

# 诺安鼎利混合型证券投资基金

## 2025 年年度报告

2025 年 12 月 31 日

基金管理人：诺安基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2026 年 03 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 03 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告财务资料已经审计，容诚会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2025 年 01 月 01 日起至 2025 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

§1	重要提示及目录 .....	2
1.1	重要提示 .....	2
1.2	目录 .....	3
§2	基金简介 .....	5
2.1	基金基本情况 .....	5
2.2	基金产品说明 .....	5
2.3	基金管理人和基金托管人 .....	7
2.4	信息披露方式 .....	7
2.5	其他相关资料 .....	7
§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 .....	9
3.3	过去三年基金的利润分配情况 .....	13
§4	管理人报告 .....	13
4.1	基金管理人及基金经理情况 .....	13
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 .....	18
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 .....	19
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	19
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 .....	20
§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 .....	20
6.1	审计报告基本信息 .....	20
6.2	审计报告的基本内容 .....	20
§7	年度财务报表 .....	22
7.1	资产负债表 .....	22
7.2	利润表 .....	24
7.3	净资产变动表 .....	25
7.4	报表附注 .....	26
§8	投资组合报告 .....	55
8.1	期末基金资产组合情况 .....	56
8.2	报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	56
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 .....	57
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动 .....	63
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	121
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 .....	121
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 .....	122

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 .....	122
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 .....	122
8.10	本基金投资股指期货的投资政策 .....	122
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	122
8.12	投资组合报告附注 .....	122
§9	基金份额持有人信息 .....	123
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	123
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	123
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	124
§10	开放式基金份额变动 .....	124
§11	重大事件揭示 .....	124
11.1	基金份额持有人大会决议 .....	124
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 .....	125
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	125
11.4	基金投资策略的改变 .....	125
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	125
11.6	管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 .....	125
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	125
11.8	其他重大事件 .....	127
§12	影响投资者决策的其他重要信息 .....	129
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 .....	129
12.2	影响投资者决策的其他重要信息 .....	129
§13	备查文件目录 .....	129
13.1	备查文件目录 .....	129
13.2	存放地点 .....	129
13.3	查阅方式 .....	130

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	诺安鼎利混合型证券投资基金		
基金简称	诺安鼎利混合		
基金主代码	006005		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2019 年 03 月 28 日		
基金管理人	诺安基金管理有限公司		
基金托管人	中国工商银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	912,406,441.29 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	诺安鼎利混合 A	诺安鼎利混合 C	诺安鼎利混合 D
下属分级基金的交易代码	006005	006006	022985
报告期末下属分级基金的份额总额	391,423,226.88 份	185,083,526.13 份	335,899,688.28 份

注：自 2025 年 3 月 17 日起，本基金增加 D 类基金份额，分设 A 类基金份额、C 类基金份额和 D 类基金份额。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制组合下行风险的基础上，通过积极的大类资产配置和个股个券精选，实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>1、大类资产配置策略</p> <p>本基金通过对国内外经济形势、宏观经济运行周期、财政及货币政策、资金供需情况、证券市场估值水平及信用风险等因素的研判，预测各大类资产在不同市场周期内的风险收益特征，并以此来调整基金资产在债券、股票、现金等大类资产之间的配置比例。</p> <p>2、类属资产配置策略</p> <p>受信用风险、税赋水平、市场流动性、市场风险等不同因素的影响，国债、央票、金融债、企业债、公司债、短期融资券等不同类属的券种收益率变化特征存在明显的差异，并表现出不同的利差变化趋势。基金管理人将分析各类属券种的利差变化趋势，合理配置并灵活调整不同类属券种在组合中的构成比例，通过对类属的合理配置力争获取超越基准的收益率水平。</p> <p>3、普通债券投资策略</p> <p>本基金将采取利率策略、期限结构策略、信用策略、息差策略和个券选择策略，判断不同债券在经济周期的不同阶段的相对投资价值，并确定不同债券在组合资产中的配置比例，实现组合的稳健增值。</p> <p>4、可转换债券投资策略</p> <p>本基金将积极参与公司发行条款较好、基本面优秀、申购收益</p>

	<p>高的可转债的一级市场申购，待其上市后依据对其正股的判断以及可转债合理定价水平决定继续持有或卖出；同时，本基金将综合运用多种投资策略在可转债二级市场上进行投资操作，力争在风险可控的前提下获取较高的投资收益。</p> <p>5、可交换债券投资策略</p> <p>可交换债券在换股期间用于交换的股票是发行人持有的其他上市公司（以下简称“目标公司”）的股票。可交换债券同样兼具股票和债券的特性。其中，债券特性与可转换债券相同，指持有至到期获取的票面利息和票面价值。股票特性则指目标公司的成长能力、盈利能力及目标公司股票价格的成长性等。本基金将通过可对可交换债券的纯债价值和目标公司的股票价值进行研究分析，综合开展投资决策。</p> <p>6、股票投资策略</p> <p>本基金可适当参与股票二级市场投资，增强基金资产收益。股票投资主要采用自上而下与自下而上相结合，定性分析与定量分析相结合。充分借鉴内部和外部研究观点，动态跟踪行业景气度和估值水平，优先选择具备完善的法人治理结构和有效的激励机制、明显受益于行业景气提升、根据市盈率（P/E）、市净率（P/B）和折现现金流（DCF）等指标衡量的估值水平相对偏低的上市公司。</p> <p>7、存托凭证投资策略</p> <p>本基金将根据投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的研究判断，进行存托凭证的投资。</p> <p>8、资产支持证券投资策略</p> <p>资产支持证券投资关键在于对基础资产质量及未来现金流的分析，本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下，采用基本面分析和数量化模型相结合，对个券进行风险分析和价值评估后进行投资。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。</p> <p>9、国债期货投资策略</p> <p>本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。</p> <p>10、权证投资策略</p> <p>在严格控制风险的前提下，本基金可适度进行权证投资。投资权证的目的为控制下跌风险和实现基金资产增值。</p> <p>未来，随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等，基金还将积极寻求其他投资机会，履行适当程序后更新</p>
--	--

	和丰富组合投资策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×20%+中证综合债指数收益率×80%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险、中高收益品种。

## 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		诺安基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李学君	郭明
	联系电话	0755-83026688	010-66105799
	电子邮箱	info@lionfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-8998	95588
传真		0755-83026677	010-66105798
注册地址		深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		518048	100140
法定代表人		李强	廖林

## 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.lionfund.com.cn
基金年度报告备置地点	深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层 诺安基金管理有限公司

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	容诚会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢 10 层 1001-1 至 1001-26
注册登记机构	诺安基金管理有限公司	深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数 据和指 标	2025 年			2024 年			2023 年		
	诺安鼎利 混合 A	诺安鼎利 混合 C	诺安鼎利 混合 D	诺安鼎 利混合 A	诺安鼎 利混合 C	诺 安 鼎 利	诺安鼎 利混合 A	诺安鼎 利混合 C	诺 安 鼎 利

						混 合 D			混 合 D
本期已实现收益	4,678,074.79	8,934,143.40	4,759,824.37	479,502.10	1,355,076.80	-	-236,776.31	-242,921.49	-
本期利润	3,767,131.99	8,572,431.19	4,130,632.01	594,885.33	1,575,474.98	-	-180,391.27	-157,509.69	-
加权平均基金份额本期利润	0.0335	0.0547	0.0312	0.0708	0.0858	-	-0.0126	-0.0136	-
本期加权平均净值利润率	2.48%	4.27%	2.31%	5.80%	7.21%	-	-1.05%	-1.15%	-
本期基金份额净值增长率	5.79%	5.15%	4.51%	6.40%	5.77%	-	-0.52%	-1.11%	-
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末			2024 年末			2023 年末		
	诺安鼎利混合 A	诺安鼎利混合 C	诺安鼎利混合 D	诺安鼎利混合 A	诺安鼎利混合 C	诺安鼎利混合 D	诺安鼎利混合 A	诺安鼎利混合 C	诺安鼎利混合 D
期末可供分配利润	140,868,005.04	56,199,016.83	119,868,531.42	1,956,619.56	2,932,091.12	-	2,517,064.58	1,949,897.93	-
期末可供分配基金份额利润	0.3599	0.3036	0.3569	0.2855	0.2397	-	0.2082	0.1721	-
期末基金资产净值	532,291,231.92	241,282,542.96	455,768,219.70	8,808,994.23	15,163,932.01	-	14,608,969.66	13,281,720.10	-
期末基金份额净值	1.3599	1.3036	1.3569	1.2855	1.2397	-	1.2082	1.1721	-
	2025 年末			2024 年末			2023 年末		

3.1.3 累计期末指标	诺安鼎利混合 A	诺安鼎利混合 C	诺安鼎利混合 D	诺安鼎利混合 A	诺安鼎利混合 C	诺安鼎利混合 D	诺安鼎利混合 A	诺安鼎利混合 C	诺安鼎利混合 D
基金份额累计净值增长率	35.99%	30.36%	4.51%	28.55%	23.97%	-	20.82%	17.21%	-

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

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

3、期末可供分配利润，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。

### 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

诺安鼎利混合 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	1.10%	0.20%	0.43%	0.19%	0.67%	0.01%
过去六个月	2.98%	0.18%	3.08%	0.18%	-0.10%	0.00%
过去一年	5.79%	0.19%	4.09%	0.18%	1.70%	0.01%
过去三年	11.97%	0.29%	15.81%	0.20%	-3.84%	0.09%
过去五年	16.18%	0.29%	17.37%	0.22%	-1.19%	0.07%
自基金合同生效起至今	35.99%	0.53%	32.61%	0.23%	3.38%	0.30%

诺安鼎利混合 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	0.94%	0.20%	0.43%	0.19%	0.51%	0.01%
过去六个月	2.66%	0.18%	3.08%	0.18%	-0.42%	0.00%
过去一年	5.15%	0.19%	4.09%	0.18%	1.06%	0.01%
过去三年	9.98%	0.29%	15.81%	0.20%	-5.83%	0.09%
过去五年	12.75%	0.29%	17.37%	0.22%	-4.62%	0.07%
自基金合同生效起至今	30.36%	0.53%	32.61%	0.23%	-2.25%	0.30%

诺安鼎利混合 D

阶段	份额净值	份额净值	业绩比较	业绩比较基	①-③	②-④
----	------	------	------	-------	-----	-----

	增长率①	增长率标准差②	基准收益率③	准收益率标准差④		
过去三个月	1.10%	0.20%	0.43%	0.19%	0.67%	0.01%
过去六个月	2.97%	0.18%	3.08%	0.18%	-0.11%	0.00%
自基金合同生效起至今	4.51%	0.18%	4.57%	0.17%	-0.06%	0.01%

### 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

诺安鼎利混合 A



诺安鼎利混合 C



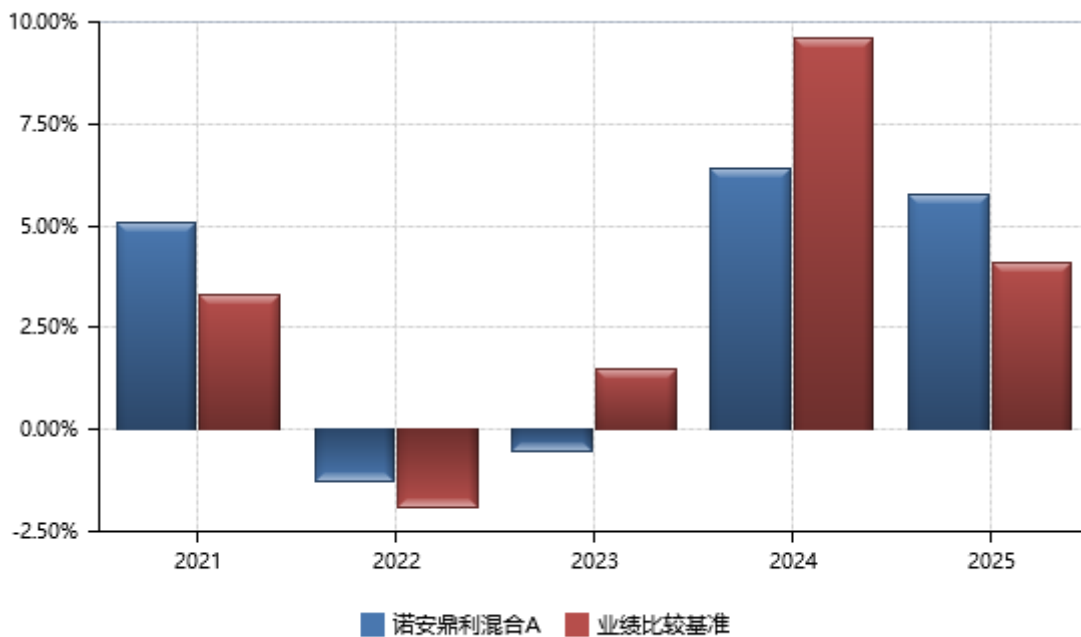
诺安鼎利混合 D



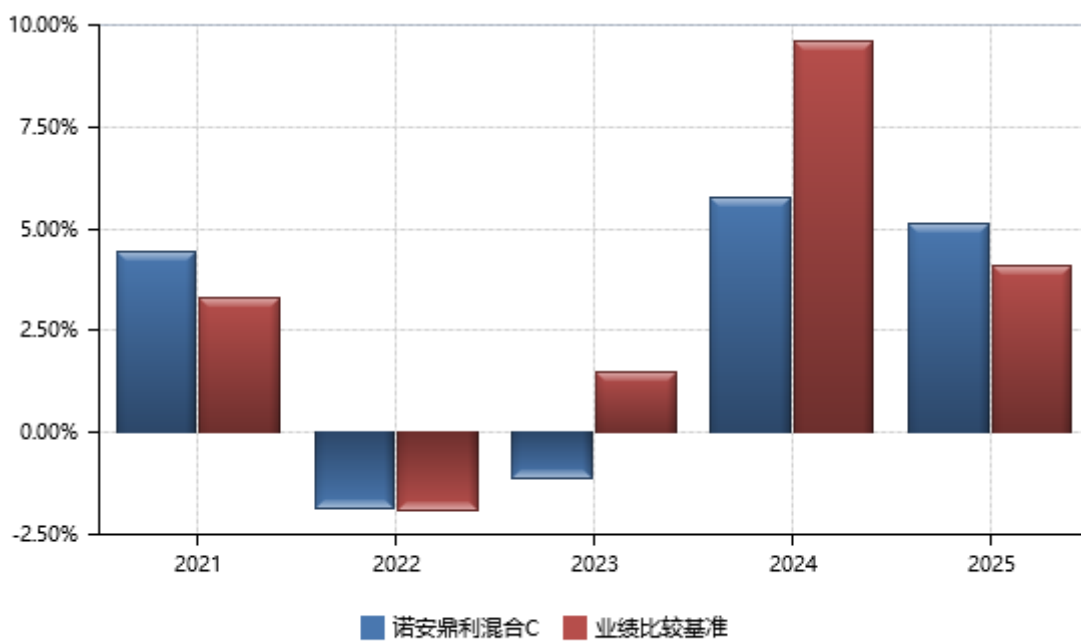
注：本基金各类份额自实际有资产之日起披露业绩数据。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

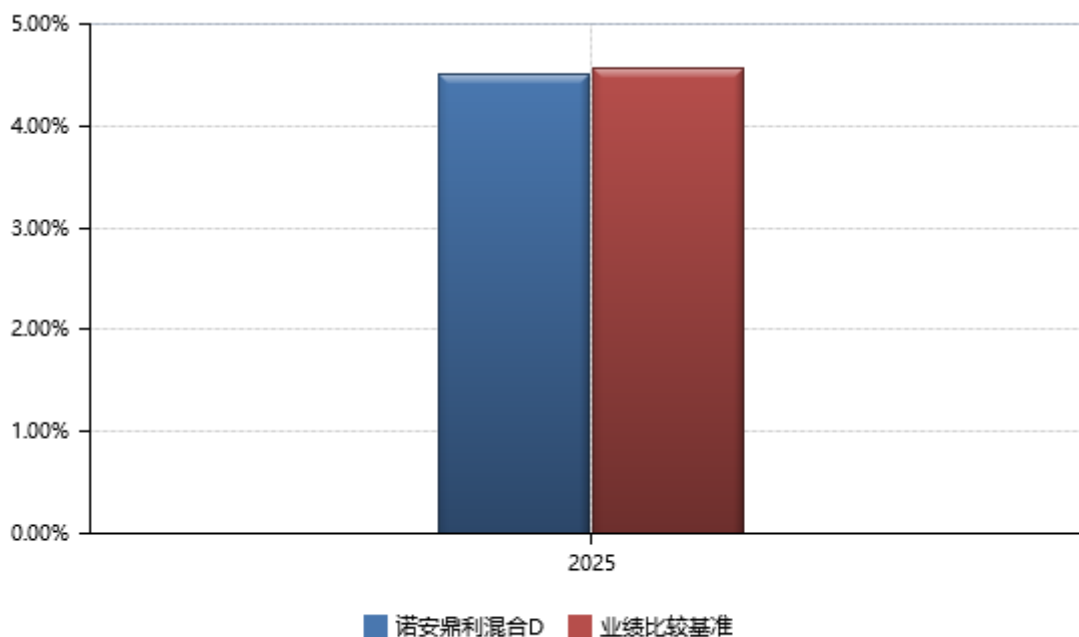
诺安鼎利混合 A



诺安鼎利混合 C



诺安鼎利混合 D



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

本基金过去三年未进行利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

截至 2025 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理六十一只开放式基金：诺安平衡证券投资基金、诺安货币市场基金、诺安先锋混合型证券投资基金、诺安优化收益债券型证券投资基金、诺安价值增长混合型证券投资基金、诺安灵活配置混合型证券投资基金、诺安成长混合型证券投资基金、诺安增利债券型证券投资基金、诺安中证 A100 指数证券投资基金、诺安中小盘精选混合型证券投资基金、诺安主题精选混合型证券投资基金、诺安全球黄金证券投资基金、诺安沪深 300 指数增强型证券投资基金、诺安行业轮动混合型证券投资基金、诺安多策略混合型证券投资基金、诺安油气能源股票证券投资基金（LOF）、诺安全球收益不动产证券投资基金、诺安新动力灵活配置混合型证券投资基金、诺安创业板指数增强型证券投资基金（LOF）、诺安策略精选股票型证券投资基金、诺安双利债券型发起式证券投资基金、诺安研究精选股票型证券投资基金、诺安鸿鑫混合型证券投资基金、诺安稳固收益一年定期开放债券型证券投资基金、诺安泰鑫一年定期开放债券型证券投资基金、诺安优势行业灵活配置混合型证券投资基金、诺安天天宝货币市场基金、诺安理财宝货

币市场基金、诺安聚鑫宝货币市场基金、诺安稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安聚利债券型证券投资基金、诺安新经济股票型证券投资基金、诺安低碳经济股票型证券投资基金、诺安中证 500 指数增强型证券投资基金、诺安创新驱动灵活配置混合型证券投资基金、诺安先进制造股票型证券投资基金、诺安利鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安景鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安益鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安安鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安精选回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安积极回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安优选回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安进取回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安高端制造股票型证券投资基金、诺安改革趋势灵活配置混合型证券投资基金、诺安瑞鑫定期开放债券型发起式证券投资基金、诺安圆鼎定期开放债券型发起式证券投资基金、诺安鑫享定期开放债券型发起式证券投资基金、诺安联创顺鑫债券型证券投资基金、诺安汇利灵活配置混合型证券投资基金、诺安积极配置混合型证券投资基金、诺安优化配置混合型证券投资基金、诺安浙享定期开放债券型发起式证券投资基金、诺安精选价值混合型证券投资基金、诺安鼎利混合型证券投资基金、诺安恒鑫混合型证券投资基金、诺安新兴产业混合型证券投资基金、诺安研究优选混合型证券投资基金、诺安均衡优选一年持有期混合型证券投资基金等。

#### 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		
张立	本基金基金经理	2021 年 11 月 13 日	-	12 年	硕士，具有基金从业资格，曾任国泰君安证券股份有限公司高级经理、建银国际（深圳）有限公司项目经理、平安信托有限公司产品经理。2016 年 12 月加入诺安基金管理有限公司，历任基金经理助理。2020 年 5 月至 2025 年 8 月任诺安增利债券型证券投资基金基金经理。2021 年 11 月起任诺安优化收益债券型证券投资基金、诺安鼎利混合型证券投资基金基金经理。

					理。
孔宪政	本基金基金经理	2023 年 02 月 21 日	-	14 年	<p>博士，具有基金从业资格。历任野村证券交易员、白湾基金投资经理、前海开源基金投资部副总监、兴证证券资产管理有限公司投资部投资经理、蜂巢基金管理有限公司基金经理。</p> <p>2021 年 10 月加入诺安基金管理有限公司，历任多资产投资部总经理兼国际业务部总经理，现任多资产投资部总经理。</p> <p>2023 年 2 月至 2024 年 8 月任诺安双利债券型发起式证券投资基金基金经理、诺安汇利灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2023 年 2 月起任诺安多策略混合型证券投资基金基金经理、诺安鼎利混合型证券投资基金基金经理，2023 年 6 月起任诺安沪深 300 指数增强型证券投资基金及诺安中证 500 指数增强型证券投资基金基金经理，2025 年 3 月起任诺安策略精选股票型证券投资基金基金经理。</p>
周颖恺	本基金基金经理	2023 年 05 月 20 日	-	7 年	<p>硕士，具有基金从业资格。曾任兴证证券资产管理有限公司研究员、风险管理岗、上海浦东发展银行资产管理部投资研究岗。2022 年 6 月加入诺安基金管理有限公</p>

					司，历任研究员。 2023 年 5 月起任诺安鼎利混合型证券投资基金基金经理，2025 年 3 月起任诺安策略精选股票型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：①此处基金经理的任职日期指根据公司决定确定的聘任日期；

②证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》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

报告期间，本基金管理人严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规，遵守了基金合同的规定，遵守了本公司管理制度。本基金投资管理未发生违法违规行为。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会 2011 年修订的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本公司更新并完善了《诺安基金管理有限公司公平交易制度》。制度的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时涵盖投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

投资研究方面，公司设立全公司所有投资组合适用的证券备选库，在此基础上，不同投资组合根据其投资目标、投资风格和投资范围的不同，建立不同投资组合的投资对象备选库和交易对手备选库；公司拥有健全的投资授权制度，明确各投资决策主体的职责和权限划分，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序；公司建立了统一的研究管理平台，所有内外部研究报告均通过该研究管理平台发布，并保障该平台对所有研究员和投资组合经理开放。

交易执行方面，对于场内交易，基金管理人在投资交易系统中设置了公平交易功能，交易中心按照时间优先、价格优先的原则执行所有指令，如果多个投资组合在同一时点就同一证券下达了相同方向的投资指令，并且市价在指令限价以内，投资交易系统自动将该证券的每笔交易报单都自动按比例分拆到各投资组合；对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易的交易分配，在参与申购之前，各投资组合经理独立地确定申购价格和数量，并下达申购指令。公司在获配额度确定后，按照价格优先的原则进行分配，如果申购价格相同，则根据该价位各投资组合的申

购数量进行比例分配；对于银行间市场交易、固定收益平台、交易所大宗交易，投资组合经理以该投资组合的名义向交易中心下达投资指令，交易中心向银行间市场或交易对手询价、成交确认，并根据“时间优先、价格优先”的原则保证各投资组合获得公平的交易机会。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好，未发现违反公平交易制度的情况。此外，公司对连续四个季度期间内，公司管理的不同投资组合在日内、3日内、5日内的同向交易的交易价差进行了分析，未发现同向交易价差在上述时间窗口下出现异常的情况。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量不存在超过该证券当日成交量的 5%的情况。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2025 年，尽管全球地缘冲突频发、关税博弈反复，但国内在财政发力、货币宽松与出口竞争优势的共同作用下，经济总量保持韧性并完成全年 GDP5%的目标，节奏上呈“前高后低”态势，结构上供强需弱，出口偏强，内需中投资偏弱，消费先强后弱，经济结构仍处于旧动能向新经济转型过程中，虽然旧动能中的房地产投资延续明显放缓，但高科技和新质生产力快速发展，加快了转型进程。通胀方面，CPI、PPI 虽有所回升，但仍处于偏低水平。海外方面，在美元信用走弱、全球产业链重构背景下，全球分化、充满不确定性及注重安全将是常态。

权益方面，报告期内我们对股票市场保持了中性偏多的仓位，持续积极看多股票资产。结构层面，报告期间我们调高了成长股的配置权重，一方面报告期初以“杭州六小龙”为代表的中国科技企业成功出圈引起全球广泛关注，另一方面政策对于市场的呵护和市场成交量活跃给中小市值上市公司提供了优渥的生长土壤，成长类持仓在报告期间给产品提供了丰厚的收益。综合来看，报告期内股票资产从资产配置和个股选择两方面均取得了正向的超额收益。但值得注意的是，报告期内股票市场呈现出极低风险的特征，这样的风险水平在长期难以持续，我们预期未来一年很快会看到市场波动加剧。同时，伴随科技成长类行业和中小盘宽基指数普遍创下十年新高，近期市场头部宽基 ETF 品种出现被放量卖出的迹象，股票类资产的配置价值正在边际递减。对于一款类“固收+”策略的偏债混合型产品来说，无论从大类资产的角度还是个股角度，股票资产的安全边际始终是我们对于投资组合的重要考量因素。短期我们认为牛市仍然没有走到尾声，科技板块的热度也未消退，

产品会保持偏高的股票仓位运作并维持成长策略偏高的配置。不过从中长期的配置视角我们将会在未来一年逐步收缩权益类资产的配置占比，并且将配置结构往更具性价比的内需板块倾斜。

债市方面，2025 年是从“单边牛市”过渡到“高波动震荡市”的关键转折年，利率全年窄幅震荡、长短端分化，10 年期国债收益率全年大致在 1.6% - 1.9% 区间反复拉锯，利率债整体收益有限但波段机会密集，信用债则受益于化债托底，信用利差整体处于低位，除了二永债跟随利率大幅波动外，其余城投、产业债整体信用利差压缩至历史低位；转债在股市向好、债券收益率低位以及转债供需错配影响下，表现较好，转债价格、估值达历史高位。操作上，组合根据市场变化，对转债仓位及纯债仓位、久期进行了灵活调整。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末诺安鼎利混合 A 份额净值为 1.3599 元，本报告期诺安鼎利混合 A 份额净值增长率为 5.79%，同期业绩比较基准收益率为 4.09%；截至本报告期末诺安鼎利混合 C 份额净值为 1.3036 元，本报告期诺安鼎利混合 C 份额净值增长率为 5.15%，同期业绩比较基准收益率为 4.09%；截至本报告期末诺安鼎利混合 D 份额净值为 1.3569 元，本报告期诺安鼎利混合 D 份额净值增长率为 4.51%，同期业绩比较基准收益率为 4.57%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

