

# 安信量化优选股票型发起式证券投资基金 2019 年年度报告

2019 年 12 月 31 日

基金管理人：安信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2020 年 4 月 28 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 4 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。

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

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	1
1.1 重要提示 .....	1
1.2 目录 .....	2
<b>§ 2 基金简介</b> .....	4
2.1 基金基本情况 .....	4
2.2 基金产品说明 .....	4
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	5
2.4 信息披露方式 .....	错误!未定义书签。
2.5 其他相关资料 .....	错误!未定义书签。
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	5
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	5
3.2 基金净值表现 .....	7
3.3 其他指标 .....	9
3.4 过去三年基金的利润分配情况 .....	错误!未定义书签。
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	10
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 .....	13
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 .....	13
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明 ...	错误!未定义书签。
4.10 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 .....	13
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	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的真实、准确和完整发表意见 .....	14
<b>§ 6 审计报告</b> .....	14
6.1 审计报告基本信息 .....	错误!未定义书签。
6.2 审计报告的基本内容 .....	错误!未定义书签。
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	16
7.1 资产负债表 .....	16
7.2 利润表 .....	17
7.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	18
7.4 报表附注 .....	20
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	42

8.1 期末基金资产组合情况 .....	42
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	43
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 .....	43
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	51
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	错误!未定义书签。
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	错误!未定义书签。
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	错误!未定义书签。
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	错误!未定义书签。
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	84
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	错误!未定义书签。
8.12 投资组合报告附注 .....	84
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>86</b>
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 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	87
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>87</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>88</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	88
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 .....	88
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	88
11.4 基金投资策略的改变 .....	88
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	88
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 .....	错误!未定义书签。
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>90</b>
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 .....	91
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	92
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>92</b>
13.1 备查文件目录 .....	92
13.2 存放地点 .....	93
13.3 查阅方式 .....	93

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	安信量化优选股票型发起式证券投资基金	
基金简称	安信量化优选股票	
基金主代码	006346	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 9 月 3 日	
基金管理人	安信基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	25,452,629.33 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	安信量化优选股票 A	安信量化优选股票 C
下属分级基金的交易代码	006346	006347
报告期末下属分级基金的份 额总额	10,938,624.93 份	14,514,004.40 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金以数量化分析为基础，在充分控制基金财产风险和保证基金财产流动性的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金财产的长期稳健增值。
投资策略	本基金使用量化模型构建股票组合，主要基于对股票市场及上市公司相关数据的深度挖掘，在综合数据可获得性、建模复杂程度的基础上，对数据进行个性化的分析处理，形成了一套完善的选股体系，并据此构建股票组合。资产配置方面，通过对宏观经济周期、宏观政策导向、货币供应量、市场估值水平以及市场情绪等因素的分析，形成对大类资产收益率在不同市场周期的预测和判断，从而确定组合中股票、债券、货币市场工具和其他金融工具的投资比例，适度降低组合系统性风险。债券投资方面，采取稳健的投资管理方式，获得与风险相匹配的投资收益，以实现在一定程度上规避股票市场的系统性风险和保证基金资产的流动性。同时，本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。此外，本基金还将采用国债期货投资策略、资产支持证券投资策略、权证投资策略等，更好地实现本基金的投资目标。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×85%+中证综合债券指数收益率×15%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型

	基金与货币市场基金。
--	------------

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		安信基金管理有限责任公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	乔江晖	郭明
	联系电话	0755-82509999	010-66105799
	电子邮箱	service@essencefund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008-088-088	95588
传真		0755-82799292	010-66105798
注册地址		广东省深圳市福田区莲花街道益田路 6009 号新世界商务中心 36 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		广东省深圳市福田区莲花街道益田路 6009 号新世界商务中心 36 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		518026	100140
法定代表人		刘入领	陈四清

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.essencefund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	中国北京市东城区东长安街 1 号，东方广场安永大楼 16 层
注册登记机构	安信基金管理有限责任公司	广东省深圳市福田区莲花街道益田路 6009 号新世界商务中心 36 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	2019 年	2018 年 9 月 3 日（基金合同生效日） -2018 年 12 月 31 日
--------------------------	--------	--

	安信量化优选股票 A	安信量化优选股票 C	安信量化优选股票 A	安信量化优选股票 C
本期已实现收益	3,982,164.03	1,840,312.63	-165,712.21	-464.08
本期利润	4,425,783.56	2,270,131.82	-325,486.88	-878.18
加权平均基金份额本期利润	0.4011	0.2630	-0.0325	-0.0338
本期加权平均净值利润率	32.22%	20.55%	-3.31%	-3.44%
本期基金份额净值增长率	44.04%	43.72%	-3.25%	-3.38%
3.1.2 期末数据和指标	2019 年末		2018 年末	
期末可供分配利润	3,897,793.29	5,098,449.07	-325,784.92	-878.18
期末可供分配基金份额利润	0.3563	0.3513	-0.0325	-0.0338
期末基金资产净值	15,244,566.60	20,153,582.32	9,694,780.70	25,124.87
期末基金份额净值	1.3936	1.3886	0.9675	0.9662
3.1.3 累计期末指标	2019 年末		2018 年末	
基金份额累计净值增长率	39.36%	38.86%	-3.25%	-3.38%

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

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

3、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

### 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

安信量化优选股票 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	9.76%	0.85%	5.82%	0.79%	3.94%	0.06%
过去六个月	11.56%	1.04%	5.93%	0.92%	5.63%	0.12%
过去一年	44.04%	1.32%	23.28%	1.25%	20.76%	0.07%
自基金合同生效起至今	39.36%	1.18%	9.67%	1.29%	29.69%	-0.11%

安信量化优选股票 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	9.66%	0.85%	5.82%	0.79%	3.84%	0.06%
过去六个月	11.35%	1.04%	5.93%	0.92%	5.42%	0.12%
过去一年	43.72%	1.32%	23.28%	1.25%	20.44%	0.07%
自基金合同生效起至今	38.86%	1.18%	9.67%	1.29%	29.19%	-0.11%

注：根据《安信量化优选股票型发起式证券投资基金基金合同》的约定，本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率×85%+中证综合债券指数收益率×15%。中证 500 指数由中证指数有限公司编制并发布。该指数样本选自沪深两个证券市场，其成份股包含了 500 只沪深 300 指数成份股之外的 A 股市场中流动性好、代表性强的小市值股票，综合反映了沪深证券市场内小市值公司的整体情况；中证综合债券指数选样债券信用类别覆盖全面，期限构成宽泛。根据本基金的投资范



围和投资比例，选用上述业绩比较基准能够客观、合理地反映本基金的风险收益特征。根据本基金的投资范围和投资比例，选用上述业绩比较基准能够客观、合理地反映本基金的风险收益特征。由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合合同要求，基准指数每日按照 85%、15%的比例采取再平衡，再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

### 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

安信量化优选股票A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



安信量化优选股票C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



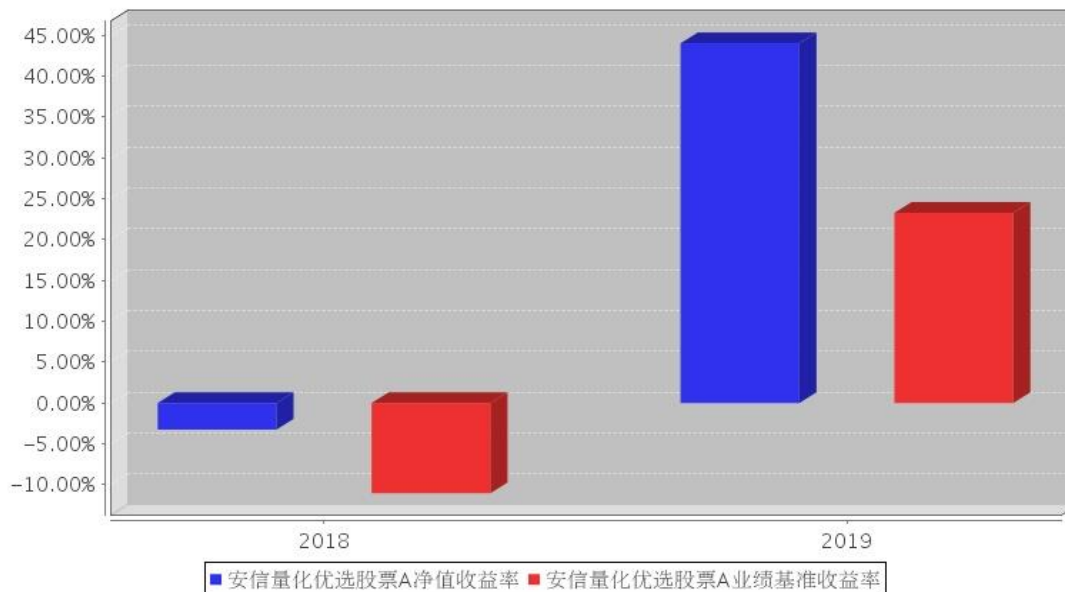
注：1、本基金基金合同生效日为 2018 年 9 月 3 日。

2、本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合

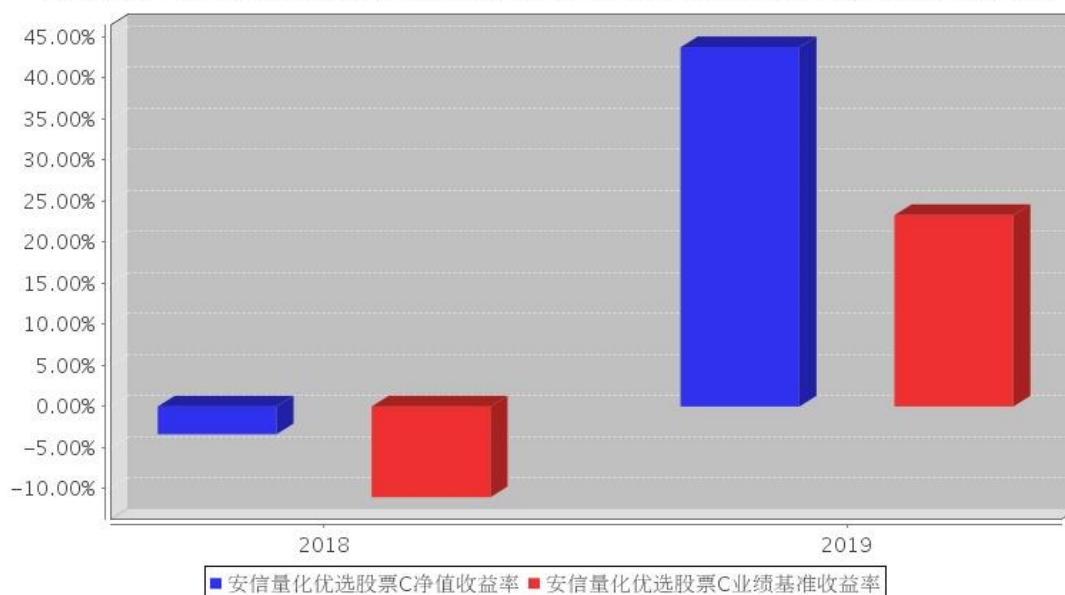
基金合同的约定。截至本报告期末，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

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

安信量化优选股票A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



安信量化优选股票C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金于 2018 年 9 月 3 日成立，截至本报告期末尚未进行利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

安信基金管理有限责任公司经中国证监会批准，成立于 2011 年 12 月，总部位于深圳，注册资本 5.0625 亿元人民币，股东及股权结构为：五矿资本控股有限公司持有 39.84%的股权，安信证券股份有限公司持有 33.95%的股权，佛山市顺德区新碧贸易有限公司持有 20.28%的股权，中广核财务有限责任公司持有 5.93%的股权。

截至 2019 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 48 只开放式基金具体如下：安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金、安信目标收益债券型证券投资基金、安信平稳增长混合型发起式证券投资基金、安信现金管理货币市场基金、安信宝利债券型证券投资基金（LOF）（原安信宝利分级债券型证券投资基金）、安信永利信用定期开放债券型证券投资基金、安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金、安信价值精选股票型证券投资基金、安信现金增利货币市场基金、安信消费医药主题股票型证券投资基金、安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金、安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金、安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金、安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金、安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金、安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金、安信新动力灵活配置混合型证券投资基金、安信新回报灵活配置混合型证券投资基金、安信新优选灵活配置混合型证券投资基金、安信新目标灵活配置混合型证券投资基金、安信新价值灵活配置混合型证券投资基金、安信新成长灵活配置混合型证券投资基金、安信尊享纯债债券型证券投资基金、安信永丰定期开放债券型证券投资基金、安信活期宝货币市场基金、安信新趋势灵活配置混合型证券投资基金、安信中国制造 2025 沪港深灵活配置混合型证券投资基金、安信合作创新主题沪港深灵活配置混合型证券投资基金、安信工业 4.0 主题沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金、安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金、安信永泰定期开放债券型发起式证券投资基金、安信尊享添益债券型证券投资基金、安信比较优势灵活配置混合型证券投资基金、安信永盛定期开放债券型发起式证券投资基金、安信永瑞定期开放债券型发起式证券投资基金、安信永鑫增强债券型证券投资基金（原安信永鑫定期开放债券型证券投资基金）、安信中证复兴发展 100 主题指数型证券投资基金、安信量化优选股票型发起式证券投资基金、安信恒利增强债券型证券投资基金、安信中证 500 指数增强型证券投资基金、安信优享纯债债券型证券投资基金、安信盈利驱动股票型证券投资基金、安信聚利增强债券型证券投资基金、安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金（原安信新起点灵活配置混合型证券投资基金）、安信鑫日享中短债债券型证券投资基金、安信核心竞争力灵活配置混合型证券投资基金、安信中短利

率债债券型证券投资基金（LOF）、安信中证深圳科技创新主题指数型证券投资基金（LOF）。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
龙川	本基金的基金经理，量化投资部总经理	2018年9月3日	-	17	龙川先生，统计学博士。历任 Susquehanna International Group（美国）量化投资经理、国泰君安证券资产管理有限公司量化投资部首席研究员、东方证券资产管理有限公司量化投资部总监。现任安信基金管理有限责任公司量化投资部总经理。曾任安信量化多因子灵活配置混合型证券投资基金、安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金、安信沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金的基金经理；现任安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金、安信中证复兴发展 100 主题指数型证券投资基金、安信量化优选股票型发起式证券投资基金的基金经理。
杨扬	本基金的基金经理	2018年11月27日	-	8	杨扬先生，清华大学工学硕士。历任东方证券股份有限公司资产管理业务总部研究助理，上海东方证券资产管理有限公司量化投资部研究员、投资助理，安信基金管理有限责任公司量化投资部投资经理助理、投资经理、基金经理助理。现任安信基金管理有限责任公司量化投资部基金经理。曾任安信量化多因子灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理。现任安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金、安信沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金、安信中证复兴发展 100 主题指数证券投资基金的基金经理助理；现任安信量化优选股票型发起式证券投资基金的基金经理。

注：1、基金经理的“任职日期”根据公司决定的公告（生效）日期填写；基金经理助理的“任职日期”根据公司决定确定的聘任日期填写。“离任日期”根据公司决定的公告（生效）日期填写。

2、证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

3、龙川先生与杨扬先生已于 2020 年 1 月 21 日离任本基金的基金经理。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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》、《证券投资基金销

售管理办法》、《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信息披露管理办法》等有关法律法规、监管部门的相关规定及基金合同的约定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人采用 T 值检验等统计方法，定期对旗下管理的所有基金和投资组合之间发生的同一交易日内、三个交易日内、五个交易日内的同向交易价差进行专项分析和检查。分析结果显示，本基金与本基金管理人旗下管理的所有其他基金和投资组合之间，不存在通过相同品种的同向交易进行投资组合间利益输送的行为。

#### 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》和公司制定的公平交易相关制度，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合，未出现违反公平交易制度的情况，亦未受到监管机构的相关调查。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本报告期内，本公司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未超过该证券当日成交量的 5%。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金作为量化股票型基金，坚持宽基选股，淡化择时。使用多因子模型综合考察股票的估值、成长、盈利等基本面因素、以及量价等技术面因素，力求为投资者获取长期稳健的超额收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金 A 类份额净值为 1.3936 元，本报告期基金份额净值增长率为 44.04%；截至本报告期末本基金 C 类基金份额净值为 1.3886 元，本报告期基金份额净值增长率为 43.72%；同期业绩比较基准收益率为 23.28%。

### 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 2020 年，宏观经济将延续之前的趋势，没有出现边际上的明显好转，整体的经济增速处于缓慢下滑阶段。从国际贸易角度看，中美贸易谈判仍处于良好的运行轨道之中，虽然有波折但依然在可控的范围内。从政策角度看，国内财政和货币政策同时发力，信贷资金倾向于小微企业和民营企业，一定程度上解决了实体融资难的问题。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人根据法律法规、监管要求和业务发展的实际需要，通过合规培训、梳理业务风险点、细化制度流程、对员工行为以及重点业务稽核检查等方式，保障了基金管理及公司业务的有效开展及合规运作。本基金管理人承诺将持续以风险控制为核心，坚持基金份额持有人利益优先的原则，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金资产安全、合规运作。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规、证监会的相关规定以及基金合同的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规及基金合同要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所定期对估值调整采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。

