

中欧量化动力混合型证券投资基金 2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：中欧基金管理有限公司

基金托管人：海通证券股份有限公司

送出日期：2024 年 3 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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。

基金托管人海通证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 03 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
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	16
§ 6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
§ 7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	19
7.3 净资产变动表	21
7.4 报表附注	22
§ 8 投资组合报告	60

8.1 期末基金资产组合情况	60
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	60
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	61
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	87
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	99
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	99
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	99
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	99
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	100
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	100
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	100
8.12 投资组合报告附注	100
§ 9 基金份额持有人信息	101
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	101
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	101
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	101
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	102
§ 10 开放式基金份额变动	102
§ 11 重大事件揭示	102
11.1 基金份额持有人大会决议	102
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	102
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	103
11.4 基金投资策略的改变	103
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	103
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	103
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	103
11.8 其他重大事件	104
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	105
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	105
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	105
§ 13 备查文件目录	105
13.1 备查文件目录	105
13.2 存放地点	106
13.3 查阅方式	106

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中欧量化动力混合型证券投资基金	
基金简称	中欧量化动力混合	
基金主代码	015006	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 3 月 2 日	
基金管理人	中欧基金管理有限公司	
基金托管人	海通证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	404,174,523.34 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中欧量化动力混合 A	中欧量化动力混合 C
下属分级基金的交易代码	015006	015007
报告期末下属分级基金的份额总额	193,727,270.60 份	210,447,252.74 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制投资组合风险的前提下，通过量化投资精选股票，力争获得超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金主要采用自上而下分析的方法进行大类资产配置，确定股票、债券、现金等资产的投资比例，重点通过跟踪宏观经济数据（包括 GDP 增长率、工业增加值、PPI、CPI、市场利率变化、进出口贸易数据等）和政策环境的变化趋势，来做前瞻性的战略判断。
业绩比较基准	中证全指指数收益率*80%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*5%+银行活期存款利率（税后）*15%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，其预期风险与预期收益水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。本基金还可投资港股通标的的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	中欧基金管理有限公司	海通证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	黎忆海
	联系电话	021-68609600
	电子邮箱	liyihai@zofund.com
客户服务电话	021-68609700、400-700-9700	95553
传真	021-33830351	021-63410637
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 8 层	上海市广东路 689 号

办公地址	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号上海中心大厦 8、10、16 层	上海市黄浦区中山南路 888 号海通外滩金融广场
邮政编码	200120	200011
法定代表人	窦玉明	周杰

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.zofund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人的办公场所。

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层
注册登记机构	中欧基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号上海中心大厦 8、10、16 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	2023 年		2022 年 3 月 2 日（基金合同生效日）-2022 年 12 月 31 日	
	中欧量化动力混合 A	中欧量化动力混合 C	中欧量化动力混合 A	中欧量化动力混合 C
本期已实现收益	-15,247,090.35	-19,183,471.55	-4,009,289.29	-887,132.46
本期利润	-16,145,437.00	-21,597,087.16	-9,861,014.30	-436,737.16
加权平均基金份额本期利润	-0.0765	-0.0914	-0.0796	-0.0042
本期加权平均净值利润率	-7.97%	-9.63%	-7.74%	-0.42%
本期基金份额净值增长率	-8.86%	-9.40%	-1.85%	-2.35%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末		2022 年末	
期末可供分配利润	-23,932,686.03	-28,032,540.56	-2,943,553.95	-1,268,165.86
期末可供分	-0.1235	-0.1332	-0.0185	-0.0235

配基金份额利润				
期末基金资产净值	169,794,584.57	182,414,712.18	156,171,211.50	52,801,489.26
期末基金份额净值	0.8765	0.8668	0.9815	0.9765
3.1.3 累计期末指标	2023 年末		2022 年末	
基金份额累计净值增长率	-10.55%	-11.53%	-1.85%	-2.35%

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

2、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中欧量化动力混合 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	-3.26%	0.82%	-3.66%	0.70%	0.40%	0.12%
过去六个月	-10.46%	0.84%	-7.75%	0.72%	-2.71%	0.12%
过去一年	-8.86%	0.81%	-6.13%	0.69%	-2.73%	0.12%
自基金合同生效起至今	-10.55%	0.92%	-17.45%	0.92%	6.90%	0.00%

注：本基金业绩比较基准为：中证全指指数收益率*80%+活期存款利率(税后)*15%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*5%。比较基准每个交易日进行一次再平衡，每个交易日在加入损益后根据设定的权重比例进行大类资产之间的再平衡，使大类资产比例保持恒定。

中欧量化动力混合 C

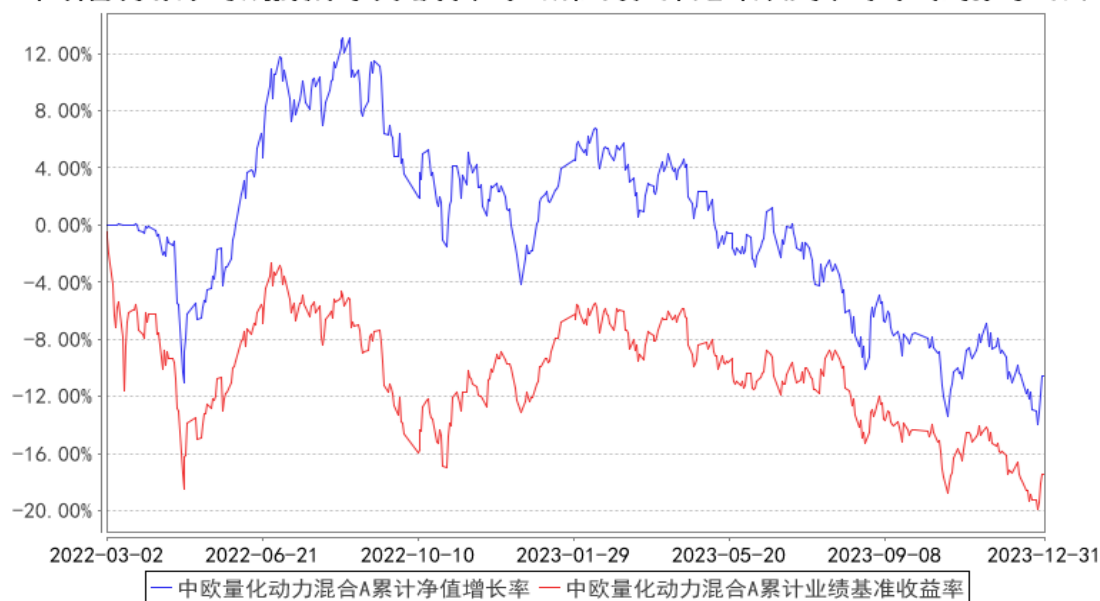
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
----	----------	------------	-----------	--------------	-----	-----

		②	率③	准差④		
过去三个月	-3.40%	0.82%	-3.66%	0.70%	0.26%	0.12%
过去六个月	-10.73%	0.84%	-7.75%	0.72%	-2.98%	0.12%
过去一年	-9.40%	0.81%	-6.13%	0.69%	-3.27%	0.12%
自基金合同生效起至今	-11.53%	0.92%	-17.45%	0.92%	5.92%	0.00%

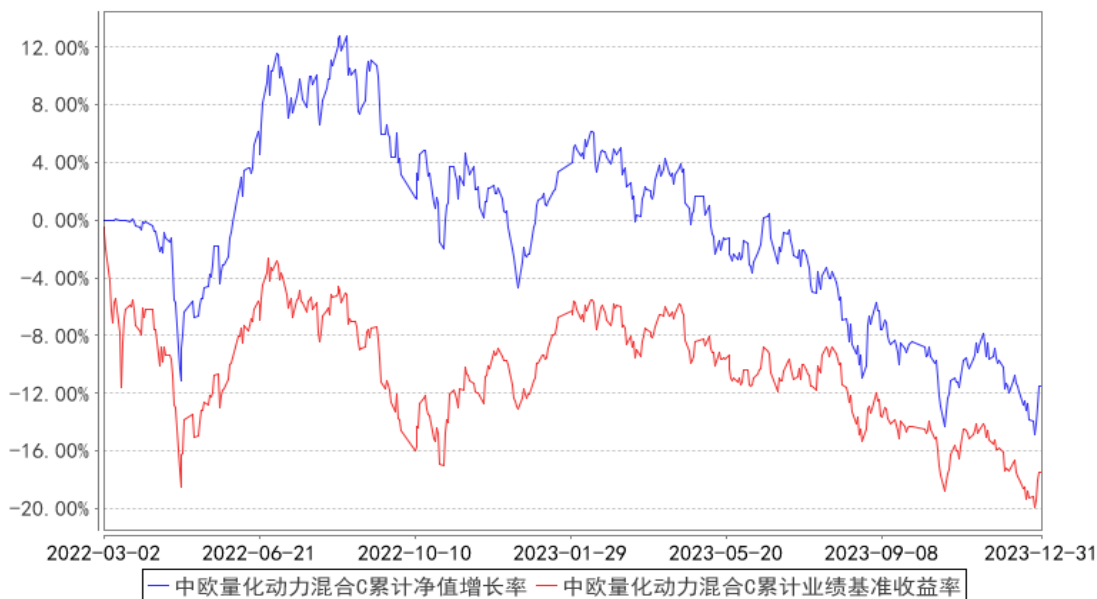
注：本基金业绩比较基准为：中证全指指数收益率*80%+活期存款利率(税后)*15%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*5%。比较基准每个交易日进行一次再平衡，每个交易日在加入损益后根据设定的权重比例进行大类资产之间的再平衡，使大类资产比例保持恒定。

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

中欧量化动力混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

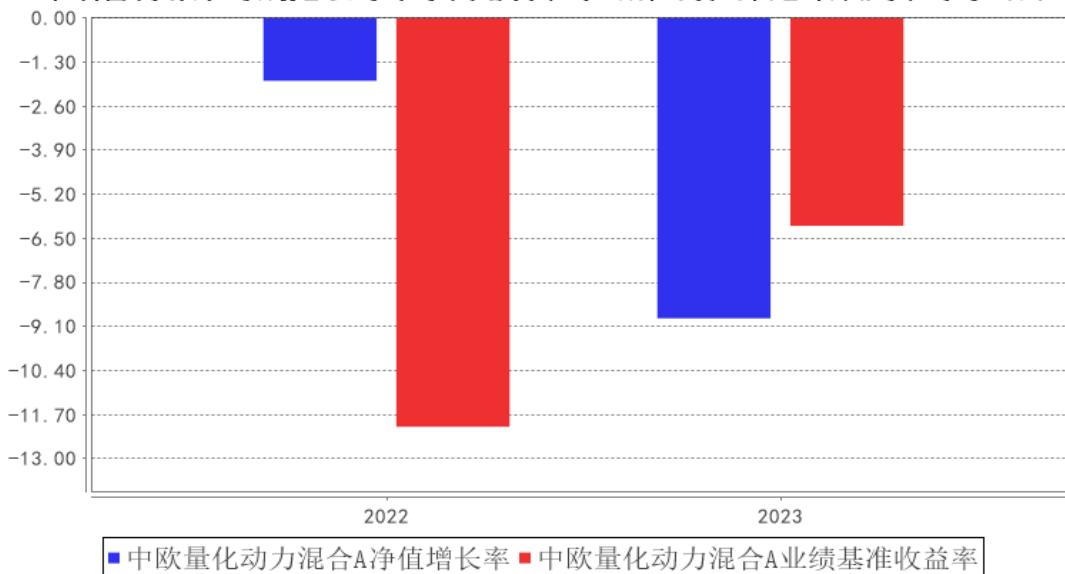


中欧量化动力混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

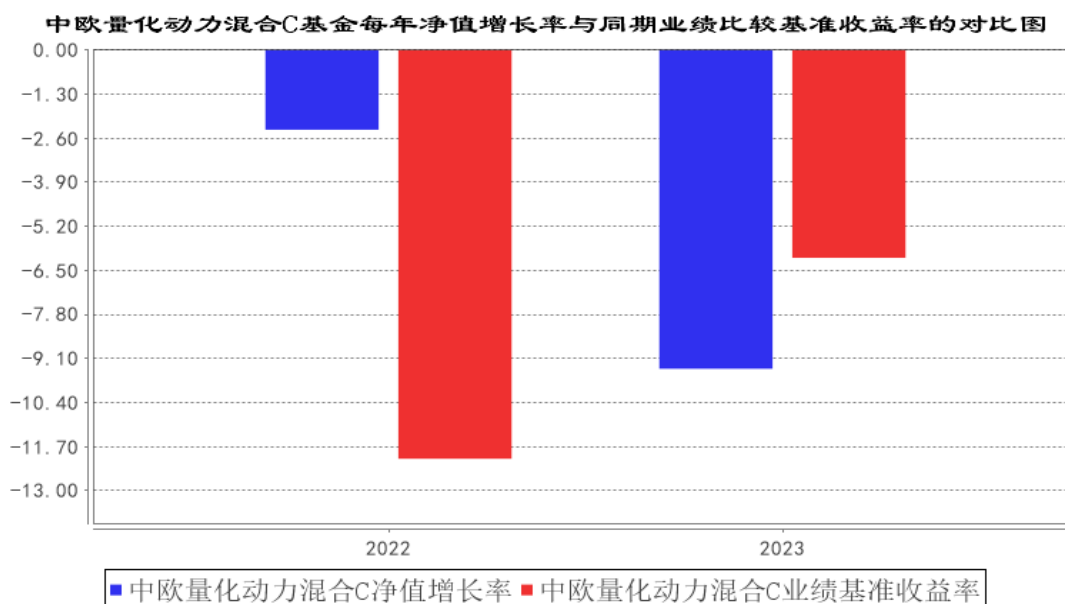


3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中欧量化动力混合A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同生效日为 2022 年 3 月 2 日，2022 年度数据为 2022 年 3 月 2 日至 2022 年 12 月 31 日数据。



注：本基金合同生效日为 2022 年 3 月 2 日，2022 年度数据为 2022 年 3 月 2 日至 2022 年 12 月 31 日数据。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

中欧量化动力混合 A

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2023	0.2080	3,673,266.21	242,964.67	3,916,230.88	-
合计	0.2080	3,673,266.21	242,964.67	3,916,230.88	-

中欧量化动力混合 C

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2023	0.2070	2,746,313.22	877,207.42	3,623,520.64	-
合计	0.2070	2,746,313.22	877,207.42	3,623,520.64	-

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中欧基金管理有限公司经中国证监会（证监基字[2006]102 号文）批准，于 2006 年 7 月 19 日正式成立。股东为 WP Asia Pacific Asset Management LLC（华平亚太资产管理有限公司）、国都证券股份有限公司、上海睦亿投资管理合伙企业（有限合伙）、上海穆延投资管理合伙企业（有限合伙）及自然人股东，注册资本为 2.20 亿元人民币，旗下设有北京分公司、深圳分公司、中欧盛世资产管理（上海）有限公司、上海中欧财富基金销售有限公司和中欧基金国际有限公司。

截至 2023 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 165 只开放式基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
曲径	量化投资总监 / 基金经理 / 投资经理	2022-03-02	-	16 年	历任千禧年基金量化基金经理，中信证券股份有限公司另类投资业务线高级副总裁。2015-04-01 加入中欧基金管理有限公司。

注：1、任职日期和离任日期一般情况下指公司作出决定之日；若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从《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》等相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
曲径	公募基金	8	4,252,875,183.55	2016-01-13
	私募资产管理计划	1	159,488,215.97	2021-12-22
	其他组合	-	-	-
	合计	9	4,412,363,399.52	-

注：1、“任职时间”为首次开始管理上表中本类产品的时间。

2、本报告期内兼任私募资产管理计划投资人员有产品离任情况，曲径离任产品情况：

①产品类型：公募，离任数量：1 只，离任时间：2023-04-21；

②产品类型：私募资产管理计划，离任数量：1 只，离任时间：2023-09-27。

4.1.4 基金经理薪酬机制

基金经理薪酬激励与私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩表现不直接挂钩。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，无违法违规、未履行基金合同承诺或损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规，本基金管理人制定了《公平交易管理办法》，建立了健全、有效的公平交易制度体系，覆盖公司旗下各类资产组合及投资顾问业务涉及的投资组合；涵盖了股票、债券等各类投资品种的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动；贯穿了研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动的各个环节，以确保公司旗下管理的不同投资组合得到公平对待，保护投资者合法权益。具体控制措施包括：在研究分析环节，研究成果与全体投资人员共享，投研体系职权划分明确且互不干预，各基金持仓及交易信息进行有效隔离；在投资决策环节，基金经理公平对待管理的所有组合，相同投资策略同时同价下达投资指令；在交易执行环节，本基金管理人以系统控制和人工控制相结合的方式，严格管理同向交易和反向交易，公平执行投资指令；在事后监控环节，本基金管理人设置每日异常交易分析机制，发现异常事项对基金经理进行提示，留存解释说明，并每季度编制公平交易分析报告，逐级审核签署备查。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格按照相关法规及制度等规定，从研究分析、投资决策、交易执行、事后监控等环节严格把关，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行。

对于同向交易，本基金管理人采集连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内）不同投资组合的同向交易计算交易价差，并结合同向交易占优比、溢价率等进行综合分析，来判断是否可能存在组合之间利益输送。

综合而言，本报告期内，公平交易制度和控制方法总体执行情况良好，不同投资组合之间不存在非公平交易或利益输送的情况。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

对于涉及基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的组合，本基金管理人按照《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》及公司内部相关制度等规定，特别地增加检查程序，将反向交易和同向交易的检查时间窗延长至 10 个交易日，并结合成交顺序、价格偏差、产品规模、成交量等因素对是否存在不公平对待的情形进行分析。综合而言，本报告期内，公平交易制度和控制方法总体执行情况良好，涉及兼任的基金经理管理的多个组合间不存在非公平交易或利益输送的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少

的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 121 次，为量化策略组合因投资策略需要发生的反向交易，公司内部风控对上述交易均履行相应控制程序。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2023 年，市场指数呈现出先扬后抑的走势，同时市场风格的结构分化较大，上半年以通信、传媒、计算机为代表的 TMT 行业受益于全球 AI 技术爆发的催化，下半年高分红和价值风格具有相对收益，市场指数回调到历史估值的低位区间。但我们相信“均值回归”的规律依然存在。从 A 股的估值水平来看，无论是市盈率还是市净率，都在比较低位的区间。经济周期是驱动市场周期的内在动力，工业增加值和工业企业利润同比增速的拐点或已在 2023 年出现，同时，上市公司的盈利拐点(用整体法计算的净利润同比增速的拐点)也有望在 2023 年第 4 季度的财报中确认。其次，市场的情绪周期也在低位。投资者情绪就像钟摆，引发市场的估值从过高到过低两个端点来回摆动。每当钟摆接近极端点的时候，极度悲观或者乐观的情绪无以为继，钟摆的运动方向发生反转。此时的市场上，风险规避类的投资策略占优，对公司业绩预期过于谨慎，而周期反转的力量也蕴含其中，可以更加乐观起来。我国的经济处于新旧产业逐步切换的过程中，在新能源、新材料、智能制造等产业链各环节中，有许多细分赛道存在国产或者渗透率提升的投资机会。在这种情况下，我们认为优质公司的基本面投资的安全边际增加了，展望未来，我们对权益市场保有信心。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，基金 A 类份额净值增长率为-8.86%，同期业绩比较基准收益率为-6.13%；基金 C 类份额净值增长率为-9.40%，同期业绩比较基准收益率为-6.13%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我国的经济处于新旧产业逐步切换的过程中，在新能源、新材料、智能制造等产业链各环节中，有许多细分赛道存在国产或者渗透率提升的投资机会，经济整体处于向好趋势中。展望 2024 年初，新增社融符合市场预期，政府债融资同比明显改善。2024 年全国 GDP 目标增速或在 5% 左右。在稳增长目标下，相信“三大工程”政策的持续推出，将对经济形成有效助力。证券市场方面，促进资本市场平稳健康发展政策频出，一方面是强调宏观政策取向一致性，加强了协调配合。二是推动中长期资金入市。三是提高上市公司质量和投资价值。同时，整体 A 股已经调整较长周期，优质公司的估值安全边际更加坚实，我们对权益市场保有信心。