报告期内，国内经济数据总体稳健，上半年的关税冲击已趋于缓和，且下半年出现一定需求端政策发力加码的迹象，尤其大范围“反内卷”的供给侧改革持续发力使得短期有望看到通胀数据重回政策目标区间并给企业利润提供空间。行业层面上半年表现并不理想的周期品出现估值的快速修复和悲观情绪转暖，下半年至今涨价逻辑刺激部分行业出现较大涨幅。在物价层面出现向上拐点的阶段，结合《“十五五”规划建议》中将“建设强大国内市场”放到了核心的位置，股票资产整体估值也较基本面提前出现趋势性上升。当前股票估值水平已经到了偏高的位置，政策层面对于科技创新提供的支持已绝大部分反映在当前股价之中，而企业发展能否兑现投资者的热情与预期尚未可知。未来一年内，我们预测市场波动相比本次报告期内会出现明显放大，而部分追逐高弹性资产的资金将在市场风险放大后回流至稳健类资产。长期来看，未来国内投资仍面临低利率和资产荒的环境约束，政策围绕“建设国内市场”具体会出台什么样的措施将会是下一年市场核心的预期差所在。

转债相对纠结一些，主要源自历史新高的估值与价格，低价转债稀少（即将到期的不算），当下容错率低的可行策略基本无效，预计 2026 年转债波动率会提升；债市方面，短期来看，央行的结构性降息及关于国债买卖、降准降息空间表述利好债市，中期利率将受到通胀、大类资产再平衡

及供需等不利影响，总体来说，中短端债券相对确定性更高些。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

在内部监察稽核工作中，本基金管理人始终坚守合法合规、基金份额持有人利益至上的核心宗旨，构建多层次、多维度的合规风控体系。严格遵循独立、客观、公正原则，依照监察稽核工作计划及流程规范履职，确保勤勉尽责管理基金资产。本年度工作开展情况如下：

在合规管理方面，扎实推进法律法规、高质量发展行动方案等重要政策法规落地执行，持续加强全员合规培训，不断优化内部制度体系、内部控制体系、内部审计体系及廉洁文化建设，从源头筑牢合规经营防线。

在风险控制方面，常态化监督基金日常投资运作，强化流动性风险管理，完善压力测试机制与应急预案，保障基金资产合规稳健运行。

在监察稽核方面，采用定期稽核与专项稽核相结合方式，对公司治理、投研交易、销售运营、信息技术、反洗钱等关键环节实现全覆盖检查，对发现问题推动整改闭环管理。

在宣传推介方面，公司严格履行适当性管理相关要求，积极践行社会责任，多措并举开展投资者教育工作。

本基金管理人将始终秉持诚实信用、勤勉尽责原则，坚守合规底线，稳健经营、严控风险，全力为基金份额持有人谋求长期稳定收益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，负责研究、指导基金估值业务，制定和适时修订基金的估值政策和程序。估值委员会由督察长、投资、研究、风险管理、法律合规和基金运营等部门负责人及指定人员组成，估值委员会成员具有多年证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

本基金管理人已与第三方定价服务机构签署服务协议，由其按约定提供相关参考数据。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行过利润分配。该处理符合相关法律法规及《基金合同》约定。

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

截至 2025 年 04 月 01 日，本基金存在连续 60 个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形。

基金管理人积极与基金托管人协商解决方案，包括但不限于持续营销、转换运作方式、与其他基金合并等，并适时根据法律法规及基金合同约定的程序进行。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期内，本基金的管理人——诺安基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

#### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对诺安基金管理有限公司编制和披露的本基金 2025 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

### § 6 审计报告

#### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	容诚审字[2026]200Z0201 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	诺安鼎利混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了诺安鼎利混合型证券投资基金（以下简称“诺安鼎利基金”）财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表，2025 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准

	<p>则在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了诺安鼎利基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 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和中国注册会计师独立性准则，我们独立于诺安鼎利基金，并遵守了独立性准则中适用于公众利益实体财务报表审计的规定，同时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>诺安鼎利基金的基金管理人诺安基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括诺安鼎利基金 2025 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，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诺安鼎利基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算诺安鼎利基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督诺安鼎利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</p>

	<p>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，就可能对诺安鼎利基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致诺安鼎利基金不能持续经营。</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>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	容诚会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	周祎 崔泽宇
会计师事务所的地址	北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢 10 层 1001-1 至 1001-26
审计报告日期	2026 年 03 月 30 日

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：诺安鼎利混合型证券投资基金

报告截止日：2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	86,130,579.51	1,446,558.98
结算备付金		3,526,972.10	389,744.94

存出保证金		154,009.75	9,797.60
交易性金融资产	7.4.7.2	1,260,471,877.23	23,400,244.01
其中：股票投资		234,702,211.32	4,623,507.00
基金投资		-	-
债券投资		1,025,769,665.91	18,776,737.01
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	-	-
应收清算款		9,670,554.54	7,120.73
应收股利		-	-
应收申购款		285,396.57	3,709.39
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		1,360,239,389.70	25,257,175.65
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2025年12月31日</b>	<b>上年度末 2024年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		113,019,549.15	1,199,918.96
应付清算款		-	12,201.44
应付赎回款		15,657,768.59	2,301.45
应付管理人报酬		1,084,836.78	23,571.09
应付托管费		216,967.37	4,714.23
应付销售服务费		138,838.57	10,216.83
应付投资顾问费		-	-
应交税费		19,108.86	942.30
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	760,325.80	30,383.11
负债合计		130,897,395.12	1,284,249.41
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	912,406,441.29	19,084,215.56
未分配利润	7.4.7.8	316,935,553.29	4,888,710.68
净资产合计		1,229,341,994.58	23,972,926.24
负债和净资产总计		1,360,239,389.70	25,257,175.65

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，诺安鼎利混合 A 基金份额净值 1.3599 元，基金份额总额 391,423,226.88 份；诺安鼎利混合 C 基金份额净值 1.3036 元，基金份额总额 185,083,526.13 份；诺安鼎利混合 D 基金份额净值 1.3569 元，基金份额总额 335,899,688.28 份。诺安鼎利混合份

额总额合计为 912,406,441.29 份。

## 7.2 利润表

会计主体：诺安鼎利混合型证券投资基金

本报告期：2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		24,178,096.57	2,723,603.25
1. 利息收入		237,292.68	20,287.42
其中：存款利息收入	7.4.7.9	102,685.57	9,367.45
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		134,607.11	10,919.97
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		24,989,639.97	2,360,120.44
其中：股票投资收益	7.4.7.10	14,215,227.71	1,144,080.29
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	8,540,011.34	826,036.04
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.12	-	-
股利收益	7.4.7.13	2,234,400.92	390,004.11
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.14	-1,901,847.37	335,781.41
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	853,011.29	7,413.98
<b>减：二、营业总支出</b>		7,707,901.38	553,242.94
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	4,896,908.75	318,889.67
2. 托管费	7.4.10.2.2	979,381.63	63,777.89
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	1,203,387.00	129,520.86
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		447,857.71	10,862.54
其中：卖出回购金融资产支出		447,857.71	10,862.54
6. 信用减值损失	7.4.7.16	-	-
7. 税金及附加		8,291.00	687.25
8. 其他费用	7.4.7.17	172,075.29	29,504.73
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		16,470,195.19	2,170,360.31
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		16,470,195.19	2,170,360.31

五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		16,470,195.19	2,170,360.31

### 7.3 净资产变动表

会计主体：诺安鼎利混合型证券投资基金

本报告期：2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配 利润	净资产合计
一、上期期末净资产	19,084,215.56	4,888,710.68	23,972,926.24
二、本期期初净资产	19,084,215.56	4,888,710.68	23,972,926.24
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	893,322,225.73	312,046,842.61	1,205,369,068.34
（一）、综合收益总额	-	16,470,195.19	16,470,195.19
（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）	893,322,225.73	295,576,647.42	1,188,898,873.15
其中：1. 基金申购款	1,548,819,106.31	489,543,077.59	2,038,362,183.90
2. 基金赎回款	-655,496,880.58	-193,966,430.17	-849,463,310.75
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	912,406,441.29	316,935,553.29	1,229,341,994.58
项目	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配 利润	净资产合计
一、上期期末净资产	23,423,727.25	4,466,962.51	27,890,689.76
二、本期期初净资产	23,423,727.25	4,466,962.51	27,890,689.76
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-4,339,511.69	421,748.17	-3,917,763.52
（一）、综合收益总额	-	2,170,360.31	2,170,360.31
（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）	-4,339,511.69	-1,748,612.14	-6,088,123.83
其中：1. 基金申购款	38,835,512.57	8,519,445.95	47,354,958.52
2. 基金赎回款	-43,175,024.26	-10,268,058.09	-53,443,082.35
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	19,084,215.56	4,888,710.68	23,972,926.24

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>齐斌</u>	<u>田冲</u>	<u>何柳姿</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

诺安鼎利混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可(2018)774号《关于准予诺安鼎利混合型证券投资基金注册的批复》及机构部函(2018)2952号《关于诺安鼎利混合型证券投资基金延期募集备案的回函》注册,由诺安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《诺安鼎利混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集322,154,278.13元。经向中国证监会备案,《诺安鼎利混合型证券投资基金基金合同》于2019年3月28日正式生效。基金合同生效日的基金份额总额为322,344,765.76份基金份额,其中认购资金利息折合190,487.63份基金份额。本基金的基金管理人为诺安基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据本基金的基金管理人诺安基金管理有限公司于2025年3月17日发布的《诺安基金管理有限公司关于诺安鼎利混合型证券投资基金增加基金份额类别并修改基金合同、托管协议等法律文件部分条款的公告》以及更新的《诺安鼎利混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,自2025年3月17日起,本基金增加基金份额类别。本基金增加基金份额类别后,设A类基金份额、C类基金份额和D类基金份额三类基金份额。其中,A类基金份额和D类基金份额在申购时收取申购费用、在赎回时根据持有期限收取赎回费用,但不从该类别基金资产中计提销售服务费;C类基金份额在申购时不收取申购费用,在赎回时根据持有期限收取赎回费用,且从该类别基金资产中计提销售服务费。本基金A类、C类和D类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金A类基金份额、C类基金份额和D类基金份额将分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《诺安鼎利混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、存托凭证、债券(包括国内依法发行、上市的国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转换债券(含可分离交易可转债)、可交换债券、短期融资券、次级债等)、债券回购、货币市场工具、同业存单、权证、资产支持证券、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)。本基金可投资于持有可转债、可交换债券转股所得的股票以及权证等中国证监会允许基金投资的其它金融工具,也可直接从二级市场上买入股票和权证。如法律法规或中国证监会允许基金投资其他品种的,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入本基金的投资范围。本基金的投资组合比例为:股票、存托凭证资产占基金资产的比例为 0-30%;债券等固定收益类金融工具投资占基金资产的比例不低于 70%,权证投资比例不高于基金资产净值的 3%。每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率 $\times$ 20%+中证综合债指数收益率 $\times$ 80%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则——基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《诺安鼎利混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2025 年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具,是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成

为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

### (1) 金融资产

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业务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。

#### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

#### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务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。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为货币资金、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

#### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

#### 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

### (2) 金融负债

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。

### (3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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，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。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、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。

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；或者(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、存托凭证、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，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。采用估值技术时，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，才可以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金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的

特征(例如它们必须都具有可回售特征,并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同);(4)除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外,该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征;(5)该工具在存续期内的预计现金流量总额,应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具,是指根据合同约定,持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利,或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时,自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同:(1)现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响);(2)实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具,列报于净资产。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列,并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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。债券投资和资产支持证券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及在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税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则按直线法计算。

#### 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则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，若《诺安鼎利混合型证券投资基金基金合同》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，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；投资者可对 A 类基金份额、C 类基金份额和 D 类基金份额分别选择不同的收益分配方式；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后各类基金份额净值均不能低于面值，即基金收益分配基准日的任一类基金份额净值减去该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、本基金同一类别的每份基金份额享有同等分配权，由于本基金各类基金份额收取费用情况不同，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同；

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

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

(1)对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告〔2017〕13号《中国证监会关于证券投资基金估值

业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发〔2017〕6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和可交换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告〔2017〕13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字〔2022〕566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和可交换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间未发生重大会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间未发生重大会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间未发生重大会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税〔2002〕128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税〔2008〕1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税〔2012〕85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税〔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》、财税〔2016〕140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税〔2017〕2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税〔2017〕56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税〔2017〕90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入，免征增值税直至债券到期。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 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，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

## 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日		上年度末 2024年12月31日	
	活期存款	86,130,579.51	1,446,558.98	1,446,558.98
等于：本金	86,122,438.23		1,446,390.74	
加：应计利息	8,141.28		168.24	
定期存款	-		-	
等于：本金	-		-	
加：应计利息	-		-	
其中：存款期限1个月以内	-		-	
存款期限1-3个月	-		-	
存款期限3个月以上	-		-	
其他存款	-		-	
等于：本金	-		-	
加：应计利息	-		-	
合计	86,130,579.51		1,446,558.98	

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	232,810,954.32	-	234,702,211.32	1,891,257.00	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	110,020,923.14	982,918.50	110,752,298.50	-251,543.14
	银行间市场	909,727,226.21	8,449,367.41	915,017,367.41	-3,159,226.21
	合计	1,019,748,149.35	9,432,285.91	1,025,769,665.91	-3,410,769.35
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	1,252,559,103.67	9,432,285.91	1,260,471,877.23	-1,519,512.35	
项目	上年度末 2024年12月31日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	4,833,895.59	-	4,623,507.00	-210,388.59	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	

债券	交易所市场	16,002,125.21	193,208.49	16,777,942.49	582,608.79
	银行间市场	1,981,885.18	6,794.52	1,998,794.52	10,114.82
	合计	17,984,010.39	200,003.01	18,776,737.01	592,723.61
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		22,817,905.98	200,003.01	23,400,244.01	382,335.02

#### 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

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

#### 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

本基金本报告期末及上年度末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

本基金本报告期末及上年度末未持有从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

无。

#### 7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

#### 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	2,989.33	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	624,489.91	20,200.34
其中：交易所市场	611,041.54	19,590.11
银行间市场	13,448.37	610.23
应付利息	-	-
预提费用	132,846.56	10,182.77

合计	760,325.80	30,383.11
----	------------	-----------

#### 7.4.7.7 实收基金

诺安鼎利混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	6,852,374.67	6,852,374.67
本期申购	447,385,445.74	447,385,445.74
本期赎回（以“-”号填列）	-62,814,593.53	-62,814,593.53
本期末	391,423,226.88	391,423,226.88

诺安鼎利混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	12,231,840.89	12,231,840.89
本期申购	680,868,513.00	680,868,513.00
本期赎回（以“-”号填列）	-508,016,827.76	-508,016,827.76
本期末	185,083,526.13	185,083,526.13

诺安鼎利混合 D

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	420,565,147.57	420,565,147.57
本期赎回（以“-”号填列）	-84,665,459.29	-84,665,459.29
本期末	335,899,688.28	335,899,688.28

#### 7.4.7.8 未分配利润

诺安鼎利混合 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,965,686.32	-1,009,066.76	1,956,619.56
本期期初	2,965,686.32	-1,009,066.76	1,956,619.56
本期利润	4,678,074.79	-910,942.80	3,767,131.99
本期基金份额交易产生的变动数	189,799,012.96	-54,654,759.47	135,144,253.49
其中：基金申购款	220,919,962.13	-63,817,708.80	157,102,253.33
基金赎回款	-31,120,949.17	9,162,949.33	-21,957,999.84
本期已分配利润	-	-	-

本期末	197,442,774.07	-56,574,769.03	140,868,005.04
-----	----------------	----------------	----------------

诺安鼎利混合 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,710,724.28	-1,778,633.16	2,932,091.12
本期期初	4,710,724.28	-1,778,633.16	2,932,091.12
本期利润	8,934,143.40	-361,712.21	8,572,431.19
本期基金份额交易产生的变动数	68,980,271.83	-24,285,777.31	44,694,494.52
其中：基金申购款	284,780,086.79	-97,712,586.15	187,067,500.64
基金赎回款	-215,799,814.96	73,426,808.84	-142,373,006.12
本期已分配利润	-	-	-
本期末	82,625,139.51	-26,426,122.68	56,199,016.83

诺安鼎利混合 D

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	4,759,824.37	-629,192.36	4,130,632.01
本期基金份额交易产生的变动数	164,533,634.54	-48,795,735.13	115,737,899.41
其中：基金申购款	206,588,451.84	-61,215,128.22	145,373,323.62
基金赎回款	-42,054,817.30	12,419,393.09	-29,635,424.21
本期已分配利润	-	-	-
本期末	169,293,458.91	-49,424,927.49	119,868,531.42

#### 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025年01月01日至2025年12月31日	2024年01月01日至2024年12月31日
活期存款利息收入	98,612.55	6,223.72
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	3,876.55	3,066.04
其他	196.47	77.69
合计	102,685.57	9,367.45

注：此处“其他”列示的是存出保证金利息收入。

#### 7.4.7.10 股票投资收益

##### 7.4.7.10.1 股票投资收益—买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025年01月01日至2025年12月	2024年01月01日至2024年12月31日

	31 日	
卖出股票成交总额	1,860,160,667.52	130,232,397.96
减：卖出股票成本总额	1,843,640,982.21	128,885,873.61
减：交易费用	2,304,457.60	202,444.06
买卖股票差价收入	14,215,227.71	1,144,080.29

#### 7.4.7.11 债券投资收益

##### 7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
债券投资收益--利息收入	9,069,149.11	622,976.32
债券投资收益--买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-529,137.77	203,059.72
债券投资收益--赎回差价收入	-	-
债券投资收益--申购差价收入	-	-
合计	8,540,011.34	826,036.04

##### 7.4.7.11.2 债券投资收益--买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	384,409,824.39	46,369,406.05
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	378,536,449.01	45,487,457.15
减：应计利息总额	6,384,875.56	677,574.68
减：交易费用	17,637.59	1,314.50
买卖债券差价收入	-529,137.77	203,059.72

#### 7.4.7.12 衍生工具收益

##### 7.4.7.12.1 衍生工具收益--买卖权证差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间内无衍生工具收益。

#### 7.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	2,234,400.92	390,004.11
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	2,234,400.92	390,004.11

#### 7.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-1,901,847.37	335,781.41
-- 股票投资	2,101,645.59	-101,037.69
-- 债券投资	-4,003,492.96	436,819.10
-- 资产支持证券投资	-	-
-- 基金投资	-	-
-- 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	-1,901,847.37	335,781.41

#### 7.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	804,817.15	7,383.06
其他	48,194.14	30.92
合计	853,011.29	7,413.98

注：此处“其他”列示的是基金转换费收入等。

#### 7.4.7.16 信用减值损失

本基金本报告期内及上年度可比期间内无信用减值损失。

#### 7.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
审计费用	21,299.79	3,982.77
信息披露费	102,246.77	-
证券出借违约金	-	-
存托服务费	0.92	0.76
汇划手续费	16,905.47	721.20
账户维护费	31,622.34	24,800.00
合计	172,075.29	29,504.73

注：本报告期内本基金管理人主动承担了本基金部分基金费用，如审计费、信息披露费等。

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无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
诺安基金管理有限公司	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
中国对外经济贸易信托有限公司	基金管理人的股东
深圳市捷隆投资有限公司	基金管理人的股东
大恒新纪元科技股份有限公司	基金管理人的股东
诺安资产管理有限公司	基金管理人的子公司
诺安控股（香港）有限公司	基金管理人的子公司
诺安基金（香港）有限公司	基金管理人子公司控股的公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

### 7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

### 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 2025年01月01日至 2025年12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至 2024年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	4,896,908.75	318,889.67
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,711,056.30	111,641.89
应支付基金管理人的净管理费	3,185,852.45	207,247.78

注：本基金的管理费率为年费率 1.00%。

基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年 12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024 年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	979,381.63	63,777.89

注：本基金的托管费率为年费率 0.20%。

基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

#### 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 2025年01月01日至2025年12月31日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	诺安鼎 利混合	诺安鼎利混合 C	诺安鼎 利混合	合计

	A		D	
诺安基金管理有限公司	-	18,637.75	-	18,637.75
中国工商银行股份有限公司	-	1,166,263.18	-	1,166,263.18
合计	-	1,184,900.93	-	1,184,900.93
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	诺安鼎利混合 A	诺安鼎利混合 C	诺安鼎利混合 D	合计
诺安基金管理有限公司	-	-	-	-
中国工商银行股份有限公司	-	127,627.42	-	127,627.42
合计	-	127,627.42	-	127,627.42

注：本基金诺安鼎利混合 A 类基金份额和 D 类基金份额不收取销售服务费，诺安鼎利混合 C 类份额的年销售服务费年费率为 0.60%。

诺安鼎利混合 C 的销售服务费计算方法如下：

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

H 为诺安鼎利混合 C 每日应计提的销售服务费

E 为诺安鼎利混合 C 前一日的基金资产净值

#### 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

本基金本报告期内及上年度可比期间内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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生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。

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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生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。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

本基金本报告期内及上年度可比期间内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

#### 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

本基金本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 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 2025年01月01日至2025年12月31日		上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司-活期存款	86,130,579.51	98,612.55	1,446,558.98	6,223.72

注：本基金由基金托管人保管的银行存款，按银行约定利率计息。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间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

##### 7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本报告期内本基金管理人主动承担了本基金部分基金费用，如审计费、信息披露费等。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末 2025 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
001233	海安集团	2025年11月18日	6个月	新股锁定	48.00	51.88	370	17,760.00	19,195.60	-
001280	中国铀业	2025年11月25日	6个月	新股锁定	17.89	45.36	2,277	40,735.53	103,284.72	-

		日								
001369	双欣材料	2025年12月23日	6个月	新股锁定	6.85	12.89	897	6,144.45	11,562.33	-
001396	誉帆科技	2025年12月23日	6个月	新股锁定	22.29	35.39	69	1,538.01	2,441.91	-
301449	天溯计量	2025年12月16日	6个月	新股锁定	36.80	65.23	112	4,121.60	7,305.76	-
301638	南网数字	2025年11月11日	6个月	新股锁定	5.69	14.21	2,322	13,212.18	32,995.62	-
301667	纳百川	2025年12月10日	6个月	新股锁定	22.63	57.07	151	3,417.13	8,617.57	-
301687	新广益	2025年12月24日	6个月	新股锁定	21.93	54.39	195	4,276.35	10,606.05	-
603092	德力佳	2025年10月30日	6个月	新股锁定	46.68	55.66	146	6,815.28	8,126.36	-
603248	锡华科技	2025年12月16日	6个月	新股锁定	10.10	16.30	260	2,626.00	4,238.00	-
603334	丰倍生物	2025年10月29日	6个月	新股锁定	24.49	32.82	88	2,155.12	2,888.16	-
603376	大明电子	2025年10月28日	6个月	新股锁定	12.55	26.21	111	1,393.05	2,909.31	-
688727	恒坤新材	2025年11月11日	6个月	新股锁定	14.99	34.87	563	8,439.37	19,631.81	-
688759	必贝特	2025年10月21日	6个月	新股锁定	17.78	25.11	2,789	49,588.42	70,031.79	-
688790	昂瑞微	2025年12月09日	6个月	新股锁定	83.06	117.19	516	42,858.96	60,470.04	-
688795	摩尔线程	2025年11月26日	6个月	新股锁定	114.28	416.18	823	94,052.44	342,516.14	-

688796	百奥赛图	2025 年 12 月 02 日	6 个月	新股锁定	26.68	42.25	423	11,285.64	17,871.75	-
688802	沐曦股份	2025 年 12 月 09 日	6 个月	新股锁定	104.66	399.31	584	61,121.44	233,197.04	-
688805	健信超导	2025 年 12 月 17 日	6 个月	新股锁定	18.58	32.37	265	4,923.70	8,578.05	-
688809	强一股份	2025 年 12 月 23 日	6 个月	新股锁定	85.09	203.31	259	22,038.31	52,657.29	-

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

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 113,019,549.15 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
092280069	22 华夏银行二级资本债 01	2026 年 01 月 05 日	103.19	100,000	10,318,649.32
092280080	22 光大银行二级资本债 01A	2026 年 01 月 05 日	103.17	300,000	30,950,794.52
092280108	22 中行二级资本债 02A	2026 年 01 月 05 日	102.69	100,000	10,269,348.49
232400035	24 南京银行二级资本债 01	2026 年 01 月 05 日	101.30	55,000	5,571,281.51
240210	24 国开 10	2026 年 01 月 05 日	104.25	653,000	68,072,119.18
合计				1,208,000	125,182,193.02

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是混合型基金，其长期平均风险和预期收益水平高于债券型基金及货币市场基金，低于股票型基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金在日常投资管理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标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以合规审查与风险控制委员会、督察长、合规风控委员会、监察稽核部、风险控制部和相关业务部门构成的多层级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规审查与风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；本基金的基金管理人设立督察长制度，积极对公司各项制度、业务的合法合规性及内部控制制度的执行情况进行监察、稽核，定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况；在管理层层面设立合规风控委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部、风险控制部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存

放在本基金的托管人中国工商银行股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	115,362,865.21	1,518,950.96
合计	115,362,865.21	1,518,950.96

注：未评级债券为国债、政策性金融债、央行票据或无第三方机构评级的债券。

#### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

#### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
AAA	440,249,296.39	6,142,364.23
AAA 以下	10,003,935.89	2,069,395.30
未评级	460,153,568.42	9,046,026.52
合计	910,406,800.70	17,257,786.05

注：未评级债券为国债、政策性金融债、央行票据或无第三方机构评级的债券。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

#### 7.4.13.3 流动性风险

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

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

于 2025 年 12 月 31 日，除卖出回购金融资产款将在一个月以内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（净资产）无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

##### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金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》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、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

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%。于 2025 年 12 月 31 日，本基金持有

的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合法律法规的相关要求。

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。于 2025 年 12 月 31 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

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。

#### 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。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，因此存在相应的利率风险。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						
货币资金	86,130,579.51	-	-	-	-	86,130,579.51
结算备付金	3,526,972.10	-	-	-	-	3,526,972.10
存出保证金	154,009.75	-	-	-	-	154,009.75
交易性金融资	106,366,083.	81,590,749.	439,379,990.	398,432,842.	234,702,211.	1,260,471,877