本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，设立估值委员会。估值委员会负责审定公司基金估值业务管理制度，建立健全估值决策体系，确定不同基金产品及投资品种的估值方法，保证基金估值业务准确真实地反映基金相关金融资产和金融负债的公允价值。估值委员会负责人由公司分管投资的公司领导担任，估值委员会成员由运营部、权益投资部、固定收益部、特定资产管理部、研究部、信用研究部和监察稽核部分别委派一名或多名代表组成，以上人员均具备必要的经验、专业胜任能力和相关工作经验。估值委员会各成员职责分工如下：权益投资部、固定收益部、特定资产管理部、研究部及信用研究部负责关注市场变化、证券发行机构重大事件等可能对估值产生重大影响的因素，向估值委员会提出合理的估值建议，确保估值的公允性；运营部负责日常估值业务的具体执行，及时准确完成基金估值，并负责和托管行沟通协调核对；监察稽核部负责定期或不定期对估值政策、程序及相关方法的一致性进行检查，确保估值政策和程序的一贯性。当估值委员会委员同时为基金经理时，涉及其相关持仓品种估值调整时采取回避机制，保持估值调整的客观性和独立性。本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

截至报告期末本基金管理人已签约的定价服务机构为中债金融估值中心有限公司和中证指数有限公司，由其按约定提供相关债券品种和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

根据相关法律法规规定和本基金合同的约定及实际运作情况，本基金本报告期末未进行利润分配。

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

本基金为发起式基金，且基金合同生效未满 3 年，故报告期不存在需要说明的情况。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期内，安信新量化优选股票型发起式证券投资基金的管理人—安信基金管理有限责任公司在安信新量化优选股票型发起式证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，安信新量化优选股票型发起式证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对安信基金管理有限责任公司编制和披露的安信量化优选股票型发起式证券投资基金 2019 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	安信量化优选股票型发起式证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了安信量化优选股票型发起式证券投资基金的财务报表，包括 2019 年 12 月 31 日的资产负债表，2019 年度的利润表、2019 年度所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的安信量化优选股票型发起式证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了安信量化优选股票型发起式证券投资基金 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于安信量化优选股票型发起式证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

强调事项	无。
其他事项	无。
其他信息	<p>安信量化优选股票型发起式证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估安信量化优选股票型发起式证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督安信量化优选股票型发起式证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对安信量化优选股票型发起式证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存</p>



	<p>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安信量化优选股票型发起式证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	吴翠蓉	高鹤
会计师事务所的地址	中国北京市东城区东长安街1号，东方广场安永大楼16层	
审计报告日期	2020年04月22日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：安信量化优选股票型发起式证券投资基金

报告截止日：2019年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	2,751,905.33	977,394.59
结算备付金		392,862.94	39,792.29
存出保证金		16,078.56	1,499.50
交易性金融资产	7.4.7.2	32,523,065.35	8,755,993.20
其中：股票投资		32,523,065.35	8,755,993.20
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	31,542.25
应收利息	7.4.7.5	786.42	526.91
应收股利		-	-
应收申购款		389.85	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		35,685,088.45	9,806,748.74
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>

		2019 年 12 月 31 日	2018 年 12 月 31 日
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	35,328.45
应付赎回款		3,821.16	-
应付管理人报酬		43,266.39	12,568.86
应付托管费		7,211.03	2,094.80
应付销售服务费		6,488.80	8.67
应付交易费用	7.4.7.7	206,146.80	16,842.39
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	20,005.35	20,000.00
负债合计		286,939.53	86,843.17
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.9	25,452,629.33	10,046,568.67
未分配利润	7.4.7.10	9,945,519.59	-326,663.10
所有者权益合计		35,398,148.92	9,719,905.57
负债和所有者权益总计		35,685,088.45	9,806,748.74

注：报告截止日 2019 年 12 月 31 日，基金份额总额 25,452,629.33 份，其中安信量化优选股票 A 基金份额总额为 10,938,624.93 份，基金份额净值 1.3936 元；安信量化优选股票 C 基金份额总额为 14,514,004.40 份，基金份额净值 1.3886 元。

## 7.2 利润表

会计主体：安信量化优选股票型发起式证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	2018 年 9 月 3 日（基金合 同生效日）至 2018 年 12 月 31 日
一、收入		8,165,157.73	-216,416.39
1. 利息收入		18,551.30	23,107.23
其中：存款利息收入	7.4.7.11	18,551.30	15,286.77
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		-	7,820.46

入			
证券出借利息收入			-
其他利息收入			-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		7,252,098.83	-79,334.85
其中：股票投资收益	7.4.7.12	6,922,398.86	-82,911.69
基金投资收益			-
债券投资收益	7.4.7.13		-
资产支持证券投资	7.4.7.14		-
收益			-
贵金属投资收益	7.4.7.15		-
衍生工具收益	7.4.7.16		-
股利收益	7.4.7.17	329,699.97	3,576.84
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	873,438.72	-160,188.77
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）			-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	21,068.88	-
减：二、费用		1,469,242.35	109,948.67
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	368,236.31	48,244.12
2. 托管费	7.4.10.2.2	61,372.67	8,040.67
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	43,449.54	33.20
4. 交易费用	7.4.7.20	974,531.83	33,532.68
5. 利息支出			-
其中：卖出回购金融资产支出			-
6. 税金及附加			-
7. 其他费用	7.4.7.21	21,652.00	20,098.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		6,695,915.38	-326,365.06
减：所得税费用			-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		6,695,915.38	-326,365.06

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：安信量化优选股票型发起式证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计

一、期初所有者权益(基金净值)	10,046,568.67	-326,663.10	9,719,905.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	6,695,915.38	6,695,915.38
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	15,406,060.66	3,576,267.31	18,982,327.97
其中：1. 基金申购款	20,913,136.72	5,035,396.83	25,948,533.55
2. 基金赎回款	-5,507,076.06	-1,459,129.52	-6,966,205.58
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	25,452,629.33	9,945,519.59	35,398,148.92
项目	上年度可比期间 2018年9月3日(基金合同生效日)至2018年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、基金合同生效日所有者权益(基金净值)	10,026,300.59	-	10,026,300.59
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-326,365.06	-326,365.06
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	20,268.08	-298.04	19,970.04
其中：1. 基金申购款	20,268.08	-298.04	19,970.04
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配	-	-	-

利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	10,046,568.67	-326,663.10	9,719,905.57

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>刘入领</u>	<u>范瑛</u>	<u>苗杨</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

安信量化优选股票型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）2018 年 7 月 13 日下发的证监许可[2018]1119 号文关于“准予安信量化优选股票型发起式证券投资基金注册的批复”的核准，由安信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《安信量化优选股票型发起式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。本基金募集期间为 2018 年 8 月 24 日至 2018 年 8 月 28 日，募集结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明(2018)验字 60962175\_H12 号验资报告。经向中国证监会备案，《安信量化优选股票型发起式证券投资基金基金合同》于 2018 年 9 月 3 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 10,026,300.59 份，其中认购资金利息折合 3.08 份基金份额。本基金的基金管理人为安信基金管理有限责任公司，注册登记机构为安信基金管理有限责任公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《安信量化优选股票型发起式证券投资基金基金合同》及《安信量化优选股票型发起式证券投资基金招募说明书》，安信量化优选股票型发起式证券投资基金根据认购/申购费用、赎回费用和销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用、赎回时收取赎回费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用、赎回时收取赎回费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。两类基金份额单独设置基金代码，并分别计算基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《安信量化优选股票型发起式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

股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券（含分离型可转换债券）、次级债、可交换债券、资产支持证券、银行存款、债券回购、权证、国债期货、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的比例为 80%-95%；每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的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%，前述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 500 指数收益率×85%+中证综合债券指数收益率×15%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度的经营成果和净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日至 12 月 31 日止。惟上年度会计期间为自 2018 年 9 月 3 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

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

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

#### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及贷款和应收款项。

本基金以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、结算备付金、买入返售金融资产和各类应收款项等。

#### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。

本基金持有的金融负债均划分为其他金融负债，主要包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

#### 初始确认

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，按照取得时的公允价值作为初始确认金额。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，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；应收款项及其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

#### 后续计量

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。在持有该类金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；应收款项及其他金融负债采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量，其摊销或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

#### 终止确认

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，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；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。

#### 金融资产转移

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。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

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

(1) 存在活跃市场的金融工具按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为



特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

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

(3) 如有确凿证据表明按上述估值原则仍不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能适当反映公允价值的价格估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金同时满足下列条件时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的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份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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股利收益。债券投资在持有期间应取得的按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除在适用情况下由债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利息收入。资产支持证券投资在持有期间应取得的按证券票面价值与票面利率计算的金额扣除在适用情况下由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利息收入。

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。

其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### **7.4.4.10 费用的确认和计量**

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

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

其他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。

其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。

#### **7.4.4.11 基金的收益分配政策**

同一类别的每一基金份额享有同等分配权；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利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；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；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所有者权益转出。

#### **7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计**

本基金本报告期无需要说明的其他重要的会计政策和会计估计事项。

### **7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

#### **7.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

#### **7.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

### 7.4.6 税项

#### 7.4.6.1 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1%，由出让方缴纳。

#### 7.4.6.2 企业所得税

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

#### 7.4.6.3 增值税及附加

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》、财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、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 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定及其他相关法规：

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，自 2018 年 1 月 1 日起，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（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税。

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

#### 7.4.6.4 个人所得税

个人所得税税率为 20%。基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利、债券的利息及储蓄利息时代扣代缴个人所得税。暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

基金从上市公司分配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，股息红利所得暂免征收个人所得税。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
活期存款	2,751,905.33	977,394.59
定期存款	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计	2,751,905.33	977,394.59

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	31,809,815.40	32,523,065.35	713,249.95
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	31,809,815.40	32,523,065.35	713,249.95
项目	上年度末 2018 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	8,916,181.97	8,755,993.20	-160,188.77
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	8,916,181.97	8,755,993.20	-160,188.77

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末无买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
应收活期存款利息	584.02	506.56
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	194.48	19.69
应收债券利息	-	-
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	7.92	0.66
合计	786.42	526.91

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
交易所市场应付交易费用	206,146.80	16,842.39
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	206,146.80	16,842.39

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	5.35	-
应付证券出借违约金	-	-
应付审计费	20,000.00	20,000.00
合计	20,005.35	20,000.00

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

##### 安信量化优选股票 A

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	10,020,565.62	10,020,565.62
本期申购	2,683,474.99	2,683,474.99
本期赎回（以“-”号填列）	-1,765,415.68	-1,765,415.68
本期末	10,938,624.93	10,938,624.93

##### 安信量化优选股票 C

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	26,003.05	26,003.05
本期申购	18,229,661.73	18,229,661.73
本期赎回（以“-”号填列）	-3,741,660.38	-3,741,660.38
本期末	14,514,004.40	14,514,004.40

注：申购份额含转换入份额；赎回份额含转换出份额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

安信量化优选股票 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-166,048.81	-159,736.11	-325,784.92
本期利润	3,982,164.03	443,619.53	4,425,783.56
本期基金份额 交易产生的变 动数	81,678.07	124,264.96	205,943.03
其中：基金申 购款	538,668.50	181,577.31	720,245.81
基金赎 回款	-456,990.43	-57,312.35	-514,302.78
本期已分配利 润	-	-	-
本期末	3,897,793.29	408,148.38	4,305,941.67

安信量化优选股票 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-464.08	-414.10	-878.18
本期利润	1,840,312.63	429,819.19	2,270,131.82
本期基金份额交易产生的变动数	3,258,600.52	111,723.76	3,370,324.28
其中：基金申购款	3,955,657.09	359,493.93	4,315,151.02
基金赎回款	-697,056.57	-247,770.17	-944,826.74
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,098,449.07	541,128.85	5,639,577.92

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年9月3日（基金合同生效日）至2018年12月31日
活期存款利息收入	13,415.41	15,114.28
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	5,000.65	168.15
其他	135.24	4.34
合计	18,551.30	15,286.77

#### 7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年9月3日（基金合同生效日）至2018年12月31日
卖出股票成交总额	369,967,742.01	9,996,660.70
减：卖出股票成本总额	363,045,343.15	10,079,572.39
买卖股票差价收入	6,922,398.86	-82,911.69

#### 7.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无债券投资收益。

#### 7.4.7.14 资产支持证券投资收益

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。

**7.4.7.15 贵金属投资收益**

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

**7.4.7.16 衍生工具收益**

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益。

**7.4.7.17 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年9月3日(基金合同生效日) 至2018年12月31日
股票投资产生的股利收益	329,699.97	3,576.84
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	329,699.97	3,576.84

**7.4.7.18 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至2019年 12月31日	上年度可比期间 2018年9月3日(基金合同生效日) 至2018年12月31日
1. 交易性金融资产	873,438.72	-160,188.77
股票投资	873,438.72	-160,188.77
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	873,438.72	-160,188.77

**7.4.7.19 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月 31日	上年度可比期间 2018年9月3日(基金合同生效日) 至2018年12月31日
基金赎回费收入	20,861.47	-
基金转换费收入	207.41	-



合计	21,068.88	-
----	-----------	---

#### 7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月 31日	上年度可比期间 2018年9月3日（基金合同生效日）至 2018年12月31日
交易所市场交易费用	974,531.83	33,532.68
银行间市场交易费用	-	-
合计	974,531.83	33,532.68

#### 7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月 31日	上年度可比期间 2018年9月3日（基金合同生效日）至 2018年12月31日
审计费用	20,000.00	20,000.00
信息披露费	-	-
证券出借违约金	-	-
银行汇划费用	1,252.00	98.00
其他	400.00	-
合计	21,652.00	20,098.00

#### 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，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要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
安信基金管理有限责任公司（以下简称“安信基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（以下简称“工商银行”）	基金托管人、基金销售机构
安信证券股份有限公司（以下简称“安信证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
五矿资本控股有限公司	基金管理人的股东
佛山市顺德区新碧贸易有限公司	基金管理人的股东
中广核财务有限责任公司	基金管理人的股东
安信乾盛财富管理（深圳）有限公司	基金管理人的子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

#### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金本期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

### 7.4.10.2 关联方报酬

#### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年9月3日（基金合同生效日）至2018年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	368,236.31	48,244.12
其中：支付销售机构的客户维护费	5,510.07	28.72

注：基金管理费每日计提，按月支付。本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年9月3日（基金合同生效日）至2018年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	61,372.67	8,040.67

注：基金托管费每日计提，按月支付。本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率

计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	安信量化优选股票 A	安信量化优选股票 C	合计
安信基金	-	41,297.75	41,297.75
安信证券	-	384.78	384.78
合计	-	41,682.53	41,682.53
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2018 年 9 月 3 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	安信量化优选股票 A	安信量化优选股票 C	合计
安信证券	-	31.94	31.94
合计	-	31.94	31.94

注：基金销售服务费每日计提，按月支付。本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%。本基金销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.40% 年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.40\% / \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

#### 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

本基金于本期及上年度可比期间均无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。

##### 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

本基金于本期及上年度可比期间均无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。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月 31日	本期 2019年1月1日至2019年12 月31日
	安信量化优选股票 A	安信量化优选股票 C
期初持有的基金份额	10,000,000.00	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	10,000,000.00	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	39.29%	-
项目	上年度可比期间 2018年9月3日至2018年12月 31日	上年度可比期间 2018年9月3日至2018年12 月31日
	安信量化优选股票 A	安信量化优选股票 C
基金合同生效日（2018年9月3日）持有的基金份额	10,000,000.00	-
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-

减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	10,000,000.00	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	99.54%	-

注：本基金管理人运用固有资金投资本基金所适用的费率/用与本基金法律文件的规定一致。

#### 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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本期末及上年度可比期间未投资本基金。

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年12月31日		上年度可比期间 2018年9月3日（基金合同生效日）至2018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
工商银行	2,751,905.33	13,415.41	977,394.59	15,114.28

注：本基金的银行存款由基金托管人工商银行保管，按约定利率计息。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 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需说明的其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本期末未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末(2019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	可流通日	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
002973	侨银环保	2019年12月27日	2020年1月6日	新股未上市	5.74	5.74	950	5,453.00	5,453.00	-

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	------	------	------	--------	------	--------	-----------	--------	--------	----

002115	三维通信	2019年 12月19 日	重大事项	8.89	2020 年1月 3日	9.08	1,900	15,641.86	16,891.00	-
--------	------	---------------------	------	------	-------------------	------	-------	-----------	-----------	---

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无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，无抵押债券。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额，无抵押债券。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金于本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

本基金管理人坚持“风险管理创造价值”、“风险管理人人有责”、“合规风险零容忍”的理念，将风险管理融入到公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的控制。本基金管理人为全面、深入控制风险，建立了自下而上的三层风险管理体系。在业务操作层面由公司各部门和各级业务岗位进行业务一线风险的自控和互控。经理层下设的风险控制委员会、投资决策委员会等专业委员会和监察稽核部、风险管理部组成公司风险管理的第二层防线，负责组织和协调公司内部的风险管理工作，查找、评估业务中的风险隐患，提出处理意见并监督执行。本基金管理人在董事会下设立合规与风险管理委员会、审计委员会和督察长作为风险管理的第三层防线，负责制定公司风险管理的框架、监督风险管理的执行情况并督促公司保护持有人的合法权益。