在报告期内，我们以偏股混合型基金的量化特征作为抓手，保持了分散的持仓、均衡的行业

配置，整体表现为中大盘的成长风格。我们遵循基本面逻辑驱动叠加数据赋能的投资方式，以企业未来一个季度到一年的业绩为抓手，以提高对行业和个股判断的前瞻性。2024 年很多基本面驱动的模式，与技术指标量化相比，超额收益都不甚理想。我们必须承认，任何一种寻找 Alpha 方式，都有顺风或逆风的市场环境。我们认为，如果盲目追求短期最强势的量化风格，往往难以避免过度拥挤。常识来看，任何一种短期看起来完美的策略，必然承担着某种未暴露的风险。我们将潜心专注在自己擅长的领域，通过基本面模型，相信优秀的企业的利润增长，终会体现在股价上，力争创造长期合理的超额回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2023 年，在公司业务全面发展的背景下，公司始终坚持保障基金份额持有人利益的原则，不断强化内部控制，并有效地组织开展监察稽核工作，具体包括以下方面：

（一）落实法律法规，培养合规文化

2023 年，监管机构相继颁布了一系列法律法规，公司在收到相关法规后以公众号“新规速递”的方式及时向部门和员工进行推送。监察稽核部负责将新颁布的法律法规及时维护至公司共享法律法规库，并以每周新规跟踪的形式，针对法律法规进行全员范围内的解读，对于重要法规或通知，公司从制度建立、流程改造、系统更新等方面安排专项落地与跟进，并配套相应检查。同时，公司致力于积极推动公司合规文化建设，通过法规培训、监管案例速递、员工合规测试、合规宣传月等多种形式，提高员工合规及风控意识，公司内部控制和风险管理基础得到夯实和优化。

（二）完善制度体系，提高运作效率

2023 年，公司根据业务需要及新近出台或修订的法律法规，对规章制度体系进行了进一步完善，在兼顾合规、风险管理和效率的前提下，对一系列规章制度进行了补充和修订，以使得各项业务运作更为规范、顺畅和高效：公司全年制订或修订多项制度流程，内容涵盖投资研究交易、基金运作、合规管理、信息技术等各项内容。

（三）加强内部审计，强化风险管理

2023 年，公司按照年初制定的监察稽核年度计划，进一步加强合规及内部稽核审计力度，全年除有序完成监管要求的法定审计工作及常规定期审计工作外，针对易发生风险的各类业务循环开展多次专项稽核工作，使业务中存在的问题能够得到及时发现和纠正。通过内部稽核审计工作，切实保证基金运作和公司经营所涉及的各个环节均能按照各项法律法规和公司内部制度有效落实。

（四）提升反洗钱管理水平，推进反洗钱系统建设

2023 年，公司严格参照法律法规的要求落实公司反洗钱管理，优化反洗钱和制裁风险管控的

治理架构和管理体系，从制度流程、培训宣传、风险评估等层面，进一步提升和完善反洗钱管理工作。公司在今年牵头各部门完成反洗钱自查工作，并积极推进反洗钱新一代系统建设，结合最新的监管要求及业务发展需要，开发和完善了反洗钱系统各功能模块，从客户洗钱风险评估、客户尽职调查、可疑交易监测及分析等方面实现反洗钱工作系统化建设。

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本公司制订的《估值委员会议事规则》以及相关法律法规的规定，有效地控制基金估值流程。公司估值委员会主席为总经理，投票成员包括主席、权益及固定收益研究总监、基金运营总监、监察稽核总监、风险管理总监，非投票成员（列席表达相关意见）包括公司高管、投资组合经理、中央交易室负责人、战略规划及业务发展部负责人、主席指定的其他相关人士。估值委员会负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允、合理，防止估值被歪曲进而对基金持有人产生不利影响。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。

本基金管理人按照最新的估值准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金投资品种进行估值。具体估值流程为：基金日常估值由基金管理人进行，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以 XBRL 形式报给基金托管人，基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人，由基金管理人依据本基金合同和有关法律法规的规定予以公布。报告期内相关基金估值政策的变更由托管银行进行复核确认。

上述参与估值流程人员均具有估值业务所需的专业胜任能力及相关工作经验。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内进行了利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。详见下述报告中“利润分配情况”。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内基金管理人无应说明预警信息。

§ 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，本基金托管人在中欧量化动力混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证

券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，中欧量化动力混合型证券投资基金的管理人——中欧基金管理有限公司在中欧量化动力混合型证券投资基金的投资运作、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，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，中欧量化动力混合型证券投资基金进行了利润分配。

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

本托管人依法对中欧基金管理有限公司编制和披露的中欧量化动力混合型证券投资基金 2023 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、投资组合报告中的财务数据等内容进行了核查，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	安永华明（2024）审字第 70028871_B94 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	中欧量化动力混合型证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	我们审计了中欧量化动力混合型证券投资基金的财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年度的利润表、净资产（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的中欧量化动力混合型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了中欧量化动力混合型证券投资基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于中欧量化动力混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	不适用
其他事项	不适用
其他信息	中欧量化动力混合型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

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

	(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	陈露	张亚旒
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层	
审计报告日期	2024年3月28日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：中欧量化动力混合型证券投资基金

报告截止日：2023年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	24,533,269.12	14,918,165.25
结算备付金		737,952.98	6,445,753.12
存出保证金		420,955.20	1,311,072.00
交易性金融资产	7.4.7.2	327,172,611.13	186,960,927.05
其中：股票投资		324,760,052.23	176,489,622.94
基金投资		-	-
债券投资		2,412,558.90	10,471,304.11
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		26,974.18	-
应收申购款		170,427.33	193,821.75
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		353,062,189.94	209,829,739.17

负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		5.86	347,198.92
应付赎回款		298,173.96	25,627.55
应付管理人报酬		363,939.30	277,920.45
应付托管费		45,492.42	27,792.03
应付销售服务费		95,281.50	28,465.73
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	50,000.15	150,033.73
负债合计		852,893.19	857,038.41
净资产:			
实收基金	7.4.7.7	404,174,523.34	213,184,420.57
未分配利润	7.4.7.8	-51,965,226.59	-4,211,719.81
净资产合计		352,209,296.75	208,972,700.76
负债和净资产总计		353,062,189.94	209,829,739.17

注：1. 报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额总额 404,174,523.34 份，其中下属 A 类基金份额净值为人民币 0.8765 元，基金份额总额 193,727,270.60 份；下属 C 类基金份额净值为人民币 0.8668 元，基金份额总额 210,447,252.74 份。

2. 本基金基金合同于 2022 年 03 月 02 日生效，上年度可比期间自 2022 年 03 月 02 日至 2022 年 12 月 31 日，下同。

7.2 利润表

会计主体：中欧量化动力混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 3 月 2 日（基金合 同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-29,651,776.98	-6,415,129.41
1. 利息收入		564,726.68	630,050.01
其中：存款利息收入	7.4.7.9	298,150.23	458,093.70
债券利息收入		-	-

资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		266,576.45	171,956.31
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-30,388,057.62	-2,954,562.09
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-36,798,137.06	-1,165,225.01
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	144,759.82	23,543.46
资产支持证券投资	7.4.7.12	-	-
收益			
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.13	2,048,635.96	-3,817,185.38
股利收益	7.4.7.14	4,216,683.66	2,004,304.84
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	-3,311,962.26	-5,401,329.71
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	3,483,516.22	1,310,712.38
减：二、营业总支出		8,090,747.18	3,882,622.05
1. 管理人报酬		5,878,675.74	2,909,219.60
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费		647,469.64	290,921.89
3. 销售服务费		1,365,070.44	525,146.11
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		541.38	-
其中：卖出回购金融资产支出		541.38	-
6. 信用减值损失	7.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		9,330.77	-
8. 其他费用	7.4.7.18	189,659.21	157,334.45
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-37,742,524.16	-10,297,751.46
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-37,742,524.16	-10,297,751.46
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-37,742,524.16	-10,297,751.46

7.3 净资产变动表

会计主体：中欧量化动力混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	213,184,420.57	-	-4,211,719.81	208,972,700.76
二、本期期初净资产	213,184,420.57	-	-4,211,719.81	208,972,700.76
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	190,990,102.77	-	-47,753,506.78	143,236,595.99
（一）、综合收益总额	-	-	-37,742,524.16	-37,742,524.16
（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)	190,990,102.77	-	-2,471,231.10	188,518,871.67
其中：1. 基金申购款	1,208,355,652.19	-	-9,985,521.25	1,198,370,130.94
2. 基金赎回款	-1,017,365,549.42	-	7,514,290.15	-1,009,851,259.27
（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)	-	-	-7,539,751.52	-7,539,751.52
四、本期期末净资产	404,174,523.34	-	-51,965,226.59	352,209,296.75
项目	上年度可比期间 2022 年 3 月 2 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-	-
二、本期期初净资产	324,069,096.67	-	-	324,069,096.67
三、本期增减变动	-110,884,676.1	-	-4,211,719.81	-115,096,395.91

动额(减少以“-”号填列)	0			
(一)、综合收益总额	-	-	-10,297,751.46	-10,297,751.46
(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)	-110,884,676.10	-	6,086,031.65	-104,798,644.45
其中: 1. 基金申购款	304,326,491.12	-	24,294,866.81	328,621,357.93
2. 基金赎回款	-415,211,167.22	-	-18,208,835.16	-433,420,002.38
(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	213,184,420.57	-	-4,211,719.81	208,972,700.76

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:

刘建平

杨毅

王音然

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

中欧量化动力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[2022]77号文《关于准予中欧量化动力混合型证券投资基金注册的批复》准予注册,由中欧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《中欧量化动力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基金,存续期限不定。首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币324,023,694.26元,业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2022)验字第61362990_B18号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《中欧量化动力混合型证券投资基金基金合同》于2022年3月2日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为324,069,096.67份基金份额,其中包含认购资金利息折合

45,402.41 份基金份额。其中 A 类基金的基金份额总额为 115,946,789.67 份，包含认购利息折合 16,331.99 份；C 类基金的基金份额总额为 208,122,307.00 份，包含认购利息折合 29,070.42 份。本基金的基金管理人与注册登记机构均为中欧基金管理有限公司，基金托管人为海通证券股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧量化动力混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板以及其他经中国证监会允许发行上市的股票）、存托凭证、港股通标的股票、债券（包括国债、地方政府债、政府支持机构债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、现金、衍生工具（包括国债期货、股指期货、股票期权）、信用衍生品（不含合约类信用衍生品）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）。本基金可以参与融资业务。

本基金的投资组合比例为：本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 60%-95%（投资于港股通标的股票不超过股票资产的 50%）。每个交易日日终，在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，保持现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。如果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：中证全指指数收益率×80%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×5%+银行活期存款利率（税后）×15%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

（1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据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分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

（2）金融负债分类

除由于金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债以外，本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

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

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。

对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

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和金融负债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，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

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

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

（3）如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

（4）如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，

同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。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确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益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利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，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

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系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、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损

失；

(7) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

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等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

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) 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；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金份额持有人可对各类基金份额分别选择不同的分红方式。选择采取红利再投资形式的，红利再投资的份额免收申购费；

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

(3) 同一类别每一基金份额享有同等分配权；

(4) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配的有关业务规则进行调整，并及时公告。法律法规或监管机构另有规定的，基金管理人在履行适当程序后，将对上述基金收益分配政策进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

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

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

7.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；根据财政部、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》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

7.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金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。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的

增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

7.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

7.4.6.4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

7.4.6.5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

7.4.6.6 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	665,941.13	1,662,454.61
等于：本金	665,464.00	1,661,970.58
加：应计利息	477.13	484.03
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	23,867,327.99	13,255,710.64
等于：本金	23,865,212.66	13,254,045.07
加：应计利息	2,115.33	1,665.57
减：坏账准备	-	-
合计	24,533,269.12	14,918,165.25

注：本基金持有的其他存款均为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	333,478,976.20	-	324,760,052.23	-8,718,923.97
贵金属投资-金交所	-	-	-	-

黄金合约					
债券	交易所市场	2,392,488.00	17,358.90	2,412,558.90	2,712.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	2,392,488.00	17,358.90	2,412,558.90	2,712.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		335,871,464.20	17,358.90	327,172,611.13	-8,716,211.97
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日				
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		181,567,605.65	-	176,489,622.94	-5,077,982.71
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	10,379,587.00	91,064.11	10,471,304.11	653.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	10,379,587.00	91,064.11	10,471,304.11	653.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		0.00	0.00	0.00	0.00
合计		191,947,192.65	91,064.11	186,960,927.05	-5,077,329.71

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	3,505,040.00	-	-	-
其中：股指期货投资	3,505,040.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	3,505,040.00	-	-	-
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
	合同/名义	公允价值		备注

	金额	资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	9,064,480.00	-	-	-
其中：股指期货投资	9,064,480.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	9,064,480.00	-	-	-

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为人民币 0 元。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股股指期货投资产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为人民币 0 元。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IM2403	IM2403	3.00	3,507,960.00	2,920.00
合计				2,920.00
减：可抵销期货暂收款				2,920.00
净额				0.00

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

无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.5 其他资产

无。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	0.15	33.73
应付证券出借违约金	-	-

应付交易费用	-	-
其中：交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用-审计费	50,000.00	50,000.00
预提费用-信息披露费	-	100,000.00
合计	50,000.15	150,033.73

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

中欧量化动力混合 A

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	159,114,765.45	159,114,765.45
本期申购	279,873,696.36	279,873,696.36
本期赎回（以“-”号填列）	-245,261,191.21	-245,261,191.21
本期末	193,727,270.60	193,727,270.60

中欧量化动力混合 C

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	54,069,655.12	54,069,655.12
本期申购	928,481,955.83	928,481,955.83
本期赎回（以“-”号填列）	-772,104,358.21	-772,104,358.21
本期末	210,447,252.74	210,447,252.74

注：申购份额含红利再投、转换入份额，赎回份额含转换出份额。

7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

中欧量化动力混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	7,122,636.62	-10,066,190.57	-2,943,553.95
本期期初	7,122,636.62	-10,066,190.57	-2,943,553.95
本期利润	-15,247,090.35	-898,346.65	-16,145,437.00
本期基金份额交易产生的变动数	543,671.27	-1,471,135.47	-927,464.20
其中：基金申购款	10,435,699.53	-9,607,741.12	827,958.41
基金赎回款	-9,892,028.26	8,136,605.65	-1,755,422.61
本期已分配利润	-3,916,230.88	-	-3,916,230.88
本期末	-11,497,013.34	-12,435,672.69	-23,932,686.03

中欧量化动力混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,140,881.21	-3,409,047.07	-1,268,165.86

本期期初	2,140,881.21	-3,409,047.07	-1,268,165.86
本期利润	-19,183,471.55	-2,413,615.61	-21,597,087.16
本期基金份额交易产生的变动数	6,080,853.00	-7,624,619.90	-1,543,766.90
其中：基金申购款	23,843,055.76	-34,656,535.42	-10,813,479.66
基金赎回款	-17,762,202.76	27,031,915.52	9,269,712.76
本期已分配利润	-3,623,520.64	-	-3,623,520.64
本期末	-14,585,257.98	-13,447,282.58	-28,032,540.56

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年3月2日（基金合同生效日）至2022年12月31日
活期存款利息收入	111,382.88	249,895.84
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	87,996.71	110,187.36
结算备付金利息收入	98,770.64	98,010.50
其他	-	-
合计	298,150.23	458,093.70

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 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年3月2日（基金合同生效日）至2022年12月31日
卖出股票成交总额	3,984,096,139.08	1,599,788,319.98
减：卖出股票成本总额	4,012,130,470.13	1,596,689,352.78
减：交易费用	8,763,806.01	4,264,192.21
买卖股票差价收入	-36,798,137.06	-1,165,225.01

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 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年3月2日（基金合同生效日）至2022年12月31日
债券投资收益——利息收入	123,780.82	23,569.46
债券投资收益——买	20,979.00	-26.00

卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入		
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	144,759.82	23,543.46

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 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年3月2日（基金合同生效日）至2022年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	11,206,800.00	-
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	10,979,017.00	-
减：应计利息总额	206,800.00	-
减：交易费用	4.00	26.00
买卖债券差价收入	20,979.00	-26.00

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

7.4.7.13 衍生工具收益

7.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年3月2日（基金合同生效日）至2022年12月31日
股指期货投资收益	2,048,635.96	-3,817,185.38

7.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年3月2日（基金合同生效日）至2022年12月31日
----	-----------------------------	---

股票投资产生的股利收益	4,216,683.66	2,004,304.84
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	4,216,683.66	2,004,304.84

7.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年3月2日（基金合 同生效日）至2022年12月31 日
1. 交易性金融资产	-3,638,882.26	-5,077,329.71
股票投资	-3,640,941.26	-5,077,982.71
债券投资	2,059.00	653.00
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	326,920.00	-324,000.00
权证投资	-	-
期货投资	326,920.00	-324,000.00
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值 变动产生的预估增值税	-	-
合计	-3,311,962.26	-5,401,329.71

7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年3月2日（基金合 同生效日）至2022年12月31 日
基金赎回费收入	3,479,473.20	1,310,409.15
基金转换费收入	359.78	303.23
其他	3,683.24	-
合计	3,483,516.22	1,310,712.38

7.4.7.17 信用减值损失

无。

7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12	上年度可比期间 2022年3月2日（基金合同生效日）
----	-------------------------	-------------------------------

	月 31 日	至 2022 年 12 月 31 日
审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	100,000.00
证券出借违约金	-	-
账户维护费	18,000.00	6,000.00
开户费	-	1,200.00
证券组合费	1,659.21	134.45
合计	189,659.21	157,334.45

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

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中欧基金管理有限公司（“中欧基金”）	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
海通证券股份有限公司（“海通证券”）	基金托管人、基金销售机构
国都证券股份有限公司（“国都证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
WP Asia Pacific Asset Management LLC（“华平亚太资管”）	基金管理人的股东（自 2023 年 6 月 1 日起）
Unione di Banche Italiane S.p.a（“意大利意联银行”）	基金管理人的股东（截止至 2023 年 5 月 31 日）
上海穆延投资管理合伙企业（有限合伙）（“上海穆延合伙”）	基金管理人的股东（自 2023 年 5 月 11 日起）
万盛基业投资有限责任公司（“万盛基业”）	基金管理人的股东（截止至 2023 年 5 月 10 日）
上海睦亿投资管理合伙企业（有限合伙）（“上海睦亿合伙”）	基金管理人股东
自然人股东	基金管理人股东
上海中欧财富基金销售有限公司（“中欧财富”）	基金管理人的控股子公司、基金销售机构
中欧盛世资产管理（上海）有限公司（“中欧盛世资管”）	基金管理人的全资子公司
中欧基金国际有限公司（“中欧基金国际”）	基金管理人的全资子公司

注：1、自 2023 年 5 月 11 日起，万盛基业投资有限责任公司不再是我司关联方，新增关联方为上海穆延投资管理合伙企业（有限合伙）及 7 名自然人股东。

2、自 2023 年 6 月 1 日起，Unione di Banche Italiane S.p.A. 不再是我司关联方，新增关联方为 WP Asia Pacific Asset Management LLC（华平亚太资产管理有限公司）。

3、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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年3月2日（基金合同生效日）至 2022年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例（%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 （%）
海通证券	2,490,048,690.95	30.61	2,149,464,867.65	63.70

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年3月2日（基金合同生效日） 至2022年12月31日	
	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 成交总额的比例 （%）
海通证券	2,396,393.75	79.85	4,018,068.48	38.46

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年3月2日（基金合同生效日） 至2022年12月31日	
	成交金额	占当期债券回 购 成交总额的比 例（%）	成交金额	占当期债券回 购 成交总额的比 例（%）
海通证券	1,254,402,000.00	40.78	539,206,000.00	68.82

7.4.10.1.4 权证交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
海通证券	1,316,635.36	28.93	-	-

关联方名称	上年度可比期间 2022年3月2日（基金合同生效日）至2022年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
海通证券	1,726,287.31	72.82	-	-

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

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

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年3月2日（基金合同 生效日）至2022年12月31 日
当期发生的基金应支付的管理费	5,878,675.74	2,909,219.60
其中：应支付销售机构的客户维护 费	2,253,383.67	1,153,198.31
应支付基金管理人的净管理费	3,625,292.07	1,756,021.29

注：1、本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.20% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

2、根据本基金管理人于 2023 年 7 月 8 日发布的《中欧基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》的公告，经与基金托管人协商一致并报中国证监会备案，自 2023 年 7 月 10 日起，本基金管理费率由 1.5%/年调低至 1.2%/年。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年3月2日（基金合 同生效日）至2022年12月 31日
----	---------------------------------	---