产	29	59	32	71	32	.23
应收清算款	-	-	-	-	9,670,554.54	9,670,554.54
应收申购款	-	-	-	-	285,396.57	285,396.57
资产总计	196,177,644.65	81,590,749.59	439,379,990.32	398,432,842.71	244,658,162.43	1,360,239,389.70
负债						
卖出回购金融资产款	113,019,549.15	-	-	-	-	113,019,549.15
应付赎回款	-	-	-	-	15,657,768.59	15,657,768.59
应付管理人报酬	-	-	-	-	1,084,836.78	1,084,836.78
应付托管费	-	-	-	-	216,967.37	216,967.37
应付销售服务费	-	-	-	-	138,838.57	138,838.57
应交税费	-	-	-	-	19,108.86	19,108.86
其他负债	-	-	-	-	760,325.80	760,325.80
负债总计	113,019,549.15	-	-	-	17,877,845.97	130,897,395.12
利率敏感度缺口	83,158,095.50	81,590,749.59	439,379,990.32	398,432,842.71	226,780,316.46	1,229,341,994.58
上年度末 2024 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						
货币资金	1,446,558.98	-	-	-	-	1,446,558.98
结算备付金	389,744.94	-	-	-	-	389,744.94
存出保证金	9,797.60	-	-	-	-	9,797.60
交易性金融资产	3,561,969.59	7,069,781.26	4,482,606.43	3,662,379.73	4,623,507.00	23,400,244.01
应收清算款	-	-	-	-	7,120.73	7,120.73
应收申购款	-	-	-	-	3,709.39	3,709.39
资产总计	5,408,071.11	7,069,781.26	4,482,606.43	3,662,379.73	4,634,337.12	25,257,175.65
负债						
卖出回购金融资产款	1,199,918.96	-	-	-	-	1,199,918.96
应付清算款	-	-	-	-	12,201.44	12,201.44
应付赎回款	-	-	-	-	2,301.45	2,301.45
应付管理人报酬	-	-	-	-	23,571.09	23,571.09
应付托管费	-	-	-	-	4,714.23	4,714.23
应付销售服务	-	-	-	-	10,216.83	10,216.83

费						
应交税费	-	-	-	-	942.30	942.30
其他负债	-	-	-	-	30,383.11	30,383.11
负债总计	1,199,918.96	-	-	-	84,330.45	1,284,249.41
利率敏感度缺口	4,208,152.15	7,069,781.26	4,482,606.43	3,662,379.73	4,550,006.67	23,972,926.24

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的利率重新定价日或到期日孰早者进行分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率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（2025年12月31日）	上年度末（2024年12月31日）
	市场利率下降27个基点	8,728,720.01	181,337.19
	市场利率上升27个基点	-8,557,866.02	-181,337.19

#### 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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金的投资组合比例为：股票、存托凭证资产占基金资产的比例为0-30%；债券等固定收益类金融工具投资占基金资产的比例不低于70%，权证投资比例不高于基金资产净值的3%。每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控

制。

#### 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 2025 年 12 月 31 日		上年度末 2024 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	234,702,211.32	19.09	4,623,507.00	19.29
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	234,702,211.32	19.09	4,623,507.00	19.29

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2025 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金净资产的比例为 19.09%（2024 年 12 月 31 日：19.29%），因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的波动对本基金净资产无重大影响（2024 年 12 月 31 日：同）。

### 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 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	233,683,086.02	4,694,107.78
第二层次	1,025,769,665.91	18,706,136.23

第三层次	1,019,125.30	-
合计	1,260,471,877.23	23,400,244.01

#### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次；本基金根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

#### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

##### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	398,502.98	398,502.98
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	620,622.32	620,622.32
其中：计入损益的利得或损失	-	620,622.32	620,622.32
期末余额	-	1,019,125.30	1,019,125.30
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	-	620,622.32	620,622.32
项目	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	-	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-

当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-

注：于 2025 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。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	1,019,125.30	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	82.85%~307.91%	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
-	-	-	-	-	-

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2025 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资产(2024 年 12 月 31 日：同)。

#### 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	234,702,211.32	17.25
	其中：股票	234,702,211.32	17.25
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,025,769,665.91	75.41
	其中：债券	1,025,769,665.91	75.41
	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	89,657,551.61	6.59
8	其他各项资产	10,109,960.86	0.74
9	合计	1,360,239,389.70	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

## 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	943,460.00	0.08
B	采矿业	103,284.72	0.01
C	制造业	156,422,602.36	12.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,823,966.00	0.23
E	建筑业	878,640.00	0.07
F	批发和零售业	9,142,022.00	0.74
G	交通运输、仓储和邮政业	1,310,088.00	0.11
H	住宿和餐饮业	1,636,217.00	0.13
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,689,993.82	1.28
J	金融业	23,552,177.00	1.92
K	房地产业	975,086.00	0.08
L	租赁和商务服务业	7,336,937.00	0.60
M	科学研究和技术服务业	4,235,755.42	0.34
N	水利、环境和公共设施管理业	3,928,065.00	0.32
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-

Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	5,723,917.00	0.47
S	综合	-	-
	合计	234,702,211.32	19.09

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600941	中国移动	29,000	2,930,450.00	0.24
2	600660	福耀玻璃	43,800	2,836,926.00	0.23
3	000651	格力电器	60,700	2,441,354.00	0.20
4	600809	山西汾酒	14,200	2,438,140.00	0.20
5	002027	分众传媒	327,000	2,409,990.00	0.20
6	600873	梅花生物	196,600	1,991,558.00	0.16
7	600015	华夏银行	276,500	1,899,555.00	0.15
8	601169	北京银行	340,000	1,863,200.00	0.15
9	601336	新华保险	26,600	1,854,020.00	0.15
10	600750	华润江中	79,000	1,830,430.00	0.15
11	600919	江苏银行	167,700	1,744,080.00	0.14
12	603368	柳药集团	97,300	1,733,886.00	0.14
13	605499	东鹏饮料	6,400	1,711,296.00	0.14
14	600760	中航沈飞	30,400	1,706,960.00	0.14
15	600757	长江传媒	188,900	1,677,432.00	0.14
16	600066	宇通客车	51,200	1,674,240.00	0.14
17	601166	兴业银行	78,100	1,644,786.00	0.13
18	600998	九州通	314,200	1,608,704.00	0.13
19	600861	北京人力	86,500	1,586,410.00	0.13
20	600036	招商银行	37,000	1,557,700.00	0.13
21	601311	骆驼股份	169,700	1,556,149.00	0.13
22	600801	华新建材	62,200	1,526,388.00	0.12
23	601998	中信银行	198,000	1,524,600.00	0.12
24	002311	海大集团	27,500	1,522,950.00	0.12
25	600989	宝丰能源	77,400	1,519,362.00	0.12
26	603833	欧派家居	29,100	1,515,819.00	0.12
27	600511	国药股份	52,100	1,497,875.00	0.12
28	601577	长沙银行	146,800	1,423,960.00	0.12
29	601838	成都银行	87,800	1,415,336.00	0.12
30	600887	伊利股份	48,700	1,392,820.00	0.11
31	600415	小商品城	87,000	1,387,650.00	0.11

32	688002	睿创微纳	13,700	1,380,960.00	0.11
33	002422	科伦药业	47,000	1,379,450.00	0.11
34	002179	中航光电	38,800	1,375,072.00	0.11
35	601900	南方传媒	99,700	1,336,977.00	0.11
36	601607	上海医药	74,800	1,335,928.00	0.11
37	600587	新华医疗	91,400	1,316,160.00	0.11
38	600012	皖通高速	88,400	1,310,088.00	0.11
39	600713	南京医药	233,600	1,275,456.00	0.10
40	601098	中南传媒	113,100	1,273,506.00	0.10
41	000700	模塑科技	88,500	1,272,630.00	0.10
42	000563	陕国投 A	368,700	1,272,015.00	0.10
43	601601	中国太保	29,900	1,253,109.00	0.10
44	000600	建投能源	146,700	1,251,351.00	0.10
45	301331	恩威医药	46,600	1,232,104.00	0.10
46	601963	重庆银行	113,200	1,225,956.00	0.10
47	600210	紫江企业	164,700	1,210,545.00	0.10
48	688213	思特威	12,700	1,207,643.00	0.10
49	002322	理工能科	100,200	1,203,402.00	0.10
50	603129	春风动力	4,300	1,198,324.00	0.10
51	600600	青岛啤酒	19,500	1,193,400.00	0.10
52	688235	百济神州	4,400	1,181,840.00	0.10
53	300661	圣邦股份	17,000	1,166,880.00	0.09
54	688019	安集科技	5,300	1,154,976.00	0.09
55	000513	丽珠集团	33,200	1,144,072.00	0.09
56	688506	百利天恒	3,500	1,130,850.00	0.09
57	688819	天能股份	33,800	1,122,836.00	0.09
58	002294	信立泰	22,600	1,119,830.00	0.09
59	002228	合兴包装	239,600	1,106,952.00	0.09
60	603606	东方电缆	18,300	1,093,425.00	0.09
61	002850	科达利	6,900	1,089,234.00	0.09
62	002078	太阳纸业	69,000	1,086,750.00	0.09
63	688038	中科通达	59,300	1,047,831.00	0.09
64	600176	中国巨石	60,900	1,041,390.00	0.08
65	300695	兆丰股份	10,400	1,040,624.00	0.08
66	600320	振华重工	198,600	1,022,790.00	0.08
67	000423	东阿阿胶	20,700	1,015,956.00	0.08
68	600686	金龙汽车	57,000	1,011,180.00	0.08
69	002318	久立特材	34,800	1,007,460.00	0.08
70	688507	索辰科技	10,000	1,002,900.00	0.08
71	603529	爱玛科技	33,700	1,000,890.00	0.08
72	300540	蜀道装备	49,900	998,000.00	0.08

73	301613	新铝时代	19,300	997,810.00	0.08
74	600482	中国动力	48,200	997,740.00	0.08
75	601888	中国中免	10,500	992,880.00	0.08
76	600060	海信视像	40,800	990,624.00	0.08
77	002826	易明医药	53,800	988,844.00	0.08
78	605118	力鼎光电	32,800	987,608.00	0.08
79	300251	光线传媒	59,900	981,162.00	0.08
80	002590	万安科技	65,400	981,000.00	0.08
81	600312	平高电气	56,400	978,540.00	0.08
82	000421	南京公用	141,600	978,456.00	0.08
83	300328	宜安科技	57,300	978,111.00	0.08
84	603220	中贝通信	45,900	977,670.00	0.08
85	603500	祥和实业	81,600	977,568.00	0.08
86	600839	四川长虹	107,300	976,430.00	0.08
87	600875	东方电气	40,200	976,056.00	0.08
88	002016	世荣兆业	168,700	975,086.00	0.08
89	002237	恒邦股份	72,600	974,292.00	0.08
90	603199	九华旅游	26,500	974,140.00	0.08
91	300852	四会富仕	25,500	973,590.00	0.08
92	688617	惠泰医疗	4,000	973,080.00	0.08
93	001218	丽臣实业	42,700	972,706.00	0.08
94	688557	兰剑智能	26,700	972,681.00	0.08
95	301080	百普赛斯	18,000	972,000.00	0.08
96	601956	东贝集团	136,200	971,106.00	0.08
97	603739	蔚蓝生物	68,600	970,690.00	0.08
98	003000	劲仔食品	85,200	970,428.00	0.08
99	301167	建研设计	59,700	970,125.00	0.08
100	688200	华峰测控	5,100	970,020.00	0.08
101	002863	今飞凯达	165,200	969,724.00	0.08
102	600507	方大特钢	164,600	969,494.00	0.08
103	000778	新兴铸管	231,800	968,924.00	0.08
104	300602	飞荣达	29,200	968,272.00	0.08
105	605020	永和股份	36,000	968,040.00	0.08
106	688626	翔宇医疗	16,000	968,000.00	0.08
107	002645	华宏科技	66,100	967,704.00	0.08
108	603086	先达股份	117,600	966,672.00	0.08
109	603507	振江股份	36,700	965,577.00	0.08
110	603029	天鹅股份	52,900	964,896.00	0.08
111	603309	维力医疗	70,900	963,531.00	0.08
112	603115	海星股份	51,400	961,694.00	0.08
113	688319	欧林生物	37,900	961,144.00	0.08

114	300257	开山股份	68,400	961,020.00	0.08
115	688059	华锐精密	12,200	960,140.00	0.08
116	300662	科锐国际	37,900	960,007.00	0.08
117	600326	西藏天路	87,000	959,610.00	0.08
118	300407	凯发电气	84,700	958,804.00	0.08
119	002560	通达股份	95,100	958,608.00	0.08
120	688385	复旦微电	13,000	958,100.00	0.08
121	603126	中材节能	142,400	956,928.00	0.08
122	001216	华瓷股份	55,900	956,449.00	0.08
123	002603	以岭药业	56,000	955,920.00	0.08
124	601218	吉鑫科技	188,900	955,834.00	0.08
125	688185	康希诺	15,200	955,320.00	0.08
126	605319	无锡振华	45,400	955,216.00	0.08
127	688138	清溢光电	33,900	954,624.00	0.08
128	002709	天赐材料	20,600	954,398.00	0.08
129	300596	利安隆	22,600	953,946.00	0.08
130	600884	杉杉股份	70,600	953,806.00	0.08
131	603099	长白山	21,100	952,665.00	0.08
132	300146	汤臣倍健	79,300	952,393.00	0.08
133	600258	首旅酒店	56,800	951,400.00	0.08
134	688702	盛科通信	6,700	949,323.00	0.08
135	300850	新强联	22,900	947,373.00	0.08
136	600446	金证股份	59,500	947,240.00	0.08
137	603939	益丰药房	43,600	946,992.00	0.08
138	002074	国轩高科	24,200	946,462.00	0.08
139	300628	亿联网络	26,500	944,725.00	0.08
140	300970	华绿生物	46,000	943,460.00	0.08
141	688236	春立医疗	41,200	942,656.00	0.08
142	002831	裕同科技	33,000	940,830.00	0.08
143	605208	永茂泰	69,220	940,007.60	0.08
144	603697	有友食品	76,300	934,675.00	0.08
145	002174	游族网络	76,300	933,912.00	0.08
146	000596	古井贡酒	7,000	928,200.00	0.08
147	688678	福立旺	38,200	923,676.00	0.08
148	300008	天海防务	116,900	922,341.00	0.08
149	688345	博力威	29,500	920,400.00	0.07
150	002276	万马股份	53,942	912,159.22	0.07
151	002434	万里扬	95,500	910,115.00	0.07
152	300438	鹏辉能源	16,800	894,096.00	0.07
153	002752	昇兴股份	134,100	890,424.00	0.07
154	600030	中信证券	30,700	881,397.00	0.07

155	603690	至纯科技	28,000	880,600.00	0.07
156	600284	浦东建设	104,600	878,640.00	0.07
157	002653	海思科	17,000	872,440.00	0.07
158	600901	江苏金租	142,100	869,652.00	0.07
159	603699	纽威股份	16,400	852,308.00	0.07
160	601881	中国银河	53,800	845,736.00	0.07
161	603816	顾家家居	27,400	842,276.00	0.07
162	600563	法拉电子	8,000	839,600.00	0.07
163	000733	振华科技	15,700	822,837.00	0.07
164	603165	荣晟环保	63,500	803,275.00	0.07
165	300679	电连技术	15,600	759,408.00	0.06
166	688301	奕瑞科技	7,500	758,325.00	0.06
167	600562	国睿科技	26,500	748,890.00	0.06
168	000034	神州数码	19,100	743,181.00	0.06
169	600398	海澜之家	122,700	742,335.00	0.06
170	600765	中航重机	38,500	737,660.00	0.06
171	603195	公牛集团	18,000	734,940.00	0.06
172	603193	润本股份	30,000	726,900.00	0.06
173	603897	长城科技	26,700	726,240.00	0.06
174	301195	北路智控	20,800	718,224.00	0.06
175	688612	威迈斯	21,400	705,558.00	0.06
176	002568	百润股份	32,300	704,463.00	0.06
177	603737	三棵树	15,100	698,677.00	0.06
178	002609	捷顺科技	75,000	696,750.00	0.06
179	000888	峨眉山 A	52,900	694,048.00	0.06
180	600754	锦江酒店	27,100	684,817.00	0.06
181	688799	华纳药厂	14,300	682,110.00	0.06
182	603444	吉比特	1,600	678,160.00	0.06
183	600054	黄山旅游	59,700	675,804.00	0.05
184	002152	广电运通	48,700	672,547.00	0.05
185	688443	智翔金泰	24,400	664,656.00	0.05
186	000951	中国重汽	38,400	648,960.00	0.05
187	605099	共创草坪	17,900	638,851.00	0.05
188	601179	中国西电	69,500	632,450.00	0.05
189	603678	火炬电子	17,900	632,228.00	0.05
190	603136	天目湖	53,600	631,408.00	0.05
191	000921	海信家电	25,200	625,212.00	0.05
192	600285	羚锐制药	29,800	617,158.00	0.05
193	002956	西麦食品	21,900	615,828.00	0.05
194	301330	熵基科技	18,500	611,425.00	0.05
195	600061	国投资本	79,900	611,235.00	0.05

196	688580	伟思医疗	12,600	609,840.00	0.05
197	300119	瑞普生物	32,000	600,640.00	0.05
198	002558	巨人网络	13,800	597,402.00	0.05
199	002111	威海广泰	56,500	594,380.00	0.05
200	002039	黔源电力	32,700	594,159.00	0.05
201	688279	峰岬科技	2,900	590,121.00	0.05
202	603259	药明康德	6,400	580,096.00	0.05
203	603899	晨光股份	21,200	573,672.00	0.05
204	002649	博彦科技	42,600	561,894.00	0.05
205	300910	瑞丰新材	9,800	554,190.00	0.05
206	600262	北方股份	20,800	541,424.00	0.04
207	003033	征和工业	6,800	534,548.00	0.04
208	603337	杰克科技	12,200	528,626.00	0.04
209	600273	嘉化能源	60,200	526,148.00	0.04
210	603279	景津装备	30,800	519,596.00	0.04
211	605088	冠盛股份	14,500	516,200.00	0.04
212	605016	百龙创园	23,600	509,760.00	0.04
213	688475	萤石网络	16,900	508,859.00	0.04
214	603855	华荣股份	26,100	505,035.00	0.04
215	300776	帝尔激光	8,100	503,334.00	0.04
216	688522	纳睿雷达	12,500	499,125.00	0.04
217	003006	百亚股份	22,800	497,952.00	0.04
218	300888	稳健医疗	13,000	491,920.00	0.04
219	002345	潮宏基	39,200	490,000.00	0.04
220	688100	威胜信息	12,400	487,320.00	0.04
221	301162	国能日新	9,500	486,970.00	0.04
222	002003	伟星股份	45,800	485,480.00	0.04
223	603486	科沃斯	6,000	484,080.00	0.04
224	002749	国光股份	36,300	483,879.00	0.04
225	300033	同花顺	1,500	483,270.00	0.04
226	601965	中国汽研	28,800	478,080.00	0.04
227	002993	奥海科技	10,900	476,439.00	0.04
228	688190	云路股份	4,800	467,520.00	0.04
229	301035	润丰股份	6,800	462,468.00	0.04
230	002423	中粮资本	39,400	460,980.00	0.04
231	002847	盐津铺子	6,700	457,677.00	0.04
232	300788	中信出版	16,600	454,840.00	0.04
233	688513	苑东生物	6,600	406,230.00	0.03
234	601066	中信建投	15,000	401,550.00	0.03
235	601100	恒立液压	3,500	384,685.00	0.03
236	688795	摩尔线程	823	342,516.14	0.03

237	688089	嘉必优	14,500	337,560.00	0.03
238	600621	华鑫股份	21,000	320,040.00	0.03
239	688372	伟测科技	2,300	250,907.00	0.02
240	688802	沐曦股份	584	233,197.04	0.02
241	688502	茂莱光学	400	159,620.00	0.01
242	688049	炬芯科技	2,700	142,020.00	0.01
243	688258	卓易信息	1,660	127,106.20	0.01
244	600276	恒瑞医药	2,100	125,097.00	0.01
245	001280	中国铀业	2,277	103,284.72	0.01
246	688759	必贝特	2,789	70,031.79	0.01
247	688790	昂瑞微	516	60,470.04	0.00
248	688809	强一股份	259	52,657.29	0.00
249	301638	南网数字	2,322	32,995.62	0.00
250	688727	恒坤新材	563	19,631.81	0.00
251	001233	海安集团	370	19,195.60	0.00
252	688796	百奥赛图	423	17,871.75	0.00
253	001369	双欣材料	897	11,562.33	0.00
254	301687	新广益	195	10,606.05	0.00
255	301667	纳百川	151	8,617.57	0.00
256	688805	健信超导	265	8,578.05	0.00
257	603092	德力佳	146	8,126.36	0.00
258	301449	天溯计量	112	7,305.76	0.00
259	603248	锡华科技	260	4,238.00	0.00
260	603376	大明电子	111	2,909.31	0.00
261	603334	丰倍生物	88	2,888.16	0.00
262	001396	誉帆科技	69	2,441.91	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	300602	飞荣达	11,221,657.89	46.81
2	002048	宁波华翔	11,125,747.00	46.41
3	600660	福耀玻璃	8,558,285.00	35.70
4	688799	华纳药厂	8,113,942.14	33.85
5	600233	圆通速递	7,945,756.00	33.14
6	600941	中国移动	7,693,355.00	32.09
7	600989	宝丰能源	7,043,218.00	29.38
8	600284	浦东建设	6,795,556.00	28.35
9	688677	海泰新光	6,381,372.83	26.62

10	002027	分众传媒	6,269,010.00	26.15
11	002899	英派斯	6,126,637.84	25.56
12	000651	格力电器	6,099,310.00	25.44
13	600809	山西汾酒	5,950,900.00	24.82
14	601311	骆驼股份	5,680,926.00	23.70
15	600066	宇通客车	5,403,376.00	22.54
16	000915	华特达因	5,397,997.00	22.52
17	601888	中国中免	5,346,891.00	22.30
18	300251	光线传媒	5,304,306.00	22.13
19	688758	赛分科技	5,164,071.33	21.54
20	002867	周大生	5,162,110.00	21.53
21	603185	弘元绿能	5,110,059.00	21.32
22	000423	东阿阿胶	4,781,293.00	19.94
23	601336	新华保险	4,723,247.00	19.70
24	002545	东方铁塔	4,692,196.00	19.57
25	601998	中信银行	4,656,843.00	19.43
26	301600	慧翰股份	4,633,495.55	19.33
27	600873	梅花生物	4,458,388.56	18.60
28	600143	金发科技	4,437,840.00	18.51
29	000828	东莞控股	4,429,076.00	18.48
30	601456	国联民生	4,344,794.00	18.12
31	603444	吉比特	4,293,219.00	17.91
32	600887	伊利股份	4,146,724.00	17.30
33	600352	浙江龙盛	4,102,933.00	17.11
34	002441	众业达	4,081,359.00	17.02
35	605499	东鹏饮料	4,040,752.00	16.86
36	300003	乐普医疗	4,024,867.00	16.79
37	300357	我武生物	4,018,695.00	16.76
38	002803	吉宏股份	4,016,963.00	16.76
39	688236	春立医疗	4,000,983.90	16.69
40	002643	万润股份	3,998,904.00	16.68
41	601169	北京银行	3,988,971.00	16.64
42	002850	科达利	3,982,274.00	16.61
43	601208	东材科技	3,959,866.00	16.52
44	002749	国光股份	3,948,289.00	16.47
45	002807	江阴银行	3,932,917.00	16.41
46	002788	鹭燕医药	3,903,516.77	16.28
47	002436	兴森科技	3,888,410.00	16.22
48	601838	成都银行	3,885,858.00	16.21
49	600750	华润江中	3,835,142.00	16.00
50	002311	海大集团	3,793,673.00	15.82

51	002555	三七互娱	3,723,589.33	15.53
52	000719	中原传媒	3,682,633.00	15.36
53	000708	中信特钢	3,655,372.97	15.25
54	600098	广州发展	3,653,086.00	15.24
55	600901	江苏金租	3,632,526.00	15.15
56	600713	南京医药	3,628,896.00	15.14
57	603816	顾家家居	3,609,093.70	15.05
58	601717	中创智领	3,600,667.00	15.02
59	601126	四方股份	3,598,722.00	15.01
60	600894	广日股份	3,593,615.00	14.99
61	601877	正泰电器	3,507,988.00	14.63
62	002276	万马股份	3,502,863.84	14.61
63	300628	亿联网络	3,463,584.20	14.45
64	002255	海陆重工	3,418,761.00	14.26
65	601339	百隆东方	3,417,203.00	14.25
66	603368	柳药集团	3,406,176.00	14.21
67	601577	长沙银行	3,391,980.00	14.15
68	600285	羚锐制药	3,382,083.18	14.11
69	600015	华夏银行	3,375,055.00	14.08
70	002216	三全食品	3,360,506.80	14.02
71	003012	东鹏控股	3,313,070.00	13.82
72	000858	五粮液	3,299,616.00	13.76
73	605377	华旺科技	3,291,324.60	13.73
74	600587	新华医疗	3,280,593.00	13.68
75	603508	思维列控	3,273,463.08	13.65
76	300619	金银河	3,243,985.00	13.53
77	688507	索辰科技	3,235,185.60	13.50
78	000726	鲁泰 A	3,204,624.99	13.37
79	603855	华荣股份	3,188,158.00	13.30
80	603698	航天工程	3,157,539.00	13.17
81	300852	四会富仕	3,145,530.00	13.12
82	000568	泸州老窖	3,145,473.00	13.12
83	002203	海亮股份	3,130,583.22	13.06
84	600757	长江传媒	3,121,463.00	13.02
85	603129	春风动力	3,118,126.00	13.01
86	300776	帝尔激光	3,106,172.00	12.96
87	603279	景津装备	3,085,037.00	12.87
88	000543	皖能电力	3,083,589.00	12.86
89	601298	青岛港	3,080,747.00	12.85
90	600801	华新建材	3,077,590.00	12.84
91	600760	中航沈飞	3,066,968.00	12.79