本基金主要的投资工具包括股票投资、债券投资等金融工具，在日常经营活动中面临信用风险、流动性风险及市场风险等相关风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡。

本基金管理人通过定性和定量两种方式对本基金投资的金融工具进行风险管理。一方面从定性的角度出发，对本基金存在的风险、风险的严重程度及风险发生的可能性进行评估、分析和宏观控制；另一方面从定量分析的角度出发，通过金融建模和特定风险量化指标计算，在日常工作中实时地对各种量化风险进行跟踪、检查和预警，并通过相应决策将风险控制在可承受的范围内。

#### 7.4.13.2 信用风险

在基金投资过程中，信用风险主要是指因债券交易对手未履行合约责任，或者基金所投资债券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金管理人建立了严格的债券备选池制度以有效地控制信用风险，对债券发行人自身偿债能力及增信条款进行了充分的考虑并同时采取分散化投资方式防范信用风险。

本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场通过对交易对手的资信情况进行充分审慎的评估，同时对证券交割方式进行限制以控制交易对手的违约风险。

截至 2019 年 12 月 31 日，本基金未持有信用类债券（2018 年 12 月 31 日：无）。

#### 7.4.13.3 流动性风险

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

##### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注 7.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合约约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的现金流量和投资品种的公允价值受市场利率变动而发生波动的风险。银行存款、结算备付金及债券投资等品种的公允价值均面临在市场利率上升时出现下降的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，采用久期、凸度、VaR（在险价值）等量化风险指标评估基金的利率风险，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,751,905.33	-	-	-	2,751,905.33
结算备付金	392,862.94	-	-	-	392,862.94
存出保证金	16,078.56	-	-	-	16,078.56
交易性金融资产	-	-	-	32,523,065.35	32,523,065.35
应收利息	-	-	-	786.42	786.42
应收申购款	-	-	-	389.85	389.85
资产总计	3,160,846.83	-	-	32,524,241.62	35,685,088.45
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,821.16	3,821.16
应付管理人报酬	-	-	-	43,266.39	43,266.39
应付托管费	-	-	-	7,211.03	7,211.03
应付销售服务费	-	-	-	6,488.80	6,488.80
应付交易费用	-	-	-	206,146.80	206,146.80
其他负债	-	-	-	20,005.35	20,005.35
负债总计	-	-	-	286,939.53	286,939.53
利率敏感度缺口	3,160,846.83	-	-	32,237,302.09	35,398,148.92
上年度末 2018年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	977,394.59	-	-	-	977,394.59
结算备付金	39,792.29	-	-	-	39,792.29
存出保证金	1,499.50	-	-	-	1,499.50
交易性金融资产	-	-	-	8,755,993.20	8,755,993.20
应收利息	-	-	-	526.91	526.91



应收证券清算款	-	-	-	31,542.25	31,542.25
资产总计	1,018,686.38	-	-	8,788,062.36	9,806,748.74
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	12,568.86	12,568.86
应付托管费	-	-	-	2,094.80	2,094.80
应付证券清算款	-	-	-	35,328.45	35,328.45
应付销售服务费	-	-	-	8.67	8.67
应付交易费用	-	-	-	16,842.39	16,842.39
其他负债	-	-	-	20,000.00	20,000.00
负债总计	-	-	-	86,843.17	86,843.17
利率敏感度缺口	1,018,686.38	-	-	8,701,219.19	9,719,905.57

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金于 2019 年 12 月 31 日未持有交易性债券投资，因此当利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动对年末基金资产净值无重大影响。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有的金融工具均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金股票投资占基金资产的比例为 80%-95%；每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的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%，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR（在险价值）等量化指标评估本基金潜在的价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日		上年度末 2018 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	32,523,065.35	91.88	8,755,993.20	90.08
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	32,523,065.35	91.88	8,755,993.20	90.08

#### 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 (2019 年 12 月 31 日)	上年度末 (2018 年 12 月 31 日)
	1. 沪深 300 指数上升 5%	1,525,435.95	498,405.72
	2. 沪深 300 指数下降 5%	-1,525,435.95	-498,405.72

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.14.1 承诺事项

截至资产负债表日, 本基金无需要说明的承诺事项。

##### 7.4.14.2 其他事项

###### (1) 公允价值

管理层已经评估了银行存款、结算备付金、买入返售金融资产、其他应收款项类投资以及其他金融负债因剩余期限不长, 公允价值与账面价值相若。

###### 各层次金融工具公允价值

于 2019 年 12 月 31 日, 本基金持有的交易性金融资产中划分为第一层级的余额为人民币 32,500,721.35 元, 划分为第二层级的余额为人民币 22,344.00 元, 无划分为第三层级余额 (于 2018 年 12 月 31 日, 本基金持有的交易性金融资产中划分为第一层级的余额为人民币 8,755,993.20 元, 无划分为第二层级及第三层级余额)。

### 公允价值所属层级间重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间或限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中所采用输入值的可观察性和重要性，确定相关股票公允价值应属第二层次或第三层次。

对于证券交易所上市的可转换、可交换债券，若出现交易不活跃的情况，本基金不会于交易不活跃期间将债券的公允价值列入第一层次；根据估值调整中所采用输入值的可观察性和重要性，确定相关债券公允价值应属第二层次或第三层次。

### 第三层级公允价值期初金额和本期变动金额

本基金于本报告期初未持有公允价值归属于第三层次的金融工具，本基金本报告期未发生第三层次公允价值转入转出情况。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

### 7.4.14.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2020 年 4 月 22 日经本基金的基金管理人批准。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	32,523,065.35	91.14
	其中：股票	32,523,065.35	91.14
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	3,144,768.27	8.81
8	其他各项资产	17,254.83	0.05
9	合计	35,685,088.45	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	1,318,112.50	3.72
B	采矿业	853,554.00	2.41
C	制造业	20,593,845.89	58.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	693,731.00	1.96
E	建筑业	246,795.00	0.70
F	批发和零售业	1,380,679.00	3.90
G	交通运输、仓储和邮政业	173,885.00	0.49
H	住宿和餐饮业	26,883.00	0.08
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,806,762.00	7.93
J	金融业	255,256.00	0.72
K	房地产业	1,938,637.96	5.48
L	租赁和商务服务业	35,550.00	0.10
M	科学研究和技术服务业	732,664.00	2.07
N	水利、环境和公共设施管理业	442,391.00	1.25
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	322,430.00	0.91
Q	卫生和社会工作	36,470.00	0.10
R	文化、体育和娱乐业	629,263.00	1.78
S	综合	36,156.00	0.10
	合计	32,523,065.35	91.88

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000913	钱江摩托	29,900	329,199.00	0.93
2	300440	运达科技	40,600	327,642.00	0.93
3	600532	宏达矿业	86,800	327,236.00	0.92
4	000573	粤宏远A	105,800	326,922.00	0.92

5	300251	光线传媒	27,700	326,860.00	0.92
6	002248	华东数控	41,100	325,923.00	0.92
7	000006	深振业 A	60,800	325,888.00	0.92
8	000708	中信特钢	14,200	325,606.00	0.92
9	002457	青龙管业	40,100	325,211.00	0.92
10	600693	东百集团	61,700	322,691.00	0.91
11	600135	乐凯胶片	45,200	321,372.00	0.91
12	300719	安达维尔	27,400	321,128.00	0.91
13	600727	鲁北化工	45,100	319,759.00	0.90
14	002379	宏创控股	89,000	319,510.00	0.90
15	300043	星辉娱乐	62,100	318,573.00	0.90
16	603926	铁流股份	26,400	315,480.00	0.89
17	601918	新集能源	94,800	307,152.00	0.87
18	300498	温氏股份	9,100	305,760.00	0.86
19	000736	中交地产	42,600	303,312.00	0.86
20	002015	协鑫能科	55,600	293,012.00	0.83
21	603033	三维股份	15,100	280,105.00	0.79
22	000534	万泽股份	29,300	271,904.00	0.77
23	600855	航天长峰	22,100	271,609.00	0.77
24	000973	佛塑科技	58,200	270,048.00	0.76
25	002782	可立克	25,100	266,311.00	0.75
26	002105	信隆健康	44,800	264,320.00	0.75
27	000779	甘咨询	25,800	264,192.00	0.75
28	300491	通合科技	20,200	262,802.00	0.74
29	300523	辰安科技	5,850	262,431.00	0.74
30	300552	万集科技	3,100	261,640.00	0.74
31	600984	建设机械	24,600	254,118.00	0.72
32	600486	扬农化工	3,700	253,931.00	0.72
33	603315	福鞍股份	20,500	249,075.00	0.70
34	600267	海正药业	25,100	248,741.00	0.70
35	603360	百傲化学	7,100	248,287.00	0.70
36	600731	湖南海利	34,200	246,924.00	0.70
37	002458	益生股份	8,660	245,511.00	0.69
38	603458	勘设股份	12,800	244,352.00	0.69
39	002111	威海广泰	15,600	243,984.00	0.69
40	601058	赛轮轮胎	54,500	243,615.00	0.69
41	600510	黑牡丹	36,300	243,210.00	0.69
42	002024	苏宁易购	24,000	242,640.00	0.69
43	603966	法兰泰克	23,500	242,520.00	0.69
44	300205	天喻信息	21,900	240,024.00	0.68
45	002452	长高集团	49,700	237,566.00	0.67
46	002161	远望谷	25,000	237,000.00	0.67

47	300693	盛弘股份	16,400	235,012.00	0.66
48	603012	创力集团	25,800	230,136.00	0.65
49	300092	科新机电	31,100	226,719.00	0.64
50	000751	锌业股份	69,800	225,454.00	0.64
51	603861	白云电器	25,800	225,234.00	0.64
52	300543	朗科智能	9,700	224,943.00	0.64
53	603977	国泰集团	27,200	223,312.00	0.63
54	600466	蓝光发展	30,200	222,574.00	0.63
55	300690	双一科技	8,700	219,849.00	0.62
56	002234	民和股份	6,900	219,489.00	0.62
57	600846	同济科技	23,500	218,785.00	0.62
58	000838	财信发展	68,000	218,280.00	0.62
59	603757	大元泵业	14,000	216,860.00	0.61
60	002869	金溢科技	3,300	215,589.00	0.61
61	000966	长源电力	46,000	213,900.00	0.60
62	000757	浩物股份	46,200	212,982.00	0.60
63	002746	仙坛股份	13,650	212,530.50	0.60
64	300453	三鑫医疗	27,800	209,890.00	0.59
65	603208	江山欧派	4,100	208,936.00	0.59
66	002144	宏达高科	20,900	208,791.00	0.59
67	000576	广东甘化	27,400	208,514.00	0.59
68	300497	富祥股份	11,000	207,570.00	0.59
69	002845	同兴达	10,500	206,850.00	0.58
70	300417	南华仪器	4,900	206,535.00	0.58
71	000802	北京文化	21,900	203,451.00	0.57
72	002182	云海金属	21,900	202,575.00	0.57
73	002755	奥赛康	12,500	202,000.00	0.57
74	300692	中环环保	16,000	201,600.00	0.57
75	002788	鹭燕医药	24,700	201,305.00	0.57
76	603058	永吉股份	27,100	201,082.00	0.57
77	002895	川恒股份	16,100	199,318.00	0.56
78	603609	禾丰牧业	16,800	198,744.00	0.56
79	603013	亚普股份	12,900	198,144.00	0.56
80	300500	启迪设计	13,100	197,417.00	0.56
81	002124	天邦股份	15,700	197,035.00	0.56
82	300014	亿纬锂能	3,900	195,624.00	0.55
83	300487	蓝晓科技	5,300	193,450.00	0.55
84	300599	雄塑科技	18,200	190,736.00	0.54
85	603036	如通股份	17,800	190,638.00	0.54
86	002611	东方精工	44,800	190,400.00	0.54
87	603238	诺邦股份	10,900	189,333.00	0.53
88	002595	豪迈科技	10,000	189,000.00	0.53

89	603968	醋化股份	12,800	188,928.00	0.53
90	600866	星湖科技	42,500	188,700.00	0.53
91	603559	中通国脉	10,600	188,574.00	0.53
92	300559	佳发教育	6,400	187,520.00	0.53
93	300593	新雷能	10,300	187,048.00	0.53
94	300231	银信科技	22,400	187,040.00	0.53
95	300419	浩丰科技	30,300	186,042.00	0.53
96	600643	爱建集团	19,100	183,360.00	0.52
97	600713	南京医药	39,000	182,520.00	0.52
98	603136	天目湖	6,800	181,016.00	0.51
99	300286	安科瑞	15,400	178,024.00	0.50
100	300695	兆丰股份	2,900	173,739.00	0.49
101	600097	开创国际	12,800	126,464.00	0.36
102	002123	梦网集团	6,000	114,780.00	0.32
103	002916	深南电路	800	113,680.00	0.32
104	000403	双林生物	3,500	113,050.00	0.32
105	002607	中公教育	6,200	110,856.00	0.31
106	603577	汇金通	10,400	110,344.00	0.31
107	603877	太平鸟	7,200	109,944.00	0.31
108	002282	博深股份	13,000	108,940.00	0.31
109	300360	炬华科技	8,600	108,790.00	0.31
110	002609	捷顺科技	12,600	108,234.00	0.31
111	600961	株冶集团	13,000	108,030.00	0.31
112	603656	泰禾光电	7,200	107,856.00	0.30
113	000606	顺利办	19,400	107,670.00	0.30
114	300292	吴通控股	21,300	107,565.00	0.30
115	603668	天马科技	13,000	107,380.00	0.30
116	002686	亿利达	17,000	107,100.00	0.30
117	600661	昂立教育	6,200	106,454.00	0.30
118	300602	飞荣达	2,500	106,000.00	0.30
119	600796	钱江生化	19,400	105,148.00	0.30
120	002621	美吉姆	9,600	105,120.00	0.30
121	603737	三棵树	1,300	104,845.00	0.30
122	603160	汇顶科技	500	103,150.00	0.29
123	601677	明泰铝业	5,568	64,199.04	0.18
124	600728	佳都科技	6,800	63,784.00	0.18
125	300062	中能电气	11,700	63,414.00	0.18
126	600720	祁连山	4,600	57,730.00	0.16
127	600449	宁夏建材	5,100	56,916.00	0.16
128	603878	武进不锈	4,900	56,105.00	0.16
129	000885	城发环境	5,100	56,049.00	0.16
130	600792	云煤能源	15,900	55,809.00	0.16

131	603916	苏博特	3,300	55,704.00	0.16
132	002860	星帅尔	2,400	55,512.00	0.16
133	002128	露天煤业	6,400	55,424.00	0.16
134	002734	利民股份	4,000	55,360.00	0.16
135	300569	天能重工	3,700	55,204.00	0.16
136	300371	汇中股份	4,100	55,186.00	0.16
137	002028	思源电气	4,000	55,080.00	0.16
138	603886	元祖股份	3,100	54,901.00	0.16
139	300235	方直科技	4,000	54,880.00	0.16
140	002928	华夏航空	4,500	54,810.00	0.15
141	000529	广弘控股	8,000	54,800.00	0.15
142	000655	金岭矿业	9,900	54,747.00	0.15
143	300130	新国都	3,100	54,653.00	0.15
144	002587	奥拓电子	7,000	54,600.00	0.15
145	603985	恒润股份	3,500	54,600.00	0.15
146	300129	泰胜风能	11,200	54,432.00	0.15
147	002016	世荣兆业	6,256	54,176.96	0.15
148	002731	萃华珠宝	6,960	53,940.00	0.15
149	300761	立华股份	900	53,460.00	0.15
150	002299	圣农发展	2,200	52,976.00	0.15
151	000042	中洲控股	4,800	52,128.00	0.15
152	002199	东晶电子	5,600	51,800.00	0.15
153	300209	天泽信息	3,600	51,372.00	0.15
154	300702	天宇股份	1,000	50,120.00	0.14
155	000672	上峰水泥	2,600	47,554.00	0.13
156	002360	同德化工	8,400	45,276.00	0.13
157	603606	东方电缆	4,100	45,018.00	0.13
158	000798	中水渔业	7,300	44,895.00	0.13
159	600382	广东明珠	6,400	44,736.00	0.13
160	002884	凌霄泵业	2,960	44,696.00	0.13
161	002873	新天药业	2,650	44,679.00	0.13
162	300703	创源文化	3,700	44,474.00	0.13
163	002039	黔源电力	3,000	43,800.00	0.12
164	603819	神力股份	3,140	43,677.40	0.12
165	300393	中来股份	3,000	43,470.00	0.12
166	300432	富临精工	3,200	39,648.00	0.11
167	002110	三钢闽光	4,000	37,440.00	0.11
168	000933	神火股份	6,800	37,264.00	0.11
169	603008	喜临门	2,400	37,128.00	0.10
170	002909	集泰股份	3,200	36,800.00	0.10
171	600326	西藏天路	5,000	36,650.00	0.10
172	600987	航民股份	5,787	36,631.71	0.10



