季度报告	管理人网站、中国证监会基金 电子披露网站	2023 年 7 月 20 日
10	中航基金管理有限公司澄清 公告	证券时报、管理人网站、中国 证监会基金电子披露网站	2023 年 8 月 16 日
11	关于中航基金管理有限公司 旗下部分产品增加销售机构 的公告	证券时报、管理人网站、中国 证监会基金电子披露网站	2023 年 8 月 18 日
12	中航量化阿尔法六个月持有 期股票型证券投资基金基金	管理人网站、中国证监会基金 电子披露网站	2023 年 8 月 24 日

	产品资料概要（更新）		
13	中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金更新的招募说明书（2023 年第 1 号）	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023 年 8 月 24 日
14	关于中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金调整管理费率、托管费率并修改法律文件的公告	证券时报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023 年 8 月 25 日
15	中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金更新的招募说明书（2023 年第 2 号）	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023 年 8 月 25 日
16	中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023 年 8 月 25 日
17	中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金基金合同	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023 年 8 月 25 日
18	中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金托管协议	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023 年 8 月 25 日
19	中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金 2023 年中期报告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023 年 8 月 29 日
20	中航基金管理有限公司澄清公告	证券时报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023 年 9 月 14 日
21	关于警惕不法分子冒用“中航基金”名义进行诈骗的风险提示公告	证券时报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023 年 9 月 20 日
22	中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金 2023 年第 3 季度报告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023 年 10 月 24 日
23	关于中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金增加销售机构的公告	证券时报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023 年 11 月 8 日
24	关于中航基金管理有限公司旗下部分产品增加销售机构的公告	证券时报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023 年 12 月 22 日

§ 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

本报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

1. 中国证监会批准中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金募集的文件
2. 《中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金基金合同》
3. 《中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金托管协议》
4. 基金管理人业务资格批件、营业执照
5. 报告期内中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金在规定媒体上披露的各项公告

13.2 存放地点

中航基金管理有限公司，地址：北京市朝阳区天辰东路 1 号院北京亚洲金融大厦 D 座第 8 层 801\805\806 单元。

13.3 查阅方式

1. 营业时间内到本公司免费查阅
2. 登录本公司网站查阅基金产品相关信息：www.avicfund.cn
3. 拨打本公司客户服务电话垂询：400-666-2186

中航基金管理有限公司

2024 年 3 月 29 日