

景顺长城量化小盘股票型证券投资基金 2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2024 年 3 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，基金管理人本报告中对相关事项亦有详细说明，请投资者注意阅读。

本报告期自 2023 年 1 月 1 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 其他指标 | 8 |
| 3.4 过去三年基金的利润分配情况 | 8 |
| § 4 管理人报告 | 8 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 8 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 | 9 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 10 |
| 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 | 11 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 | 11 |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 | 12 |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 13 |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 14 |
| 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 | 14 |
| § 5 托管人报告 | 14 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 | 14 |
| 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 | 14 |
| 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 | 14 |
| § 6 审计报告 | 14 |
| 6.1 审计报告基本信息 | 14 |
| 6.2 审计报告的基本内容 | 15 |
| § 7 年度财务报表 | 16 |
| 7.1 资产负债表 | 16 |
| 7.2 利润表 | 18 |
| 7.3 净资产变动表 | 19 |
| 7.4 报表附注 | 21 |

| | |
|--|-----------|
| § 8 投资组合报告 | 53 |
| 8.1 期末基金资产组合情况 | 53 |
| 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 54 |
| 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 | 54 |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 69 |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 84 |
| 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 | 84 |
| 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 | 85 |
| 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 | 85 |
| 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 | 85 |
| 8.10 本基金投资股指期货的投资政策 | 85 |
| 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 85 |
| 8.12 投资组合报告附注 | 85 |
| § 9 基金份额持有人信息 | 86 |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 86 |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 86 |
| 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 | 86 |
| 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 | 87 |
| § 10 开放式基金份额变动 | 87 |
| § 11 重大事件揭示 | 87 |
| 11.1 基金份额持有人大会决议 | 87 |
| 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 | 87 |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 87 |
| 11.4 基金投资策略的改变 | 87 |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 87 |
| 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 | 88 |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 88 |
| 11.8 其他重大事件 | 91 |
| § 12 影响投资者决策的其他重要信息 | 94 |
| 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 | 94 |
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息 | 95 |
| § 13 备查文件目录 | 95 |
| 13.1 备查文件目录 | 95 |
| 13.2 存放地点 | 95 |
| 13.3 查阅方式 | 95 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|-------------------|
| 基金名称 | 景顺长城量化小盘股票型证券投资基金 |
| 基金简称 | 景顺长城量化小盘股票 |
| 场内简称 | 无 |
| 基金主代码 | 005457 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2018年2月6日 |
| 基金管理人 | 景顺长城基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 1,086,722,403.05份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|---|
| 投资目标 | 本基金通过量化模型精选股票，在严格控制风险的前提下，力争获取超越业绩比较基准的投资回报，谋求基金资产的长期增值。 |
| 投资策略 | <p>1、资产配置策略： 本基金股票资产占基金资产的比例为 80%-95%，大类资产配置不作为本基金的核心策略。一般情况下将保持各类资产配置的基本稳定。在综合考量系统性风险、各类资产收益风险比值、股票资产估值、流动性要求、申购赎回以及分红等因素后，对基金资产配置做出合适调整。</p> <p>2、股票投资策略： 本基金主要采用三大类量化模型分别用以评估资产定价、控制风险和优化交易。基于模型结果，基金管理人结合市场环境和股票特性，精选个股产出投资组合，以追求超越业绩比较基准表现的业绩水平。</p> <p>3、债券投资策略： 出于对流动性、跟踪误差、有效利用基金资产的考量，本基金适时对债券进行投资。通过研究国内外宏观经济、货币和财政政策、市场结构变化、资金流动情况，采取自上而下的策略判断未来利率变化和收益率曲线变动的趋势及幅度，确定组合久期。进而根据各类资产的预期收益率，确定债券资产配置。</p> |
| 业绩比较基准 | 中证 1000 指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5% |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | 基金管理人 | 基金托管人 |
|-------------|--------------|------------------------|
| 名称 | 景顺长城基金管理有限公司 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 杨皞阳 |
| | 联系电话 | 0755-82370388 |
| | 电子邮箱 | investor@igwfm.com |
| | | 王小飞 |
| | | 021-60637103 |
| | | wangxiaofei.zh@ccb.com |

| | | |
|--------|------------------------------|-----------------------|
| 客户服务电话 | 4008888606 | 021-60637228 |
| 传真 | 0755-22381339 | 021-60635778 |
| 注册地址 | 深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层 | 北京市西城区金融大街 25 号 |
| 办公地址 | 深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层 | 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼 |
| 邮政编码 | 518048 | 100033 |
| 法定代表人 | 李进 | 田国立 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|---------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 证券日报 |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | www.igwfm.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 | 普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙) | 中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼 |
| 注册登记机构 | 景顺长城基金管理有限公司 | 深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 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 | 2021 年 |
|---------------|------------------|-----------------|----------------|
| 本期已实现收益 | -97,495,803.07 | -153,152,782.37 | 60,724,703.83 |
| 本期利润 | -91,089,041.74 | -192,848,570.78 | 72,670,568.84 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.1061 | -0.3963 | 0.3689 |
| 本期加权平均净值利润率 | -7.61% | -24.56% | 21.90% |
| 本期基金份额净值增长率 | -2.90% | -17.50% | 31.98% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2023 年末 | 2022 年末 | 2021 年末 |
| 期末可供分配利润 | 223,668,980.97 | 172,774,137.11 | 319,030,729.85 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.2058 | 0.5149 | 0.8363 |
| 期末基金资产净值 | 1,310,391,384.02 | 508,350,941.26 | 700,511,812.78 |
| 期末基金份额净值 | 1.2058 | 1.5148 | 1.8362 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 2023 年末 | 2022 年末 | 2021 年末 |
| 基金份额累计净值增长率 | 47.09% | 51.48% | 83.62% |

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。

3、基金份额净值的计算精确到小数点后四位，小数点后第五位舍去，由此产生的误差计入基

金资产。

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

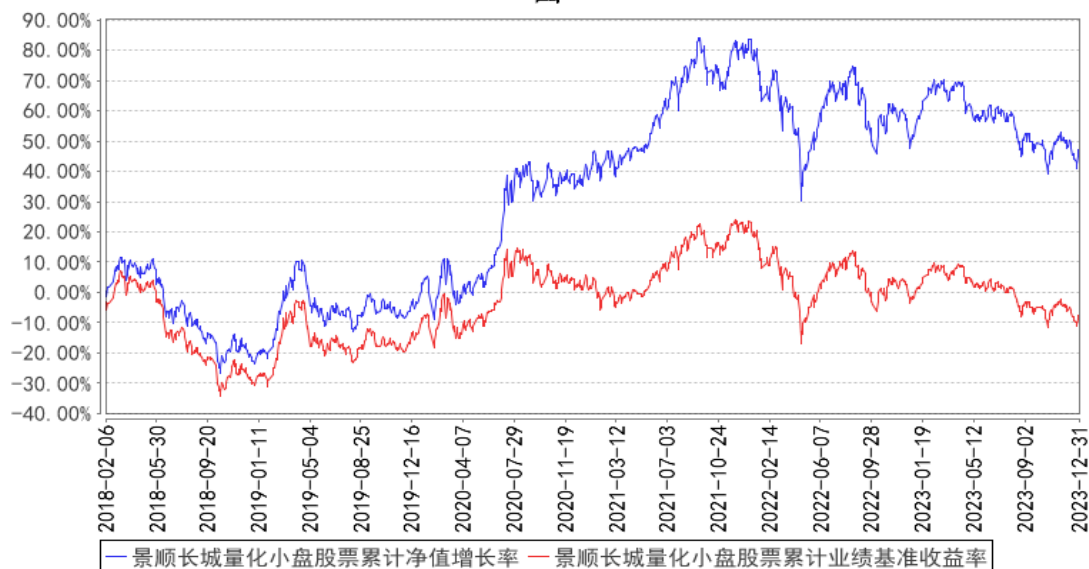
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月 | -1.67% | 0.96% | -2.98% | 0.98% | 1.31% | -0.02% |
| 过去六个月 | -8.37% | 0.94% | -10.28% | 0.95% | 1.91% | -0.01% |
| 过去一年 | -2.90% | 0.89% | -5.91% | 0.90% | 3.01% | -0.01% |
| 过去三年 | 5.72% | 1.17% | -10.58% | 1.21% | 16.30% | -0.04% |
| 过去五年 | 90.18% | 1.34% | 31.93% | 1.37% | 58.25% | -0.03% |
| 自基金合同生效起至今 | 47.09% | 1.37% | -7.69% | 1.39% | 54.78% | -0.02% |

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

景顺长城量化小盘股票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

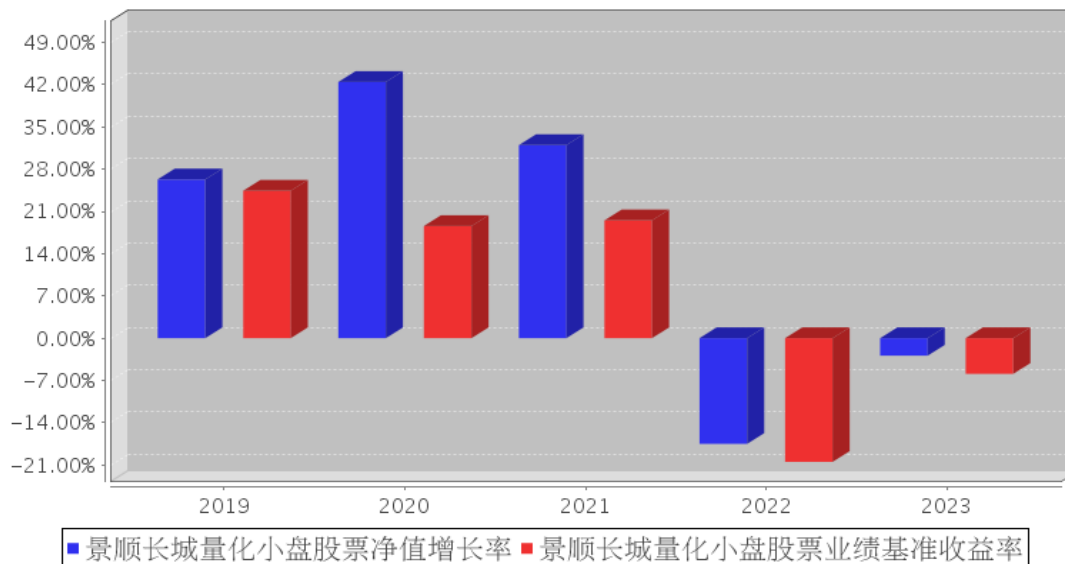


注：基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 80%–95%，投资于小盘股票的比例不低于非现金基金资产的 80%，除股票外的其他资产占基金资产的比例范围为 5%–20%，每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的建仓期为自 2018 年 2 月 6 日基金合同生效日起 6 个月。建仓期结束时，本基金投

投资组合达到上述投资组合比例的要求。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

景顺长城量化小盘股票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



3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

| 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 年 | 2.8000 | 261,448,879.02 | 44,756,772.20 | 306,205,651.22 | - |
| 2022 年 | - | - | - | - | - |
| 2021 年 | - | - | - | - | - |
| 合计 | 2.8000 | 261,448,879.02 | 44,756,772.20 | 306,205,651.22 | - |

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人景顺长城基金管理有限公司（以下简称“本公司”）是经中国证监会证监基金字[2003]76号文批准设立的证券投资基金管理公司，由长城证券股份有限公司、景顺资产管理有限公司、开滦（集团）有限责任公司、大连实德集团有限公司共同发起设立，并于2003年6月9日获得开业批文，注册资本1.3亿元人民币，目前，各家出资比例分别为49%、49%、1%、1%。总部设在深圳，在北京、上海、广州设有分公司，并设立全资子公司——景顺长城资产管理（深圳）有限公司。

本公司拥有公募、特定客户资产管理、QDII 等业务资格，截至 2023 年 12 月 31 日，本公司旗下共管理 179 只开放式基金，在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、海外投资、资产配置等多个领域布局。

本公司采用团队投资方式，即通过整个投资部门全体人员的共同努力，争取良好投资业绩。

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 | | |
| 黎海威 | 本基金的基金经理 | 2018 年 2 月 6 日 | - | 20 年 | 经济学硕士，CFA。曾任美国穆迪 KMV 公司研究员，美国贝莱德集团（原巴克莱国际投资管理有限公司）基金经理、主动股票部副总裁，香港海通国际资产管理有限公司（海通国际投资管理有限公司）量化总监。2012 年 8 月加入本公司，自 2013 年 10 月起担任量化及指数投资部基金经理，现任公司副总经理、量化及指数投资部总经理、基金经理。具有 20 年证券、基金行业从业经验。 |

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”按基金合同生效日填写，“离任日期”为根据公司决定的解聘日期（公告前一日）；对此后的非首任基金经理，“任职日期”指根据公司决定聘任后的公告日期，“离任日期”指根据公司决定的解聘日期（公告前一日）；

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 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

无。

4.1.4 基金经理薪酬机制

本报告期内，本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

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守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》和《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《景顺长城量化小盘股票型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

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

为了进一步规范和完善本基金管理人（以下简称“本公司”）投资和交易管理，严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011 年修订）》、《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》等法律法规，本公司制定了《景顺长城基金管理有限公司公平交易指引》，该《指引》涵盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时对授权、研究分析与投资决策、交易执行的内部控制、交易指令的分配执行、公平交易监控、报告措施及信息披露、利益冲突的防范和异常交易的监控等方面进行了全面规范。具体控制措施如下：

1、授权、研究分析与投资决策的内部控制

建立投资授权制度，明确各投资决策主体的职责和权限划分；建立客观的研究方法，任何投资分析和建议均应有充分的事实和数据支持，避免主观臆断，严禁利用内幕信息作为投资依据；确保所有投资组合平等地享有研究成果；根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和投资限制等，建立不同投资组合的投资主题库和交易对手备选库，投资组合经理在此基础上根据投资授权构建具体的投资组合并独立进行投资决策。

2、交易执行的内部控制

本公司实行集中交易制度，将投资管理职能和交易执行职能相隔离；建立公平的交易分配机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。同时严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。

3、交易指令分配的控制

所有投资对象的投资指令必须经由交易管理部总监或其授权人审核后分配至交易员执行。

交易员对于接收到的交易指令依照时间优先、价格优先的顺序执行。在执行多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的投资指令时，需根据价格优先、比例分配的原则，经过公平性审核，公平对待多个不同投资组合的投资指令。

4、公平交易监控

本公司建立异常交易行为日常监控和分析评估制度。交易管理部负责异常交易的日常实时监控，风险管理部于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗内（如 1 日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合的同向交易的交易价差进行分析，对不同投资组合临近交易日

的反向交易的交易价差进行分析。相关投资组合经理应对异常交易情况进行合理解释，由投资组合经理、督察长、总经理签署后，妥善保存分析报告备查。如果在上述分析期间内，公司管理的所有投资组合同向交易价差出现异常情况，应重新核查公司投资决策和交易执行环节的内部控制，针对潜在问题完善公平交易制度，并在监察稽核季度报告和年度报告中对此做专项说明。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011年修订）》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有投资组合。本报告期内本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011年修订）》及《景顺长城基金管理有限公司公平交易指引》对本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现不公平交易的情况。

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

本报告期内，本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共有 31 次，为投资组合的投资策略需要而发生的同日反向交易，按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现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

2023 年是三年新冠疫情防控转折后经济恢复发展的一年，但受制于地产持续调整、外需走弱、社会预期偏弱等不利因素，修复过程较为波折。2023 年全年 GDP 增长 5.2%，高于年初制定的 5%左右的增长目标。12 月 PMI 指数为 49，经济景气程度依旧偏弱。12 月 PPI 同比下跌 2.7%，环比下跌 0.3%；12 月 CPI 同比下跌 0.30%，环比上涨 0.10%，价格信号依旧偏弱。12 月 M2 同比增速为 9.7%，M1 同比增速为 1.3%，全年社会融资规模同比增长 9.84%。12 月末外汇储备 3.2 万亿美元，汇率整体平稳。2023 年全年 A 股市场表现疲软，风格方面小盘优于大盘、价值优于成长，沪深 300、中证 500 和创业板指分别下跌 11.38%、7.42%和 19.41%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2023 年度，本基金份额净值增长率为-2.90%，业绩比较基准收益率为-5.91%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2024 年，海外方面，美国经济预计保持相当韧性，在通胀得到控制之后，联储有望开启

宽松周期，这将有利于新兴市场的资产表现；国内方面，有效需求不足以及地产行业的调整等因素将会导致经济回升面临一定的困难，但中央财政的持续发力以及“三大工程”有望对经济形成一定支撑，而中美库存周期的震荡回升有望对全年经济形成拉动。市场风格方面，过去 2 年成长与价值、大盘与小盘的分化有望得到改善，市场风格将更加均衡。长期来看，改革创新是保持经济增长的根本动力，在科学技术带动产业升级的大背景下，我们对经济的长期健康发展持较为乐观的态度。目前 A 股市场整体估值已进入长期价值配置区间，具有较高成长性的行业和较强竞争力的公司，将具备较高的投资价值。我们的投资组合仍然会维持价值和成长之间的平衡，同时关注现金流良好和内生成长稳健的公司，在股市波动中以自下而上选股为主以期产生长期投资回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人继续完善内部控制体系和内部控制制度，健全管理制度和业务规章，依据国家相关法律法规、内部控制制度、内部管理制度和业务规章、基金合同以及基金招募说明书对本基金的投资、销售、运营等业务中的内部控制完善程度和执行情况进行持续的监察稽核，对监察稽核中发现的问题及时提示，督促改进并跟踪改进效果。定期编制监察稽核报告，及时报送上级监管部门（如需）。

为提高防范和化解经营风险的能力，确保经营业务稳健运行和受托资产安全完整，保障基金份额持有人利益，本基金管理人采取的主要措施包括：

1、进一步完善内部控制体系和内部控制制度。本公司已经建立了科学合理的层次分明的包括内控组织架构、控制程序和控制措施以及控制职责在内的运行高效、严密的内部控制体系。

2、进一步健全管理制度和业务规章。在已建立的基本管理制度、业务流程、规章等基础上，根据公司的业务发展和法律法规的颁布情况，对相关管理制度和业务流程规章进行全面修订及更新，从管理制度和业务流程上进行风险控制，进一步强化内部制度的执行力度。

3、坚持岗位分离、相互制衡的内控机制。在岗位设置上继续采取严格的分离制度，形成不同岗位之间的相互制衡机制，从岗位设置上减少和防范操作及操守风险。

4、持续地对基金经营业务的合法合规性进行监控。采取了实时监控、常规稽核、专项稽核和临时稽核等方式，对发现的问题及时提示并督促改进，防范各种违法违规行为的发生，切实保护基金份额持有人的合法权益。

5、执行以 KPI(Key Performance Indicator 主要绩效指标)为风险控制主要手段和评估标准的风险评估、预警、报告、控制以及监督程序。并通过适当的控制流程，定期或实时对风险进行评估、预警和监督，从而确认、评估和预警与公司管理及基金运作有关的风险。通过顺畅的报告渠道，对风险问题进行层层监督、管理和控制，使部门和管理层及时把握风险状况并快速做

出风险控制决策。

6、采用自动化监督控制系统。采用电子化投资交易系统，对投资比例进行限制，有效地防止合规性运作风险和操作风险。

7、按照法律法规的要求，认真做好旗下各只基金的信息披露工作，确保有关信息披露的真实、完整、准确、及时。

8、定期不定期地组织合规培训。通过结合外部律师培训、内部合规培训以及证券业协会的后续教育课程，进一步加强对员工的合规教育，健全公司合规文化。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人成立基金估值委员会对基金财产的估值方法及程序作决策，基金估值委员会在遵守法律法规的前提下，通过参考行业协会的估值指引及独立第三方估值服务机构的估值数据等方式，谨慎合理地制定高效可行的估值方法，及时准确地进行份额净值的计量，保护基金份额持有人的合法权益。

基金日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行。基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以双方认可的方式报送给基金托管人，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，无误后返回给基金管理人，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

当发生了影响估值方法和程序的有效性及适用性的情况时，通过会议方式启动估值委员会的运作。研究人员凭借其丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究，综合宏观经济、行业发展及个券状况等各方面因素，从价值投资的角度进行理论分析，并根据分析的结果向基金估值委员会提出有关估值方法或估值模型的建议。风险管理人员根据研究人员提出的估值方法或估值模型进行计算及验证，并根据计算和验证的结果与投资人员共同确定估值方法并提交估值委员会。基金事务部基金会计负责与基金托管人沟通，必要时应就所采用的估值技术、假设及输入值得适当性等咨询会计师事务所的专业意见。法律、监察稽核部相关人员负责监察执行估值政策及程序的合规性，控制执行中可能发生的风险。估值委员会共同讨论通过后，基金事务部基金会计根据估值委员会确认的估值方法对各基金进行估值核算并与基金托管行核对，法律、监察稽核部负责对外进行信息披露。

截止本报告期末，本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司合作，

由其提供相关债券品种、流通受限股票的估值参考数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内实施了二次利润分配。(1)截至2023年6月21日,本基金可供分配利润为648,751,607.99元,本基金的基金管理人已于2023年6月28日完成权益登记,每10份基金份额派发红利2.38元,详细信息请查阅相关分红公告。(2)截至2023年12月25日,本基金可供分配利润为233,332,397.90元,本基金的基金管理人已于2023年12月28日完成权益登记,每10份基金份额派发红利0.42元,详细信息请查阅相关分红公告。

截至本报告期末,根据相关法律法规和基金合同的要求以及本基金的实际运作情况,经本基金管理人研究决定暂不实施利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期,本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§ 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 | 普华永道中天审字(2024)第25180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 | 景顺长城量化小盘股票型证券投资基金全体基金份额持有人 |
| 审计意见 | <p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了景顺长城量化小盘股票型证券投资基金(以下简称“景顺长城量化小盘基金”)的财务报表,包括2023年12月31日的资产负债表,2023年度的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了景顺长城量化小盘基金2023年12月31日的财务状况以及2023年度的经营成果和净资产变动情况。</p> |
| 形成审计意见的基础 | <p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于景顺长城量化小盘基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p> |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | <p>景顺长城量化小盘基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估景顺长城量化小盘基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算景顺长城量化小盘基金、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督景顺长城量化小盘基金的财务报告过程。</p> |
| 注册会计师对财务报表审计的责任 | <p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(一) 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、</p> |

| | |
|-----------|--|
| | <p>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>(二) 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>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对导致对景顺长城量化小盘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景顺长城量化小盘基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p> |
| 会计师事务所的名称 | 普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) |
| 注册会计师的姓名 | 朱宏宇 郭劲扬 |
| 会计师事务所的地址 | 中国上海市 |
| 审计报告日期 | 2024 年 3 月 27 日 |