173	300422	博世科	3,500	36,610.00	0.10
174	002130	沃尔核材	7,400	36,556.00	0.10
175	002524	光正集团	3,500	36,470.00	0.10
176	600778	友好集团	6,700	36,381.00	0.10
177	002518	科士达	3,400	36,278.00	0.10
178	000952	广济药业	3,800	36,214.00	0.10
179	002632	道明光学	4,900	36,211.00	0.10
180	000985	大庆华科	2,200	36,168.00	0.10
181	600784	鲁银投资	6,900	36,156.00	0.10
182	002541	鸿路钢构	3,400	36,006.00	0.10
183	000993	闽东电力	4,900	35,966.00	0.10
184	002660	茂硕电源	4,100	35,957.00	0.10
185	001896	豫能控股	10,100	35,956.00	0.10
186	300433	蓝思科技	2,600	35,932.00	0.10
187	603165	荣晟环保	2,120	35,870.40	0.10
188	002279	久其软件	5,900	35,813.00	0.10
189	000537	广宇发展	4,600	35,742.00	0.10
190	000882	华联股份	15,800	35,550.00	0.10
191	300306	远方信息	2,900	35,148.00	0.10
192	603890	春秋电子	3,300	34,848.00	0.10
193	002512	达华智能	5,400	34,830.00	0.10
194	000622	恒立实业	7,300	34,821.00	0.10
195	002326	永太科技	3,500	34,650.00	0.10
196	300087	荃银高科	3,000	30,390.00	0.09
197	603444	吉比特	100	29,849.00	0.08
198	002866	传艺科技	2,100	29,589.00	0.08
199	000518	四环生物	8,100	29,403.00	0.08
200	002475	立讯精密	800	29,200.00	0.08
201	603679	华体科技	700	28,840.00	0.08
202	000877	天山股份	2,400	28,440.00	0.08
203	300630	普利制药	500	28,320.00	0.08
204	600774	汉商集团	2,500	27,900.00	0.08
205	002367	康力电梯	3,500	27,825.00	0.08
206	600745	闻泰科技	300	27,750.00	0.08
207	300118	东方日升	2,000	27,700.00	0.08
208	600988	赤峰黄金	5,500	27,665.00	0.08
209	603838	四通股份	3,300	27,654.00	0.08
210	002592	八菱科技	2,000	27,560.00	0.08
211	300512	中亚股份	2,400	27,552.00	0.08
212	002146	荣盛发展	2,800	27,524.00	0.08
213	300571	平治信息	500	27,440.00	0.08
214	002575	群兴玩具	3,900	27,417.00	0.08

215	002853	皮阿诺	1,500	27,390.00	0.08
216	002554	惠博普	9,000	27,360.00	0.08
217	600346	恒力石化	1,700	27,336.00	0.08
218	603043	广州酒家	900	27,333.00	0.08
219	601012	隆基股份	1,100	27,313.00	0.08
220	600064	南京高科	2,800	27,300.00	0.08
221	300181	佐力药业	5,400	27,270.00	0.08
222	000069	华侨城A	3,500	27,265.00	0.08
223	300660	江苏雷利	1,700	27,251.00	0.08
224	600262	北方股份	1,500	27,225.00	0.08
225	000719	中原传媒	3,800	27,208.00	0.08
226	300737	科顺股份	2,400	27,168.00	0.08
227	002362	汉王科技	1,700	27,166.00	0.08
228	002221	东华能源	3,500	27,160.00	0.08
229	002498	汉缆股份	9,000	27,090.00	0.08
230	002858	力盛赛车	1,800	27,090.00	0.08
231	300697	电工合金	1,800	27,090.00	0.08
232	600551	时代出版	3,300	27,060.00	0.08
233	000780	平庄能源	9,000	27,000.00	0.08
234	601225	陕西煤业	3,000	26,970.00	0.08
235	300253	卫宁健康	1,800	26,964.00	0.08
236	002555	三七互娱	1,000	26,930.00	0.08
237	601007	金陵饭店	2,900	26,883.00	0.08
238	000548	湖南投资	6,400	26,816.00	0.08
239	601997	贵阳银行	2,800	26,768.00	0.08
240	603663	三祥新材	2,000	26,760.00	0.08
241	000019	深粮控股	4,400	26,752.00	0.08
242	603818	曲美家居	3,200	26,752.00	0.08
243	300359	全通教育	4,700	26,743.00	0.08
244	300712	永福股份	2,300	26,703.00	0.08
245	300560	中富通	1,700	26,690.00	0.08
246	002651	利君股份	5,500	26,675.00	0.08
247	002714	牧原股份	300	26,637.00	0.08
248	600343	航天动力	2,900	26,535.00	0.07
249	002527	新时达	5,100	26,520.00	0.07
250	600681	百川能源	3,900	26,520.00	0.07
251	300357	我武生物	600	26,490.00	0.07
252	600367	红星发展	3,500	26,460.00	0.07
253	002339	积成电子	4,100	26,404.00	0.07
254	600444	国机通用	2,500	26,375.00	0.07
255	002925	盈趣科技	600	26,370.00	0.07
256	002265	西仪股份	3,000	26,310.00	0.07

257	002415	海康威视	800	26,192.00	0.07
258	002114	罗平锌电	3,500	26,075.00	0.07
259	603365	水星家纺	1,700	26,044.00	0.07
260	600779	水井坊	500	25,875.00	0.07
261	300659	中孚信息	400	25,588.00	0.07
262	002100	天康生物	1,500	19,170.00	0.05
263	002487	大金重工	3,500	19,040.00	0.05
264	000565	渝三峡A	3,500	18,865.00	0.05
265	002649	博彦科技	1,900	18,848.00	0.05
266	600352	浙江龙盛	1,300	18,811.00	0.05
267	600750	江中药业	1,500	18,795.00	0.05
268	603801	志邦家居	806	18,771.74	0.05
269	300438	鹏辉能源	700	18,760.00	0.05
270	000401	冀东水泥	1,100	18,711.00	0.05
271	603303	得邦照明	1,800	18,558.00	0.05
272	000656	金科股份	2,400	18,432.00	0.05
273	600710	苏美达	3,300	18,315.00	0.05
274	000591	太阳能	5,000	18,300.00	0.05
275	300218	安利股份	2,300	18,262.00	0.05
276	000932	华菱钢铁	3,820	18,259.60	0.05
277	000906	浙商中拓	3,100	18,259.00	0.05
278	000498	山东路桥	3,900	18,252.00	0.05
279	002377	国创高新	4,400	18,216.00	0.05
280	603035	常熟汽饰	1,400	18,200.00	0.05
281	300443	金雷股份	1,300	18,187.00	0.05
282	002832	比音勒芬	700	18,179.00	0.05
283	600328	兰太实业	2,200	18,172.00	0.05
284	000755	山西路桥	4,600	18,170.00	0.05
285	601577	长沙银行	2,000	18,140.00	0.05
286	601838	成都银行	2,000	18,140.00	0.05
287	600177	雅戈尔	2,600	18,122.00	0.05
288	600020	中原高速	4,100	18,040.00	0.05
289	000810	创维数字	1,500	17,985.00	0.05
290	603937	丽岛新材	1,600	17,984.00	0.05
291	300625	三雄极光	1,100	17,952.00	0.05
292	603356	华菱精工	1,400	17,948.00	0.05
293	600995	文山电力	2,300	17,940.00	0.05
294	000961	中南建设	1,700	17,935.00	0.05
295	300280	紫天科技	1,100	17,919.00	0.05
296	002150	通润装备	2,600	17,784.00	0.05
297	000888	峨眉山A	2,700	17,712.00	0.05
298	000063	中兴通讯	500	17,695.00	0.05

299	300132	青松股份	1,600	17,648.00	0.05
300	601900	南方传媒	1,900	17,594.00	0.05
301	002732	燕塘乳业	800	17,584.00	0.05
302	002605	姚记科技	900	17,505.00	0.05
303	002115	三维通信	1,900	16,891.00	0.05
304	300632	光莆股份	700	16,877.00	0.05
305	300428	四通新材	1,200	16,872.00	0.05
306	300418	昆仑万维	1,000	16,750.00	0.05
307	000046	泛海控股	2,300	10,465.00	0.03
308	002531	天顺风能	1,600	10,112.00	0.03
309	603368	柳药股份	300	10,092.00	0.03
310	603639	海利尔	400	9,964.00	0.03
311	600970	中材国际	1,400	9,758.00	0.03
312	600388	龙净环保	1,000	9,750.00	0.03
313	603558	健盛集团	900	9,675.00	0.03
314	603488	展鹏科技	1,100	9,669.00	0.03
315	600070	浙江富润	1,000	9,650.00	0.03
316	002809	红墙股份	500	9,545.00	0.03
317	000925	众合科技	1,400	9,380.00	0.03
318	002133	广宇集团	2,800	9,268.00	0.03
319	300016	北陆药业	1,000	8,990.00	0.03
320	603108	润达医疗	900	8,946.00	0.03
321	600901	江苏租赁	1,400	8,848.00	0.02
322	300259	新天科技	2,000	8,720.00	0.02
323	002757	南兴股份	500	8,405.00	0.02
324	603393	新天然气	300	8,337.00	0.02
325	603611	诺力股份	500	8,260.00	0.02
326	000049	德赛电池	200	8,148.00	0.02
327	300052	中青宝	500	7,750.00	0.02
328	002973	侨银环保	950	5,453.00	0.02

## 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	002755	奥赛康	2,167,102.00	22.30
2	002734	利民股份	1,727,860.00	17.78
3	002555	三七互娱	1,689,071.00	17.38
4	002161	远望谷	1,637,113.00	16.84
5	300417	南华仪器	1,429,252.00	14.70
6	601058	赛轮轮胎	1,410,175.00	14.51
7	600728	佳都科技	1,403,503.00	14.44

8	002234	民和股份	1,402,780.00	14.43
9	300559	佳发教育	1,355,120.00	13.94
10	601677	明泰铝业	1,347,276.84	13.86
11	603360	百傲化学	1,316,316.00	13.54
12	002884	凌霄泵业	1,303,231.80	13.41
13	600731	湖南海利	1,263,091.00	12.99
14	300571	平治信息	1,250,187.00	12.86
15	300487	蓝晓科技	1,230,964.00	12.66
16	300209	天泽信息	1,222,251.00	12.57
17	002605	姚记科技	1,198,682.00	12.33
18	002746	仙坛股份	1,167,726.50	12.01
19	300543	朗科智能	1,149,426.00	11.83
20	002452	长高集团	1,136,436.00	11.69
21	002082	万邦德	1,135,615.00	11.68
22	300690	双一科技	1,122,375.00	11.55
23	603800	道森股份	1,107,104.00	11.39
24	000966	长源电力	1,097,576.00	11.29
25	002105	信隆健康	1,091,382.00	11.23
26	603609	禾丰牧业	1,077,392.00	11.08
27	600229	城市传媒	1,075,405.58	11.06
28	300443	金雷股份	1,074,351.00	11.05
29	300360	炬华科技	1,071,111.00	11.02
30	603966	法兰泰克	1,062,899.00	10.94
31	002199	东晶电子	1,059,720.00	10.90
32	603208	江山欧派	1,044,207.00	10.74
33	603315	福鞍股份	1,038,699.00	10.69
34	300205	天喻信息	1,031,488.00	10.61
35	603985	恒润股份	1,013,735.00	10.43
36	300291	华录百纳	1,009,478.00	10.39
37	002458	益生股份	1,000,723.00	10.30
38	603277	银都股份	973,977.00	10.02
39	300130	新国都	967,345.70	9.95
40	002015	协鑫能科	960,157.00	9.88
41	603606	东方电缆	946,802.00	9.74
42	603887	城地股份	939,736.40	9.67
43	002788	鹭燕医药	931,767.00	9.59
44	600668	尖峰集团	930,543.00	9.57
45	601918	新集能源	929,309.00	9.56
46	603519	立霸股份	915,525.00	9.42
47	603926	铁流股份	908,600.80	9.35
48	002587	奥拓电子	906,164.00	9.32
49	300014	亿纬锂能	905,410.00	9.32

50	002441	众业达	904,742.00	9.31
51	300286	安科瑞	901,955.50	9.28
52	000411	英特集团	899,756.00	9.26
53	002128	露天煤业	898,396.07	9.24
54	002732	燕塘乳业	897,448.00	9.23
55	300303	聚飞光电	897,050.00	9.23
56	600466	蓝光发展	893,700.00	9.19
57	300498	温氏股份	887,287.00	9.13
58	000019	深粮控股	870,373.00	8.95
59	002738	中矿资源	865,043.00	8.90
60	002809	红墙股份	863,418.26	8.88
61	600580	卧龙电驱	861,665.00	8.86
62	300702	天宇股份	845,812.00	8.70
63	000668	荣丰控股	838,657.00	8.63
64	300132	青松股份	836,330.00	8.60
65	002651	利君股份	835,991.54	8.60
66	002150	通润装备	831,311.80	8.55
67	600855	航天长峰	830,297.00	8.54
68	603458	勘设股份	829,714.00	8.54
69	000005	世纪星源	816,263.00	8.40
70	300219	鸿利智汇	811,936.00	8.35
71	000913	钱江摩托	809,517.00	8.33
72	300693	盛弘股份	807,885.00	8.31
73	300043	星辉娱乐	798,848.00	8.22
74	002182	云海金属	789,992.00	8.13
75	600031	三一重工	788,139.00	8.11
76	600961	株冶集团	776,456.00	7.99
77	300709	精研科技	774,323.00	7.97
78	600353	旭光股份	769,458.00	7.92
79	600449	宁夏建材	767,286.00	7.89
80	000779	甘咨询	765,555.00	7.88
81	002299	圣农发展	763,059.00	7.85
82	002457	青龙管业	762,860.00	7.85
83	603890	春秋电子	760,649.00	7.83
84	002406	远东传动	760,464.00	7.82
85	600784	鲁银投资	759,548.00	7.81
86	603878	武进不锈	757,193.00	7.79
87	601996	丰林集团	756,491.00	7.78
88	603559	中通国脉	753,317.00	7.75
89	002860	星帅尔	753,156.00	7.75
90	600346	恒力石化	750,232.00	7.72
91	600486	扬农化工	746,705.00	7.68

92	600261	阳光照明	744,684.00	7.66
93	603058	永吉股份	744,025.00	7.65
94	600053	九鼎投资	742,063.00	7.63
95	000565	渝三峡A	739,315.00	7.61
96	000637	茂化实华	738,189.00	7.59
97	603309	维力医疗	736,736.87	7.58
98	000708	中信特钢	734,043.00	7.55
99	600987	航民股份	733,323.27	7.54
100	300628	亿联网络	731,053.00	7.52
101	002016	世荣兆业	730,887.36	7.52
102	300092	科新机电	725,324.00	7.46
103	002360	同德化工	725,228.00	7.46
104	600267	海正药业	718,829.00	7.40
105	600866	星湖科技	718,524.00	7.39
106	600727	鲁北化工	716,032.00	7.37
107	002111	威海广泰	714,175.00	7.35
108	000006	深振业A	711,436.00	7.32
109	600985	淮北矿业	709,496.00	7.30
110	600984	建设机械	707,124.00	7.28
111	300497	富祥股份	701,212.00	7.21
112	300423	鲁亿通	700,841.00	7.21
113	600653	申华控股	699,070.00	7.19
114	002875	安奈儿	698,555.00	7.19
115	000573	粤宏远A	694,234.00	7.14
116	002444	巨星科技	687,762.00	7.08
117	000973	佛塑科技	679,009.85	6.99
118	002379	宏创控股	673,250.00	6.93
119	000848	承德露露	672,762.00	6.92
120	300697	电工合金	669,683.00	6.89
121	300613	富瀚微	666,940.00	6.86
122	300118	东方日升	662,667.00	6.82
123	601567	三星医疗	660,978.00	6.80
124	000838	财信发展	660,915.00	6.80
125	000985	大庆华科	660,096.00	6.79
126	603977	国泰集团	659,630.60	6.79
127	601137	博威合金	658,021.00	6.77
128	300440	运达科技	656,325.00	6.75
129	300236	上海新阳	656,292.00	6.75
130	300016	北陆药业	654,181.00	6.73
131	600130	波导股份	649,743.00	6.68
132	300599	雄塑科技	649,625.00	6.68
133	600386	北巴传媒	647,599.00	6.66