92	603529	爱玛科技	3,060,808.00	12.77
93	002837	英维克	3,041,723.00	12.69
94	600219	南山铝业	3,040,468.00	12.68
95	603113	金能科技	3,034,789.00	12.66
96	300636	同和药业	3,030,178.00	12.64
97	000999	华润三九	3,019,768.61	12.60
98	002508	老板电器	2,990,481.00	12.47
99	603323	苏农银行	2,983,492.40	12.45
100	600262	北方股份	2,979,094.00	12.43
101	603086	先达股份	2,978,286.00	12.42
102	603558	健盛集团	2,972,141.00	12.40
103	600012	皖通高速	2,963,578.00	12.36
104	600998	九州通	2,944,511.00	12.28
105	600690	海尔智家	2,930,774.00	12.23
106	002322	理工能科	2,928,594.00	12.22
107	601900	南方传媒	2,918,579.00	12.17
108	603737	三棵树	2,911,586.00	12.15
109	603151	邦基科技	2,899,871.00	12.10
110	002299	圣农发展	2,881,843.00	12.02
111	601963	重庆银行	2,880,267.00	12.01
112	300866	安克创新	2,875,600.00	12.00
113	600875	东方电气	2,875,466.00	11.99
114	603345	安井食品	2,869,207.00	11.97
115	600395	盘江股份	2,868,943.00	11.97
116	002469	三维化学	2,813,578.00	11.74
117	603833	欧派家居	2,802,242.00	11.69
118	000598	兴蓉环境	2,798,437.00	11.67
119	000951	中国重汽	2,793,903.82	11.65
120	688002	睿创微纳	2,781,947.15	11.60
121	003011	海象新材	2,771,643.00	11.56
122	688612	威迈斯	2,763,026.04	11.53
123	300119	瑞普生物	2,761,384.00	11.52
124	600703	三安光电	2,758,177.00	11.51
125	601330	绿色动力	2,746,365.00	11.46
126	301613	新铝时代	2,744,432.00	11.45
127	300041	回天新材	2,736,289.00	11.41
128	603233	大参林	2,732,680.00	11.40
129	002625	光启技术	2,729,054.00	11.38
130	600987	航民股份	2,705,914.00	11.29
131	002563	森马服饰	2,704,011.00	11.28
132	688345	博力威	2,700,371.17	11.26

133	600694	大商股份	2,683,439.40	11.19
134	300406	九强生物	2,674,718.00	11.16
135	002179	中航光电	2,651,042.00	11.06
136	601018	宁波港	2,646,828.00	11.04
137	002270	华明装备	2,632,859.00	10.98
138	688382	益方生物	2,622,935.05	10.94
139	600511	国药股份	2,617,256.00	10.92
140	603456	九洲药业	2,616,245.00	10.91
141	603518	锦泓集团	2,601,935.00	10.85
142	300770	新媒股份	2,601,645.00	10.85
143	000596	古井贡酒	2,590,553.00	10.81
144	601827	三峰环境	2,588,346.00	10.80
145	688019	安集科技	2,585,169.05	10.78
146	002228	合兴包装	2,576,037.00	10.75
147	603089	正裕工业	2,574,133.00	10.74
148	603697	有友食品	2,571,380.40	10.73
149	300888	稳健医疗	2,570,659.60	10.72
150	601098	中南传媒	2,568,609.00	10.71
151	000921	海信家电	2,563,125.00	10.69
152	601528	瑞丰银行	2,556,947.40	10.67
153	600861	北京人力	2,556,170.00	10.66
154	002091	江苏国泰	2,552,237.55	10.65
155	600582	天地科技	2,543,214.00	10.61
156	688626	翔宇医疗	2,541,384.04	10.60
157	688617	惠泰医疗	2,539,105.26	10.59
158	603506	南都物业	2,533,219.20	10.57
159	603165	荣晟环保	2,532,919.00	10.57
160	605277	新亚电子	2,529,529.00	10.55
161	300360	炬华科技	2,526,461.00	10.54
162	605368	蓝天燃气	2,523,877.00	10.53
163	300364	中文在线	2,521,330.00	10.52
164	002034	旺能环境	2,517,383.00	10.50
165	600273	嘉化能源	2,509,936.00	10.47
166	600035	楚天高速	2,501,964.00	10.44
167	601555	东吴证券	2,498,107.00	10.42
168	300652	雷迪克	2,494,145.00	10.40
169	000690	宝新能源	2,486,575.00	10.37
170	600282	南钢股份	2,485,405.00	10.37
171	001872	招商港口	2,478,666.00	10.34
172	002315	焦点科技	2,478,201.00	10.34
173	603071	物产环能	2,472,056.00	10.31

174	600415	小商品城	2,469,604.00	10.30
175	301015	百洋医药	2,463,431.00	10.28
176	688819	天能股份	2,462,239.26	10.27
177	600507	方大特钢	2,461,852.00	10.27
178	600519	贵州茅台	2,461,670.00	10.27
179	000731	四川美丰	2,459,740.00	10.26
180	002831	裕同科技	2,448,118.00	10.21
181	000718	苏宁环球	2,440,730.00	10.18
182	000630	铜陵有色	2,431,279.00	10.14
183	300850	新强联	2,424,389.00	10.11
184	002956	西麦食品	2,423,905.00	10.11
185	601766	中国中车	2,413,665.00	10.07
186	601825	沪农商行	2,403,552.00	10.03
187	300748	金力永磁	2,402,379.00	10.02
188	600919	江苏银行	2,397,644.00	10.00
189	600908	无锡银行	2,395,352.00	9.99
190	603486	科沃斯	2,389,060.00	9.97
191	600742	富维股份	2,381,050.00	9.93
192	600060	海信视像	2,379,087.00	9.92
193	600033	福建高速	2,377,439.00	9.92
194	002318	久立特材	2,366,985.00	9.87
195	301004	嘉益股份	2,365,676.22	9.87
196	603801	志邦家居	2,363,754.00	9.86
197	002014	永新股份	2,353,843.00	9.82
198	000885	城发环境	2,348,008.00	9.79
199	688213	思特威	2,346,801.51	9.79
200	688239	航宇科技	2,344,118.83	9.78
201	300662	科锐国际	2,341,564.00	9.77
202	688201	信安世纪	2,338,386.19	9.75
203	300972	万辰集团	2,337,555.00	9.75
204	001218	丽臣实业	2,329,428.40	9.72
205	600820	隧道股份	2,316,606.00	9.66
206	600177	雅戈尔	2,313,710.00	9.65
207	600551	时代出版	2,312,232.00	9.65
208	002422	科伦药业	2,304,581.00	9.61
209	603893	瑞芯微	2,299,751.00	9.59
210	600210	紫江企业	2,298,801.00	9.59
211	002993	奥海科技	2,289,771.00	9.55
212	601607	上海医药	2,285,242.00	9.53
213	603766	隆鑫通用	2,284,205.00	9.53
214	600017	日照港	2,283,825.94	9.53

215	688200	华峰测控	2,281,966.02	9.52
216	002839	张家港行	2,275,841.00	9.49
217	300257	开山股份	2,270,640.00	9.47
218	600036	招商银行	2,270,142.00	9.47
219	688293	奥浦迈	2,254,667.16	9.41
220	300535	达威股份	2,251,270.00	9.39
221	600839	四川长虹	2,249,519.00	9.38
222	600512	腾达建设	2,241,256.00	9.35
223	002991	甘源食品	2,238,434.00	9.34
224	002616	长青集团	2,233,893.56	9.32
225	600600	青岛啤酒	2,232,670.00	9.31
226	688121	卓然股份	2,230,866.77	9.31
227	603897	长城科技	2,230,485.00	9.30
228	600362	江西铜业	2,226,247.00	9.29
229	688326	经纬恒润	2,224,904.29	9.28
230	002381	双箭股份	2,224,220.00	9.28
231	688443	智翔金泰	2,221,935.51	9.27
232	601128	常熟银行	2,219,836.00	9.26
233	601229	上海银行	2,212,519.00	9.23
234	688235	百济神州	2,212,296.39	9.23
235	002589	瑞康医药	2,201,981.00	9.19
236	301098	金埔园林	2,198,959.00	9.17
237	000685	中山公用	2,193,202.00	9.15
238	688472	阿特斯	2,188,116.97	9.13
239	601567	三星医疗	2,187,837.00	9.13
240	601928	凤凰传媒	2,185,740.00	9.12
241	600446	金证股份	2,163,015.00	9.02
242	000987	越秀资本	2,162,975.00	9.02
243	600782	新钢股份	2,161,968.00	9.02
244	600216	浙江医药	2,161,295.00	9.02
245	002015	协鑫能科	2,160,617.00	9.01
246	002352	顺丰控股	2,159,953.00	9.01
247	000498	山东路桥	2,150,088.00	8.97
248	002170	芭田股份	2,147,184.00	8.96
249	600461	洪城环境	2,145,221.00	8.95
250	603871	嘉友国际	2,141,448.78	8.93
251	600196	复星医药	2,134,085.00	8.90
252	605098	行动教育	2,133,884.00	8.90
253	002818	富森美	2,131,971.00	8.89
254	600741	华域汽车	2,127,047.00	8.87
255	601939	建设银行	2,125,798.00	8.87

256	000563	陕国投 A	2,118,828.00	8.84
257	603277	银都股份	2,111,681.60	8.81
258	300979	华利集团	2,111,414.00	8.81
259	605208	永茂泰	2,108,145.80	8.79
260	600522	中天科技	2,100,084.00	8.76
261	603126	中材节能	2,095,332.25	8.74
262	603939	益丰药房	2,088,153.00	8.71
263	600248	陕建股份	2,085,122.00	8.70
264	003022	联泓新科	2,067,208.00	8.62
265	600028	中国石化	2,058,173.00	8.59
266	688222	成都先导	2,052,523.91	8.56
267	002454	松芝股份	2,046,629.16	8.54
268	301308	江波龙	2,045,950.00	8.53
269	301603	乔锋智能	2,040,386.00	8.51
270	601083	锦江航运	2,037,972.00	8.50
271	000882	华联股份	2,036,638.00	8.50
272	600927	永安期货	2,034,773.00	8.49
273	002518	科士达	2,034,469.00	8.49
274	688560	明冠新材	2,033,870.37	8.48
275	002653	海思科	2,032,435.00	8.48
276	603699	纽威股份	2,029,206.00	8.46
277	600356	恒丰纸业	2,024,639.00	8.45
278	600900	长江电力	2,022,826.00	8.44
279	002487	大金重工	2,021,590.64	8.43
280	601598	中国外运	2,019,655.00	8.42
281	688536	思瑞浦	2,019,191.75	8.42
282	000600	建投能源	2,018,040.00	8.42
283	603081	大丰实业	2,013,879.00	8.40
284	688329	艾隆科技	2,003,340.41	8.36
285	002003	伟星股份	2,001,570.00	8.35
286	000521	长虹美菱	1,995,378.00	8.32
287	600549	厦门钨业	1,990,024.00	8.30
288	603008	喜临门	1,989,062.00	8.30
289	600930	华电新能	1,988,143.00	8.29
290	002237	恒邦股份	1,985,407.42	8.28
291	603380	易德龙	1,982,830.00	8.27
292	601991	大唐发电	1,979,916.00	8.26
293	601166	兴业银行	1,978,142.00	8.25
294	688678	福立旺	1,966,119.15	8.20
295	600076	康欣新材	1,965,715.00	8.20
296	000932	华菱钢铁	1,959,808.00	8.18

297	600079	ST 人福	1,958,698.00	8.17
298	301035	润丰股份	1,957,113.00	8.16
299	688033	天宜新材	1,954,237.67	8.15
300	002752	昇兴股份	1,952,096.55	8.14
301	002061	浙江交科	1,950,812.00	8.14
302	603096	新经典	1,950,266.00	8.14
303	603309	维力医疗	1,948,797.00	8.13
304	003000	劲仔食品	1,947,391.00	8.12
305	300801	泰和科技	1,943,350.00	8.11
306	000950	重药控股	1,935,839.00	8.08
307	002261	拓维信息	1,933,238.00	8.06
308	600269	赣粤高速	1,930,034.00	8.05
309	603600	永艺股份	1,927,621.00	8.04
310	603156	养元饮品	1,922,990.00	8.02
311	002829	星网宇达	1,922,225.00	8.02
312	300540	蜀道装备	1,921,128.00	8.01
313	000733	振华科技	1,920,825.00	8.01
314	002174	游族网络	1,919,367.00	8.01
315	003006	百亚股份	1,919,287.00	8.01
316	002511	中顺洁柔	1,915,749.00	7.99
317	600212	绿能慧充	1,914,438.00	7.99
318	002294	信立泰	1,913,420.00	7.98
319	002393	力生制药	1,912,141.00	7.98
320	002078	太阳纸业	1,908,448.00	7.96
321	688506	百利天恒	1,906,023.51	7.95
322	605158	华达新材	1,905,302.00	7.95
323	600728	佳都科技	1,905,136.00	7.95
324	000893	亚钾国际	1,903,791.00	7.94
325	600258	首旅酒店	1,902,444.00	7.94
326	603919	金徽酒	1,899,807.00	7.92
327	600863	华能蒙电	1,896,831.00	7.91
328	000333	美的集团	1,896,012.00	7.91
329	688372	伟测科技	1,894,946.99	7.90
330	601058	赛轮轮胎	1,879,221.08	7.84
331	002603	以岭药业	1,876,008.00	7.83
332	301377	鼎泰高科	1,871,674.00	7.81
333	002560	通达股份	1,869,099.00	7.80
334	002056	横店东磁	1,867,703.00	7.79
335	002133	广宇集团	1,867,044.00	7.79
336	603899	晨光股份	1,860,964.00	7.76
337	688089	嘉必优	1,857,507.40	7.75

338	301095	广立微	1,836,198.00	7.66
339	300661	圣邦股份	1,832,834.00	7.65
340	603199	九华旅游	1,832,747.00	7.65
341	600563	法拉电子	1,832,349.00	7.64
342	601898	中煤能源	1,825,201.00	7.61
343	601328	交通银行	1,824,779.00	7.61
344	001914	招商积余	1,821,406.00	7.60
345	601179	中国西电	1,813,535.00	7.56
346	300531	优博讯	1,807,455.00	7.54
347	003010	若羽臣	1,807,414.30	7.54
348	001308	康冠科技	1,801,544.00	7.51
349	601211	国泰海通	1,792,152.76	7.48
350	002303	美盈森	1,787,689.00	7.46
351	605009	豪悦护理	1,786,487.00	7.45
352	600681	百川能源	1,785,720.00	7.45
353	688100	威胜信息	1,780,478.63	7.43
354	601811	新华文轩	1,779,814.00	7.42
355	601500	通用股份	1,779,754.00	7.42
356	001313	粤海饲料	1,778,406.00	7.42
357	600118	中国卫星	1,776,802.00	7.41
358	300476	胜宏科技	1,775,557.00	7.41
359	688167	炬光科技	1,772,684.55	7.39
360	688093	世华科技	1,768,613.36	7.38
361	605118	力鼎光电	1,764,020.00	7.36
362	688206	概伦电子	1,762,397.62	7.35
363	600067	冠城新材	1,761,928.00	7.35
364	603682	锦和商管	1,756,679.00	7.33
365	002032	苏泊尔	1,749,505.00	7.30
366	601601	中国太保	1,747,054.00	7.29
367	603551	奥普科技	1,746,950.00	7.29
368	603115	海星股份	1,746,317.00	7.28
369	301200	大族数控	1,746,013.80	7.28
370	600398	海澜之家	1,742,905.00	7.27
371	002293	罗莱生活	1,740,432.80	7.26
372	002100	天康生物	1,739,701.00	7.26
373	688021	奥福科技	1,737,460.32	7.25
374	000400	许继电气	1,726,775.00	7.20
375	688521	芯原股份	1,716,199.09	7.16
376	600874	创业环保	1,706,322.00	7.12
377	002102	能特科技	1,704,140.00	7.11
378	601886	江河集团	1,704,060.72	7.11

379	002815	崇达技术	1,703,883.00	7.11
380	300548	长芯博创	1,700,817.00	7.09
381	600926	杭州银行	1,698,510.00	7.09
382	605020	永和股份	1,697,604.42	7.08
383	301056	森赫股份	1,689,826.00	7.05
384	603408	建霖家居	1,688,312.00	7.04
385	600312	平高电气	1,681,334.00	7.01
386	603797	联泰环保	1,680,600.00	7.01
387	600203	福日电子	1,680,389.00	7.01
388	603300	海南华铁	1,676,592.00	6.99
389	601288	农业银行	1,675,303.00	6.99
390	688067	爱威科技	1,675,115.06	6.99
391	300594	朗进科技	1,674,944.00	6.99
392	601881	中国银河	1,673,773.00	6.98
393	603611	诺力股份	1,673,672.00	6.98
394	000906	浙商中拓	1,673,508.00	6.98
395	601988	中国银行	1,669,424.00	6.96
396	001299	美能能源	1,664,051.00	6.94
397	688065	凯赛生物	1,663,024.02	6.94
398	603239	浙江仙通	1,662,455.00	6.93
399	002327	富安娜	1,660,920.00	6.93
400	301280	珠城科技	1,658,261.00	6.92
401	002083	孚日股份	1,657,797.00	6.92
402	601222	林洋能源	1,653,581.00	6.90
403	605117	德业股份	1,651,610.00	6.89
404	688017	绿的谐波	1,651,546.55	6.89
405	603606	东方电缆	1,648,009.00	6.87
406	603365	水星家纺	1,646,245.00	6.87
407	600580	卧龙电驱	1,643,843.00	6.86
408	603689	皖天然气	1,643,034.60	6.85
409	688301	奕瑞科技	1,633,140.06	6.81
410	600642	申能股份	1,629,599.00	6.80
411	300803	指南针	1,626,123.00	6.78
412	600491	龙元建设	1,620,678.00	6.76
413	688629	华丰科技	1,617,119.64	6.75
414	301103	何氏眼科	1,616,868.00	6.74
415	603393	新天然气	1,615,933.00	6.74
416	301078	孩子王	1,614,481.00	6.73
417	600780	通宝能源	1,614,375.00	6.73
418	601619	嘉泽新能	1,613,826.00	6.73
419	002884	凌霄泵业	1,612,718.00	6.73

420	603983	丸美生物	1,611,205.00	6.72
421	002029	七匹狼	1,603,808.00	6.69
422	600761	安徽合力	1,600,163.26	6.67
423	601369	陕鼓动力	1,598,900.00	6.67
424	300008	天海防务	1,595,585.00	6.66
425	603700	宁水集团	1,591,758.00	6.64
426	603112	华翔股份	1,591,643.00	6.64
427	002275	桂林三金	1,590,609.00	6.64
428	601326	秦港股份	1,588,257.00	6.63
429	600958	东方证券	1,582,991.00	6.60
430	601187	厦门银行	1,582,659.00	6.60
431	002863	今飞凯达	1,582,518.00	6.60
432	000066	中国长城	1,581,858.00	6.60
433	002959	小熊电器	1,579,791.00	6.59
434	600502	安徽建工	1,578,628.00	6.59
435	002851	麦格米特	1,574,596.00	6.57
436	600048	保利发展	1,573,873.00	6.57
437	300068	南都电源	1,573,764.00	6.56
438	000900	现代投资	1,573,257.00	6.56
439	002026	山东威达	1,573,141.00	6.56
440	002705	新宝股份	1,570,116.00	6.55
441	002370	亚太药业	1,565,724.00	6.53
442	002479	富春环保	1,565,718.00	6.53
443	301150	中一科技	1,562,827.00	6.52
444	605319	无锡振华	1,558,888.00	6.50
445	601019	山东出版	1,555,125.00	6.49
446	603167	渤海轮渡	1,554,953.00	6.49
447	002557	洽洽食品	1,550,839.01	6.47
448	601000	唐山港	1,550,686.00	6.47
449	688501	青达环保	1,550,145.89	6.47
450	301087	可孚医疗	1,549,357.00	6.46
451	601009	南京银行	1,549,301.00	6.46
452	301396	宏景科技	1,548,895.00	6.46
453	601139	深圳燃气	1,546,932.00	6.45
454	000419	通程控股	1,540,641.00	6.43
455	603282	亚光股份	1,540,348.00	6.43
456	300453	三鑫医疗	1,540,018.00	6.42
457	300328	宜安科技	1,538,897.00	6.42
458	002384	东山精密	1,537,229.00	6.41
459	000897	津滨发展	1,537,158.00	6.41
460	601636	旗滨集团	1,533,280.00	6.40

461	605266	健之佳	1,532,930.00	6.39
462	002600	领益智造	1,532,832.00	6.39
463	603605	珀莱雅	1,532,315.44	6.39
464	002271	东方雨虹	1,526,537.00	6.37
465	688557	兰剑智能	1,524,269.79	6.36
466	600406	国电南瑞	1,523,981.00	6.36
467	002128	电投能源	1,522,006.00	6.35
468	300693	盛弘股份	1,521,603.00	6.35
469	603758	秦安股份	1,521,429.00	6.35
470	000758	中色股份	1,519,626.00	6.34
471	300481	濮阳惠成	1,517,961.00	6.33
472	603095	越剑智能	1,516,984.00	6.33
473	300988	津荣天宇	1,513,528.00	6.31
474	603386	骏亚科技	1,512,715.00	6.31
475	603948	建业股份	1,511,608.00	6.31
476	688112	鼎阳科技	1,511,482.73	6.30
477	301061	匠心家居	1,507,336.00	6.29
478	300616	尚品宅配	1,506,409.00	6.28
479	301048	金鹰重工	1,504,330.00	6.28
480	001216	华瓷股份	1,503,771.00	6.27
481	600993	马应龙	1,499,396.00	6.25
482	000910	大亚圣象	1,495,630.00	6.24
483	002701	奥瑞金	1,493,426.00	6.23
484	600180	瑞茂通	1,492,219.00	6.22
485	301206	三元生物	1,488,849.00	6.21
486	601059	信达证券	1,481,880.00	6.18
487	600057	厦门象屿	1,473,168.37	6.15
488	688138	清溢光电	1,470,755.74	6.14
489	603678	火炬电子	1,466,337.80	6.12
490	300407	凯发电气	1,461,344.00	6.10
491	301230	泓博医药	1,460,473.00	6.09
492	603730	岱美股份	1,458,592.00	6.08
493	000686	东北证券	1,457,426.00	6.08
494	000429	粤高速 A	1,452,823.32	6.06
495	601088	中国神华	1,452,422.00	6.06
496	002847	盐津铺子	1,447,660.00	6.04
497	002154	报喜鸟	1,445,929.00	6.03
498	002746	仙坛股份	1,442,979.00	6.02
499	300779	惠城环保	1,442,403.00	6.02
500	688385	复旦微电	1,438,410.43	6.00
501	688187	时代电气	1,437,344.71	6.00

502	600022	山东钢铁	1,434,735.00	5.98
503	601628	中国人寿	1,432,130.00	5.97
504	300442	润泽科技	1,431,822.00	5.97
505	002135	东南网架	1,430,417.00	5.97
506	601390	中国中铁	1,429,270.57	5.96
507	688059	华锐精密	1,425,333.69	5.95
508	688190	云路股份	1,425,254.78	5.95
509	002590	万安科技	1,425,155.00	5.94
510	000029	深深房 A	1,424,141.00	5.94
511	600051	宁波联合	1,423,741.00	5.94
512	600063	皖维高新	1,423,288.00	5.94
513	300596	利安隆	1,421,828.00	5.93
514	300910	瑞丰新材	1,421,694.40	5.93
515	002891	中宠股份	1,420,540.00	5.93
516	603220	中贝通信	1,418,786.00	5.92
517	600673	东阳光	1,418,252.00	5.92
518	688009	中国通号	1,417,887.35	5.91
519	688185	康希诺	1,417,128.69	5.91
520	601857	中国石油	1,416,589.00	5.91
521	002142	宁波银行	1,416,004.00	5.91
522	300945	曼卡龙	1,414,433.00	5.90
523	600697	欧亚集团	1,413,371.00	5.90
524	002968	新大正	1,412,635.00	5.89
525	002258	利尔化学	1,412,543.00	5.89
526	600320	振华重工	1,412,035.00	5.89
527	301080	百普赛斯	1,411,646.00	5.89
528	600790	轻纺城	1,410,133.00	5.88
529	600062	华润双鹤	1,409,993.00	5.88
530	603530	神马电力	1,399,444.00	5.84
531	002826	易明医药	1,398,169.00	5.83
532	601117	中国化学	1,395,806.00	5.82
533	000528	柳工	1,394,740.00	5.82
534	301339	通行宝	1,393,108.00	5.81
535	002073	软控股份	1,391,356.00	5.80
536	003008	开普检测	1,391,006.70	5.80
537	300146	汤臣倍健	1,389,001.00	5.79
538	600711	盛屯矿业	1,386,921.00	5.79
539	600326	西藏天路	1,386,489.00	5.78
540	002895	川恒股份	1,380,323.00	5.76
541	300322	硕贝德	1,379,847.00	5.76
542	600482	中国动力	1,379,766.00	5.76

543	601677	明泰铝业	1,378,549.00	5.75
544	000048	京基智农	1,377,131.36	5.74
545	603565	中谷物流	1,374,536.00	5.73
546	688279	峰昭科技	1,374,323.84	5.73
547	301362	民爆光电	1,374,263.42	5.73
548	002662	峰璟股份	1,373,087.00	5.73
549	002572	索菲亚	1,371,758.00	5.72
550	002081	金螳螂	1,368,657.00	5.71
551	600308	华泰股份	1,366,632.60	5.70
552	600261	阳光照明	1,363,855.00	5.69
553	605088	冠盛股份	1,359,779.00	5.67
554	603303	得邦照明	1,358,831.00	5.67
555	603500	祥和实业	1,355,607.00	5.65
556	603538	美诺华	1,354,710.27	5.65
557	001228	永泰运	1,354,439.00	5.65
558	600266	城建发展	1,354,108.00	5.65
559	001316	润贝航科	1,353,966.00	5.65
560	600335	国机汽车	1,353,465.00	5.65
561	300532	今天国际	1,351,998.00	5.64
562	002035	华帝股份	1,350,395.00	5.63
563	600710	苏美达	1,350,018.00	5.63
564	603901	永创智能	1,349,552.00	5.63
565	002074	国轩高科	1,349,185.00	5.63
566	002126	银轮股份	1,347,277.00	5.62
567	002345	潮宏基	1,344,755.00	5.61
568	601678	滨化股份	1,344,346.00	5.61
569	688029	南微医学	1,344,218.11	5.61
570	300443	金雷股份	1,341,323.00	5.60
571	603218	日月股份	1,341,033.00	5.59
572	601368	绿城水务	1,340,076.00	5.59
573	002645	华宏科技	1,339,268.00	5.59
574	603326	我乐家居	1,338,516.00	5.58
575	300970	华绿生物	1,336,619.00	5.58
576	301162	国能日新	1,334,950.00	5.57
577	688628	优利德	1,334,011.09	5.56
578	002282	博深股份	1,333,092.00	5.56
579	601727	上海电气	1,332,982.00	5.56
580	600211	西藏药业	1,332,938.00	5.56
581	000529	广弘控股	1,332,891.00	5.56
582	603029	天鹅股份	1,329,009.00	5.54
583	002375	亚厦股份	1,328,430.00	5.54