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：景顺长城量化小盘股票型证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2023 年 12 月 31 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|-------------------------|--------------------------|
| 资产： | | | |
| 货币资金 | 7.4.7.1 | 85,365,489.72 | 29,280,457.86 |
| 结算备付金 | | 31,032,622.31 | 2,485,449.52 |
| 存出保证金 | | 4,224,180.16 | 316,290.19 |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 1,205,831,923.67 | 479,660,016.70 |
| 其中：股票投资 | | 1,204,657,343.66 | 479,660,016.70 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 1,174,580.01 | - |

| | | | |
|---------------|------------|----------------------------|-----------------------------|
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 7.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 7.4.7.4 | - | - |
| 债权投资 | 7.4.7.5 | - | - |
| 其中：债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 其他债权投资 | 7.4.7.6 | - | - |
| 其他权益工具投资 | 7.4.7.7 | - | - |
| 应收清算款 | | - | 3,765,276.40 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 86,042.14 | 166,612.93 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 7.4.7.8 | - | - |
| 资产总计 | | 1,326,540,258.00 | 515,674,103.60 |
| 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 | | 9,787,675.00 | 2,989,206.15 |
| 应付赎回款 | | 245,958.94 | 1,106,948.22 |
| 应付管理人报酬 | | 1,391,377.54 | 702,986.93 |
| 应付托管费 | | 231,896.27 | 117,164.47 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | 2.78 | 3.05 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 7.4.7.9 | 4,491,963.45 | 2,406,853.52 |
| 负债合计 | | 16,148,873.98 | 7,323,162.34 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 7.4.7.10 | 1,086,722,403.05 | 335,576,804.15 |
| 其他综合收益 | 7.4.7.11 | - | - |
| 未分配利润 | 7.4.7.12 | 223,668,980.97 | 172,774,137.11 |
| 净资产合计 | | 1,310,391,384.02 | 508,350,941.26 |
| 负债和净资产总计 | | 1,326,540,258.00 | 515,674,103.60 |

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.2058 元，基金份额总额 1,086,722,403.05 份。

7.2 利润表

会计主体：景顺长城量化小盘股票型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 |
|------------------------|------------|---|--|
| 一、营业总收入 | | -71,829,345.70 | -178,922,465.20 |
| 1. 利息收入 | | 753,237.54 | 283,880.59 |
| 其中：存款利息收入 | 7.4.7.13 | 753,237.54 | 283,880.59 |
| 债券利息收入 | | - | - |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | -79,483,102.73 | -141,586,005.11 |
| 其中：股票投资收益 | 7.4.7.14 | -93,253,478.78 | -151,352,807.91 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 7.4.7.15 | 1,730,006.34 | 671,500.16 |
| 资产支持证券投资 | 7.4.7.16 | - | - |
| 收益 | | | |
| 贵金属投资收益 | 7.4.7.17 | - | - |
| 衍生工具收益 | 7.4.7.18 | -4,618,098.49 | - |
| 股利收益 | 7.4.7.19 | 16,658,468.20 | 9,095,302.64 |
| 以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益 | | - | - |
| 其他投资收益 | | - | - |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.20 | 6,406,761.33 | -39,695,788.41 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | 7.4.7.21 | 493,758.16 | 2,075,447.73 |
| 减：二、营业总支出 | | 19,259,696.04 | 13,926,105.58 |
| 1. 管理人报酬 | 7.4.10.2.1 | 16,322,969.98 | 11,774,996.71 |
| 其中：暂估管理人报酬 | | - | - |
| 2. 托管费 | 7.4.10.2.2 | 2,720,494.95 | 1,962,499.45 |
| 3. 销售服务费 | 7.4.10.2.3 | - | - |
| 4. 投资顾问费 | | - | - |
| 5. 利息支出 | | - | - |

| | | | |
|---------------------|----------|----------------|-----------------|
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6. 信用减值损失 | 7.4.7.22 | - | - |
| 7. 税金及附加 | | 100.19 | 2.60 |
| 8. 其他费用 | 7.4.7.23 | 216,130.92 | 188,606.82 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | -91,089,041.74 | -192,848,570.78 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | -91,089,041.74 | -192,848,570.78 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | -91,089,041.74 | -192,848,570.78 |

7.3 净资产变动表

会计主体：景顺长城量化小盘股票型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日 | | | |
|--|--|--------|-----------------|------------------|
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产 | 335,576,804.15 | - | 172,774,137.11 | 508,350,941.26 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本年期初净资产 | 335,576,804.15 | - | 172,774,137.11 | 508,350,941.26 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | 751,145,598.90 | - | 50,894,843.86 | 802,040,442.76 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | -91,089,041.74 | -91,089,041.74 |
| （二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列） | 751,145,598.90 | - | 448,189,536.82 | 1,199,335,135.72 |
| 其中：1. 基金申购款 | 937,425,732.34 | - | 533,867,808.26 | 1,471,293,540.60 |
| 2. 基金赎回款 | -186,280,133.44 | - | -85,678,271.44 | -271,958,404.88 |
| （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） | - | - | -306,205,651.22 | -306,205,651.22 |

| | | | | |
|--|----------------------------------|--------|-----------------|------------------|
| (四)、其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产 | 1,086,722,403.05 | - | 223,668,980.97 | 1,310,391,384.02 |
| 项目 | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日 | | | |
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产 | 381,481,082.93 | - | 319,030,729.85 | 700,511,812.78 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产 | 381,481,082.93 | - | 319,030,729.85 | 700,511,812.78 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -45,904,278.78 | - | -146,256,592.74 | -192,160,871.52 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | -192,848,570.78 | -192,848,570.78 |
| （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） | -45,904,278.78 | - | 46,591,978.04 | 687,699.26 |
| 其中：1. 基金申购款 | 514,302,888.75 | - | 359,847,247.34 | 874,150,136.09 |
| 2. 基金赎回款 | -560,207,167.53 | - | -313,255,269.30 | -873,462,436.83 |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列） | - | - | - | - |
| （四）、其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产 | 335,576,804.15 | - | 172,774,137.11 | 508,350,941.26 |

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：

康乐

吴建军

邵媛媛

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

景顺长城量化小盘股票型证券投资基金(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[2017]第 2169 号《关于准予景顺长城量化小盘股票型证券投资基金注册的批复》核准,由景顺长城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《景顺长城量化小盘股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,783,703,963.03 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2018)第 0090 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《景顺长城量化小盘股票型证券投资基金基金合同》于 2018 年 2 月 6 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,784,551,427.10 份基金份额,其中认购资金利息折合 847,464.07 份基金份额。本基金的基金管理人为景顺长城基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城量化小盘股票型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票及存托凭证)、债券(包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、可交换公司债券、可转换公司债券(含可分离交易可转债)、中小企业私募债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债等)、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货以及法律法规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)。基金的投资组合比例为:股票投资占基金资产的比例范围为 80-95%,投资于小盘股票的比例不低于非现金基金资产的 80%,除股票外的其他资产占基金资产的比例范围为 5%-20%,每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需要缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府证券不低于基金净资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:中证 1000 指数收益率 X95%+银行活期存款利率(税后)X5%。

本财务报表由本基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司于 2024 年 3 月 27 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业

务指引》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2023 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

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

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

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

(2) 金融负债

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

(3) 衍生金融工具

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价

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

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

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管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

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

(1)对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

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

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

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于

资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39 号《关于减半征收交易印花税的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前(如适用)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，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起(如适用)产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

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

对基金通过沪港通或深港通(如有)投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。基金通过沪港通或深港通(如有)买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2023 年 12 月 31 日 | | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 | |
|-----------------------|-------------------------|---------------|--------------------------|---------------|
| | 活期存款 | 85,365,489.72 | | 29,280,457.86 |
| 等于：本金 | 85,356,114.15 | | 29,277,382.48 | |
| 加：应计利息 | 9,375.57 | | 3,075.38 | |
| 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 个月（含） -3 个月 | - | | - | |
| 其他存款 | - | | - | |
| 等于：本金 | - | | - | |
| 加：应计利息 | - | | - | |
| 减：坏账准备 | - | | - | |
| 合计 | 85,365,489.72 | | 29,280,457.86 | |

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 | 1,228,457,470.54 | - | 1,204,657,343.66 | -23,800,126.88 | |
| 贵金属投资-金交 所黄金合约 | - | - | - | - | |
| 债券 | 交易所市 场 | 1,096,000.00 | 88.25 | 1,174,580.01 | 78,491.76 |
| | 银行间市 场 | - | - | - | - |
| | 合计 | 1,096,000.00 | 88.25 | 1,174,580.01 | 78,491.76 |
| 资产支持证券 | - | - | - | - | |
| 基金 | - | - | - | - | |
| 其他 | - | - | - | - | |
| 合计 | 1,229,553,470.54 | 88.25 | 1,205,831,923.67 | -23,721,635.12 | |
| 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 | | 509,172,733.15 | - | 479,660,016.70 | -29,512,716.45 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | | - | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | - | - | - | - |
| | 银行间市场 | - | - | - | - |
| | 合计 | - | - | - | - |
| 资产支持证券 | | - | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - | - |
| 合计 | | 509,172,733.15 | - | 479,660,016.70 | -29,512,716.45 |

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 | 32,161,680.00 | - | - | - |
| 其中：股指期货投资 | 32,161,680.00 | - | - | - |
| 其他衍生工具 | - | - | - | - |
| 合计 | 32,161,680.00 | - | - | - |
| 项目 | 上年度末 2022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 | - | - | - | - |
| 其他衍生工具 | - | - | - | - |
| 合计 | - | - | - | - |

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 |
|--------|------------------|----------|---------------|------------|
| IM2402 | 中证1000股指期货2402合约 | 10.00 | 11,729,600.00 | 362,360.00 |
| IM2403 | 中证1000股指期货2403合约 | 18.00 | 21,047,760.00 | 253,320.00 |
| 合计 | | | | 615,680.00 |

| | | | | |
|----------------|--|--|--|------------|
| 减：可抵销期货 暂收款 | | | | 615,680.00 |
| 净额 | | | | - |

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 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，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 0。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末的买入返售金融资产余额为零。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末买断式逆回购交易中取得的债券余额为零。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末及上年度末债权投资余额为零。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末及上年度末债权投资余额为零。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末及上年度末其他债权投资余额为零。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末及上年度末其他债权投资余额为零。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金本报告期末及上年度末其他权益工具投资余额为零。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金本报告期末及上年度末其他权益工具投资余额为零。

7.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末及上年度末其他资产余额为零。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2023 年 12 月 31 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|--------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - | - |
| 应付赎回费 | 369.50 | 5,613.07 |
| 应付证券出借违约金 | - | - |
| 应付交易费用 | 4,281,593.95 | 2,221,240.45 |
| 其中：交易所市场 | 4,281,593.95 | 2,221,240.45 |
| 银行间市场 | - | - |
| 应付利息 | - | - |
| 预提费用 | 210,000.00 | 180,000.00 |
| 合计 | 4,491,963.45 | 2,406,853.52 |

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

| 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 | 335,576,804.15 | 335,576,804.15 |
| 本期申购 | 937,425,732.34 | 937,425,732.34 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -186,280,133.44 | -186,280,133.44 |
| 基金拆分/份额折算前 | - | - |
| 基金拆分/份额折算调整 | - | - |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回（以“-”号填列） | - | - |
| 本期末 | 1,086,722,403.05 | 1,086,722,403.05 |

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.11 其他综合收益

无。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------|----------------|----------------|----------------|
| 上年度末 | 213,142,312.84 | -40,368,175.73 | 172,774,137.11 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 本期期初 | 213,142,312.84 | -40,368,175.73 | 172,774,137.11 |
| 本期利润 | -97,495,803.07 | 6,406,761.33 | -91,089,041.74 |

| | | | |
|----------------|-----------------|----------------|-----------------|
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 484,235,932.19 | -36,046,395.37 | 448,189,536.82 |
| 其中：基金申购款 | 583,062,400.37 | -49,194,592.11 | 533,867,808.26 |
| 基金赎回款 | -98,826,468.18 | 13,148,196.74 | -85,678,271.44 |
| 本期已分配利润 | -306,205,651.22 | - | -306,205,651.22 |
| 本期末 | 293,676,790.74 | -70,007,809.77 | 223,668,980.97 |

7.4.7.13 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1月1日至2022年12月31日 |
|-----------|-----------------------------|----------------------------------|
| 活期存款利息收入 | 291,992.96 | 195,079.58 |
| 定期存款利息收入 | - | - |
| 其他存款利息收入 | - | - |
| 结算备付金利息收入 | 455,179.28 | 83,711.53 |
| 其他 | 6,065.30 | 5,089.48 |
| 合计 | 753,237.54 | 283,880.59 |

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年12月31日 | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日 |
|------------------|-----------------------------|----------------------------------|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | -93,253,478.78 | -151,352,807.91 |
| 股票投资收益——赎回差价收入 | - | - |
| 股票投资收益——申购差价收入 | - | - |
| 股票投资收益——证券出借差价收入 | - | - |
| 合计 | -93,253,478.78 | -151,352,807.91 |

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年12月31日 | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日 |
|------------|-----------------------------|----------------------------------|
| 卖出股票成交总额 | 8,344,487,285.38 | 7,145,310,740.95 |
| 减：卖出股票成本总额 | 8,413,259,757.55 | 7,274,983,003.69 |
| 减：交易费用 | 24,481,006.61 | 21,680,545.17 |
| 买卖股票差价收入 | -93,253,478.78 | -151,352,807.91 |

7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年12月31 日 | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31 日 |
|------------------------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 债券投资收益——利息收入 | 1,297.81 | 729.52 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 1,728,708.53 | 670,770.64 |
| 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 | 1,730,006.34 | 671,500.16 |

7.4.7.15.2 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1月1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 | 9,052,919.71 | 3,356,179.18 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 7,322,600.00 | 2,684,500.00 |
| 减：应计利息总额 | 1,248.38 | 788.40 |
| 减：交易费用 | 362.80 | 120.14 |
| 买卖债券差价收入 | 1,728,708.53 | 670,770.64 |

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年12月 31日 | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12 月31日 |
|----------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 股指期货投资收益 | -4,618,098.49 | - |

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年12月 31日 | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月 31日 |
|---------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 16,658,468.20 | 9,095,302.64 |
| 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 | 16,658,468.20 | 9,095,302.64 |

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2023年1月1日至2023年 12月31日 | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日 |
|------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | 5,791,081.33 | -39,695,788.41 |
| 股票投资 | 5,712,589.57 | -39,593,388.41 |
| 债券投资 | 78,491.76 | -102,400.00 |
| 资产支持证券投资 | - | - |
| 基金投资 | - | - |
| 贵金属投资 | - | - |
| 其他 | - | - |
| 2. 衍生工具 | 615,680.00 | - |

| | | |
|------------------------|--------------|----------------|
| 权证投资 | - | - |
| 期货投资 | 615,680.00 | - |
| 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 | 6,406,761.33 | -39,695,788.41 |

7.4.7.21 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1月1日至2022年12月31日 |
|---------|-----------------------------|----------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 477,635.69 | 1,374,002.73 |
| 基金转换费收入 | 16,122.47 | 701,445.00 |
| 合计 | 493,758.16 | 2,075,447.73 |

7.4.7.22 信用减值损失

无。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年12月31日 | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日 |
|---------|-----------------------------|----------------------------------|
| 审计费用 | 90,000.00 | 60,000.00 |
| 信息披露费 | 120,000.00 | 120,000.00 |
| 证券出借违约金 | - | - |
| 银行划款手续费 | 5,770.92 | 8,246.82 |
| 其他 | 360.00 | 360.00 |
| 合计 | 216,130.92 | 188,606.82 |

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

截至财务报表报出日，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 |
|------------------------|-------------------|
| 景顺长城基金管理有限公司 | 基金管理人、登记机构、基金销售机构 |
| 中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”） | 基金托管人、基金销售机构 |
| 长城证券股份有限公司（“长城证券”） | 基金管理人的股东、基金销售机构 |
| 景顺资产管理有限公司 | 基金管理人的股东 |

| | |
|------------------|-----------|
| 开滦(集团)有限责任公司 | 基金管理人的股东 |
| 大连实德集团有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 景顺长城资产管理(深圳)有限公司 | 基金管理人的子公司 |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2023年1月1日至2023年12月31日 | | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日 | |
|-------|-----------------------------|-------------------------|----------------------------------|-------------------------|
| | 成交金额 | 占当期股票 成交总额的比 例(%) | 成交金额 | 占当期股票 成交总额的比 例(%) |
| 长城证券 | 54,301,490.41 | 0.31 | 186,643,089.90 | 1.31 |

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 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(%) |
| 长城证券 | 50,990.59 | 0.31 | 27,170.75 | 0.63 |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日 | | | |
| | 当期 佣金 | 占当期佣金总量 的比例(%) | 期末应付佣金余 额 | 占期末应付佣金 总额的比例(%) |
| 长城证券 | 173,815.23 | 1.31 | 173,815.23 | 7.83 |

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

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

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----|----|---------|
|----|----|---------|

| | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日 | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 |
|------------------|----------------------------------|----------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 16,322,969.98 | 11,774,996.71 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 2,128,486.43 | 3,117,570.45 |
| 应支付基金管理人的净管理费 | 14,194,483.55 | 8,657,426.26 |

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.5\% / \text{当年天数}。$$

根据《景顺长城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》，自 2023 年 8 月 22 日起，支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.2% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.2\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 |
|----------------|--|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 2,720,494.95 | 1,962,499.45 |

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

根据《景顺长城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》，自 2023 年 8 月 22 日起，支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.2% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.2\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期及上年度可比期间无支付给各关联方的销售服务费。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金于本报告期及上年度可比期间未与关联方发生转融通证券出借业务交易。

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

本基金于本报告期及上年度可比期间未与关联方发生转融通证券出借业务交易。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人于本报告期及上年度可比期间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

本基金的其他关联方于本报告期末及上年度末均未持有本基金份额。

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 | | 上年度可比期间 | |
|-----------|-----------------------|------------|-----------------------|------------|
| | 2023年1月1日至2023年12月31日 | | 2022年1月1日至2022年12月31日 | |
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国建设银行-活期 | 85,365,489.72 | 291,992.96 | 29,280,457.86 | 195,079.58 |

注：本基金的活期银行存款由基金托管人保管，并按银行间同业利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

| 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 |
|----|-------------|-------------|-------------|----------------|---------------|----------------|----|
| 1 | 2023年6月28日 | 2023年6月28日 | 2.3800 | 234,809,936.18 | 26,400,894.18 | 261,210,830.36 | - |
| 2 | 2023年12月28日 | 2023年12月28日 | 0.4200 | 26,638,942.84 | 18,355,878.02 | 44,994,820.86 | - |
| 合计 | - | - | 2.8000 | 261,448,879.02 | 44,756,772.20 | 306,205,651.22 | - |

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 | 夏厦精密 | 2023年11月9日 | 6个月 | 新股流通受限 | 53.63 | 75.36 | 64 | 3,432.32 | 4,823.04 | - |
| 001326 | 联域股份 | 2023年11月1日 | 6个月 | 新股流通受限 | 41.18 | 48.64 | 99 | 4,076.82 | 4,815.36 | - |
| 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 | - |
| 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 | - |
| 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 | - |
| 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 | - |
| 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 | 信音电子 | 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 | - |
| 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 | - |
| 301371 | 敷尔佳 | 2023年7月24日 | 6个月 | 新股流通受限 | 55.68 | 37.58 | 564 | 31,403.52 | 21,195.12 | - |
| 301381 | 赛维时代 | 2023年7月5日 | 6个月 | 新股流通受限 | 20.45 | 29.69 | 571 | 11,676.95 | 16,952.99 | - |
| 301393 | 昊帆生物 | 2023年7月5日 | 6个月 | 新股流通受限 | 67.68 | 59.37 | 260 | 17,596.80 | 15,436.20 | - |
| 301413 | 安培龙 | 2023年12 | 6个月 | 新股 | 33.25 | 58.19 | 164 | 5,453.00 | 9,543.16 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------------|------|--------|-------|-------|-----|-----------|-----------|---|
| | | 月 11 日 | | 流通受限 | | | | | | |
| 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 | 407 | 15,449.72 | 12,368.73 | - |
| 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 | - |
| 301486 | 致尚科技 | 2023 年 6 月 30 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 57.66 | 47.25 | 482 | 27,792.12 | 22,774.50 | - |
| 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 | - |
| 301498 | 乖宝宠物 | 2023 年 8 月 9 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 39.99 | 38.81 | 554 | 22,154.46 | 21,500.74 | - |
| 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 | - |
| 301509 | 金凯生科 | 2023 年 7 月 26 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 56.56 | 62.23 | 266 | 15,044.96 | 16,553.18 | - |
| 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 | - |
| 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 | - |
| 301525 | 儒竞科技 | 2023年8月23日 | 6个月 | 新股 流通 受限 | 99.57 | 81.46 | 266 | 26,485.62 | 21,668.36 | - |
| 301526 | 国际复材 | 2023年12月19日 | 6个月 | 新股 流通 受限 | 2.66 | 4.45 | 9,723 | 25,863.18 | 43,267.35 | - |
| 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 | - |
| 301548 | 崇德科技 | 2023年9月11日 | 6个月 | 新股 流通 受限 | 66.80 | 58.99 | 136 | 9,084.80 | 8,022.64 | - |
| 301550 | 斯菱股份 | 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 | - |
| 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 | 1,315 | 31,849.30 | 23,985.60 | - |
| 301566 | 达利凯普 | 2023年12月22日 | 6个月 | 新股 流通 | 8.90 | 22.14 | 576 | 5,126.40 | 12,752.64 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|-------------|-----|----------------|-------|-------|-------|-----------|-----------|---|
| | | | | 受限 | | | | | | |
| 301568 | 思泰克 | 2023年11月21日 | 6个月 | 新股 流通 受限 | 23.23 | 35.58 | 246 | 5,714.58 | 8,752.68 | - |
| 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 | 1,263 | 14,208.75 | 13,981.41 | - |
| 601096 | 宏盛华源 | 2023年12月15日 | 6个月 | 新股 流通 受限 | 1.70 | 4.06 | 3,918 | 6,660.60 | 15,907.08 | - |
| 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 | 126 | 7,318.08 | 7,284.06 | - |
| 603075 | 热威股份 | 2023年9月1日 | 6个月 | 新股 流通 受限 | 23.10 | 23.31 | 182 | 4,204.20 | 4,242.42 | - |
| 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 | 浙江荣泰 | 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 | - |
| 603193 | 润本股份 | 2023年10月9日 | 6个月 | 新股 流通 受限 | 17.38 | 16.66 | 303 | 5,266.14 | 5,047.98 | - |
| 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 | - |
| 603275 | 众辰科技 | 2023年8月16日 | 6个月 | 新股 流通 受限 | 49.97 | 39.70 | 193 | 9,644.21 | 7,662.10 | - |
| 603276 | 恒兴新材 | 2023年9 | 6个月 | 新股 | 25.73 | 24.88 | 134 | 3,447.82 | 3,333.92 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------------|--------|--------|-------|-------|-------|-----------|-----------|---|
| | | 月 18 日 | | 流通受限 | | | | | | |
| 603296 | 华勤技术 | 2023 年 8 月 1 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 80.80 | 77.75 | 593 | 47,914.40 | 46,105.75 | - |
| 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 | - |
| 688548 | 广钢气体 | 2023 年 8 月 8 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 9.87 | 12.75 | 4,048 | 39,953.76 | 51,612.00 | - |
| 688549 | 中巨芯 | 2023 年 8 月 30 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 5.18 | 8.09 | 4,294 | 22,242.92 | 34,738.46 | - |
| 688563 | 航材股份 | 2023 年 7 月 12 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 78.99 | 60.49 | 1,195 | 94,393.05 | 72,285.55 | - |
| 688582 | 芯动联科 | 2023 年 6 月 21 日 | 6 个月以上 | 新股流通受限 | 26.74 | 38.67 | 648 | 17,327.52 | 25,058.16 | - |
| 688591 | 泰凌微 | 2023 年 8 月 18 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 24.98 | 28.02 | 681 | 17,011.38 | 19,081.62 | - |
| 688592 | 司南导航 | 2023 年 8 月 7 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 50.50 | 50.53 | 216 | 10,908.00 | 10,914.48 | - |
| 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 | - |
| 688603 | 天承科技 | 2023 年 6 月 30 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 55.00 | 74.14 | 140 | 7,700.00 | 10,379.60 | - |
| 688612 | 威迈斯 | 2023 年 7 月 19 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 47.29 | 37.97 | 422 | 19,956.38 | 16,023.34 | - |
| 688627 | 精智达 | 2023 年 7 月 11 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 46.77 | 87.72 | 222 | 10,382.94 | 19,473.84 | - |
| 688646 | 逸飞激光 | 2023 年 7 月 21 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 46.80 | 36.07 | 219 | 10,249.20 | 7,899.33 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|-------------|-----|----------------|--------|-------|-----|-----------|-----------|---|
| 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 | 416 | 13,291.20 | 21,736.00 | - |
| 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 | - |
| 688671 | 碧兴物联 | 2023年8月2日 | 6个月 | 新股 流通 受限 | 36.12 | 34.30 | 226 | 8,163.12 | 7,751.80 | - |
| 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 | 盛科通信 | 2023年9月6日 | 6个月 | 新股 流通 受限 | 42.66 | 48.18 | 549 | 23,420.34 | 26,450.82 | - |
| 688716 | 中研股份 | 2023年9月13日 | 6个月 | 新股 流通 受限 | 29.66 | 36.39 | 267 | 7,919.22 | 9,716.13 | - |
| 688719 | 爱科赛博 | 2023年9月20日 | 6个月 | 新股 流通 受限 | 69.98 | 60.10 | 194 | 13,576.12 | 11,659.40 | - |
| 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 | - |