当期发生的基金应支付的托管费	647,469.64	290,921.89
----------------	------------	------------

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中欧量化动力混合 A	中欧量化动力混合 C	合计
海通证券	-	457,956.29	457,956.29
中欧财富	-	112.26	112.26
中欧基金	-	97,435.04	97,435.04
合计	-	555,503.59	555,503.59
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022 年 3 月 2 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中欧量化动力混合 A	中欧量化动力混合 C	合计
海通证券	-	482,640.30	482,640.30
中欧财富	-	70.78	70.78
中欧基金	-	75.82	75.82
合计	-	482,786.90	482,786.90

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.60%，销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.60% 年费率计提。计算方法如下：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一

次性支付给基金管理人。经基金管理人代付给各个基金销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

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均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

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

本报告期及上年度可比期间，基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

中欧量化动力混合 A

关联方名称	本期末 2023 年 12 月 31 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例
自然人股东	1,086,004.70	0.56%	100,024.11	0.06%

注：1、本报告期及上年度可比期间，除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的适用费率符合本基金招募说明书和相关公告的规定。

2、本报告期期末及上年度可比期期末，除基金管理人之外的其他关联方均未持有本基金 C 类份额。

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 3 月 2 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入

海通证券股份有限公司	9,813,977.20	131,150.57	8,398,349.63	321,517.39
------------	--------------	------------	--------------	------------

注：本基金的银行存款由基金托管人海通证券股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

中欧量化动力混合 A								
序号	权益 登记日	除息日		每 10 份基 金份额分 红数	现金形 式 发放总 额	再投资形 式 发放总额	本期利 润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2023 年 4 月 14 日	-	2023 年 4 月 14 日	0.2080	3,673,266 .21	242,964.67	3,916,230 .88	-
合计	-	-	-	0.2080	3,673,266 .21	242,964.67	3,916,230 .88	-
中欧量化动力混合 C								
序号	权益 登记日	除息日		每 10 份基 金份额分 红数	现金形 式 发放总 额	再投资形 式 发放总额	本期利 润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2023 年 4 月 14 日	-	2023 年 4 月 14 日	0.2070	2,746,313 .22	877,207.42	3,623,520 .64	-
合计	-	-	-	0.2070	2,746,313 .22	877,207.42	3,623,520 .64	-

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

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券 代码	证 券 名 称	成 功 认 购 日	受 限 期	流 通 受 限 类 型	认 购 价 格	期 末 估 值 单 价	数 量 （ 单 位： 股）	期 末 成 本 总 额	期 末 估 值 总 额	备 注
001239	永 达 股 份	2023 年 12 月 4 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	12.05	19.92	189	2,277.45	3,764.88	-
001306	夏	2023	6 个月	新 股	53.63	75.36	64	3,432.32	4,823.04	-

	厦精密	年 11 月 9 日		流通受限						
001358	兴欣新材	2023 年 12 月 14 日	6 个月	新股流通受限	41.00	44.16	87	3,567.00	3,841.92	-
001378	德冠新材	2023 年 10 月 23 日	6 个月	新股流通受限	31.68	31.27	205	6,494.40	6,410.35	-
300904	威力传动	2023 年 8 月 2 日	6 个月	新股流通受限	35.41	61.53	304	10,764.64	18,705.12	-
301172	君逸数码	2023 年 7 月 19 日	6 个月	新股流通受限	31.33	38.16	438	13,722.54	16,714.08	-
301202	朗威股份	2023 年 6 月 28 日	6 个月	新股流通受限	25.82	31.80	306	7,900.92	9,730.80	-
301210	金杨股份	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新股流通受限	57.88	45.48	257	14,875.16	11,688.36	-
301251	威尔高	2023 年 8 月 30 日	6 个月	新股流通受限	28.88	34.59	321	9,270.48	11,103.39	-
301261	恒工精密	2023 年 6 月 29 日	6 个月	新股流通受限	36.90	50.85	198	7,306.20	10,068.30	-
301272	英华特	2023 年 7 月 6 日	6 个月	新股流通受限	51.39	53.38	173	8,890.47	9,234.74	-
301292	海科新源	2023 年 6 月 29 日	6 个月	新股流通受限	19.99	19.35	583	11,654.17	11,281.05	-
301329	信音电	2023 年 7 月 5 日	6 个月	新股流通受限	21.00	22.23	458	9,618.00	10,181.34	-

	子									
301348	蓝箭电子	2023年8月1日	6个月	新股流通受限	18.08	44.57	613	11,083.04	27,321.41	-
301362	民爆光电	2023年7月27日	6个月	新股流通受限	51.05	38.52	420	21,441.00	16,178.40	-
301370	国科恒泰	2023年7月3日	6个月	新股流通受限	13.39	16.01	1,240	16,603.60	19,852.40	-
301371	敷尔佳	2023年7月24日	6个月	新股流通受限	55.68	37.58	290	16,147.20	10,898.20	-
301393	昊帆生物	2023年7月5日	6个月	新股流通受限	67.68	59.37	175	11,844.00	10,389.75	-
301395	仁信新材	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	26.68	18.69	520	13,873.60	9,718.80	-
301413	安培龙	2023年12月11日	6个月	新股流通受限	33.25	58.19	164	5,453.00	9,543.16	-
301418	协昌科技	2023年8月10日	6个月	新股流通受限	51.88	50.20	189	9,805.32	9,487.80	-
301421	波长光电	2023年8月16日	6个月	新股流通受限	29.38	59.37	332	9,754.16	19,710.84	-
301456	盘古智能	2023年7月6日	6个月	新股流通受限	37.96	30.39	329	12,488.84	9,998.31	-
301459	丰茂股份	2023年12月6日	6个月	新股流通受限	31.90	39.84	208	6,635.20	8,286.72	-

301469	恒达新材	2023年8月10日	6个月	新股流通受限	36.58	33.09	275	10,059.50	9,099.75	-
301486	致尚科技	2023年6月30日	6个月	新股流通受限	57.66	47.25	272	15,683.52	12,852.00	-
301487	盟固利	2023年8月1日	6个月	新股流通受限	5.32	40.96	867	4,612.44	35,512.32	-
301488	豪恩汽电	2023年6月26日	6个月	新股流通受限	39.78	69.09	262	10,422.36	18,101.58	-
301489	思泉新材	2023年10月16日	6个月	新股流通受限	41.66	64.11	128	5,332.48	8,206.08	-
301499	维科精密	2023年7月13日	6个月	新股流通受限	19.50	28.93	371	7,234.50	10,733.03	-
301500	飞南资源	2023年9月13日	6个月	新股流通受限	23.97	20.89	455	10,906.35	9,504.95	-
301505	苏州规划	2023年7月12日	6个月	新股流通受限	26.35	35.81	194	5,111.90	6,947.14	-
301507	民生健康	2023年8月24日	6个月	新股流通受限	10.00	15.85	851	8,510.00	13,488.35	-
301508	中机认检	2023年11月23日	6个月	新股流通受限	16.82	26.68	419	7,047.58	11,178.92	-
301510	固高科技	2023年8月4日	6个月	新股流通受限	12.00	35.01	396	4,752.00	13,863.96	-
301511	德	2023	6个月	新股	28.00	22.67	743	20,804.00	16,843.81	-

	福科技	年8月8日		流通受限						
301515	港通医疗	2023年7月13日	6个月	新股流通受限	31.16	28.27	230	7,166.80	6,502.10	-
301516	中远通	2023年12月1日	6个月	新股流通受限	6.87	15.51	604	4,149.48	9,368.04	-
301517	陕西华达	2023年10月9日	6个月	新股流通受限	26.87	43.69	185	4,970.95	8,082.65	-
301518	长华化学	2023年7月26日	6个月	新股流通受限	25.75	23.01	385	9,913.75	8,858.85	-
301519	舜禹股份	2023年7月19日	6个月	新股流通受限	20.93	20.21	442	9,251.06	8,932.82	-
301520	万邦医药	2023年9月18日	6个月	新股流通受限	67.88	52.74	160	10,860.80	8,438.40	-
301526	国际复材	2023年12月19日	6个月	新股流通受限	2.66	4.45	5,875	15,627.50	26,143.75	-
301528	多浦乐	2023年8月17日	6个月	新股流通受限	71.80	68.91	148	10,626.40	10,198.68	-
301529	福赛科技	2023年8月31日	6个月	新股流通受限	36.60	37.88	182	6,661.20	6,894.16	-
301533	威马农机	2023年8月7日	6个月	新股流通受限	29.50	33.16	225	6,637.50	7,461.00	-
301550	斯菱股	2023年9月6日	6个月	新股流通受限	37.56	43.57	260	9,765.60	11,328.20	-

	份									
301555	惠柏新材	2023年10月24日	6个月	新股流通受限	22.88	32.44	224	5,125.12	7,266.56	-
301558	三态股份	2023年9月21日	6个月	新股流通受限	7.33	13.40	1,458	10,687.14	19,537.20	-
301559	中集环科	2023年9月26日	6个月	新股流通受限	24.22	18.24	492	11,916.24	8,974.08	-
301566	达利凯普	2023年12月22日	6个月	新股流通受限	8.90	22.14	576	5,126.40	12,752.64	-
301578	辰奕智能	2023年12月21日	6个月	新股流通受限	48.94	68.32	118	5,774.92	8,061.76	-
601083	锦江航运	2023年11月28日	6个月	新股流通受限	11.25	11.07	605	6,806.25	6,697.35	-
601096	宏盛华源	2023年12月15日	6个月	新股流通受限	1.70	4.06	3,034	5,157.80	12,318.04	-
603004	鼎龙科技	2023年12月20日	6个月	新股流通受限	16.80	31.19	195	3,276.00	6,082.05	-
603062	麦加芯彩	2023年10月31日	6个月	新股流通受限	58.08	57.81	82	4,762.56	4,740.42	-
603107	上海汽配	2023年10月25日	6个月	新股流通受限	14.23	18.19	292	4,155.16	5,311.48	-
603119	浙江荣	2023年7月21日	6个月	新股流通受限	15.32	23.87	226	3,462.32	5,394.62	-

	泰									
603193	润本股份	2023年10月9日	6个月	新股流通受限	17.38	16.66	288	5,005.44	4,798.08	-
603231	索宝蛋白	2023年12月6日	6个月	新股流通受限	21.29	21.53	161	3,427.69	3,466.33	-
603270	金帝股份	2023年8月25日	6个月	新股流通受限	21.77	29.58	195	4,245.15	5,768.10	-
603273	天元智能	2023年10月16日	6个月	新股流通受限	9.50	18.97	178	1,691.00	3,376.66	-
603276	恒兴新材	2023年9月18日	6个月	新股流通受限	25.73	24.88	134	3,447.82	3,333.92	-
603296	华勤技术	2023年8月1日	6个月	新股流通受限	80.80	77.75	226	18,260.80	17,571.50	-
603373	安邦护卫	2023年12月13日	6个月	新股流通受限	19.10	34.75	88	1,680.80	3,058.00	-
688450	光格科技	2023年7月17日	6个月	新股流通受限	53.09	36.42	167	8,866.03	6,082.14	-
688563	航材股份	2023年7月12日	6个月	新股流通受限	78.99	60.49	275	21,722.25	16,634.75	-
688573	信宇人	2023年8月9日	6个月	新股流通受限	23.68	28.80	285	6,748.80	8,208.00	-
688582	芯动联科	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	26.74	38.67	430	11,498.20	16,628.10	-

688591	泰凌微	2023年8月18日	6个月	新股流通受限	24.98	28.02	643	16,062.14	18,016.86	-
688602	康鹏科技	2023年7月13日	6个月	新股流通受限	8.66	11.06	1,066	9,231.56	11,789.96	-
688610	埃科光电	2023年7月10日	6个月	新股流通受限	73.33	51.00	252	18,479.16	12,852.00	-
688612	威迈斯	2023年7月19日	6个月	新股流通受限	47.29	37.97	300	14,187.00	11,391.00	-
688638	誉辰智能	2023年7月4日	6个月	新股流通受限	83.90	59.68	141	11,829.90	8,414.88	-
688648	中邮科技	2023年11月6日	6个月	新股流通受限	15.18	21.43	303	4,599.54	6,493.29	-
688651	盛邦安全	2023年7月19日	6个月	新股流通受限	39.90	46.05	178	7,102.20	8,196.90	-
688652	京仪装备	2023年11月22日	6个月	新股流通受限	31.95	52.25	308	9,840.60	16,093.00	-
688653	康希通信	2023年11月10日	6个月	新股流通受限	10.50	15.99	648	6,804.00	10,361.52	-
688657	浩辰软件	2023年9月25日	6个月	新股流通受限	103.40	78.23	101	10,443.40	7,901.23	-
688693	锆威特	2023年8月10日	6个月	新股流通受限	40.83	43.41	178	7,267.74	7,726.98	-
688702	盛科通	2023年9月6日	6个月	新股流通受限	42.66	48.18	289	12,328.74	13,924.02	-

	信									
688719	爱科赛博	2023年9月20日	6个月	新股流通受限	69.98	60.10	175	12,246.50	10,517.50	-
688720	艾森股份	2023年11月29日	6个月	新股流通受限	28.03	49.84	165	4,624.95	8,223.60	-

注：基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000657	中钨高新	2023年12月26日	重大资产重组	8.48	2024年1月10日	9.33	27,000	249,145.66	228,960.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

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融出证券。

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

本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金将投资港股通标

的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。本基金在严格控制投资组合风险的前提下，通过量化投资精选股票，力争获得超越业绩比较基准的收益。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心，督察长、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。风险控制委员会负责协助确立公司风险控制的原则、目标和策略，并就风险控制重要事项进行审议和决策。督察长负责组织和指导公司的监察稽核工作。监察稽核部独立于公司各业务部门开展监察稽核工作，负责监察公司的风险管理措施的执行，对内部控制制度的执行情况进行全面及专项检查 and 反馈。风险管理部负责公司层面金融工具投资的风险评估、风险监测以及风险管理措施的执行。相关业务部门负责本部门的风险评估和监控。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。

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。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。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%。本基金的基金管理人管理的所有开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股不得超过该上市公司可流通股票的 15%。本基金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%。除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，本基金所持大部分资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2023 年 12 月 31 日，本基金所承担的除卖出回购金融资产款以外的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

本基金持有的资产主要为银行存款、股票及信用状况良好的固定收益类资产，其中银行存款主要为活期存款及可提前支取的定期存款，股票及固定收益类资产主要为在交易所及银行间公开发行上市且可自由流通的品种。本基金持有的流通受限资产比例较低，未对组合流动性造成重大影响，附注 7.4.12 披露的流通受限资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	24,533,269.12	-	-	-	24,533,269.12
结算备付金	737,952.98	-	-	-	737,952.98
存出保证金	-	-	-	420,955.20	420,955.20
交易性金融资产	2,412,558.90	-	-	-324,760,052.23	327,172,611.13
应收股利	-	-	-	26,974.18	26,974.18
应收申购款	-	-	-	170,427.33	170,427.33
资产总计	27,683,781.00	-	-	-325,378,408.94	353,062,189.94
负债					
应付赎回款	-	-	-	298,173.96	298,173.96
应付管理人报酬	-	-	-	363,939.30	363,939.30
应付托管费	-	-	-	45,492.42	45,492.42
应付清算款	-	-	-	5.86	5.86
应付销售服务费	-	-	-	95,281.50	95,281.50
其他负债	-	-	-	50,000.15	50,000.15
负债总计	-	-	-	852,893.19	852,893.19
利率敏感度缺口	27,683,781.00	-	-	-324,525,515.75	352,209,296.75
上年度末 2022 年 12 月 31 日					
资产					
银行存款	14,918,165.25	-	-	-	14,918,165.25
结算备付金	6,445,753.12	-	-	-	6,445,753.12
存出保证金	-	-	-	1,311,072.00	1,311,072.00
交易性金融资产	10,471,304.11	-	-	-176,489,622.94	186,960,927.05
应收申购款	-	-	-	193,821.75	193,821.75
资产总计	31,835,222.48	-	-	-177,994,516.69	209,829,739.17
负债					
应付赎回款	-	-	-	25,627.55	25,627.55
应付管理人报酬	-	-	-	277,920.45	277,920.45
应付托管费	-	-	-	27,792.03	27,792.03
应付清算款	-	-	-	347,198.92	347,198.92
应付销售服务费	-	-	-	28,465.73	28,465.73
其他负债	-	-	-	150,033.73	150,033.73
负债总计	-	-	-	857,038.41	857,038.41
利率敏感度缺口	31,835,222.48	-	-	-177,137,478.28	208,972,700.76

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2023 年 12 月 31 日，本基金持有交易性债券资产占基金资产净值的比例为 0.68%（2022 年 12 月 31 日：5.01%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2022 年 12 月 31 日：同）。

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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
交易性金融资产	-	27,050,947.01	-	27,050,947.01
应收股利	-	26,974.18	-	26,974.18
资产合计	-	27,077,921.19	-	27,077,921.19
以外币计价的 负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 汇风险敞口净 额	-	27,077,921.19	-	27,077,921.19
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
交易性金融资产	-	10,703,308.53	-	10,703,308.53
资产合计	-	10,703,308.53	-	10,703,308.53
以外币计价的				

负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 汇风险敞口净 额	-	10,703,308.53	-	10,703,308.53

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变，且未考虑基金管理人为降低汇率风险而可能采取的风险管理活动		
分析	相关风险变量的变 动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年12月31日）	上年度末（2022年12月 31日）
	港币相对人民币贬 值 5%	-1,353,896.06	-535,165.43
	港币相对人民币升 值 5%	1,353,896.06	535,165.43

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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	324,760,052.23	92.21	176,489,622.94	84.46
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-

衍生金融资产 —权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	324,760,052.23	92.21	176,489,622.94	84.46

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变，表格中本期与上期的数据均披露		
分析	相关风险变量的变 动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年12月31日）	上年度末（2022年12月 31日）
	业绩比较基准上升 5%	19,422,359.62	10,433,447.86
	业绩比较基准下降 5%	-19,422,359.62	-10,433,447.86

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	323,635,654.01	176,218,528.72
第二层次	2,641,518.90	10,471,304.11
第三层次	895,438.22	271,094.22
合计	327,172,611.13	186,960,927.05

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。对于公开市场

交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，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投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	0.00	271,094.22	271,094.22
当期购买	0.00	748,901.70	748,901.70
当期出售/结算	0.00	0.00	0.00
转入第三层次	0.00	0.00	0.00
转出第三层次	0.00	271,094.22	271,094.22
当期利得或损失总额	0.00	146,536.52	146,536.52
其中：计入损益的利得或损失	0.00	146,536.52	146,536.52
计入其他综合收益的利得或损失	0.00	0.00	0.00
期末余额	0.00	895,438.22	895,438.22
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	0.00	146,536.52	146,536.52
项目	上年度可比期间 2022年3月2日（基金合同生效日）至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	0.00	0.00	0.00
当期购买	0.00	295,487.03	295,487.03
当期出售/结算	0.00	0.00	0.00
转入第三层次	0.00	0.00	0.00
转出第三层次	0.00	0.00	0.00
当期利得或损失总额	0.00	-24,392.81	-24,392.81
其中：计入损益的利得或损	0.00	-24,392.81	-24,392.81

失			
计入其他综合收益的利得或损失	0.00	0.00	0.00
期末余额	0.00	271,094.22	271,094.22
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	0.00	-24,392.81	-24,392.81

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

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	895,438.22	平均价格亚式期权模型	波动率	0.1855-2.1988	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
限售股票	271,094.22	平均价格亚式期权模型	波动率	0.1891-2.4756	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.15.2 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。

7.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2024 年 3 月 28 日经本基金的基金管理人批准。

§ 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	324,760,052.23	91.98
	其中：股票	324,760,052.23	91.98
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,412,558.90	0.68
	其中：债券	2,412,558.90	0.68
	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	25,271,222.10	7.16
8	其他各项资产	618,356.71	0.18
9	合计	353,062,189.94	100.00

注：权益投资中通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 27,050,947.01 元，占基金资产净值比例 7.68%。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	666,989.00	0.19
B	采矿业	4,881,099.00	1.39
C	制造业	207,005,839.11	58.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,159,835.80	2.32
E	建筑业	8,576,156.00	2.43
F	批发和零售业	7,069,793.65	2.01
G	交通运输、仓储和邮政业	5,639,461.35	1.60
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	19,245,406.48	5.46
J	金融业	10,299,414.86	2.92
K	房地产业	5,147,728.80	1.46
L	租赁和商务服务业	3,475,331.00	0.99
M	科学研究和技术服务业	5,344,424.96	1.52