134	002362	汉王科技	647,272.00	6.66
135	002024	苏宁易购	646,192.00	6.65
136	603089	正裕工业	645,034.00	6.64
137	300428	四通新材	643,237.00	6.62
138	600120	浙江东方	641,835.00	6.60
139	002487	大金重工	641,737.36	6.60
140	300019	硅宝科技	640,923.00	6.59
141	002090	金智科技	638,884.00	6.57
142	002398	垒知集团	634,675.00	6.53
143	300686	智动力	630,999.00	6.49
144	000534	万泽股份	629,923.00	6.48
145	002114	罗平锌电	629,357.00	6.47
146	300251	光线传媒	625,429.00	6.43
147	000718	苏宁环球	625,070.00	6.43
148	300719	安达维尔	621,631.00	6.40
149	600993	马应龙	621,147.20	6.39
150	000900	现代投资	619,189.00	6.37
151	300231	银信科技	617,056.00	6.35
152	002295	精艺股份	616,299.00	6.34
153	000601	韶能股份	615,945.00	6.34
154	603500	祥和实业	612,851.00	6.31
155	600662	强生控股	612,717.00	6.30
156	000606	顺利办	611,797.00	6.29
157	002139	拓邦股份	610,901.00	6.29
158	603801	志邦家居	610,602.34	6.28
159	002043	兔宝宝	610,194.00	6.28
160	300129	泰胜风能	609,115.00	6.27
161	600532	宏达矿业	609,056.00	6.27
162	000042	中洲控股	607,343.00	6.25
163	002832	比音勒芬	606,423.00	6.24
164	002749	国光股份	606,049.00	6.24
165	002869	金溢科技	605,209.00	6.23
166	603608	天创时尚	604,593.00	6.22
167	603136	天目湖	600,032.00	6.17
168	300213	佳讯飞鸿	599,399.00	6.17
169	002851	麦格米特	599,268.00	6.17
170	000576	广东甘化	599,011.00	6.16
171	300531	优博讯	597,161.00	6.14
172	603050	科林电气	595,808.00	6.13
173	300401	花园生物	594,909.00	6.12
174	603278	大业股份	591,841.00	6.09
175	600846	同济科技	583,059.00	6.00



176	002084	海鸥住工	582,746.00	6.00
177	002763	汇洁股份	582,325.00	5.99
178	300578	会畅通讯	582,233.00	5.99
179	600510	黑牡丹	580,915.00	5.98
180	603598	引力传媒	575,428.00	5.92
181	300446	乐凯新材	574,256.00	5.91
182	300658	延江股份	571,979.50	5.88
183	603811	诚意药业	570,942.00	5.87
184	601002	晋亿实业	566,642.00	5.83
185	002124	天邦股份	565,587.00	5.82
186	603585	苏利股份	562,899.00	5.79
187	002649	博彦科技	562,688.00	5.79
188	603398	邦宝益智	560,857.60	5.77
189	603300	华铁应急	560,425.00	5.77
190	600070	浙江富润	560,070.00	5.76
191	603516	淳中科技	556,923.00	5.73
192	600575	淮河能源	556,242.00	5.72
193	002144	宏达高科	553,911.00	5.70
194	603861	白云电器	552,930.00	5.69
195	600452	涪陵电力	548,981.00	5.65
196	002554	惠博普	547,874.00	5.64
197	002654	万润科技	546,667.00	5.62
198	002130	沃尔核材	546,587.00	5.62
199	002045	国光电器	546,186.00	5.62
200	000757	浩物股份	544,617.00	5.60
201	002790	瑞尔特	541,933.40	5.58
202	002782	可立克	541,771.00	5.57
203	600647	同达创业	539,576.00	5.55
204	603067	振华股份	537,944.00	5.53
205	300735	光弘科技	537,635.00	5.53
206	603508	思维列控	537,097.00	5.53
207	601566	九牧王	535,338.00	5.51
208	002907	华森制药	534,673.00	5.50
209	603669	灵康药业	529,467.20	5.45
210	603393	新天然气	526,030.00	5.41
211	002621	美吉姆	525,792.00	5.41
212	000755	山西路桥	525,744.00	5.41
213	300248	新开普	525,699.00	5.41
214	002133	广宇集团	525,426.00	5.41
215	002381	双箭股份	525,088.00	5.40
216	000915	山大华特	524,199.10	5.39
217	603160	汇顶科技	524,046.00	5.39

218	600248	延长化建	522,973.00	5.38
219	603081	大丰实业	519,593.00	5.35
220	300393	中来股份	518,355.40	5.33
221	600719	大连热电	518,266.00	5.33
222	600335	国机汽车	517,936.00	5.33
223	600834	申通地铁	514,143.00	5.29
224	600995	文山电力	513,981.00	5.29
225	002195	二三四五	510,317.40	5.25
226	603311	金海环境	508,726.00	5.23
227	601900	南方传媒	507,912.00	5.23
228	600713	南京医药	507,660.00	5.22
229	603033	三维股份	507,489.00	5.22
230	002163	中航三鑫	507,464.00	5.22
231	600530	交大昂立	505,435.00	5.20
232	603380	易德龙	501,954.00	5.16
233	002803	吉宏股份	501,024.00	5.15
234	000736	中交地产	501,014.00	5.15
235	600533	栖霞建设	500,806.00	5.15
236	600589	广东榕泰	500,790.00	5.15
237	002719	麦趣尔	500,772.00	5.15
238	603488	展鹏科技	498,677.00	5.13
239	603036	如通股份	497,561.00	5.12
240	002531	天顺风能	497,158.00	5.11
241	002637	赞宇科技	495,025.00	5.09
242	603319	湘油泵	494,938.40	5.09
243	603199	九华旅游	494,724.00	5.09
244	000987	越秀金控	492,728.00	5.07
245	000686	东北证券	490,262.00	5.04
246	600693	东百集团	485,522.00	5.00
247	300500	启迪设计	483,332.00	4.97
248	300532	今天国际	481,424.00	4.95
249	603505	金石资源	480,029.00	4.94
250	002478	常宝股份	479,131.00	4.93
251	600490	鹏欣资源	479,064.00	4.93
252	600551	时代出版	478,508.00	4.92
253	300552	万集科技	477,318.00	4.91
254	000338	潍柴动力	476,474.00	4.90
255	603129	春风动力	476,169.00	4.90
256	603556	海兴电力	473,271.00	4.87
257	603855	华荣股份	471,716.00	4.85
258	002873	新天药业	471,277.50	4.85
259	600020	中原高速	471,152.00	4.85

260	000623	吉林敖东	470,792.00	4.84
261	600675	中华企业	470,096.00	4.84
262	600249	两面针	469,338.00	4.83
263	600162	香江控股	466,603.00	4.80
264	002611	东方精工	466,230.00	4.80
265	600848	上海临港	460,819.00	4.74
266	000157	中联重科	460,019.00	4.73
267	000951	中国重汽	459,820.00	4.73
268	600581	八一钢铁	458,053.00	4.71
269	002053	云南能投	456,854.00	4.70
270	300419	浩丰科技	456,192.00	4.69
271	002184	海得控制	455,774.00	4.69
272	603819	神力股份	454,772.20	4.68
273	600793	宜宾纸业	453,388.00	4.66
274	300692	中环环保	452,709.00	4.66
275	002928	华夏航空	452,351.00	4.65
276	300035	中科电气	451,993.00	4.65
277	300703	创源文化	451,549.00	4.65
278	300523	辰安科技	451,128.00	4.64
279	603822	嘉澳环保	450,014.00	4.63
280	000425	徐工机械	449,973.00	4.63
281	300682	朗新科技	449,614.00	4.63
282	002331	皖通科技	449,104.00	4.62
283	603012	创力集团	449,089.00	4.62
284	600794	保税科技	448,768.00	4.62
285	600606	绿地控股	448,472.00	4.61
286	603313	梦百合	447,103.00	4.60
287	600287	江苏舜天	445,476.00	4.58
288	002399	海普瑞	445,272.00	4.58
289	600438	通威股份	444,564.00	4.57
290	002300	太阳电缆	444,508.00	4.57
291	000929	兰州黄河	444,223.00	4.57
292	002660	茂硕电源	443,988.00	4.57
293	002882	金龙羽	443,935.00	4.57
294	601369	陕鼓动力	443,664.00	4.56
295	300305	裕兴股份	442,875.00	4.56
296	601199	江南水务	442,184.00	4.55
297	600673	东阳光	440,936.00	4.54
298	300233	金城医药	438,526.00	4.51
299	300235	方直科技	438,058.00	4.51
300	002895	川恒股份	437,734.00	4.50
301	002602	世纪华通	437,595.00	4.50

302	300007	汉威科技	437,505.00	4.50
303	000936	华西股份	436,682.00	4.49
304	600405	动力源	436,047.00	4.49
305	603356	华菱精工	435,234.00	4.48
306	002489	浙江永强	434,609.00	4.47
307	300695	兆丰股份	434,557.00	4.47
308	300017	网宿科技	433,560.00	4.46
309	000065	北方国际	432,571.00	4.45
310	002925	盈趣科技	431,097.00	4.44
311	300259	新天科技	430,465.00	4.43
312	600755	厦门国贸	430,378.00	4.43
313	000036	华联控股	428,831.00	4.41
314	002912	中新赛克	428,638.00	4.41
315	002632	道明光学	428,325.00	4.41
316	300522	世名科技	426,698.00	4.39
317	002893	华通热力	423,489.30	4.36
318	600585	海螺水泥	423,457.00	4.36
319	600801	华新水泥	420,522.00	4.33
320	000885	城发环境	419,965.00	4.32
321	600626	申达股份	419,482.00	4.32
322	002387	维信诺	417,011.00	4.29
323	603013	亚普股份	416,565.00	4.29
324	000034	神州数码	416,254.00	4.28
325	002337	赛象科技	415,731.00	4.28
326	300371	汇中股份	414,508.00	4.26
327	600382	广东明珠	412,827.00	4.25
328	600805	悦达投资	412,003.00	4.24
329	600865	百大集团	410,753.00	4.23
330	300442	普丽盛	410,395.00	4.22
331	600136	当代明诚	410,044.00	4.22
332	603988	中电电机	404,966.00	4.17
333	002248	华东数控	404,471.00	4.16
334	300572	安车检测	403,342.40	4.15
335	600191	华资实业	402,535.00	4.14
336	603980	吉华集团	401,700.00	4.13
337	300031	宝通科技	399,366.00	4.11
338	000933	神火股份	398,268.00	4.10
339	600117	西宁特钢	397,740.00	4.09
340	002271	东方雨虹	397,192.00	4.09
341	002514	宝馨科技	396,312.00	4.08
342	002367	康力电梯	395,533.00	4.07
343	300181	佐力药业	395,273.00	4.07

344	002876	三利谱	395,220.00	4.07
345	600792	云煤能源	395,156.00	4.07
346	002272	川润股份	394,103.00	4.05
347	600285	羚锐制药	392,641.95	4.04
348	603326	我乐家居	392,268.00	4.04
349	002137	麦达数字	391,834.00	4.03
350	002626	金达威	391,087.00	4.02
351	002757	南兴股份	389,595.00	4.01
352	600611	大众交通	389,408.00	4.01
353	000802	北京文化	389,012.00	4.00
354	000031	大悦城	387,908.00	3.99
355	603661	恒林股份	386,541.00	3.98
356	603626	科森科技	384,803.00	3.96
357	600992	贵绳股份	383,514.30	3.95
358	603586	金麒麟	383,501.00	3.95
359	300200	高盟新材	383,356.00	3.94
360	000032	深桑达A	383,256.00	3.94
361	002037	保利联合	383,114.00	3.94
362	002740	爱迪尔	383,018.00	3.94
363	300140	中环装备	381,928.00	3.93
364	600135	乐凯胶片	381,653.00	3.93
365	000789	万年青	381,465.00	3.92
366	600327	大东方	381,115.00	3.92
367	002177	御银股份	380,188.00	3.91
368	000656	金科股份	380,118.00	3.91
369	600785	新华百货	379,915.00	3.91
370	000603	盛达资源	379,358.00	3.90
371	002425	凯撒文化	379,049.00	3.90
372	600035	楚天高速	378,992.00	3.90
373	300569	天能重工	378,602.00	3.90
374	300074	华平股份	377,667.00	3.89
375	600706	曲江文旅	377,566.00	3.88
376	002687	乔治白	376,150.14	3.87
377	600810	神马股份	375,832.00	3.87
378	000751	锌业股份	375,375.00	3.86
379	600469	风神股份	375,137.00	3.86
380	600368	五洲交通	373,503.00	3.84
381	600636	三爱富	372,972.00	3.84
382	000529	广弘控股	372,695.00	3.83
383	300570	太辰光	370,217.00	3.81
384	002607	中公教育	370,081.00	3.81
385	300738	奥飞数据	369,475.00	3.80

386	002214	大立科技	369,072.00	3.80
387	601012	隆基股份	368,896.00	3.80
388	600170	上海建工	368,127.00	3.79
389	603968	醋化股份	367,298.00	3.78
390	600780	通宝能源	367,185.00	3.78
391	300175	朗源股份	367,088.00	3.78
392	002438	江苏神通	364,646.00	3.75
393	002916	深南电路	364,322.00	3.75
394	000700	模塑科技	364,240.00	3.75
395	600310	桂东电力	364,108.00	3.75
396	000701	厦门信达	363,984.00	3.74
397	300296	利亚德	363,919.00	3.74
398	600724	宁波富达	362,778.00	3.73
399	300407	凯发电气	362,511.00	3.73
400	601336	新华保险	361,423.00	3.72
401	300660	江苏雷利	361,243.60	3.72
402	000715	中兴商业	360,572.65	3.71
403	603859	能科股份	357,836.00	3.68
404	000888	峨眉山 A	356,015.00	3.66
405	603818	曲美家居	355,591.00	3.66
406	300438	鹏辉能源	354,766.00	3.65
407	600097	开创国际	354,712.00	3.65
408	600757	长江传媒	354,437.00	3.65
409	601233	桐昆股份	354,348.82	3.65
410	603538	美诺华	354,248.00	3.64
411	300602	飞荣达	353,332.00	3.64
412	300491	通合科技	352,954.00	3.63
413	000630	铜陵有色	352,565.00	3.63
414	600328	兰太实业	350,112.00	3.60
415	002088	鲁阳节能	349,973.60	3.60
416	002110	三钢闽光	349,261.00	3.59
417	603188	ST 亚邦	348,875.00	3.59
418	000301	东方盛虹	347,499.00	3.58
419	600167	联美控股	346,425.00	3.56
420	300179	四方达	346,120.00	3.56
421	300461	田中精机	344,830.00	3.55
422	300467	迅游科技	344,469.00	3.54
423	000568	泸州老窖	344,379.00	3.54
424	002706	良信电器	343,081.00	3.53
425	600824	益民集团	342,979.00	3.53
426	300575	中旗股份	342,311.00	3.52
427	600166	福田汽车	342,110.00	3.52

428	300359	全通教育	339,353.00	3.49
429	000828	东莞控股	338,512.00	3.48
430	603378	亚士创能	337,402.00	3.47
431	300117	嘉寓股份	337,126.00	3.47
432	000045	深纺织A	336,953.80	3.47
433	300636	同和药业	336,877.00	3.47
434	603303	得邦照明	336,719.40	3.46
435	300557	理工光科	336,547.00	3.46
436	603916	苏博特	335,232.00	3.45
437	600208	新湖中宝	334,798.00	3.44
438	601588	北辰实业	334,418.00	3.44
439	000509	华塑控股	332,093.00	3.42
440	300632	光莆股份	331,659.00	3.41
441	600548	深高速	331,602.00	3.41
442	600470	六国化工	331,497.00	3.41
443	600997	开滦股份	330,077.00	3.40
444	600939	重庆建工	330,019.00	3.40
445	603667	五洲新春	329,617.00	3.39
446	002353	杰瑞股份	327,727.00	3.37
447	600366	宁波韵升	327,699.00	3.37
448	002498	汉缆股份	327,213.00	3.37
449	600461	洪城水业	325,639.00	3.35
450	300640	德艺文创	325,086.00	3.34
451	600873	梅花生物	324,723.00	3.34
452	002265	西仪股份	322,978.00	3.32
453	601811	新华文轩	322,935.00	3.32
454	000629	攀钢钒钛	320,817.00	3.30
455	000798	中水渔业	320,005.00	3.29
456	600643	爱建集团	319,094.00	3.28
457	603877	太平鸟	318,985.00	3.28
458	002174	游族网络	318,439.00	3.28
459	300198	纳川股份	318,380.00	3.28
460	002657	中科金财	318,013.00	3.27
461	600127	金健米业	317,839.00	3.27
462	000671	阳光城	317,561.00	3.27
463	603165	荣晟环保	317,245.60	3.26
464	002449	国星光电	311,581.00	3.21
465	002249	大洋电机	311,554.00	3.21
466	000517	荣安地产	307,694.00	3.17
467	300385	雪浪环境	307,053.00	3.16
468	300096	易联众	306,791.00	3.16
469	603882	金域医学	306,137.00	3.15