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券

| 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:张) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
|--------|-------|-------------|-----------|--------|--------|--------|--------------|------------|------------|----|
| 113069 | 博23转债 | 2023年12月25日 | 1个月内(含) | 新债未上市 | 100.00 | 100.01 | 6,960 | 696,000.00 | 696,045.76 | - |
| 118046 | 诺泰转债 | 2023年12月18日 | 1-6个月(含)) | 新债未上市 | 100.00 | 100.01 | 110 | 11,000.00 | 11,000.82 | - |
| 127100 | 神码转债 | 2023年12 | 1个月内 | 新债 | 100.00 | 100.01 | 2,454 | 245,400.00 | 245,417.75 | - |

| | | | | | | | | | |
|--|--|--------|-----|-----|--|--|--|--|--|
| | | 月 21 日 | (含) | 未上市 | | | | | |
|--|--|--------|-----|-----|--|--|--|--|--|

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金于本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 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, 本基金无因从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金管理人秉承全面风险管理的理念, 将风险管理融入业务中, 建立了以风险管理委员会为核心, 由风险管理委员会、督察长、法律监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。各业务部门负责人为其所在部门的风险管理第一责任人, 对本部门业务范围内的风险负有管控和及时报告的义务。员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。本基金管理人配备的风险管理人员对投资风险进行独立的监控并及时向管理层汇报。

7.4.13.2 信用风险

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

本基金的投资范围及投资比例符合相关法律法规的要求、相关监管机构的相关规定及本基金的合同要求。本基金管理人通过建立和完善内部信用评级体系和交易对手库, 对发行人及债券投资进行内部评级, 对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度, 以控制可能出现的信用风险。本基金的活期银行存款存放在具有托管资格的银行; 本基金存放定期存款前, 均对交易对

手进行信用评估以控制相应的信用风险，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在银行间同业市场仅与达到本基金管理人既定信用政策标准的交易对手进行交易，以控制相应的信用风险。

本基金管理人还通过分散化投资以分散信用风险。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管理人管理的其他基金共同持有一家公司的发行的证券，不得超过该证券余额的 10%。

于本报告期末，本基金持有除国债、央行票据、政策性金融债及地方政府债券之外的债券和资产支持证券的账面价值占基金净资产的比例为 0.09%（上年度末：0.00%）。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险，是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难，另一方面来自于基金份额持有人可依据基金合同约定要求赎回其持有的基金份额。

本基金的基金管理人专业审慎、勤勉尽责地管控本基金的流动性风险，全覆盖、多维度的建立以压力测试为核心的流动性风险监测与预警制度，确保本基金组合的资产变现能力与投资者赎回需求匹配与平衡。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式

借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人对其管理的所有开放式基金于开放期内，对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场价格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。本基金管理人通过对不同类型的风险分别设定风险限制，并由独立于投资部门的风险管理人员监控、报告以及定期风险回顾的方法管理投资组合的市场风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。

本基金管理人通过风险管理人员定期监控组合中债券投资部分的利率风险，及时调整投资组合久期等方法管理利率风险。

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的重新定价日或到期日进行了分类。

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 个月以内 | 1-3 个月 | 3 个 月-1 年 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|-------------------------------|---------------|-----------|-----------------|-------|-------|-----|---------------|
| 资产 | | | | | | | |
| 货币资金 | 85,365,489.72 | - | - | - | - | - | 85,365,489.72 |
| 结算备付金 | 31,032,622.31 | - | - | - | - | - | 31,032,622.31 |

| | | | | | | | |
|--------------------------------|----------------|-----------|-----------------|------------|------------------|------------------|----------------|
| 存出保证金 | 290,896.96 | - | - | - | - | 3,933,283.20 | 4,224,180.16 |
| 交易性金融资产 | - | - | -696,045.76 | 478,534.25 | 1,204,657,343.66 | 1,205,831,923.67 | |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | 86,042.14 | 86,042.14 |
| 资产总计 | 116,689,008.99 | - | -696,045.76 | 478,534.25 | 1,208,676,669.00 | 1,326,540,258.00 | |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 245,958.94 | 245,958.94 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 1,391,377.54 | 1,391,377.54 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 231,896.27 | 231,896.27 |
| 应付清算款 | - | - | - | - | - | 9,787,675.00 | 9,787,675.00 |
| 应交税费 | - | - | - | - | - | 2.78 | 2.78 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 4,491,963.45 | 4,491,963.45 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 16,148,873.98 | 16,148,873.98 |
| 利率敏感度缺口 | 116,689,008.99 | - | -696,045.76 | 478,534.25 | - | - | - |
| 上年度末 2022 年 12 月 31 日 | 1 个月以内 | 1-3 个月 | 3 个 月-1 年 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | | | |
| 货币资金 | 29,280,457.86 | - | - | - | - | - | 29,280,457.86 |
| 结算备付金 | 2,485,449.52 | - | - | - | - | - | 2,485,449.52 |
| 存出保证金 | 316,290.19 | - | - | - | - | - | 316,290.19 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | - | - | 479,660,016.70 | 479,660,016.70 |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | 166,612.93 | 166,612.93 |
| 应收清算款 | - | - | - | - | - | 3,765,276.40 | 3,765,276.40 |
| 资产总计 | 32,082,197.57 | - | - | - | - | 483,591,906.03 | 515,674,103.60 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 1,106,948.22 | 1,106,948.22 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 702,986.93 | 702,986.93 |
| 应付托管 | - | - | - | - | - | 117,164.47 | 117,164.47 |

| | | | | | | | |
|---------|---------------|--|--|--|--|--------------|--------------|
| 费 | | | | | | | |
| 应付清算款 | | | | | | 2,989,206.15 | 2,989,206.15 |
| 应交税费 | | | | | | 3.05 | 3.05 |
| 其他负债 | | | | | | 2,406,853.52 | 2,406,853.52 |
| 负债总计 | | | | | | 7,323,162.34 | 7,323,162.34 |
| 利率敏感度缺口 | 32,082,197.57 | | | | | | |

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期末，本基金持有的债券资产的账面价值占资产净值比例为 0.09%（上年度末：0.00%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年度末：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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因除外汇风险和利率风险以外的市场价格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证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金通过投资组合的分散化降低其它价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

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 | 1,204,657,343.66 | 91.93 | 479,660,016.70 | 94.36 |
| 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 | 1,204,657,343.66 | 91.93 | 479,660,016.70 | 94.36 |

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资（附注：7.4.7.3）。在当日无负债结算制度下，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 0。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变 | | |
|----------------|-------------------------|---------------------------------|------------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元） | |
| | | 本期末（2023 年 12 月 31 日） | 上年度末（2022 年 12 月 31 日） |
| | 沪深 300 指数上升 5% | 59,989,528.39 | 14,084,582.58 |
| 沪深 300 指数下降 5% | -59,989,528.39 | -14,084,582.58 | |

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 | 1,203,732,616.15 | 476,525,479.19 |
| 第二层次 | 977,522.49 | 1,469,297.52 |
| 第三层次 | 1,121,785.03 | 1,665,239.99 |
| 合计 | 1,205,831,923.67 | 479,660,016.70 |

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

| 项目 | 本期 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 | - | 1,665,239.99 | 1,665,239.99 |
| 当期购买 | - | - | - |
| 当期出售/结算 | - | - | - |
| 转入第三层次 | - | 956,613.79 | 956,613.79 |
| 转出第三层次 | - | 1,665,239.99 | 1,665,239.99 |
| 当期利得或损失总额 | - | 165,171.24 | 165,171.24 |
| 其中：计入损益的利得或损失 | - | 165,171.24 | 165,171.24 |
| 计入其他综合收益的利得或损失 | - | - | - |
| 期末余额 | - | 1,121,785.03 | 1,121,785.03 |
| 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 | - | 165,171.24 | 165,171.24 |
| 项目 | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日 | | |
| | 交易性金融资产 | | 合计 |
| | 债券投资 | 股票投资 | |
| 期初余额 | - | - | - |
| 当期购买 | - | - | - |
| 当期出售/结算 | - | - | - |
| 转入第三层次 | - | 1,806,556.46 | 1,806,556.46 |
| 转出第三层次 | - | - | - |
| 当期利得或损失总额 | - | -141,316.47 | -141,316.47 |
| 其中：计入损益的利得或损失 | - | -141,316.47 | -141,316.47 |
| 计入其他综合收益的利得或损失 | - | - | - |
| 期末余额 | - | 1,665,239.99 | 1,665,239.99 |
| 期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未 | - | -141,316.47 | -141,316.47 |

| | | | |
|--------------------------|--|--|--|
| 实现利得或损失的变动— —公允价值变动损益 | | | |
|--------------------------|--|--|--|

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

单位：人民币元

| 项目 | 本期末公允价值 | 采用的估值技术 | 不可观察输入值 | | |
|------|--------------|------------|---------|---------------|------------|
| | | | 名称 | 范围/加权平均值 | 与公允价值之间的关系 |
| 限售股票 | 1,121,785.03 | 平均价格亚式期权模型 | 预期波动率 | 0.1962-2.1988 | 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 | 1,665,239.99 | 平均价格亚式期权模型 | 预期波动率 | 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

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

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|------------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | 1,204,657,343.66 | 90.81 |
| | 其中：股票 | 1,204,657,343.66 | 90.81 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 1,174,580.01 | 0.09 |
| | 其中：债券 | 1,174,580.01 | 0.09 |
| | 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 | - | - |

| | | | |
|---|--------------|------------------|--------|
| | 产 | | |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 116,398,112.03 | 8.77 |
| 8 | 其他各项资产 | 4,310,222.30 | 0.32 |
| 9 | 合计 | 1,326,540,258.00 | 100.00 |

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|------------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 7,522,017.00 | 0.57 |
| B | 采矿业 | 23,195,495.76 | 1.77 |
| C | 制造业 | 799,747,149.19 | 61.03 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 19,783,033.00 | 1.51 |
| E | 建筑业 | 30,185,018.13 | 2.30 |
| F | 批发和零售业 | 61,160,195.69 | 4.67 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 19,712,036.76 | 1.50 |
| H | 住宿和餐饮业 | 3,767,400.00 | 0.29 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 135,358,238.85 | 10.33 |
| J | 金融业 | 14,935,764.92 | 1.14 |
| K | 房地产业 | 28,112,431.56 | 2.15 |
| L | 租赁和商务服务业 | 4,045,216.00 | 0.31 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 15,180,561.36 | 1.16 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 9,287,293.82 | 0.71 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 12,440,554.00 | 0.95 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 20,224,937.62 | 1.54 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 1,204,657,343.66 | 91.93 |

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

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 | 002456 | 欧菲光 | 1,161,100 | 10,113,181.00 | 0.77 |
| 2 | 603530 | 神马电力 | 396,000 | 8,213,040.00 | 0.63 |
| 3 | 688298 | 东方生物 | 228,276 | 8,163,149.76 | 0.62 |
| 4 | 688235 | 百济神州 | 58,172 | 8,088,234.88 | 0.62 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-----------|--------------|------|
| 5 | 603505 | 金石资源 | 292,400 | 7,938,660.00 | 0.61 |
| 6 | 002320 | 海峡股份 | 1,306,645 | 7,617,740.35 | 0.58 |
| 7 | 000597 | 东北制药 | 1,375,000 | 7,356,250.00 | 0.56 |
| 8 | 000990 | 诚志股份 | 882,148 | 7,242,435.08 | 0.55 |
| 9 | 300398 | 飞凯材料 | 446,800 | 7,041,568.00 | 0.54 |
| 10 | 600312 | 平高电气 | 554,363 | 7,034,866.47 | 0.54 |
| 11 | 300455 | 航天智装 | 569,300 | 6,797,442.00 | 0.52 |
| 12 | 002436 | 兴森科技 | 461,100 | 6,792,003.00 | 0.52 |
| 13 | 600480 | 凌云股份 | 745,088 | 6,787,751.68 | 0.52 |
| 14 | 002488 | 金固股份 | 943,600 | 6,775,048.00 | 0.52 |
| 15 | 300170 | 汉得信息 | 806,252 | 6,699,954.12 | 0.51 |
| 16 | 002276 | 万马股份 | 650,215 | 6,645,197.30 | 0.51 |
| 17 | 000928 | 中钢国际 | 1,120,916 | 6,534,940.28 | 0.50 |
| 18 | 000813 | 德展健康 | 1,991,200 | 6,511,224.00 | 0.50 |
| 19 | 300458 | 全志科技 | 286,300 | 6,496,147.00 | 0.50 |
| 20 | 601028 | 玉龙股份 | 606,200 | 6,492,402.00 | 0.50 |
| 21 | 002390 | 信邦制药 | 1,415,600 | 6,285,264.00 | 0.48 |
| 22 | 300476 | 胜宏科技 | 340,000 | 6,273,000.00 | 0.48 |
| 23 | 688185 | 康希诺 | 82,736 | 6,165,486.72 | 0.47 |
| 24 | 603306 | 华懋科技 | 223,800 | 6,067,218.00 | 0.46 |
| 25 | 600363 | 联创光电 | 173,700 | 5,905,800.00 | 0.45 |
| 26 | 601890 | 亚星锚链 | 586,800 | 5,809,320.00 | 0.44 |
| 27 | 300123 | 亚光科技 | 781,000 | 5,724,730.00 | 0.44 |
| 28 | 600595 | 中孚实业 | 1,637,600 | 5,698,848.00 | 0.43 |
| 29 | 002041 | 登海种业 | 428,900 | 5,674,347.00 | 0.43 |
| 30 | 603229 | 奥翔药业 | 425,300 | 5,618,213.00 | 0.43 |
| 31 | 300323 | 华灿光电 | 765,900 | 5,606,388.00 | 0.43 |
| 32 | 300101 | 振芯科技 | 245,000 | 5,593,350.00 | 0.43 |
| 33 | 300346 | 南大光电 | 196,445 | 5,423,846.45 | 0.41 |
| 34 | 002036 | 联创电子 | 524,100 | 5,351,061.00 | 0.41 |
| 35 | 688700 | 东威科技 | 87,536 | 5,341,446.72 | 0.41 |
| 36 | 300188 | 国投智能 | 327,000 | 5,238,540.00 | 0.40 |
| 37 | 002396 | 星网锐捷 | 289,857 | 5,237,715.99 | 0.40 |
| 38 | 300379 | 东方通 | 284,400 | 5,198,832.00 | 0.40 |
| 39 | 000969 | 安泰科技 | 578,000 | 5,196,220.00 | 0.40 |
| 40 | 603368 | 柳药集团 | 274,600 | 5,195,432.00 | 0.40 |
| 41 | 600850 | 电科数字 | 238,200 | 5,180,850.00 | 0.40 |
| 42 | 600612 | 老凤祥 | 74,459 | 5,137,671.00 | 0.39 |
| 43 | 000543 | 皖能电力 | 818,700 | 5,125,062.00 | 0.39 |
| 44 | 600206 | 有研新材 | 412,761 | 5,114,108.79 | 0.39 |
| 45 | 600872 | 中炬高新 | 181,900 | 5,111,390.00 | 0.39 |
| 46 | 002283 | 天润工业 | 872,883 | 5,106,365.55 | 0.39 |
| 47 | 300236 | 上海新阳 | 144,100 | 5,075,202.00 | 0.39 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-----------|--------------|------|
| 48 | 300348 | 长亮科技 | 490,800 | 5,060,148.00 | 0.39 |
| 49 | 002649 | 博彦科技 | 411,190 | 5,045,301.30 | 0.39 |
| 50 | 002038 | 双鹭药业 | 495,100 | 5,045,069.00 | 0.39 |
| 51 | 688518 | 联赢激光 | 245,911 | 5,036,257.28 | 0.38 |
| 52 | 002006 | 精工科技 | 325,200 | 4,969,056.00 | 0.38 |
| 53 | 603033 | 三维股份 | 312,211 | 4,936,055.91 | 0.38 |
| 54 | 600797 | 浙大网新 | 748,400 | 4,909,504.00 | 0.37 |
| 55 | 300180 | 华峰超纤 | 1,108,800 | 4,900,896.00 | 0.37 |
| 56 | 600037 | 歌华有线 | 632,900 | 4,892,317.00 | 0.37 |
| 57 | 000829 | 天音控股 | 511,700 | 4,881,618.00 | 0.37 |
| 58 | 000951 | 中国重汽 | 364,700 | 4,872,392.00 | 0.37 |
| 59 | 000555 | 神州信息 | 431,202 | 4,868,270.58 | 0.37 |
| 60 | 300671 | 富满微 | 150,500 | 4,865,665.00 | 0.37 |
| 61 | 000090 | 天健集团 | 1,057,423 | 4,864,145.80 | 0.37 |
| 62 | 603328 | 依顿电子 | 593,700 | 4,838,655.00 | 0.37 |
| 63 | 301060 | 兰卫医学 | 362,000 | 4,810,980.00 | 0.37 |
| 64 | 002091 | 江苏国泰 | 614,200 | 4,809,186.00 | 0.37 |
| 65 | 601777 | 力帆科技 | 1,341,000 | 4,800,780.00 | 0.37 |
| 66 | 600295 | 鄂尔多斯 | 493,940 | 4,791,218.00 | 0.37 |
| 67 | 688439 | 振华风光 | 53,604 | 4,776,652.44 | 0.36 |
| 68 | 601137 | 博威合金 | 307,500 | 4,775,475.00 | 0.36 |
| 69 | 301071 | 力量钻石 | 147,289 | 4,757,434.70 | 0.36 |
| 70 | 688733 | 壹石通 | 162,196 | 4,747,476.92 | 0.36 |
| 71 | 603636 | 南威软件 | 369,900 | 4,742,118.00 | 0.36 |
| 72 | 688339 | 亿华通 | 103,608 | 4,739,029.92 | 0.36 |
| 73 | 603920 | 世运电路 | 258,300 | 4,721,724.00 | 0.36 |
| 74 | 688048 | 长光华芯 | 75,146 | 4,709,399.82 | 0.36 |
| 75 | 002428 | 云南锗业 | 381,100 | 4,698,963.00 | 0.36 |
| 76 | 000006 | 深振业A | 1,022,800 | 4,694,652.00 | 0.36 |
| 77 | 600531 | 豫光金铅 | 774,501 | 4,685,731.05 | 0.36 |
| 78 | 600100 | 同方股份 | 635,000 | 4,667,250.00 | 0.36 |
| 79 | 002741 | 光华科技 | 313,800 | 4,666,206.00 | 0.36 |
| 80 | 603938 | 三孚股份 | 259,380 | 4,663,652.40 | 0.36 |
| 81 | 601019 | 山东出版 | 496,007 | 4,652,545.66 | 0.36 |
| 82 | 603297 | 永新光学 | 46,800 | 4,649,580.00 | 0.35 |
| 83 | 600449 | 宁夏建材 | 258,900 | 4,642,077.00 | 0.35 |
| 84 | 300134 | 大富科技 | 449,800 | 4,641,936.00 | 0.35 |
| 85 | 600456 | 宝钛股份 | 147,580 | 4,632,536.20 | 0.35 |
| 86 | 000600 | 建投能源 | 923,800 | 4,628,238.00 | 0.35 |
| 87 | 300768 | 迪普科技 | 312,900 | 4,624,662.00 | 0.35 |
| 88 | 002194 | 武汉凡谷 | 467,480 | 4,609,352.80 | 0.35 |
| 89 | 688800 | 瑞可达 | 114,695 | 4,608,445.10 | 0.35 |
| 90 | 603439 | 贵州三力 | 244,000 | 4,606,720.00 | 0.35 |