N	水利、环境和公共设施管理业	4,706,278.82	1.34
O	居民服务、修理和其他服务业	257,954.00	0.07
P	教育	509,655.00	0.14
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	5,445,815.00	1.55
S	综合	1,277,922.39	0.36
	合计	297,709,105.22	84.53

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
基础材料	1,908,263.70	0.54
消费者非必需品	1,881,348.06	0.53
消费者常用品	1,787,283.33	0.51
能源	-	-
金融	-	-
医疗保健	2,324,345.55	0.66
工业	-	-
信息技术	5,399,598.60	1.53
电信服务	8,969,253.54	2.55
公用事业	2,533,066.14	0.72
地产业	2,247,788.09	0.64
合计	27,050,947.01	7.68

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

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	00700	腾讯控股	13,800	3,671,713.45	1.04
2	01024	快手-W	70,900	3,402,090.34	0.97
3	00285	比亚迪电子	72,500	2,404,654.77	0.68
4	00123	越秀地产	390,000	2,247,788.09	0.64
5	002541	鸿路钢构	99,400	2,159,962.00	0.61
6	00772	阅文集团	72,000	1,895,449.75	0.54
7	09868	小鹏汽车-W	36,600	1,880,605.87	0.53
8	02367	巨子生物	55,400	1,787,283.33	0.51
9	600316	洪都航空	83,600	1,769,812.00	0.50
10	600039	四川路桥	227,900	1,706,971.00	0.48
11	002022	科华生物	136,900	1,557,922.00	0.44
12	301391	卡莱特	13,400	1,534,032.00	0.44
13	002997	瑞鹄模具	45,000	1,499,400.00	0.43
14	01071	华电国际电力股份	472,000	1,484,243.36	0.42
15	00268	金蝶国际	132,000	1,361,287.44	0.39

16	03993	洛阳钼业	351,000	1,358,215.35	0.39
17	600064	南京高科	217,520	1,313,820.80	0.37
18	01548	金斯瑞生物科技	72,000	1,295,822.10	0.37
19	603327	福蓉科技	96,500	1,286,345.00	0.37
20	600373	中文传媒	90,600	1,194,108.00	0.34
21	601998	中信银行	225,300	1,191,837.00	0.34
22	01415	高伟电子	57,000	1,190,637.15	0.34
23	000725	京东方 A	297,100	1,158,690.00	0.33
24	601633	长城汽车	44,800	1,129,856.00	0.32
25	300981	中红医疗	68,900	1,103,778.00	0.31
26	300583	赛托生物	55,600	1,099,768.00	0.31
27	000568	泸州老窖	5,914	1,061,089.88	0.30
28	00836	华润电力	74,000	1,048,822.78	0.30
29	000932	华菱钢铁	202,800	1,044,420.00	0.30
30	000906	浙商中拓	142,600	1,042,406.00	0.30
31	688019	安集科技	6,500	1,038,440.00	0.29
32	600519	贵州茅台	600	1,035,600.00	0.29
33	601009	南京银行	137,997	1,018,417.86	0.29
34	688550	瑞联新材	25,543	1,013,546.24	0.29
35	688209	英集芯	56,484	1,008,804.24	0.29
36	002810	山东赫达	47,400	1,004,406.00	0.29
37	688167	炬光科技	8,600	980,400.00	0.28
38	603516	淳中科技	43,600	979,692.00	0.28
39	688072	拓荆科技	4,216	975,160.80	0.28
40	600941	中国移动	9,800	974,904.00	0.28
41	600755	厦门国贸	139,000	968,830.00	0.28
42	002415	海康威视	27,900	968,688.00	0.28
43	002030	达安基因	100,000	968,000.00	0.27
44	600790	轻纺城	242,700	963,519.00	0.27
45	688012	中微公司	6,221	955,545.60	0.27
46	688720	艾森股份	15,765	948,279.60	0.27
47	300556	丝路视觉	25,300	932,305.00	0.26
48	600961	株冶集团	111,500	932,140.00	0.26
49	600057	厦门象屿	138,400	928,664.00	0.26
50	301117	佳缘科技	16,900	921,219.00	0.26
51	000930	中粮科技	135,500	899,720.00	0.26
52	301312	智立方	8,200	888,388.00	0.25
53	688258	卓易信息	17,700	876,150.00	0.25
54	688687	凯因科技	24,700	861,042.00	0.24
55	300969	恒帅股份	9,500	853,765.00	0.24
56	601728	中国电信	157,800	853,698.00	0.24
57	600028	中国石化	152,200	849,276.00	0.24
58	000581	威孚高科	56,200	846,934.00	0.24

59	603071	物产环能	55,700	846,640.00	0.24
60	600741	华域汽车	51,900	844,932.00	0.24
61	600967	内蒙一机	101,800	840,868.00	0.24
62	301383	天键股份	12,900	838,500.00	0.24
63	603977	国泰集团	80,500	837,200.00	0.24
64	601098	中南传媒	82,200	835,974.00	0.24
65	600104	上汽集团	61,600	833,448.00	0.24
66	600820	隧道股份	144,400	831,744.00	0.24
67	601857	中国石油	117,400	828,844.00	0.24
68	600325	华发股份	114,900	828,429.00	0.24
69	000157	中联重科	126,700	827,351.00	0.23
70	600901	江苏金租	170,000	822,800.00	0.23
71	300779	惠城环保	15,900	820,440.00	0.23
72	601229	上海银行	137,200	819,084.00	0.23
73	002068	黑猫股份	70,600	818,960.00	0.23
74	601398	工商银行	171,100	817,858.00	0.23
75	600461	洪城环境	89,100	814,374.00	0.23
76	601658	邮储银行	186,900	813,015.00	0.23
77	601988	中国银行	203,300	811,167.00	0.23
78	601288	农业银行	222,500	809,900.00	0.23
79	601088	中国神华	25,700	805,695.00	0.23
80	300873	海晨股份	33,800	804,778.00	0.23
81	688120	华海清科	4,251	797,912.70	0.23
82	301272	英华特	14,573	791,442.74	0.22
83	600938	中国海油	37,400	784,278.00	0.22
84	605319	无锡振华	34,000	782,680.00	0.22
85	600582	天地科技	141,800	771,392.00	0.22
86	002110	三钢闽光	188,400	763,020.00	0.22
87	001309	德明利	8,000	759,120.00	0.22
88	000030	富奥股份	141,600	756,144.00	0.21
89	002446	盛路通信	91,100	756,130.00	0.21
90	001314	亿道信息	10,500	755,265.00	0.21
91	002376	新北洋	98,600	751,332.00	0.21
92	600900	长江电力	31,600	737,544.00	0.21
93	600662	外服控股	153,200	735,360.00	0.21
94	000789	万年青	107,000	734,020.00	0.21
95	002126	银轮股份	39,300	733,731.00	0.21
96	603200	上海洗霸	34,000	723,860.00	0.21
97	002061	浙江交科	197,800	721,970.00	0.20
98	688468	科美诊断	65,700	708,903.00	0.20
99	300757	罗博特科	8,700	708,093.00	0.20
100	300145	中金环境	232,300	701,546.00	0.20
101	688577	浙海德曼	7,437	700,565.40	0.20

102	300203	聚光科技	44,100	698,985.00	0.20
103	603267	鸿远电子	13,900	697,780.00	0.20
104	688981	中芯国际	13,000	689,260.00	0.20
105	003000	劲仔食品	56,300	687,986.00	0.20
106	300254	仟源医药	70,900	682,767.00	0.19
107	688313	仕佳光子	53,600	681,256.00	0.19
108	301345	涛涛车业	11,163	679,826.70	0.19
109	300700	岱勒新材	40,000	678,800.00	0.19
110	300415	伊之密	38,500	678,755.00	0.19
111	688401	路维光电	21,600	663,552.00	0.19
112	02269	药明生物	24,500	657,190.74	0.19
113	605289	罗曼股份	11,400	655,500.00	0.19
114	688260	昀冢科技	21,580	653,874.00	0.19
115	300161	华中数控	18,100	649,790.00	0.18
116	002244	滨江集团	89,300	649,211.00	0.18
117	688362	甬矽电子	24,700	646,893.00	0.18
118	603167	渤海轮渡	72,700	645,576.00	0.18
119	300818	耐普矿机	19,400	640,394.00	0.18
120	002843	泰嘉股份	24,157	640,160.50	0.18
121	002034	旺能环境	41,700	635,925.00	0.18
122	688150	莱特光电	29,264	631,809.76	0.18
123	688127	蓝特光学	26,600	619,514.00	0.18
124	600684	珠江股份	178,200	618,354.00	0.18
125	002947	恒铭达	19,100	614,638.00	0.17
126	300548	博创科技	22,700	612,219.00	0.17
127	603383	顶点软件	12,400	611,320.00	0.17
128	688078	龙软科技	15,025	605,808.00	0.17
129	603778	国晟科技	108,400	602,704.00	0.17
130	300592	华凯易佰	24,200	599,434.00	0.17
131	688278	特宝生物	11,342	593,753.70	0.17
132	300608	思特奇	35,000	593,250.00	0.17
133	002154	报喜鸟	102,800	583,904.00	0.17
134	601028	玉龙股份	54,400	582,624.00	0.17
135	688378	奥来德	12,100	572,814.00	0.16
136	002035	华帝股份	92,200	572,562.00	0.16
137	301129	瑞纳智能	21,500	572,545.00	0.16
138	603439	贵州三力	30,000	566,400.00	0.16
139	300517	海波重科	39,900	564,585.00	0.16
140	002150	通润装备	31,700	562,358.00	0.16
141	002338	奥普光电	16,700	561,955.00	0.16
142	688518	联赢激光	27,300	559,104.00	0.16
143	603322	超讯通信	14,800	558,108.00	0.16
144	603666	亿嘉和	17,700	555,603.00	0.16

145	02099	中国黄金国际	18,200	550,048.35	0.16
146	688513	苑东生物	8,576	546,977.28	0.16
147	300926	博俊科技	18,500	542,605.00	0.15
148	600757	长江传媒	72,600	540,870.00	0.15
149	002291	遥望科技	57,300	537,474.00	0.15
150	688035	德邦科技	10,000	533,600.00	0.15
151	300494	盛天网络	33,300	526,473.00	0.15
152	688048	长光华芯	8,400	526,428.00	0.15
153	300407	凯发电气	55,600	524,864.00	0.15
154	300181	佐力药业	49,000	522,340.00	0.15
155	688636	智明达	8,000	521,600.00	0.15
156	605167	利柏特	54,700	519,103.00	0.15
157	603230	内蒙新华	33,200	514,600.00	0.15
158	002991	甘源食品	7,200	514,512.00	0.15
159	300141	和顺电气	48,800	509,472.00	0.14
160	603859	能科科技	13,500	509,355.00	0.14
161	600566	济川药业	16,100	506,023.00	0.14
162	601766	中国中车	96,100	505,486.00	0.14
163	300418	昆仑万维	13,500	504,900.00	0.14
164	000661	长春高新	3,400	495,720.00	0.14
165	002891	中宠股份	18,800	495,380.00	0.14
166	300218	安利股份	36,500	494,575.00	0.14
167	300782	卓胜微	3,500	493,500.00	0.14
168	000333	美的集团	9,000	491,670.00	0.14
169	600571	信雅达	35,700	490,875.00	0.14
170	600690	海尔智家	23,200	487,200.00	0.14
171	603558	健盛集团	50,100	485,469.00	0.14
172	300654	世纪天鸿	43,000	485,040.00	0.14
173	002903	宇环数控	18,800	480,340.00	0.14
174	300213	佳讯飞鸿	66,700	480,240.00	0.14
175	002256	兆新股份	174,900	479,226.00	0.14
176	300727	润禾材料	16,600	477,914.00	0.14
177	688613	奥精医疗	21,464	477,788.64	0.14
178	688601	力芯微	9,100	476,749.00	0.14
179	601168	西部矿业	33,300	475,191.00	0.13
180	688590	新致软件	21,000	475,020.00	0.13
181	688621	阳光诺和	6,794	473,881.50	0.13
182	300315	掌趣科技	91,900	473,285.00	0.13
183	002983	芯瑞达	15,200	469,072.00	0.13
184	688611	杭州柯林	14,300	468,754.00	0.13
185	002749	国光股份	39,100	468,418.00	0.13
186	688627	精智达	5,250	468,195.00	0.13
187	002215	诺普信	56,500	466,690.00	0.13

188	600353	旭光电子	51,000	466,140.00	0.13
189	688132	邦彦技术	21,700	465,031.00	0.13
190	605128	上海沿浦	8,000	464,400.00	0.13
191	300687	赛意信息	21,300	463,914.00	0.13
192	001380	华纬科技	13,286	462,884.24	0.13
193	300539	横河精密	37,200	461,652.00	0.13
194	002646	天佑德酒	33,900	461,379.00	0.13
195	300606	金太阳	13,500	461,160.00	0.13
196	002149	西部材料	29,300	460,596.00	0.13
197	002046	国机精工	39,800	459,690.00	0.13
198	688053	思科瑞	9,200	459,448.00	0.13
199	603611	诺力股份	24,200	458,106.00	0.13
200	001306	夏厦精密	5,064	458,073.04	0.13
201	601006	大秦铁路	63,400	457,114.00	0.13
202	600499	科达制造	43,100	454,705.00	0.13
203	603009	北特科技	30,600	453,798.00	0.13
204	603699	纽威股份	32,200	446,292.00	0.13
205	300803	指南针	7,400	445,924.00	0.13
206	02382	舜宇光学科技	6,900	443,019.24	0.13
207	603330	天洋新材	58,400	442,672.00	0.13
208	688503	聚和材料	8,245	441,932.00	0.13
209	688228	开普云	6,741	441,063.63	0.13
210	300349	金卡智能	35,400	439,668.00	0.12
211	600588	用友网络	24,700	439,413.00	0.12
212	600376	首开股份	144,500	439,280.00	0.12
213	300389	艾比森	25,200	436,968.00	0.12
214	688305	科德数控	5,700	435,765.00	0.12
215	300882	万胜智能	17,800	433,608.00	0.12
216	605016	百龙创园	15,232	432,436.48	0.12
217	603388	元成股份	47,400	428,496.00	0.12
218	688529	豪森智能	18,419	424,926.33	0.12
219	601928	凤凰传媒	48,200	424,642.00	0.12
220	300522	世名科技	31,300	422,550.00	0.12
221	301188	力诺特玻	23,500	420,415.00	0.12
222	605098	行动教育	10,900	420,195.00	0.12
223	600603	广汇物流	54,000	420,120.00	0.12
224	300795	米奥会展	11,300	416,631.00	0.12
225	000977	浪潮信息	12,500	415,000.00	0.12
226	300158	振东制药	61,400	414,450.00	0.12
227	600323	瀚蓝环境	23,700	410,721.00	0.12
228	688103	国力股份	8,300	409,854.00	0.12
229	301349	信德新材	8,700	409,596.00	0.12
230	300928	华安鑫创	8,100	408,564.00	0.12

231	300206	理邦仪器	40,000	408,400.00	0.12
232	001269	欧晶科技	7,600	406,220.00	0.12
233	600919	江苏银行	60,500	404,745.00	0.11
234	600997	开滦股份	52,964	404,115.32	0.11
235	601169	北京银行	89,200	404,076.00	0.11
236	688059	华锐精密	5,100	401,421.00	0.11
237	603878	武进不锈	53,152	401,297.60	0.11
238	300545	联得装备	11,600	400,780.00	0.11
239	688323	瑞华泰	18,600	399,342.00	0.11
240	601818	光大银行	137,400	398,460.00	0.11
241	600000	浦发银行	60,100	397,862.00	0.11
242	600674	川投能源	26,300	397,656.00	0.11
243	002208	合肥城建	61,600	394,856.00	0.11
244	600282	南钢股份	106,700	394,790.00	0.11
245	600398	海澜之家	53,200	394,744.00	0.11
246	600795	国电电力	94,800	394,368.00	0.11
247	688393	安必平	15,701	392,053.97	0.11
248	688115	思林杰	11,300	391,771.00	0.11
249	688239	航宇科技	8,200	391,714.00	0.11
250	601328	交通银行	68,200	391,468.00	0.11
251	002452	长高电新	54,900	389,790.00	0.11
252	601636	旗滨集团	56,900	389,196.00	0.11
253	601019	山东出版	41,400	388,332.00	0.11
254	300366	创意信息	29,500	387,040.00	0.11
255	600251	冠农股份	44,300	384,967.00	0.11
256	688182	灿勤科技	21,400	380,492.00	0.11
257	300833	浩洋股份	4,200	378,420.00	0.11
258	600350	山东高速	54,400	377,536.00	0.11
259	301193	家联科技	22,200	376,956.00	0.11
260	300228	富瑞特装	52,900	375,590.00	0.11
261	603868	飞科电器	7,400	373,700.00	0.11
262	688631	莱斯信息	10,600	373,650.00	0.11
263	603408	建霖家居	29,100	373,644.00	0.11
264	300295	三六五网	30,200	372,366.00	0.11
265	000786	北新建材	15,900	371,424.00	0.11
266	03692	翰森制药	26,000	371,332.71	0.11
267	301096	百诚医药	5,700	371,070.00	0.11
268	603225	新凤鸣	26,100	370,620.00	0.11
269	688698	伟创电气	10,200	370,566.00	0.11
270	688676	金盘科技	10,300	369,049.00	0.10
271	301004	嘉益股份	8,100	368,145.00	0.10
272	688330	宏力达	12,900	366,489.00	0.10
273	001218	丽臣实业	16,900	365,209.00	0.10

274	603500	祥和实业	29,700	363,825.00	0.10
275	300280	紫天科技	8,500	363,205.00	0.10
276	300384	三联虹普	22,700	362,292.00	0.10
277	000700	模塑科技	51,700	361,900.00	0.10
278	301313	凡拓数创	10,000	360,600.00	0.10
279	300857	协创数据	6,800	360,332.00	0.10
280	300996	普联软件	15,700	359,530.00	0.10
281	300729	乐歌股份	20,000	358,200.00	0.10
282	688093	世华科技	19,500	355,095.00	0.10
283	603725	天安新材	31,800	353,934.00	0.10
284	600529	山东药玻	13,800	353,280.00	0.10
285	603059	倍加洁	15,600	351,936.00	0.10
286	603901	永创智能	29,400	349,860.00	0.10
287	688361	中科飞测	4,700	349,821.00	0.10
288	300054	鼎龙股份	14,400	348,480.00	0.10
289	605287	德才股份	20,500	347,885.00	0.10
290	000090	天健集团	75,600	347,760.00	0.10
291	600177	雅戈尔	52,900	346,495.00	0.10
292	600886	国投电力	26,100	343,998.00	0.10
293	601985	中国核电	45,700	342,750.00	0.10
294	603826	坤彩科技	5,800	342,374.00	0.10
295	601233	桐昆股份	22,500	340,425.00	0.10
296	000019	深粮控股	45,100	340,054.00	0.10
297	688311	盟升电子	6,664	339,930.64	0.10
298	603239	浙江仙通	22,100	337,467.00	0.10
299	603929	亚翔集成	14,100	337,272.00	0.10
300	600079	人福医药	13,500	335,610.00	0.10
301	603600	永艺股份	30,300	334,512.00	0.09
302	688153	唯捷创芯	5,100	334,050.00	0.09
303	603369	今世缘	6,800	331,500.00	0.09
304	301000	肇民科技	15,500	331,080.00	0.09
305	688429	时创能源	15,506	328,572.14	0.09
306	002092	中泰化学	53,600	326,960.00	0.09
307	688320	禾川科技	7,835	321,235.00	0.09
308	300260	新莱应材	10,500	319,515.00	0.09
309	600592	龙溪股份	27,400	315,374.00	0.09
310	301050	雷电微力	5,400	314,604.00	0.09
311	300042	朗科科技	8,800	308,000.00	0.09
312	603660	苏州科达	35,000	307,650.00	0.09
313	601137	博威合金	19,700	305,941.00	0.09
314	688136	科兴制药	15,100	305,775.00	0.09
315	000893	亚钾国际	11,600	304,384.00	0.09
316	600572	康恩贝	60,200	304,010.00	0.09