584	300677	英科医疗	1,328,292.00	5.54
585	603061	金海通	1,327,226.00	5.54
586	301376	致欧科技	1,326,475.00	5.53
587	000404	长虹华意	1,325,296.00	5.53
588	002938	鹏鼎控股	1,323,989.00	5.52
589	300639	凯普生物	1,323,510.00	5.52
590	605090	九丰能源	1,320,491.00	5.51
591	002344	海宁皮城	1,320,363.00	5.51
592	002022	科华生物	1,320,044.00	5.51
593	603676	卫信康	1,319,787.00	5.51
594	601965	中国汽研	1,318,783.00	5.50
595	600938	中国海油	1,317,946.00	5.50
596	688772	珠海冠宇	1,316,741.66	5.49
597	300095	华伍股份	1,316,479.00	5.49
598	301551	无线传媒	1,313,542.00	5.48
599	601665	齐鲁银行	1,312,369.00	5.47
600	000088	盐田港	1,311,386.00	5.47
601	601199	江南水务	1,310,730.00	5.47
602	600884	杉杉股份	1,310,527.00	5.47
603	600733	北汽蓝谷	1,309,796.00	5.46
604	603900	莱绅通灵	1,309,619.00	5.46
605	002144	宏达高科	1,307,878.00	5.46
606	688166	博瑞医药	1,305,550.39	5.45
607	600816	建元信托	1,303,299.00	5.44
608	300187	永清环保	1,303,009.00	5.44
609	603337	杰克科技	1,301,522.00	5.43
610	300083	创世纪	1,300,624.00	5.43
611	002080	中材科技	1,300,589.00	5.43
612	603406	天富龙	1,300,288.00	5.42
613	603296	华勤技术	1,299,908.00	5.42
614	002521	齐峰新材	1,299,342.00	5.42
615	688717	艾罗能源	1,298,086.98	5.41
616	300501	海顺新材	1,297,559.00	5.41
617	603866	桃李面包	1,296,999.00	5.41
618	002998	优彩资源	1,296,098.00	5.41
619	600132	重庆啤酒	1,292,662.00	5.39
620	000850	华茂股份	1,291,067.00	5.39
621	688070	纵横股份	1,291,012.90	5.39
622	688267	中触媒	1,289,804.91	5.38
623	002852	道道全	1,289,076.00	5.38
624	001323	慕思股份	1,287,235.00	5.37

625	000913	钱江摩托	1,285,933.00	5.36
626	002202	金风科技	1,285,273.00	5.36
627	000700	模塑科技	1,283,985.00	5.36
628	002049	紫光国微	1,281,979.20	5.35
629	000683	博源化工	1,281,549.00	5.35
630	002811	郑中设计	1,281,097.00	5.34
631	002236	大华股份	1,280,571.00	5.34
632	001368	通达创智	1,279,939.00	5.34
633	000513	丽珠集团	1,270,419.00	5.30
634	601218	吉鑫科技	1,269,209.00	5.29
635	601996	丰林集团	1,268,682.00	5.29
636	301291	明阳电气	1,267,289.00	5.29
637	605338	巴比食品	1,266,759.00	5.28
638	000926	福星股份	1,263,819.00	5.27
639	603966	法兰泰克	1,262,160.00	5.26
640	688639	华恒生物	1,260,079.04	5.26
641	603305	旭升集团	1,256,529.00	5.24
642	688198	佰仁医疗	1,256,395.22	5.24
643	601077	渝农商行	1,255,543.00	5.24
644	002340	格林美	1,252,431.00	5.22
645	001206	依依股份	1,251,185.00	5.22
646	002558	巨人网络	1,250,328.00	5.22
647	002004	华邦健康	1,246,329.00	5.20
648	600686	金龙汽车	1,242,848.00	5.18
649	603979	金诚信	1,239,227.00	5.17
650	301031	中熔电气	1,238,995.00	5.17
651	000755	山西高速	1,238,599.00	5.17
652	600754	锦江酒店	1,236,918.00	5.16
653	600854	春兰股份	1,235,772.00	5.15
654	002075	沙钢股份	1,232,185.00	5.14
655	301331	恩威医药	1,231,237.00	5.14
656	002753	永东股份	1,230,601.00	5.13
657	600821	金开新能	1,222,122.00	5.10
658	002664	信质集团	1,220,525.00	5.09
659	600179	安通控股	1,220,510.00	5.09
660	002346	柘中股份	1,219,809.00	5.09
661	603915	国茂股份	1,219,562.00	5.09
662	605599	莱百股份	1,217,675.00	5.08
663	002415	海康威视	1,215,332.00	5.07
664	002966	苏州银行	1,214,911.00	5.07
665	301215	中汽股份	1,213,832.00	5.06

666	601010	文峰股份	1,211,489.00	5.05
667	300305	裕兴股份	1,210,851.00	5.05
668	000507	珠海港	1,208,857.00	5.04
669	301187	欧圣电气	1,207,422.00	5.04
670	600533	栖霞建设	1,206,011.00	5.03
671	000895	双汇发展	1,204,797.00	5.03
672	600641	先导基电	1,202,552.00	5.02
673	000090	天健集团	1,202,277.00	5.02
674	000707	双环科技	1,200,945.00	5.01
675	603458	勘设股份	1,200,757.00	5.01
676	605122	四方新材	1,199,758.00	5.00
677	300743	天地数码	1,198,620.00	5.00
678	688097	博众精工	1,197,242.58	4.99
679	603018	华设集团	1,194,110.00	4.98
680	001337	四川黄金	1,193,687.00	4.98
681	002532	天山铝业	1,190,378.00	4.97
682	600027	华电国际	1,189,988.00	4.96
683	603588	高能环境	1,189,034.00	4.96
683	301283	聚胶股份	1,189,034.00	4.96
684	603236	移远通信	1,187,753.00	4.95
685	000975	山金国际	1,186,133.00	4.95
686	002414	高德红外	1,183,103.00	4.94
687	600776	东方通信	1,180,343.00	4.92
688	601828	美凯龙	1,179,796.64	4.92
689	300685	艾德生物	1,179,793.00	4.92
690	600657	信达地产	1,178,122.00	4.91
691	002117	东港股份	1,177,534.00	4.91
692	000990	诚志股份	1,177,457.92	4.91
693	000589	贵州轮胎	1,176,521.00	4.91
694	603768	常青股份	1,175,970.00	4.91
695	601668	中国建筑	1,174,652.00	4.90
696	600643	爱建集团	1,174,523.00	4.90
697	300405	科隆股份	1,173,775.00	4.90
698	601778	晶科科技	1,171,711.00	4.89
699	002573	清新环境	1,168,891.00	4.88
700	688606	奥泰生物	1,168,681.33	4.88
701	600287	苏豪时尚	1,167,674.00	4.87
702	601366	利群股份	1,167,305.00	4.87
703	603729	龙韵股份	1,166,009.00	4.86
704	600716	凤凰股份	1,165,108.00	4.86
705	002434	万里扬	1,164,697.00	4.86

706	002614	奥佳华	1,163,057.00	4.85
707	600188	兖矿能源	1,162,121.00	4.85
708	002833	弘亚数控	1,162,029.00	4.85
709	002632	道明光学	1,161,110.00	4.84
710	002690	美亚光电	1,159,174.10	4.84
711	603980	吉华集团	1,157,997.00	4.83
712	002574	明牌珠宝	1,157,771.00	4.83
713	601985	中国核电	1,156,436.00	4.82
714	300717	华信新材	1,156,304.00	4.82
715	600176	中国巨石	1,155,600.00	4.82
716	000560	我爱我家	1,153,427.00	4.81
717	603818	曲美家居	1,152,887.00	4.81
718	600939	重庆建工	1,151,469.00	4.80
719	603385	惠达卫浴	1,150,368.00	4.80
720	000717	中南股份	1,149,650.00	4.80
721	002595	豪迈科技	1,149,523.00	4.80
722	688073	毕得医药	1,148,142.96	4.79
723	600350	山东高速	1,147,912.00	4.79
724	003033	征和工业	1,145,288.00	4.78
725	601916	浙商银行	1,144,987.00	4.78
726	603012	创力集团	1,141,811.00	4.76
727	600858	银座股份	1,141,685.00	4.76
728	002191	劲嘉股份	1,139,594.00	4.75
729	600007	中国国贸	1,139,550.00	4.75
730	300912	凯龙高科	1,139,494.00	4.75
731	003041	真爱美家	1,139,450.00	4.75
732	688117	圣诺生物	1,139,141.33	4.75
733	001268	联合精密	1,138,970.00	4.75
734	000822	山东海化	1,136,599.00	4.74
735	603858	步长制药	1,136,593.00	4.74
736	000059	华锦股份	1,133,077.00	4.73
737	301167	建研设计	1,132,789.00	4.73
738	600729	重庆百货	1,132,481.00	4.72
739	603898	好莱客	1,132,422.00	4.72
740	603648	畅联股份	1,131,141.00	4.72
741	688298	东方生物	1,126,126.01	4.70
742	600323	瀚蓝环境	1,125,595.00	4.70
743	603207	小方制药	1,125,558.60	4.70
744	001328	登康口腔	1,125,003.00	4.69
745	002382	蓝帆医疗	1,124,039.01	4.69
746	601633	长城汽车	1,122,189.00	4.68

747	601600	中国铝业	1,122,176.00	4.68
748	605296	神农集团	1,120,061.00	4.67
749	300664	鹏鹞环保	1,113,284.50	4.64
750	002763	汇洁股份	1,107,949.00	4.62
751	000338	潍柴动力	1,102,832.00	4.60
752	600755	厦门国贸	1,101,434.00	4.59
753	603556	海兴电力	1,100,675.85	4.59
754	002146	荣盛发展	1,099,789.00	4.59
755	300349	金卡智能	1,098,845.00	4.58
756	601588	北辰实业	1,097,475.00	4.58
757	600467	好当家	1,094,118.00	4.56
758	600298	安琪酵母	1,093,972.00	4.56
759	002585	双星新材	1,093,205.00	4.56
760	002920	德赛西威	1,092,821.88	4.56
761	002107	沃华医药	1,092,420.20	4.56
762	688075	安旭生物	1,092,095.63	4.56
763	000783	长江证券	1,091,329.00	4.55
764	002772	众兴菌业	1,088,256.00	4.54
765	688319	欧林生物	1,086,424.71	4.53
766	603099	长白山	1,085,213.00	4.53
767	002984	森麒麟	1,084,904.10	4.53
768	600153	建发股份	1,081,124.00	4.51
769	601919	中远海控	1,077,323.00	4.49
770	000785	居然智家	1,075,038.00	4.48
771	600585	海螺水泥	1,072,979.00	4.48
772	688350	富淼科技	1,072,934.11	4.48
773	002404	嘉欣丝绸	1,070,372.00	4.46
774	688113	联测科技	1,066,263.51	4.45
775	601318	中国平安	1,064,771.00	4.44
776	002016	世荣兆业	1,064,147.00	4.44
777	688702	盛科通信	1,060,690.14	4.42
778	000548	湖南投资	1,060,639.00	4.42
779	688296	和达科技	1,060,556.92	4.42
780	300775	三角防务	1,059,997.00	4.42
781	300456	赛微电子	1,058,623.00	4.42
782	300638	广和通	1,053,543.00	4.39
783	002978	安宁股份	1,052,959.00	4.39
784	600157	永泰能源	1,052,864.00	4.39
785	600888	新疆众和	1,051,512.00	4.39
786	601956	东贝集团	1,051,047.00	4.38
787	000888	峨眉山 A	1,049,476.00	4.38

788	603183	建研院	1,048,818.00	4.38
789	689009	九号公司	1,048,462.36	4.37
790	603202	天有为	1,047,862.00	4.37
791	002349	精华制药	1,047,046.00	4.37
792	000938	紫光股份	1,046,432.00	4.37
793	300886	华业香料	1,046,078.00	4.36
794	000778	新兴铸管	1,044,941.00	4.36
795	300438	鹏辉能源	1,044,194.00	4.36
796	603929	亚翔集成	1,043,858.00	4.35
797	002156	通富微电	1,039,257.00	4.34
798	002709	天赐材料	1,037,039.00	4.33
799	601921	浙版传媒	1,036,898.00	4.33
800	001227	兰州银行	1,036,071.00	4.32
801	301300	远翔新材	1,033,984.00	4.31
802	002533	金杯电工	1,033,336.00	4.31
803	002138	顺络电子	1,033,019.00	4.31
804	300491	通合科技	1,032,590.00	4.31
805	688565	力源科技	1,031,901.82	4.30
806	000962	东方钽业	1,031,456.00	4.30
807	002043	兔宝宝	1,031,437.00	4.30
808	300695	兆丰股份	1,031,317.00	4.30
809	603998	方盛制药	1,031,053.00	4.30
810	600325	华发股份	1,031,028.00	4.30
811	003027	同兴科技	1,028,950.00	4.29
812	688681	科汇股份	1,028,206.79	4.29
813	688058	宝兰德	1,028,009.49	4.29
814	300199	翰宇药业	1,027,745.54	4.29
815	688659	元琛科技	1,027,467.51	4.29
816	601107	四川成渝	1,026,687.00	4.28
817	000421	南京公用	1,025,714.00	4.28
818	603182	嘉华股份	1,025,318.00	4.28
819	002001	新和成	1,025,192.00	4.28
820	600137	浪莎股份	1,025,023.00	4.28
821	002215	诺普信	1,024,123.00	4.27
822	000408	藏格矿业	1,023,997.00	4.27
823	603193	润本股份	1,022,273.00	4.26
824	688550	瑞联新材	1,021,347.89	4.26
825	600095	湘财股份	1,020,976.00	4.26
826	301047	义翘神州	1,019,839.00	4.25
827	600019	宝钢股份	1,019,066.00	4.25
828	301552	科力装备	1,018,626.00	4.25

829	000786	北新建材	1,018,270.00	4.25
830	688789	宏华数科	1,017,647.57	4.24
831	001388	信通电子	1,016,260.00	4.24
832	301077	星华新材	1,015,268.00	4.24
833	000538	云南白药	1,015,127.00	4.23
834	688408	中信博	1,014,560.14	4.23
835	300138	晨光生物	1,014,179.00	4.23
836	301043	绿岛风	1,013,905.00	4.23
837	300929	华骐环保	1,013,622.00	4.23
838	603507	振江股份	1,013,536.00	4.23
839	300641	正丹股份	1,011,983.00	4.22
840	688038	中科通达	1,011,332.95	4.22
841	002148	北纬科技	1,010,766.00	4.22
842	001210	金房能源	1,010,522.84	4.22
843	600847	万里股份	1,010,366.00	4.21
844	300417	南华仪器	1,009,703.00	4.21
845	301273	瑞晨环保	1,009,403.00	4.21
846	688450	光格科技	1,009,131.88	4.21
847	300272	开能健康	1,007,583.00	4.20
848	600883	博闻科技	1,007,111.00	4.20
849	000795	英洛华	1,006,240.00	4.20
850	002458	益生股份	1,005,825.00	4.20
851	300649	杭州园林	1,005,138.00	4.19
852	605108	同庆楼	1,004,580.00	4.19
853	600999	招商证券	1,002,817.00	4.18
854	601595	上海电影	1,002,750.00	4.18
855	002011	盾安环境	1,002,364.00	4.18
856	600016	民生银行	1,002,108.00	4.18
857	000863	三湘印象	999,961.00	4.17
858	600332	白云山	999,692.00	4.17
859	601319	中国人保	999,545.00	4.17
860	600765	中航重机	999,418.00	4.17
861	603967	中创物流	999,337.00	4.17
862	603859	能科科技	999,227.00	4.17
863	688334	西高院	998,680.37	4.17
864	688309	恒誉环保	996,210.50	4.16
865	301063	海锅股份	993,565.00	4.14
866	688182	灿勤科技	992,766.08	4.14
867	688399	硕世生物	991,869.92	4.14
868	601728	中国电信	991,229.00	4.13
869	000739	普洛药业	990,176.00	4.13

870	600030	中信证券	989,040.00	4.13
871	603132	金徽股份	988,253.00	4.12
872	000028	国药一致	987,971.00	4.12
873	600732	爱旭股份	986,745.00	4.12
874	003035	南网能源	985,786.00	4.11
875	002743	富煌钢构	983,916.00	4.10
876	605001	威奥股份	982,972.00	4.10
877	002727	一心堂	982,427.00	4.10
878	000156	华数传媒	981,529.00	4.09
879	002222	福晶科技	981,510.00	4.09
880	603306	华懋科技	977,829.00	4.08
881	603195	公牛集团	977,457.80	4.08
882	002972	科安达	976,808.20	4.07
883	300190	维尔利	971,178.56	4.05
884	002492	恒基达鑫	968,603.00	4.04
885	600455	博通股份	968,581.00	4.04
886	603739	蔚蓝生物	968,417.00	4.04
887	301207	华兰疫苗	967,125.00	4.03
888	001289	龙源电力	966,673.00	4.03
889	603006	黎明股份	960,518.00	4.01
890	603173	福斯达	959,433.00	4.00
891	002223	鱼跃医疗	957,646.00	3.99
892	600612	老凤祥	956,554.00	3.99
893	601918	新集能源	955,079.00	3.98
894	603017	中衡设计	954,880.00	3.98
895	603680	今创集团	954,351.00	3.98
896	002648	卫星化学	952,702.00	3.97
897	600866	星湖科技	951,751.00	3.97
898	000672	上峰水泥	950,656.20	3.97
899	301223	中荣股份	949,989.00	3.96
900	002301	齐心集团	949,120.00	3.96
901	688638	誉辰智能	947,275.71	3.95
902	001207	联科科技	947,206.00	3.95
903	600718	东软集团	946,573.00	3.95
904	300733	西菱动力	946,482.00	3.95
905	600933	爱柯迪	945,028.00	3.94
906	600633	浙数文化	943,044.00	3.93
907	603661	恒林股份	941,777.00	3.93
908	688676	金盘科技	933,777.10	3.90
909	601333	广深铁路	933,301.00	3.89
910	300994	久祺股份	933,262.00	3.89

911	000155	川能动力	931,057.00	3.88
912	002204	大连重工	929,942.00	3.88
913	600977	中国电影	929,595.00	3.88
914	000001	平安银行	929,530.00	3.88
915	301195	北路智控	928,979.00	3.88
916	688016	心脉医疗	928,207.71	3.87
917	600623	华谊集团	928,028.00	3.87
918	603757	大元泵业	926,191.00	3.86
919	603045	福达合金	925,185.00	3.86
920	603690	至纯科技	924,801.00	3.86
921	601016	节能风电	924,426.00	3.86
922	600064	南京高科	923,866.00	3.85
923	000534	万泽股份	921,795.00	3.85
924	603569	长久物流	921,184.00	3.84
925	603799	华友钴业	920,851.00	3.84
926	002666	德联集团	920,781.00	3.84
927	603566	普莱柯	920,519.00	3.84
928	603708	家家悦	918,055.00	3.83
929	600050	中国联通	917,961.00	3.83
930	002332	仙琚制药	917,008.00	3.83
931	300219	鸿利智汇	915,831.00	3.82
932	300470	中密控股	914,826.00	3.82
933	603416	信捷电气	914,476.00	3.81
934	601006	大秦铁路	914,124.00	3.81
935	000159	国际实业	912,922.00	3.81
936	300498	温氏股份	912,888.00	3.81
937	002151	北斗星通	912,841.00	3.81
938	600031	三一重工	912,804.00	3.81
939	600576	祥源文旅	912,771.00	3.81
940	600020	中原高速	912,587.00	3.81
941	002714	牧原股份	912,234.00	3.81
942	605133	嵘泰股份	910,813.00	3.80
943	605337	李子园	910,667.00	3.80
944	000582	北部湾港	909,608.00	3.79
945	000402	金融街	907,582.00	3.79
946	688620	安凯微	907,207.66	3.78
947	002007	华兰生物	907,153.00	3.78
948	000807	云铝股份	907,086.00	3.78
949	600448	华纺股份	904,248.00	3.77
950	600601	方正科技	901,895.00	3.76
951	600150	中国船舶	901,705.00	3.76

952	600276	恒瑞医药	900,680.00	3.76
953	601799	星宇股份	900,351.56	3.76
954	300599	雄塑科技	899,323.00	3.75
955	600483	福能股份	898,823.00	3.75
956	600795	国电电力	897,000.00	3.74
957	300140	节能环境	896,127.00	3.74
958	603968	醋化股份	895,252.00	3.73
959	002809	红墙股份	894,992.00	3.73
960	002551	尚荣医疗	894,519.00	3.73
961	600235	民丰特纸	894,236.00	3.73
962	002109	兴化股份	893,554.00	3.73
963	603041	美思德	893,503.00	3.73
964	605058	澳弘电子	893,497.00	3.73
965	600784	鲁银投资	892,850.95	3.72
966	605177	东亚药业	892,841.00	3.72
967	000605	渤海股份	891,693.00	3.72
968	300504	天邑股份	891,019.00	3.72
969	600594	益佰制药	890,798.00	3.72
970	688183	生益电子	890,588.77	3.71
971	600128	苏豪弘业	890,141.00	3.71
972	600717	天津港	890,015.00	3.71
973	600638	新黄浦	889,442.00	3.71
974	301395	仁信新材	889,027.00	3.71
975	301115	联检科技	888,801.00	3.71
976	603629	利通电子	888,727.00	3.71
977	002566	益盛药业	888,577.00	3.71
978	000652	泰达股份	888,512.00	3.71
979	688061	灿瑞科技	888,188.48	3.70
980	601200	上海环境	888,132.00	3.70
981	301330	熵基科技	887,832.00	3.70
982	600303	曙光股份	886,616.00	3.70
983	688533	上声电子	885,818.45	3.70
984	000061	农产品	885,669.00	3.69
985	688459	哈铁科技	883,509.53	3.69
986	300001	特锐德	882,993.00	3.68
987	002449	国星光电	882,945.00	3.68
988	600736	苏州高新	882,122.00	3.68
989	603587	地素时尚	881,347.00	3.68
990	300034	钢研高纳	881,157.00	3.68
991	000517	荣安地产	880,923.00	3.67
992	300230	永利股份	880,897.00	3.67

993	000779	甘咨询	878,092.00	3.66
994	301231	荣信文化	877,473.00	3.66
995	600499	科达制造	876,969.00	3.66
996	000963	华东医药	873,995.97	3.65
997	002773	康弘药业	873,989.00	3.65
998	601168	西部矿业	873,789.00	3.64
999	301365	矩阵股份	872,458.00	3.64
1,000	603055	台华新材	870,305.00	3.63
1,001	688036	传音控股	868,532.36	3.62
1,002	301345	涛涛车业	868,400.00	3.62
1,003	002430	杭氧股份	868,271.00	3.62
1,004	600864	哈投股份	865,274.00	3.61
1,005	603136	天目湖	865,179.65	3.61
1,006	300857	协创数据	864,236.00	3.61
1,007	002552	宝鼎科技	855,637.00	3.57
1,008	000933	神火股份	855,235.00	3.57
1,009	600802	福建水泥	854,484.00	3.56
1,010	300679	电连技术	854,448.00	3.56
1,011	300627	华测导航	853,581.00	3.56
1,012	002624	完美世界	851,468.00	3.55
1,013	600973	宝胜股份	848,825.00	3.54
1,014	301498	乖宝宠物	844,727.00	3.52
1,015	600315	上海家化	842,790.00	3.52
1,016	002452	长高电新	840,094.00	3.50
1,017	605099	共创草坪	836,894.00	3.49
1,018	688768	容知日新	836,421.30	3.49
1,019	600054	黄山旅游	835,326.00	3.48
1,020	002928	华夏航空	834,887.00	3.48
1,021	603589	口子窖	834,132.00	3.48
1,022	601615	明阳智能	832,618.00	3.47
1,023	002946	新乳业	832,397.00	3.47
1,024	688091	上海谊众	831,695.03	3.47
1,025	002461	珠江啤酒	830,906.00	3.47
1,026	002562	兄弟科技	829,561.00	3.46
1,027	301175	中科环保	829,417.00	3.46
1,028	300033	同花顺	825,947.00	3.45
1,029	001301	尚太科技	823,739.00	3.44
1,030	605056	咸亨国际	823,290.00	3.43
1,031	002357	富临运业	823,164.00	3.43
1,032	601512	中新集团	822,525.00	3.43
1,033	300226	上海钢联	822,067.00	3.43

1,034	300363	博腾股份	821,758.00	3.43
1,035	300835	龙磁科技	818,374.00	3.41
1,036	300612	宣亚国际	815,284.00	3.40
1,037	002661	克明食品	814,214.00	3.40
1,038	000958	电投产融	812,857.00	3.39
1,039	603111	康尼机电	809,765.00	3.38
1,040	000034	神州数码	808,375.00	3.37
1,041	600547	山东黄金	806,296.00	3.36
1,042	300867	圣元环保	802,678.00	3.35
1,043	603266	天龙股份	802,070.00	3.35
1,044	002010	传化智联	801,160.00	3.34
1,045	603259	药明康德	799,576.00	3.34
1,046	688333	铂力特	798,116.51	3.33
1,047	300873	海晨股份	797,877.00	3.33
1,048	300607	拓斯达	796,356.00	3.32
1,049	002262	恩华药业	796,190.00	3.32
1,050	605598	上海港湾	795,859.00	3.32
1,051	688295	中复神鹰	791,326.03	3.30
1,052	301313	凡拓数创	790,423.00	3.30
1,053	002184	海得控制	790,209.00	3.30
1,054	688286	敏芯股份	789,110.04	3.29
1,055	300263	隆华科技	788,537.00	3.29
1,056	600771	广誉远	788,275.48	3.29
1,057	603217	元利科技	786,477.00	3.28
1,058	301033	迈普医学	786,114.00	3.28
1,059	600562	国睿科技	785,255.00	3.28
1,060	002688	金河生物	782,332.00	3.26
1,061	600928	西安银行	781,360.00	3.26
1,062	002948	青岛银行	779,480.00	3.25
1,063	002538	司尔特	778,948.00	3.25
1,064	600496	精工钢构	776,381.00	3.24
1,065	600662	外服控股	776,065.00	3.24
1,066	600237	铜峰电子	774,186.00	3.23
1,067	688257	新锐股份	772,945.69	3.22
1,068	688310	迈得医疗	771,278.82	3.22
1,069	603102	百合股份	770,303.00	3.21
1,070	002025	航天电器	767,873.00	3.20
1,071	301235	华康洁净	767,149.00	3.20
1,072	603035	常熟汽饰	766,289.00	3.20
1,073	300996	普联软件	765,661.00	3.19
1,074	002609	捷顺科技	764,121.00	3.19