470	603699	纽威股份	306,083.96	3.15
471	600833	第一医药	305,573.00	3.14
472	600522	中天科技	305,477.00	3.14
473	000672	上峰水泥	305,045.00	3.14
474	600587	新华医疗	303,807.00	3.13
475	300146	汤臣倍健	302,351.00	3.11
476	600620	天宸股份	301,294.00	3.10
477	603680	今创集团	299,365.00	3.08
478	300397	天和防务	298,526.00	3.07
479	600132	重庆啤酒	297,950.00	3.07
480	300625	三雄极光	297,765.00	3.06
481	600475	华光股份	296,963.00	3.06
482	300696	爱乐达	296,435.00	3.05
483	000030	富奥股份	296,338.00	3.05
484	600681	百川能源	295,914.00	3.04
485	002772	众兴菌业	295,460.00	3.04
486	300320	海达股份	295,330.00	3.04
487	002304	洋河股份	295,215.00	3.04
488	002760	凤形股份	294,855.00	3.03
489	603678	火炬电子	294,476.00	3.03
490	300395	菲利华	294,259.00	3.03
491	603299	苏盐井神	293,537.00	3.02
492	000859	国风塑业	292,765.00	3.01
493	000850	华茂股份	291,345.00	3.00
494	300708	聚灿光电	291,331.00	3.00
495	300669	沪宁股份	290,799.00	2.99
496	600743	华远地产	290,187.00	2.99
497	002097	山河智能	289,266.00	2.98
498	002233	塔牌集团	288,873.00	2.97
499	002326	永太科技	287,320.00	2.96
500	300551	古鳌科技	286,214.00	2.94
501	300661	圣邦股份	284,786.00	2.93
502	600720	祁连山	284,497.00	2.93
503	002847	盐津铺子	284,378.00	2.93
504	600383	金地集团	284,325.00	2.93
505	603180	金牌厨柜	284,183.00	2.92
506	300638	广和通	284,021.00	2.92
507	600829	人民同泰	283,987.00	2.92
508	600048	保利地产	283,481.00	2.92
509	600740	山西焦化	283,089.00	2.91
510	002283	天润曲轴	282,173.00	2.90
511	600203	福日电子	280,466.00	2.89



512	600444	国机通用	280,246.00	2.88
513	600909	华安证券	279,717.00	2.88
514	603757	大元泵业	279,656.00	2.88
515	601717	郑煤机	278,537.00	2.87
516	300464	星徽精密	277,999.00	2.86
517	002468	申通快递	277,229.00	2.85
518	603730	岱美股份	276,255.00	2.84
519	601515	东风股份	275,958.00	2.84
520	600694	大商股份	275,489.00	2.83
521	603041	美思德	274,709.00	2.83
522	300272	开能健康	274,498.20	2.82
523	000403	双林生物	273,363.00	2.81
524	000502	绿景控股	273,190.00	2.81
525	000719	中原传媒	273,096.00	2.81
526	000922	佳电股份	272,986.00	2.81
527	002315	焦点科技	272,430.00	2.80
528	000906	浙商中拓	271,840.00	2.80
529	002731	萃华珠宝	270,734.40	2.79
530	300511	雪榕生物	269,536.00	2.77
531	603369	今世缘	265,871.00	2.74
532	300088	长信科技	265,865.00	2.74
533	002595	豪迈科技	264,384.00	2.72
534	000877	天山股份	263,201.00	2.71
535	600217	中再资环	262,961.00	2.71
536	603596	伯特利	262,227.00	2.70
537	000811	冰轮环境	261,543.00	2.69
538	000524	岭南控股	260,619.00	2.68
539	600618	氯碱化工	259,931.00	2.67
540	000415	渤海租赁	258,536.00	2.66
541	603856	东宏股份	258,227.50	2.66
542	300066	三川智慧	258,172.00	2.66
543	002083	孚日股份	257,673.00	2.65
544	002560	通达股份	257,467.00	2.65
545	300630	普利制药	257,375.00	2.65
546	002394	联发股份	256,929.00	2.64
547	601100	恒立液压	256,872.00	2.64
548	300596	利安隆	256,657.00	2.64
549	002126	银轮股份	255,981.00	2.63
550	002357	富临运业	255,385.00	2.63
551	000928	中钢国际	255,290.00	2.63
552	002534	杭锅股份	254,899.80	2.62
553	601360	三六零	253,443.00	2.61

554	600657	信达地产	252,618.00	2.60
555	300292	吴通控股	250,729.00	2.58
556	600704	物产中大	249,903.00	2.57
557	300378	鼎捷软件	249,014.00	2.56
558	603288	海天味业	248,658.00	2.56
559	002208	合肥城建	248,615.00	2.56
560	603035	常熟汽饰	247,294.00	2.54
561	300422	博世科	247,032.00	2.54
562	600665	天地源	245,505.00	2.53
563	002146	荣盛发展	243,854.00	2.51
564	601218	吉鑫科技	243,404.00	2.50
565	000993	闽东电力	242,808.00	2.50
566	002314	南山控股	242,560.00	2.50
567	300466	赛摩电气	242,002.12	2.49
568	002703	浙江世宝	242,000.00	2.49
569	300337	银邦股份	241,785.00	2.49
570	300453	三鑫医疗	241,416.00	2.48
571	600633	浙数文化	239,795.00	2.47
572	300508	维宏股份	239,447.00	2.46
573	603727	博迈科	239,143.00	2.46
574	601107	四川成渝	238,515.00	2.45
575	600387	海越能源	237,503.00	2.44
576	300424	航新科技	237,095.00	2.44
577	603889	新澳股份	236,750.00	2.44
578	300389	艾比森	236,617.00	2.43
579	600143	金发科技	236,213.00	2.43
580	000417	合肥百货	235,398.00	2.42
581	002714	牧原股份	234,947.00	2.42
582	603456	九洲药业	234,347.00	2.41
583	002853	皮阿诺	234,323.00	2.41
584	002845	同兴达	234,261.00	2.41
585	603527	众源新材	232,871.00	2.40
586	002094	青岛金王	232,859.00	2.40
587	000880	潍柴重机	232,387.00	2.39
588	300111	向日葵	232,371.00	2.39
589	603871	嘉友国际	232,027.00	2.39
590	002712	思美传媒	230,575.00	2.37
591	603161	科华控股	229,948.00	2.37
592	603108	润达医疗	229,686.00	2.36
593	002775	文科园林	229,302.00	2.36
594	300220	金运激光	229,125.00	2.36
595	600266	北京城建	228,696.00	2.35

596	000100	TCL 科技	228,289.00	2.35
597	300521	爱司凯	228,214.00	2.35
598	600782	新钢股份	227,445.00	2.34
599	000863	三湘印象	226,682.00	2.33
600	600282	南钢股份	226,565.00	2.33
601	600781	ST 辅仁	226,134.00	2.33
602	002582	好想你	225,649.00	2.32
603	300161	华中数控	225,309.00	2.32
604	000921	海信家电	225,234.00	2.32
605	000421	南京公用	224,958.00	2.31
606	600889	南京化纤	224,780.00	2.31
607	603026	石大胜华	224,429.00	2.31
608	002518	科士达	224,392.00	2.31
609	300659	中孚信息	224,236.00	2.31
610	300114	中航电测	223,729.00	2.30
611	603111	康尼机电	222,608.00	2.29
612	000591	太阳能	221,885.00	2.28
613	600509	天富能源	221,826.00	2.28
614	600410	华胜天成	219,949.00	2.26
615	000810	创维数字	219,131.00	2.25
616	000925	众合科技	218,910.00	2.25
617	300761	立华股份	218,651.00	2.25
618	000655	金岭矿业	218,534.00	2.25
619	002512	达华智能	218,448.00	2.25
620	300243	瑞丰高材	218,297.00	2.25
621	603689	皖天然气	217,415.00	2.24
622	002598	山东章鼓	216,959.00	2.23
623	600064	南京高科	216,690.00	2.23
624	002635	安洁科技	216,612.00	2.23
625	603737	三棵树	216,116.00	2.22
626	600152	维科技术	215,618.00	2.22
627	603238	诺邦股份	215,520.00	2.22
628	603088	宁波精达	215,254.00	2.21
629	600796	钱江生化	215,042.00	2.21
630	600271	航天信息	214,718.00	2.21
631	600100	同方股份	214,504.00	2.21
632	002527	新时达	213,079.00	2.19
633	600052	浙江广厦	213,020.00	2.19
634	600661	昂立教育	212,973.00	2.19
635	002160	常铝股份	212,608.00	2.19
636	603043	广州酒家	212,571.00	2.19
637	002571	德力股份	212,513.00	2.19

638	002545	东方铁塔	212,416.00	2.19
639	000096	广聚能源	210,584.00	2.17
640	002171	楚江新材	210,453.00	2.17
641	000153	丰原药业	210,030.00	2.16
642	002879	长缆科技	209,489.00	2.16
643	600768	宁波富邦	209,465.00	2.16
644	002415	海康威视	209,431.00	2.15
645	002835	同为股份	209,312.00	2.15
646	300138	晨光生物	209,105.00	2.15
647	300353	东土科技	208,996.00	2.15
648	002255	海陆重工	208,722.00	2.15
649	002269	美邦服饰	208,460.00	2.14
650	600890	中房股份	208,395.00	2.14
651	000952	广济药业	207,436.00	2.13
652	300715	凯伦股份	206,865.00	2.13
653	002909	集泰股份	206,852.00	2.13
654	000910	大亚圣象	206,742.00	2.13
655	002192	融捷股份	206,711.00	2.13
656	300221	银禧科技	206,244.00	2.12
657	002298	中电兴发	205,766.00	2.12
658	300148	天舟文化	205,708.00	2.12
659	002451	摩恩电气	204,635.00	2.11
660	603283	赛腾股份	203,814.00	2.10
661	000895	双汇发展	202,304.00	2.08
662	002866	传艺科技	202,260.00	2.08
663	600864	哈投股份	202,122.00	2.08
664	000949	新乡化纤	201,860.00	2.08
665	002543	万和电气	201,676.00	2.07
666	002533	金杯电工	201,158.00	2.07
667	300418	昆仑万维	201,106.00	2.07
668	603638	艾迪精密	200,340.00	2.06
669	000531	穗恒运A	200,300.00	2.06
670	002221	东华能源	200,228.00	2.06
671	002743	富煌钢构	200,094.00	2.06
672	002911	佛燃股份	199,924.00	2.06
673	601377	兴业证券	199,105.00	2.05
674	603030	全筑股份	197,996.00	2.04
675	601888	中国国旅	197,772.00	2.03
676	300062	中能电气	197,751.00	2.03
677	600269	赣粤高速	197,405.00	2.03
678	603018	中设集团	196,476.00	2.02
679	600677	航天通信	195,417.00	2.01

680	600655	豫园股份	195,356.00	2.01
-----	--------	------	------------	------

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

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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002755	奥赛康	2,057,620.20	21.17
2	002555	三七互娱	1,757,688.00	18.08
3	002734	利民股份	1,693,207.00	17.42
4	002161	远望谷	1,506,079.00	15.49
5	600728	佳都科技	1,359,196.85	13.98
6	601677	明泰铝业	1,351,917.00	13.91
7	002884	凌霄泵业	1,332,552.00	13.71
8	002234	民和股份	1,303,290.00	13.41
9	300571	平治信息	1,301,519.12	13.39
10	002605	姚记科技	1,297,991.00	13.35
11	300417	南华仪器	1,263,348.00	13.00
12	300559	佳发教育	1,260,465.41	12.97
13	601058	赛轮轮胎	1,242,269.00	12.78
14	300209	天泽信息	1,191,657.00	12.26
15	002082	万邦德	1,159,572.00	11.93
16	603800	道森股份	1,134,379.00	11.67
17	603360	百傲化学	1,115,102.00	11.47
18	002746	仙坛股份	1,088,865.85	11.20
19	600229	城市传媒	1,076,474.08	11.07
20	300443	金雷股份	1,062,827.00	10.93
21	600731	湖南海利	1,044,060.00	10.74
22	300487	蓝晓科技	1,038,438.00	10.68
23	603985	恒润股份	1,028,091.00	10.58
24	603208	江山欧派	1,023,310.00	10.53
25	300291	华录百纳	1,006,462.00	10.35
26	300543	朗科智能	997,350.00	10.26
27	300303	聚飞光电	994,019.00	10.23
28	002199	东晶电子	990,148.00	10.19
29	603887	城地股份	982,910.60	10.11
30	603609	禾丰牧业	980,970.00	10.09
31	600668	尖峰集团	980,312.84	10.09
32	603277	银都股份	980,101.00	10.08
33	002452	长高集团	956,189.00	9.84
34	300360	炬华科技	954,908.00	9.82

35	000966	长源电力	938,674.00	9.66
36	603519	立霸股份	922,623.00	9.49
37	002587	奥拓电子	917,495.00	9.44
38	300690	双一科技	915,267.00	9.42
39	300130	新国都	915,202.00	9.42
40	002150	通润装备	911,924.00	9.38
41	300132	青松股份	907,541.00	9.34
42	603606	东方电缆	900,240.00	9.26
43	000411	英特集团	894,715.00	9.20
44	002441	众业达	891,669.00	9.17
45	002732	燕塘乳业	883,127.00	9.09
46	002105	信隆健康	879,929.00	9.05
47	002809	红墙股份	866,662.22	8.92
48	002738	中矿资源	860,719.00	8.86
49	002128	露天煤业	857,605.00	8.82
50	000005	世纪星源	856,685.00	8.81
51	000668	荣丰控股	855,301.00	8.80
52	600580	卧龙电驱	844,805.48	8.69
53	300702	天宇股份	843,167.48	8.67
54	000019	深粮控股	839,857.00	8.64
55	002458	益生股份	837,039.00	8.61
56	600031	三一重工	834,781.00	8.59
57	603966	法兰泰克	830,488.00	8.54
58	603315	福鞍股份	821,069.00	8.45
59	002651	利君股份	814,324.00	8.38
60	300423	鲁亿通	805,768.60	8.29
61	300219	鸿利智汇	794,111.00	8.17
62	002788	鹭燕医药	787,419.00	8.10
63	300709	精研科技	786,644.00	8.09
64	600449	宁夏建材	785,438.00	8.08
65	600261	阳光照明	773,696.00	7.96
66	600353	旭光股份	771,140.00	7.93
67	600985	淮北矿业	769,729.00	7.92
68	601996	丰林集团	765,342.00	7.87
69	600346	恒力石化	762,435.00	7.84
70	300205	天喻信息	759,530.00	7.81
71	300628	亿联网络	756,643.00	7.78
72	600466	蓝光发展	753,687.00	7.75
73	300286	安科瑞	752,805.00	7.74
74	603309	维力医疗	745,270.00	7.67
75	002406	远东传动	744,370.00	7.66
76	603890	春秋电子	744,178.24	7.66

77	000637	茂化实华	742,032.00	7.63
78	600784	鲁银投资	733,375.90	7.55
79	002860	星帅尔	732,468.00	7.54
80	600053	九鼎投资	731,103.70	7.52
81	601137	博威合金	725,564.00	7.46
82	002299	圣农发展	725,308.00	7.46
83	000565	渝三峡A	720,653.00	7.41
84	002016	世荣兆业	719,595.00	7.40
85	002398	垒知集团	715,795.94	7.36
86	300014	亿纬锂能	714,129.00	7.35
87	002444	巨星科技	711,447.00	7.32
88	002875	安奈儿	705,422.00	7.26
89	300613	富瀚微	702,896.00	7.23
90	600987	航民股份	702,124.00	7.22
91	603089	正裕工业	701,213.95	7.21
92	600653	申华控股	698,770.00	7.19
93	603878	武进不锈	694,951.00	7.15
94	601567	三星医疗	687,188.00	7.07
95	000900	现代投资	685,706.00	7.05
96	002182	云海金属	684,004.00	7.04
97	300236	上海新阳	683,193.85	7.03
98	300697	电工合金	677,051.00	6.97
99	002487	大金重工	677,012.40	6.97
100	002360	同德化工	676,624.00	6.96
101	300118	东方日升	673,938.00	6.93
102	000848	承德露露	669,769.00	6.89
103	002015	协鑫能科	667,461.00	6.87
104	600961	株冶集团	665,482.00	6.85
105	600070	浙江富润	663,362.00	6.82
106	600130	波导股份	660,083.00	6.79
107	600386	北巴传媒	658,773.00	6.78
108	300428	四通新材	656,209.00	6.75
109	300019	硅宝科技	652,350.00	6.71
110	300016	北陆药业	648,101.00	6.67
111	600993	马应龙	646,390.20	6.65
112	002362	汉王科技	643,148.00	6.62
113	603598	引力传媒	640,270.00	6.59
114	000601	韶能股份	640,137.32	6.59
115	002090	金智科技	639,616.00	6.58
116	600120	浙江东方	639,367.90	6.58
117	002749	国光股份	639,202.00	6.58
118	300686	智动力	637,750.46	6.56

119	002649	博彦科技	637,115.00	6.55
120	000718	苏宁环球	636,928.00	6.55
121	603608	天创时尚	627,658.00	6.46
122	603811	诚意药业	627,097.20	6.45
123	000985	大庆华科	626,810.00	6.45
124	601918	新集能源	621,136.00	6.39
125	603801	志邦家居	619,319.00	6.37
126	300693	盛弘股份	618,070.00	6.36
127	002043	兔宝宝	617,506.00	6.35
128	002295	精艺股份	616,567.00	6.34
129	603500	祥和实业	612,819.00	6.30
130	600452	涪陵电力	610,910.00	6.29
131	002139	拓邦股份	609,808.00	6.27
132	002114	罗平锌电	608,189.00	6.26
133	600662	强生控股	605,332.00	6.23
134	300531	优博讯	603,416.00	6.21
135	002084	海鸥住工	602,025.00	6.19
136	002851	麦格米特	601,931.00	6.19
137	002045	国光电器	600,585.00	6.18
138	603926	铁流股份	600,239.00	6.18
139	300213	佳讯飞鸿	599,321.00	6.17
140	300401	花园生物	594,087.00	6.11
141	300578	会畅通讯	589,817.36	6.07
142	603050	科林电气	588,972.00	6.06
143	300446	乐凯新材	588,077.50	6.05
144	600486	扬农化工	587,237.00	6.04
145	603278	大业股份	585,757.70	6.03
146	002763	汇洁股份	584,482.00	6.01
147	603669	灵康药业	581,381.00	5.98
148	002832	比音勒芬	581,003.00	5.98
149	603458	勘设股份	577,918.00	5.95
150	603516	淳中科技	574,283.00	5.91
151	000042	中洲控股	572,495.86	5.89
152	300658	延江股份	571,234.00	5.88
153	603398	邦宝益智	570,989.00	5.87
154	603508	思维列控	570,856.00	5.87
155	002654	万润科技	568,818.00	5.85
156	603300	华铁应急	568,694.00	5.85
157	300129	泰胜风能	568,574.00	5.85
158	300735	光弘科技	568,291.90	5.85
159	600575	淮河能源	568,005.00	5.84
160	603585	苏利股份	560,674.00	5.77