| | | | | | |
|-----|--------|-------|-----------|--------------|------|
| 91 | 002402 | 和而泰 | 322,364 | 4,606,581.56 | 0.35 |
| 92 | 688268 | 华特气体 | 68,363 | 4,606,298.94 | 0.35 |
| 93 | 300527 | 中船应急 | 599,905 | 4,571,276.10 | 0.35 |
| 94 | 002534 | 西子洁能 | 365,800 | 4,568,842.00 | 0.35 |
| 95 | 301293 | 三博脑科 | 73,100 | 4,562,902.00 | 0.35 |
| 96 | 301217 | 铜冠铜箔 | 384,100 | 4,555,426.00 | 0.35 |
| 97 | 600643 | 爱建集团 | 892,773 | 4,553,142.30 | 0.35 |
| 98 | 301087 | 可孚医疗 | 119,930 | 4,545,347.00 | 0.35 |
| 99 | 000029 | 深深房 A | 386,400 | 4,544,064.00 | 0.35 |
| 100 | 688238 | 和元生物 | 503,902 | 4,530,078.98 | 0.35 |
| 101 | 002212 | 天融信 | 461,801 | 4,516,413.78 | 0.34 |
| 102 | 300224 | 正海磁材 | 383,100 | 4,489,932.00 | 0.34 |
| 103 | 600556 | 天下秀 | 758,500 | 4,482,735.00 | 0.34 |
| 104 | 300579 | 数字认证 | 172,500 | 4,460,850.00 | 0.34 |
| 105 | 600266 | 城建发展 | 918,379 | 4,444,954.36 | 0.34 |
| 106 | 000019 | 深粮控股 | 587,500 | 4,429,750.00 | 0.34 |
| 107 | 603132 | 金徽股份 | 321,800 | 4,402,224.00 | 0.34 |
| 108 | 600986 | 浙文互联 | 801,900 | 4,378,374.00 | 0.33 |
| 109 | 002335 | 科华数据 | 157,900 | 4,370,672.00 | 0.33 |
| 110 | 605365 | 立达信 | 234,500 | 4,364,045.00 | 0.33 |
| 111 | 301165 | 锐捷网络 | 114,997 | 4,357,236.33 | 0.33 |
| 112 | 002249 | 大洋电机 | 872,000 | 4,333,840.00 | 0.33 |
| 113 | 300627 | 华测导航 | 139,294 | 4,320,899.88 | 0.33 |
| 114 | 600649 | 城投控股 | 1,166,200 | 4,314,940.00 | 0.33 |
| 115 | 603027 | 千禾味业 | 266,400 | 4,307,688.00 | 0.33 |
| 116 | 000901 | 航天科技 | 460,900 | 4,295,588.00 | 0.33 |
| 117 | 002706 | 良信股份 | 483,600 | 4,270,188.00 | 0.33 |
| 118 | 000690 | 宝新能源 | 963,100 | 4,266,533.00 | 0.33 |
| 119 | 601068 | 中铝国际 | 919,900 | 4,249,938.00 | 0.32 |
| 120 | 600740 | 山西焦化 | 837,700 | 4,222,008.00 | 0.32 |
| 121 | 603197 | 保隆科技 | 74,800 | 4,218,720.00 | 0.32 |
| 122 | 300460 | 惠伦晶体 | 342,500 | 4,199,050.00 | 0.32 |
| 123 | 000034 | 神州数码 | 140,200 | 4,193,382.00 | 0.32 |
| 124 | 300887 | 谱尼测试 | 354,600 | 4,187,826.00 | 0.32 |
| 125 | 300639 | 凯普生物 | 446,800 | 4,173,112.00 | 0.32 |
| 126 | 601700 | 风范股份 | 831,600 | 4,166,316.00 | 0.32 |
| 127 | 000062 | 深圳华强 | 367,790 | 4,144,993.30 | 0.32 |
| 128 | 002467 | 二六三 | 891,840 | 4,138,137.60 | 0.32 |
| 129 | 600502 | 安徽建工 | 883,977 | 4,110,493.05 | 0.31 |
| 130 | 002051 | 中工国际 | 506,000 | 4,108,720.00 | 0.31 |
| 131 | 603588 | 高能环境 | 626,000 | 4,094,040.00 | 0.31 |
| 132 | 002152 | 广电运通 | 333,900 | 4,093,614.00 | 0.31 |
| 133 | 600618 | 氯碱化工 | 449,800 | 4,093,180.00 | 0.31 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-----------|--------------|------|
| 134 | 601811 | 新华文轩 | 299,600 | 4,092,536.00 | 0.31 |
| 135 | 688128 | 中国电研 | 199,166 | 4,086,886.32 | 0.31 |
| 136 | 002472 | 双环传动 | 156,900 | 4,082,538.00 | 0.31 |
| 137 | 300442 | 润泽科技 | 160,700 | 4,076,959.00 | 0.31 |
| 138 | 300024 | 机器人 | 343,400 | 4,076,158.00 | 0.31 |
| 139 | 002158 | 汉钟精机 | 182,322 | 4,058,487.72 | 0.31 |
| 140 | 300001 | 特锐德 | 201,700 | 4,054,170.00 | 0.31 |
| 141 | 002268 | 电科网安 | 179,900 | 4,040,554.00 | 0.31 |
| 142 | 000566 | 海南海药 | 893,700 | 4,039,524.00 | 0.31 |
| 143 | 600161 | 天坛生物 | 130,500 | 4,037,670.00 | 0.31 |
| 144 | 000059 | 华锦股份 | 732,200 | 4,019,778.00 | 0.31 |
| 145 | 603876 | 鼎胜新材 | 319,500 | 4,003,335.00 | 0.31 |
| 146 | 600180 | 瑞茂通 | 656,900 | 4,000,521.00 | 0.31 |
| 147 | 002773 | 康弘药业 | 215,800 | 3,979,352.00 | 0.30 |
| 148 | 600998 | 九州通 | 559,200 | 3,919,992.00 | 0.30 |
| 149 | 300702 | 天宇股份 | 180,300 | 3,914,313.00 | 0.30 |
| 150 | 600348 | 华阳股份 | 399,400 | 3,898,144.00 | 0.30 |
| 151 | 603053 | 成都燃气 | 378,500 | 3,875,840.00 | 0.30 |
| 152 | 301017 | 漱玉平民 | 189,500 | 3,871,485.00 | 0.30 |
| 153 | 605589 | 圣泉集团 | 172,699 | 3,865,003.62 | 0.29 |
| 154 | 688131 | 皓元医药 | 73,782 | 3,841,090.92 | 0.29 |
| 155 | 600623 | 华谊集团 | 594,500 | 3,828,580.00 | 0.29 |
| 156 | 600252 | 中恒集团 | 1,521,600 | 3,819,216.00 | 0.29 |
| 157 | 601609 | 金田股份 | 559,300 | 3,786,461.00 | 0.29 |
| 158 | 300942 | 易瑞生物 | 323,100 | 3,777,039.00 | 0.29 |
| 159 | 601921 | 浙版传媒 | 494,100 | 3,774,924.00 | 0.29 |
| 160 | 300997 | 欢乐家 | 270,200 | 3,774,694.00 | 0.29 |
| 161 | 600754 | 锦江酒店 | 126,000 | 3,767,400.00 | 0.29 |
| 162 | 600526 | 菲达环保 | 759,500 | 3,751,930.00 | 0.29 |
| 163 | 603610 | 麒盛科技 | 314,328 | 3,746,789.76 | 0.29 |
| 164 | 605138 | 盛泰集团 | 483,100 | 3,744,025.00 | 0.29 |
| 165 | 002583 | 海能达 | 619,800 | 3,687,810.00 | 0.28 |
| 166 | 300811 | 铂科新材 | 69,000 | 3,648,030.00 | 0.28 |
| 167 | 300457 | 赢合科技 | 197,530 | 3,642,453.20 | 0.28 |
| 168 | 301207 | 华兰疫苗 | 130,100 | 3,616,780.00 | 0.28 |
| 169 | 300113 | 顺网科技 | 257,700 | 3,607,800.00 | 0.28 |
| 170 | 002215 | 诺普信 | 435,700 | 3,598,882.00 | 0.27 |
| 171 | 002646 | 天佑德酒 | 264,215 | 3,595,966.15 | 0.27 |
| 172 | 600861 | 北京人力 | 189,600 | 3,553,104.00 | 0.27 |
| 173 | 300741 | 华宝股份 | 165,600 | 3,545,496.00 | 0.27 |
| 174 | 600389 | 江山股份 | 203,299 | 3,537,402.60 | 0.27 |
| 175 | 000737 | 北方铜业 | 607,800 | 3,525,240.00 | 0.27 |
| 176 | 605168 | 三人行 | 55,400 | 3,510,144.00 | 0.27 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|---------|--------------|------|
| 177 | 600007 | 中国国贸 | 181,000 | 3,507,780.00 | 0.27 |
| 178 | 000528 | 柳工 | 519,185 | 3,499,306.90 | 0.27 |
| 179 | 600446 | 金证股份 | 301,200 | 3,484,884.00 | 0.27 |
| 180 | 688035 | 德邦科技 | 64,991 | 3,467,919.76 | 0.26 |
| 181 | 002351 | 漫步者 | 193,300 | 3,415,611.00 | 0.26 |
| 182 | 300119 | 瑞普生物 | 205,541 | 3,368,816.99 | 0.26 |
| 183 | 000650 | 仁和药业 | 496,600 | 3,292,458.00 | 0.25 |
| 184 | 002023 | 海特高新 | 358,400 | 3,261,440.00 | 0.25 |
| 185 | 003012 | 东鹏控股 | 386,300 | 3,186,975.00 | 0.24 |
| 186 | 002287 | 奇正藏药 | 141,200 | 3,175,588.00 | 0.24 |
| 187 | 603063 | 禾望电气 | 126,900 | 3,172,500.00 | 0.24 |
| 188 | 600639 | 浦东金桥 | 309,600 | 3,130,056.00 | 0.24 |
| 189 | 002895 | 川恒股份 | 164,700 | 3,129,300.00 | 0.24 |
| 190 | 300002 | 神州泰岳 | 350,700 | 3,103,695.00 | 0.24 |
| 191 | 002405 | 四维图新 | 348,700 | 3,103,430.00 | 0.24 |
| 192 | 000035 | 中国天楹 | 627,800 | 3,101,332.00 | 0.24 |
| 193 | 603713 | 密尔克卫 | 58,100 | 3,091,501.00 | 0.24 |
| 194 | 601101 | 吴华能源 | 487,443 | 3,080,639.76 | 0.24 |
| 195 | 301180 | 万祥科技 | 168,800 | 3,053,592.00 | 0.23 |
| 196 | 000921 | 海信家电 | 148,700 | 3,033,480.00 | 0.23 |
| 197 | 603618 | 杭电股份 | 470,000 | 3,008,000.00 | 0.23 |
| 198 | 300143 | 盈康生命 | 276,900 | 2,943,447.00 | 0.22 |
| 199 | 600572 | 康恩贝 | 575,100 | 2,904,255.00 | 0.22 |
| 200 | 300319 | 麦捷科技 | 300,600 | 2,897,784.00 | 0.22 |
| 201 | 300377 | 赢时胜 | 373,298 | 2,896,792.48 | 0.22 |
| 202 | 603123 | 翠微股份 | 271,308 | 2,889,430.20 | 0.22 |
| 203 | 300463 | 迈克生物 | 191,500 | 2,885,905.00 | 0.22 |
| 204 | 603093 | 南华期货 | 238,800 | 2,865,600.00 | 0.22 |
| 205 | 688556 | 高测股份 | 72,953 | 2,844,437.47 | 0.22 |
| 206 | 601126 | 四方股份 | 199,900 | 2,830,584.00 | 0.22 |
| 207 | 301325 | 曼恩斯特 | 36,500 | 2,830,210.00 | 0.22 |
| 208 | 600587 | 新华医疗 | 107,800 | 2,780,162.00 | 0.21 |
| 209 | 600320 | 振华重工 | 816,100 | 2,709,452.00 | 0.21 |
| 210 | 600391 | 航发科技 | 138,700 | 2,651,944.00 | 0.20 |
| 211 | 002182 | 宝武镁业 | 130,800 | 2,571,528.00 | 0.20 |
| 212 | 605111 | 新洁能 | 67,660 | 2,559,577.80 | 0.20 |
| 213 | 603826 | 坤彩科技 | 43,100 | 2,544,193.00 | 0.19 |
| 214 | 600120 | 浙江东方 | 705,800 | 2,533,822.00 | 0.19 |
| 215 | 688158 | 优刻得 | 153,342 | 2,522,475.90 | 0.19 |
| 216 | 002928 | 华夏航空 | 348,500 | 2,488,290.00 | 0.19 |
| 217 | 002819 | 东方中科 | 94,100 | 2,409,901.00 | 0.18 |
| 218 | 603919 | 金徽酒 | 97,300 | 2,395,526.00 | 0.18 |
| 219 | 002130 | 沃尔核材 | 316,708 | 2,391,145.40 | 0.18 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|---------|--------------|------|
| 220 | 688018 | 乐鑫科技 | 23,016 | 2,369,497.20 | 0.18 |
| 221 | 688711 | 宏微科技 | 56,789 | 2,356,175.61 | 0.18 |
| 222 | 688037 | 芯源微 | 17,589 | 2,350,066.29 | 0.18 |
| 223 | 603801 | 志邦家居 | 139,200 | 2,334,384.00 | 0.18 |
| 224 | 300303 | 聚飞光电 | 392,000 | 2,324,560.00 | 0.18 |
| 225 | 002303 | 美盈森 | 657,100 | 2,306,421.00 | 0.18 |
| 226 | 605007 | 五洲特纸 | 156,500 | 2,302,115.00 | 0.18 |
| 227 | 603032 | 德新科技 | 111,200 | 2,257,360.00 | 0.17 |
| 228 | 002745 | 木林森 | 259,400 | 2,246,404.00 | 0.17 |
| 229 | 600366 | 宁波韵升 | 287,400 | 2,233,098.00 | 0.17 |
| 230 | 002079 | 苏州固锔 | 197,700 | 2,230,056.00 | 0.17 |
| 231 | 300973 | 立高食品 | 45,600 | 2,213,880.00 | 0.17 |
| 232 | 600860 | 京城股份 | 164,600 | 2,203,994.00 | 0.17 |
| 233 | 603187 | 海容冷链 | 143,400 | 2,173,944.00 | 0.17 |
| 234 | 688027 | 国盾量子 | 16,400 | 2,097,560.00 | 0.16 |
| 235 | 300451 | 创业慧康 | 318,600 | 2,086,830.00 | 0.16 |
| 236 | 300172 | 中电环保 | 387,700 | 2,081,949.00 | 0.16 |
| 237 | 601801 | 皖新传媒 | 299,460 | 2,081,247.00 | 0.16 |
| 238 | 002237 | 恒邦股份 | 191,800 | 2,067,604.00 | 0.16 |
| 239 | 300856 | 科思股份 | 33,200 | 2,066,036.00 | 0.16 |
| 240 | 688300 | 联瑞新材 | 38,876 | 2,058,484.20 | 0.16 |
| 241 | 600977 | 中国电影 | 167,604 | 2,051,472.96 | 0.16 |
| 242 | 300882 | 万胜智能 | 84,200 | 2,051,112.00 | 0.16 |
| 243 | 600284 | 浦东建设 | 324,300 | 2,043,090.00 | 0.16 |
| 244 | 000811 | 冰轮环境 | 148,700 | 2,017,859.00 | 0.15 |
| 245 | 001205 | 盛航股份 | 123,100 | 2,015,147.00 | 0.15 |
| 246 | 002446 | 盛路通信 | 242,500 | 2,012,750.00 | 0.15 |
| 247 | 600211 | 西藏药业 | 41,102 | 2,005,777.60 | 0.15 |
| 248 | 603567 | 珍宝岛 | 162,800 | 1,979,648.00 | 0.15 |
| 249 | 002065 | 东华软件 | 318,800 | 1,966,996.00 | 0.15 |
| 250 | 688083 | 中望软件 | 19,500 | 1,941,030.00 | 0.15 |
| 251 | 002612 | 朗姿股份 | 100,701 | 1,936,480.23 | 0.15 |
| 252 | 603131 | 上海沪工 | 131,100 | 1,935,036.00 | 0.15 |
| 253 | 300366 | 创意信息 | 145,300 | 1,906,336.00 | 0.15 |
| 254 | 300806 | 斯迪克 | 135,020 | 1,899,731.40 | 0.14 |
| 255 | 600399 | 抚顺特钢 | 191,800 | 1,864,296.00 | 0.14 |
| 256 | 600609 | 金杯汽车 | 382,300 | 1,857,978.00 | 0.14 |
| 257 | 002822 | 中装建设 | 422,600 | 1,850,988.00 | 0.14 |
| 258 | 002124 | 天邦食品 | 509,000 | 1,847,670.00 | 0.14 |
| 259 | 002991 | 甘源食品 | 25,800 | 1,843,668.00 | 0.14 |
| 260 | 603236 | 移远通信 | 34,300 | 1,843,625.00 | 0.14 |
| 261 | 002206 | 海利得 | 366,886 | 1,841,767.72 | 0.14 |
| 262 | 300327 | 中颖电子 | 79,800 | 1,819,440.00 | 0.14 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|---------|--------------|------|
| 263 | 300342 | 天银机电 | 117,300 | 1,802,901.00 | 0.14 |
| 264 | 601528 | 瑞丰银行 | 357,600 | 1,770,120.00 | 0.14 |
| 265 | 603861 | 白云电器 | 175,200 | 1,713,456.00 | 0.13 |
| 266 | 688110 | 东芯股份 | 49,476 | 1,703,458.68 | 0.13 |
| 267 | 688521 | 芯原股份 | 33,634 | 1,680,354.64 | 0.13 |
| 268 | 603005 | 晶方科技 | 76,260 | 1,674,669.60 | 0.13 |
| 269 | 601677 | 明泰铝业 | 147,200 | 1,669,248.00 | 0.13 |
| 270 | 603887 | 城地香江 | 206,300 | 1,658,652.00 | 0.13 |
| 271 | 301219 | 腾远钴业 | 41,815 | 1,646,256.55 | 0.13 |
| 272 | 300065 | 海兰信 | 158,900 | 1,616,013.00 | 0.12 |
| 273 | 600710 | 苏美达 | 226,500 | 1,605,885.00 | 0.12 |
| 274 | 300409 | 道氏技术 | 143,700 | 1,600,818.00 | 0.12 |
| 275 | 688326 | 经纬恒润 | 13,700 | 1,589,885.00 | 0.12 |
| 276 | 000529 | 广弘控股 | 232,600 | 1,579,354.00 | 0.12 |
| 277 | 603983 | 丸美股份 | 62,300 | 1,574,321.00 | 0.12 |
| 278 | 603228 | 景旺电子 | 69,300 | 1,563,408.00 | 0.12 |
| 279 | 301179 | 泽宇智能 | 60,100 | 1,559,595.00 | 0.12 |
| 280 | 600880 | 博瑞传播 | 308,500 | 1,545,585.00 | 0.12 |
| 281 | 600771 | 广誉远 | 56,600 | 1,527,634.00 | 0.12 |
| 282 | 300222 | 科大智能 | 207,439 | 1,526,751.04 | 0.12 |
| 283 | 601866 | 中远海发 | 649,600 | 1,520,064.00 | 0.12 |
| 284 | 000727 | 冠捷科技 | 557,900 | 1,495,172.00 | 0.11 |
| 285 | 300726 | 宏达电子 | 49,500 | 1,494,405.00 | 0.11 |
| 286 | 300846 | 首都在线 | 102,600 | 1,466,154.00 | 0.11 |
| 287 | 600350 | 山东高速 | 210,400 | 1,460,176.00 | 0.11 |
| 288 | 300039 | 上海凯宝 | 216,500 | 1,439,725.00 | 0.11 |
| 289 | 002217 | 合力泰 | 526,200 | 1,431,264.00 | 0.11 |
| 290 | 601333 | 广深铁路 | 551,900 | 1,429,421.00 | 0.11 |
| 291 | 301123 | 奕东电子 | 57,000 | 1,337,220.00 | 0.10 |
| 292 | 300674 | 宇信科技 | 78,564 | 1,279,021.92 | 0.10 |
| 293 | 603110 | 东方材料 | 52,200 | 1,258,020.00 | 0.10 |
| 294 | 002792 | 通宇通讯 | 74,400 | 1,246,944.00 | 0.10 |
| 295 | 603979 | 金诚信 | 32,500 | 1,227,200.00 | 0.09 |
| 296 | 688016 | 心脉医疗 | 6,300 | 1,226,169.00 | 0.09 |
| 297 | 603323 | 苏农银行 | 294,600 | 1,225,536.00 | 0.09 |
| 298 | 301080 | 百普赛斯 | 20,700 | 1,220,058.00 | 0.09 |
| 299 | 688289 | 圣湘生物 | 62,016 | 1,212,412.80 | 0.09 |
| 300 | 600667 | 太极实业 | 170,900 | 1,201,427.00 | 0.09 |
| 301 | 600458 | 时代新材 | 129,200 | 1,189,932.00 | 0.09 |
| 302 | 002913 | 奥士康 | 38,793 | 1,189,005.45 | 0.09 |
| 303 | 002453 | 华软科技 | 105,000 | 1,186,500.00 | 0.09 |
| 304 | 000151 | 中成股份 | 104,400 | 1,182,852.00 | 0.09 |
| 305 | 300130 | 新国都 | 48,700 | 1,178,540.00 | 0.09 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|---------|--------------|------|
| 306 | 603689 | 皖天然气 | 133,700 | 1,161,853.00 | 0.09 |
| 307 | 600459 | 贵研铂业 | 80,466 | 1,155,491.76 | 0.09 |
| 308 | 600851 | 海欣股份 | 167,100 | 1,147,977.00 | 0.09 |
| 309 | 300618 | 寒锐钴业 | 39,900 | 1,128,771.00 | 0.09 |
| 310 | 301155 | 海力风电 | 18,700 | 1,106,105.00 | 0.08 |
| 311 | 301078 | 孩子王 | 132,200 | 1,085,362.00 | 0.08 |
| 312 | 605598 | 上海港湾 | 40,200 | 1,075,752.00 | 0.08 |
| 313 | 600225 | 卓朗科技 | 282,700 | 1,074,260.00 | 0.08 |
| 314 | 300567 | 精测电子 | 12,000 | 1,051,440.00 | 0.08 |
| 315 | 002967 | 广电计量 | 69,100 | 1,037,191.00 | 0.08 |
| 316 | 688403 | 汇成股份 | 97,953 | 1,033,404.15 | 0.08 |
| 317 | 603881 | 数据港 | 51,863 | 1,027,924.66 | 0.08 |
| 318 | 301090 | 华润材料 | 94,500 | 1,026,270.00 | 0.08 |
| 319 | 603818 | 曲美家居 | 189,100 | 1,021,140.00 | 0.08 |
| 320 | 000818 | 航锦科技 | 31,600 | 991,608.00 | 0.08 |
| 321 | 002285 | 世联行 | 405,200 | 976,532.00 | 0.07 |
| 322 | 002859 | 洁美科技 | 38,700 | 965,565.00 | 0.07 |
| 323 | 300068 | 南都电源 | 73,900 | 956,266.00 | 0.07 |
| 324 | 002984 | 森麒麟 | 32,900 | 949,165.00 | 0.07 |
| 325 | 600637 | 东方明珠 | 126,200 | 949,024.00 | 0.07 |
| 326 | 000795 | 英洛华 | 152,100 | 947,583.00 | 0.07 |
| 327 | 600621 | 华鑫股份 | 66,800 | 939,876.00 | 0.07 |
| 328 | 002261 | 拓维信息 | 62,000 | 932,480.00 | 0.07 |
| 329 | 002747 | 埃斯顿 | 47,200 | 877,448.00 | 0.07 |
| 330 | 605388 | 均瑶健康 | 69,000 | 865,260.00 | 0.07 |
| 331 | 300271 | 华宇软件 | 105,626 | 865,076.94 | 0.07 |
| 332 | 002085 | 万丰奥威 | 173,400 | 856,596.00 | 0.07 |
| 333 | 300226 | 上海钢联 | 30,000 | 854,700.00 | 0.07 |
| 334 | 600729 | 重庆百货 | 30,000 | 846,000.00 | 0.06 |
| 335 | 002376 | 新北洋 | 111,000 | 845,820.00 | 0.06 |
| 336 | 601606 | 长城军工 | 66,900 | 814,842.00 | 0.06 |
| 337 | 688020 | 方邦股份 | 16,500 | 799,920.00 | 0.06 |
| 338 | 000426 | 兴业银锡 | 86,600 | 786,328.00 | 0.06 |
| 339 | 000411 | 英特集团 | 69,400 | 777,974.00 | 0.06 |
| 340 | 600201 | 生物股份 | 72,200 | 777,594.00 | 0.06 |
| 341 | 002891 | 中宠股份 | 28,960 | 763,096.00 | 0.06 |
| 342 | 000719 | 中原传媒 | 78,200 | 760,886.00 | 0.06 |
| 343 | 605299 | 舒华体育 | 74,600 | 738,540.00 | 0.06 |
| 344 | 000567 | 海德股份 | 68,200 | 724,966.00 | 0.06 |
| 345 | 600641 | 万业企业 | 40,900 | 705,934.00 | 0.05 |
| 346 | 688798 | 艾为电子 | 10,100 | 697,203.00 | 0.05 |
| 347 | 688003 | 天准科技 | 18,300 | 686,616.00 | 0.05 |
| 348 | 300666 | 江丰电子 | 11,685 | 684,507.30 | 0.05 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|---------|------------|------|
| 349 | 300687 | 赛意信息 | 31,000 | 675,180.00 | 0.05 |
| 350 | 688023 | 安恒信息 | 6,041 | 669,886.49 | 0.05 |
| 351 | 600971 | 恒源煤电 | 56,300 | 627,745.00 | 0.05 |
| 352 | 002617 | 露笑科技 | 99,700 | 618,140.00 | 0.05 |
| 353 | 603208 | 江山欧派 | 20,500 | 608,645.00 | 0.05 |
| 354 | 688686 | 奥普特 | 5,400 | 604,800.00 | 0.05 |
| 355 | 000681 | 视觉中国 | 41,100 | 604,170.00 | 0.05 |
| 356 | 688665 | 四方光电 | 8,000 | 590,080.00 | 0.05 |
| 357 | 600172 | 黄河旋风 | 154,400 | 577,456.00 | 0.04 |
| 358 | 002585 | 双星新材 | 68,200 | 553,102.00 | 0.04 |
| 359 | 300369 | 绿盟科技 | 58,300 | 549,769.00 | 0.04 |
| 360 | 300773 | 拉卡拉 | 32,585 | 522,663.40 | 0.04 |
| 361 | 603599 | 广信股份 | 35,900 | 520,550.00 | 0.04 |
| 362 | 603520 | 司太立 | 35,700 | 502,656.00 | 0.04 |
| 363 | 688596 | 正帆科技 | 12,481 | 494,622.03 | 0.04 |
| 364 | 300102 | 乾照光电 | 66,597 | 489,487.95 | 0.04 |
| 365 | 600586 | 金晶科技 | 72,500 | 484,300.00 | 0.04 |
| 366 | 000030 | 富奥股份 | 89,100 | 475,794.00 | 0.04 |
| 367 | 002043 | 兔宝宝 | 52,200 | 462,492.00 | 0.04 |
| 368 | 603690 | 至纯科技 | 17,644 | 453,450.80 | 0.03 |
| 369 | 000550 | 江铃汽车 | 23,700 | 451,011.00 | 0.03 |
| 370 | 688327 | 云从科技 | 26,308 | 443,552.88 | 0.03 |
| 371 | 601918 | 新集能源 | 84,100 | 443,207.00 | 0.03 |
| 372 | 600498 | 烽火通信 | 24,700 | 411,008.00 | 0.03 |
| 373 | 300260 | 新莱应材 | 13,320 | 405,327.60 | 0.03 |
| 374 | 688630 | 芯碁微装 | 4,560 | 389,287.20 | 0.03 |
| 375 | 688033 | 天宜上佳 | 22,959 | 388,007.10 | 0.03 |
| 376 | 688198 | 佰仁医疗 | 3,000 | 373,590.00 | 0.03 |
| 377 | 300747 | 锐科激光 | 15,800 | 371,774.00 | 0.03 |
| 378 | 000682 | 东方电子 | 45,900 | 369,495.00 | 0.03 |
| 379 | 000552 | 甘肃能化 | 120,700 | 368,135.00 | 0.03 |
| 380 | 600551 | 时代出版 | 31,800 | 346,302.00 | 0.03 |
| 381 | 600602 | 云赛智联 | 29,600 | 342,472.00 | 0.03 |
| 382 | 300820 | 英杰电气 | 5,850 | 335,088.00 | 0.03 |
| 383 | 301046 | 能辉科技 | 12,100 | 328,152.00 | 0.03 |
| 384 | 600055 | 万东医疗 | 19,200 | 327,936.00 | 0.03 |
| 385 | 000718 | 苏宁环球 | 125,200 | 324,268.00 | 0.02 |
| 386 | 300294 | 博雅生物 | 9,500 | 319,960.00 | 0.02 |
| 387 | 000061 | 农产品 | 48,200 | 311,854.00 | 0.02 |
| 388 | 301366 | 一博科技 | 9,300 | 310,341.00 | 0.02 |
| 389 | 600197 | 伊力特 | 14,259 | 310,133.25 | 0.02 |
| 390 | 688209 | 英集芯 | 17,233 | 307,781.38 | 0.02 |
| 391 | 600216 | 浙江医药 | 28,600 | 306,878.00 | 0.02 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 392 | 601222 | 林洋能源 | 46,674 | 298,246.86 | 0.02 |
| 393 | 600648 | 外高桥 | 29,900 | 294,814.00 | 0.02 |
| 394 | 300382 | 斯莱克 | 28,500 | 283,005.00 | 0.02 |
| 395 | 000925 | 众合科技 | 32,600 | 282,316.00 | 0.02 |
| 396 | 600198 | 大唐电信 | 41,300 | 271,341.00 | 0.02 |
| 397 | 000685 | 中山公用 | 36,400 | 266,084.00 | 0.02 |
| 398 | 688166 | 博瑞医药 | 7,600 | 266,000.00 | 0.02 |
| 399 | 600738 | 丽尚国潮 | 49,000 | 260,680.00 | 0.02 |
| 400 | 301095 | 广立微 | 3,400 | 254,082.00 | 0.02 |
| 401 | 601311 | 骆驼股份 | 31,111 | 249,199.11 | 0.02 |
| 402 | 300378 | 鼎捷软件 | 11,500 | 245,065.00 | 0.02 |
| 403 | 603300 | 华铁应急 | 34,400 | 220,160.00 | 0.02 |
| 404 | 300332 | 天壕能源 | 26,500 | 210,675.00 | 0.02 |
| 405 | 603583 | 捷昌驱动 | 10,500 | 210,315.00 | 0.02 |
| 406 | 688102 | 斯瑞新材 | 15,400 | 203,126.00 | 0.02 |
| 407 | 688368 | 晶丰明源 | 1,781 | 192,241.14 | 0.01 |
| 408 | 688608 | 恒玄科技 | 1,189 | 183,427.03 | 0.01 |
| 409 | 002318 | 久立特材 | 8,800 | 174,944.00 | 0.01 |
| 410 | 688050 | 爱博医疗 | 1,000 | 172,040.00 | 0.01 |
| 411 | 300027 | 华谊兄弟 | 62,600 | 167,768.00 | 0.01 |
| 412 | 300036 | 超图软件 | 8,000 | 167,200.00 | 0.01 |
| 413 | 688408 | 中信博 | 2,300 | 165,025.00 | 0.01 |
| 414 | 002813 | 路畅科技 | 4,700 | 164,688.00 | 0.01 |
| 415 | 600761 | 安徽合力 | 8,897 | 162,014.37 | 0.01 |
| 416 | 600508 | 上海能源 | 11,400 | 158,004.00 | 0.01 |
| 417 | 600810 | 神马股份 | 21,200 | 157,728.00 | 0.01 |
| 418 | 000503 | 国新健康 | 11,900 | 156,842.00 | 0.01 |
| 419 | 688680 | 海优新材 | 2,342 | 153,752.30 | 0.01 |
| 420 | 603396 | 金辰股份 | 2,800 | 153,020.00 | 0.01 |
| 421 | 002701 | 奥瑞金 | 36,771 | 152,231.94 | 0.01 |
| 422 | 688366 | 昊海生科 | 1,400 | 151,606.00 | 0.01 |
| 423 | 300685 | 艾德生物 | 6,880 | 151,222.40 | 0.01 |
| 424 | 605090 | 九丰能源 | 5,400 | 150,822.00 | 0.01 |
| 425 | 688127 | 蓝特光学 | 6,400 | 149,056.00 | 0.01 |
| 426 | 300860 | 锋尚文化 | 2,700 | 147,501.00 | 0.01 |
| 427 | 600688 | 上海石化 | 51,400 | 147,004.00 | 0.01 |
| 428 | 002416 | 爱施德 | 15,800 | 146,782.00 | 0.01 |
| 429 | 002233 | 塔牌集团 | 20,600 | 145,848.00 | 0.01 |
| 430 | 688578 | 艾力斯 | 3,500 | 145,810.00 | 0.01 |
| 431 | 000627 | 天茂集团 | 51,300 | 145,692.00 | 0.01 |
| 432 | 600248 | 陕建股份 | 36,200 | 145,524.00 | 0.01 |
| 433 | 603171 | 税友股份 | 4,100 | 145,058.00 | 0.01 |
| 434 | 605376 | 博迁新材 | 5,100 | 143,820.00 | 0.01 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 435 | 688389 | 普门科技 | 6,300 | 141,813.00 | 0.01 |
| 436 | 601375 | 中原证券 | 36,914 | 141,380.62 | 0.01 |
| 437 | 603105 | 芯能科技 | 12,200 | 141,276.00 | 0.01 |
| 438 | 002705 | 新宝股份 | 9,600 | 139,872.00 | 0.01 |
| 439 | 300770 | 新媒股份 | 3,608 | 139,557.44 | 0.01 |
| 440 | 688508 | 芯朋微 | 2,761 | 135,868.81 | 0.01 |
| 441 | 300762 | 上海瀚讯 | 8,900 | 134,212.00 | 0.01 |
| 442 | 688381 | 帝奥微 | 5,300 | 134,196.00 | 0.01 |
| 443 | 605222 | 起帆电缆 | 6,900 | 133,032.00 | 0.01 |
| 444 | 603989 | 艾华集团 | 6,168 | 132,735.36 | 0.01 |
| 445 | 300696 | 爱乐达 | 7,600 | 132,316.00 | 0.01 |
| 446 | 600059 | 古越龙山 | 14,000 | 130,200.00 | 0.01 |
| 447 | 688356 | 键凯科技 | 1,200 | 127,680.00 | 0.01 |
| 448 | 603730 | 岱美股份 | 8,700 | 126,063.00 | 0.01 |
| 449 | 600195 | 中牧股份 | 10,500 | 124,530.00 | 0.01 |
| 450 | 003006 | 百亚股份 | 8,200 | 124,312.00 | 0.01 |
| 451 | 688007 | 光峰科技 | 4,800 | 124,224.00 | 0.01 |
| 452 | 002978 | 安宁股份 | 3,900 | 123,474.00 | 0.01 |
| 453 | 000517 | 荣安地产 | 49,976 | 122,441.20 | 0.01 |
| 454 | 600675 | 中华企业 | 38,500 | 121,275.00 | 0.01 |
| 455 | 000560 | 我爱我家 | 53,700 | 120,825.00 | 0.01 |
| 456 | 002044 | 美年健康 | 20,100 | 120,801.00 | 0.01 |
| 457 | 300456 | 赛微电子 | 4,800 | 115,392.00 | 0.01 |
| 458 | 688499 | 利元亨 | 3,000 | 114,240.00 | 0.01 |
| 459 | 688322 | 奥比中光 | 3,000 | 112,740.00 | 0.01 |
| 460 | 002929 | 润建股份 | 2,700 | 112,671.00 | 0.01 |
| 461 | 688088 | 虹软科技 | 2,600 | 106,704.00 | 0.01 |
| 462 | 600331 | 宏达股份 | 20,600 | 105,678.00 | 0.01 |
| 463 | 002960 | 青鸟消防 | 7,500 | 103,800.00 | 0.01 |
| 464 | 300679 | 电连技术 | 2,500 | 103,750.00 | 0.01 |
| 465 | 600285 | 羚锐制药 | 5,975 | 102,232.25 | 0.01 |
| 466 | 688639 | 华恒生物 | 800 | 100,720.00 | 0.01 |
| 467 | 688278 | 特宝生物 | 1,900 | 99,465.00 | 0.01 |
| 468 | 600409 | 三友化工 | 16,400 | 90,036.00 | 0.01 |
| 469 | 688106 | 金宏气体 | 3,591 | 86,507.19 | 0.01 |
| 470 | 002645 | 华宏科技 | 7,600 | 85,880.00 | 0.01 |
| 471 | 002746 | 仙坛股份 | 11,618 | 81,790.72 | 0.01 |
| 472 | 000902 | 新洋丰 | 7,084 | 80,686.76 | 0.01 |
| 473 | 002174 | 游族网络 | 6,848 | 78,478.08 | 0.01 |
| 474 | 603279 | 景津装备 | 3,500 | 77,385.00 | 0.01 |
| 475 | 603565 | 中谷物流 | 9,200 | 75,716.00 | 0.01 |
| 476 | 301015 | 百洋医药 | 2,100 | 75,306.00 | 0.01 |
| 477 | 000923 | 河钢资源 | 4,400 | 73,920.00 | 0.01 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 478 | 688563 | 航材股份 | 1,195 | 72,285.55 | 0.01 |
| 479 | 603010 | 万盛股份 | 6,600 | 71,214.00 | 0.01 |
| 480 | 688122 | 西部超导 | 1,300 | 69,199.00 | 0.01 |
| 481 | 601001 | 晋控煤业 | 5,500 | 67,815.00 | 0.01 |
| 482 | 688568 | 中科星图 | 1,359 | 66,672.54 | 0.01 |
| 483 | 300233 | 金城医药 | 4,000 | 66,640.00 | 0.01 |
| 484 | 688100 | 威胜信息 | 2,300 | 66,516.00 | 0.01 |
| 485 | 000791 | 甘肃能源 | 11,700 | 65,169.00 | 0.00 |
| 486 | 002048 | 宁波华翔 | 4,914 | 63,931.14 | 0.00 |
| 487 | 600718 | 东软集团 | 6,900 | 63,825.00 | 0.00 |
| 488 | 601163 | 三角轮胎 | 4,200 | 60,522.00 | 0.00 |
| 489 | 688526 | 科前生物 | 2,829 | 57,655.02 | 0.00 |
| 490 | 603985 | 恒润股份 | 2,300 | 57,155.00 | 0.00 |
| 491 | 600751 | 海航科技 | 21,700 | 56,854.00 | 0.00 |
| 492 | 603997 | 继峰股份 | 4,100 | 55,227.00 | 0.00 |
| 493 | 002946 | 新乳业 | 4,800 | 55,104.00 | 0.00 |
| 494 | 688548 | 广钢气体 | 4,048 | 51,612.00 | 0.00 |
| 495 | 603055 | 台华新材 | 4,000 | 48,160.00 | 0.00 |
| 496 | 603087 | 甘李药业 | 900 | 47,385.00 | 0.00 |
| 497 | 688072 | 拓荆科技 | 200 | 46,260.00 | 0.00 |
| 498 | 603296 | 华勤技术 | 593 | 46,105.75 | 0.00 |
| 499 | 002190 | 成飞集成 | 2,400 | 45,528.00 | 0.00 |
| 500 | 601208 | 东材科技 | 3,600 | 44,568.00 | 0.00 |
| 501 | 301526 | 国际复材 | 9,723 | 43,267.35 | 0.00 |
| 502 | 002214 | 大立科技 | 3,700 | 42,439.00 | 0.00 |
| 503 | 688372 | 伟测科技 | 534 | 41,865.60 | 0.00 |
| 504 | 603566 | 普莱柯 | 1,842 | 41,721.30 | 0.00 |
| 505 | 000982 | 中银绒业 | 26,100 | 38,367.00 | 0.00 |
| 506 | 300613 | 富瀚微 | 900 | 38,196.00 | 0.00 |
| 507 | 600536 | 中国软件 | 1,000 | 36,260.00 | 0.00 |
| 508 | 002903 | 宇环数控 | 1,400 | 35,770.00 | 0.00 |
| 509 | 301487 | 盟固利 | 867 | 35,512.32 | 0.00 |
| 510 | 688549 | 中巨芯 | 4,294 | 34,738.46 | 0.00 |
| 511 | 603699 | 纽威股份 | 2,500 | 34,650.00 | 0.00 |
| 512 | 300604 | 长川科技 | 900 | 34,191.00 | 0.00 |
| 513 | 688082 | 盛美上海 | 325 | 33,933.25 | 0.00 |
| 514 | 002224 | 三力士 | 6,600 | 33,594.00 | 0.00 |
| 515 | 600098 | 广州发展 | 6,100 | 32,757.00 | 0.00 |
| 516 | 002314 | 南山控股 | 10,500 | 30,450.00 | 0.00 |
| 517 | 300470 | 中密控股 | 800 | 30,240.00 | 0.00 |
| 518 | 002274 | 华昌化工 | 4,000 | 30,200.00 | 0.00 |
| 519 | 603612 | 索通发展 | 1,900 | 29,241.00 | 0.00 |
| 520 | 688239 | 航宇科技 | 600 | 28,662.00 | 0.00 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-------|-----------|------|
| 521 | 002961 | 瑞达期货 | 1,900 | 28,310.00 | 0.00 |
| 522 | 688200 | 华峰测控 | 228 | 27,998.40 | 0.00 |
| 523 | 301348 | 蓝箭电子 | 613 | 27,321.41 | 0.00 |
| 524 | 601212 | 白银有色 | 9,900 | 26,631.00 | 0.00 |
| 525 | 688702 | 盛科通信 | 549 | 26,450.82 | 0.00 |
| 526 | 300777 | 中简科技 | 879 | 26,220.57 | 0.00 |
| 527 | 688582 | 芯动联科 | 648 | 25,058.16 | 0.00 |
| 528 | 301559 | 中集环科 | 1,315 | 23,985.60 | 0.00 |
| 529 | 301486 | 致尚科技 | 482 | 22,774.50 | 0.00 |
| 530 | 688652 | 京仪装备 | 416 | 21,736.00 | 0.00 |
| 531 | 301525 | 儒竞科技 | 266 | 21,668.36 | 0.00 |
| 532 | 301498 | 乖宝宠物 | 554 | 21,500.74 | 0.00 |
| 533 | 301371 | 敷尔佳 | 564 | 21,195.12 | 0.00 |
| 534 | 301421 | 波长光电 | 332 | 19,710.84 | 0.00 |
| 535 | 688120 | 华海清科 | 105 | 19,708.50 | 0.00 |
| 536 | 301558 | 三态股份 | 1,458 | 19,537.20 | 0.00 |
| 537 | 688627 | 精智达 | 222 | 19,473.84 | 0.00 |
| 538 | 688591 | 泰凌微 | 681 | 19,081.62 | 0.00 |
| 539 | 300428 | 立中集团 | 900 | 19,008.00 | 0.00 |
| 540 | 300904 | 威力传动 | 304 | 18,705.12 | 0.00 |
| 541 | 002516 | 旷达科技 | 3,700 | 18,241.00 | 0.00 |
| 542 | 301381 | 赛维时代 | 571 | 16,952.99 | 0.00 |
| 543 | 600993 | 马应龙 | 700 | 16,926.00 | 0.00 |
| 544 | 301509 | 金凯生科 | 266 | 16,553.18 | 0.00 |
| 545 | 688612 | 威迈斯 | 422 | 16,023.34 | 0.00 |
| 546 | 601096 | 宏盛华源 | 3,918 | 15,907.08 | 0.00 |
| 547 | 301393 | 昊帆生物 | 260 | 15,436.20 | 0.00 |
| 548 | 601083 | 锦江航运 | 1,263 | 13,981.41 | 0.00 |
| 549 | 301510 | 固高科技 | 396 | 13,863.96 | 0.00 |
| 550 | 301507 | 民生健康 | 851 | 13,488.35 | 0.00 |
| 551 | 300480 | 光力科技 | 600 | 12,810.00 | 0.00 |
| 552 | 301566 | 达利凯普 | 576 | 12,752.64 | 0.00 |
| 553 | 301456 | 盘古智能 | 407 | 12,368.73 | 0.00 |
| 554 | 688602 | 康鹏科技 | 1,066 | 11,789.96 | 0.00 |
| 555 | 688719 | 爱科赛博 | 194 | 11,659.40 | 0.00 |
| 556 | 301550 | 斯菱股份 | 260 | 11,328.20 | 0.00 |
| 557 | 301292 | 海科新源 | 583 | 11,281.05 | 0.00 |
| 558 | 301508 | 中机认检 | 419 | 11,178.92 | 0.00 |
| 559 | 300203 | 聚光科技 | 700 | 11,095.00 | 0.00 |
| 560 | 688592 | 司南导航 | 216 | 10,914.48 | 0.00 |
| 561 | 301499 | 维科精密 | 371 | 10,733.03 | 0.00 |
| 562 | 688603 | 天承科技 | 140 | 10,379.60 | 0.00 |
| 563 | 688653 | 康希通信 | 648 | 10,361.52 | 0.00 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-------|-----------|------|
| 564 | 301329 | 信音电子 | 458 | 10,181.34 | 0.00 |
| 565 | 301261 | 恒工精密 | 198 | 10,068.30 | 0.00 |
| 566 | 002421 | 达实智能 | 3,100 | 9,982.00 | 0.00 |
| 567 | 002088 | 鲁阳节能 | 700 | 9,975.00 | 0.00 |
| 568 | 603298 | 杭叉集团 | 400 | 9,952.00 | 0.00 |
| 569 | 301202 | 朗威股份 | 306 | 9,730.80 | 0.00 |
| 570 | 688716 | 中研股份 | 267 | 9,716.13 | 0.00 |
| 571 | 300676 | 华大基因 | 200 | 9,600.00 | 0.00 |
| 572 | 301413 | 安培龙 | 164 | 9,543.16 | 0.00 |
| 573 | 301500 | 飞南资源 | 455 | 9,504.95 | 0.00 |
| 574 | 301516 | 中远通 | 604 | 9,368.04 | 0.00 |
| 575 | 301519 | 舜禹股份 | 442 | 8,932.82 | 0.00 |
| 576 | 301518 | 长华化学 | 385 | 8,858.85 | 0.00 |
| 577 | 301568 | 思泰克 | 246 | 8,752.68 | 0.00 |
| 578 | 301520 | 万邦医药 | 160 | 8,438.40 | 0.00 |
| 579 | 301459 | 丰茂股份 | 208 | 8,286.72 | 0.00 |
| 580 | 688720 | 艾森股份 | 165 | 8,223.60 | 0.00 |
| 581 | 688651 | 盛邦安全 | 178 | 8,196.90 | 0.00 |
| 582 | 301517 | 陕西华达 | 185 | 8,082.65 | 0.00 |
| 583 | 301578 | 辰奕智能 | 118 | 8,061.76 | 0.00 |
| 584 | 301548 | 崇德科技 | 136 | 8,022.64 | 0.00 |
| 585 | 688657 | 浩辰软件 | 101 | 7,901.23 | 0.00 |
| 586 | 688646 | 逸飞激光 | 219 | 7,899.33 | 0.00 |
| 587 | 688671 | 碧兴物联 | 226 | 7,751.80 | 0.00 |
| 588 | 688693 | 锆威特 | 178 | 7,726.98 | 0.00 |
| 589 | 603275 | 众辰科技 | 193 | 7,662.10 | 0.00 |
| 590 | 301533 | 威马农机 | 225 | 7,461.00 | 0.00 |
| 591 | 002948 | 青岛银行 | 2,400 | 7,320.00 | 0.00 |
| 592 | 603062 | 麦加芯彩 | 126 | 7,284.06 | 0.00 |
| 593 | 301555 | 惠柏新材 | 224 | 7,266.56 | 0.00 |
| 594 | 301505 | 苏州规划 | 194 | 6,947.14 | 0.00 |
| 595 | 301529 | 福赛科技 | 182 | 6,894.16 | 0.00 |
| 596 | 301515 | 港通医疗 | 230 | 6,502.10 | 0.00 |
| 597 | 688648 | 中邮科技 | 303 | 6,493.29 | 0.00 |
| 598 | 688450 | 光格科技 | 167 | 6,082.14 | 0.00 |
| 599 | 603004 | 鼎龙科技 | 195 | 6,082.05 | 0.00 |
| 600 | 002068 | 黑猫股份 | 502 | 5,823.20 | 0.00 |
| 601 | 603270 | 金帝股份 | 195 | 5,768.10 | 0.00 |
| 602 | 600577 | 精达股份 | 1,332 | 5,514.48 | 0.00 |
| 603 | 603119 | 浙江荣泰 | 226 | 5,394.62 | 0.00 |
| 604 | 603107 | 上海汽配 | 292 | 5,311.48 | 0.00 |
| 605 | 603193 | 润本股份 | 303 | 5,047.98 | 0.00 |
| 606 | 001306 | 夏厦精密 | 64 | 4,823.04 | 0.00 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-----|----------|------|
| 607 | 001326 | 联域股份 | 99 | 4,815.36 | 0.00 |
| 608 | 605338 | 巴比食品 | 200 | 4,296.00 | 0.00 |
| 609 | 603075 | 热威股份 | 182 | 4,242.42 | 0.00 |
| 610 | 001358 | 兴欣新材 | 87 | 3,841.92 | 0.00 |
| 611 | 001239 | 永达股份 | 189 | 3,764.88 | 0.00 |
| 612 | 300767 | 震安科技 | 200 | 3,476.00 | 0.00 |
| 613 | 603231 | 索宝蛋白 | 161 | 3,466.33 | 0.00 |
| 614 | 603273 | 天元智能 | 178 | 3,376.66 | 0.00 |
| 615 | 603276 | 恒兴新材 | 134 | 3,333.92 | 0.00 |
| 616 | 603373 | 安邦护卫 | 88 | 3,058.00 | 0.00 |
| 617 | 600750 | 江中药业 | 117 | 2,442.96 | 0.00 |
| 618 | 002219 | 新里程 | 800 | 2,424.00 | 0.00 |
| 619 | 300432 | 富临精工 | 200 | 2,100.00 | 0.00 |
| 620 | 300400 | 劲拓股份 | 100 | 1,629.00 | 0.00 |
| 621 | 300525 | 博思软件 | 100 | 1,492.00 | 0.00 |
| 622 | 600475 | 华光环能 | 100 | 1,040.00 | 0.00 |
| 623 | 300497 | 富祥药业 | 100 | 936.00 | 0.00 |
| 624 | 001696 | 宗申动力 | 100 | 663.00 | 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 | 600797 | 浙大网新 | 41,896,486.00 | 8.24 |
| 2 | 002597 | 金禾实业 | 41,325,954.94 | 8.13 |
| 3 | 600572 | 康恩贝 | 38,998,100.00 | 7.67 |
| 4 | 301039 | 中集车辆 | 38,952,864.54 | 7.66 |
| 5 | 300036 | 超图软件 | 38,739,793.67 | 7.62 |
| 6 | 300775 | 三角防务 | 37,941,735.00 | 7.46 |
| 7 | 603118 | 共进股份 | 35,942,017.00 | 7.07 |
| 8 | 601137 | 博威合金 | 35,215,708.00 | 6.93 |
| 9 | 300232 | 洲明科技 | 34,678,554.00 | 6.82 |
| 10 | 605111 | 新洁能 | 34,174,181.48 | 6.72 |
| 11 | 600850 | 电科数字 | 33,792,143.00 | 6.65 |
| 12 | 002697 | 红旗连锁 | 33,016,238.00 | 6.49 |
| 13 | 600420 | 国药现代 | 32,968,881.63 | 6.49 |
| 14 | 600211 | 西藏药业 | 32,630,100.42 | 6.42 |
| 15 | 002402 | 和而泰 | 32,391,120.00 | 6.37 |
| 16 | 002044 | 美年健康 | 32,268,227.00 | 6.35 |
| 17 | 002237 | 恒邦股份 | 31,526,057.25 | 6.20 |
| 18 | 603368 | 柳药集团 | 31,407,861.68 | 6.18 |
| 19 | 600285 | 羚锐制药 | 31,204,875.54 | 6.14 |
| 20 | 000034 | 神州数码 | 31,159,014.00 | 6.13 |
| 21 | 002517 | 恺英网络 | 31,066,625.00 | 6.11 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 22 | 000758 | 中色股份 | 30,962,883.00 | 6.09 |
| 23 | 300674 | 宇信科技 | 30,498,913.87 | 6.00 |
| 24 | 002158 | 汉钟精机 | 30,449,293.46 | 5.99 |
| 25 | 600480 | 凌云股份 | 30,353,239.88 | 5.97 |
| 26 | 603345 | 安井食品 | 29,777,484.00 | 5.86 |
| 27 | 605589 | 圣泉集团 | 29,723,794.00 | 5.85 |
| 28 | 600073 | 上海梅林 | 29,661,091.00 | 5.83 |
| 29 | 300856 | 科思股份 | 29,224,026.03 | 5.75 |
| 30 | 300777 | 中简科技 | 28,906,893.00 | 5.69 |
| 31 | 600210 | 紫江企业 | 28,705,124.00 | 5.65 |
| 32 | 002283 | 天润工业 | 28,689,208.07 | 5.64 |
| 33 | 600064 | 南京高科 | 28,349,032.21 | 5.58 |
| 34 | 300119 | 瑞普生物 | 27,632,467.79 | 5.44 |
| 35 | 300638 | 广和通 | 27,363,210.47 | 5.38 |
| 36 | 688556 | 高测股份 | 27,335,781.91 | 5.38 |
| 37 | 002291 | 遥望科技 | 27,255,712.00 | 5.36 |
| 38 | 600458 | 时代新材 | 27,221,175.00 | 5.35 |
| 39 | 000951 | 中国重汽 | 27,150,792.72 | 5.34 |
| 40 | 603027 | 千禾味业 | 27,065,732.00 | 5.32 |
| 41 | 002139 | 拓邦股份 | 27,000,261.58 | 5.31 |
| 42 | 000555 | 神州信息 | 26,973,071.34 | 5.31 |
| 43 | 002126 | 银轮股份 | 26,906,348.94 | 5.29 |
| 44 | 601126 | 四方股份 | 26,849,482.00 | 5.28 |
| 45 | 600502 | 安徽建工 | 26,798,720.50 | 5.27 |
| 46 | 600750 | 江中药业 | 26,765,166.85 | 5.27 |
| 47 | 601921 | 浙版传媒 | 26,536,660.12 | 5.22 |
| 48 | 300226 | 上海钢联 | 26,517,990.30 | 5.22 |
| 49 | 600531 | 豫光金铅 | 26,372,250.00 | 5.19 |
| 50 | 000612 | 焦作万方 | 25,701,018.40 | 5.06 |
| 51 | 002649 | 博彦科技 | 25,289,789.69 | 4.97 |
| 52 | 605388 | 均瑶健康 | 25,164,806.25 | 4.95 |
| 53 | 301219 | 腾远钴业 | 24,867,596.18 | 4.89 |
| 54 | 002746 | 仙坛股份 | 24,843,947.40 | 4.89 |
| 55 | 000650 | 仁和药业 | 24,734,250.00 | 4.87 |
| 56 | 002421 | 达实智能 | 24,726,196.00 | 4.86 |
| 57 | 600129 | 太极集团 | 24,576,390.00 | 4.83 |
| 58 | 002233 | 塔牌集团 | 24,402,076.00 | 4.80 |
| 59 | 600057 | 厦门象屿 | 24,353,312.75 | 4.79 |
| 60 | 600789 | 鲁抗医药 | 24,216,067.00 | 4.76 |
| 61 | 002215 | 诺普信 | 24,171,586.00 | 4.75 |
| 62 | 000928 | 中钢国际 | 23,930,785.21 | 4.71 |
| 63 | 000933 | 神火股份 | 23,696,361.00 | 4.66 |
| 64 | 000567 | 海德股份 | 23,511,093.25 | 4.62 |