1,075	600163	中闽能源	762,385.00	3.18
1,076	688321	微芯生物	762,101.65	3.18
1,077	601226	华电科工	760,788.00	3.17
1,078	600882	妙可蓝多	759,033.00	3.17
1,079	603197	保隆科技	756,459.00	3.16
1,080	600959	江苏有线	755,927.00	3.15
1,081	603301	振德医疗	754,646.00	3.15
1,082	605123	派克新材	754,498.00	3.15
1,083	000978	桂林旅游	753,576.00	3.14
1,084	002402	和而泰	751,686.00	3.14
1,085	603808	歌力思	751,506.00	3.13
1,086	000301	东方盛虹	750,223.00	3.13
1,087	002063	远光软件	749,520.00	3.13
1,088	688488	艾迪药业	749,183.71	3.13
1,089	688778	厦钨新能	744,174.26	3.10
1,090	002659	凯文教育	743,399.00	3.10
1,091	300986	志特新材	743,000.00	3.10
1,092	300863	卡倍亿	740,211.00	3.09
1,093	301196	唯科科技	739,742.00	3.09
1,094	603215	比依股份	737,353.00	3.08
1,095	688391	钜泉科技	736,586.94	3.07
1,096	002225	濮耐股份	736,303.00	3.07
1,097	002516	旷达科技	734,756.00	3.06
1,098	002568	百润股份	731,604.00	3.05
1,099	600528	中铁工业	729,432.00	3.04
1,100	300559	佳发教育	729,332.00	3.04
1,101	300622	博士眼镜	728,872.00	3.04
1,102	688261	东微半导	728,574.59	3.04
1,103	001322	箭牌家居	726,155.00	3.03
1,104	688015	交控科技	726,010.37	3.03
1,105	688621	阳光诺和	725,606.46	3.03
1,106	600618	氯碱化工	721,641.00	3.01
1,107	603379	三美股份	720,646.00	3.01
1,108	688615	合合信息	720,625.31	3.01
1,109	600029	南方航空	717,904.00	2.99
1,110	601609	金田股份	714,017.00	2.98
1,111	300761	立华股份	713,093.40	2.97
1,112	300389	艾比森	710,455.00	2.96
1,113	600392	盛和资源	710,036.00	2.96
1,114	603238	诺邦股份	702,855.00	2.93
1,115	688618	三旺通信	702,835.75	2.93

1, 116	300631	久吾高科	702, 405. 00	2. 93
1, 117	002745	木林森	700, 847. 00	2. 92
1, 118	301113	雅艺科技	700, 300. 90	2. 92
1, 119	600583	海油工程	700, 203. 00	2. 92
1, 120	300072	海新能科	699, 890. 00	2. 92
1, 121	002153	石基信息	698, 911. 00	2. 92
1, 122	600517	国网英大	696, 395. 00	2. 90
1, 123	600316	洪都航空	696, 148. 00	2. 90
1, 124	601066	中信建投	696, 023. 00	2. 90
1, 125	002597	金禾实业	694, 778. 00	2. 90
1, 126	002987	京北方	687, 009. 00	2. 87
1, 127	301488	豪恩汽电	685, 372. 00	2. 86
1, 128	600109	国金证券	683, 038. 00	2. 85
1, 129	688498	源杰科技	679, 505. 10	2. 83
1, 130	000035	中国天楹	679, 202. 10	2. 83
1, 131	601865	福莱特	678, 633. 00	2. 83
1, 132	603889	新澳股份	673, 524. 00	2. 81
1, 133	301003	江苏博云	672, 293. 00	2. 80
1, 134	002911	佛燃能源	666, 229. 00	2. 78
1, 135	600351	亚宝药业	665, 934. 00	2. 78
1, 136	002697	红旗连锁	664, 811. 00	2. 77
1, 137	301068	大地海洋	660, 509. 00	2. 76
1, 138	688128	中国电研	659, 952. 58	2. 75
1, 139	605028	世茂能源	657, 517. 00	2. 74
1, 140	002039	黔源电力	649, 983. 00	2. 71
1, 141	000539	粤电力 A	647, 594. 00	2. 70
1, 142	688048	长光华芯	646, 673. 10	2. 70
1, 143	002111	威海广泰	639, 894. 00	2. 67
1, 144	600976	健民集团	638, 784. 00	2. 66
1, 145	002152	广电运通	637, 462. 55	2. 66
1, 146	688580	伟思医疗	634, 668. 57	2. 65
1, 147	603088	宁波精达	633, 796. 00	2. 64
1, 148	300815	玉禾田	628, 491. 00	2. 62
1, 149	002649	博彦科技	627, 520. 00	2. 62
1, 150	600061	国投资本	618, 092. 00	2. 58
1, 151	605305	中际联合	605, 427. 00	2. 53
1, 152	600459	贵研铂业	599, 233. 00	2. 50
1, 153	300236	上海新阳	598, 527. 00	2. 50
1, 154	600234	科新发展	597, 502. 00	2. 49
1, 155	002579	中京电子	597, 202. 00	2. 49
1, 156	600869	远东股份	596, 798. 00	2. 49

1, 157	301220	亚香股份	594, 841. 00	2. 48
1, 158	002658	雪迪龙	590, 639. 00	2. 46
1, 159	600073	光明肉业	590, 250. 00	2. 46
1, 160	002778	中晟高科	589, 349. 00	2. 46
1, 161	000936	华西股份	586, 985. 00	2. 45
1, 162	605066	天正电气	584, 027. 00	2. 44
1, 163	300019	硅宝科技	583, 880. 00	2. 44
1, 164	002961	瑞达期货	583, 767. 00	2. 44
1, 165	603322	超讯通信	581, 772. 00	2. 43
1, 166	300788	中信出版	579, 112. 00	2. 42
1, 167	603317	天味食品	571, 885. 00	2. 39
1, 168	300643	万通智控	567, 156. 00	2. 37
1, 169	603886	元祖股份	566, 469. 00	2. 36
1, 170	002594	比亚迪	559, 800. 00	2. 34
1, 171	000823	超声电子	550, 385. 00	2. 30
1, 172	300388	节能国祯	544, 735. 00	2. 27
1, 173	601163	三角轮胎	543, 774. 00	2. 27
1, 174	603128	华贸物流	541, 855. 00	2. 26
1, 175	603567	珍宝岛	527, 178. 00	2. 20
1, 176	000550	江铃汽车	519, 242. 00	2. 17
1, 177	002423	中粮资本	518, 546. 00	2. 16
1, 178	600817	宇通重工	518, 499. 00	2. 16
1, 179	688516	奥特维	512, 522. 53	2. 14
1, 180	603338	浙江鼎力	509, 536. 00	2. 13
1, 181	601818	光大银行	509, 268. 00	2. 12
1, 182	688522	纳睿雷达	507, 615. 10	2. 12
1, 183	688107	安路科技	506, 553. 35	2. 11
1, 184	600428	中远海特	506, 304. 00	2. 11
1, 185	002478	常宝股份	504, 646. 00	2. 11
1, 186	300545	联得装备	504, 466. 00	2. 10
1, 187	600131	国网信通	504, 353. 00	2. 10
1, 188	002976	瑞玛精密	501, 086. 00	2. 09
1, 189	300737	科顺股份	499, 347. 00	2. 08
1, 190	002483	润邦股份	499, 013. 00	2. 08
1, 191	600833	第一医药	498, 318. 00	2. 08
1, 192	600905	三峡能源	498, 069. 00	2. 08
1, 193	688122	西部超导	497, 378. 08	2. 07
1, 194	603707	健友股份	496, 644. 00	2. 07
1, 195	688232	新点软件	492, 969. 05	2. 06
1, 196	603658	安图生物	492, 731. 00	2. 06
1, 197	002802	洪汇新材	492, 714. 00	2. 06

1,198	002139	拓邦股份	491,170.00	2.05
1,199	688475	萤石网络	491,070.46	2.05
1,200	605016	百龙创园	488,966.00	2.04
1,201	600460	士兰微	485,829.00	2.03
1,202	002587	奥拓电子	484,919.00	2.02
1,203	300990	同飞股份	480,642.00	2.00
1,204	600737	中粮糖业	480,128.00	2.00

注：买入金额按成交金额(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	002048	宁波华翔	10,635,738.00	44.37
2	300602	飞荣达	10,220,969.00	42.64
3	600233	圆通速递	7,811,080.00	32.58
4	688799	华纳药厂	7,070,224.74	29.49
5	002899	英派斯	6,104,507.00	25.46
6	688677	海泰新光	6,080,449.58	25.36
7	600660	福耀玻璃	5,938,065.00	24.77
8	600284	浦东建设	5,887,555.15	24.56
9	600989	宝丰能源	5,825,595.00	24.30
10	603185	弘元绿能	5,460,240.00	22.78
11	688758	赛分科技	5,452,192.29	22.74
12	000915	华特达因	5,419,335.00	22.61
13	002545	东方铁塔	5,373,293.00	22.41
14	002867	周大生	5,162,349.00	21.53
15	002788	鹭燕医药	5,000,263.35	20.86
16	301600	慧翰股份	4,798,936.00	20.02
17	601888	中国中免	4,638,534.00	19.35
18	600941	中国移动	4,572,506.00	19.07
19	000828	东莞控股	4,381,078.00	18.28
20	601456	国联民生	4,320,193.00	18.02
21	300251	光线传媒	4,223,408.00	17.62
22	600143	金发科技	4,133,968.00	17.24
23	002441	众业达	4,083,750.00	17.03
24	002436	兴森科技	4,047,044.00	16.88
25	601311	骆驼股份	4,016,829.00	16.76
26	600352	浙江龙盛	3,965,865.00	16.54
27	002807	江阴银行	3,962,238.00	16.53
28	002027	分众传媒	3,960,634.00	16.52
29	601717	中创智领	3,936,800.00	16.42

30	603444	吉比特	3,933,942.00	16.41
31	601126	四方股份	3,919,379.00	16.35
32	300357	我武生物	3,911,898.00	16.32
33	002643	万润股份	3,892,171.50	16.24
34	002803	吉宏股份	3,888,629.00	16.22
35	300003	乐普医疗	3,821,170.00	15.94
36	600066	宇通客车	3,753,886.00	15.66
37	601208	东材科技	3,746,338.00	15.63
38	300619	金银河	3,723,071.70	15.53
39	000423	东阿阿胶	3,694,389.00	15.41
40	002555	三七互娱	3,671,930.00	15.32
41	002255	海陆重工	3,668,705.00	15.30
42	000708	中信特钢	3,665,741.00	15.29
43	600098	广州发展	3,620,978.00	15.10
44	000719	中原传媒	3,561,220.40	14.86
45	601877	正泰电器	3,542,361.00	14.78
46	603698	航天工程	3,526,296.70	14.71
47	600894	广日股份	3,459,181.00	14.43
48	000651	格力电器	3,458,160.00	14.43
49	002216	三全食品	3,435,422.00	14.33
50	003012	东鹏控股	3,390,908.00	14.14
51	601339	百隆东方	3,389,503.00	14.14
52	002625	光启技术	3,375,446.00	14.08
53	002749	国光股份	3,306,519.00	13.79
54	600809	山西汾酒	3,288,765.00	13.72
55	603508	思维列控	3,285,017.04	13.70
56	000726	鲁泰 A	3,274,895.38	13.66
57	601998	中信银行	3,255,684.00	13.58
58	605377	华旺科技	3,250,494.80	13.56
59	002203	海亮股份	3,248,099.00	13.55
60	000568	泸州老窖	3,240,446.00	13.52
61	000858	五粮液	3,239,315.00	13.51
62	603558	健盛集团	3,115,972.00	13.00
63	601336	新华保险	3,112,629.88	12.98
64	601298	青岛港	3,074,398.00	12.82
65	002508	老板电器	3,070,914.00	12.81
66	002837	英维克	3,055,243.40	12.74
67	603113	金能科技	3,033,146.00	12.65
68	600690	海尔智家	3,026,643.00	12.63
69	300866	安克创新	3,026,410.50	12.62
70	002850	科达利	3,017,963.00	12.59

71	688236	春立医疗	3,014,035.17	12.57
72	000543	皖能电力	3,007,081.00	12.54
73	603816	顾家家居	3,002,335.00	12.52
74	600219	南山铝业	2,954,208.00	12.32
75	000999	华润三九	2,946,650.00	12.29
76	603151	邦基科技	2,936,310.00	12.25
77	603323	苏农银行	2,927,008.40	12.21
78	002299	圣农发展	2,897,874.00	12.09
79	600395	盘江股份	2,895,767.00	12.08
80	600887	伊利股份	2,850,129.00	11.89
81	603345	安井食品	2,846,634.23	11.87
82	300636	同和药业	2,837,915.00	11.84
83	300041	回天新材	2,791,695.00	11.65
84	002469	三维化学	2,778,332.00	11.59
85	000598	兴蓉环境	2,767,645.00	11.54
86	600703	三安光电	2,762,192.00	11.52
87	000630	铜陵有色	2,756,771.00	11.50
88	600901	江苏金租	2,752,894.00	11.48
89	603233	大参林	2,735,486.14	11.41
90	002563	森马服饰	2,721,417.00	11.35
91	002091	江苏国泰	2,708,058.55	11.30
92	003011	海象新材	2,706,589.00	11.29
93	601330	绿色动力	2,697,044.00	11.25
94	300364	中文在线	2,687,190.00	11.21
95	002589	瑞康医药	2,669,578.00	11.14
96	600987	航民股份	2,668,080.00	11.13
97	600285	羚锐制药	2,657,143.00	11.08
98	300406	九强生物	2,636,133.00	11.00
99	600362	江西铜业	2,631,587.00	10.98
100	603518	锦泓集团	2,630,917.00	10.97
101	002270	华明装备	2,626,888.00	10.96
102	300770	新媒股份	2,620,785.00	10.93
103	603456	九洲药业	2,615,877.00	10.91
104	603855	华荣股份	2,604,847.00	10.87
105	603279	景津装备	2,587,417.00	10.79
106	601827	三峰环境	2,572,182.00	10.73
107	002315	焦点科技	2,569,459.00	10.72
108	600694	大商股份	2,564,207.70	10.70
109	300776	帝尔激光	2,552,491.00	10.65
110	600282	南钢股份	2,551,740.00	10.64
111	002276	万马股份	2,550,426.00	10.64

112	605277	新亚电子	2,550,131.00	10.64
113	601528	瑞丰银行	2,541,982.00	10.60
114	603506	南都物业	2,539,296.00	10.59
115	601018	宁波港	2,538,415.00	10.59
116	600582	天地科技	2,537,717.00	10.59
117	688239	航宇科技	2,535,501.60	10.58
118	603089	正裕工业	2,517,215.00	10.50
119	300628	亿联网络	2,516,298.00	10.50
120	000685	中山公用	2,507,280.00	10.46
121	605368	蓝天燃气	2,492,016.00	10.40
122	600262	北方股份	2,490,354.00	10.39
123	603071	物产环能	2,487,441.00	10.38
124	300360	炬华科技	2,485,505.00	10.37
125	300748	金力永磁	2,459,815.37	10.26
126	600519	贵州茅台	2,457,372.00	10.25
127	603893	瑞芯微	2,447,925.00	10.21
128	600035	楚天高速	2,444,185.00	10.20
129	002034	旺能环境	2,438,416.00	10.17
130	600713	南京医药	2,424,093.00	10.11
131	601838	成都银行	2,416,842.00	10.08
132	001872	招商港口	2,416,751.00	10.08
133	601825	沪农商行	2,416,283.00	10.08
134	601555	东吴证券	2,411,556.00	10.06
135	301015	百洋医药	2,408,162.00	10.05
136	300652	雷迪克	2,392,721.00	9.98
137	000731	四川美丰	2,388,482.00	9.96
138	601766	中国中车	2,385,799.00	9.95
139	000718	苏宁环球	2,383,567.30	9.94
140	600551	时代出版	2,375,894.00	9.91
141	603766	隆鑫通用	2,367,967.48	9.88
142	600908	无锡银行	2,366,336.00	9.87
143	000690	宝新能源	2,357,934.00	9.84
144	002014	永新股份	2,356,793.00	9.83
145	605499	东鹏饮料	2,346,617.00	9.79
146	600820	隧道股份	2,342,872.00	9.77
147	300972	万辰集团	2,342,253.00	9.77
148	600033	福建高速	2,326,622.00	9.71
149	600742	富维股份	2,323,131.00	9.69
150	688293	奥浦迈	2,309,617.51	9.63
151	601229	上海银行	2,305,702.00	9.62
152	300535	达威股份	2,299,955.00	9.59

153	603801	志邦家居	2,289,154.00	9.55
154	002839	张家港行	2,286,029.00	9.54
155	002311	海大集团	2,278,232.00	9.50
156	600177	雅戈尔	2,276,175.00	9.49
157	688033	天宜新材	2,260,846.28	9.43
158	600873	梅花生物	2,258,872.00	9.42
159	301004	嘉益股份	2,253,932.80	9.40
160	603156	养元饮品	2,236,147.76	9.33
161	600522	中天科技	2,233,266.00	9.32
162	600461	洪城环境	2,232,046.00	9.31
163	688326	经纬恒润	2,228,362.33	9.30
164	603871	嘉友国际	2,225,513.38	9.28
165	600017	日照港	2,224,454.50	9.28
166	603277	银都股份	2,216,914.00	9.25
167	301098	金埔园林	2,212,877.00	9.23
168	301200	大族数控	2,203,495.00	9.19
169	601128	常熟银行	2,198,760.00	9.17
170	002991	甘源食品	2,198,219.00	9.17
171	000885	城发环境	2,184,309.00	9.11
172	002381	双箭股份	2,182,293.00	9.10
173	600512	腾达建设	2,178,956.00	9.09
174	600741	华域汽车	2,175,504.00	9.07
175	300852	四会富仕	2,170,571.00	9.05
176	002487	大金重工	2,165,994.00	9.04
177	688201	信安世纪	2,161,696.20	9.02
178	688507	索辰科技	2,151,283.36	8.97
179	000498	山东路桥	2,148,873.00	8.96
180	002352	顺丰控股	2,138,158.00	8.92
181	601567	三星医疗	2,134,678.00	8.90
182	002170	芭田股份	2,131,698.00	8.89
183	601939	建设银行	2,130,579.00	8.89
184	000987	越秀资本	2,129,707.00	8.88
185	601169	北京银行	2,128,495.00	8.88
186	002616	长青集团	2,128,196.16	8.88
187	300979	华利集团	2,124,575.00	8.86
188	600875	东方电气	2,122,533.00	8.85
189	600782	新钢股份	2,119,508.00	8.84
190	601928	凤凰传媒	2,117,621.72	8.83
191	603737	三棵树	2,111,162.00	8.81
192	688612	威迈斯	2,110,269.89	8.80
193	605098	行动教育	2,106,402.00	8.79

194	600930	华电新能	2,104,618.00	8.78
195	000951	中国重汽	2,095,047.20	8.74
196	300888	稳健医疗	2,094,089.60	8.74
197	688222	成都先导	2,092,395.84	8.73
198	688472	阿特斯	2,092,312.14	8.73
199	300119	瑞普生物	2,090,578.00	8.72
200	002818	富森美	2,079,940.00	8.68
201	688560	明冠新材	2,074,334.99	8.65
202	300801	泰和科技	2,070,263.00	8.64
203	002056	横店东磁	2,067,425.00	8.62
204	000950	重药控股	2,067,163.00	8.62
205	600273	嘉化能源	2,061,565.00	8.60
206	600927	永安期货	2,060,750.00	8.60
207	601598	中国外运	2,052,345.00	8.56
208	600750	华润江中	2,047,507.00	8.54
209	600196	复星医药	2,037,301.96	8.50
210	603008	喜临门	2,036,702.00	8.50
211	688167	炬光科技	2,031,904.34	8.48
212	600028	中国石化	2,028,184.00	8.46
213	600900	长江电力	2,025,680.00	8.45
214	600356	恒丰纸业	2,023,135.00	8.44
215	002454	松芝股份	2,021,204.12	8.43
216	301603	乔锋智能	2,013,255.00	8.40
217	600248	陕建股份	2,007,753.00	8.38
218	601083	锦江航运	1,999,392.00	8.34
219	688121	卓然股份	1,996,340.41	8.33
220	600863	华能蒙电	1,994,770.00	8.32
221	601991	大唐发电	1,993,431.00	8.32
222	002829	星网宇达	1,992,266.00	8.31
223	000882	华联股份	1,990,697.00	8.30
224	600216	浙江医药	1,987,610.00	8.29
225	688329	艾隆科技	1,987,301.65	8.29
226	000893	亚钾国际	1,987,235.00	8.29
227	002518	科士达	1,984,367.00	8.28
228	301308	江波龙	1,982,377.00	8.27
229	603600	永艺股份	1,981,655.00	8.27
230	601058	赛轮轮胎	1,981,515.96	8.27
231	002133	广宇集团	1,975,461.00	8.24
232	605117	德业股份	1,973,200.00	8.23
233	000521	长虹美菱	1,971,260.00	8.22
234	002993	奥海科技	1,970,460.00	8.22

235	600728	佳都科技	1,969,726.00	8.22
236	600076	康欣新材	1,959,316.00	8.17
237	603081	大丰实业	1,953,760.00	8.15
238	000333	美的集团	1,948,073.00	8.13
239	002015	协鑫能科	1,944,234.00	8.11
240	603096	新经典	1,941,329.84	8.10
241	601577	长沙银行	1,935,885.00	8.08
242	603086	先达股份	1,934,516.00	8.07
243	000921	海信家电	1,933,704.00	8.07
244	688345	博力威	1,933,100.24	8.06
245	600212	绿能慧充	1,928,551.00	8.04
246	002956	西麦食品	1,928,520.20	8.04
247	603529	爱玛科技	1,916,161.00	7.99
248	000932	华菱钢铁	1,915,178.00	7.99
249	003022	联泓新科	1,907,584.00	7.96
250	002061	浙江交科	1,904,013.00	7.94
251	600549	厦门钨业	1,895,877.00	7.91
252	603129	春风动力	1,888,074.00	7.88
253	600269	赣粤高速	1,884,593.00	7.86
254	603948	建业股份	1,881,239.55	7.85
255	603919	金徽酒	1,878,725.00	7.84
256	603380	易德龙	1,878,676.00	7.84
257	601211	国泰海通	1,877,564.00	7.83
258	002511	中顺洁柔	1,875,949.86	7.83
259	605158	华达新材	1,873,650.00	7.82
260	002261	拓维信息	1,859,501.00	7.76
261	600587	新华医疗	1,856,595.00	7.74
262	002393	力生制药	1,855,085.40	7.74
263	688382	益方生物	1,848,967.64	7.71
264	300476	胜宏科技	1,848,058.00	7.71
265	688536	思瑞浦	1,846,913.60	7.70
266	301377	鼎泰高科	1,838,203.00	7.67
267	603365	水星家纺	1,837,537.00	7.67
268	601500	通用股份	1,832,956.00	7.65
269	301095	广立微	1,831,615.00	7.64
270	601328	交通银行	1,831,559.00	7.64
271	600079	ST 人福	1,831,337.00	7.64
272	003010	若羽臣	1,817,892.20	7.58
273	002083	孚日股份	1,814,607.00	7.57
274	601898	中煤能源	1,814,398.00	7.57
275	301150	中一科技	1,803,766.00	7.52

276	688372	伟测科技	1,800,907.27	7.51
277	002029	七匹狼	1,794,330.00	7.48
278	001308	康冠科技	1,787,141.50	7.45
279	001914	招商积余	1,785,100.00	7.45
280	603682	锦和商管	1,781,962.00	7.43
281	603300	海南华铁	1,773,766.00	7.40
282	600681	百川能源	1,771,964.00	7.39
283	688093	世华科技	1,771,561.18	7.39
284	002851	麦格米特	1,766,974.00	7.37
285	301396	宏景科技	1,764,862.00	7.36
286	601886	江河集团	1,758,163.00	7.33
287	688501	青达环保	1,756,556.43	7.33
288	300548	长芯博创	1,754,700.90	7.32
289	688021	奥福科技	1,749,782.58	7.30
290	600118	中国卫星	1,748,172.00	7.29
291	001313	粤海饲料	1,748,036.00	7.29
292	002100	天康生物	1,743,623.00	7.27
293	301613	新铝时代	1,738,978.00	7.25
294	600203	福日电子	1,737,193.00	7.25
295	002384	东山精密	1,736,764.00	7.24
296	002303	美盈森	1,735,704.00	7.24
297	603551	奥普科技	1,727,613.00	7.21
298	603165	荣晟环保	1,727,446.00	7.21
299	601963	重庆银行	1,725,378.87	7.20
300	688206	概伦电子	1,724,223.01	7.19
301	600067	冠城新材	1,721,583.00	7.18
302	688002	睿创微纳	1,720,019.56	7.17
303	600761	安徽合力	1,711,537.00	7.14
304	688017	绿的谐波	1,709,361.47	7.13
305	601811	新华文轩	1,708,678.00	7.13
306	600179	安通控股	1,702,202.00	7.10
307	002293	罗莱生活	1,700,460.60	7.09
308	600926	杭州银行	1,698,400.00	7.08
309	603239	浙江仙通	1,696,210.00	7.08
310	000400	许继电气	1,693,978.00	7.07
311	002831	裕同科技	1,692,419.00	7.06
312	002032	苏泊尔	1,690,497.00	7.05
313	601288	农业银行	1,688,383.00	7.04
314	601988	中国银行	1,687,017.00	7.04
315	601187	厦门银行	1,685,499.00	7.03
316	603730	岱美股份	1,684,395.20	7.03

317	603368	柳药集团	1,684,247.00	7.03
318	603112	华翔股份	1,679,601.00	7.01
319	002815	崇达技术	1,678,299.00	7.00
320	603486	科沃斯	1,677,999.00	7.00
321	301056	森赫股份	1,677,970.00	7.00
322	688067	爱威科技	1,674,494.33	6.98
323	605009	豪悦护理	1,667,940.60	6.96
324	600874	创业环保	1,657,565.00	6.91
325	688065	凯赛生物	1,653,699.57	6.90
326	002128	电投能源	1,652,847.00	6.89
327	000906	浙商中拓	1,652,811.00	6.89
328	300803	指南针	1,651,612.30	6.89
329	688626	翔宇医疗	1,650,858.01	6.89
330	600012	皖通高速	1,650,652.00	6.89
331	300531	优博讯	1,650,183.00	6.88
332	002322	理工能科	1,650,094.19	6.88
333	600642	申能股份	1,649,329.00	6.88
334	600580	卧龙电驱	1,647,530.00	6.87
335	002102	能特科技	1,643,445.00	6.86
336	300068	南都电源	1,640,757.00	6.84
337	600801	华新建材	1,638,507.00	6.83
338	301078	孩子王	1,634,425.00	6.82
339	603797	联泰环保	1,633,485.00	6.81
340	603697	有友食品	1,632,411.00	6.81
341	603699	纽威股份	1,632,072.00	6.81
342	603408	建霖家居	1,631,679.00	6.81
343	002026	山东威达	1,630,799.00	6.80
344	000686	东北证券	1,630,325.00	6.80
345	002327	富安娜	1,628,139.00	6.79
346	300594	朗进科技	1,626,451.00	6.78
347	301103	何氏眼科	1,625,207.00	6.78
348	688629	华丰科技	1,624,108.51	6.77
349	002884	凌霄泵业	1,619,824.00	6.76
350	603700	宁水集团	1,619,438.00	6.76
351	688617	惠泰医疗	1,616,400.58	6.74
352	601619	嘉泽新能	1,614,972.00	6.74
353	601369	陕鼓动力	1,612,040.00	6.72
354	601222	林洋能源	1,608,517.00	6.71
355	001299	美能能源	1,603,643.60	6.69
356	603611	诺力股份	1,603,081.00	6.69
357	002202	金风科技	1,601,120.00	6.68