317	002875	安奈儿	20,400	303,756.00	0.09
318	000551	创元科技	28,937	302,970.39	0.09
319	603658	安图生物	5,300	302,153.00	0.09
320	688356	键凯科技	2,839	302,069.60	0.09
321	300501	海顺新材	20,900	301,587.00	0.09
322	605369	拱东医疗	5,400	301,428.00	0.09
323	688571	杭华股份	40,200	300,696.00	0.09
324	603848	好太太	19,400	300,312.00	0.09
325	002296	辉煌科技	36,400	300,300.00	0.09
326	301056	森赫股份	29,000	296,380.00	0.08
327	300902	国安达	8,400	296,100.00	0.08
328	600379	宝光股份	29,200	293,460.00	0.08
329	600377	宁沪高速	28,600	293,150.00	0.08
330	300241	瑞丰光电	51,700	291,071.00	0.08
331	300693	盛弘股份	9,700	290,127.00	0.08
332	603589	口子窖	6,400	289,920.00	0.08
333	601100	恒立液压	5,300	289,804.00	0.08
334	300335	迪森股份	51,483	288,304.80	0.08
335	688328	深科达	6,400	287,040.00	0.08
336	605333	沪光股份	14,400	286,560.00	0.08
337	002062	宏润建设	64,600	286,178.00	0.08
338	688596	正帆科技	7,200	285,336.00	0.08
339	600101	明星电力	33,900	285,099.00	0.08
340	600579	克劳斯	39,100	283,866.00	0.08
341	605288	凯迪股份	6,000	282,720.00	0.08
342	000612	焦作万方	49,100	282,325.00	0.08
343	002448	中原内配	42,500	282,200.00	0.08
344	300997	欢乐家	20,100	280,797.00	0.08
345	603111	康尼机电	50,100	279,057.00	0.08
346	600073	上海梅林	40,900	278,529.00	0.08
347	002083	孚日股份	55,200	278,208.00	0.08
348	002753	永东股份	33,700	278,025.00	0.08
349	300105	龙源技术	40,900	277,711.00	0.08
350	601113	华鼎股份	80,900	277,487.00	0.08
351	603890	春秋电子	24,100	275,945.00	0.08
352	603530	神马电力	13,300	275,842.00	0.08
353	000404	长虹华意	46,800	275,652.00	0.08
354	000708	中信特钢	19,600	275,184.00	0.08
355	688306	均普智能	49,300	274,601.00	0.08
356	002119	康强电子	20,500	274,085.00	0.08
357	601512	中新集团	35,400	272,934.00	0.08
358	000531	穗恒运 A	40,700	272,283.00	0.08
359	600737	中粮糖业	33,000	271,920.00	0.08

360	300471	厚普股份	19,700	271,663.00	0.08
361	603130	云中马	12,600	271,530.00	0.08
362	300323	华灿光电	37,000	270,840.00	0.08
363	688668	鼎通科技	4,889	270,459.48	0.08
364	300337	银邦股份	33,300	269,397.00	0.08
365	603109	神驰机电	16,400	269,288.00	0.08
366	688595	芯海科技	6,199	268,416.70	0.08
367	001267	汇绿生态	51,200	267,776.00	0.08
368	603300	华铁应急	41,775	267,360.00	0.08
369	688097	博众精工	7,948	267,052.80	0.08
370	600847	万里股份	22,400	267,008.00	0.08
371	600620	天宸股份	28,400	266,960.00	0.08
372	605007	五洲特纸	18,100	266,251.00	0.08
373	000791	甘肃能源	47,800	266,246.00	0.08
374	600217	中再资环	60,600	265,428.00	0.08
375	300125	聆达股份	21,000	264,810.00	0.08
376	002759	天际股份	24,900	264,189.00	0.08
377	002847	盐津铺子	3,800	264,024.00	0.07
378	300092	科新机电	19,800	263,736.00	0.07
379	688553	汇宇制药	17,356	262,596.28	0.07
380	603012	创力集团	44,400	262,404.00	0.07
381	300546	雄帝科技	16,600	261,782.00	0.07
382	300578	会畅通讯	14,600	260,756.00	0.07
383	002297	博云新材	32,700	260,619.00	0.07
384	002028	思源电气	5,000	260,200.00	0.07
385	300890	翔丰华	7,500	259,350.00	0.07
386	300787	海能实业	15,400	259,028.00	0.07
387	600903	贵州燃气	32,800	258,792.00	0.07
388	600501	航天晨光	18,900	258,552.00	0.07
389	603556	海兴电力	8,900	258,367.00	0.07
390	688289	圣湘生物	13,200	258,060.00	0.07
391	300736	百邦科技	20,200	257,954.00	0.07
392	300472	新元科技	27,300	257,712.00	0.07
393	300072	海新能科	73,100	256,581.00	0.07
394	688533	上声电子	6,700	255,404.00	0.07
395	002079	苏州固锟	22,600	254,928.00	0.07
396	002096	易普力	24,600	254,856.00	0.07
397	300120	经纬辉开	35,100	254,826.00	0.07
398	002441	众业达	26,900	254,743.00	0.07
399	600575	淮河能源	105,700	254,737.00	0.07
400	000925	众合科技	29,400	254,604.00	0.07
401	001696	宗申动力	38,400	254,592.00	0.07
402	301368	丰立智能	5,400	254,556.00	0.07

403	000881	中广核技	35,100	254,475.00	0.07
404	300021	大禹节水	53,400	254,184.00	0.07
405	300793	佳禾智能	11,700	254,007.00	0.07
406	000899	赣能股份	32,800	253,872.00	0.07
407	002204	大连重工	55,500	253,635.00	0.07
408	002197	证通电子	24,400	253,516.00	0.07
409	300266	兴源环境	93,800	253,260.00	0.07
410	300871	回盛生物	17,500	253,050.00	0.07
411	688660	电气风电	49,214	252,959.96	0.07
412	300401	花园生物	21,400	252,734.00	0.07
413	605222	起帆电缆	13,100	252,568.00	0.07
414	002838	道恩股份	19,700	252,357.00	0.07
415	002971	和远气体	9,100	252,252.00	0.07
416	300838	浙江力诺	15,400	251,944.00	0.07
417	002757	南兴股份	16,100	251,804.00	0.07
418	002454	松芝股份	33,500	251,585.00	0.07
419	600180	瑞茂通	41,300	251,517.00	0.07
420	601011	宝泰隆	71,700	250,950.00	0.07
421	002342	巨力索具	58,200	250,842.00	0.07
422	300365	恒华科技	37,100	250,796.00	0.07
423	300520	科大国创	11,500	250,010.00	0.07
424	601609	金田股份	36,900	249,813.00	0.07
425	300040	九洲集团	44,600	249,760.00	0.07
426	600590	泰豪科技	37,300	249,164.00	0.07
427	300437	清水源	19,800	248,886.00	0.07
428	688165	埃夫特	21,700	248,682.00	0.07
429	002090	金智科技	24,900	248,502.00	0.07
430	300531	优博讯	16,200	248,346.00	0.07
431	002023	海特高新	27,200	247,520.00	0.07
432	300790	宇瞳光学	15,200	247,304.00	0.07
433	000901	航天科技	26,500	246,980.00	0.07
434	300792	壹网壹创	10,300	246,891.00	0.07
435	300397	天和防务	23,900	246,648.00	0.07
436	300352	北信源	51,900	246,525.00	0.07
437	002286	保龄宝	30,300	246,036.00	0.07
438	688681	科汇股份	15,900	245,655.00	0.07
439	002444	巨星科技	10,900	245,468.00	0.07
440	601107	四川成渝	55,900	245,401.00	0.07
441	002239	奥特佳	75,500	245,375.00	0.07
442	300274	阳光电源	2,800	245,252.00	0.07
443	002190	成飞集成	12,900	244,713.00	0.07
444	600017	日照港	88,900	244,475.00	0.07
445	002327	富安娜	27,300	244,335.00	0.07

446	688603	天承科技	3,251	243,759.98	0.07
447	300962	中金辐照	15,700	243,664.00	0.07
448	688108	赛诺医疗	19,400	243,470.00	0.07
449	301360	荣旗科技	2,600	243,360.00	0.07
450	000039	中集集团	31,800	243,270.00	0.07
451	603387	基蛋生物	22,100	243,100.00	0.07
452	601500	通用股份	58,600	242,604.00	0.07
453	301116	益客食品	18,900	242,298.00	0.07
454	000534	万泽股份	18,500	242,165.00	0.07
455	301175	中科环保	48,500	242,015.00	0.07
456	002412	汉森制药	35,600	241,368.00	0.07
457	603992	松霖科技	13,300	241,262.00	0.07
458	301377	鼎泰高科	10,200	241,230.00	0.07
459	688383	新益昌	2,300	241,017.00	0.07
460	603227	雪峰科技	34,900	240,810.00	0.07
461	300278	华昌达	62,900	240,278.00	0.07
462	002111	威海广泰	26,500	240,090.00	0.07
463	300783	三只松鼠	13,300	240,065.00	0.07
464	300124	汇川技术	3,800	239,932.00	0.07
465	688519	南亚新材	9,300	239,568.00	0.07
466	002017	东信和平	23,000	239,430.00	0.07
467	002326	永太科技	20,600	239,372.00	0.07
468	603126	中材节能	35,500	239,270.00	0.07
469	300867	圣元环保	15,000	239,250.00	0.07
470	300318	博晖创新	38,300	238,992.00	0.07
471	300197	节能铁汉	114,800	237,636.00	0.07
472	300131	英唐智控	39,500	237,395.00	0.07
473	002067	景兴纸业	70,000	237,300.00	0.07
474	688018	乐鑫科技	2,300	236,785.00	0.07
475	002404	嘉欣丝绸	39,200	236,768.00	0.07
476	002562	兄弟科技	58,600	236,744.00	0.07
477	688580	伟思医疗	3,700	236,541.00	0.07
478	300963	中洲特材	18,000	236,160.00	0.07
479	300485	赛升药业	22,300	236,157.00	0.07
480	002969	嘉美包装	57,300	236,076.00	0.07
481	600279	重庆港	53,000	235,850.00	0.07
482	002225	濮耐股份	62,300	235,494.00	0.07
483	688296	和达科技	13,100	235,407.00	0.07
484	002093	国脉科技	31,300	235,376.00	0.07
485	002723	小崧股份	23,000	235,290.00	0.07
486	600420	国药现代	24,000	234,960.00	0.07
487	300789	唐源电气	10,400	234,416.00	0.07
488	300752	隆利科技	12,900	234,393.00	0.07

489	002735	王子新材	18,000	234,000.00	0.07
490	600664	哈药股份	69,800	233,830.00	0.07
491	002540	亚太科技	35,300	233,333.00	0.07
492	300099	尤洛卡	37,523	232,267.37	0.07
493	603099	长白山	15,500	232,190.00	0.07
494	600955	维远股份	12,900	231,555.00	0.07
495	600736	苏州高新	48,600	231,336.00	0.07
496	002831	裕同科技	8,400	231,084.00	0.07
497	002009	天奇股份	15,300	230,877.00	0.07
498	600809	山西汾酒	1,000	230,730.00	0.07
499	002965	祥鑫科技	5,600	230,552.00	0.07
500	300129	泰胜风能	21,400	230,478.00	0.07
501	000063	中兴通讯	8,700	230,376.00	0.07
502	600551	时代出版	21,100	229,779.00	0.07
503	002933	新兴装备	6,300	229,635.00	0.07
504	000657	中钨高新	27,000	228,960.00	0.07
505	603297	永新光学	2,300	228,505.00	0.06
506	300977	深圳瑞捷	12,200	228,018.00	0.06
507	601689	拓普集团	3,100	227,850.00	0.06
508	688041	海光信息	3,200	227,136.00	0.06
509	002421	达实智能	70,400	226,688.00	0.06
510	603339	四方科技	19,000	225,910.00	0.06
511	000607	华媒控股	49,300	225,794.00	0.06
512	002626	金达威	13,800	225,354.00	0.06
513	300523	辰安科技	11,100	225,330.00	0.06
514	300239	东宝生物	36,100	224,903.00	0.06
515	002226	江南化工	51,200	224,256.00	0.06
516	300831	派瑞股份	18,200	223,132.00	0.06
517	600403	大有能源	58,700	223,060.00	0.06
518	002015	协鑫能科	18,000	222,840.00	0.06
519	000993	闽东电力	21,800	222,360.00	0.06
520	003026	中晶科技	6,200	221,960.00	0.06
521	002102	冠福股份	81,900	221,949.00	0.06
522	603759	海天股份	26,700	221,877.00	0.06
523	688247	宣泰医药	20,200	221,796.00	0.06
524	301220	亚香股份	6,700	221,435.00	0.06
525	002546	新联电子	44,200	221,000.00	0.06
526	000731	四川美丰	29,800	220,520.00	0.06
527	600283	钱江水利	17,500	220,325.00	0.06
528	002920	德赛西威	1,700	220,167.00	0.06
529	000055	方大集团	48,700	220,124.00	0.06
530	300189	神农科技	66,900	220,101.00	0.06
531	688211	中科微至	6,000	220,020.00	0.06

532	300802	矩子科技	11,500	219,880.00	0.06
533	000949	新乡化纤	67,900	219,317.00	0.06
534	300020	银江技术	26,400	219,120.00	0.06
535	300117	嘉寓股份	75,500	218,950.00	0.06
536	300259	新天科技	60,300	218,889.00	0.06
537	603903	中持股份	22,100	218,348.00	0.06
538	002728	特一药业	12,140	217,548.80	0.06
539	600880	博瑞传播	43,400	217,434.00	0.06
540	601133	柏诚股份	16,500	217,305.00	0.06
541	603255	鼎际得	5,800	216,340.00	0.06
542	300813	泰林生物	8,800	215,776.00	0.06
543	000722	湖南发展	22,400	215,264.00	0.06
544	688013	天臣医疗	10,200	215,220.00	0.06
545	688380	中微半导	9,000	214,740.00	0.06
546	605388	均瑶健康	17,000	213,180.00	0.06
547	002666	德联集团	39,400	212,760.00	0.06
548	301235	华康医疗	8,300	212,729.00	0.06
549	600480	凌云股份	23,300	212,263.00	0.06
550	300722	新余国科	8,100	212,139.00	0.06
551	688081	兴图新科	12,280	211,338.80	0.06
552	000625	长安汽车	12,500	210,375.00	0.06
553	002463	沪电股份	9,500	210,140.00	0.06
554	301199	迈赫股份	8,000	210,000.00	0.06
555	002730	电光科技	22,100	209,508.00	0.06
556	002166	莱茵生物	26,900	209,013.00	0.06
557	688159	有方科技	5,539	208,543.35	0.06
558	603053	成都燃气	20,200	206,848.00	0.06
559	000807	云铝股份	16,900	206,518.00	0.06
560	000601	韶能股份	48,200	206,296.00	0.06
561	000078	海王生物	64,800	203,472.00	0.06
562	300085	银之杰	14,200	203,344.00	0.06
563	600150	中国船舶	6,900	203,136.00	0.06
564	603112	华翔股份	16,600	201,690.00	0.06
565	300662	科锐国际	7,300	201,626.00	0.06
566	300743	天地数码	14,500	201,260.00	0.06
567	002262	恩华药业	7,400	200,688.00	0.06
568	000933	神火股份	11,900	199,920.00	0.06
569	601121	宝地矿业	28,200	199,092.00	0.06
570	688038	中科通达	13,809	198,987.69	0.06
571	600429	三元股份	44,600	198,916.00	0.06
572	000680	山推股份	40,200	198,588.00	0.06
573	300826	测绘股份	10,900	196,963.00	0.06
574	603308	应流股份	13,700	196,321.00	0.06

575	001231	农心科技	9,400	195,802.00	0.06
576	300980	祥源新材	8,300	194,718.00	0.06
577	002727	一心堂	8,400	194,544.00	0.06
578	300889	爱克股份	11,500	193,200.00	0.05
579	600019	宝钢股份	32,500	192,725.00	0.05
580	601601	中国太保	8,100	192,618.00	0.05
581	600435	北方导航	16,400	192,536.00	0.05
582	002929	润建股份	4,600	191,958.00	0.05
583	300308	中际旭创	1,700	191,947.00	0.05
584	601668	中国建筑	39,900	191,919.00	0.05
585	603378	亚士创能	22,600	191,196.00	0.05
586	603688	石英股份	2,200	191,136.00	0.05
587	688652	京仪装备	3,208	190,818.00	0.05
588	601127	赛力斯	2,500	190,500.00	0.05
589	688543	国科军工	3,400	190,060.00	0.05
590	000921	海信家电	9,200	187,680.00	0.05
591	002568	百润股份	7,600	187,036.00	0.05
592	003002	壶化股份	12,300	186,837.00	0.05
593	002508	老板电器	8,530	185,783.40	0.05
594	603163	圣晖集成	5,600	185,528.00	0.05
595	002367	康力电梯	24,600	184,992.00	0.05
596	603757	大元泵业	7,600	184,224.00	0.05
597	000619	海螺新材	26,500	183,380.00	0.05
598	000777	中核科技	12,600	183,204.00	0.05
599	600641	万业企业	10,600	182,956.00	0.05
600	000533	顺钠股份	38,900	182,441.00	0.05
601	002852	道道全	16,800	181,776.00	0.05
602	300609	汇纳科技	6,600	180,180.00	0.05
603	301168	通灵股份	3,900	180,024.00	0.05
604	300062	中能电气	28,600	178,178.00	0.05
605	002151	北斗星通	5,600	176,848.00	0.05
606	603298	杭叉集团	7,100	176,648.00	0.05
607	603020	爱普股份	21,100	176,396.00	0.05
608	688548	广钢气体	13,500	176,310.00	0.05
609	603758	秦安股份	15,400	176,176.00	0.05
610	605599	莱百股份	11,800	175,702.00	0.05
611	600060	海信视像	8,400	175,560.00	0.05
612	688578	艾力斯	4,200	174,972.00	0.05
613	603915	国茂股份	10,600	174,688.00	0.05
614	688028	沃尔德	7,000	174,230.00	0.05
615	002074	国轩高科	8,100	174,150.00	0.05
616	300462	华铭智能	14,700	173,313.00	0.05
617	688009	中国通号	39,500	173,010.00	0.05

618	300970	华绿生物	10,000	172,600.00	0.05
619	600356	恒丰纸业	21,600	172,368.00	0.05
620	603183	建研院	36,800	171,856.00	0.05
621	688556	高测股份	4,400	171,556.00	0.05
622	688096	京源环保	18,300	171,471.00	0.05
623	600262	北方股份	8,900	171,325.00	0.05
624	003023	彩虹集团	8,400	170,184.00	0.05
625	603319	湘油泵	9,700	170,138.00	0.05
626	688169	石头科技	600	169,770.00	0.05
627	688656	浩欧博	4,871	169,315.96	0.05
628	300898	熊猫乳品	7,000	169,120.00	0.05
629	002544	普天科技	8,300	168,656.00	0.05
630	002722	物产金轮	10,900	167,969.00	0.05
631	002351	漫步者	9,500	167,865.00	0.05
632	601921	浙版传媒	21,900	167,316.00	0.05
633	603062	麦加芯彩	2,682	167,084.42	0.05
634	603027	千禾味业	10,300	166,551.00	0.05
635	600391	航发科技	8,600	164,432.00	0.05
636	688410	山外山	5,600	163,520.00	0.05
637	002611	东方精工	32,800	162,688.00	0.05
638	603289	泰瑞机器	14,700	162,288.00	0.05
639	603707	健友股份	10,800	162,000.00	0.05
640	603366	日出东方	26,000	161,980.00	0.05
641	300162	雷曼光电	19,900	161,190.00	0.05
642	688037	芯源微	1,200	160,332.00	0.05
643	002851	麦格米特	6,500	159,900.00	0.05
644	601890	亚星锚链	16,000	158,400.00	0.04
645	001217	华尔泰	11,200	158,144.00	0.04
646	603197	保隆科技	2,800	157,920.00	0.04
647	603179	新泉股份	3,100	157,201.00	0.04
648	300033	同花顺	1,000	156,870.00	0.04
649	000715	中兴商业	21,400	156,434.00	0.04
650	300272	开能健康	25,100	155,620.00	0.04
651	300394	天孚通信	1,700	155,584.00	0.04
652	601699	潞安环能	7,100	155,561.00	0.04
653	002123	梦网科技	13,900	154,985.00	0.04
654	600642	申能股份	24,100	154,722.00	0.04
655	688626	翔宇医疗	2,900	154,541.00	0.04
656	300016	北陆药业	21,700	154,504.00	0.04
657	300580	贝斯特	5,100	154,428.00	0.04
658	600644	乐山电力	22,100	153,816.00	0.04
659	688510	航亚科技	8,700	153,294.00	0.04
660	600805	悦达投资	30,000	153,000.00	0.04