161	002790	瑞尔特	558,818.00	5.75
162	603067	振华股份	552,232.00	5.68
163	603559	中通国脉	551,002.00	5.67
164	600855	航天长峰	548,638.00	5.64
165	601002	晋亿实业	548,445.00	5.64
166	603058	永吉股份	547,723.00	5.64
167	603129	春风动力	544,303.00	5.60
168	300498	温氏股份	540,475.00	5.56
169	002907	华森制药	536,168.00	5.52
170	600801	华新水泥	535,210.00	5.51
171	600335	国机汽车	530,228.00	5.46
172	600248	延长化建	529,691.40	5.45
173	002133	广宇集团	528,995.00	5.44
174	000606	顺利办	528,680.00	5.44
175	600589	广东榕泰	528,561.00	5.44
176	601900	南方传媒	525,392.00	5.41
177	002195	二三四五	524,958.50	5.40
178	002554	惠博普	523,600.00	5.39
179	002381	双箭股份	522,538.00	5.38
180	600866	星湖科技	522,100.00	5.37
181	600647	同达创业	521,798.00	5.37
182	300248	新开普	520,462.00	5.35
183	603393	新天然气	519,941.00	5.35
184	000915	山大华特	519,039.00	5.34
185	600719	大连热电	518,793.00	5.34
186	002803	吉宏股份	518,049.50	5.33
187	603380	易德龙	517,957.00	5.33
188	603081	大丰实业	516,841.00	5.32
189	601566	九牧王	516,267.00	5.31
190	002719	麦趣尔	511,356.00	5.26
191	603311	金海环境	511,338.00	5.26
192	600834	申通地铁	510,822.93	5.26
193	000936	华西股份	510,235.00	5.25
194	002163	中航三鑫	509,695.00	5.24
195	000987	越秀金控	509,051.00	5.24
196	002478	常宝股份	508,814.00	5.23
197	002130	沃尔核材	508,342.00	5.23
198	000913	钱江摩托	507,578.00	5.22
199	603488	展鹏科技	507,247.00	5.22
200	603199	九华旅游	507,092.00	5.22
201	300043	星辉娱乐	505,444.00	5.20
202	600585	海螺水泥	503,676.00	5.18

203	300497	富祥股份	502,686.60	5.17
204	600995	文山电力	502,244.00	5.17
205	002111	威海广泰	500,868.00	5.15
206	600673	东阳光	499,214.00	5.14
207	000755	山西路桥	499,181.00	5.14
208	002626	金达威	496,938.00	5.11
209	002637	赞宇科技	495,091.00	5.09
210	600984	建设机械	493,993.00	5.08
211	600533	栖霞建设	492,655.00	5.07
212	300532	今天国际	489,899.08	5.04
213	002531	天顺风能	488,467.00	5.03
214	603505	金石资源	488,215.00	5.02
215	603319	湘油泵	488,203.60	5.02
216	300092	科新机电	488,026.00	5.02
217	600581	八一钢铁	487,800.00	5.02
218	600530	交大昂立	486,514.00	5.01
219	000708	中信特钢	484,442.57	4.98
220	300393	中来股份	484,283.40	4.98
221	000338	潍柴动力	483,807.00	4.98
222	300007	汉威科技	481,325.00	4.95
223	000603	盛达资源	480,108.00	4.94
224	000157	中联重科	479,406.00	4.93
225	000623	吉林敖东	478,925.00	4.93
226	000686	东北证券	478,853.00	4.93
227	603855	华荣股份	475,858.00	4.90
228	600267	海正药业	475,366.00	4.89
229	000036	华联控股	475,357.20	4.89
230	600794	保税科技	472,967.00	4.87
231	300259	新天科技	471,513.00	4.85
232	000425	徐工机械	469,354.00	4.83
233	300682	朗新科技	465,974.00	4.79
234	600162	香江控股	465,088.00	4.78
235	600490	鹏欣资源	464,220.00	4.78
236	000789	万年青	463,616.00	4.77
237	600606	绿地控股	463,362.00	4.77
238	600848	上海临港	462,546.00	4.76
239	603556	海兴电力	462,398.00	4.76
240	600793	宜宾纸业	462,114.00	4.75
241	600675	中华企业	459,873.72	4.73
242	000779	甘咨询	457,268.00	4.70
243	300599	雄塑科技	455,485.00	4.69
244	600755	厦门国贸	452,966.00	4.66

245	300233	金城医药	452,867.00	4.66
246	300522	世名科技	452,772.00	4.66
247	603822	嘉澳环保	452,398.00	4.65
248	600249	两面针	450,704.00	4.64
249	002399	海普瑞	449,048.00	4.62
250	601369	陕鼓动力	448,923.00	4.62
251	603313	梦百合	448,705.00	4.62
252	000951	中国重汽	447,638.00	4.61
253	603977	国泰集团	447,334.00	4.60
254	603980	吉华集团	447,271.00	4.60
255	603160	汇顶科技	447,242.00	4.60
256	600020	中原高速	446,978.00	4.60
257	600287	江苏舜天	446,899.00	4.60
258	002184	海得控制	445,946.00	4.59
259	002602	世纪华通	445,433.00	4.58
260	600626	申达股份	443,549.00	4.56
261	300231	银信科技	443,172.80	4.56
262	002300	太阳电缆	443,074.00	4.56
263	300035	中科电气	442,475.00	4.55
264	300305	裕兴股份	441,443.60	4.54
265	002882	金龙羽	439,640.00	4.52
266	000929	兰州黄河	439,594.00	4.52
267	002660	茂硕电源	439,203.00	4.52
268	000838	财信发展	438,551.00	4.51
269	300407	凯发电气	438,454.00	4.51
270	603356	华菱精工	437,741.00	4.50
271	002053	云南能投	437,623.70	4.50
272	601199	江南水务	437,471.00	4.50
273	002893	华通热力	437,194.60	4.50
274	600382	广东明珠	436,783.00	4.49
275	600636	三爱富	436,588.00	4.49
276	002912	中新赛克	436,189.00	4.49
277	002331	皖通科技	435,507.00	4.48
278	600551	时代出版	433,437.00	4.46
279	000973	佛塑科技	433,086.00	4.46
280	002387	维信诺	432,774.00	4.45
281	002873	新天药业	431,779.00	4.44
282	300551	古鳌科技	431,635.00	4.44
283	601233	桐昆股份	431,510.00	4.44
284	002457	青龙管业	430,950.00	4.43
285	600810	神马股份	430,335.60	4.43
286	603136	天目湖	429,517.00	4.42

287	300175	朗源股份	428,946.00	4.41
288	300017	网宿科技	428,486.00	4.41
289	000065	北方国际	428,369.03	4.41
290	002928	华夏航空	427,891.00	4.40
291	600727	鲁北化工	427,475.00	4.40
292	600438	通威股份	426,275.00	4.39
293	600368	五洲交通	426,256.00	4.39
294	600405	动力源	422,603.00	4.35
295	300703	创源文化	420,653.00	4.33
296	300442	普丽盛	417,865.00	4.30
297	000656	金科股份	416,993.00	4.29
298	002489	浙江永强	414,887.00	4.27
299	000032	深桑达A	413,914.20	4.26
300	000034	神州数码	413,131.00	4.25
301	600035	楚天高速	413,087.00	4.25
302	603661	恒林股份	412,523.00	4.24
303	601588	北辰实业	412,450.00	4.24
304	002621	美吉姆	412,225.00	4.24
305	002632	道明光学	411,862.00	4.24
306	300371	汇中股份	410,304.00	4.22
307	300632	光莆股份	407,440.00	4.19
308	300738	奥飞数据	405,569.00	4.17
309	002271	东方雨虹	405,198.00	4.17
310	603326	我乐家居	404,868.80	4.17
311	000301	东方盛虹	403,873.00	4.16
312	002876	三利谱	403,618.00	4.15
313	603988	中电电机	402,411.00	4.14
314	600117	西宁特钢	402,146.00	4.14
315	300572	安车检测	401,667.60	4.13
316	300461	田中精机	401,588.20	4.13
317	002337	赛象科技	401,334.00	4.13
318	600805	悦达投资	400,909.00	4.12
319	300438	鹏辉能源	399,900.00	4.11
320	000031	大悦城	399,307.00	4.11
321	600136	当代明诚	398,231.00	4.10
322	603626	科森科技	397,968.00	4.09
323	300235	方直科技	396,534.00	4.08
324	603819	神力股份	396,195.00	4.08
325	600285	羚锐制药	395,725.73	4.07
326	002925	盈趣科技	395,675.00	4.07
327	600611	大众交通	394,998.00	4.06
328	600469	风神股份	394,957.00	4.06

329	600191	华资实业	394,422.00	4.06
330	300200	高盟新材	394,189.00	4.06
331	002137	麦达数字	393,461.00	4.05
332	300251	光线传媒	390,370.79	4.02
333	600846	同济科技	388,869.00	4.00
334	002177	御银股份	388,773.00	4.00
335	000006	深振业A	388,697.00	4.00
336	002514	宝馨科技	388,129.00	3.99
337	002272	川润股份	387,329.00	3.98
338	002706	良信电器	387,286.00	3.98
339	603586	金麒麟	386,788.00	3.98
340	600167	联美控股	386,440.80	3.98
341	300074	华平股份	386,283.00	3.97
342	600865	百大集团	385,839.00	3.97
343	600992	贵绳股份	385,386.98	3.96
344	002214	大立科技	383,720.00	3.95
345	000701	厦门信达	383,276.00	3.94
346	002024	苏宁易购	382,219.00	3.93
347	300031	宝通科技	381,493.00	3.92
348	000672	上峰水泥	380,390.00	3.91
349	002367	康力电梯	377,230.00	3.88
350	002468	申通快递	377,136.00	3.88
351	300140	中环装备	377,026.00	3.88
352	603303	得邦照明	376,784.00	3.88
353	000715	中兴商业	376,489.76	3.87
354	300638	广和通	375,931.00	3.87
355	002037	保利联合	375,768.00	3.87
356	002425	凯撒文化	374,742.00	3.86
357	000828	东莞控股	374,446.00	3.85
358	600706	曲江文旅	374,123.00	3.85
359	600785	新华百货	373,715.00	3.84
360	600997	开滦股份	373,117.00	3.84
361	002869	金溢科技	372,959.00	3.84
362	000576	广东甘化	369,454.00	3.80
363	002740	爱迪尔	368,601.00	3.79
364	002124	天邦股份	368,290.00	3.79
365	002687	乔治白	367,938.00	3.79
366	300181	佐力药业	367,765.00	3.78
367	002438	江苏神通	367,553.00	3.78
368	002757	南兴股份	367,355.87	3.78
369	000885	城发环境	367,133.00	3.78
370	000045	深纺织A	366,914.50	3.77

371	000933	神火股份	366,579.00	3.77
372	600510	黑牡丹	366,399.00	3.77
373	300296	利亚德	365,515.00	3.76
374	600170	上海建工	365,321.00	3.76
375	603859	能科股份	364,162.00	3.75
376	600780	通宝能源	363,114.00	3.74
377	002379	宏创控股	362,500.00	3.73
378	600327	大东方	361,467.60	3.72
379	601336	新华保险	361,409.00	3.72
380	300179	四方达	360,084.00	3.70
381	300511	雪榕生物	357,218.00	3.68
382	000573	粤宏远 A	356,485.00	3.67
383	000517	荣安地产	356,005.00	3.66
384	600310	桂东电力	355,091.00	3.65
385	300660	江苏雷利	352,252.80	3.62
386	002110	三钢闽光	351,426.50	3.62
387	300570	太辰光	349,505.00	3.60
388	603538	美诺华	349,347.00	3.59
389	600757	长江传媒	348,981.00	3.59
390	000700	模塑科技	348,737.00	3.59
391	603378	亚士创能	347,622.00	3.58
392	600366	宁波韵升	347,203.00	3.57
393	600792	云煤能源	346,723.00	3.57
394	002088	鲁阳节能	346,426.00	3.56
395	300440	运达科技	346,225.00	3.56
396	000630	铜陵有色	345,144.00	3.55
397	601012	隆基股份	344,944.00	3.55
398	000534	万泽股份	344,413.00	3.54
399	300117	嘉寓股份	344,371.00	3.54
400	000568	泸州老窖	344,197.00	3.54
401	002144	宏达高科	342,097.00	3.52
402	603299	苏盐井神	341,900.00	3.52
403	000888	峨眉山 A	340,299.00	3.50
404	300569	天能重工	339,178.00	3.49
405	002353	杰瑞股份	338,953.00	3.49
406	603818	曲美家居	338,268.00	3.48
407	000757	浩物股份	337,795.00	3.48
408	600548	深高速	337,091.00	3.47
409	600383	金地集团	336,649.00	3.46
410	600713	南京医药	336,156.00	3.46
411	300467	迅游科技	335,557.00	3.45
412	600824	益民集团	334,084.00	3.44

413	300636	同和药业	334,051.00	3.44
414	600939	重庆建工	333,655.00	3.43
415	600208	新湖中宝	333,076.00	3.43
416	600470	六国化工	332,939.00	3.43
417	600166	福田汽车	331,859.00	3.41
418	000509	华塑控股	330,797.00	3.40
419	002174	游族网络	330,632.00	3.40
420	600328	兰太实业	330,568.00	3.40
421	300088	长信科技	330,375.00	3.40
422	603667	五洲新春	329,654.00	3.39
423	300557	理工光科	329,559.00	3.39
424	600724	宁波富达	329,048.00	3.39
425	603188	ST 亚邦	328,571.00	3.38
426	300640	德艺文创	328,234.00	3.38
427	601811	新华文轩	328,132.00	3.38
428	000529	广弘控股	328,094.00	3.38
429	300359	全通教育	327,666.00	3.37
430	603861	白云电器	326,767.00	3.36
431	600873	梅花生物	325,494.00	3.35
432	002449	国星光电	325,466.00	3.35
433	000671	阳光城	324,422.00	3.34
434	002394	联发股份	324,304.00	3.34
435	600587	新华医疗	323,502.00	3.33
436	600461	洪城水业	323,294.00	3.33
437	300096	易联众	320,703.00	3.30
438	002083	孚日股份	319,003.00	3.28
439	600132	重庆啤酒	317,879.00	3.27
440	000629	攀钢钒钛	317,787.00	3.27
441	300696	爱乐达	316,309.30	3.25
442	002233	塔牌集团	314,580.00	3.24
443	603699	纽威股份	313,718.77	3.23
444	600475	华光股份	313,522.00	3.23
445	300397	天和防务	313,391.00	3.22
446	600743	华远地产	312,565.00	3.22
447	300575	中旗股份	311,891.00	3.21
448	300661	圣邦股份	311,844.00	3.21
449	600657	信达地产	310,938.00	3.20
450	002265	西仪股份	309,955.00	3.19
451	300146	汤臣倍健	309,517.00	3.18
452	600740	山西焦化	308,971.00	3.18
453	600127	金健米业	308,261.00	3.17
454	002304	洋河股份	307,836.00	3.17

455	600833	第一医药	307,835.00	3.17
456	600829	人民同泰	307,179.00	3.16
457	603916	苏博特	306,524.00	3.15
458	300198	纳川股份	305,290.00	3.14
459	603882	金域医学	304,711.00	3.13
460	000877	天山股份	304,035.00	3.13
461	002498	汉缆股份	303,558.00	3.12
462	600781	ST 辅仁	302,547.00	3.11
463	000859	国风塑业	302,389.00	3.11
464	600532	宏达矿业	302,014.00	3.11
465	002847	盐津铺子	301,879.00	3.11
466	603680	今创集团	300,257.16	3.09
467	002772	众兴菌业	299,695.00	3.08
468	600620	天宸股份	299,209.22	3.08
469	300719	安达维尔	296,994.00	3.06
470	300708	聚灿光电	296,589.00	3.05
471	300464	星徽精密	295,834.00	3.04
472	002249	大洋电机	295,639.00	3.04
473	002760	凤形股份	295,525.00	3.04
474	300385	雪浪环境	295,344.80	3.04
475	002657	中科金财	295,241.00	3.04
476	300669	沪宁股份	294,651.00	3.03
477	603678	火炬电子	294,354.00	3.03
478	603036	如通股份	293,852.00	3.02
479	600720	祁连山	293,348.00	3.02
480	600782	新钢股份	292,945.00	3.01
481	603165	荣晟环保	292,940.00	3.01
482	600665	天地源	292,592.00	3.01
483	300625	三雄极光	292,322.00	3.01
484	300395	菲利华	290,780.00	2.99
485	600522	中天科技	290,590.00	2.99
486	600048	保利地产	290,301.00	2.99
487	000030	富奥股份	290,243.00	2.99
488	300320	海达股份	288,459.00	2.97
489	601515	东风股份	288,042.00	2.96
490	300422	博世科	283,251.00	2.91
491	002782	可立克	283,088.00	2.91
492	603180	金牌厨柜	281,332.00	2.89
493	600909	华安证券	280,885.00	2.89
494	601717	郑煤机	280,476.00	2.89
495	002097	山河智能	280,269.00	2.88
496	002283	天润曲轴	279,747.00	2.88