| | | | | |
|-----|--------|------|---------------|------|
| 65 | 002747 | 埃斯顿 | 23,383,202.00 | 4.60 |
| 66 | 002276 | 万马股份 | 23,270,854.35 | 4.58 |
| 67 | 600612 | 老凤祥 | 23,118,560.00 | 4.55 |
| 68 | 002335 | 科华数据 | 23,089,267.00 | 4.54 |
| 69 | 300352 | 北信源 | 23,055,797.00 | 4.54 |
| 70 | 002610 | 爱康科技 | 22,923,772.00 | 4.51 |
| 71 | 002063 | 远光软件 | 22,834,634.53 | 4.49 |
| 72 | 002518 | 科士达 | 22,656,530.12 | 4.46 |
| 73 | 002558 | 巨人网络 | 22,643,806.00 | 4.45 |
| 74 | 600158 | 中体产业 | 22,423,514.97 | 4.41 |
| 75 | 601222 | 林洋能源 | 22,418,060.00 | 4.41 |
| 76 | 000917 | 电广传媒 | 22,344,703.96 | 4.40 |
| 77 | 002782 | 可立克 | 22,279,438.40 | 4.38 |
| 78 | 002611 | 东方精工 | 22,254,218.00 | 4.38 |
| 79 | 002706 | 良信股份 | 22,204,030.00 | 4.37 |
| 80 | 600587 | 新华医疗 | 22,159,393.00 | 4.36 |
| 81 | 601375 | 中原证券 | 22,051,244.00 | 4.34 |
| 82 | 300130 | 新国都 | 22,000,374.00 | 4.33 |
| 83 | 601908 | 京运通 | 21,971,344.00 | 4.32 |
| 84 | 002038 | 双鹭药业 | 21,967,424.98 | 4.32 |
| 85 | 300236 | 上海新阳 | 21,943,012.33 | 4.32 |
| 86 | 002413 | 雷科防务 | 21,935,948.00 | 4.32 |
| 87 | 000921 | 海信家电 | 21,930,088.75 | 4.31 |
| 88 | 603919 | 金徽酒 | 21,906,749.75 | 4.31 |
| 89 | 002967 | 广电计量 | 21,905,364.98 | 4.31 |
| 90 | 002463 | 沪电股份 | 21,882,525.00 | 4.30 |
| 91 | 603301 | 振德医疗 | 21,857,987.85 | 4.30 |
| 92 | 002768 | 国恩股份 | 21,856,214.28 | 4.30 |
| 93 | 002605 | 姚记科技 | 21,766,228.00 | 4.28 |
| 94 | 000528 | 柳 工 | 21,628,548.20 | 4.25 |
| 95 | 002456 | 欧菲光 | 21,620,901.00 | 4.25 |
| 96 | 000969 | 安泰科技 | 21,378,159.00 | 4.21 |
| 97 | 002895 | 川恒股份 | 21,092,390.00 | 4.15 |
| 98 | 002174 | 游族网络 | 21,084,634.12 | 4.15 |
| 99 | 600312 | 平高电气 | 20,985,853.65 | 4.13 |
| 100 | 603979 | 金诚信 | 20,966,398.00 | 4.12 |
| 101 | 300973 | 立高食品 | 20,877,628.00 | 4.11 |
| 102 | 600483 | 福能股份 | 20,790,889.46 | 4.09 |
| 103 | 688018 | 乐鑫科技 | 20,727,278.19 | 4.08 |
| 104 | 002017 | 东信和平 | 20,658,135.25 | 4.06 |
| 105 | 300118 | 东方日升 | 20,655,027.00 | 4.06 |
| 106 | 300348 | 长亮科技 | 20,577,419.00 | 4.05 |
| 107 | 600120 | 浙江东方 | 20,555,284.83 | 4.04 |