661	603170	宝立食品	9,000	152,190.00	0.04
662	300800	力合科技	11,100	151,737.00	0.04
663	300967	晓鸣股份	10,600	151,368.00	0.04
664	300741	华宝股份	7,000	149,870.00	0.04
665	002091	江苏国泰	19,100	149,553.00	0.04
666	000589	贵州轮胎	24,400	149,328.00	0.04
667	301237	和顺科技	4,900	149,303.00	0.04
668	600276	恒瑞医药	3,300	149,259.00	0.04
669	688472	阿特斯	11,814	149,210.82	0.04
670	002358	森源电气	34,300	149,205.00	0.04
671	605300	佳禾食品	9,500	148,770.00	0.04
672	600711	盛屯矿业	34,200	148,428.00	0.04
673	300862	蓝盾光电	3,500	147,840.00	0.04
674	600717	天津港	35,900	147,549.00	0.04
675	001286	陕西能源	17,200	147,060.00	0.04
676	300419	浩丰科技	24,800	146,320.00	0.04
677	603596	伯特利	2,100	145,530.00	0.04
678	601568	北元集团	30,700	145,518.00	0.04
679	000521	长虹美菱	25,800	145,254.00	0.04
680	001219	青岛食品	6,300	145,215.00	0.04
681	301027	华蓝集团	11,600	145,116.00	0.04
682	301022	海泰科	5,300	144,584.00	0.04
683	002879	长缆科技	9,000	144,180.00	0.04
684	603093	南华期货	12,000	144,000.00	0.04
685	603511	爱慕股份	9,300	143,964.00	0.04
686	000027	深圳能源	22,300	143,835.00	0.04
687	603121	华培动力	13,200	143,484.00	0.04
688	003004	声迅股份	4,700	143,209.00	0.04
689	300376	易事特	22,400	142,688.00	0.04
690	001212	中旗新材	6,000	142,560.00	0.04
691	600502	安徽建工	30,600	142,290.00	0.04
692	001210	金房能源	7,200	142,200.00	0.04
693	300644	南京聚隆	6,800	141,100.00	0.04
694	301002	崧盛股份	6,800	141,032.00	0.04
695	300111	向日葵	46,300	140,752.00	0.04
696	002418	康盛股份	50,400	140,616.00	0.04
697	603233	大参林	5,640	140,436.00	0.04
698	601717	郑煤机	11,100	140,415.00	0.04
699	601975	招商南油	50,100	140,280.00	0.04
700	605080	浙江自然	6,600	139,722.00	0.04
701	002088	鲁阳节能	9,800	139,650.00	0.04
702	688679	通源环境	10,800	138,564.00	0.04
703	000400	许继电气	6,300	138,348.00	0.04

704	002029	七匹狼	24,100	138,093.00	0.04
705	603680	今创集团	14,600	137,970.00	0.04
706	001336	楚环科技	4,800	137,856.00	0.04
707	002169	智光电气	20,000	137,600.00	0.04
708	688610	埃科光电	2,652	137,460.00	0.04
709	002408	齐翔腾达	26,000	137,280.00	0.04
710	300004	南风股份	22,200	137,196.00	0.04
711	000811	冰轮环境	10,100	137,057.00	0.04
712	002320	海峡股份	23,500	137,005.00	0.04
713	600010	包钢股份	93,600	136,656.00	0.04
714	000709	河钢股份	64,100	136,533.00	0.04
715	002282	博深股份	16,800	136,080.00	0.04
716	601126	四方股份	9,600	135,936.00	0.04
717	300677	英科医疗	5,800	135,488.00	0.04
717	600538	国发股份	29,200	135,488.00	0.04
718	002717	岭南股份	41,900	135,337.00	0.04
719	301390	经纬股份	3,100	134,881.00	0.04
720	600673	东阳光	18,400	134,872.00	0.04
721	002734	利民股份	16,900	134,693.00	0.04
722	001288	运机集团	8,000	134,560.00	0.04
723	300122	智飞生物	2,200	134,442.00	0.04
724	002520	日发精机	20,400	134,232.00	0.04
725	301196	唯科科技	3,900	134,082.00	0.04
726	301127	天源环保	12,200	134,078.00	0.04
727	603976	正川股份	6,800	134,028.00	0.04
728	601608	中信重工	34,700	133,942.00	0.04
729	600110	诺德股份	23,700	133,668.00	0.04
730	600281	华阳新材	28,800	133,632.00	0.04
731	600221	海航控股	97,400	133,438.00	0.04
732	600505	西昌电力	15,700	133,293.00	0.04
733	300086	康芝药业	22,700	133,249.00	0.04
734	300502	新易盛	2,700	133,164.00	0.04
735	603100	川仪股份	4,800	133,056.00	0.04
736	300604	长川科技	3,500	132,965.00	0.04
737	001965	招商公路	13,600	132,872.00	0.04
738	002183	怡亚通	29,600	132,608.00	0.04
739	603606	东方电缆	3,100	132,525.00	0.04
740	600011	华能国际	17,200	132,440.00	0.04
741	000016	深康佳 A	31,700	132,189.00	0.04
742	002389	航天彩虹	7,100	132,060.00	0.04
743	688538	和辉光电	54,311	131,975.73	0.04
744	300217	东方电热	24,500	131,810.00	0.04
745	603956	威派格	16,600	131,804.00	0.04

746	601866	中远海发	56,200	131,508.00	0.04
747	002402	和而泰	9,200	131,468.00	0.04
748	603886	元祖股份	7,200	131,256.00	0.04
749	603689	皖天然气	15,100	131,219.00	0.04
750	600066	宇通客车	9,900	131,175.00	0.04
751	002996	顺博合金	12,000	131,040.00	0.04
752	301222	浙江恒威	4,400	130,812.00	0.04
753	300676	华大基因	2,700	129,600.00	0.04
754	688269	凯立新材	3,500	129,535.00	0.04
755	688008	澜起科技	2,200	129,272.00	0.04
756	688357	建龙微纳	2,500	129,225.00	0.04
757	603236	移远通信	2,400	129,000.00	0.04
758	600271	航天信息	12,100	128,744.00	0.04
759	300983	尤安设计	4,200	128,646.00	0.04
760	600056	中国医药	11,500	128,455.00	0.04
761	300371	汇中股份	10,500	127,995.00	0.04
762	601061	中信金属	16,600	127,986.00	0.04
763	002011	盾安环境	9,300	127,875.00	0.04
764	002136	安纳达	11,000	127,820.00	0.04
764	605196	华通线缆	16,600	127,820.00	0.04
765	000723	美锦能源	19,100	127,206.00	0.04
766	301201	诚达药业	5,000	127,150.00	0.04
767	600188	兖矿能源	6,400	126,784.00	0.04
768	600273	嘉化能源	14,700	126,273.00	0.04
769	600681	百川能源	32,000	125,760.00	0.04
770	688175	高凌信息	4,500	125,685.00	0.04
771	301223	中荣股份	6,900	125,028.00	0.04
772	600744	华银电力	38,500	124,740.00	0.04
773	002650	加加食品	30,500	124,440.00	0.04
774	688567	孚能科技	7,600	123,956.00	0.04
775	000911	广农糖业	15,200	123,880.00	0.04
776	603026	胜华新材	2,700	123,822.00	0.04
777	002249	大洋电机	24,900	123,753.00	0.04
778	600872	中炬高新	4,400	123,640.00	0.04
779	688772	珠海冠宇	5,600	123,256.00	0.03
780	002516	旷达科技	25,000	123,250.00	0.03
781	000985	大庆华科	7,600	122,968.00	0.03
782	605296	神农集团	4,000	122,920.00	0.03
783	600933	爱柯迪	5,600	122,864.00	0.03
784	688200	华峰测控	1,000	122,800.00	0.03
785	688010	福光股份	5,100	122,706.00	0.03
786	300567	精测电子	1,400	122,668.00	0.03
787	601727	上海电气	29,400	122,598.00	0.03

788	002459	晶澳科技	5,900	122,248.00	0.03
789	000651	格力电器	3,800	122,246.00	0.03
790	000529	广弘控股	18,000	122,220.00	0.03
791	002255	海陆重工	23,100	122,199.00	0.03
792	002492	恒基达鑫	20,400	122,196.00	0.03
793	688433	华曙高科	3,900	121,875.00	0.03
794	002779	中坚科技	4,900	121,863.00	0.03
795	001333	光华股份	5,500	121,770.00	0.03
796	603296	华勤技术	1,526	121,428.50	0.03
797	000720	新能泰山	29,300	121,302.00	0.03
798	300281	金明精机	20,200	120,998.00	0.03
799	605122	四方新材	7,500	120,975.00	0.03
800	301200	大族数控	3,200	120,864.00	0.03
801	002228	合兴包装	35,200	120,736.00	0.03
802	002777	久远银海	4,800	120,528.00	0.03
802	600406	国电南瑞	5,400	120,528.00	0.03
803	002078	太阳纸业	9,900	120,483.00	0.03
804	600917	重庆燃气	18,700	120,428.00	0.03
805	002014	永新股份	14,400	120,240.00	0.03
806	688485	九州一轨	8,600	120,228.00	0.03
807	688051	佳华科技	3,600	120,060.00	0.03
808	300430	诚益通	8,400	120,036.00	0.03
809	603997	继峰股份	8,900	119,883.00	0.03
810	002131	利欧股份	52,500	119,700.00	0.03
811	002109	兴化股份	25,200	119,448.00	0.03
812	688585	上纬新材	14,100	119,427.00	0.03
813	301061	匠心家居	2,400	119,400.00	0.03
814	002298	中电兴发	20,700	119,232.00	0.03
815	688099	晶晨股份	1,900	118,997.00	0.03
816	300932	三友联众	7,300	118,844.00	0.03
817	301063	海锅股份	5,200	118,560.00	0.03
817	600475	华光环能	11,400	118,560.00	0.03
818	688130	晶华微	2,900	118,465.00	0.03
819	002884	凌霄泵业	6,800	118,048.00	0.03
820	603192	汇得科技	6,000	117,900.00	0.03
821	603010	万盛股份	10,900	117,611.00	0.03
822	000559	万向钱潮	22,600	117,294.00	0.03
823	688230	芯导科技	2,800	117,152.00	0.03
824	600036	招商银行	4,200	116,844.00	0.03
825	002268	电科网安	5,200	116,792.00	0.03
826	301210	金杨股份	2,567	116,747.16	0.03
827	603806	福斯特	4,800	116,496.00	0.03
828	000761	本钢板材	32,600	116,382.00	0.03

829	600285	羚锐制药	6,800	116,348.00	0.03
830	603839	安正时尚	14,000	116,200.00	0.03
831	300943	春晖智控	8,100	116,154.00	0.03
832	688087	英科再生	4,823	116,137.84	0.03
833	003018	金富科技	10,900	116,085.00	0.03
834	300458	全志科技	5,100	115,719.00	0.03
835	300834	星辉环材	5,400	115,452.00	0.03
836	688597	煜邦电力	12,684	115,424.40	0.03
837	300907	康平科技	5,200	115,388.00	0.03
838	688307	中润光学	3,700	115,070.00	0.03
839	600699	均胜电子	6,400	114,944.00	0.03
840	000793	华闻集团	52,700	114,886.00	0.03
841	002572	索菲亚	7,200	114,840.00	0.03
842	603195	公牛集团	1,200	114,780.00	0.03
843	301356	天振股份	6,300	114,597.00	0.03
844	300950	德固特	7,100	114,523.00	0.03
845	301248	杰创智能	6,500	114,465.00	0.03
846	601198	东兴证券	13,900	114,397.00	0.03
847	002901	大博医疗	2,800	113,652.00	0.03
848	603079	圣达生物	7,800	113,646.00	0.03
849	301212	联盛化学	4,200	113,400.00	0.03
850	002156	通富微电	4,900	113,288.00	0.03
851	605155	西大门	7,300	113,004.00	0.03
852	601956	东贝集团	18,900	112,833.00	0.03
853	001230	劲旅环境	4,800	112,608.00	0.03
854	603129	春风动力	1,100	112,464.00	0.03
855	002010	传化智联	24,200	111,804.00	0.03
856	688728	格科微	5,400	110,538.00	0.03
857	600026	中远海能	9,000	110,160.00	0.03
858	300801	泰和科技	6,400	109,952.00	0.03
859	603797	联泰环保	19,900	109,848.00	0.03
860	688077	大地熊	4,600	109,710.00	0.03
861	688057	金达莱	7,700	109,032.00	0.03
862	603305	旭升集团	5,500	108,515.00	0.03
863	603356	华菱精工	7,400	108,262.00	0.03
864	603856	东宏股份	9,200	107,364.00	0.03
865	000665	湖北广电	22,300	107,040.00	0.03
866	603909	建发合诚	9,400	106,784.00	0.03
867	600855	航天长峰	9,900	106,128.00	0.03
868	688334	西高院	6,100	105,713.00	0.03
869	300405	科隆股份	16,300	105,298.00	0.03
870	300321	同大股份	5,400	104,490.00	0.03
871	605259	绿田机械	4,600	104,420.00	0.03

872	002883	中设股份	8,500	104,380.00	0.03
873	688517	金冠电气	6,600	104,214.00	0.03
874	300223	北京君正	1,600	103,440.00	0.03
875	688616	西力科技	7,500	102,300.00	0.03
876	300640	德艺文创	15,800	101,436.00	0.03
877	301336	趣睡科技	2,300	100,717.00	0.03
878	002620	瑞和股份	18,600	100,068.00	0.03
879	600309	万华化学	1,300	99,866.00	0.03
880	600548	深高速	11,100	99,789.00	0.03
881	688004	博汇科技	3,389	99,534.93	0.03
882	300449	汉邦高科	14,800	99,456.00	0.03
883	301273	瑞晨环保	3,600	99,324.00	0.03
884	000929	兰州黄河	10,100	98,980.00	0.03
885	003003	天元股份	8,600	98,814.00	0.03
886	300665	飞鹿股份	11,400	98,496.00	0.03
887	603316	诚邦股份	14,500	97,730.00	0.03
888	688215	瑞晟智能	2,700	97,065.00	0.03
889	002633	申科股份	8,300	97,027.00	0.03
890	002629	仁智股份	24,600	96,924.00	0.03
891	688036	传音控股	700	96,880.00	0.03
892	603021	山东华鹏	14,600	96,214.00	0.03
893	301357	北方长龙	1,900	95,912.00	0.03
894	000668	荣丰控股	7,500	95,250.00	0.03
895	688379	华光新材	4,800	94,896.00	0.03
896	300013	新宁物流	25,100	94,878.00	0.03
897	300535	达威股份	5,400	94,554.00	0.03
898	688669	聚石化学	5,000	93,700.00	0.03
899	600768	宁波富邦	7,900	93,615.00	0.03
900	300626	华瑞股份	8,600	93,310.00	0.03
901	300509	新美星	12,900	93,267.00	0.03
902	301040	中环海陆	4,900	92,953.00	0.03
903	688326	经纬恒润	800	92,840.00	0.03
904	600493	凤竹纺织	13,800	92,736.00	0.03
905	600778	友好集团	14,800	92,500.00	0.03
906	300329	海伦钢琴	12,400	92,380.00	0.03
907	600421	华嵘控股	8,300	92,379.00	0.03
908	002836	新宏泽	10,500	91,875.00	0.03
909	688589	力合微	2,300	91,793.00	0.03
910	002295	精艺股份	11,200	91,504.00	0.03
911	688166	博瑞医药	2,600	91,000.00	0.03
912	688001	华兴源创	2,600	90,870.00	0.03
913	301125	腾亚精工	4,800	90,816.00	0.03
914	688218	江苏北人	4,568	90,766.16	0.03

915	603507	振江股份	3,500	90,685.00	0.03
916	300992	泰福泵业	4,200	90,636.00	0.03
917	300716	泉为科技	7,800	90,246.00	0.03
918	601369	陕鼓动力	11,300	90,174.00	0.03
919	300703	创源股份	8,000	89,920.00	0.03
920	300594	朗进科技	4,300	89,784.00	0.03
921	301010	晶雪节能	4,800	89,712.00	0.03
922	301037	保立佳	4,500	89,685.00	0.03
923	301167	建研设计	5,300	89,676.00	0.03
924	688021	奥福环保	4,300	89,655.00	0.03
925	301046	能辉科技	3,300	89,496.00	0.03
926	002144	宏达高科	7,700	89,474.00	0.03
927	600455	博通股份	3,600	89,460.00	0.03
928	001211	双枪科技	3,700	89,392.00	0.03
929	688498	源杰科技	600	89,388.00	0.03
930	300816	艾可蓝	3,600	88,812.00	0.03
931	002236	大华股份	4,800	88,560.00	0.03
932	301079	邵阳液压	5,100	88,230.00	0.03
933	603709	中源家居	4,900	88,200.00	0.03
934	002949	华阳国际	6,300	88,011.00	0.02
935	002899	英派斯	5,300	87,715.00	0.02
936	300961	深水海纳	7,800	87,594.00	0.02
937	600883	博闻科技	10,300	87,550.00	0.02
938	301198	喜悦智行	7,200	87,408.00	0.02
939	300849	锦盛新材	6,600	87,384.00	0.02
940	301057	汇隆新材	5,200	87,360.00	0.02
941	300152	新动力	29,900	87,308.00	0.02
942	000880	潍柴重机	8,200	87,166.00	0.02
943	002669	康达新材	7,300	87,016.00	0.02
944	002188	中天服务	13,200	86,856.00	0.02
945	688178	万德斯	4,800	86,784.00	0.02
946	301156	美农生物	4,600	86,756.00	0.02
947	002789	建艺集团	6,300	86,688.00	0.02
948	300270	中威电子	11,200	86,464.00	0.02
949	300611	美力科技	7,500	86,175.00	0.02
950	300425	中建环能	18,400	86,112.00	0.02
951	603272	联翔股份	5,100	86,088.00	0.02
952	688655	迅捷兴	5,697	86,024.70	0.02
953	688682	霍莱沃	1,800	85,878.00	0.02
954	688217	睿昂基因	2,400	85,872.00	0.02
955	002917	金奥博	8,700	85,869.00	0.02
956	688067	爱威科技	3,600	85,716.00	0.02
957	688607	康众医疗	4,200	85,596.00	0.02

958	301300	远翔新材	2,700	85,401.00	0.02
959	301158	德石股份	5,300	85,277.00	0.02
960	300929	华骐环保	7,000	85,190.00	0.02
961	002591	恒大高新	11,900	84,609.00	0.02
962	605303	园林股份	6,900	84,180.00	0.02
963	003017	大洋生物	3,460	84,147.20	0.02
964	002275	桂林三金	5,800	84,042.00	0.02
965	300411	金盾股份	12,000	83,880.00	0.02
966	000423	东阿阿胶	1,700	83,844.00	0.02
967	688309	恒誉环保	4,200	83,832.00	0.02
968	688171	纬德信息	3,700	83,250.00	0.02
969	002674	兴业科技	6,800	82,756.00	0.02
970	688271	联影医疗	600	82,206.00	0.02
971	001259	利仁科技	2,900	82,128.00	0.02
972	688335	复洁环保	6,400	82,112.00	0.02
973	688329	艾隆科技	3,288	81,739.68	0.02
974	688701	卓锦股份	9,000	81,450.00	0.02
975	300845	捷安高科	4,500	81,315.00	0.02
976	000937	冀中能源	11,300	80,682.00	0.02
977	300717	华信新材	4,800	80,592.00	0.02
978	600184	光电股份	7,000	80,010.00	0.02
979	688193	仁度生物	1,770	79,862.40	0.02
980	688367	工大高科	4,400	78,496.00	0.02
981	603955	大千生态	5,300	77,857.00	0.02
982	603813	原尚股份	4,800	77,520.00	0.02
983	603108	润达医疗	3,800	77,330.00	0.02
984	002775	文科股份	18,700	74,800.00	0.02
985	300886	华业香料	3,000	74,310.00	0.02
986	002890	弘宇股份	4,800	74,160.00	0.02
987	688321	微芯生物	3,306	72,566.70	0.02
988	002993	奥海科技	1,900	72,390.00	0.02
989	603580	艾艾精工	4,800	71,472.00	0.02
990	300827	上能电气	2,357	71,322.82	0.02
991	301177	迪阿股份	2,400	70,776.00	0.02
992	688528	秦川物联	6,200	68,510.00	0.02
993	600845	宝信软件	1,400	68,320.00	0.02
994	600812	华北制药	11,500	65,550.00	0.02
995	688350	富淼科技	3,953	65,343.09	0.02
996	300529	健帆生物	2,900	64,467.00	0.02
997	605399	晨光新材	4,500	61,020.00	0.02
998	600123	兰花科创	5,500	60,720.00	0.02
999	688699	明微电子	1,500	60,525.00	0.02
1,000	603787	新日股份	3,900	48,789.00	0.01