497	603041	美思德	279,378.00	2.87
498	000502	绿景控股	279,125.00	2.87
499	603730	岱美股份	279,109.00	2.87
500	000798	中水渔业	278,769.00	2.87
501	600097	开创国际	276,841.00	2.85
502	002326	永太科技	276,802.00	2.85
503	600052	浙江广厦	276,345.00	2.84
504	300500	启迪设计	273,061.00	2.81
505	600203	福日电子	273,059.00	2.81
506	300419	浩丰科技	272,409.00	2.80
507	603369	今世缘	272,094.00	2.80
508	000850	华茂股份	271,112.00	2.79
509	002315	焦点科技	271,032.00	2.79
510	600694	大商股份	269,726.00	2.77
511	002611	东方精工	269,303.00	2.77
512	603856	东宏股份	268,270.00	2.76
513	601360	三六零	267,692.00	2.75
514	600217	中再资环	266,847.00	2.75
515	600152	维科技术	266,052.00	2.74
516	300114	中航电测	265,586.50	2.73
517	002314	南山控股	264,167.00	2.72
518	300692	中环环保	263,921.00	2.72
519	300272	开能健康	263,886.00	2.71
520	002560	通达股份	262,712.00	2.70
521	000910	大亚圣象	262,145.00	2.70
522	300695	兆丰股份	262,006.00	2.70
523	603086	先达股份	261,973.00	2.70
524	600618	氯碱化工	260,617.00	2.68
525	300596	利安隆	258,835.00	2.66
526	002607	中公教育	258,567.00	2.66
527	300466	赛摩电气	258,224.00	2.66
528	600681	百川能源	257,827.00	2.65
529	603108	润达医疗	255,613.00	2.63
530	000415	渤海租赁	255,255.00	2.63
531	002916	深南电路	254,464.00	2.62
532	002126	银轮股份	253,893.80	2.61
533	002357	富临运业	253,482.00	2.61
534	300378	鼎捷软件	252,950.00	2.60
535	000922	佳电股份	252,679.00	2.60
536	002534	杭锅股份	252,610.60	2.60
537	603596	伯特利	252,109.00	2.59
538	600387	海越能源	251,971.00	2.59

539	002895	川恒股份	251,488.00	2.59
540	600143	金发科技	249,671.00	2.57
541	000524	岭南控股	249,511.00	2.57
542	000928	中钢国际	249,357.00	2.57
543	600444	国机通用	248,237.00	2.55
544	603288	海天味业	248,161.00	2.55
545	600410	华胜天成	248,045.00	2.55
546	600704	物产中大	247,325.00	2.54
547	600633	浙数文化	247,063.00	2.54
548	601100	恒立液压	246,888.00	2.54
549	600282	南钢股份	245,837.00	2.53
550	300552	万集科技	245,816.00	2.53
551	000153	丰原药业	244,845.00	2.52
552	300066	三川智慧	244,658.00	2.52
553	300508	维宏股份	244,466.00	2.52
554	603035	常熟汽饰	243,783.00	2.51
555	300243	瑞丰高材	243,012.00	2.50
556	603727	博迈科	242,730.00	2.50
557	600592	龙溪股份	241,996.00	2.49
558	300602	飞荣达	241,728.00	2.49
559	601107	四川成渝	241,475.00	2.48
560	300120	经纬辉开	241,133.00	2.48
561	000719	中原传媒	241,117.00	2.48
562	002866	传艺科技	240,708.60	2.48
563	002703	浙江世宝	239,610.00	2.47
564	300389	艾比森	239,451.00	2.46
565	000880	潍柴重机	237,921.00	2.45
566	603033	三维股份	236,843.00	2.44
567	300521	爱司凯	235,604.00	2.42
568	002208	合肥城建	235,365.00	2.42
569	600655	豫园股份	235,293.00	2.42
570	300220	金运激光	235,260.00	2.42
571	000811	冰轮环境	235,246.00	2.42
572	300337	银邦股份	235,119.00	2.42
573	600352	浙江龙盛	235,063.00	2.42
574	603527	众源新材	234,903.00	2.42
575	002775	文科园林	234,869.00	2.42
576	000049	德赛电池	234,654.00	2.41
577	000906	浙商中拓	234,367.00	2.41
578	300424	航新科技	234,314.00	2.41
579	002146	荣盛发展	233,926.00	2.41
580	601218	吉鑫科技	233,285.00	2.40

581	603871	嘉友国际	232,845.00	2.40
582	603456	九洲药业	232,582.00	2.39
583	000159	国际实业	231,278.00	2.38
584	000863	三湘印象	231,182.00	2.38
585	002835	同为股份	230,373.00	2.37
586	002705	新宝股份	229,768.00	2.36
587	000401	冀东水泥	229,366.00	2.36
588	300111	向日葵	229,251.00	2.36
589	600644	乐山电力	228,950.00	2.36
590	603161	科华控股	228,502.00	2.35
591	300630	普利制药	228,290.00	2.35
592	603111	康尼机电	227,644.00	2.34
593	600826	兰生股份	227,441.00	2.34
594	000421	南京公用	227,402.00	2.34
595	603030	全筑股份	226,861.00	2.33
596	300341	麦克奥迪	226,790.00	2.33
597	002040	南京港	226,519.00	2.33
598	603013	亚普股份	225,501.00	2.32
599	300161	华中数控	225,184.00	2.32
600	002094	青岛金王	224,655.00	2.31
601	300353	东土科技	224,005.00	2.30
602	002298	中电兴发	223,860.00	2.30
603	300588	熙菱信息	223,213.00	2.30
604	002582	好想你	223,208.00	2.30
605	000921	海信家电	223,134.00	2.30
606	002635	安洁科技	222,404.00	2.29
607	603889	新澳股份	221,578.00	2.28
608	000417	合肥百货	220,136.00	2.26
609	002712	思美传媒	219,503.00	2.26
610	600266	北京城建	219,429.20	2.26
611	603088	宁波精达	219,099.00	2.25
612	000925	众合科技	218,608.00	2.25
613	002171	楚江新材	218,395.00	2.25
614	002853	皮阿诺	217,934.00	2.24
615	600889	南京化纤	217,212.00	2.23
616	002192	融捷股份	216,219.00	2.22
617	000802	北京文化	215,975.00	2.22
618	002879	长缆科技	215,857.00	2.22
619	002731	萃华珠宝	213,704.00	2.20
620	000096	广聚能源	213,343.00	2.19
621	002598	山东章鼓	213,319.00	2.19
622	002545	东方铁塔	213,049.00	2.19

623	002911	佛燃股份	212,688.00	2.19
624	600509	天富能源	212,430.00	2.19
625	600100	同方股份	212,274.00	2.18
626	002571	德力股份	212,117.00	2.18
627	000100	TCL 科技	211,329.00	2.17
628	603996	ST 中新	211,213.00	2.17
629	600768	宁波富邦	210,454.00	2.17
630	300715	凯伦股份	210,202.00	2.16
631	000949	新乡化纤	209,786.00	2.16
632	603689	皖天然气	209,751.00	2.16
633	300138	晨光生物	209,734.00	2.16
634	603283	赛腾股份	208,991.00	2.15
635	002714	牧原股份	208,193.00	2.14
636	300523	辰安科技	208,173.00	2.14
637	002269	美邦服饰	208,112.00	2.14
638	002743	富煌钢构	208,078.00	2.14
639	000963	华东医药	207,938.00	2.14
640	300148	天舟文化	207,198.00	2.13
641	603877	太平鸟	207,044.00	2.13
642	000731	四川美丰	206,937.00	2.13
643	000591	太阳能	206,513.00	2.12
644	000823	超声电子	205,389.00	2.11
645	000531	穗恒运 A	204,144.00	2.10
646	600271	航天信息	203,771.00	2.10
647	603638	艾迪精密	202,863.00	2.09
648	002533	金杯电工	202,851.00	2.09
649	603026	石大胜华	201,991.00	2.08
650	002255	海陆重工	201,915.00	2.08
651	002462	嘉事堂	201,711.00	2.08
652	600864	哈投股份	201,470.00	2.07
653	300687	赛意信息	201,351.00	2.07
654	300230	永利股份	200,922.00	2.07
655	300659	中孚信息	199,864.00	2.06
656	002543	万和电气	199,850.30	2.06
657	002160	常铝股份	198,765.00	2.04
658	000993	闽东电力	198,515.00	2.04
659	601888	中国国旅	198,448.00	2.04
660	002377	国创高新	196,510.00	2.02
661	600890	中房股份	196,086.00	2.02
662	601377	兴业证券	195,885.00	2.02
663	600977	中国电影	195,627.00	2.01
664	000895	双汇发展	195,535.42	2.01

665	002688	金河生物	195,170.00	2.01
666	603018	中设集团	194,666.00	2.00
667	000810	创维数字	194,650.00	2.00

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

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	385,938,976.58
卖出股票收入（成交）总额	369,967,742.01

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

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

##### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

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

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

### 8.11.3 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合约。

## 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

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

### 8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

### 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	16,078.56
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	786.42
5	应收申购款	389.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,254.83

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
安信量化优选股票 A	106	103,194.57	10,000,000.00	91.42	938,624.93	8.58
安信量化优选股票 C	1,156	12,555.37	12,838,710.76	88.46	1,675,293.64	11.54
合计	1,241	20,509.77	22,838,710.76	89.73	2,613,918.57	10.27

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

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	安信量化优选股票 A	2.28	0.0000
	安信量化优选股票 C	14,811.52	0.1020
	合计	14,813.80	0.0582

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

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门	安信量化优选股票 A	0
	安信量化优选股票 C	0

负责人持有本开放式基金		
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	安信量化优选股票 A	0
	安信量化优选股票 C	0
	合计	0

#### 9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	39.29	10,000,000.00	39.29	3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,000.00	39.29	10,000,000.00	39.29	-

### § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	安信量化优选股票 A	安信量化优选股票 C
基金合同生效日 (2018 年 9 月 3 日) 基金份额总额	10,000,297.54	26,003.05
本报告期期初基金份额总额	10,020,565.62	26,003.05
本报告期基金总申购份额	2,683,474.99	18,229,661.73
减：本报告期基金总赎回份额	1,765,415.68	3,741,660.38
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-	-
本报告期期末基金份额总额	10,938,624.93	14,514,004.40



## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未举行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

#### 一、基金管理人的重大人事变动

本基金管理人于 2019 年 6 月 1 日发布了《安信基金管理有限责任公司高级管理人员（副总经理）变更公告》，经安信基金管理有限责任公司第三届董事会第十次会议审议通过，廖维坤先生自 2019 年 5 月 31 日起担任公司副总经理兼首席信息官。

#### 二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

本报告期内本基金基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内本基金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

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

本基金聘请的会计师事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），该事务所自本基金合同生效以来为本基金提供审计服务至今。本年度应支付的审计费为人民币 20,000.00 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

本报告期内，基金管理人收到中国证券监督管理委员会深圳监管局出具的责令整改措施以及对相关负责人的警示函，公司高度重视，制定并实施相关整改措施，及时向监管机构提交整改报告。报告期内，公司已经通过监管机构的现场验收。

除上述情况外，本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	

方正证券	2	448,785,814.15	59.39%	319,223.09	59.39%	-
江海证券	2	170,120,178.08	22.51%	121,010.31	22.51%	新增
华泰证券	1	63,472,641.54	8.40%	45,148.43	8.40%	-
广发证券	2	48,697,597.96	6.44%	34,637.64	6.44%	-
华创证券	2	24,585,736.72	3.25%	17,488.08	3.25%	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

注:根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》(证监基金字[2007]48号)的有关规定,本基金管理人制定了《安信基金管理有限责任公司券商交易单元选择标准及佣金分配办法》,对券商交易单元的选择标准和程序进行了规定。本基金管理人将券商路演数量和质量、提供的信息充分性和及时性、系统支持等作为交易单元的选择标准,由权益投资部、研究部、运营部交易室对券商考评后提出租用及变更方案,最终由公司基金投资决策委员讨论及决定。

### 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
方正证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-

中信证券	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	安信量化优选股票型发起式证券投资基金 2018 年第 4 季度报告	上海证券报	2019-01-19
2	安信基金管理有限责任公司关于暂停大泰金石基金销售有限公司和北京钱景基金销售有限公司销售旗下基金业务的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2019-01-30
3	安信基金管理有限责任公司关于新增基金直销账户信息的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2019-02-28
4	安信基金管理有限责任公司关于旗下基金所持长春高新（000661）估值调整的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2019-03-06
5	关于安信量化优选股票型发起式证券投资基金和安信恒利增强债券型证券投资基金新增上海基煜基金销售有限公司为基金销售服务机构的公告	上海证券报、证券时报	2019-03-15
6	安信量化优选股票型发起式证券投资基金 2018 年年度报告摘要	上海证券报	2019-03-29
7	安信基金管理有限责任公司关于旗下基金所持格力电器（000651）估值调整的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2019-04-02
8	关于安信基金管理有限责任公司新增开放式基金销售代理服务机构的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2019-04-03
9	安信量化优选股票型发起式证券投资基金更新招募说明书摘要（2019 年第 1 号）	上海证券报	2019-04-17
10	安信量化优选股票型发起式证券投资基金 2019 年第 1 季度报告	上海证券报	2019-04-22
11	关于安信基金管理有限责任公司新增开放式基金销售代理服务机构的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2019-05-13
12	关于安信平稳增长混合型发起式证券投资基金 C 类份额等基金新增开源证券股份有限公司为基金销售服务机构的公告	中国证券报、上海证券报	2019-05-15
13	关于安信基金管理有限责任公司新增开放式基金销售代理服务机构的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2019-05-20

		报	
14	安信基金管理有限责任公司高级管理人员（副总经理）变更公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2019-06-01
15	关于安信平稳增长混合型发起式证券投资基金 C 类份额等基金新增蚂蚁（杭州）基金销售有限公司为基金销售服务机构的公告	证券时报、中国证券报、上海证券报	2019-06-21
16	安信基金管理有限责任公司关于旗下部分基金可投资科创板股票的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2019-06-21
17	关于安信基金管理有限责任公司新增开放式基金销售代理服务机构的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2019-06-21
18	关于安信基金管理有限责任公司暂停快速取现业务的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2019-06-29
19	安信量化优选股票型发起式证券投资基金 2019 年第 2 季度报告	上海证券报	2019-07-18
20	安信量化优选股票型发起式证券投资基金 2019 年半年度报告摘要	上海证券报	2019-08-27
21	安信基金管理有限责任公司旗下全部基金季度报告提示性公告	证券时报、证券日报、上海证券报、中国证券报	2019-10-23
22	安信基金管理有限责任公司关于旗下基金在直销柜台面向养老金客户实施特定费率优惠的公告	证券时报、证券日报、上海证券报、中国证券报	2019-12-02
23	安信基金管理有限责任公司根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修改旗下 47 只基金相关法律文件的公告	上海证券报、证券日报、证券时报	2019-12-18
24	安信量化优选股票型发起式证券投资基金更新招募说明书摘要（2019 年 12 月更新）	上海证券报	2019-12-19
25	安信基金管理有限责任公司关于调整适用“养老金客户费率优惠”的养老金客户范围的公告	证券时报、证券日报、上海证券报、中国证券报	2019-12-25

## § 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	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况
------	----------------	------------

别	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	20190101-20191231	10,000,000.00	-	-	10,000,000.00	39.29
	2	20190605-20191231	-	12,838,710.76	-	12,838,710.76	50.44
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

本基金如果出现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%，则面临大额赎回的情况，可能导致：

(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；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；

(2) 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；

(3) 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；

(4) 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；

(5) 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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予安信量化优选股票型发起式证券投资基金募集的文件；
- 2、《安信量化优选股票型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《安信量化优选股票型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、《安信量化优选股票型发起式证券投资基金招募说明书》；
- 5、中国证监会要求的其他文件。

### 13.2 存放地点

本基金管理人和基金托管人的住所。

### 13.3 查阅方式

上述文件可在安信基金管理有限责任公司互联网站上查阅，或者在营业时间内到安信基金管理有限责任公司查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人安信基金管理有限责任公司。

客户服务电话：4008-088-088

网址：<http://www.essencefund.com>

安信基金管理有限责任公司

2020年4月28日