| | | | | |
|-----|--------|------|---------------|------|
| 108 | 603236 | 移远通信 | 20,553,603.05 | 4.04 |
| 109 | 000048 | 京基智农 | 20,370,998.77 | 4.01 |
| 110 | 002212 | 天融信 | 20,353,835.29 | 4.00 |
| 111 | 002851 | 麦格米特 | 20,315,666.50 | 4.00 |
| 112 | 002865 | 钧达股份 | 20,120,146.41 | 3.96 |
| 113 | 000913 | 钱江摩托 | 19,947,201.00 | 3.92 |
| 114 | 002737 | 葵花药业 | 19,840,683.00 | 3.90 |
| 115 | 000517 | 荣安地产 | 19,721,977.00 | 3.88 |
| 116 | 603306 | 华懋科技 | 19,697,389.00 | 3.87 |
| 117 | 300398 | 飞凯材料 | 19,681,227.00 | 3.87 |
| 118 | 300123 | 亚光科技 | 19,649,663.00 | 3.87 |
| 119 | 300567 | 精测电子 | 19,614,809.00 | 3.86 |
| 120 | 002396 | 星网锐捷 | 19,491,199.00 | 3.83 |
| 121 | 002698 | 博实股份 | 19,249,747.77 | 3.79 |
| 122 | 600266 | 城建发展 | 19,220,346.56 | 3.78 |
| 123 | 601619 | 嘉泽新能 | 19,140,328.00 | 3.77 |
| 124 | 600267 | 海正药业 | 18,973,487.00 | 3.73 |
| 125 | 600459 | 贵研铂业 | 18,964,556.58 | 3.73 |
| 126 | 002324 | 普利特 | 18,872,999.54 | 3.71 |
| 127 | 300900 | 广联航空 | 18,851,709.00 | 3.71 |
| 128 | 002036 | 联创电子 | 18,822,532.00 | 3.70 |
| 129 | 000600 | 建投能源 | 18,612,006.00 | 3.66 |
| 130 | 688037 | 芯源微 | 18,463,785.01 | 3.63 |
| 131 | 600284 | 浦东建设 | 18,426,821.72 | 3.62 |
| 132 | 003012 | 东鹏控股 | 18,360,476.00 | 3.61 |
| 133 | 601519 | 大智慧 | 18,311,326.50 | 3.60 |
| 134 | 002079 | 苏州固锝 | 18,279,788.39 | 3.60 |
| 135 | 000915 | 华特达因 | 18,259,380.00 | 3.59 |
| 136 | 000423 | 东阿阿胶 | 18,227,802.02 | 3.59 |
| 137 | 601567 | 三星医疗 | 18,220,645.79 | 3.58 |
| 138 | 600197 | 伊力特 | 18,197,148.00 | 3.58 |
| 139 | 600662 | 外服控股 | 18,110,612.00 | 3.56 |
| 140 | 600577 | 精达股份 | 18,079,456.00 | 3.56 |
| 141 | 600481 | 双良节能 | 18,057,729.20 | 3.55 |
| 142 | 002979 | 雷赛智能 | 17,997,515.90 | 3.54 |
| 143 | 600320 | 振华重工 | 17,993,870.10 | 3.54 |
| 144 | 000893 | 亚钾国际 | 17,939,155.00 | 3.53 |
| 145 | 300827 | 上能电气 | 17,921,169.33 | 3.53 |
| 146 | 300068 | 南都电源 | 17,904,909.00 | 3.52 |
| 147 | 300002 | 神州泰岳 | 17,839,855.00 | 3.51 |
| 148 | 000690 | 宝新能源 | 17,650,197.00 | 3.47 |
| 149 | 003006 | 百亚股份 | 17,630,139.00 | 3.47 |
| 150 | 688707 | 振华新材 | 17,591,484.78 | 3.46 |

| | | | | |
|-----|--------|------|---------------|------|
| 151 | 600761 | 安徽合力 | 17,559,491.06 | 3.45 |
| 152 | 603690 | 至纯科技 | 17,411,794.56 | 3.43 |
| 153 | 300109 | 新开源 | 17,315,301.67 | 3.41 |
| 154 | 688399 | 硕世生物 | 17,301,786.83 | 3.40 |
| 155 | 002006 | 精工科技 | 17,252,727.00 | 3.39 |
| 156 | 002815 | 崇达技术 | 17,240,315.51 | 3.39 |
| 157 | 600456 | 宝钛股份 | 17,196,976.00 | 3.38 |
| 158 | 688711 | 宏微科技 | 17,047,202.92 | 3.35 |
| 159 | 002449 | 国星光电 | 17,033,068.69 | 3.35 |
| 160 | 002467 | 二六三 | 16,991,004.00 | 3.34 |
| 161 | 300101 | 振芯科技 | 16,979,302.52 | 3.34 |
| 162 | 600685 | 中船防务 | 16,882,928.05 | 3.32 |
| 163 | 300451 | 创业慧康 | 16,797,684.68 | 3.30 |
| 164 | 600557 | 康缘药业 | 16,700,096.80 | 3.29 |
| 165 | 300031 | 宝通科技 | 16,624,305.50 | 3.27 |
| 166 | 600971 | 恒源煤电 | 16,619,565.00 | 3.27 |
| 167 | 600908 | 无锡银行 | 16,595,717.00 | 3.26 |
| 168 | 002446 | 盛路通信 | 16,460,557.05 | 3.24 |
| 169 | 300377 | 赢时胜 | 16,429,580.00 | 3.23 |
| 170 | 300303 | 聚飞光电 | 16,418,345.00 | 3.23 |
| 171 | 688298 | 东方生物 | 16,352,319.20 | 3.22 |
| 172 | 002918 | 蒙娜丽莎 | 16,280,387.00 | 3.20 |
| 173 | 300773 | 拉卡拉 | 16,210,293.35 | 3.19 |
| 174 | 300188 | 国投智能 | 15,995,785.00 | 3.15 |
| 175 | 603005 | 晶方科技 | 15,965,786.60 | 3.14 |
| 176 | 300298 | 三诺生物 | 15,963,672.00 | 3.14 |
| 177 | 688277 | 天智航 | 15,913,326.84 | 3.13 |
| 178 | 000811 | 冰轮环境 | 15,904,620.00 | 3.13 |
| 179 | 601686 | 友发集团 | 15,753,687.12 | 3.10 |
| 180 | 300872 | 天阳科技 | 15,688,804.80 | 3.09 |
| 181 | 300394 | 天孚通信 | 15,653,614.00 | 3.08 |
| 182 | 300855 | 图南股份 | 15,502,097.87 | 3.05 |
| 183 | 002987 | 京北方 | 15,499,469.51 | 3.05 |
| 184 | 300080 | 易成新能 | 15,429,696.00 | 3.04 |
| 185 | 002222 | 福晶科技 | 15,237,456.00 | 3.00 |
| 186 | 300672 | 国科微 | 15,205,540.11 | 2.99 |
| 187 | 002318 | 久立特材 | 15,160,542.00 | 2.98 |
| 188 | 603466 | 风语筑 | 15,111,699.60 | 2.97 |
| 189 | 002020 | 京新药业 | 15,060,723.00 | 2.96 |
| 190 | 000829 | 天音控股 | 15,013,847.77 | 2.95 |
| 191 | 000049 | 德赛电池 | 14,998,739.40 | 2.95 |
| 192 | 600864 | 哈投股份 | 14,988,596.00 | 2.95 |
| 193 | 301095 | 广立微 | 14,956,533.58 | 2.94 |

| | | | | |
|-----|--------|------|---------------|------|
| 194 | 300382 | 斯莱克 | 14,920,678.00 | 2.94 |
| 195 | 600748 | 上实发展 | 14,871,398.00 | 2.93 |
| 196 | 300315 | 掌趣科技 | 14,813,471.00 | 2.91 |
| 197 | 300662 | 科锐国际 | 14,741,246.60 | 2.90 |
| 198 | 300170 | 汉得信息 | 14,688,869.84 | 2.89 |
| 199 | 605168 | 三人行 | 14,688,683.36 | 2.89 |
| 200 | 688066 | 航天宏图 | 14,526,321.65 | 2.86 |
| 201 | 300803 | 指南针 | 14,526,242.00 | 2.86 |
| 202 | 000566 | 海南海药 | 14,519,626.30 | 2.86 |
| 203 | 688516 | 奥特维 | 14,468,222.08 | 2.85 |
| 204 | 600639 | 浦东金桥 | 14,456,028.00 | 2.84 |
| 205 | 300762 | 上海瀚讯 | 14,324,571.60 | 2.82 |
| 206 | 002123 | 梦网科技 | 14,312,143.00 | 2.82 |
| 207 | 002085 | 万丰奥威 | 14,289,589.00 | 2.81 |
| 208 | 300079 | 数码视讯 | 14,286,179.60 | 2.81 |
| 209 | 000676 | 智度股份 | 14,274,417.72 | 2.81 |
| 210 | 002055 | 得润电子 | 14,210,945.00 | 2.80 |
| 211 | 603505 | 金石资源 | 14,154,222.52 | 2.78 |
| 212 | 603920 | 世运电路 | 14,102,610.00 | 2.77 |
| 213 | 002106 | 莱宝高科 | 14,046,618.00 | 2.76 |
| 214 | 688033 | 天宜上佳 | 14,013,937.53 | 2.76 |
| 215 | 002727 | 一心堂 | 13,974,838.54 | 2.75 |
| 216 | 002437 | 誉衡药业 | 13,946,613.00 | 2.74 |
| 217 | 688139 | 海尔生物 | 13,944,124.60 | 2.74 |
| 218 | 600370 | 三房巷 | 13,788,730.00 | 2.71 |
| 219 | 688508 | 芯朋微 | 13,742,122.32 | 2.70 |
| 220 | 002099 | 海翔药业 | 13,729,061.00 | 2.70 |
| 221 | 688800 | 瑞可达 | 13,665,773.74 | 2.69 |
| 222 | 002583 | 海能达 | 13,665,279.00 | 2.69 |
| 223 | 603323 | 苏农银行 | 13,658,358.00 | 2.69 |
| 224 | 002436 | 兴森科技 | 13,582,223.00 | 2.67 |
| 225 | 603103 | 横店影视 | 13,548,384.00 | 2.67 |
| 226 | 603881 | 数据港 | 13,389,659.92 | 2.63 |
| 227 | 300634 | 彩讯股份 | 13,367,258.00 | 2.63 |
| 228 | 002978 | 安宁股份 | 13,292,502.00 | 2.61 |
| 229 | 600490 | 鹏欣资源 | 13,259,468.00 | 2.61 |
| 230 | 603093 | 南华期货 | 13,241,548.00 | 2.60 |
| 231 | 600776 | 东方通信 | 13,175,391.00 | 2.59 |
| 232 | 002472 | 双环传动 | 13,155,496.00 | 2.59 |
| 233 | 600206 | 有研新材 | 13,144,200.36 | 2.59 |
| 234 | 002984 | 森麒麟 | 13,045,073.00 | 2.57 |
| 235 | 300842 | 帝科股份 | 13,043,614.00 | 2.57 |
| 236 | 300765 | 新诺威 | 12,983,526.42 | 2.55 |

| | | | | |
|-----|--------|------|---------------|------|
| 237 | 688268 | 华特气体 | 12,973,891.99 | 2.55 |
| 238 | 000036 | 华联控股 | 12,964,804.00 | 2.55 |
| 239 | 000090 | 天健集团 | 12,892,521.00 | 2.54 |
| 240 | 600105 | 永鼎股份 | 12,889,337.35 | 2.54 |
| 241 | 600876 | 凯盛新能 | 12,883,035.00 | 2.53 |
| 242 | 688518 | 联赢激光 | 12,866,837.76 | 2.53 |
| 243 | 603876 | 鼎胜新材 | 12,793,536.40 | 2.52 |
| 244 | 600363 | 联创光电 | 12,782,064.00 | 2.51 |
| 245 | 600559 | 老白干酒 | 12,758,239.00 | 2.51 |
| 246 | 002773 | 康弘药业 | 12,755,436.00 | 2.51 |
| 247 | 688578 | 艾力斯 | 12,753,536.22 | 2.51 |
| 248 | 603328 | 依顿电子 | 12,732,896.00 | 2.50 |
| 249 | 601019 | 山东出版 | 12,732,290.00 | 2.50 |
| 250 | 002182 | 宝武镁业 | 12,718,281.51 | 2.50 |
| 251 | 600017 | 日照港 | 12,650,899.00 | 2.49 |
| 252 | 002240 | 盛新锂能 | 12,642,986.00 | 2.49 |
| 253 | 300869 | 康泰医学 | 12,618,598.55 | 2.48 |
| 254 | 600821 | 金开新能 | 12,574,813.00 | 2.47 |
| 255 | 603393 | 新天然气 | 12,518,193.00 | 2.46 |
| 256 | 603718 | 海利生物 | 12,509,694.69 | 2.46 |
| 257 | 300263 | 隆华科技 | 12,501,176.00 | 2.46 |
| 258 | 300725 | 药石科技 | 12,497,253.32 | 2.46 |
| 259 | 002839 | 张家港行 | 12,458,716.00 | 2.45 |
| 260 | 000860 | 顺鑫农业 | 12,454,005.10 | 2.45 |
| 261 | 605009 | 豪悦护理 | 12,436,303.82 | 2.45 |
| 262 | 002567 | 唐人神 | 12,427,853.00 | 2.44 |
| 263 | 600872 | 中炬高新 | 12,426,444.00 | 2.44 |
| 264 | 600100 | 同方股份 | 12,404,885.26 | 2.44 |
| 265 | 688575 | 亚辉龙 | 12,395,376.03 | 2.44 |
| 266 | 000902 | 新洋丰 | 12,381,873.00 | 2.44 |
| 267 | 300767 | 震安科技 | 12,357,148.90 | 2.43 |
| 268 | 002061 | 浙江交科 | 12,300,466.32 | 2.42 |
| 269 | 002351 | 漫步者 | 12,295,951.00 | 2.42 |
| 270 | 688235 | 百济神州 | 12,268,140.04 | 2.41 |
| 271 | 300596 | 利安隆 | 12,196,396.00 | 2.40 |
| 272 | 300319 | 麦捷科技 | 12,128,488.00 | 2.39 |
| 273 | 600389 | 江山股份 | 12,116,777.70 | 2.38 |
| 274 | 002913 | 奥士康 | 12,106,760.00 | 2.38 |
| 275 | 600977 | 中国电影 | 12,066,093.00 | 2.37 |
| 276 | 300439 | 美康生物 | 11,997,091.00 | 2.36 |
| 277 | 301060 | 兰卫医学 | 11,981,198.10 | 2.36 |
| 278 | 603612 | 索通发展 | 11,966,062.00 | 2.35 |
| 279 | 300346 | 南大光电 | 11,919,671.58 | 2.34 |