1,001	300582	英飞特	4,000	48,040.00	0.01
1,002	600985	淮北矿业	2,800	46,564.00	0.01
1,003	300901	中胤时尚	4,200	43,008.00	0.01
1,004	000852	石化机械	6,600	40,590.00	0.01
1,005	300615	欣天科技	2,400	37,944.00	0.01
1,006	301487	盟固利	867	35,512.32	0.01
1,007	605001	威奥股份	5,100	34,119.00	0.01
1,008	688308	欧科亿	1,200	33,480.00	0.01
1,009	601319	中国人保	5,800	28,072.00	0.01
1,010	301348	蓝箭电子	613	27,321.41	0.01
1,011	301526	国际复材	5,875	26,143.75	0.01
1,012	688768	容知日新	600	22,086.00	0.01
1,013	301370	国科恒泰	1,240	19,852.40	0.01
1,014	301421	波长光电	332	19,710.84	0.01
1,015	301558	三态股份	1,458	19,537.20	0.01
1,016	300904	威力传动	304	18,705.12	0.01
1,017	301488	豪恩汽电	262	18,101.58	0.01
1,018	688591	泰凌微	643	18,016.86	0.01
1,019	301511	德福科技	743	16,843.81	0.00
1,020	301172	君逸数码	438	16,714.08	0.00
1,021	688563	航材股份	275	16,634.75	0.00
1,022	688582	芯动联科	430	16,628.10	0.00
1,023	301362	民爆光电	420	16,178.40	0.00
1,024	300770	新媒股份	400	15,472.00	0.00
1,025	301358	湖南裕能	435	14,768.25	0.00
1,026	301408	华人健康	879	14,020.05	0.00
1,027	688702	盛科通信	289	13,924.02	0.00
1,028	301510	固高科技	396	13,863.96	0.00
1,029	301507	民生健康	851	13,488.35	0.00
1,030	603016	新宏泰	600	13,314.00	0.00
1,031	301246	宏源药业	509	13,223.82	0.00
1,032	301486	致尚科技	272	12,852.00	0.00
1,033	301566	达利凯普	576	12,752.64	0.00
1,034	601096	宏盛华源	3,034	12,318.04	0.00
1,035	301419	阿莱德	330	12,243.00	0.00
1,036	301141	中科磁业	262	12,193.48	0.00
1,037	688602	康鹏科技	1,066	11,789.96	0.00
1,038	000557	西部创业	2,400	11,592.00	0.00
1,039	301281	科源制药	337	11,471.48	0.00
1,040	688612	威迈斯	300	11,391.00	0.00
1,041	301550	斯菱股份	260	11,328.20	0.00
1,042	301292	海科新源	583	11,281.05	0.00
1,043	301508	中机认检	419	11,178.92	0.00

1,044	301251	威尔高	321	11,103.39	0.00
1,045	301371	敷尔佳	290	10,898.20	0.00
1,046	301499	维科精密	371	10,733.03	0.00
1,047	688719	爱科赛博	175	10,517.50	0.00
1,048	301393	昊帆生物	175	10,389.75	0.00
1,049	688653	康希通信	648	10,361.52	0.00
1,050	301528	多浦乐	148	10,198.68	0.00
1,051	301329	信音电子	458	10,181.34	0.00
1,052	301261	恒工精密	198	10,068.30	0.00
1,053	301456	盘古智能	329	9,998.31	0.00
1,054	301202	朗威股份	306	9,730.80	0.00
1,055	301395	仁信新材	520	9,718.80	0.00
1,056	301386	未来电器	378	9,612.54	0.00
1,057	301413	安培龙	164	9,543.16	0.00
1,058	301500	飞南资源	455	9,504.95	0.00
1,059	301418	协昌科技	189	9,487.80	0.00
1,060	301516	中远通	604	9,368.04	0.00
1,061	301277	新天地	442	9,198.02	0.00
1,062	301469	恒达新材	275	9,099.75	0.00
1,063	301559	中集环科	492	8,974.08	0.00
1,064	301519	舜禹股份	442	8,932.82	0.00
1,065	301518	长华化学	385	8,858.85	0.00
1,066	301203	国泰环保	225	8,748.00	0.00
1,067	301520	万邦医药	160	8,438.40	0.00
1,068	688638	誉辰智能	141	8,414.88	0.00
1,069	301459	丰茂股份	208	8,286.72	0.00
1,070	688573	信宇人	285	8,208.00	0.00
1,071	301489	思泉新材	128	8,206.08	0.00
1,072	688651	盛邦安全	178	8,196.90	0.00
1,073	301517	陕西华达	185	8,082.65	0.00
1,074	301578	辰奕智能	118	8,061.76	0.00
1,075	301439	泓淋电力	551	8,055.62	0.00
1,076	688657	浩辰软件	101	7,901.23	0.00
1,077	688693	锆威特	178	7,726.98	0.00
1,078	301533	威马农机	225	7,461.00	0.00
1,079	301555	惠柏新材	224	7,266.56	0.00
1,080	301260	格力博	412	7,160.56	0.00
1,081	301505	苏州规划	194	6,947.14	0.00
1,082	301529	福赛科技	182	6,894.16	0.00
1,083	601083	锦江航运	605	6,697.35	0.00
1,084	301515	港通医疗	230	6,502.10	0.00
1,085	688648	中邮科技	303	6,493.29	0.00
1,086	301157	华塑科技	150	6,420.00	0.00

1,087	001378	德冠新材	205	6,410.35	0.00
1,088	688450	光格科技	167	6,082.14	0.00
1,089	603004	鼎龙科技	195	6,082.05	0.00
1,090	301373	凌玮科技	204	6,048.60	0.00
1,091	603270	金帝股份	195	5,768.10	0.00
1,092	603119	浙江荣泰	226	5,394.62	0.00
1,093	603107	上海汽配	292	5,311.48	0.00
1,094	603193	润本股份	288	4,798.08	0.00
1,095	001358	兴欣新材	87	3,841.92	0.00
1,096	001239	永达股份	189	3,764.88	0.00
1,097	603231	索宝蛋白	161	3,466.33	0.00
1,098	603273	天元智能	178	3,376.66	0.00
1,099	603276	恒兴新材	134	3,333.92	0.00
1,100	603373	安邦护卫	88	3,058.00	0.00
1,101	03690	美团-W	10	742.19	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	688111	金山办公	22,249,738.83	10.65
2	600546	山煤国际	21,929,141.00	10.49
3	002271	东方雨虹	21,171,267.29	10.13
4	000568	泸州老窖	21,127,914.44	10.11
5	300750	宁德时代	20,963,395.00	10.03
6	300573	兴齐眼药	20,858,136.00	9.98
7	002459	晶澳科技	20,568,362.20	9.84
8	600487	亨通光电	20,475,389.00	9.80
9	600050	中国联通	19,579,914.65	9.37
10	300593	新雷能	18,962,363.62	9.07
11	002230	科大讯飞	18,857,606.00	9.02
12	000661	长春高新	18,197,144.00	8.71
13	600188	兖矿能源	17,150,188.00	8.21
14	600988	赤峰黄金	16,971,746.00	8.12
15	600483	福能股份	15,957,891.00	7.64
16	601225	陕西煤业	15,929,790.00	7.62
17	002371	北方华创	15,674,243.80	7.50
18	002179	中航光电	15,396,017.78	7.37
19	600028	中国石化	15,387,109.00	7.36
20	600570	恒生电子	14,848,452.80	7.11
21	002508	老板电器	14,614,185.60	6.99
22	002841	视源股份	14,405,097.00	6.89
23	600886	国投电力	12,587,964.00	6.02

24	688023	安恒信息	12,451,952.21	5.96
25	600426	华鲁恒升	12,161,358.00	5.82
26	601702	华峰铝业	12,120,442.00	5.80
27	603659	璞泰来	11,896,022.69	5.69
28	300491	通合科技	11,787,470.00	5.64
29	601208	东材科技	11,580,795.00	5.54
30	688358	祥生医疗	11,509,462.29	5.51
31	688223	晶科能源	11,442,005.60	5.48
32	600276	恒瑞医药	11,412,715.00	5.46
33	000333	美的集团	11,386,697.00	5.45
34	300308	中际旭创	11,375,927.99	5.44
35	000921	海信家电	11,119,147.21	5.32
36	000932	华菱钢铁	11,072,721.00	5.30
37	600026	中远海能	10,945,619.00	5.24
38	600585	海螺水泥	10,922,915.00	5.23
39	300274	阳光电源	10,473,794.20	5.01
40	600519	贵州茅台	10,464,290.00	5.01
41	600230	沧州大化	10,401,600.00	4.98
42	000425	徐工机械	10,326,559.00	4.94
43	603345	安井食品	10,153,588.37	4.86
44	603701	德宏股份	10,137,211.45	4.85
45	300638	广和通	10,125,488.20	4.85
46	002050	三花智控	10,057,292.00	4.81
47	601899	紫金矿业	9,922,619.00	4.75
48	300502	新易盛	9,807,425.00	4.69
49	300217	东方电热	9,698,859.00	4.64
50	601100	恒立液压	9,543,740.00	4.57
51	002475	立讯精密	9,485,056.70	4.54
52	000516	国际医学	9,403,407.00	4.50
53	000063	中兴通讯	9,162,529.00	4.38
54	002324	普利特	9,154,314.00	4.38
55	300551	古鳌科技	9,152,385.00	4.38
56	688278	特宝生物	9,146,103.37	4.38
57	002043	兔宝宝	9,000,223.98	4.31
58	601636	旗滨集团	8,924,715.00	4.27
59	01024	快手-W	8,875,154.09	4.25
60	603379	三美股份	8,873,495.00	4.25
61	002555	三七互娱	8,867,735.00	4.24
62	002572	索菲亚	8,688,253.24	4.16
63	300122	智飞生物	8,634,905.00	4.13
64	603378	亚士创能	8,623,152.94	4.13
65	600926	杭州银行	8,568,651.00	4.10
66	601985	中国核电	8,474,361.00	4.06

67	300451	创业慧康	8,464,153.00	4.05
68	002865	钧达股份	8,460,737.09	4.05
69	601699	潞安环能	8,412,431.00	4.03
70	300394	天孚通信	8,395,053.00	4.02
71	300418	昆仑万维	8,373,553.00	4.01
72	000938	紫光股份	8,341,145.00	3.99
73	300454	深信服	8,311,757.00	3.98
74	000725	京东方 A	8,306,568.00	3.97
75	600941	中国移动	8,242,662.00	3.94
76	601728	中国电信	8,168,864.00	3.91
77	000625	长安汽车	8,112,652.00	3.88
78	688169	石头科技	8,032,605.33	3.84
79	600702	舍得酒业	8,013,906.24	3.83
80	603516	淳中科技	7,982,899.00	3.82
81	002517	恺英网络	7,935,680.02	3.80
82	600309	万华化学	7,934,860.00	3.80
83	603859	能科科技	7,919,507.00	3.79
84	600039	四川路桥	7,919,131.00	3.79
85	002129	TCL 中环	7,829,716.00	3.75
86	601288	农业银行	7,779,083.00	3.72
87	300014	亿纬锂能	7,773,643.00	3.72
88	000893	亚钾国际	7,771,226.00	3.72
89	688012	中微公司	7,746,385.08	3.71
90	688687	凯因科技	7,711,994.52	3.69
91	600557	康缘药业	7,689,391.60	3.68
92	300443	金雷股份	7,660,688.00	3.67
93	600522	中天科技	7,641,530.00	3.66
94	603198	迎驾贡酒	7,607,654.00	3.64
95	300170	汉得信息	7,597,911.11	3.64
96	002643	万润股份	7,592,508.00	3.63
97	002920	德赛西威	7,562,446.00	3.62
98	600011	华能国际	7,552,981.00	3.61
99	601633	长城汽车	7,533,515.00	3.61
100	601668	中国建筑	7,440,146.00	3.56
101	603187	海容冷链	7,432,451.41	3.56
102	00700	腾讯控股	7,364,195.21	3.52
103	603477	巨星农牧	7,243,877.00	3.47
104	000977	浪潮信息	7,226,476.79	3.46
105	600809	山西汾酒	7,159,882.00	3.43
106	600048	保利发展	7,148,835.00	3.42
107	002154	报喜鸟	7,146,728.00	3.42
108	603611	诺力股份	7,134,095.80	3.41
109	600900	长江电力	7,132,339.00	3.41

110	002372	伟星新材	7,131,925.93	3.41
111	603979	金诚信	7,068,933.65	3.38
112	002929	润建股份	7,061,059.00	3.38
113	301236	软通动力	7,007,329.75	3.35
114	300496	中科创达	7,005,581.40	3.35
115	600801	华新水泥	6,973,039.00	3.34
116	002463	沪电股份	6,878,871.64	3.29
117	000858	五粮液	6,861,822.00	3.28
118	300450	先导智能	6,792,195.00	3.25
119	300996	普联软件	6,772,685.00	3.24
120	605117	德业股份	6,759,400.00	3.23
121	002568	百润股份	6,739,315.00	3.22
122	300316	晶盛机电	6,695,897.74	3.20
123	688099	晶晨股份	6,668,850.52	3.19
124	603369	今世缘	6,666,000.00	3.19
125	601872	招商轮船	6,659,073.00	3.19
126	002007	华兰生物	6,596,687.00	3.16
127	301030	仕净科技	6,539,027.52	3.13
128	301162	国能日新	6,469,574.00	3.10
129	300567	精测电子	6,455,778.00	3.09
130	300253	卫宁健康	6,438,076.50	3.08
131	603529	爱玛科技	6,401,547.00	3.06
132	002446	盛路通信	6,382,666.00	3.05
133	600642	申能股份	6,298,404.00	3.01
134	688503	聚和材料	6,225,155.04	2.98
135	002212	天融信	6,212,731.00	2.97
136	002705	新宝股份	6,196,152.43	2.97
137	605168	三人行	6,193,781.15	2.96
138	002352	顺丰控股	6,171,585.00	2.95
139	600399	抚顺特钢	6,159,563.00	2.95
140	300559	佳发教育	6,158,600.00	2.95
141	601857	中国石油	6,148,225.00	2.94
142	601567	三星医疗	6,118,498.00	2.93
143	603486	科沃斯	6,076,518.87	2.91
144	600060	海信视像	6,056,187.00	2.90
145	000651	格力电器	6,025,011.00	2.88
146	603338	浙江鼎力	6,015,756.00	2.88
147	688046	药康生物	5,989,359.54	2.87
148	000928	中钢国际	5,979,282.00	2.86
149	603197	保隆科技	5,957,964.79	2.85
150	000915	华特达因	5,940,224.00	2.84
151	688677	海泰新光	5,895,746.00	2.82
152	600845	宝信软件	5,854,711.60	2.80

153	300260	新莱应材	5,830,530.00	2.79
154	603737	三棵树	5,817,328.23	2.78
155	002756	永兴材料	5,813,987.40	2.78
156	002605	姚记科技	5,795,425.00	2.77
157	300832	新产业	5,760,091.23	2.76
158	600729	重庆百货	5,750,605.00	2.75
159	688016	心脉医疗	5,749,310.43	2.75
160	300592	华凯易佰	5,709,171.00	2.73
161	688608	恒玄科技	5,707,397.91	2.73
162	002518	科士达	5,688,348.00	2.72
163	600023	浙能电力	5,645,153.00	2.70
164	688319	欧林生物	5,626,442.76	2.69
165	002126	银轮股份	5,603,814.00	2.68
166	000002	万科 A	5,587,747.00	2.67
167	002174	游族网络	5,583,827.00	2.67
168	603255	鼎际得	5,494,867.34	2.63
169	002833	弘亚数控	5,452,066.00	2.61
170	601939	建设银行	5,449,281.84	2.61
171	300369	绿盟科技	5,426,873.41	2.60
172	601928	凤凰传媒	5,383,059.00	2.58
173	601186	中国铁建	5,380,792.00	2.57
174	002918	蒙娜丽莎	5,380,142.35	2.57
175	002142	宁波银行	5,347,741.00	2.56
176	002531	天顺风能	5,331,883.00	2.55
177	03690	美团-W	5,301,368.94	2.54
178	601398	工商银行	5,288,176.00	2.53
179	688072	拓荆科技	5,278,378.05	2.53
180	300724	捷佳伟创	5,265,956.27	2.52
181	600690	海尔智家	5,257,198.00	2.52
182	300776	帝尔激光	5,253,622.00	2.51
183	601618	中国中冶	5,246,939.00	2.51
184	002777	久远银海	5,221,635.00	2.50
185	300911	亿田智能	5,209,101.00	2.49
186	603000	人民网	5,187,594.00	2.48
187	688239	航宇科技	5,057,073.20	2.42
188	300762	上海瀚讯	5,031,049.00	2.41
189	002979	雷赛智能	5,029,831.00	2.41
190	03993	洛阳钼业	2,528,800.79	1.21
190	603993	洛阳钼业	2,443,556.00	1.17
191	000400	许继电气	4,972,297.00	2.38
192	002092	中泰化学	4,932,802.00	2.36
193	601900	南方传媒	4,910,850.00	2.35
194	301391	卡莱特	4,909,928.66	2.35

195	300481	濮阳惠成	4,905,137.00	2.35
196	300034	钢研高纳	4,901,601.00	2.35
197	000786	北新建材	4,871,002.00	2.33
198	300073	当升科技	4,860,693.00	2.33
199	688320	禾川科技	4,859,359.38	2.33
200	000983	山西焦煤	4,858,859.00	2.33
201	300124	汇川技术	4,851,759.00	2.32
202	300009	安科生物	4,843,964.67	2.32
203	600036	招商银行	4,828,442.00	2.31
204	688335	复洁环保	4,823,240.06	2.31
205	300566	激智科技	4,822,271.00	2.31
206	601012	隆基绿能	4,749,846.00	2.27
207	688041	海光信息	4,741,768.06	2.27
208	600989	宝丰能源	4,732,202.00	2.26
209	02328	中国财险	4,727,686.21	2.26
210	601336	新华保险	4,696,976.00	2.25
211	300747	锐科激光	4,693,766.65	2.25
212	600835	上海机电	4,692,043.00	2.25
213	688305	科德数控	4,676,350.53	2.24
214	603444	吉比特	4,666,204.00	2.23
215	301004	嘉益股份	4,664,150.00	2.23
216	600085	同仁堂	4,658,375.00	2.23
217	603128	华贸物流	4,648,781.00	2.22
218	002735	王子新材	4,646,593.00	2.22
219	688019	安集科技	4,643,040.91	2.22
220	603639	海利尔	4,641,022.00	2.22
221	600019	宝钢股份	4,628,182.00	2.21
222	002389	航天彩虹	4,615,403.00	2.21
223	603215	比依股份	4,613,127.00	2.21
224	600129	太极集团	4,605,210.00	2.20
225	601858	中国科传	4,538,024.00	2.17
226	01071	华电国际电力 股份	3,232,603.38	1.55
226	600027	华电国际	1,304,397.00	0.62
227	600004	白云机场	4,536,711.00	2.17
228	601318	中国平安	4,516,823.00	2.16
229	002311	海大集团	4,511,269.00	2.16
230	603667	五洲新春	4,510,153.00	2.16
231	600452	涪陵电力	4,468,562.46	2.14
232	002714	牧原股份	4,463,444.43	2.14
233	002847	盐津铺子	4,432,002.00	2.12
234	300718	长盛轴承	4,391,930.00	2.10
235	605399	晨光新材	4,384,001.00	2.10
236	300613	富瀚微	4,364,442.00	2.09