358	002271	东方雨虹	1,600,148.00	6.67
359	601009	南京银行	1,596,823.00	6.66
360	002600	领益智造	1,594,048.00	6.65
361	688112	鼎阳科技	1,593,813.95	6.65
362	300616	尚品宅配	1,593,415.00	6.65
363	002275	桂林三金	1,586,319.00	6.62
364	603167	渤海轮渡	1,582,821.00	6.60
365	600958	东方证券	1,578,317.00	6.58
366	300453	三鑫医疗	1,577,899.20	6.58
367	002370	亚太药业	1,568,687.00	6.54
368	603282	亚光股份	1,568,163.00	6.54
369	688521	芯原股份	1,567,152.10	6.54
370	000900	现代投资	1,565,618.38	6.53
371	603095	越剑智能	1,564,215.80	6.52
372	002318	久立特材	1,560,699.00	6.51
373	600048	保利发展	1,558,928.00	6.50
374	600673	东阳光	1,557,977.00	6.50
375	002705	新宝股份	1,557,512.00	6.50
376	688019	安集科技	1,555,621.10	6.49
377	002701	奥瑞金	1,552,452.00	6.48
378	301087	可孚医疗	1,551,143.00	6.47
379	600780	通宝能源	1,550,893.00	6.47
380	002959	小熊电器	1,549,161.00	6.46
381	600502	安徽建工	1,547,664.00	6.46
382	601019	山东出版	1,546,542.00	6.45
383	603393	新天然气	1,545,992.00	6.45
384	000897	津滨发展	1,545,685.00	6.45
385	000419	通程控股	1,543,461.00	6.44
386	002479	富春环保	1,537,838.00	6.41
387	603983	丸美生物	1,536,999.00	6.41
388	600015	华夏银行	1,536,724.00	6.41
389	603689	皖天然气	1,536,191.00	6.41
390	601139	深圳燃气	1,533,203.00	6.40
391	605266	健之佳	1,532,727.00	6.39
392	600406	国电南瑞	1,529,429.65	6.38
393	603897	长城科技	1,527,643.00	6.37
394	601059	信达证券	1,527,467.00	6.37
395	688443	智翔金泰	1,524,959.45	6.36
396	301280	珠城科技	1,522,918.00	6.35
397	002557	洽洽食品	1,520,542.00	6.34
398	002003	伟星股份	1,517,397.00	6.33

399	300481	濮阳惠成	1,513,838.24	6.31
400	601900	南方传媒	1,512,059.00	6.31
401	603758	秦安股份	1,511,175.00	6.30
402	301048	金鹰重工	1,505,341.00	6.28
403	002228	合兴包装	1,505,282.00	6.28
404	301035	润丰股份	1,501,209.00	6.26
405	601677	明泰铝业	1,500,898.00	6.26
406	000758	中色股份	1,500,739.00	6.26
407	603530	神马电力	1,499,578.00	6.26
408	601000	唐山港	1,499,433.00	6.25
409	301206	三元生物	1,499,023.00	6.25
410	000596	古井贡酒	1,497,523.00	6.25
411	300443	金雷股份	1,492,986.00	6.23
412	688200	华峰测控	1,492,881.53	6.23
413	000528	柳工	1,492,415.00	6.23
414	600507	方大特钢	1,490,561.00	6.22
415	601326	秦港股份	1,490,032.00	6.22
416	688187	时代电气	1,489,322.86	6.21
417	000429	粤高速 A	1,488,115.00	6.21
418	000066	中国长城	1,482,182.00	6.18
419	002154	报喜鸟	1,481,560.00	6.18
420	300988	津荣天宇	1,481,322.00	6.18
421	600711	盛屯矿业	1,480,269.00	6.17
422	002340	格林美	1,479,888.00	6.17
423	300442	润泽科技	1,478,766.26	6.17
424	601088	中国神华	1,478,225.00	6.17
425	300945	曼卡龙	1,476,747.00	6.16
426	601636	旗滨集团	1,475,446.82	6.15
427	603898	好莱客	1,473,510.00	6.15
428	688089	嘉必优	1,470,218.07	6.13
429	002968	新大正	1,467,625.00	6.12
430	600993	马应龙	1,463,820.00	6.11
431	301061	匠心家居	1,462,559.20	6.10
432	603605	珀莱雅	1,462,103.00	6.10
433	300677	英科医疗	1,460,704.00	6.09
434	600491	龙元建设	1,452,522.00	6.06
435	600757	长江传媒	1,452,290.00	6.06
436	600060	海信视像	1,449,223.00	6.05
437	600760	中航沈飞	1,446,216.00	6.03
438	300693	盛弘股份	1,442,536.00	6.02
439	001206	依依股份	1,440,333.00	6.01

440	301230	泓博医药	1,439,922.00	6.01
441	002746	仙坛股份	1,439,635.00	6.01
442	601390	中国中铁	1,439,171.00	6.00
443	688819	天能股份	1,438,944.70	6.00
444	000910	大亚圣象	1,438,299.00	6.00
445	002073	软控股份	1,433,932.00	5.98
446	603386	骏亚科技	1,423,340.00	5.94
447	603901	永创智能	1,421,867.00	5.93
448	002344	海宁皮城	1,421,496.00	5.93
449	002895	川恒股份	1,420,448.00	5.93
450	002142	宁波银行	1,417,798.00	5.91
451	002179	中航光电	1,417,018.00	5.91
452	601857	中国石油	1,416,965.00	5.91
453	600022	山东钢铁	1,414,439.00	5.90
454	000048	京基智农	1,414,318.00	5.90
455	601628	中国人寿	1,412,557.00	5.89
456	603218	日月股份	1,409,735.00	5.88
457	600057	厦门象屿	1,406,120.00	5.87
458	002998	优彩资源	1,405,333.00	5.86
459	688009	中国通号	1,405,117.41	5.86
460	002662	峰璟股份	1,405,074.00	5.86
461	002938	鹏鼎控股	1,400,253.00	5.84
462	002891	中宠股份	1,399,731.00	5.84
463	002080	中材科技	1,398,358.00	5.83
464	600063	皖维高新	1,398,031.00	5.83
465	603061	金海通	1,395,110.00	5.82
466	002258	利尔化学	1,394,466.00	5.82
467	000962	东方钽业	1,391,999.00	5.81
468	003008	开普检测	1,391,394.30	5.80
469	600790	轻纺城	1,382,353.00	5.77
470	000913	钱江摩托	1,382,076.00	5.77
471	600266	城建发展	1,380,193.00	5.76
472	600697	欧亚集团	1,380,068.00	5.76
473	688029	南微医学	1,378,886.94	5.75
474	601678	滨化股份	1,375,173.00	5.74
475	688717	艾罗能源	1,375,014.24	5.74
476	600998	九州通	1,374,380.00	5.73
477	601117	中国化学	1,374,034.00	5.73
478	002126	银轮股份	1,373,601.00	5.73
479	002282	博深股份	1,373,189.00	5.73
480	600261	阳光照明	1,372,850.00	5.73

481	301362	民爆光电	1,372,704.00	5.73
482	600051	宁波联合	1,372,686.00	5.73
483	605338	巴比食品	1,371,276.00	5.72
484	688772	珠海冠宇	1,370,611.45	5.72
485	600308	华泰股份	1,370,357.00	5.72
486	300850	新强联	1,369,479.11	5.71
487	300532	今天国际	1,365,616.00	5.70
488	600062	华润双鹤	1,362,870.00	5.69
489	600211	西藏药业	1,362,597.00	5.68
490	002135	东南网架	1,361,080.00	5.68
491	301339	通行宝	1,359,182.00	5.67
492	603538	美诺华	1,359,045.17	5.67
493	300322	硕贝德	1,357,254.00	5.66
494	601179	中国西电	1,356,741.00	5.66
495	603565	中谷物流	1,356,377.00	5.66
496	000529	广弘控股	1,348,422.00	5.62
497	601727	上海电气	1,340,945.00	5.59
498	600938	中国海油	1,339,690.00	5.59
499	002144	宏达高科	1,333,175.00	5.56
500	300779	惠城环保	1,332,926.00	5.56
501	002572	索菲亚	1,332,478.00	5.56
502	001218	丽臣实业	1,332,355.00	5.56
503	603303	得邦照明	1,331,120.00	5.55
504	600733	北汽蓝谷	1,328,937.00	5.54
505	605090	九丰能源	1,328,264.00	5.54
506	600335	国机汽车	1,327,961.00	5.54
507	300775	三角防务	1,326,225.00	5.53
508	002415	海康威视	1,323,558.00	5.52
509	002081	金螳螂	1,322,685.00	5.52
510	603676	卫信康	1,322,562.00	5.52
511	600710	苏美达	1,321,892.00	5.51
512	603326	我乐家居	1,321,383.00	5.51
513	002753	永东股份	1,321,180.00	5.51
514	002585	双星新材	1,318,949.00	5.50
515	000404	长虹华意	1,318,680.00	5.50
516	001316	润贝航科	1,316,807.40	5.49
517	603296	华勤技术	1,316,350.00	5.49
518	600180	瑞茂通	1,313,881.00	5.48
519	601010	文峰股份	1,312,699.00	5.48
520	688166	博瑞医药	1,312,445.60	5.47
521	002811	郑中设计	1,312,091.88	5.47

522	002035	华帝股份	1,309,201.00	5.46
523	001228	永泰运	1,307,123.00	5.45
524	601665	齐鲁银行	1,304,819.00	5.44
525	603406	天富龙	1,304,443.97	5.44
526	000926	福星股份	1,304,365.00	5.44
527	002236	大华股份	1,304,330.00	5.44
528	301291	明阳电气	1,301,562.00	5.43
529	301551	无线传媒	1,301,286.70	5.43
530	603966	法兰泰克	1,300,257.00	5.42
531	688100	威胜信息	1,295,205.25	5.40
532	003006	百亚股份	1,294,491.00	5.40
533	601077	渝农商行	1,291,797.00	5.39
534	688628	优利德	1,288,826.17	5.38
535	600132	重庆啤酒	1,288,712.00	5.38
536	300187	永清环保	1,286,241.00	5.37
537	600816	建元信托	1,285,195.00	5.36
538	300083	创世纪	1,281,772.00	5.35
539	688267	中触媒	1,280,830.27	5.34
540	301376	致欧科技	1,280,550.00	5.34
541	603979	金诚信	1,279,778.00	5.34
542	001323	慕思股份	1,279,494.30	5.34
543	000029	深深房 A	1,276,269.00	5.32
544	000088	盐田港	1,275,560.00	5.32
545	002852	道道全	1,275,212.00	5.32
546	601368	绿城水务	1,274,229.00	5.32
547	600939	重庆建工	1,273,545.00	5.31
548	603833	欧派家居	1,273,456.00	5.31
549	000863	三湘印象	1,272,355.00	5.31
550	300095	华伍股份	1,270,370.00	5.30
551	601199	江南水务	1,270,312.00	5.30
552	002156	通富微电	1,269,970.00	5.30
553	300639	凯普生物	1,269,647.00	5.30
554	002521	齐峰新材	1,269,539.00	5.30
555	300662	科锐国际	1,269,458.00	5.30
556	688070	纵横股份	1,268,885.31	5.29
557	603866	桃李面包	1,266,686.00	5.28
558	002752	昇兴股份	1,261,804.00	5.26
559	301031	中熔电气	1,260,528.00	5.26
560	002595	豪迈科技	1,254,191.00	5.23
561	605599	菜百股份	1,253,638.00	5.23
562	601098	中南传媒	1,252,562.00	5.22

563	000755	山西高速	1,251,585.00	5.22
564	300257	开山股份	1,249,805.00	5.21
565	002346	柘中股份	1,249,268.00	5.21
566	603900	莱绅通灵	1,247,758.00	5.20
567	000850	华茂股份	1,246,996.84	5.20
568	600858	银座股份	1,246,708.00	5.20
569	002375	亚厦股份	1,243,792.00	5.19
570	002022	科华生物	1,242,251.00	5.18
571	300501	海顺新材	1,235,243.00	5.15
572	300857	协创数据	1,235,131.00	5.15
573	002532	天山铝业	1,233,937.00	5.15
574	002004	华邦健康	1,231,698.00	5.14
575	603236	移远通信	1,230,220.00	5.13
576	688073	毕得医药	1,226,030.61	5.11
577	688639	华恒生物	1,224,150.42	5.11
578	002075	沙钢股份	1,223,878.00	5.11
579	601828	美凯龙	1,222,492.71	5.10
580	601996	丰林集团	1,222,170.00	5.10
581	000683	博源化工	1,221,311.00	5.09
582	688117	圣诺生物	1,219,883.22	5.09
583	002966	苏州银行	1,215,446.00	5.07
584	600467	好当家	1,214,932.00	5.07
585	002117	东港股份	1,214,441.00	5.07
586	600027	华电国际	1,214,384.00	5.07
587	300743	天地数码	1,211,944.00	5.06
588	000895	双汇发展	1,210,421.00	5.05
589	000560	我爱我家	1,209,372.00	5.04
590	001368	通达创智	1,208,881.00	5.04
591	603588	高能环境	1,207,583.00	5.04
592	600821	金开新能	1,207,404.00	5.04
593	603899	晨光股份	1,207,143.00	5.04
594	688198	佰仁医疗	1,206,321.63	5.03
595	300912	凯龙高科	1,205,613.00	5.03
596	688213	思特威	1,197,300.73	4.99
597	002237	恒邦股份	1,194,694.00	4.98
598	600839	四川长虹	1,192,674.00	4.98
599	002049	紫光国微	1,190,792.00	4.97
600	300638	广和通	1,188,519.00	4.96
601	000090	天健集团	1,187,068.00	4.95
602	603126	中材节能	1,185,870.00	4.95
603	600007	中国国贸	1,184,734.00	4.94

604	002614	奥佳华	1,183,920.00	4.94
605	301283	聚胶股份	1,182,259.00	4.93
606	601668	中国建筑	1,181,668.00	4.93
607	301187	欧圣电气	1,175,785.00	4.90
608	600188	兖矿能源	1,175,172.00	4.90
609	603799	华友钴业	1,174,512.00	4.90
610	000707	双环科技	1,173,712.45	4.90
611	300717	华信新材	1,172,749.00	4.89
612	600533	栖霞建设	1,171,644.00	4.89
613	000589	贵州轮胎	1,170,660.00	4.88
614	300685	艾德生物	1,168,280.00	4.87
615	603818	曲美家居	1,166,150.00	4.86
616	601366	利群股份	1,165,908.00	4.86
617	603305	旭升集团	1,160,411.00	4.84
618	002833	弘亚数控	1,160,106.00	4.84
619	301043	绿岛风	1,159,946.00	4.84
620	603729	龙韵股份	1,157,644.00	4.83
621	600323	瀚蓝环境	1,156,818.00	4.83
622	301215	中汽股份	1,156,573.22	4.82
623	300405	科隆股份	1,155,978.00	4.82
624	600854	春兰股份	1,155,420.00	4.82
625	002414	高德红外	1,155,070.00	4.82
626	603915	国茂股份	1,153,789.00	4.81
627	000990	诚志股份	1,153,319.00	4.81
628	600350	山东高速	1,151,509.00	4.80
629	600657	信达地产	1,150,786.00	4.80
630	001337	四川黄金	1,149,988.00	4.80
631	600641	先导基电	1,146,956.00	4.78
632	002382	蓝帆医疗	1,146,570.03	4.78
633	000507	珠海港	1,145,022.00	4.78
634	600287	苏豪时尚	1,144,674.00	4.77
635	300305	裕兴股份	1,144,425.00	4.77
636	002574	明牌珠宝	1,143,095.00	4.77
637	002632	道明光学	1,139,592.00	4.75
638	603018	华设集团	1,138,847.00	4.75
639	002690	美亚光电	1,138,472.00	4.75
640	000059	华锦股份	1,137,674.00	4.75
641	300664	鹏鹞环保	1,136,095.00	4.74
642	600258	首旅酒店	1,132,852.00	4.73
643	688097	博众精工	1,132,413.58	4.72
644	688606	奥泰生物	1,131,326.41	4.72

645	301365	矩阵股份	1,130,060.00	4.71
646	000785	居然智家	1,127,808.00	4.70
647	002146	荣盛发展	1,127,628.00	4.70
648	605296	神农集团	1,127,291.00	4.70
649	002984	森麒麟	1,126,944.50	4.70
650	603556	海兴电力	1,125,722.00	4.70
651	603207	小方制药	1,124,274.00	4.69
652	600888	新疆众和	1,123,661.00	4.69
653	002772	众兴菌业	1,123,406.00	4.69
654	003041	真爱美家	1,122,602.60	4.68
655	600776	东方通信	1,122,408.00	4.68
656	301231	荣信文化	1,119,553.00	4.67
657	605122	四方新材	1,118,273.00	4.66
658	603012	创力集团	1,117,489.00	4.66
659	000938	紫光股份	1,117,281.00	4.66
660	300456	赛微电子	1,117,177.00	4.66
661	603858	步长制药	1,116,504.00	4.66
662	000672	上峰水泥	1,115,847.00	4.65
663	601985	中国核电	1,111,745.00	4.64
664	600298	安琪酵母	1,108,288.00	4.62
665	601778	晶科科技	1,108,156.00	4.62
666	000733	振华科技	1,107,777.00	4.62
667	601916	浙商银行	1,107,416.00	4.62
668	600446	金证股份	1,107,115.00	4.62
669	600716	凤凰股份	1,106,952.00	4.62
670	603385	惠达卫浴	1,106,146.00	4.61
671	002191	劲嘉股份	1,105,483.00	4.61
672	000783	长江证券	1,105,030.00	4.61
673	600511	国药股份	1,103,137.00	4.60
674	300349	金卡智能	1,102,289.00	4.60
675	603939	益丰药房	1,102,016.00	4.60
676	001268	联合精密	1,102,000.00	4.60
677	600643	爱建集团	1,100,813.00	4.59
678	688183	生益电子	1,099,559.00	4.59
679	605208	永茂泰	1,099,035.00	4.58
680	688075	安旭生物	1,098,351.50	4.58
681	003027	同兴科技	1,097,954.00	4.58
682	002138	顺络电子	1,097,401.00	4.58
683	000338	潍柴动力	1,096,336.00	4.57
684	688550	瑞联新材	1,094,947.49	4.57
685	603648	畅联股份	1,094,167.00	4.56

686	002573	清新环境	1,093,570.00	4.56
687	603980	吉华集团	1,092,053.80	4.56
688	000975	山金国际	1,091,223.00	4.55
689	002001	新和成	1,090,332.00	4.55
690	002349	精华制药	1,089,866.00	4.55
691	601600	中国铝业	1,089,692.00	4.55
692	601633	长城汽车	1,089,009.00	4.54
693	002978	安宁股份	1,087,130.00	4.53
694	688298	东方生物	1,087,029.97	4.53
695	688350	富淼科技	1,087,029.82	4.53
696	002107	沃华医药	1,086,887.80	4.53
697	601588	北辰实业	1,086,641.00	4.53
698	600755	厦门国贸	1,086,176.00	4.53
699	603458	勘设股份	1,084,835.00	4.53
700	600585	海螺水泥	1,084,707.00	4.52
701	603768	常青股份	1,084,079.00	4.52
702	601318	中国平安	1,083,834.00	4.52
703	600157	永泰能源	1,083,243.00	4.52
704	605133	嵘泰股份	1,077,374.00	4.49
705	600153	建发股份	1,076,990.00	4.49
706	600137	浪莎股份	1,076,877.00	4.49
707	601919	中远海控	1,076,319.00	4.49
708	605123	派克新材	1,075,825.00	4.49
709	002492	恒基达鑫	1,071,037.00	4.47
710	002215	诺普信	1,070,199.00	4.46
711	688113	联测科技	1,070,017.13	4.46
712	300417	南华仪器	1,069,509.00	4.46
713	688681	科汇股份	1,068,135.07	4.46
714	002404	嘉欣丝绸	1,066,943.00	4.45
715	600325	华发股份	1,063,887.00	4.44
716	301300	远翔新材	1,063,454.00	4.44
717	000717	中南股份	1,063,180.00	4.43
718	002222	福晶科技	1,062,423.00	4.43
719	688296	和达科技	1,061,607.80	4.43
720	000822	山东海化	1,061,209.00	4.43
721	600210	紫江企业	1,060,011.00	4.42
722	601319	中国人保	1,058,877.00	4.42
723	002560	通达股份	1,055,390.00	4.40
724	000061	农产品	1,055,158.00	4.40
725	001328	登康口腔	1,055,083.00	4.40
726	301077	星华新材	1,053,652.00	4.40

727	600612	老凤祥	1,053,307.00	4.39
728	688659	元琛科技	1,052,074.98	4.39
729	002533	金杯电工	1,051,708.00	4.39
730	002458	益生股份	1,051,340.00	4.39
731	301273	瑞晨环保	1,047,415.00	4.37
732	600729	重庆百货	1,047,240.00	4.37
733	002763	汇洁股份	1,046,707.00	4.37
734	600415	小商品城	1,046,585.00	4.37
735	603967	中创物流	1,045,301.00	4.36
736	300929	华骐环保	1,044,732.00	4.36
737	000739	普洛药业	1,044,278.00	4.36
738	300190	维尔利	1,044,065.00	4.36
739	601107	四川成渝	1,043,735.00	4.35
740	002653	海思科	1,042,951.00	4.35
741	002664	信质集团	1,042,708.00	4.35
742	603132	金徽股份	1,040,803.00	4.34
743	001210	金房能源	1,040,057.87	4.34
744	605108	同庆楼	1,039,322.00	4.34
745	300649	杭州园林	1,038,880.00	4.33
746	600933	爱柯迪	1,037,604.00	4.33
747	603998	方盛制药	1,037,343.00	4.33
748	688058	宝兰德	1,037,323.19	4.33
749	300886	华业香料	1,034,484.00	4.32
750	600883	博闻科技	1,033,469.00	4.31
751	600847	万里股份	1,032,379.00	4.31
752	688309	恒誉环保	1,031,084.34	4.30
753	000548	湖南投资	1,030,203.00	4.30
754	003035	南网能源	1,030,028.00	4.30
755	300272	开能健康	1,029,589.00	4.29
756	600977	中国电影	1,026,596.00	4.28
757	002174	游族网络	1,025,546.00	4.28
758	301552	科力装备	1,024,734.60	4.27
759	603202	天有为	1,023,673.00	4.27
760	603306	华懋科技	1,023,553.00	4.27
761	601921	浙版传媒	1,023,294.00	4.27
762	688399	硕世生物	1,023,241.38	4.27
763	688565	力源科技	1,022,897.45	4.27
764	688789	宏华数科	1,020,578.09	4.26
765	300138	晨光生物	1,018,363.00	4.25
766	688182	灿勤科技	1,018,025.71	4.25
767	600019	宝钢股份	1,017,135.00	4.24

768	001227	兰州银行	1,014,534.00	4.23
769	689009	九号公司	1,014,447.17	4.23
770	002920	德赛西威	1,013,490.00	4.23
771	001388	信通电子	1,013,442.98	4.23
772	688450	光格科技	1,013,094.37	4.23
773	601595	上海电影	1,011,531.00	4.22
774	603183	建研院	1,008,677.00	4.21
775	600999	招商证券	1,006,381.00	4.20
776	000028	国药一致	1,004,160.00	4.19
777	603929	亚翔集成	1,003,946.00	4.19
778	300641	正丹股份	1,003,287.00	4.19
779	002566	益盛药业	1,002,813.00	4.18
780	000538	云南白药	1,001,758.00	4.18
781	301047	义翘神州	999,018.00	4.17
782	603182	嘉华股份	998,852.00	4.17
783	600732	爱旭股份	997,975.00	4.16
784	603173	福斯达	995,990.00	4.15
785	000795	英洛华	993,950.00	4.15
786	600455	博通股份	993,560.00	4.14
787	600332	白云山	993,338.00	4.14
788	000001	平安银行	989,966.00	4.13
789	601728	中国电信	987,704.00	4.12
790	603017	中衡设计	987,558.00	4.12
791	600563	法拉电子	987,502.00	4.12
792	300491	通合科技	985,217.00	4.11
793	688620	安凯微	984,165.27	4.11
794	300540	蜀道装备	983,922.00	4.10
795	688334	西高院	982,528.00	4.10
796	002011	盾安环境	981,988.00	4.10
797	002043	兔宝宝	980,800.00	4.09
798	000408	藏格矿业	980,793.00	4.09
799	605001	威奥股份	980,181.00	4.09
800	600016	民生银行	979,538.00	4.09
801	301063	海锅股份	978,848.00	4.08
802	002847	盐津铺子	975,879.75	4.07
803	300994	久祺股份	974,024.00	4.06
804	002727	一心堂	970,994.00	4.05
805	600095	湘财股份	970,927.00	4.05
806	600623	华谊集团	970,829.00	4.05
807	601333	广深铁路	967,213.00	4.03
808	603309	维力医疗	965,414.00	4.03