| | | | | |
|-----|--------|------|---------------|------|
| 280 | 002130 | 沃尔核材 | 11,873,173.20 | 2.34 |
| 281 | 600710 | 苏美达 | 11,762,299.50 | 2.31 |
| 282 | 002011 | 盾安环境 | 11,746,960.50 | 2.31 |
| 283 | 600933 | 爱柯迪 | 11,712,790.00 | 2.30 |
| 284 | 002993 | 奥海科技 | 11,683,583.00 | 2.30 |
| 285 | 603197 | 保隆科技 | 11,653,913.00 | 2.29 |
| 286 | 300476 | 胜宏科技 | 11,641,876.00 | 2.29 |
| 287 | 300685 | 艾德生物 | 11,546,714.94 | 2.27 |
| 288 | 603533 | 掌阅科技 | 11,539,093.00 | 2.27 |
| 289 | 300224 | 正海磁材 | 11,526,431.65 | 2.27 |
| 290 | 301165 | 锐捷网络 | 11,482,099.49 | 2.26 |
| 291 | 300416 | 苏试试验 | 11,468,233.88 | 2.26 |
| 292 | 300206 | 理邦仪器 | 11,445,042.00 | 2.25 |
| 293 | 601975 | 招商南油 | 11,442,047.00 | 2.25 |
| 294 | 600583 | 海油工程 | 11,373,590.00 | 2.24 |
| 295 | 003009 | 中天火箭 | 11,368,481.00 | 2.24 |
| 296 | 600037 | 歌华有线 | 11,314,731.00 | 2.23 |
| 297 | 002859 | 洁美科技 | 11,302,691.00 | 2.22 |
| 298 | 300438 | 鹏辉能源 | 11,297,574.00 | 2.22 |
| 299 | 000685 | 中山公用 | 11,244,018.00 | 2.21 |
| 300 | 002664 | 信质集团 | 11,200,707.00 | 2.20 |
| 301 | 002489 | 浙江永强 | 11,186,856.00 | 2.20 |
| 302 | 002617 | 露笑科技 | 11,139,213.68 | 2.19 |
| 303 | 002390 | 信邦制药 | 11,094,204.00 | 2.18 |
| 304 | 300379 | 东方通 | 11,061,967.00 | 2.18 |
| 305 | 002048 | 宁波华翔 | 11,059,205.00 | 2.18 |
| 306 | 002428 | 云南锗业 | 10,992,849.00 | 2.16 |
| 307 | 688106 | 金宏气体 | 10,952,218.74 | 2.15 |
| 308 | 601801 | 皖新传媒 | 10,926,516.00 | 2.15 |
| 309 | 600888 | 新疆众和 | 10,898,026.00 | 2.14 |
| 310 | 688700 | 东威科技 | 10,855,524.99 | 2.14 |
| 311 | 300633 | 开立医疗 | 10,845,981.00 | 2.13 |
| 312 | 601311 | 骆驼股份 | 10,811,799.00 | 2.13 |
| 313 | 300133 | 华策影视 | 10,811,684.00 | 2.13 |
| 314 | 000546 | 金圆股份 | 10,811,662.00 | 2.13 |
| 315 | 605369 | 拱东医疗 | 10,765,668.40 | 2.12 |
| 316 | 300693 | 盛弘股份 | 10,758,896.20 | 2.12 |
| 317 | 000543 | 皖能电力 | 10,747,598.00 | 2.11 |
| 318 | 300811 | 铂科新材 | 10,730,191.40 | 2.11 |
| 319 | 000950 | 重药控股 | 10,703,412.00 | 2.11 |
| 320 | 002891 | 中宠股份 | 10,699,607.00 | 2.10 |
| 321 | 002701 | 奥瑞金 | 10,693,780.00 | 2.10 |
| 322 | 600771 | 广誉远 | 10,651,300.00 | 2.10 |

| | | | | |
|-----|--------|-------|---------------|------|
| 323 | 002646 | 天佑德酒 | 10,569,458.00 | 2.08 |
| 324 | 603063 | 禾望电气 | 10,544,664.00 | 2.07 |
| 325 | 000029 | 深深房 A | 10,544,582.70 | 2.07 |
| 326 | 688559 | 海目星 | 10,536,335.91 | 2.07 |
| 327 | 603583 | 捷昌驱动 | 10,479,907.00 | 2.06 |
| 328 | 000990 | 诚志股份 | 10,416,696.88 | 2.05 |
| 329 | 600742 | 一汽富维 | 10,406,202.00 | 2.05 |
| 330 | 002004 | 华邦健康 | 10,379,956.00 | 2.04 |
| 331 | 605365 | 立达信 | 10,375,168.44 | 2.04 |
| 332 | 002023 | 海特高新 | 10,361,745.00 | 2.04 |
| 333 | 603636 | 南威软件 | 10,359,673.00 | 2.04 |
| 334 | 600649 | 城投控股 | 10,324,044.00 | 2.03 |
| 335 | 000560 | 我爱我家 | 10,282,710.00 | 2.02 |
| 336 | 603129 | 春风动力 | 10,267,941.00 | 2.02 |
| 337 | 002314 | 南山控股 | 10,243,057.00 | 2.01 |
| 338 | 300065 | 海兰信 | 10,212,333.00 | 2.01 |

注：买入金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

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 | 002597 | 金禾实业 | 46,115,638.29 | 9.07 |
| 2 | 301039 | 中集车辆 | 45,326,377.76 | 8.92 |
| 3 | 603118 | 共进股份 | 42,873,703.65 | 8.43 |
| 4 | 002517 | 恺英网络 | 40,136,673.00 | 7.90 |
| 5 | 002697 | 红旗连锁 | 38,849,464.00 | 7.64 |
| 6 | 300036 | 超图软件 | 38,695,505.00 | 7.61 |
| 7 | 300775 | 三角防务 | 38,611,289.64 | 7.60 |
| 8 | 600285 | 羚锐制药 | 38,246,018.04 | 7.52 |
| 9 | 000758 | 中色股份 | 38,072,789.12 | 7.49 |
| 10 | 600572 | 康恩贝 | 37,323,586.00 | 7.34 |
| 11 | 600797 | 浙大网新 | 36,436,881.00 | 7.17 |
| 12 | 600210 | 紫江企业 | 35,626,169.12 | 7.01 |
| 13 | 300352 | 北信源 | 34,464,717.56 | 6.78 |
| 14 | 600073 | 上海梅林 | 34,148,164.00 | 6.72 |
| 15 | 002463 | 沪电股份 | 32,904,296.50 | 6.47 |
| 16 | 601137 | 博威合金 | 32,427,362.00 | 6.38 |
| 17 | 600420 | 国药现代 | 32,397,591.88 | 6.37 |
| 18 | 002044 | 美年健康 | 32,196,718.34 | 6.33 |
| 19 | 600750 | 江中药业 | 31,966,967.66 | 6.29 |
| 20 | 600211 | 西藏药业 | 31,488,087.13 | 6.19 |
| 21 | 300232 | 洲明科技 | 31,340,273.02 | 6.17 |
| 22 | 002291 | 遥望科技 | 30,908,594.14 | 6.08 |
| 23 | 002139 | 拓邦股份 | 30,314,084.52 | 5.96 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 24 | 300226 | 上海钢联 | 30,294,984.32 | 5.96 |
| 25 | 605111 | 新洁能 | 29,861,853.84 | 5.87 |
| 26 | 000917 | 电广传媒 | 29,715,973.01 | 5.85 |
| 27 | 000034 | 神州数码 | 29,401,409.88 | 5.78 |
| 28 | 603368 | 柳药集团 | 29,187,766.27 | 5.74 |
| 29 | 300674 | 宇信科技 | 29,166,008.23 | 5.74 |
| 30 | 002649 | 博彦科技 | 28,847,842.13 | 5.67 |
| 31 | 002237 | 恒邦股份 | 28,535,996.06 | 5.61 |
| 32 | 000933 | 神火股份 | 28,391,293.39 | 5.58 |
| 33 | 300856 | 科思股份 | 28,301,935.50 | 5.57 |
| 34 | 603345 | 安井食品 | 28,194,476.41 | 5.55 |
| 35 | 000612 | 焦作万方 | 28,169,681.05 | 5.54 |
| 36 | 300130 | 新国都 | 28,003,575.93 | 5.51 |
| 37 | 002158 | 汉钟精机 | 27,888,568.00 | 5.49 |
| 38 | 300119 | 瑞普生物 | 27,721,948.22 | 5.45 |
| 39 | 002126 | 银轮股份 | 27,484,833.00 | 5.41 |
| 40 | 002402 | 和而泰 | 27,481,707.38 | 5.41 |
| 41 | 002610 | 爱康科技 | 27,448,318.00 | 5.40 |
| 42 | 600850 | 电科数字 | 27,431,164.02 | 5.40 |
| 43 | 605589 | 圣泉集团 | 27,070,048.52 | 5.33 |
| 44 | 600064 | 南京高科 | 26,952,718.00 | 5.30 |
| 45 | 600158 | 中体产业 | 26,541,966.40 | 5.22 |
| 46 | 600057 | 厦门象屿 | 26,540,902.45 | 5.22 |
| 47 | 000517 | 荣安地产 | 26,205,990.28 | 5.16 |
| 48 | 601908 | 京运通 | 26,102,362.80 | 5.13 |
| 49 | 688556 | 高测股份 | 25,970,771.54 | 5.11 |
| 50 | 300638 | 广和通 | 25,939,290.42 | 5.10 |
| 51 | 002283 | 天润工业 | 25,927,867.00 | 5.10 |
| 52 | 600480 | 凌云股份 | 25,875,303.36 | 5.09 |
| 53 | 300777 | 中简科技 | 25,822,206.06 | 5.08 |
| 54 | 002276 | 万马股份 | 25,726,332.15 | 5.06 |
| 55 | 601375 | 中原证券 | 25,525,482.84 | 5.02 |
| 56 | 300900 | 广联航空 | 25,382,184.39 | 4.99 |
| 57 | 601921 | 浙版传媒 | 25,011,342.40 | 4.92 |
| 58 | 600458 | 时代新材 | 24,855,283.67 | 4.89 |
| 59 | 601126 | 四方股份 | 24,853,667.00 | 4.89 |
| 60 | 600129 | 太极集团 | 24,819,411.28 | 4.88 |
| 61 | 600789 | 鲁抗医药 | 24,787,273.20 | 4.88 |
| 62 | 002605 | 姚记科技 | 23,911,617.84 | 4.70 |
| 63 | 002746 | 仙坛股份 | 23,903,082.96 | 4.70 |
| 64 | 000951 | 中国重汽 | 23,702,880.22 | 4.66 |
| 65 | 600971 | 恒源煤电 | 23,658,827.00 | 4.65 |
| 66 | 605388 | 均瑶健康 | 23,649,013.00 | 4.65 |

| | | | | |
|-----|--------|------|---------------|------|
| 67 | 301219 | 腾远钴业 | 23,561,846.10 | 4.63 |
| 68 | 000567 | 海德股份 | 23,493,336.01 | 4.62 |
| 69 | 000913 | 钱江摩托 | 23,484,847.27 | 4.62 |
| 70 | 600284 | 浦东建设 | 23,260,102.19 | 4.58 |
| 71 | 002421 | 达实智能 | 23,234,534.00 | 4.57 |
| 72 | 600502 | 安徽建工 | 23,219,564.80 | 4.57 |
| 73 | 000915 | 华特达因 | 23,113,058.55 | 4.55 |
| 74 | 002558 | 巨人网络 | 23,106,321.46 | 4.55 |
| 75 | 002413 | 雷科防务 | 23,023,817.35 | 4.53 |
| 76 | 600531 | 豫光金铅 | 23,017,701.79 | 4.53 |
| 77 | 002174 | 游族网络 | 22,940,498.14 | 4.51 |
| 78 | 600481 | 双良节能 | 22,762,228.00 | 4.48 |
| 79 | 002233 | 塔牌集团 | 22,657,807.00 | 4.46 |
| 80 | 002063 | 远光软件 | 22,478,483.31 | 4.42 |
| 81 | 002611 | 东方精工 | 22,355,061.00 | 4.40 |
| 82 | 002518 | 科士达 | 22,088,034.98 | 4.35 |
| 83 | 002747 | 埃斯顿 | 21,901,222.48 | 4.31 |
| 84 | 000921 | 海信家电 | 21,778,858.67 | 4.28 |
| 85 | 300567 | 精测电子 | 21,714,062.00 | 4.27 |
| 86 | 600612 | 老凤祥 | 21,613,387.57 | 4.25 |
| 87 | 002768 | 国恩股份 | 21,592,451.12 | 4.25 |
| 88 | 002967 | 广电计量 | 21,394,285.22 | 4.21 |
| 89 | 000650 | 仁和药业 | 21,393,687.00 | 4.21 |
| 90 | 002865 | 钧达股份 | 21,287,078.58 | 4.19 |
| 91 | 601567 | 三星医疗 | 21,099,754.82 | 4.15 |
| 92 | 601222 | 林洋能源 | 20,958,120.94 | 4.12 |
| 93 | 600685 | 中船防务 | 20,767,730.00 | 4.09 |
| 94 | 002324 | 普利特 | 20,713,073.46 | 4.07 |
| 95 | 000555 | 神州信息 | 20,694,916.80 | 4.07 |
| 96 | 603979 | 金诚信 | 20,657,933.40 | 4.06 |
| 97 | 002698 | 博实股份 | 20,584,947.99 | 4.05 |
| 98 | 603690 | 至纯科技 | 20,571,085.60 | 4.05 |
| 99 | 603919 | 金徽酒 | 20,565,894.10 | 4.05 |
| 100 | 600587 | 新华医疗 | 20,516,234.57 | 4.04 |
| 101 | 002017 | 东信和平 | 20,486,981.00 | 4.03 |
| 102 | 002851 | 麦格米特 | 20,366,645.00 | 4.01 |
| 103 | 000048 | 京基智农 | 20,357,267.58 | 4.00 |
| 104 | 603027 | 千禾味业 | 20,054,309.74 | 3.94 |
| 105 | 603301 | 振德医疗 | 19,932,543.53 | 3.92 |
| 106 | 000423 | 东阿阿胶 | 19,915,235.00 | 3.92 |
| 107 | 300394 | 天孚通信 | 19,810,974.05 | 3.90 |
| 108 | 002215 | 诺普信 | 19,799,956.88 | 3.89 |
| 109 | 002782 | 可立克 | 19,735,256.44 | 3.88 |

| | | | | |
|-----|--------|------|---------------|------|
| 110 | 688037 | 芯源微 | 19,588,548.53 | 3.85 |
| 111 | 600761 | 安徽合力 | 19,561,037.32 | 3.85 |
| 112 | 300377 | 赢时胜 | 19,404,412.73 | 3.82 |
| 113 | 002020 | 京新药业 | 19,304,752.45 | 3.80 |
| 114 | 600559 | 老白干酒 | 19,271,894.00 | 3.79 |
| 115 | 002737 | 葵花药业 | 19,231,081.06 | 3.78 |
| 116 | 600267 | 海正药业 | 18,950,128.00 | 3.73 |
| 117 | 600459 | 贵研铂业 | 18,838,730.48 | 3.71 |
| 118 | 002222 | 福晶科技 | 18,633,693.85 | 3.67 |
| 119 | 600483 | 福能股份 | 18,525,048.98 | 3.64 |
| 120 | 688018 | 乐鑫科技 | 18,495,366.61 | 3.64 |
| 121 | 300118 | 东方日升 | 18,459,251.40 | 3.63 |
| 122 | 000928 | 中钢国际 | 18,390,035.08 | 3.62 |
| 123 | 688707 | 振华新材 | 18,372,271.83 | 3.61 |
| 124 | 002895 | 川恒股份 | 18,305,291.88 | 3.60 |
| 125 | 601519 | 大智慧 | 18,075,317.00 | 3.56 |
| 126 | 300973 | 立高食品 | 18,039,765.12 | 3.55 |
| 127 | 600577 | 精达股份 | 18,037,863.70 | 3.55 |
| 128 | 000600 | 建投能源 | 17,887,958.00 | 3.52 |
| 129 | 300502 | 新易盛 | 17,882,430.88 | 3.52 |
| 130 | 000049 | 德赛电池 | 17,838,347.07 | 3.51 |
| 131 | 600557 | 康缘药业 | 17,797,173.82 | 3.50 |
| 132 | 300634 | 彩讯股份 | 17,757,916.05 | 3.49 |
| 133 | 002038 | 双鹭药业 | 17,753,265.00 | 3.49 |
| 134 | 603236 | 移远通信 | 17,647,415.50 | 3.47 |
| 135 | 600120 | 浙江东方 | 17,642,781.54 | 3.47 |
| 136 | 300236 | 上海新阳 | 17,576,312.88 | 3.46 |
| 137 | 600662 | 外服控股 | 17,462,507.72 | 3.44 |
| 138 | 002449 | 国星光电 | 17,448,546.98 | 3.43 |
| 139 | 002706 | 良信股份 | 17,221,917.12 | 3.39 |
| 140 | 002055 | 得润电子 | 17,188,540.33 | 3.38 |
| 141 | 003006 | 百亚股份 | 17,095,461.09 | 3.36 |
| 142 | 002085 | 万丰奥威 | 17,065,992.22 | 3.36 |
| 143 | 600197 | 伊力特 | 16,904,143.41 | 3.33 |
| 144 | 601619 | 嘉泽新能 | 16,901,924.00 | 3.32 |
| 145 | 002036 | 联创电子 | 16,885,890.58 | 3.32 |
| 146 | 000528 | 柳 工 | 16,874,212.00 | 3.32 |
| 147 | 000893 | 亚钾国际 | 16,867,895.98 | 3.32 |
| 148 | 002815 | 崇达技术 | 16,731,593.75 | 3.29 |
| 149 | 300842 | 帝科股份 | 16,723,096.00 | 3.29 |
| 150 | 002456 | 欧菲光 | 16,609,248.00 | 3.27 |
| 151 | 000969 | 安泰科技 | 16,489,416.00 | 3.24 |
| 152 | 600105 | 永鼎股份 | 16,470,454.24 | 3.24 |

| | | | | |
|-----|--------|------|---------------|------|
| 153 | 300872 | 天阳科技 | 16,374,224.74 | 3.22 |
| 154 | 300773 | 拉卡拉 | 16,343,943.00 | 3.22 |
| 155 | 002979 | 雷赛智能 | 16,292,752.35 | 3.21 |
| 156 | 002335 | 科华数据 | 16,268,839.31 | 3.20 |
| 157 | 688399 | 硕世生物 | 16,268,772.02 | 3.20 |
| 158 | 002446 | 盛路通信 | 16,254,318.59 | 3.20 |
| 159 | 603005 | 晶方科技 | 16,196,702.89 | 3.19 |
| 160 | 002918 | 蒙娜丽莎 | 16,174,834.04 | 3.18 |
| 161 | 600908 | 无锡银行 | 16,115,042.00 | 3.17 |
| 162 | 002662 | 京威股份 | 15,992,798.38 | 3.15 |
| 163 | 300827 | 上能电气 | 15,979,641.31 | 3.14 |
| 164 | 002079 | 苏州固锟 | 15,844,810.32 | 3.12 |
| 165 | 300315 | 掌趣科技 | 15,814,895.60 | 3.11 |
| 166 | 300031 | 宝通科技 | 15,766,935.30 | 3.10 |
| 167 | 300765 | 新诺威 | 15,635,218.50 | 3.08 |
| 168 | 300298 | 三诺生物 | 15,595,478.48 | 3.07 |
| 169 | 601686 | 友发集团 | 15,492,220.28 | 3.05 |
| 170 | 300662 | 科锐国际 | 15,408,635.40 | 3.03 |
| 171 | 300348 | 长亮科技 | 15,400,526.65 | 3.03 |
| 172 | 688277 | 天智航 | 15,359,788.00 | 3.02 |
| 173 | 600748 | 上实发展 | 15,218,972.00 | 2.99 |
| 174 | 688066 | 航天宏图 | 15,161,116.17 | 2.98 |
| 175 | 300303 | 聚飞光电 | 15,160,243.00 | 2.98 |
| 176 | 688516 | 奥特维 | 15,141,512.83 | 2.98 |
| 177 | 300068 | 南都电源 | 15,091,540.00 | 2.97 |
| 178 | 002318 | 久立特材 | 15,009,670.00 | 2.95 |
| 179 | 600312 | 平高电气 | 14,990,896.50 | 2.95 |
| 180 | 600864 | 哈投股份 | 14,883,284.00 | 2.93 |
| 181 | 002212 | 天融信 | 14,838,970.00 | 2.92 |
| 182 | 002100 | 天康生物 | 14,810,341.02 | 2.91 |
| 183 | 300123 | 亚光科技 | 14,807,413.00 | 2.91 |
| 184 | 002106 | 莱宝高科 | 14,785,539.00 | 2.91 |
| 185 | 300855 | 图南股份 | 14,765,697.46 | 2.90 |
| 186 | 300080 | 易成新能 | 14,707,669.00 | 2.89 |
| 187 | 002839 | 张家港行 | 14,637,239.00 | 2.88 |
| 188 | 300762 | 上海瀚讯 | 14,617,185.00 | 2.88 |
| 189 | 600320 | 振华重工 | 14,613,435.20 | 2.87 |
| 190 | 003012 | 东鹏控股 | 14,533,222.41 | 2.86 |
| 191 | 688578 | 艾力斯 | 14,493,498.99 | 2.85 |
| 192 | 300101 | 振芯科技 | 14,460,059.64 | 2.84 |
| 193 | 300109 | 新开源 | 14,436,088.36 | 2.84 |
| 194 | 600266 | 城建发展 | 14,426,655.88 | 2.84 |
| 195 | 000676 | 智度股份 | 14,356,856.04 | 2.82 |