237	603300	华铁应急	4,359,864.73	2.09
238	603713	密尔克卫	4,339,354.00	2.08
239	300161	华中数控	4,330,076.00	2.07
240	600566	济川药业	4,328,227.00	2.07
241	300166	东方国信	4,310,713.00	2.06
242	600325	华发股份	4,304,015.00	2.06
243	002028	思源电气	4,300,567.00	2.06
244	688107	安路科技	4,296,135.24	2.06
245	002027	分众传媒	4,292,244.00	2.05
246	688256	寒武纪	4,260,008.01	2.04
247	688981	中芯国际	4,256,505.61	2.04
248	688217	睿昂基因	4,254,649.94	2.04
249	603589	口子窖	4,237,937.88	2.03
250	300033	同花顺	4,201,020.00	2.01
251	601600	中国铝业	4,198,948.00	2.01
252	300408	三环集团	4,181,030.00	2.00

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

8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	300573	兴齐眼药	23,361,067.80	11.18
2	300750	宁德时代	22,899,803.67	10.96
3	688111	金山办公	22,445,456.19	10.74
4	600546	山煤国际	22,143,884.00	10.60
5	002271	东方雨虹	22,074,772.60	10.56
6	600487	亨通光电	20,651,769.16	9.88
7	002459	晶澳科技	20,077,859.82	9.61
8	000568	泸州老窖	19,858,373.00	9.50
9	600050	中国联通	19,607,578.55	9.38
10	002230	科大讯飞	19,225,225.68	9.20
11	300593	新雷能	19,101,811.64	9.14
12	600188	兖矿能源	17,388,321.00	8.32
12	01171	兖矿能源	933,064.10	0.45
13	002179	中航光电	18,159,317.80	8.69
14	000661	长春高新	17,658,745.44	8.45
15	002371	北方华创	17,152,377.99	8.21
16	600988	赤峰黄金	16,981,548.00	8.13
17	601225	陕西煤业	16,243,161.00	7.77
18	600483	福能股份	15,597,575.90	7.46
19	002841	视源股份	14,789,061.65	7.08
20	600570	恒生电子	14,755,841.10	7.06
21	002508	老板电器	14,399,078.00	6.89

22	600028	中国石化	13,991,997.00	6.70
23	300308	中际旭创	13,303,305.88	6.37
24	300491	通合科技	12,865,672.00	6.16
25	603659	璞泰来	12,602,528.77	6.03
26	600426	华鲁恒升	12,408,932.00	5.94
27	300502	新易盛	12,403,517.49	5.94
28	600886	国投电力	12,379,110.00	5.92
29	601702	华峰铝业	12,153,240.00	5.82
30	600276	恒瑞医药	11,954,448.60	5.72
31	688023	安恒信息	11,878,601.24	5.68
32	601208	东材科技	11,623,671.70	5.56
33	688358	祥生医疗	11,433,409.67	5.47
34	002043	兔宝宝	11,356,419.00	5.43
35	000333	美的集团	11,250,487.00	5.38
36	000921	海信家电	11,031,782.50	5.28
37	603345	安井食品	10,910,494.00	5.22
38	688223	晶科能源	10,855,403.48	5.19
39	600230	沧州大化	10,841,610.60	5.19
40	601899	紫金矿业	10,669,630.00	5.11
41	600557	康缘药业	10,651,323.40	5.10
42	688278	特宝生物	10,543,624.23	5.05
43	002463	沪电股份	10,423,529.60	4.99
44	600026	中远海能	10,409,218.00	4.98
45	000425	徐工机械	10,224,107.00	4.89
46	603701	德宏股份	10,179,568.66	4.87
47	300551	古鳌科技	10,172,850.00	4.87
48	002050	三花智控	10,148,119.00	4.86
49	600585	海螺水泥	10,024,599.00	4.80
50	300274	阳光电源	9,899,111.00	4.74
51	000932	华菱钢铁	9,876,224.00	4.73
52	300638	广和通	9,796,329.20	4.69
53	002129	TCL 中环	9,791,299.25	4.69
54	300217	东方电热	9,758,918.00	4.67
55	600519	贵州茅台	9,683,656.00	4.63
56	300394	天孚通信	9,450,324.40	4.52
57	002475	立讯精密	9,431,484.30	4.51
58	002865	钧达股份	9,389,096.06	4.49
59	601100	恒立液压	9,221,985.00	4.41
60	300451	创业慧康	9,082,406.20	4.35
61	603379	三美股份	9,078,186.00	4.34
62	000063	中兴通讯	8,915,487.00	4.27
63	300122	智飞生物	8,912,110.50	4.26
64	000516	国际医学	8,906,035.00	4.26

65	600926	杭州银行	8,777,150.00	4.20
66	600702	舍得酒业	8,715,893.64	4.17
67	002572	索菲亚	8,660,850.30	4.14
68	002517	恺英网络	8,543,942.00	4.09
69	000938	紫光股份	8,540,958.49	4.09
70	002555	三七互娱	8,527,716.00	4.08
71	002324	普利特	8,441,039.00	4.04
72	300454	深信服	8,334,359.00	3.99
73	300496	中科创达	8,324,347.88	3.98
74	601699	潞安环能	8,237,627.34	3.94
75	601985	中国核电	8,207,470.00	3.93
76	600309	万华化学	8,116,008.00	3.88
77	688099	晶晨股份	8,105,723.37	3.88
78	688169	石头科技	8,089,057.26	3.87
79	002643	万润股份	7,961,998.00	3.81
80	603378	亚士创能	7,800,364.16	3.73
81	300170	汉得信息	7,785,299.00	3.73
82	300418	昆仑万维	7,737,956.78	3.70
83	603859	能科科技	7,734,929.00	3.70
84	601636	旗滨集团	7,727,078.00	3.70
85	600048	保利发展	7,700,661.00	3.69
86	600522	中天科技	7,682,286.00	3.68
87	002372	伟星新材	7,670,957.00	3.67
88	603611	诺力股份	7,657,325.00	3.66
89	01024	快手-W	7,655,541.45	3.66
90	603198	迎驾贡酒	7,622,993.00	3.65
91	000625	长安汽车	7,585,702.00	3.63
92	600941	中国移动	7,222,187.00	3.46
92	00941	中国移动	262,872.84	0.13
93	603187	海容冷链	7,412,678.00	3.55
94	603979	金诚信	7,365,716.43	3.52
95	603477	巨星农牧	7,353,707.00	3.52
96	600011	华能国际	7,348,645.00	3.52
97	002929	润建股份	7,286,423.60	3.49
98	300014	亿纬锂能	7,284,179.00	3.49
99	300443	金雷股份	7,236,713.00	3.46
100	000977	浪潮信息	7,222,286.24	3.46
101	002920	德赛西威	7,165,060.00	3.43
102	03690	美团-W	7,130,467.75	3.41
103	600809	山西汾酒	7,126,780.20	3.41
104	000893	亚钾国际	7,107,713.00	3.40
105	301236	软通动力	7,093,316.00	3.39
106	603529	爱玛科技	7,092,127.10	3.39

107	000725	京东方 A	7,075,717.00	3.39
108	601288	农业银行	7,013,766.00	3.36
109	300316	晶盛机电	6,991,424.20	3.35
110	301030	仕净科技	6,960,958.00	3.33
111	601728	中国电信	6,918,959.00	3.31
112	688012	中微公司	6,906,580.87	3.31
113	002154	报喜鸟	6,844,209.00	3.28
114	600060	海信视像	6,759,637.00	3.23
115	600801	华新水泥	6,738,352.00	3.22
116	300253	卫宁健康	6,688,605.50	3.20
117	601668	中国建筑	6,654,385.00	3.18
118	600039	四川路桥	6,631,107.00	3.17
119	600900	长江电力	6,622,871.74	3.17
120	000858	五粮液	6,598,269.00	3.16
121	688687	凯因科技	6,594,577.95	3.16
122	605117	德业股份	6,495,557.00	3.11
123	002007	华兰生物	6,448,346.00	3.09
124	002352	顺丰控股	6,416,038.00	3.07
125	603369	今世缘	6,377,289.00	3.05
126	002568	百润股份	6,339,774.00	3.03
127	300996	普联软件	6,330,407.32	3.03
128	300567	精测电子	6,303,248.00	3.02
129	601872	招商轮船	6,260,598.88	3.00
130	300450	先导智能	6,253,823.00	2.99
131	600729	重庆百货	6,244,791.00	2.99
132	603688	石英股份	6,243,868.00	2.99
133	002446	盛路通信	6,230,491.70	2.98
134	601567	三星医疗	6,194,816.00	2.96
135	300592	华凯易佰	6,163,619.00	2.95
136	002705	新宝股份	6,151,300.22	2.94
137	603486	科沃斯	6,126,600.20	2.93
138	600642	申能股份	6,115,481.00	2.93
139	600845	宝信软件	6,096,973.54	2.92
140	603516	淳中科技	6,089,531.80	2.91
141	301162	国能日新	6,088,479.60	2.91
142	688335	复洁环保	6,078,418.64	2.91
143	601633	长城汽车	6,059,564.00	2.90
144	688503	聚和材料	6,037,570.41	2.89
145	002979	雷赛智能	6,012,371.25	2.88
146	002531	天顺风能	5,995,476.00	2.87
147	300559	佳发教育	5,992,209.00	2.87
148	002212	天融信	5,947,527.00	2.85
149	603338	浙江鼎力	5,935,297.00	2.84

150	600023	浙能电力	5,903,130.00	2.82
151	300776	帝尔激光	5,890,286.56	2.82
152	688608	恒玄科技	5,854,104.43	2.80
153	688046	药康生物	5,842,452.49	2.80
154	000651	格力电器	5,836,601.00	2.79
155	300832	新产业	5,811,581.10	2.78
156	603197	保隆科技	5,799,864.00	2.78
157	300762	上海瀚讯	5,720,926.00	2.74
158	688107	安路科技	5,701,505.34	2.73
159	000002	万科 A	5,683,232.00	2.72
160	688677	海泰新光	5,636,203.67	2.70
161	600399	抚顺特钢	5,628,316.00	2.69
162	688319	欧林生物	5,619,847.88	2.69
163	000915	华特达因	5,578,889.00	2.67
164	02328	中国财险	5,547,052.27	2.65
165	002142	宁波银行	5,534,613.40	2.65
166	601939	建设银行	5,518,065.00	2.64
167	605168	三人行	5,515,798.50	2.64
168	002918	蒙娜丽莎	5,507,142.00	2.64
169	603737	三棵树	5,484,422.00	2.62
170	002605	姚记科技	5,453,102.00	2.61
171	688016	心脉医疗	5,452,032.87	2.61
172	000983	山西焦煤	5,431,193.00	2.60
173	601900	南方传媒	5,416,119.00	2.59
174	300911	亿田智能	5,401,588.96	2.58
175	002833	弘亚数控	5,279,606.00	2.53
176	002518	科士达	5,275,500.81	2.52
177	000928	中钢国际	5,257,447.00	2.52
178	300369	绿盟科技	5,216,025.27	2.50
179	002756	永兴材料	5,207,711.86	2.49
180	300009	安科生物	5,147,741.20	2.46
181	601928	凤凰传媒	5,118,798.00	2.45
182	688239	航宇科技	5,112,323.32	2.45
183	002174	游族网络	5,063,453.00	2.42
184	002126	银轮股份	5,032,032.00	2.41
185	300260	新莱应材	5,019,286.00	2.40
186	601318	中国平安	5,004,457.00	2.39
187	601857	中国石油	4,986,323.00	2.39
188	601186	中国铁建	4,984,417.00	2.39
189	603667	五洲新春	4,953,946.01	2.37
190	605399	晨光新材	4,947,627.22	2.37
191	603000	人民网	4,920,179.00	2.35
192	601336	新华保险	4,915,265.48	2.35

193	301004	嘉益股份	4,894,307.00	2.34
194	002847	盐津铺子	4,859,004.00	2.33
195	300073	当升科技	4,844,146.00	2.32
196	600690	海尔智家	4,819,295.00	2.31
197	300481	濮阳惠成	4,815,605.00	2.30
198	000400	许继电气	4,804,909.00	2.30
199	603255	鼎际得	4,804,794.69	2.30
200	300724	捷佳伟创	4,786,169.54	2.29
201	002389	航天彩虹	4,782,342.00	2.29
202	603215	比依股份	4,777,629.88	2.29
203	300015	爱尔眼科	4,764,477.85	2.28
204	300034	钢研高纳	4,736,049.80	2.27
205	603444	吉比特	4,711,448.00	2.25
206	300124	汇川技术	4,708,188.00	2.25
207	601858	中国科传	4,693,823.00	2.25
208	603128	华贸物流	4,660,779.00	2.23
209	600989	宝丰能源	4,633,605.00	2.22
210	600129	太极集团	4,607,641.00	2.20
211	300747	锐科激光	4,594,841.00	2.20
212	002714	牧原股份	4,569,455.27	2.19
213	601618	中国中冶	4,544,091.00	2.17
214	600004	白云机场	4,537,812.56	2.17
215	688041	海光信息	4,533,417.41	2.17
216	000596	古井贡酒	4,501,691.00	2.15
217	002092	中泰化学	4,452,456.00	2.13
218	600085	同仁堂	4,439,248.00	2.12
219	300718	长盛轴承	4,430,347.00	2.12
220	002594	比亚迪	4,416,997.00	2.11
221	601398	工商银行	4,396,476.00	2.10
222	000786	北新建材	4,386,937.00	2.10
223	600036	招商银行	4,381,743.00	2.10
224	688320	禾川科技	4,345,291.21	2.08
225	603589	口子窖	4,339,255.78	2.08
226	603713	密尔克卫	4,335,092.00	2.07
227	300566	激智科技	4,324,575.00	2.07
228	600452	涪陵电力	4,323,587.10	2.07
229	603896	寿仙谷	4,311,669.00	2.06
230	002311	海大集团	4,309,788.00	2.06
231	601238	广汽集团	4,307,466.00	2.06
232	600019	宝钢股份	4,303,708.00	2.06
233	300166	东方国信	4,300,413.00	2.06
234	600835	上海机电	4,298,808.00	2.06
235	300408	三环集团	4,294,059.00	2.05

236	688256	寒武纪	4,249,188.26	2.03
237	002777	久远银海	4,233,417.00	2.03
238	603556	海兴电力	4,220,716.00	2.02
239	601012	隆基绿能	4,220,513.00	2.02
240	002735	王子新材	4,217,888.80	2.02
241	600025	华能水电	4,214,599.00	2.02
242	688072	拓荆科技	4,199,365.50	2.01
243	600212	绿能慧充	4,199,286.00	2.01
244	600150	中国船舶	4,192,873.00	2.01

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	4,164,041,840.68
卖出股票收入（成交）总额	3,984,096,139.08

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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	2,412,558.90	0.68
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,412,558.90	0.68

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	019709	23 国债 16	24,000	2,412,558.90	0.68

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

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。基金管理人将按照相关法律法规的规定，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，并结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本报告期内没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2

本基金投资的前十名股票中，没有投资于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	420,955.20
2	应收清算款	-
3	应收股利	26,974.18
4	应收利息	-
5	应收申购款	170,427.33
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	618,356.71

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

本报告中因四舍五入原因，投资组合报告中市值占总资产或净资产比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
中欧量化动力混合 A	4,870	39,779.73	1,140,612.64	0.59%	192,586,657.96	99.41%
中欧量化动力混合 C	4,446	47,334.06	734,024.96	0.35%	209,713,227.78	99.65%
合计	9,316	43,384.99	1,874,637.60	0.46%	402,299,885.74	99.54%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中欧量化动力混合 A	1,104,015.86	0.57%
	中欧量化动力混合 C	0.00	0.00%
	合计	1,104,015.86	0.27%

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、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	中欧量化动力混合 A	0
	中欧量化动力混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	中欧量化动力混合 A	>100
	中欧量化动力混合 C	0

	合计	>100
--	----	------

9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产 品情况

基金经理姓名	产品类型	持有本人管理的基金份额总量的数量区间(万份)
曲径	公募基金	>100
	私募资产管理计划	0
	合计	>100

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中欧量化动力混合 A	中欧量化动力混合 C
基金合同生效日 (2022 年 3 月 2 日) 基金份额总额	115,946,789.67	208,122,307.00
本报告期期初基金份 额总额	159,114,765.45	54,069,655.12
本报告期基金总申购 份额	279,873,696.36	928,481,955.83
减：本报告期基金总 赎回份额	245,261,191.21	772,104,358.21
本报告期基金拆分变 动份额	-	-
本报告期期末基金份 额总额	193,727,270.60	210,447,252.74

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

11.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

11.2.2 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，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生重大改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自合同生效日起聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。报告期内本基金未改聘会计师事务所。本年度应支付给所聘任的会计师事务所审计费用为 50,000.00 元人民币。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，基金管理人及其高级管理人员不存在受稽查或处罚的情况。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，托管人及其高级管理人员不存在受稽查或处罚的情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
东北证券	3	3,493,715,352.78	42.95	2,102,193.88	46.19	本报告期新增 2 个
海通证券	3	2,490,048,690.95	30.61	1,316,635.36	28.93	本报告期新增 1 个
方正证券	3	2,150,607,947.33	26.44	1,131,953.81	24.87	本报告期新增 1 个

注：根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能力的基础上，选择基金专用交易席位。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
东北证券	-	-	974,100,000.00	31.67	-	-
海通证券	2,396,393.75	79.85	1,254,402,000.00	40.78	-	-
方正证券	604,838.22	20.15	847,697,000.00	27.56	-	-

注：根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能力的基础上，选择基金专用交易席位。

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中欧基金管理有限公司旗下部分基金2022年第四季度报告提示性公告	中国证监会指定媒介	2023-01-20
2	中欧量化动力混合型证券投资基金2022年第4季度报告	中国证监会指定媒介	2023-01-20
3	中欧基金管理有限公司部分部门办公地址变更公告	中国证监会指定媒介	2023-02-17
4	中欧量化动力混合型证券投资基金2022年年度报告	中国证监会指定媒介	2023-03-31
5	中欧基金管理有限公司旗下部分基金2022年年度报告	中国证监会指定媒介	2023-03-31
6	中欧量化动力混合型证券投资基金暂停大额申购、转换转入、定期定额投资业务公告	中国证监会指定媒介	2023-04-12
7	中欧量化动力混合型证券投资基金分红公告	中国证监会指定媒介	2023-04-13
8	中欧量化动力混合型证券投资基金恢复大额申购、转换转入、定期定额投资业务公告	中国证监会指定媒介	2023-04-14
9	中欧基金管理有限公司旗下部分基金2023年第一季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2023-04-22
10	中欧量化动力混合型证券投资基金2023年第1季度报告	中国证监会指定媒介	2023-04-22
11	中欧基金管理有限公司关于公司股权变更的公告	中国证监会指定媒介	2023-06-03
12	中欧量化动力混合型证券投资基金基	中国证监会指定媒介	2023-06-29

	金产品资料概要更新		
13	中欧基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告	中国证监会指定媒介	2023-07-08
14	中欧量化动力混合型证券投资基金更新招募说明书（2023 年 7 月）	中国证监会指定媒介	2023-07-08
15	中欧量化动力混合型证券投资基金基金合同（修订）	中国证监会指定媒介	2023-07-08
16	中欧量化动力混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定媒介	2023-07-13
17	中欧量化动力混合型证券投资基金 2023 年第 2 季度报告	中国证监会指定媒介	2023-07-21
18	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2023 年第 2 季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2023-07-21
19	中欧量化动力混合型证券投资基金 2023 年中期报告	中国证监会指定媒介	2023-08-31
20	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2023 年中期报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2023-08-31
21	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2023 年第三季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2023-10-25
22	中欧量化动力混合型证券投资基金 2023 年第 3 季度报告	中国证监会指定媒介	2023-10-25
23	中欧量化动力混合型证券投资基金更新招募说明书（2023 年 12 月）	中国证监会指定媒介	2023-12-20
24	中欧量化动力混合型证券投资基金更新招募说明书（2023 年 12 月）	中国证监会指定媒介	2023-12-20

§ 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

报告期内单一投资者持有基金份额比例不存在达到或超过 20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中欧量化动力混合型证券投资基金相关批准文件
- 2、《中欧量化动力混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《中欧量化动力混合型证券投资基金托管协议》
- 4、《中欧量化动力混合型证券投资基金招募说明书》

5、基金管理人业务资格批件、营业执照

6、本报告期内在中国证监会指定媒介上公开披露的各项公告

13.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

13.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站(www.zofund.com)查阅，或在营业时间内至基金管理人办公场所免费查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人中欧基金管理有限公司：

客户服务中心电话：021-68609700，400-700-9700

中欧基金管理有限公司

2024年3月29日