809	688678	福立旺	959,623.94	4.00
810	301223	中荣股份	958,265.00	4.00
811	000786	北新建材	957,127.00	3.99
812	301207	华兰疫苗	956,676.00	3.99
813	600866	星湖科技	956,298.00	3.99
814	688279	峰昭科技	956,273.96	3.99
815	688408	中信博	955,995.36	3.99
816	600064	南京高科	955,884.00	3.99
817	301345	涛涛车业	954,598.00	3.98
818	001289	龙源电力	952,864.00	3.97
819	603006	黎明股份	951,533.00	3.97
820	603661	恒林股份	950,290.00	3.96
821	601799	星宇股份	949,608.00	3.96
822	600499	科达制造	949,366.00	3.96
823	002648	卫星化学	949,267.00	3.96
824	002972	科安达	949,264.00	3.96
825	601918	新集能源	948,604.00	3.96
826	002743	富煌钢构	948,022.00	3.95
827	300001	特锐德	946,899.00	3.95
828	688190	云路股份	945,433.99	3.94
829	601607	上海医药	943,732.00	3.94
830	000156	华数传媒	943,687.00	3.94
831	002204	大连重工	941,591.00	3.93
832	001207	联科科技	940,879.00	3.92
833	002301	齐心集团	940,451.00	3.92
834	603859	能科科技	937,566.00	3.91
835	300219	鸿利智汇	936,104.00	3.90
836	000534	万泽股份	935,788.00	3.90
837	605056	咸亨国际	935,666.00	3.90
838	600795	国电电力	934,950.00	3.90
839	002430	杭氧股份	934,919.00	3.90
840	002151	北斗星通	934,030.00	3.90
841	000807	云铝股份	933,955.00	3.90
842	600600	青岛啤酒	930,966.00	3.88
843	601016	节能风电	930,208.00	3.88
844	600633	浙数文化	928,370.00	3.87
845	001301	尚太科技	927,080.00	3.87
846	002603	以岭药业	925,666.00	3.86
847	000155	川能动力	925,374.00	3.86
848	300867	圣元环保	924,582.00	3.86
849	600031	三一重工	924,190.00	3.86

850	003000	劲仔食品	924,158.00	3.86
851	002223	鱼跃医疗	921,510.00	3.84
852	600736	苏州高新	918,644.00	3.83
853	688676	金盘科技	917,498.64	3.83
854	603569	长久物流	917,103.00	3.83
855	300504	天邑股份	916,335.00	3.82
856	600050	中国联通	916,188.00	3.82
857	603629	利通电子	916,032.00	3.82
858	688036	传音控股	915,928.20	3.82
859	600718	东软集团	915,820.17	3.82
860	002714	牧原股份	915,805.00	3.82
861	603045	福达合金	915,798.00	3.82
862	601006	大秦铁路	914,277.00	3.81
863	300199	翰宇药业	913,768.12	3.81
864	600398	海澜之家	913,017.00	3.81
865	688235	百济神州	910,732.21	3.80
866	002666	德联集团	910,283.00	3.80
867	000582	北部湾港	910,278.00	3.80
868	002007	华兰生物	910,130.00	3.80
869	603708	家家悦	908,840.00	3.79
870	601168	西部矿业	906,979.00	3.78
871	002332	仙琚制药	905,966.00	3.78
872	688016	心脉医疗	905,805.56	3.78
873	605058	澳弘电子	905,391.00	3.78
874	603587	地素时尚	902,729.00	3.77
875	300498	温氏股份	902,264.00	3.76
876	605337	李子园	901,280.00	3.76
877	603566	普莱柯	901,261.00	3.76
878	600717	天津港	901,229.92	3.76
879	600150	中国船舶	900,270.35	3.76
880	000652	泰达股份	899,639.00	3.75
881	000963	华东医药	898,250.00	3.75
882	000402	金融街	897,490.00	3.74
883	603199	九华旅游	895,457.28	3.74
884	688061	灿瑞科技	891,486.44	3.72
885	300140	节能环保	891,408.00	3.72
886	600483	福能股份	890,084.00	3.71
887	600020	中原高速	890,010.00	3.71
888	002928	华夏航空	888,548.00	3.71
889	300470	中密控股	887,542.00	3.70
890	002449	国星光电	887,330.00	3.70

891	600128	苏豪弘业	886,089.00	3.70
892	002109	兴化股份	882,652.00	3.68
893	603416	信捷电气	880,557.00	3.67
894	300034	钢研高纳	880,404.00	3.67
895	603678	火炬电子	878,365.00	3.66
896	603680	今创集团	877,117.00	3.66
897	300733	西菱动力	876,960.00	3.66
898	600576	祥源文旅	875,026.00	3.65
899	600784	鲁银投资	873,605.00	3.64
900	301395	仁信新材	872,836.00	3.64
901	688459	哈铁科技	870,893.73	3.63
902	002262	恩华药业	870,458.00	3.63
903	600235	民丰特纸	870,345.00	3.63
904	002624	完美世界	869,454.00	3.63
905	601512	中新集团	869,089.00	3.63
906	600802	福建水泥	868,398.00	3.62
907	603111	康尼机电	868,262.00	3.62
908	688533	上声电子	867,870.82	3.62
909	300008	天海防务	867,857.00	3.62
910	601200	上海环境	867,697.30	3.62
911	000933	神火股份	866,837.00	3.62
912	600861	北京人力	866,091.00	3.61
913	600864	哈投股份	865,732.00	3.61
914	603757	大元泵业	864,572.00	3.61
915	000159	国际实业	863,896.00	3.60
916	002552	宝鼎科技	863,728.00	3.60
917	601965	中国汽研	861,690.00	3.59
918	002078	太阳纸业	861,303.00	3.59
919	688638	誉辰智能	861,218.80	3.59
920	600601	方正科技	861,120.00	3.59
921	300363	博腾股份	860,735.00	3.59
922	300230	永利股份	860,477.00	3.59
923	600448	华纺股份	858,539.00	3.58
924	300599	雄塑科技	856,278.00	3.57
925	002148	北纬科技	855,929.00	3.57
926	688301	奕瑞科技	853,060.03	3.56
927	002551	尚荣医疗	850,517.00	3.55
928	002422	科伦药业	848,772.00	3.54
929	002809	红墙股份	848,098.00	3.54
930	600594	益佰制药	847,761.00	3.54
931	002010	传化智联	846,455.00	3.53

932	605088	冠盛股份	845,326.00	3.53
933	603055	台华新材	844,981.00	3.52
934	000779	甘咨询	844,263.00	3.52
935	688333	铂力特	843,321.01	3.52
936	603041	美思德	842,061.00	3.51
937	600638	新黄浦	841,203.00	3.51
938	300226	上海钢联	839,543.00	3.50
939	601881	中国银河	839,008.00	3.50
940	301162	国能日新	838,689.00	3.50
941	001216	华瓷股份	837,898.00	3.50
942	002661	克明食品	836,721.00	3.49
943	603217	元利科技	834,723.00	3.48
944	600315	上海家化	833,518.00	3.48
945	600928	西安银行	832,369.00	3.47
946	601615	明阳智能	832,110.00	3.47
947	000605	渤海股份	829,913.00	3.46
948	603968	醋化股份	827,512.00	3.45
949	600303	曙光股份	827,018.00	3.45
950	301175	中科环保	825,970.00	3.45
951	000958	电投产融	825,911.00	3.45
952	002452	长高电新	825,432.00	3.44
953	600496	精工钢构	823,468.00	3.43
954	301115	联检科技	822,906.00	3.43
955	301498	乖宝宠物	822,485.00	3.43
956	600547	山东黄金	820,792.00	3.42
957	605177	东亚药业	820,168.00	3.42
958	688768	容知日新	816,271.15	3.40
959	300910	瑞丰新材	814,280.00	3.40
960	002946	新乳业	812,118.00	3.39
961	603589	口子窖	809,052.00	3.37
962	002184	海得控制	807,204.00	3.37
963	603215	比依股份	807,073.00	3.37
964	301313	凡拓数创	802,980.00	3.35
965	002402	和而泰	802,590.00	3.35
966	600276	恒瑞医药	801,751.00	3.34
967	603808	歌力思	801,691.00	3.34
968	300873	海晨股份	801,498.00	3.34
969	002538	司尔特	798,795.00	3.33
970	600882	妙可蓝多	798,066.00	3.33
971	603301	振德医疗	793,937.00	3.31
972	002357	富临运业	793,682.00	3.31

973	688257	新锐股份	792,987.32	3.31
974	605598	上海港湾	792,818.00	3.31
975	600973	宝胜股份	792,812.00	3.31
976	000563	陕国投 A	792,506.00	3.31
977	000978	桂林旅游	790,327.90	3.30
978	300607	拓斯达	790,041.00	3.30
979	000301	东方盛虹	788,278.00	3.29
980	300863	卡倍亿	786,610.80	3.28
981	002773	康弘药业	784,465.00	3.27
982	688091	上海谊众	784,344.82	3.27
983	300263	隆华科技	784,119.00	3.27
984	300612	宣亚国际	783,442.00	3.27
985	002659	凯文教育	782,883.00	3.27
986	002562	兄弟科技	780,229.00	3.25
987	000517	荣安地产	779,435.00	3.25
988	300627	华测导航	777,950.00	3.25
989	603266	天龙股份	777,927.00	3.25
990	002461	珠江啤酒	777,484.00	3.24
991	688321	微芯生物	776,759.75	3.24
992	600618	氯碱化工	774,563.00	3.23
993	600662	外服控股	772,363.00	3.22
994	688778	厦钨新能	771,445.48	3.22
995	603238	诺邦股份	767,777.00	3.20
996	002948	青岛银行	767,135.00	3.20
997	603337	杰克科技	766,925.00	3.20
998	002345	潮宏基	766,026.00	3.20
999	603035	常熟汽饰	764,425.00	3.19
1,000	688488	艾迪药业	763,784.97	3.19
1,001	600237	铜峰电子	762,043.00	3.18
1,002	601226	华电科工	761,693.00	3.18
1,003	603115	海星股份	759,501.00	3.17
1,004	000600	建投能源	759,234.00	3.17
1,005	002063	远光软件	758,522.00	3.16
1,006	603102	百合股份	756,947.00	3.16
1,007	600959	江苏有线	756,466.00	3.16
1,008	301033	迈普医学	756,173.00	3.15
1,009	002516	旷达科技	755,687.00	3.15
1,010	300622	博士眼镜	755,607.00	3.15
1,011	688286	敏芯股份	753,623.66	3.14
1,012	600517	国网英大	749,334.00	3.13
1,013	605118	力鼎光电	747,910.00	3.12

1,014	688391	钜泉科技	746,487.08	3.11
1,015	301235	华康洁净	745,367.00	3.11
1,016	000035	中国天楹	743,704.00	3.10
1,017	300661	圣邦股份	741,579.00	3.09
1,018	688295	中复神鹰	740,951.25	3.09
1,019	688618	三旺通信	740,609.63	3.09
1,020	600771	广誉远	738,644.90	3.08
1,021	688310	迈得医疗	734,548.70	3.06
1,022	002025	航天电器	734,113.00	3.06
1,023	002745	木林森	733,866.00	3.06
1,024	600528	中铁工业	733,777.00	3.06
1,025	600392	盛和资源	733,400.00	3.06
1,026	300986	志特新材	732,902.00	3.06
1,027	605020	永和股份	730,983.00	3.05
1,028	300996	普联软件	730,914.00	3.05
1,029	300835	龙磁科技	728,819.10	3.04
1,030	002688	金河生物	728,575.00	3.04
1,031	003033	征和工业	726,825.00	3.03
1,032	601601	中国太保	726,181.00	3.03
1,033	600163	中闽能源	724,881.00	3.02
1,034	002697	红旗连锁	724,666.00	3.02
1,035	688615	合合信息	722,598.77	3.01
1,036	600029	南方航空	719,786.00	3.00
1,037	300761	立华股份	719,621.00	3.00
1,038	603379	三美股份	717,358.00	2.99
1,039	301196	唯科科技	717,028.00	2.99
1,040	603197	保隆科技	708,638.00	2.96
1,041	300072	海新能科	707,502.00	2.95
1,042	301003	江苏博云	707,417.00	2.95
1,043	688015	交控科技	706,287.39	2.95
1,044	002558	巨人网络	706,256.00	2.95
1,045	002225	濮耐股份	704,914.00	2.94
1,046	300389	艾比森	704,804.00	2.94
1,047	001322	箭牌家居	703,020.00	2.93
1,048	601609	金田股份	702,322.00	2.93
1,049	300631	久吾高科	701,927.00	2.93
1,050	600109	国金证券	700,412.00	2.92
1,051	600583	海油工程	698,677.00	2.91
1,052	600351	亚宝药业	692,934.00	2.89
1,053	002597	金禾实业	690,181.00	2.88
1,054	600234	科新发展	687,966.00	2.87

1,055	601865	福莱特	685,898.00	2.86
1,056	605305	中际联合	683,757.00	2.85
1,057	002987	京北方	681,798.00	2.84
1,058	605028	世茂能源	681,658.00	2.84
1,059	600316	洪都航空	679,948.00	2.84
1,060	600036	招商银行	678,887.00	2.83
1,061	688128	中国电研	676,972.39	2.82
1,062	301488	豪恩汽电	676,928.00	2.82
1,063	300559	佳发教育	676,315.00	2.82
1,064	600312	平高电气	674,176.00	2.81
1,065	603322	超讯通信	671,895.00	2.80
1,066	603889	新澳股份	670,703.00	2.80
1,067	301113	雅艺科技	668,700.40	2.79
1,068	600459	贵研铂业	667,163.00	2.78
1,069	300236	上海新阳	666,568.00	2.78
1,070	688385	复旦微电	664,481.76	2.77
1,071	002911	佛燃能源	663,847.00	2.77
1,072	688621	阳光诺和	663,431.75	2.77
1,073	002153	石基信息	661,567.00	2.76
1,074	688506	百利天恒	657,814.97	2.74
1,075	688795	摩尔线程	656,275.00	2.74
1,076	688261	东微半导	652,519.95	2.72
1,077	002863	今飞凯达	651,117.00	2.72
1,078	301068	大地海洋	646,551.00	2.70
1,079	600754	锦江酒店	646,390.00	2.70
1,080	688498	源杰科技	644,866.12	2.69
1,081	600976	健民集团	643,390.00	2.68
1,082	600919	江苏银行	642,971.00	2.68
1,083	600869	远东股份	639,312.00	2.67
1,084	300970	华绿生物	636,999.00	2.66
1,085	000539	粤电力 A	631,227.00	2.63
1,086	688802	沐曦股份	631,149.72	2.63
1,087	002778	中晟高科	612,749.00	2.56
1,088	002579	中京电子	612,046.00	2.55
1,089	603088	宁波精达	611,513.00	2.55
1,090	000936	华西股份	610,458.00	2.55
1,091	002961	瑞达期货	609,335.00	2.54
1,092	600073	光明肉业	606,430.00	2.53
1,093	300328	宜安科技	602,227.00	2.51
1,094	688809	强一股份	602,162.31	2.51
1,095	603128	华贸物流	598,309.00	2.50

1,096	300643	万通智控	598,215.00	2.50
1,097	605066	天正电气	586,477.00	2.45
1,098	301220	亚香股份	581,534.40	2.43
1,099	002658	雪迪龙	581,012.00	2.42
1,100	688048	长光华芯	574,707.55	2.40
1,101	300019	硅宝科技	574,650.00	2.40
1,102	002594	比亚迪	574,333.00	2.40
1,103	603317	天味食品	573,784.00	2.39
1,104	002294	信立泰	568,002.00	2.37
1,105	300815	玉禾田	561,346.00	2.34
1,106	000823	超声电子	556,300.00	2.32
1,107	603886	元祖股份	553,691.00	2.31
1,108	688138	清溢光电	544,843.22	2.27
1,109	601163	三角轮胎	542,236.70	2.26
1,110	603606	东方电缆	532,028.00	2.22
1,111	300596	利安隆	532,005.00	2.22
1,112	000550	江铃汽车	531,963.00	2.22
1,113	003020	立方制药	526,248.00	2.20
1,114	688122	西部超导	523,350.38	2.18
1,115	603567	珍宝岛	522,156.00	2.18
1,116	600428	中远海特	520,327.00	2.17
1,117	002976	瑞玛精密	519,883.00	2.17
1,118	002590	万安科技	518,456.00	2.16
1,119	601818	光大银行	518,121.00	2.16
1,120	600737	中粮糖业	512,108.00	2.14
1,121	601688	华泰证券	509,870.00	2.13
1,122	300388	节能国祯	509,599.00	2.13
1,123	600817	宇通重工	507,737.00	2.12
1,124	002478	常宝股份	507,437.00	2.12
1,125	301132	满坤科技	506,726.00	2.11
1,126	688516	奥特维	506,335.83	2.11
1,127	600131	国网信通	504,814.00	2.11
1,128	688107	安路科技	503,752.14	2.10
1,129	603707	健友股份	501,030.00	2.09
1,130	300737	科顺股份	499,688.00	2.08
1,131	600905	三峡能源	499,230.00	2.08
1,132	600833	第一医药	498,592.00	2.08
1,133	603658	安图生物	497,180.00	2.07
1,134	688232	新点软件	496,441.57	2.07
1,135	002587	奥拓电子	495,940.00	2.07
1,136	002483	润邦股份	494,438.00	2.06

1,137	600460	士兰微	494,407.00	2.06
1,138	688379	华光新材	493,792.29	2.06
1,139	002802	洪汇新材	493,493.10	2.06
1,140	300990	同飞股份	493,392.00	2.06
1,141	002130	沃尔核材	492,110.00	2.05
1,142	002540	亚太科技	484,994.00	2.02
1,143	002139	拓邦股份	482,264.00	2.01
1,144	600106	重庆路桥	482,147.00	2.01
1,145	300545	联得装备	481,683.00	2.01
1,146	301248	杰创智能	480,322.00	2.00

注：卖出金额按成交金额(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	2,071,618,040.94
卖出股票收入（成交）总额	1,860,160,667.52

注：买入股票成本和卖出股票收入按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	75,553,627.31	6.15
2	央行票据	-	-
3	金融债券	686,010,430.97	55.80
	其中：政策性金融债	217,579,959.74	17.70
4	企业债券	2,060,235.02	0.17
5	企业短期融资券	70,095,078.91	5.70
6	中期票据	171,849,258.08	13.98
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	20,201,035.62	1.64
10	合计	1,025,769,665.91	83.44

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	240210	24 国开 10	700,000	72,971,643.84	5.94
2	250208	25 国开 08	500,000	49,991,136.99	4.07
3	230202	23 国开 02	400,000	41,023,616.44	3.34

4	200205	20 国开 05	300,000	32,309,416.44	2.63
5	2228041	22 农业银行二级 01	300,000	31,274,087.67	2.54

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

### 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末投资国债期货。

### 8.12 投资组合报告附注

#### 8.12.1 基金投资前十名证券的发行主体本期被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚说明

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国农业银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局的行政处罚，中国光大银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局、国家外汇管理局北京市分局的行政处罚，成都银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局四川监管局的行政处罚。本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规、基金合同及公司投资制度的要求。

截至本报告期末，其余证券的发行主体没有出现被监管部门立案调查的情形，也没有出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

#### 8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定备选库之外的股票。

#### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	154,009.75

2	应收清算款	9,670,554.54
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	285,396.57
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,109,960.86

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，投资组合报告中分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
诺安鼎利混合 A	1,623	241,172.66	7,256.66	0.00%	391,415,970.22	100.00%
诺安鼎利混合 C	3,658	50,596.92	17,318,635.49	9.36%	167,764,890.64	90.64%
诺安鼎利混合 D	452	743,140.90	-	-	335,899,688.28	100.00%
合计	5,733	159,149.91	17,325,892.15	1.90%	895,080,549.14	98.10%

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

2、户均持有的基金份额合计=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

### 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	诺安鼎利混合 A	243,181.78	0.0621%
	诺安鼎利混合 C	888.11	0.0005%
	诺安鼎利混合 D	9.21	0.0000%
	合计	244,079.10	0.0268%

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

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	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	诺安鼎利混合 A	0
	诺安鼎利混合 C	0
	诺安鼎利混合 D	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	诺安鼎利混合 A	10~50
	诺安鼎利混合 C	0
	诺安鼎利混合 D	0
	合计	10~50

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	诺安鼎利混合 A	诺安鼎利混合 C	诺安鼎利混合 D
基金合同生效日（2019 年 03 月 28 日）基金份额总额	171,722,863.16	150,621,902.60	-
本报告期期初基金份额总额	6,852,374.67	12,231,840.89	-
本报告期基金总申购份额	447,385,445.74	680,868,513.00	420,565,147.57
减：本报告期基金总赎回份额	62,814,593.53	508,016,827.76	84,665,459.29
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	391,423,226.88	185,083,526.13	335,899,688.28

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会，没有基金份额持有人大会决议。

## 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

本报告期内，本基金管理人重大人事变动情况如下：

王蓓女士担任公司董事，王学明先生不再担任公司董事；高蔚卿先生、王斌先生担任公司独立董事，汤小青先生、史其禄先生不再担任公司独立董事；刘翔先生担任公司副总经理，杨谷先生不再担任公司副总经理。

本报告期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

本报告期内，未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

## 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金的投资策略没有重大改变。

## 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金聘请的会计师事务所没有发生变更。

本报告期应支付给所聘任会计师事务所的审计费为人民币 21,299.79 元。截至本报告期末，该事务所已提供审计服务的连续年限：2 年。

## 11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

### 11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人无受调查或处罚等情况。

### 11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

### 11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内托管人无受调查或处罚等情况。

### 11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

## 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	
德邦证券	1	326,367,535.15	8.30%	145,522.83	12.97%	-
广发证券	1	59,713,677.08	1.52%	26,027.69	2.32%	-
国信证券	1	724,584,930.59	18.44%	69,488.98	6.19%	-
申万宏源证券	1	1,707,038,070.16	43.44%	761,170.95	67.82%	-
首创证券	1	38,569,647.00	0.98%	17,197.44	1.53%	-
中金公司	1	1,073,795,483.61	27.32%	102,979.29	9.18%	-

注：1、本报告期租用证券公司交易单元的变更情况：无

## 2、专用交易单元的选择标准和程序

基金管理人选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的选择标准为：

- (1) 依法取得相关业务资格；
- (2) 信誉良好，财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强；
- (3) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合基金进行证券交易的需要；
- (4) 研究实力较强，有足够数量的专职的高素质研究人员，能为公司提供全面的研究支持和信息服务；
- (5) 能根据基金投资的特定要求，提供个性化的研究服务；

基金管理人根据以上标准进行充分评估后，选定证券公司，并在完成公司内部审批流程后，与之签订相关协议。

## 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
德邦证券	7,830,365.00	11.29%	43,300,000.00	22.25%	-	-	-	-
广发证券	23,737,114.66	34.24%	79,400,000.00	40.80%	-	-	-	-
国信证券	10,148,816.71	14.64%	1,000,000.00	0.51%	-	-	-	-

申万宏源 证券	26,875,556.00	38.76%	67,900,000.00	34.89%	-	-	-	-
首创证券	665,260.87	0.96%	3,000,000.00	1.54%	-	-	-	-
中金公司	74,474.26	0.11%	-	-	-	-	-	-

## 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	诺安鼎利混合型证券投资基金 2024 年第 4 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 01 月 22 日
2	诺安基金管理有限公司旗下基金 2024 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 01 月 22 日
3	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加云湾基金为销售机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 01 月 22 日
4	诺安鼎利混合型证券投资基金招募说明书（更新）2025 年第 1 期	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 01 月 24 日
5	诺安鼎利混合型证券投资基金招募说明书、基金产品资料概要（更新）的提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 01 月 24 日
6	诺安鼎利混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 01 月 24 日
7	诺安鼎利混合型证券投资基金招募说明书（更新）2025 年第 2 期	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 03 月 17 日
8	诺安鼎利混合型证券投资基金基金合同	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 03 月 17 日
9	诺安鼎利混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 03 月 17 日
10	诺安鼎利混合型证券投资基金托管协议	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 03 月 17 日
11	诺安基金管理有限公司关于诺安鼎利混合型证券投资基金增加基金份额类别并修改基金合同、托管协议等法律文件部分条款的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 03 月 17 日
12	诺安基金管理有限公司关于诺安鼎利混合 D 增加工商银行行为销售机构并开通转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 03 月 28 日
13	诺安基金管理有限公司旗下基金 2024 年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 03 月 31 日
14	诺安鼎利混合型证券投资基金 2024 年年度报告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 03 月 31 日
15	诺安基金管理有限公司关于高级管理人员	中国证监会规定报刊及	2025 年 04 月 19 日

	员变更的公告	网站	日
16	诺安基金管理有限公司旗下基金 2025 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 04 月 22 日
17	诺安鼎利混合型证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 04 月 22 日
18	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加方正证券为销售机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 06 月 19 日
19	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加江苏银行融联创同业交易平台为销售机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 07 月 07 日
20	诺安鼎利混合型证券投资基金 2025 年第 2 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 07 月 21 日
21	诺安基金管理有限公司旗下基金 2025 年第 2 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 07 月 21 日
22	诺安鼎利混合型证券投资基金 2025 年中期报告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 08 月 29 日
23	诺安基金管理有限公司旗下基金 2025 年中期报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 08 月 29 日
24	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加英大证券为销售机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 08 月 29 日
25	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加微众银行为销售机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 10 月 24 日
26	诺安鼎利混合型证券投资基金 2025 年第 3 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 10 月 28 日
27	诺安基金管理有限公司旗下基金 2025 年第 3 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 10 月 28 日
28	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金在工商银行开通定投业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 10 月 30 日
29	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资北交所上市股票及相关风险提示的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 10 月 31 日
30	诺安基金管理有限公司关于终止上海凯石财富基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 12 月 13 日
31	诺安基金管理有限公司关于诺安鼎利混合型证券投资基金风险等级变动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 12 月 26 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	1	20250101-20250401	10,000,000.00	-	-	10,000,000.00	1.10%
产品特有风险							
本报告期内，本基金出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情形，敬请投资者留意可能由此产生的包括但不限于大额赎回可能引发的净值波动风险、基金流动性风险等风险事项。							

注：1、申购份额包含基金申购份额、基金转换入份额、强制调增份额、场内买入份额和红利再投资份额；

2、赎回份额包含基金赎回份额、基金转换出份额、强制调减份额、场内卖出份额。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

(1) 本基金管理人于 2025 年 12 月 26 日披露了《诺安基金管理有限公司关于诺安鼎利混合型证券投资基金风险等级变动的公告》，自 2026 年 1 月 7 日起，本基金风险等级由 R3 调整为 R2。

(2) 自 2025 年 2 月 8 日至 2025 年 4 月 2 日，基金管理人自主承担本基金的信息披露费、审计费等固定费用。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- ① 中国证券监督管理委员会批准诺安鼎利混合型证券投资基金募集的文件。
- ② 《诺安鼎利混合型证券投资基金基金合同》。
- ③ 《诺安鼎利混合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 报告期内诺安鼎利混合型证券投资基金在指定媒介上披露的各项公告。

### 13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

### 13.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可致电本基金管理人全国统一客户服务电话：400-888-8998，亦可至基金管理人网站 [www.lionfund.com.cn](http://www.lionfund.com.cn) 查阅详情。

诺安基金管理有限公司  
2026 年 03 月 31 日