| | | | | |
|-----|--------|------|---------------|------|
| 196 | 002123 | 梦网科技 | 14,268,393.00 | 2.81 |
| 197 | 002099 | 海翔药业 | 14,247,826.00 | 2.80 |
| 198 | 600742 | 一汽富维 | 14,208,440.00 | 2.80 |
| 199 | 688139 | 海尔生物 | 14,130,233.52 | 2.78 |
| 200 | 300725 | 药石科技 | 14,072,136.99 | 2.77 |
| 201 | 300451 | 创业慧康 | 14,019,816.00 | 2.76 |
| 202 | 603103 | 横店影视 | 13,978,919.00 | 2.75 |
| 203 | 002987 | 京北方 | 13,935,899.19 | 2.74 |
| 204 | 603129 | 春风动力 | 13,893,102.00 | 2.73 |
| 205 | 300803 | 指南针 | 13,873,744.34 | 2.73 |
| 206 | 300382 | 斯莱克 | 13,777,974.38 | 2.71 |
| 207 | 300079 | 数码视讯 | 13,637,175.74 | 2.68 |
| 208 | 002567 | 唐人神 | 13,597,672.00 | 2.67 |
| 209 | 301095 | 广立微 | 13,542,530.44 | 2.66 |
| 210 | 300438 | 鹏辉能源 | 13,532,837.00 | 2.66 |
| 211 | 000860 | 顺鑫农业 | 13,472,133.00 | 2.65 |
| 212 | 000560 | 我爱我家 | 13,446,696.94 | 2.65 |
| 213 | 600776 | 东方通信 | 13,446,310.00 | 2.65 |
| 214 | 002258 | 利尔化学 | 13,444,726.94 | 2.64 |
| 215 | 600370 | 三房巷 | 13,429,010.00 | 2.64 |
| 216 | 603306 | 华懋科技 | 13,410,606.00 | 2.64 |
| 217 | 300002 | 神州泰岳 | 13,402,736.56 | 2.64 |
| 218 | 603466 | 风语筑 | 13,394,187.35 | 2.63 |
| 219 | 002727 | 一心堂 | 13,366,963.00 | 2.63 |
| 220 | 300398 | 飞凯材料 | 13,297,383.88 | 2.62 |
| 221 | 688711 | 宏微科技 | 13,284,432.19 | 2.61 |
| 222 | 688033 | 天宜上佳 | 13,281,199.38 | 2.61 |
| 223 | 300672 | 国科微 | 13,020,587.60 | 2.56 |
| 224 | 603533 | 掌阅科技 | 12,951,110.88 | 2.55 |
| 225 | 605009 | 豪悦护理 | 12,931,967.92 | 2.54 |
| 226 | 002467 | 二六三 | 12,862,806.00 | 2.53 |
| 227 | 000036 | 华联控股 | 12,786,494.00 | 2.52 |
| 228 | 002437 | 誉衡药业 | 12,766,710.00 | 2.51 |
| 229 | 603393 | 新天然气 | 12,762,397.80 | 2.51 |
| 230 | 603920 | 世运电路 | 12,752,042.00 | 2.51 |
| 231 | 002993 | 奥海科技 | 12,747,437.00 | 2.51 |
| 232 | 600821 | 金开新能 | 12,735,251.00 | 2.51 |
| 233 | 600017 | 日照港 | 12,716,912.00 | 2.50 |
| 234 | 603612 | 索通发展 | 12,680,209.00 | 2.49 |
| 235 | 002978 | 安宁股份 | 12,676,954.00 | 2.49 |
| 236 | 000811 | 冰轮环境 | 12,635,112.00 | 2.49 |
| 237 | 002182 | 宝武镁业 | 12,621,935.21 | 2.48 |
| 238 | 688575 | 亚辉龙 | 12,612,635.10 | 2.48 |

| | | | | |
|-----|--------|------|---------------|------|
| 239 | 000546 | 金圆股份 | 12,539,349.00 | 2.47 |
| 240 | 600490 | 鹏欣资源 | 12,501,891.00 | 2.46 |
| 241 | 600456 | 宝钛股份 | 12,461,012.18 | 2.45 |
| 242 | 603718 | 海利生物 | 12,404,392.03 | 2.44 |
| 243 | 002396 | 星网锐捷 | 12,385,501.33 | 2.44 |
| 244 | 300869 | 康泰医学 | 12,374,506.15 | 2.43 |
| 245 | 300767 | 震安科技 | 12,182,161.72 | 2.40 |
| 246 | 300761 | 立华股份 | 12,139,003.00 | 2.39 |
| 247 | 605168 | 三人行 | 12,137,859.56 | 2.39 |
| 248 | 003009 | 中天火箭 | 12,129,868.45 | 2.39 |
| 249 | 600888 | 新疆众和 | 12,091,855.00 | 2.38 |
| 250 | 603881 | 数据港 | 12,001,580.86 | 2.36 |
| 251 | 300263 | 隆华科技 | 11,931,996.00 | 2.35 |
| 252 | 601975 | 招商南油 | 11,920,524.00 | 2.34 |
| 253 | 688508 | 芯朋微 | 11,904,430.48 | 2.34 |
| 254 | 688559 | 海目星 | 11,826,570.31 | 2.33 |
| 255 | 000902 | 新洋丰 | 11,818,417.72 | 2.32 |
| 256 | 002240 | 盛新锂能 | 11,764,107.00 | 2.31 |
| 257 | 688148 | 芳源股份 | 11,682,982.71 | 2.30 |
| 258 | 002011 | 盾安环境 | 11,676,163.00 | 2.30 |
| 259 | 300639 | 凯普生物 | 11,627,811.93 | 2.29 |
| 260 | 300910 | 瑞丰新材 | 11,622,277.20 | 2.29 |
| 261 | 002984 | 森麒麟 | 11,619,740.00 | 2.29 |
| 262 | 600583 | 海油工程 | 11,611,045.00 | 2.28 |
| 263 | 603323 | 苏农银行 | 11,606,269.00 | 2.28 |
| 264 | 603529 | 爱玛科技 | 11,596,996.81 | 2.28 |
| 265 | 000690 | 宝新能源 | 11,543,105.00 | 2.27 |
| 266 | 600933 | 爱柯迪 | 11,482,594.00 | 2.26 |
| 267 | 300439 | 美康生物 | 11,388,809.00 | 2.24 |
| 268 | 002061 | 浙江交科 | 11,351,726.60 | 2.23 |
| 269 | 603960 | 克来机电 | 11,335,468.70 | 2.23 |
| 270 | 600098 | 广州发展 | 11,266,672.00 | 2.22 |
| 271 | 300596 | 利安隆 | 11,247,278.50 | 2.21 |
| 272 | 002913 | 奥士康 | 11,141,805.03 | 2.19 |
| 273 | 600876 | 凯盛新能 | 11,103,162.67 | 2.18 |
| 274 | 603108 | 润达医疗 | 11,091,125.00 | 2.18 |
| 275 | 600389 | 江山股份 | 11,022,519.76 | 2.17 |
| 276 | 002664 | 信质集团 | 10,973,720.11 | 2.16 |
| 277 | 002006 | 精工科技 | 10,962,575.99 | 2.16 |
| 278 | 002489 | 浙江永强 | 10,889,337.54 | 2.14 |
| 279 | 600639 | 浦东金桥 | 10,840,882.00 | 2.13 |
| 280 | 000685 | 中山公用 | 10,799,695.00 | 2.12 |
| 281 | 002048 | 宁波华翔 | 10,795,172.72 | 2.12 |

| | | | | |
|-----|--------|------|---------------|------|
| 282 | 600993 | 马应龙 | 10,772,346.68 | 2.12 |
| 283 | 600710 | 苏美达 | 10,749,686.75 | 2.11 |
| 284 | 600977 | 中国电影 | 10,675,206.55 | 2.10 |
| 285 | 300188 | 国投智能 | 10,661,965.00 | 2.10 |
| 286 | 688106 | 金宏气体 | 10,648,913.84 | 2.09 |
| 287 | 603105 | 芯能科技 | 10,550,228.00 | 2.08 |
| 288 | 000950 | 重药控股 | 10,518,145.00 | 2.07 |
| 289 | 000566 | 海南海药 | 10,505,830.35 | 2.07 |
| 290 | 600635 | 大众公用 | 10,475,376.00 | 2.06 |
| 291 | 002617 | 露笑科技 | 10,462,224.40 | 2.06 |
| 292 | 002837 | 英维克 | 10,441,856.11 | 2.05 |
| 293 | 002130 | 沃尔核材 | 10,366,972.66 | 2.04 |
| 294 | 603093 | 南华期货 | 10,317,683.00 | 2.03 |
| 295 | 300602 | 飞荣达 | 10,308,147.00 | 2.03 |
| 296 | 002961 | 瑞达期货 | 10,251,865.63 | 2.02 |
| 297 | 300633 | 开立医疗 | 10,178,490.07 | 2.00 |
| 298 | 002171 | 楚江新材 | 10,167,359.00 | 2.00 |

注：卖出金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

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 | 9,132,544,494.94 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 8,344,487,285.38 |

注：买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额均为买卖股票成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

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 | 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） | 1,174,580.01 | 0.09 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 1,174,580.01 | 0.09 |

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 | 113069 | 博 23 转债 | 6,960 | 696,045.76 | 0.05 |
| 2 | 127100 | 神码转债 | 2,454 | 245,417.75 | 0.02 |
| 3 | 127098 | 欧晶转债 | 1,436 | 222,115.68 | 0.02 |
| 4 | 118046 | 诺泰转债 | 110 | 11,000.82 | 0.00 |

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

本基金可投资股指期货、国债期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金投资股指期货、国债期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要评估期货合约的流动性、交易活跃度等方面。本基金力争利用期货的杠杆作用，降低基金资产调整的频率和交易成本。

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

本基金可投资股指期货、国债期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金投资股指期货、国债期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要评估期货合约的流动性、交易活跃度等方面。本基金力争利用期货的杠杆作用，降低基金资产调整的频率和交易成本。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

金石资源集团股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到地方国税局的处罚。

东北制药集团股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到辽宁省市场监督管理局的处罚。

本基金基金经理依据基金合同及公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对上述主体所发行证券进行了投资。

本基金投资前十名证券的其余发行主体本报告期内没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

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 | 4,224,180.16 |
| 2 | 应收清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 86,042.14 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 4,310,222.30 |

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的情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数 (户) | 户均持有的 基金份额 | 持有人结构 | | | |
|--------------|---------------|----------------|----------------|----------------|----------------|
| | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | 持有份额 | 占总份额比 例 (%) | 持有份额 | 占总份额比 例 (%) |
| 28,867 | 37,645.84 | 930,808,257.57 | 85.65 | 155,914,145.48 | 14.35 |

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 持有份额总数 (份) | 占基金总份额比例 (%) |
|------------------|------------|--------------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 59,767.12 | 0.005500 |

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

- 1、本期末基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。
- 2、本期末本基金的基金经理未持有本基金。

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

无。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|-------------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2018 年 2 月 6 日）基金份额总额 | 1,784,551,427.10 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 335,576,804.15 |
| 本报告期基金总申购份额 | 937,425,732.34 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 186,280,133.44 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 1,086,722,403.05 |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

在本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人重大人事变动：

报告期内本基金管理人未发生重大人事变动。

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根据工作需要，任命牛环起、施伟为资产管理业务部副总经理。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内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

在本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)已经连续 6 年为本基金提供审计服务，本年度应支付给会计师事务所的报酬为人民币 90,000.00 元。

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

本报告期内，本基金的管理人及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金的托管人及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|--------------|--------|------------------|------------------|--------------|----------------|----------------|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 (%) | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 (%) | |
| 光大证券股份有限公司 | 2 | 2,123,682,588.04 | 12.17 | 1,996,654.76 | 12.22 | - |
| 长江证券股份有限公司 | 1 | 1,819,032,478.55 | 10.42 | 1,699,443.70 | 10.40 | - |
| 华创证券有限责任公司 | 1 | 1,792,674,731.07 | 10.27 | 1,675,960.14 | 10.26 | - |
| 中信建投证券股份有限公司 | 2 | 1,495,362,388.10 | 8.57 | 1,402,535.81 | 8.58 | - |
| 西部证券股份有限公司 | 2 | 1,316,641,782.53 | 7.54 | 1,234,831.64 | 7.56 | - |
| 招商证券股份有限公司 | 1 | 1,162,692,452.75 | 6.66 | 1,093,560.28 | 6.69 | - |
| 天风证券股份有限公司 | 1 | 1,088,228,660.74 | 6.23 | 1,013,460.01 | 6.20 | - |
| 东方证券股份有限公司 | 1 | 1,008,847,694.23 | 5.78 | 944,634.92 | 5.78 | - |
| 中信证券股份有限公司 | 4 | 929,205,635.93 | 5.32 | 868,887.51 | 5.32 | - |
| 中泰证券股份有限公司 | 1 | 803,274,070.48 | 4.60 | 748,098.41 | 4.58 | 本期报告 退租 1 个 |
| 华金证券股份有限公司 | 2 | 739,043,410.50 | 4.23 | 688,274.73 | 4.21 | - |
| 渤海证券股份有限公司 | 1 | 703,158,403.05 | 4.03 | 654,859.81 | 4.01 | - |
| 广发证券股份有限公司 | 1 | 545,434,418.31 | 3.13 | 512,750.21 | 3.14 | - |
| 中国国际金 | 1 | 387,399,409.70 | 2.22 | 366,440.61 | 2.24 | - |

| | | | | | | |
|----------------------|---|----------------|------|------------|------|----------------|
| 融股份有限 公司 | | | | | | |
| 国信证券股 份有限公司 | 2 | 375,065,221.79 | 2.15 | 349,301.26 | 2.14 | - |
| 东北证券股 份有限公司 | 1 | 330,364,589.99 | 1.89 | 307,672.42 | 1.88 | - |
| 国投证券股 份有限公司 | 1 | 263,105,969.01 | 1.51 | 248,453.81 | 1.52 | - |
| 湘财证券责 任有限公司 | 2 | 260,020,388.81 | 1.49 | 245,953.50 | 1.51 | 本期报告 新增 2 个 |
| 国泰君安证 券股份有限 公司 | 1 | 140,004,387.44 | 0.80 | 130,385.13 | 0.80 | - |
| 方正证券股 份有限公司 | 1 | 79,800,328.68 | 0.46 | 74,320.88 | 0.45 | - |
| 长城证券股 份有限公司 | 2 | 54,301,490.41 | 0.31 | 50,990.59 | 0.31 | - |
| 东方财富证 券股份有限 公司 | 2 | 36,372,257.69 | 0.21 | 33,876.60 | 0.21 | - |
| 汇丰前海证 券有限责任 公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 1 | - | - | - | - | - |

注：1、基金专用交易单元的选择标准和程序如下：

1) 选择标准

- a、资金实力雄厚，信誉良好；
- b、财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- c、经营行为规范，最近三年未因重大违规行为受到监管机关的处罚；
- d、内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求；
- e、该证券经营机构具有较强的研究能力，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析报告、个股分析报告及其他专门报告以及全面的信息服务。并能根据基金管理人的特定要求，提供专门研究报告。

2) 选择程序

基金管理人根据以上标准进行考察后，确定证券经营机构的选择。基金管理人与被选择的证

券经营机构签订协议。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|--------------|--------------|-----------------|--------|-------------------|------|-----------------|
| | 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(%) |
| 光大证券股份有限公司 | 87,073.80 | 0.96 | - | - | - | - |
| 长江证券股份有限公司 | 1,340.56 | 0.01 | - | - | - | - |
| 华创证券有限责任公司 | 993,666.15 | 10.98 | - | - | - | - |
| 中信建投证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 西部证券股份有限公司 | 972,736.20 | 10.74 | - | - | - | - |
| 招商证券股份有限公司 | 159,662.79 | 1.76 | - | - | - | - |
| 天风证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 东方证券股份有限公司 | 821,573.98 | 9.08 | - | - | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证券股份有限公司 | 210,826.57 | 2.33 | - | - | - | - |
| 华金证券股份有限公司 | 2,768,311.91 | 30.58 | - | - | - | - |
| 渤海证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 广发证券股份有限公司 | 419,302.54 | 4.63 | - | - | - | - |
| 中国国际金融股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券股份有限公司 | 2,140,149.50 | 23.64 | - | - | - | - |
| 东北证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 国投证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 湘财证券责任有 | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|------------------|------------|------|---|---|---|---|
| 限公司 | | | | | | |
| 国泰君安证券股份 有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 方正证券股份有 限公司 | 478,275.71 | 5.28 | - | - | - | - |
| 长城证券股份有 限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 东方财富证券股 份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 汇丰前海证券有 限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中银国际证券股 份有限公司 | - | - | - | - | - | - |

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 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2022 年第 4 季度报告提示性公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 1 月 20 日 |
| 2 | 景顺长城量化小盘股票型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 1 月 20 日 |
| 3 | 关于旗下部分基金新增平安银行为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”、基金转换业务及参加申购、定期定额投资申购费率优惠的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 2 月 3 日 |
| 4 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 2 月 10 日 |
| 5 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 2 月 24 日 |
| 6 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 3 月 25 日 |
| 7 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2022 年年度报告提示性公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 3 月 28 日 |
| 8 | 景顺长城量化小盘股票型证券投资基金 2022 年年度报告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 3 月 28 日 |
| 9 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 4 月 8 日 |
| 10 | 景顺长城基金管理有限公司关于持续完善客户身份信息的提示 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 4 月 18 日 |
| 11 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2023 年第 1 季度报告提示性公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 4 月 21 日 |
| 12 | 景顺长城量化小盘股票型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 4 月 21 日 |
| 13 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 4 月 22 日 |

| | | | |
|----|--|--------------|-----------------|
| 14 | 关于旗下部分基金新增中国光大银行为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”、基金转换业务的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 4 月 28 日 |
| 15 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 5 月 6 日 |
| 16 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 5 月 13 日 |
| 17 | 景顺长城量化小盘股票型证券投资基金 2023 年第 1 号更新招募说明书 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 5 月 26 日 |
| 18 | 景顺长城量化小盘股票型证券投资基金基金产品资料概要更新 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 5 月 26 日 |
| 19 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增德邦证券为销售机构并开通基金定期定额投资业务的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 5 月 26 日 |
| 20 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 5 月 27 日 |
| 21 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 6 月 10 日 |
| 22 | 关于旗下部分基金新增杭州银行股份有限公司杭 e 家平台为销售平台并开通基金转换业务及参加申购费率优惠的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 6 月 16 日 |
| 23 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 6 月 17 日 |
| 24 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增开源证券为销售机构并开通基金定期定额投资业务、基金转换业务及参加申购、定期定额投资申购费率优惠的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 6 月 20 日 |
| 25 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 6 月 22 日 |
| 26 | 关于景顺长城量化小盘股票型证券投资基金暂停接受伍佰万元以上申购（含日常申购和定期定额投资）及转换转入业务的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 6 月 27 日 |
| 27 | 景顺长城量化小盘股票型证券投资基金分红公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 6 月 27 日 |
| 28 | 关于景顺长城量化小盘股票型证券投资基金恢复接受伍佰万元以上申购（含日常申购和定期定额投资）及转换转入业务的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 6 月 29 日 |
| 29 | 景顺长城基金管理有限公司 2022 年度环境信息披露报告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 6 月 30 日 |
| 30 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统 | 中国证监会指定报刊及 | 2023 年 7 月 1 日 |

| | | | |
|----|--|--------------|------------------|
| | 停机维护的公告 | 网站 | |
| 31 | 关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金调整持有停牌股票估值价格的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 7 月 1 日 |
| 32 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 7 月 8 日 |
| 33 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 7 月 15 日 |
| 34 | 景顺长城量化小盘股票型证券投资基金 2023 年第 2 季度报告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 7 月 21 日 |
| 35 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2023 年第 2 季度报告提示性公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 7 月 21 日 |
| 36 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金在腾安基金销售（深圳）有限公司开展赎回费率优惠活动的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 8 月 2 日 |
| 37 | 景顺长城量化小盘股票型证券投资基金基金产品资料概要更新 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 8 月 18 日 |
| 38 | 景顺长城量化小盘股票型证券投资基金 2023 年第 2 号更新招募说明书 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 8 月 18 日 |
| 39 | 景顺长城量化小盘股票型证券投资基金基金合同（更新） | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 8 月 18 日 |
| 40 | 景顺长城量化小盘股票型证券投资基金托管协议（更新） | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 8 月 18 日 |
| 41 | 景顺长城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 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 8 月 18 日 |
| 42 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2023 年中期报告提示性公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 8 月 30 日 |
| 43 | 景顺长城基金管理有限公司关于终止南京途牛基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 8 月 30 日 |
| 44 | 景顺长城量化小盘股票型证券投资基金 2023 年中期报告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 8 月 30 日 |
| 45 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 9 月 2 日 |
| 46 | 景顺长城基金管理有限公司关于终止凤凰金信（海口）基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 9 月 4 日 |
| 47 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 9 月 22 日 |
| 48 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 10 月 14 日 |
| 49 | 景顺长城量化小盘股票型证券投资基金 2023 年第 3 季度报告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 10 月 25 日 |

| | | | |
|----|---|--------------|------------------|
| 50 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2023 年第 3 季度报告提示性公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 10 月 25 日 |
| 51 | 景顺长城基金管理有限公司关于持续完善客户身份信息的提示 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 11 月 2 日 |
| 52 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 11 月 25 日 |
| 53 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 12 月 9 日 |
| 54 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 12 月 16 日 |
| 55 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 12 月 23 日 |
| 56 | 关于景顺长城量化小盘股票型证券投资基金暂停接受伍佰万元以上申购（含日常申购和定期定额投资）及转换转入业务的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 12 月 27 日 |
| 57 | 景顺长城量化小盘股票型证券投资基金分红公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 12 月 27 日 |
| 58 | 关于景顺长城量化小盘股票型证券投资基金恢复接受伍佰万元以上申购（含日常申购和定期定额投资）及转换转入业务的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 12 月 29 日 |

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|--|----------------|-------------------------|---------------|----------------|---------------|----------------|----------|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 (%) |
| 机构 | 1 | 20230526-20231231 | 0.00 | 376,538,426.01 | 22,733,134.86 | 353,805,291.15 | 32.56 |
| | 2 | 20230101-20230119 | 70,406,087.12 | 23,668,047.33 | 0.00 | 94,074,134.45 | 8.66 |
| | 3 | 20230131-20231231 | 0.00 | 376,402,379.21 | 0.00 | 376,402,379.21 | 34.64 |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| <p>本基金由于存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%的情况，可能会出现如下风险：</p> <p>1、大额申购风险 在出现投资者大额申购时，如本基金所投资的标的资产未及时准备，则可能降低基金净值涨幅。</p> <p>2、如面临大额赎回的情况，可能导致以下风险：</p> <p>（1）基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；</p> <p>（2）如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20%的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回，如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额</p> | | | | | | | |

赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；

(3) 基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；

(4) 因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，导致基金净值出现较大波动；

(5) 基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略；

(6) 大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。

本基金管理人将建立完善的风险管理机制，以有效防止和化解上述风险，最大限度地保护基金份额持有人的合法权益。投资者在投资本基金前，请认真阅读本风险提示及基金合同等信息披露文件，全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，获得基金投资收益，亦自行承担基金投资中出现的各类风险。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

为了更好地满足广大投资者的投资理财需求，降低投资者的理财成本，经与本基金的基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，景顺长城基金管理有限公司决定自 2023 年 8 月 22 日起，调低本基金的管理费率和托管费率并对基金合同有关条款进行修订。详情请参阅本基金管理人于 2023 年 8 月 18 日发布的《景顺长城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》。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予景顺长城量化小盘股票型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城量化小盘股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城量化小盘股票型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城量化小盘股票型证券投资基金托管协议》；
- 5、景顺长城基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程；
- 6、其他在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、定期报告及临时公告。

13.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

13.3 查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅。

景顺长城基金管理有限公司

2024 年 3 月 29 日